

Федеральное государственное образовательное бюджетное  
учреждение высшего образования  
**«Финансовый университет при Правительстве Российской Федерации»**  
**Уфимский филиал Финуниверситета**

**ФОНД ОЦЕНОЧНЫХ СРЕДСТВ**

**по дисциплине «Риск-менеджмент»**

Разработчик: кафедра «Экономика, менеджмент, маркетинг»

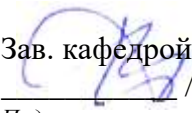
Направление подготовки 38.03.02 Менеджмент

Образовательная программа Управление проектами

РАССМОТРЕН  
На заседании кафедры  
«Экономика, менеджмент и маркетинг»

Протокол №10  
от «30» июня 2020 г.

Зав. кафедрой

 /Д.В.Чувилин  
Подпись .

Разработан основе  
ОС ФГОБУ Финуниверситета по направлению  
подготовки 38.03.02 Менеджмент (уровень ба-  
калавриата). Приказ № 2324/о от 26.12.2017 г.

## **Оценочные средства для оценки сформированности компетенций**

Вопрос 1. (ПКП-5): Неопределённость – это:

- 1) неполное или неточное представление о значениях различных параметров в будущем, порождаемых различными причинами и, прежде всего, неполнотой или неточностью информации об условиях реализации решения, в том числе связанных с ним затратах и результатах;
- 2) любое представление о значениях различных параметров в будущем, порождаемых различными причинами;
- 3) отсутствие представления о значениях различных параметров в будущем, порождаемых различными причинами и, прежде всего, неполнотой или неточностью информации об условиях реализации решения, в том числе связанных с ним затратах и результатах;
- 4) любая неизвестность.

Вопрос 2. (ПКП-5): К экономическим неопределенностям нельзя отнести:

- 1) неопределенность рыночного спроса;
- 2) слабая предсказуемость рыночных цен;
- 3) недостаточность информации о действиях конкурентов;
- 4) различного рода помехи (атмосферные, электромагнитные).

Вопрос 3. (ПКП-5): Риск – это:

- 1) деятельность, связанная с преодолением неопределённости в ситуации неизбежного выбора, в процессе которой имеется возможность количественно и качественно оценить вероятность достижения предполагаемого результата, неудачи или отклонения от цели;
- 2) деятельность, связанная с преодолением неопределённости в ситуации неизбежного выбора, в процессе которой отсутствует возможность количественно и качественно оценить вероятность достижения предполагаемого результата, неудачи или отклонения от цели;
- 3) любая новая деятельность;
- 4) деятельность, не связанная с преодолением неопределённости в ситуации неизбежного выбора.

Вопрос 4. (ПКП-5): Риски классифицируют по следующим совокупностям признаков:

- 1) месту и времени возникновения рисков;
- 2) внешним и внутренним факторам, влияющим на их величину;
- 3) способам их анализа и методам воздействия на них;
- 4) неустойчивости экономики и финансовой системы страны.

Вопрос 5. (ПКП-5): Управления риском можно охарактеризовать как:

- 1) процесс оценки и минимизации рисков;

- 2) совокупность методов, приемов и мероприятий, позволяющих в определённой степени прогнозировать наступление рискованных событий и принимать меры к исключению или снижению отрицательных последствий наступления таких событий;
- 3) определённые этапы: идентификация рисков, анализ и оценка рисков, разработка мероприятий по управлению рисками, мониторинг и оперативное управления рисками;
- 4) верны все ответы.

Вопрос 6. (ПКП-5): Идентификация рисков:

- 1) выявление рисков, способных повлиять на достижение целей решения, и документальное оформление их характеристик;
- 2) отказ от реализации мероприятия, связанного с риском;
- 3) определение последствий возникновения рискованной ситуации;
- 4) разработка критериев и методов сопоставимой оценки последствий.

Вопрос 7. (ПКП-5): К методам снижения рисков не относится:

- 1) диверсификация;
- 2) страхование риска;
- 3) выпуск нового вида продукции;
- 4) резервирование средств.

Вопрос 8. (ПKN-11): Эффективная система риск-менеджмента включает:

- 1) политику управления рисками, организационную структуру управления рисками с чётким позиционированием внутри компании;
- 2) политику управления рисками, организационную структуру управления рисками с чётким позиционированием внутри компании, процедуры и алгоритмы управления рисками, системы управления рисками;
- 3) процедуры и алгоритмы управления рисками;
- 4) процедуры и алгоритмы управления рисками, системы управления рисками.

Вопрос 9. (ПКП-5): Инструменты качественной оценки рисков:

- 1) матрица «вероятность-последствия», карты рисков;
- 2) карты рисков;
- 3) описание возможного ущерба, его стоимостной оценки и мер по снижению или предотвращению риска;
- 4) антирисковые меры.

Вопрос 10. (ПKN-11): Стратегия принятия риска используется:

- 1) только для угроз;
- 2) только для возможностей;
- 3) для угроз и возможностей;
- 4) нет верного ответа.

Вопрос 11. (ПКН-11): Какое из утверждений характеризует мониторинг и контроль рисков:

- 1) бывает качественный и количественный, формирует оценочную процедуру;
- 2) занимает особое место в системе риск-менеджмента и выполняется на всем протяжении жизненного цикла мероприятия;
- 3) подразумевает определение рисков на основе выявленных факторов их возникновения, документальное оформление параметров;
- 4) предполагает разработку мер по снижению неблагоприятного воздействия на результаты.

Вопрос 12. (ПКН-11): Подразумевается переложение негативных последствий угрозы с ответственностью за реагирование на риск частично или полностью на третью сторону, но сам риск при этом не устраняется. Это стратегия:

- 1) снижения рисков;
- 2) передачи и разделения рисков;
- 3) использования;
- 4) усиления.

Вопрос 13. (ПКП-5): В каких пределах может колебаться вероятность наступления риска:

- 1)  $>0$  и  $<100\%$ ;
- 2) от 0 до 100%;
- 3) от 10% до 90%;
- 4) от 5% до 99%.

Вопрос 14. (ПКН-11): Принятие на себя финансовых последствий от наступления неблагоприятного события – это \_\_\_\_\_.

Вопрос 15. (ПКН-11): Общепринятый числовой показатель последствий Value-at-Risk (VaR) имеет российское обозначение:

- 1) сумма под риском;
- 2) максимально возможный риск;
- 3) наиболее вероятный риск;
- 4) неизбежный риск.

Вопрос 16. (ПКП-5): Использование, разделение, увеличение, принятие – это стратегии реагирования на \_\_\_\_\_ риски (благоприятные возможности).

Вопрос 17. (ПКП-5): Риск, отражающий потенциальную возможность потери или снижения качества товара в процессе его транспортировки от продавца к покупателю – это \_\_\_\_\_ риск:

- 1) инвестиционный
- 2) производственный
- 3) транспортный

#### 4) спекулятивный

Вопрос 18. (ПКН-11): Форма записи информации об идентифицированном риске – это \_\_\_\_\_.

Вопрос 19. (ПКН-7): Управление рисками в \_\_\_\_\_ модели координируется на высшем уровне управления, и каждый сотрудник рассматривает риск- менеджмент как часть своей работы.

Вопрос 20. (ПКП-5): Наличие альтернативных решений, известные вероятности исходов и их ожидаемые результаты можно определить, случайный характер происходящих событий – это характерные черты \_\_\_\_\_.

#### **Критерии оценивания:**

Оценкой «отлично» (зачет) оценивается полное освоение компетенции по данной дисциплине – 85 и выше баллов.

Оценкой «хорошо» (зачет) оценивается усвоение компетенции, однако в ответах допускаются неточности и незначительные ошибки – от 70 до 84 баллов.

Оценка «удовлетворительно» (зачет) свидетельствует о том, что студент освоил компетенции, допускает отдельные ошибки – от 50 до 69 баллов.

Оценка «неудовлетворительно» (незачет) выставляется в том случае, если студентом компетенции не освоены и ответы содержат существенные ошибки – менее 50 баллов.

## Ключ к тесту

Вопрос	1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	11	12	13	14	15	16	17	18	19	20
Ответ	1	4	1	1	4	1	3	2	1	3	2	2	1	принятие риска	1	положительные	3	реестр риска	интегрированной	рисковых ситуаций
Баллы	5	5	5	5	5	5	5	5	5	5	5	5	5	5	5	5	5	5	5	5