Приложение 1

ФОНД ОЦЕНОЧНЫХ СРЕДСТВ ДЛЯ ПРОВЕДЕНИЯ ПРОМЕЖУТОЧНОЙ АТТЕСТАЦИИ

Дисциплины Б1.В.07 «Управление рисками в системе обеспечения экономической безопасности»

Специальность 38.05.01 «Экономическая безопасность»

Специализация «Экономическая безопасность и экспертиза деятельности

хозяйствующих субъектов»

Квалификация выпускника экономист

ПАСПОРТ ФОНДА ОЦЕНОЧНЫХ СРЕДСТВ

дисциплины Б1.В.07 «Управление рисками в системе обеспечения экономической безопасности»

№ п/п	Контролируемые разделы дисциплины	Код индикатора достижения компетенций	Наименование оценочного средства и иных материалов	Кол-во
1	В целом	ПК-1.1; ПК-1.2; ПК-1.3; ПК-1.4	Описание показателей и критериев оценивания сформированности компетенций, описание шкал оценивания	4
2			Типовые контрольные задания и иные материалы, необходимые для оценки знаний, умений, навыков и опыта деятельности, характеризующих этапы формирования компетенций в процессе освоения дисциплины	3
3			Методические материалы, определяющие процедуры оценивания знаний, умений, навыков и опыта деятельности, характеризующих этапы формирования компетенций	3

1. ОПИСАНИЕ ПОКАЗАТЕЛЕЙ И КРИТЕРИЕВ ОЦЕНИВАНИЯ СФОРМИРОВАННОСТИ КОМПЕТЕНЦИЙ, ОПИСАНИЕ ШКАЛ ОЦЕНИВАНИЯ

1.1 Описание шкалы оценивания сформированности компетенций

Сформированность компетенций по дисциплине оценивается 4-балльной шкалой: «отлично», «хорошо», «удовлетворительно», «неудовлетворительно».

1.2 Описание показателей и критериев оценивания сформированности компетенций по дисциплине, обеспечивающие достижение планируемых результатов освоения образовательной программы

Код компетенции (индикатора достижения компетенции)	Результат обучения по дисциплине	Критерии и показатели оценивания результатов обучения			
		«неудовлетворительно»	«удовлетворительно»	«хорошо»	«отлично»
1	2	3	4	5	6
ПК-1 (ПК-1.1; ПК-1.2; ПК-1.3; ПК-1.4)	знает характеристики ситуации неопределенности, основные принципы оценки риска; современные информационные системы и технологии управления рисками и возможности их применения; стратегии, методы управления рисками и варианты их применения	Фрагментарные знания сущности неопределенности, основные принципы оценки риска; современные информационные системы и технологии управления рисками и возможности их применения; стратегии, методы управления рисками и варианты их применения	Неполные знания сущности неопределенности, основные принципы оценки риска; современные информационные системы и технологии управления рисками и возможности их применения; стратегии, методы управления рисками и варианты их применения	Сформированные, но содержащие отдельные пробелы знания неопределенности, основные принципы оценки риска; современные информационные системы и технологии управления рисками и возможности их применения; стратегии, методы управления рисками и варианты их применения	Сформированные и систематические знания сущности неопределенности, основные принципы оценки риска; современные информационные системы и технологии управления рисками и возможности их применения; стратегии, методы управления рисками и варианты их применения
	знать сущность отраслевых рисков и отраслевой экономической безопасности; основные подходы к	Фрагментарные знания сущности отраслевых рисков и отраслевой экономической безопасности; основных подхо-	Неполные знания сущности отраслевых рисков и отраслевой экономической безопасности; основных	Сформированные, но содержащие отдельные пробелы знания сущности отраслевых рисков и отраслевой экономиче-	Сформированные и систематические знания сущности отраслевых рисков и отраслевой экономической безопас-

	выявлению и анализу отраслевых рисков	дов к выявлению и анализу отраслевых рисков / Отсутствие знаний	подходов к выявлению и анализу отраслевых рисков	ской безопасности; основных подходов к выявлению и анализу отраслевых рисков	ности; основных подходов к выявлению и анализу отраслевых рисков
	уметь осуществлять расчеты, прогнозировать, тестировать и верифицировать методики управления рисками с учетом отраслевой специфики	Фрагментарное умение осуществлять расчеты, прогнозировать, тестировать и верифицировать методики управления рисками с учетом отраслевой специфики / Отсутствие умений	В целом успешное, но не систематическое умение осуществлять расчеты, прогнозировать, тестировать и верифицировать методики управления рисками с учетом отраслевой специфики	В целом успешное, но содержащее отдельные пробелы умение осуществлять расчеты, прогнозировать, тестировать и верифицировать методики управления рисками с учетом отраслевой специфики	Успешное и систематическое умение осуществлять расчеты, прогнозировать, тестировать и верифицировать методики управления рисками с учетом отраслевой специфики
	владеть навыками оценки эффективности воздействия на риск; навыками построения карты риска и методами подготовки и внедрения планов воздействия на риск в целях обеспечения экономической безопасности	Фрагментарное владение навыками оценки эффективности воздействия на риск; навыками построения карты риска и методами подготовки и внедрения планов воздействия на риск в целях обеспечения экономической безопасности / Отсутствие навыков	В целом успешное, но не систематическое владение навыками оценки эффективности воздействия на риск; навыками построения карты риска и методами подготовки и внедрения планов воздействия на риск в целях обеспечения экономической безопасности	В целом успешное, но сопровождающееся отдельными ошибками применение навыков оценки эффективности воздействия на риск; навыков построения карты риска и методами подготовки и внедрения планов воздействия на риск в целях обеспечения экономической безопасности	Успешное и систематическое применение навыков оценки эффективности воздействия на риск; навыков построения карты риска и методами подготовки и внедрения планов воздействия на риск в целях обеспечения экономической безопасности

Описание показателей и критериев оценивания сформированности компетенций по дисциплине, обеспечивающие достижение планируемых результатов освоения образовательной программы

Код компетенции (индикатора достижения компетенции)	Результат обучения по дисциплине	Критерии и показатели оценивания результатов обучения	
		«зачтено»	«не зачтено»
1	2	3	6
ПК-1 (ПК-1.1; ПК-1.2; ПК-1.3; ПК-1.4)	знает характеристики ситуации неопределенности, основные принципы оценки риска; современные информационные системы и технологии управления рисками и возможности их применения; стратегии, методы управления рисками и варианты их применения	Фрагментарные знания сущности неопределенности, основные принципы оценки риска; современные информационные системы и технологии управления рисками и возможности их применения; стратегии, методы управления рисками и варианты их применения	Сформированные и систематические знания сущности неопределенности, основные принципы оценки риска; современные информационные системы и технологии управления рисками и возможности их применения; стратегии, методы управления рисками и варианты их применения
	знать сущность отраслевых рисков и отраслевой экономической безопасности; основные подходы к выявлению и анализу отраслевых рисков	Фрагментарные знания сущности отраслевых рисков и отраслевой экономической безопасности; основных подходов к выявлению и анализу отраслевых рисков / Отсутствие знаний	Сформированные и систематические знания сущности отраслевых рисков и отраслевой экономической безопасности; основных подходов к выявлению и анализу отраслевых рисков
	уметь осуществлять расчеты, прогнозировать, тестировать и верифицировать методики управления рисками с учетом отраслевой специфики	Фрагментарное умение осуществлять расчеты, прогнозировать, тестировать и верифицировать методики управления рисками с учетом отраслевой специфики / Отсутствие умений	Успешное и систематическое умение осуществлять расчеты, прогнозировать, тестировать и верифицировать методики управления рисками с учетом отраслевой специфики
	владеть навыками оценки эффективности воздействия на риск; навыками построения карты риска и методами подготовки и внедрения планов воздействия на риск в целях обеспечения экономической безопасности	Фрагментарное владение навыками оценки эффективности воздействия на риск; навыками построения карты риска и методами подготовки и внедрения планов воздействия на риск в целях обеспечения экономической безопасности / Отсутствие навыков	Успешное и систематическое применение навыков оценки эффективности воздействия на риск; навыков построения карты риска и методами подготовки и внедрения планов воздействия на риск в целях обеспечения экономической безопасности

1.3 Описание шкалы оценивания освоения дисциплины в форме зачета, курсовой работы и экзамена

Освоение дисциплины оценивается в форме зачета, курсовой работы и экзамена 4-балльной шкалой: «отлично», «хорошо», «удовлетворительно», «неудовлетворительно».

Зачет	Критерии
Зачтено	ответы на вопросы четкие, обоснованные и полные, проявлена готовность к дискуссии, студент демонстрирует высокий уровень владения знаниями, умениями и навыками соответствующих компетенций, что позволяет ему решать широкий круг типовых и нетиповых задач, студент проявил высокую эрудицию и свободное владение материалом дисциплины
Не зачтено	на большую часть вопросов ответы не были получены, либо они показали полную некомпетентность студента в материале дисциплины, студент не способен самостоятельно, без помощи извне, воспроизводить и применять соответствующие знания, умения, навыки или знания, умения и навыки у студента не выявлены

Описание показателей и критериев оценивания курсовой работы

Курсовая работа оценивается комиссией по результатам защиты 4-балльной шкалой: «отлично», «хорошо», «удовлетворительно», «неудовлетворительно».

В случае, если студент не выполнил или не сдал курсовую работу в установленные сроки, выставляется оценка «не аттестован».

Каждый член комиссии оценивает курсовую работу каждого студента по следующим обобщенным критериям:

1) Владение компетенциями.

Оценивается сформированность компетенций дисциплины и соответствующие им знания, умения и навыки.

По данному обобщенному критерию выставляются оценки:

– «отлично» – студент демонстрирует высокий уровень владения знаниями, умениями и навыками соответствующих компетенций, что позволяет ему решать широкий круг нетиповых задач дисциплины;

– «хорошо» – студент способен самостоятельно воспроизводить и применять соответствующие знания, умения и навыки для решения типовых задач дисциплины, может выполнять поиск и использование новой информации для выполнения новых профессиональных действий на основе полностью освоенных знаний, умений и навыков соответствующих компетенций;

– «удовлетворительно» – знания, умения, навыки сформированы на базовом уровне, студенты частично, с помощью извне (например, с использованием наводящих вопросов, ассоциативного ряда понятий и т.д.) могут воспроизводить и применять соответствующие знания, умения, навыки;

– «неудовлетворительно» – студент не способен самостоятельно, без помощи извне, воспроизводить и применять соответствующие знания, умения, навыки или знания, умения и навыки у студента не выявлены.

2) Качество выполненной работы.

Оценивается соответствие правил оформления пояснительной записки, графической част), иллюстрационного материала, библиографического списка и ссылок установленным стандартам; орфографическая и пунктуационная грамотность; применение оригинальных методов выполнения графической части (применены современные компьютерные технологии и др.).

По данному обобщенному критерию выставляются оценки:

– «отлично» – в случае, если оформление всех составляющих курсовой работы полностью со-

ответствует установленным стандартам, задание на курсовую работу выполнено в полном объеме, присутствуют оригинальные методы и элементы оформления, изложение текста курсовой работы не содержит существенных грамматических и стилистических ошибок;

– «хорошо» – в случае, если оформление всех составляющих курсовой работы преимущественно соответствует установленным стандартам, задание на курсовую работу выполнено в полном объеме, но имеются некоторые ошибки и погрешности, изложение текста курсовой работы содержит некоторые грамматические и стилистические ошибки;

– «удовлетворительно» – в случае, если имеются значительные отклонения от норм оформления, задание на курсовую работу выполнено в полном объеме, но с некоторыми отклонениями, графический материал недостаточно читаем, иллюстрационный материал оформлен небрежно, изложение текста курсовой работы содержит значительные грамматические и стилистические ошибки;

– «неудовлетворительно» – в случае, если нормы оформления грубо нарушены, задание на курсовую работу выполнено не в полном объеме, графический материал плохо читаем, иллюстрационный материал отсутствует или имеет плохое оформление, изложение текста курсовой работы содержит большое количество значительных грамматических и стилистических ошибок, обнаружен плагиат или выявлена несамостоятельность выполнения.

3) Защита курсовой работы.

Оценивается качество представления комиссии курсовой работы студентом, правильность и полнота ответов на вопросы членов комиссии; готовность к дискуссии; контактность; умение мыслить и пользоваться полученными при изучении дисциплины знаниями, умениями и навыками, сформированными при реализации компетенций ФГОС.; полнота представления работы; знание предметной области; свободное владение материалом курсовой работы; эрудиция; использование междисциплинарных связей.

По данному обобщенному критерию выставляются оценки:

– «отлично» – в случае, если ответы на вопросы четкие, обоснованные и полные, проявлена готовность к дискуссии, высокий уровень владения сформированными знаниями, умениями и навыками, полностью и доходчиво изложены этапы решения задач, четко сформулированы результаты и доказана их высокая значимость, студент проявил высокую эрудицию и свободное владение материалом курсовой работы;

– «хорошо» – в случае, если ответы на вопросы преимущественно правильные, но недостаточно четкие, уровень владения сформированными знаниями, умениями и навыками достаточно высокий, но сформулированные задачи изложены с некоторыми погрешностями, владение материалом курсовой работы достаточно свободное;

– «удовлетворительно» – в случае, если ответы на вопросы не полные, на некоторые ответ не получен, уровень владения знаниями, умениями и навыками удовлетворительный, если имеются заметные погрешности в структуре курсовой работы, владение материалом курсовой работы не вполне свободное, но достаточное;

– «неудовлетворительно» – в случае, если на большую часть вопросов и замечаний ответы не были получены, либо они показали полную некомпетентность студента в теме ВКР, вызывающие сомнение в самостоятельном выполнении курсовой работы, плохое владение полученными знаниями, умениями и навыками, владение материалом курсовой работы плохое, обнаружена несамостоятельность выполнения курсовой работы.

1.4 Описание показателей и критериев оценивания компетенций дисциплины в форме экзамена

Критерии оценки знаний, умений и навыков при сдаче экзамена:

Оценка	Критерии
Отлично	ответы на вопросы четкие, обоснованные и полные, проявлена готовность к дискуссии, студент демонстрирует высокий уровень владения знаниями, умениями и навыками соответствующих компетенций, что позволяет ему решать широкий круг типовых и нетиповых задач, сту-

	дент проявил высокую эрудицию и свободное владение материалом дисциплины
Хорошо	ответы на вопросы преимущественно правильные, но недостаточно четкие, студент способен самостоятельно воспроизводить и применять соответствующие знания, умения и навыки для решения типовых задач дисциплины, может выполнять поиск и использование новой информации для выполнения новых профессиональных действий на основе полностью освоенных знаний, умений и навыков соответствующих компетенций
Удовлетворительно	ответы на вопросы не полные, на некоторые ответ не получен, знания, умения, навыки сформированы на базовом уровне, студенты частично, с помощью извне (например, с использованием наводящих вопросов, ассоциативного ряда понятий и т.д.) могут воспроизводить и применять соответствующие знания, умения, навыки
Неудовлетворительно	на большую часть вопросов ответы не были получены, либо они показали полную некомпетентность студента в материале дисциплины, студент не способен самостоятельно, без помощи извне, воспроизводить и применять соответствующие знания, умения, навыки или знания, умения и навыки у студента не выявлены

2 ТИПОВЫЕ КОНТРОЛЬНЫЕ ЗАДАНИЯ И ИНЫЕ МАТЕРИАЛЫ, НЕОБХОДИМЫЕ ДЛЯ ОЦЕНКИ ЗНАНИЙ, УМЕНИЙ, НАВЫКОВ И ОПЫТА ДЕЯТЕЛЬНОСТИ, ХАРАКТЕРИЗУЮЩИХ ЭТАПЫ ФОРМИРОВАНИЯ КОМПЕТЕНЦИЙ В ПРОЦЕССЕ ОСВОЕНИЯ ОБРАЗОВАТЕЛЬНОЙ ПРОГРАММЫ

2.1 Вопросы к зачёту

1. Требования, предъявляемые к информации в экономическом анализе.
2. Место анализа в системе экономических наук.
3. Экономический анализ и смежные науки.
4. Роль экономического анализа в принятии управленческих решений.
5. История развития экономического анализа.
6. Научные основы экономического анализа.
7. Предмет и объекты экономического анализа.
8. Сущность и основные задачи экономического анализа.
9. Классификация видов экономического анализа по отраслевому, временному и пространственному признаку.
10. Классификация видов экономического анализа по субъектам пользователя, объектам управления, охвату изучаемых явлений.
11. Классификация видов экономического анализа: горизонтальный, вертикальный, трендовый анализ.
12. Классификация видов экономического анализа: анализ относительных показателей, сравнительный и факторный анализ.
13. Особенности финансового анализа.
14. Специфика управленческого анализа.
15. Классификация методов и приемов экономического анализа.
16. Характеристика традиционных методов экономического анализа: использование аналитических показателей, сравнение, группировка.
17. Характеристика традиционных методов экономического анализа: индексный, интегральный, балансовый, графический методы.
18. Характеристика традиционных методов экономического анализа: метод цепных подстановок.
19. Характеристика традиционных методов экономического анализа: метод абсолютных и относительных разниц.
20. Характеристика детерминированного факторного анализа.
21. Характеристика маржинального и функционально-стоимостного анализа.
22. Общая характеристика математических методов анализа.

23. Способы стохастического факторного анализа: корреляционный и регрессионный анализ.
24. Способы оптимизации показателей: методы линейного программирования, теория игр, теория массового обслуживания.
25. Экономико-математическое моделирование микроуровневых финансовых ситуаций.
26. Система экономической информации.
27. Авт. обработка экономической информации (АОЭИ).
28. Внешние и внутренние пользователи отчетности.
29. Современные информационные технологии.
30. Методика и организация комплексного АХД.
31. Основные этапы аналитического исследования.
32. Разработка системы аналитических показателей.
33. Сущность технико-экономического анализа.
34. Цель и организация ФСА.
35. Виды межхозяйственного сравнительного анализа.
36. Условия сопоставимости в межхозяйственном анализе.
37. Классификация факторов повышения эффективности производства.
38. Классификация резервов по источникам образования и характеру воздействия на результат.
39. Классификация резервов по способу выявления, временному и пространственному признаку.
40. Показатели интенсивного и экстенсивного развития производства.
41. Принципы поиска и подсчета резервов.
42. Методика подсчета резервов.
43. Взаимосвязь экономического анализа с другими науками.
44. Анализ как технология управления.
45. Роль экономического анализа в информационном обеспечении управления.
46. Экономический анализ и его связь с контролем.
47. Предмет и объект экономического анализа.
48. Основные задачи экономического анализа.
49. Субъекты и пользователи экономического анализа.
50. Содержание экономического анализа.
51. Основные принципы экономического анализа.
52. Классификация видов экономического анализа.
53. Понятие экономической информации.

54. Этапы проведения экономического анализа.
55. Подготовка, планирование и организация аналитической работы.
56. Обобщение результатов экономического анализа.
57. Метод экономического анализа и его особенности.
58. Методология и методика экономического анализа деятельности предприятий.
59. Разработка системы взаимосвязанных аналитических показателей.
60. Основные свойства и модели детерминированного факторного анализа.

2.2 ПРИМЕРНЫЕ ТЕМЫ КУРСОВЫХ РАБОТ

1. Применение модели оценки управления рисками капитальных активов
2. Исследование методов идентификации портфельных рисков и обоснование их выбора
3. Методики оценки ущерба при реализации рискового события чрезвычайной ситуации
4. Анализ рисков на основе вероятностных законов распределения событий и ущербов
5. Аналитические методы оценки управления рисками в системе экономической безопасности
6. Анализ использования экспертных методов оценки рисков в системе экономической безопасности и их эффективность
7. Технический анализ на рынке ценных бумаг как инструмент оценки риска
8. Оценка премии за систематический риск
9. Метод сценариев в оценке рисков организации в системе экономической безопасности
10. Методология анализа финансовых рисков
11. Анализ инвестиционных рисков проекта
12. Анализ операционных рисков в системе экономической безопасности
13. Методология анализа кредитных рисков
14. Методология анализа рисков ликвидности
15. Роль суверенных кредитных рейтингов при управлении страновыми рисками
16. Сущность актуарных расчетов и применение их для анализа рисков
17. Оценка влияния инструментов хеджирования на риски деятельности организации
18. Применение опционов для управления рисками организации
19. Применение концепции VaR в оценке рисков
20. Информационная составляющая управления рисками деятельности организации
21. Использование методики стратегических игр в управлении рисками
22. Хеджирование рисков промышленных предприятий
23. Статистические методы оценки и анализа риска
24. Управление рисками в сфере страхования

25. Разработка системы управления рисками на промышленном предприятии

26. Управление рисками в инвестиционной деятельности фирмы

27. Управление рисками венчурного фонда

28. Экспертная оценка управления рисками в системе экономической безопасности

29. Использование метода статистических испытаний (Monte-Carlo Simulation) в системе управления рисками

30. Риски на различных стадиях жизненного цикла организации

31. Риски и банкротство: причины и следствия

32. Управление рисками лизинговой компании

33. Разработка системы мониторинга рисков

34. Аутсорсинг управления рисками: плюсы и минусы

35. Проектирование системы управления рисками организации

36. Совершенствование системы управления рисками с учетом стадии жизненного цикла организации

37. Разработка системы риск-индикаторов организации

38. Организация противодействия недобросовестной конкуренции и ограничительной практики в деятельности организации

39. Совершенствование способов минимизации последствий правовых рисков в деятельности организации (на примере)

40. Особенности учета отраслевых рисков (на примере)

41. Стратегический риск-менеджмент в системе экономической безопасности

42. Производственные риски: анализ, оценка и методы управления

43. Формирование культуры управления рисками (на примере)

44. Экологический риск-менеджмент в практике экономической деятельности хозяйствующих субъектов

45. Организация управления регуляторным риском

46. Анализ и учет логистических рисков предприятия

47. Классификация и содержание банковских рисков.

48. Развитие стандартизации в банковской сфере.

49. Экономический капитал и риски в системе экономической безопасности

50. Система управления рисками как инструмент развития экономической безопасности.

51. Особенности систем управления вертикально интегрированных компаний.

52. Сравнительный анализ международных стандартов управления рисками.

53. Конфликты в системе управления рисками.

54. Анализ индивидуальных и социальных рисков.

55. Модели управления рисками в условиях цифровой экономики.

56. Методы оценки финансовых рисков.

57. Развитие системы управления рисками организации в системе экономической безопасности.

58. Управление комплаенс-рисками.

2.3 Список экзаменационных вопросов

№ вопроса	Вопросы	Коды индикаторов достижения компетенций
1	Управление рисками: понятие и классификация.	ПК-1.1; ПК-1.2; ПК-1.3; ПК-1.4
2	Неопределенность в системе экономической безопасности: понятие и виды.	
3	Неопределенность и управление рисками.	
4	Общая характеристика хозяйственных рисков в системе экономической безопасности.	
5	Функции управления рисками в системе экономической безопасности.	
6	Объекты, субъекты и характерные черты методологии управления рисками в системе экономической безопасности.	
7	Риск как источник прибыли.	
8	Риск и доходность в системе экономической безопасности.	
9	Факторы управления рисками в системе экономической безопасности.	
10	Система управления рисками в хозяйственной деятельности.	
11	Классификация хозяйственных рисков в системе ЭБ.	
12	Производственные риски, их классификация и характеристика.	
13	Финансовые риски, их классификация и характеристика.	
14	Коммерческие риски, их классификация и характеристика.	
15	Инвестиционные риски, их классификация и характеристика.	
16	Валютные риски, их классификация и характеристика.	
17	Кредитные риски, их классификация и характеристика.	
18	Банковские риски, их классификация и характеристика.	
19	Классификация транспортных рисков.	
20	Факторы внешней среды в управлении хозяйственным риском.	
21	Факторы внутренней среды в рискованной деятельности организации.	
22	Среда прямого воздействия на организацию.	
23	Среда косвенного воздействия на организацию.	
24	Идентификация и анализ управленческого риска в системе ЭБ.	
25	Методы выявления хозяйственных рисков: сущность и характеристика.	
26	Качественный анализ управленческих рисков.	
27	Количественный анализ управленческих рисков.	
28	Зоны хозяйственного риска.	
29	Построение кривой риска организации в системе ЭБ.	
30	Пороговые значения риска.	
31	Показатели степени риска.	
32	Экономико-статистические методы оценки риска.	

33	Метод экспертных оценок анализа хозяйственного риска.	
34	Основные понятия и показатели оценки эффективности инвестиций.	
35	Анализ степени риска реализации инвестиционных проектов.	
36	Методы анализа риска инвестиционных проектов.	
37	Риск инвестирования в отдельный актив.	
38	Риск инвестиционного портфеля.	
39	Методы анализа риска инвестиционного портфеля.	
40	Анализ корреляционной зависимости финансовых активов в портфеле ценных бумаг	

2.2 Примерные варианты тестов

Вариант №1

Что такое риск?
а) разновидность ситуации, объективно содержащая высокую вероятность невозможности осуществления цели
б)наличие факторов, при которых результаты действий не являются детерминированными, а степень возможного влияния этих факторов на результаты неизвестна
в) следствие действия либо бездействия, в результате которого существует реальная возможность получения неопределенных результатов различного характера

Какие потери можно обозначить как трудовые?
а) потери рабочего времени+
б) уменьшение выручки вследствие снижения цен на реализуемую продукцию
в) уплата дополнительных налогов
г) невыполнение сроков сдачи объекта
д) потери материалов
е) ущерб здоровью
ж) потери сырья
з) ущерб репутации
и) выплата штрафа

Какие компании называют кэптивными?
а) универсальные страховые;
б) специализированные страховые;
в) ведомственные страховые.+

Какие потери можно считать финансовыми?
а) потери ценных бумаг+
б) потери сырья
в) невыполнение сроков сдачи объекта
г) выплата штрафа+
д) уплата дополнительных налогов+
е) уменьшение выручки вследствие снижения цен на реализуемую продукцию+

Факторы, которые влияют на уровень финансовых рисков подразделяются на:
а) объектные и субъектные;+
б) позитивные и негативные;
в) простые и сложные.

Какие потери можно отнести к потерям времени
а) невыполнение сроков сдачи объекта+
б) потери ценных бумаг
в) выплата штрафа
г) уменьшение выручки вследствие снижения цен на реализуемую продукцию
д) уплата дополнительных налогов

Как называется процесс использования механизмов уменьшения рисков?
а) диверсификация;
б) лимитирование;
в) хеджирование.+

Что такое анализ риска?
а) систематизация множества рисков на основании каких-либо признаков и критериев, позволяющих объединить подмножества рисков в более общие понятия
б) систематическое научное исследование степени риска, которому подвержены конкретные объекты, виды деятельности и проекты+
в) начальный этап системы мероприятий по управлению рисками, состоящий в систематическом выявлении рисков, характерных для определенного вида деятельности, и определении их характеристик

Что является принципом действия механизма диверсификации?
а) избежание рисков;
б) разделение рисков;+
в) снижение рисков.

Что такое идентификация риска?
а) систематизация множества рисков на основании каких-либо признаков и критериев, позволяющих объединить подмножества рисков в более общие понятия
б) начальный этап системы мероприятий по управлению рисками, состоящий в систематическом выявлении рисков, характерных для определенного вида деятельности, и определении их характеристик+
в) систематическое научное исследование степени риска, которому подвержены конкретные объекты, виды деятельности и проекты

Под максимальным объемом страховой защиты предприятия по конкретным видам страхуемых финансовых рисков понимается:
а) страховой тариф;
б) страховая сумма;+
в) страховая премия.

Как называются риски, которые могут нести в себе как потери, так и дополнительную прибыль?
а) чистыми
б) критическими
в) спекулятивными+

На какие виды подразделяются риски по уровню финансовых потерь?
а) допустимый, критический и катастрофический;+
б) недопустимый, допустимый и критический;
в) критический, катастрофический и недопустимый.

Что такое последствия риска?
а) скорее положительными
б) как положительными, так и отрицательными+
в) только отрицательными

Как называются риски, которые практически всегда несут в себе потери?
а) критическими
б) спекулятивными
в) чистыми+

В основе какой из ниже предложенных операции лежит обмен финансовыми активами или обязательствами для улучшения их структуры и снижения возможных потерь:
а) своп;+
б) хеджирование;
в) репо.

Как называются риски, которые обусловлены деятельностью самого предприятия и его контактной аудиторией?
а) внешними
б) внутренними+
в) чистыми

Как называются риски, в результате реализации которых предприятию грозит потеря прибыли?
а) катастрофическими
б) критическими
в) допустимыми+

Чем измеряется величина или степень риска?
а) средним ожидаемым значение
б) изменчивостью возможного результата
в) оба варианта верны+

В чем состоит социально-экономическая функция риска?
а) в том, что в процессе рыночной деятельности риск и конкуренция позволяет выделить социальные группы эффективных собственников в общественных классах, а в экономике – отрасли деятельности, в которых риск приемлем+
б) в том, что реализация риска может обеспечить дополнительную по сравнению с плановой прибыль в случае благоприятного исхода
в) оба варианта верны

Риск это:
а) разновидность ситуации, объективно содержащая высокую вероятность невозможности осуществления цели
б)наличие факторов, при которых результаты действий не являются детерминированными, а степень возможного влияния этих факторов на результаты неизвестна
в) следствие действия либо бездействия, в результате которого существует реальная возможность получения неопределенных результатов различного характера+

Выберите метод оценки риска, который реализуется путем введения поправки на риск или путем учета вероятности возникновения денежных потоков?
а) построение дерева решений
б) метод сценариев
в) учет рисков при расчете чистой приведенной стоимости+
г) анализ чувствительности
д) вероятностный метод
е) имитационное моделирование

Выберите метод оценки риска, который используется в ситуациях, когда принимаемые решения сильно зависят от принятых ранее и определяют сценарии дальнейшего развития событий?
а) имитационное моделирование
б) вероятностный метод
в) учет рисков при расчете чистой приведенной стоимости
г) построение дерева решений+
д) анализ чувствительности
е) метод сценариев

Выберите метод оценки риска, который представляет собой серию численных экспериментов, призванных получить эмпирические оценки степени влияния различных факторов на некоторые зависящие от них результаты?
а) учет рисков при расчете чистой приведенной стоимости
б) анализ чувствительности
в) построение дерева решений
г) вероятностный метод
д) метод сценариев
е) имитационное моделирование+

Каким образом можно учитывать риск при расчете чистой приведенной стоимости?
а) в знаменателе формулы NPV посредством корректировки ставки дисконта
б) комбинация формул NPV посредством корректировки чистых денежных потоков
в) все варианты верны+
г) в числителе формулы NPV посредством корректировки чистых денежных потоков

Субъект управления в риск-менеджменте:
а) специальная группа людей, которая посредством различных приемов и способов управленческого воздействия осуществляет управление рисками+
б) все варианты верны
в) риск, рисковые вложения капитала и экономические отношения между хозяйствующими субъектами

Объект управления в риск-менеджменте:
а) риск, рисковые вложения капитала и экономические отношения между хозяйствующими субъектами+
б) все варианты верны
в) специальная группа людей, которая посредством различных приемов и способов управленческого воздействия осуществляет управление рисками

«Деятельность любой организации всегда сопровождается рисками, присутствующими в ее внешней или внутренней среде» включает в себя смысл:

а) закона неизбежности риска+
б) закона сочетания потенциальных потерь и выгод
в) закона прямой зависимости между степенью риска и уровнем планируемых доходов

«Практически в любых ситуациях риска потенциальная возможность потерь или убытков сочетается с потенциальной возможностью получения дополнительных доходов» включает в себя смысл:
а) закона прямой зависимости между степенью риска и уровнем планируемых доходов
б) закона неизбежности риска
в) закона сочетания потенциальных потерь и выгод+

«Чем выше степень риска при осуществлении хозяйственной операции, тем выше уровень планируемых от этой операции доходов» включает в себя смысл:
а) закона прямой зависимости между степенью риска и уровнем планируемых доходов+
б) закона неизбежности риска
в) закона сочетания потенциальных потерь и выгод

Прогнозирование внешней обстановки относится к:
а) методы компенсации рисков+
б) методы уклонения от рисков
в) методы локализации рисков
г) методы диверсификации рисков

Страхование относится к:
а) методы уклонения от рисков
б) методы диверсификации рисков
в) методы локализации рисков
г) методы компенсации рисков

Распределение риска по этапам работы относится к:
а) методы локализации рисков
б) методы компенсации рисков
в) методы уклонения от рисков
г) методы диверсификации рисков+

Заключение договоров о совместной деятельности для реализации рискованных проектов относится к:
а) методы диверсификации рисков
б) методы уклонения от рисков
в) методы компенсации рисков
г) методы локализации рисков+

Обучение и инструктирование персонала относится к:
а) методы уклонения от рисков
б) методы компенсации рисков+
в) методы диверсификации рисков
г) методы локализации рисков

Распределение ответственности между участниками проекта относится к:
а) методы диверсификации рисков+
б) методы компенсации рисков
в) методы локализации рисков
г) методы уклонения от рисков

Увольнение некомпетентных сотрудников относится к:
а) методы локализации рисков
б) методы диверсификации рисков
в) методы уклонения от рисков+
г) методы компенсации рисков

Создание системы резервов относится к:
а) методы уклонения от рисков
б) методы диверсификации рисков
в) методы компенсации рисков+
г) методы локализации рисков

Создание специальных инновационных подразделений относится к:
а) методы локализации рисков+
б) методы диверсификации рисков
в) методы компенсации рисков
г) методы уклонения от рисков

Распределение инвестиций в разных отраслях и сферах деятельности относится к:
а) методы диверсификации рисков+
б) методы локализации рисков
в) методы компенсации рисков
г) методы уклонения от рисков

Идентификация риска это:
а) систематизация множества рисков на основании каких-либо признаков и критериев, позволяющих объединить подмножества рисков в более общие понятия
б) начальный этап системы мероприятий по управлению рисками, состоящий в систематическом выявлении рисков, характерных для определенного вида деятельности, и определении их характеристик+
в) систематическое научное исследование степени риска, которому подвержены конкретные объекты, виды деятельности и проекты

Определите, что подразумевается под максимальным объемом страховой защиты предприятия по конкретным видам страхуемых финансовых рисков:
а) страховой тариф;
б) страховая сумма;+
в) страховая премия.

_____ риски могут нести в себе как потери, так и дополнительную прибыль.
а) чистые
б) критические
в) спекулятивные+

Риски по уровню финансовых потерь делятся на:
а) допустимый, критический и катастрофический;+
б) недопустимый, допустимый и критический;
в) критический, катастрофический и недопустимый.

Вид риска, к которому относится разрыв контракта из-за действий властей страны, в которой находится компания-контрагент:
а) экономический
б) предпринимательский
в) политический+

Подвид экологического риска, к которому можно отнести вероятность потерь, вызванных спецификой климатических условий, а также наличием природных ресурсов:
а) природно-климатические+
б) антропогенные
в) социально-бытовые

_____ риски – такие риски, в результате которых реализации предприятию грозит потеря прибыли.
а) катастрофические
б) критические
в) допустимые+

Укажите, чем измеряется величина или степень риска:
а) средним ожидаемым значение
б) изменчивостью возможного результата
в) оба варианта верны+

Социально-экономическая функция риска состоит в следующем:
а) в том, что в процессе рыночной деятельности риск и конкуренция позволяет выделить социальные группы эффективных собственников в общественных классах, а в экономике – отрасли деятельности, в которых риск приемлем+
б) в том, что реализация риска может обеспечить дополнительную по сравнению с плановой прибыль в случае благоприятного исхода
в) оба варианта верны

Выделите метод оценки риска, используемый в ситуациях, когда принимаемые решения сильно зависят от принятых ранее и определяют сценарии дальнейшего развития событий:
а) имитационное моделирование
б) вероятностный метод
в) учет рисков при расчете чистой приведенной стоимости
г) построение дерева решений+
д) анализ чувствительности
е) метод сценариев

Отметьте метод оценки риска, представляющий собой серию численных экспериментов, призванных получить эмпирические оценки степени влияния различных факторов на некоторые зависящие от них результаты:
а) учет рисков при расчете чистой приведенной стоимости
б) анализ чувствительности
в) построение дерева решений
г) вероятностный метод

д) метод сценариев
е) имитационное моделирование+

Субъект управления в риск-менеджменте это:
а) специальная группа людей, которая посредством различных приемов и способов управленческого воздействия осуществляет управление рисками+
б) все варианты верны
в) риск, рисковые вложения капитала и экономические отношения между хозяйствующими субъектами

Объектом управления в риск-менеджменте выступает:
а) риск, рисковые вложения капитала и экономические отношения между хозяйствующими субъектами+
б) все варианты верны
в) специальная группа людей, которая посредством различных приемов и способов управленческого воздействия осуществляет управление рисками

«Чем выше степень риска при осуществлении хозяйственной операции, тем выше уровень планируемых от этой операции доходов» — в чем смысл этой фразы?
а) закона прямой зависимости между степенью риска и уровнем планируемых доходов+
б) закона неизбежности риска
в) закона сочетания потенциальных потерь и выгод

Выберите методы, к которым относится обучение и инструктирование персонала:
а) методы уклонения от рисков
б) методы компенсации рисков+
в) методы диверсификации рисков
г) методы локализации рисков

Дайте определение термину «риск»:
а) разновидность ситуации, объективно содержащая высокую вероятность невозможности осуществления цели
б)наличие факторов, при которых результаты действий не являются детерминированными, а степень возможного влияния этих факторов на результаты неизвестна
в) следствие действия либо бездействия, в результате которого существует реальная возможность получения неопределенных результатов различного характера+

Что из перечисленного относится к потерям времени?
а) невыполнение сроков сдачи объекта+
б) потери ценных бумаг
в) выплата штрафа
г) уменьшение выручки вследствие снижения цен на реализуемую продукцию
д) уплата дополнительных налогов

Процесс использования механизмов уменьшения рисков называется так:
а) диверсификация
б) лимитирование
в) хеджирование+

Анализ риска подразумевает под собой следующее:
а) систематизация множества рисков на основании каких-либо признаков и критериев, позволяющих объединить подмножества рисков в более общие понятия

б) систематическое научное исследование степени риска, которому подвержены конкретные объекты, виды деятельности и проекты+
в) начальный этап системы мероприятий по управлению рисками, состоящий в систематическом выявлении рисков, характерных для определенного вида деятельности, и определении их характеристик

Выберите, что является принципом действия механизма диверсификации:
а) избежание рисков;
б) разделение рисков;+
в) снижение рисков.

К этим методам относится распределение ответственности между участниками проекта:
а) методы диверсификации рисков+
б) методы компенсации рисков
в) методы локализации рисков
г) методы уклонения от рисков

Выберите подвид экологического риска, к которому можно отнести вероятность потерь, вызванных техногенными катастрофами:
а) антропогенные+
б) природно-климатические
в) социально-бытовые

Отметьте подвид экологического риска, к которому можно отнести вероятность потерь, вызванных заболеваемостью животных и людей инфекционными заболеваниями:
а) природно-климатические
б) социально-бытовые+
в) антропогенные

Укажите группу методов управления экологическими рисками, к которой относится введение нормативных стандартов и ограничений для производителей:
а) распределение прав на загрязнение
б) административное регулирование+
в) система платежей и налогов за экологические загрязнения
г) создание экономических стимулов

Как называется контракт, который дает право купить определенное количество базового актива по оговоренной цене и в определенный срок?
а) опционом пут
б) фьючерсным контрактом
в) опционом колл+
г) форвардным контрактом

К каким методам относится прогнозирование внешней обстановки?
а) методы компенсации рисков+
б) методы уклонения от рисков
в) методы локализации рисков
г) методы диверсификации рисков

К каким методам относится распределение риска по этапам работы?
а) методы локализации рисков
б) методы компенсации рисков

в) методы уклонения от рисков
г) методы диверсификации рисков+

Выберите, к каким методам относится заключение договоров о совместной деятельности для реализации рискованных проектов:
а) методы диверсификации рисков
б) методы уклонения от рисков
в) методы компенсации рисков
г) методы локализации рисков+

Название риска, который не зависит от состояния рынка и является спецификой конкретной организации:
а) чистый
б) спекулятивный
в) несистемный+
г) системный

Название риска, связанного с изменениями, вызванными общерыночными колебаниями, и не зависящий от конкретного предприятия:
а) чистый
б) системный+
в) несистемный

2.3. Образец экзаменационного билета

МИНИСТЕРСТВО СЕЛЬСКОГО ХОЗЯЙСТВА РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ
ДЕПАРТАМЕНТ ОБРАЗОВАНИЯ, НАУЧНО-ТЕХНОЛОГИЧЕСКОЙ ПОЛИТИКИ
И РЫБОХОЗЯЙСТВЕННОГО КОМПЛЕКСА
ФЕДЕРАЛЬНОЕ ГОСУДАРСТВЕННОЕ БЮДЖЕТНОЕ ОБРАЗОВАТЕЛЬНОЕ УЧРЕЖДЕНИЕ
ВЫСШЕГО ОБРАЗОВАНИЯ «ДОНСКОЙ ГОСУДАРСТВЕННЫЙ АГРАРНЫЙ УНИВЕРСИТЕТ»
АЗОВО-ЧЕРНОМОРСКИЙ ИНЖЕНЕРНЫЙ ИНСТИТУТ – ФИЛИАЛ
ФЕДЕРАЛЬНОГО ГОСУДАРСТВЕННОГО БЮДЖЕТНОГО ОБРАЗОВАТЕЛЬНОГО
УЧРЕЖДЕНИЯ ВЫСШЕГО ОБРАЗОВАНИЯ
«ДОНСКОЙ ГОСУДАРСТВЕННЫЙ АГРАРНЫЙ УНИВЕРСИТЕТ» В Г. ЗЕРНОГРАДЕ

Направление подготовки
_____38.05.01_____
Дисциплина _Управление рисками в системе обеспечения экономической безопасности
Курс ___ Семестр ____

Утверждено на заседании кафедры
_Экономики и управления
от «___»_____20___г.
протокол № ___

ЭКЗАМЕНАЦИОННЫЙ БИЛЕТ №

1. Общая характеристика хозяйственных рисков в системе экономической безопасности.
2. Факторы управления рисками в системе экономической безопасности.

3. Идентификация и анализ управленческого риска в системе экономической безопасности.

Зав. кафедрой _____ Экзаменатор _____ _____
(подпись) (подпись) (Ф.И.О.)

3 МЕТОДИЧЕСКИЕ МАТЕРИАЛЫ, ОПРЕДЕЛЯЮЩИЕ ПРОЦЕДУРЫ ОЦЕНИВАНИЯ ЗНАНИЙ, УМЕНИЙ, НАВЫКОВ И ОПЫТА ДЕЯТЕЛЬНОСТИ, ХАРАКТЕРИЗУЮЩИХ ЭТАПЫ ФОРМИРОВАНИЯ КОМПЕТЕНЦИЙ

1. Положение о текущем контроле и промежуточной аттестации обучающихся, осваивающих образовательные программы высшего образования – программы бакалавриата, программы специалитета, программы магистратуры СМК-П-02.01-04-21 / разраб. Т.А. Лашина. – Зерноград: Азово-Черноморский инженерный институт ФГБОУ ВО Донской ГАУ, 2021. – 15 с.

2. Положение о проведении текущего контроля и промежуточной аттестации обучающихся с применением электронного обучения, дистанционных образовательных технологий в условиях усиления санитарно-эпидемиологических мероприятий. СМК-П-02.01-01-20 / разраб. Т.А. Лашина. – Зерноград: Азово-Черноморский инженерный институт ФГБОУ ВО Донской ГАУ, 2020. – 8 с.

3. Рабочая программа дисциплины Б1.В.07 «Управление рисками в системе обеспечения экономической безопасности» по специальности 38.05.01 Экономическая безопасность / разраб. Н.А. Глечикова. – Зерноград: Азово-Черноморский инженерный институт ФГБОУ ВО Донской ГАУ, 2022. – 62 с.