


ФГБОУ ВО Новосибирский ГАУ
Кафедра управления и отраслевой экономики

Рег. № 1947.03-59
«05» 10 2022 г.

УТВЕРЖДЕН
на заседании кафедры
Протокол от «12» 09 2022 г. № 2
Заведующий кафедрой

Рудой Е.В.
(подпись)

ФОНД ОЦЕНОЧНЫХ СРЕДСТВ

Б1.В.ДВ.06.02 Анализ и управление рисками

Шифр и наименование дисциплины

38.03.02 Менеджмент

Код и наименование направления подготовки

Логистика и управление цепями поставок

Направленность (профиль)

**МАТРИЦА СООТВЕТСТВИЯ КРИТЕРИЕВ ОЦЕНКИ УРОВНЮ
СФОРМИРОВАННОСТИ КОМПЕТЕНЦИЙ**

Критерии оценки	Уровень сформированности компетенций
Оценка по пятибалльной системе	
«Отлично»	«Высокий уровень»
«Хорошо»	«Повышенный уровень»
«Удовлетворительно»	«Пороговый уровень»
«Неудовлетворительно»	«Не достаточный»
Оценка по системе «зачет <input type="checkbox"/> незачет»	
«Зачтено»	«Достаточный»
«Не зачтено»	«Не достаточный»

**Методические материалы, определяющие процедуру оценивания знаний, умений,
навыков и (или) опыта деятельности, характеризующих этапы формирования
компетенций**

1. Положение «О балльно-рейтинговой системе аттестации студентов»: СМК ПНД 08-01-2022, введено приказом от 28.09.2011 №371-О (<http://nsau.edu.ru/file/403>: режим доступа свободный);

2. Положение «О проведении текущего контроля и промежуточной аттестации обучающихся в ФГБОУ ВО Новосибирский ГАУ»: СМК ПНД 77-01-2022, введено в действие приказом от 03.08.2015 №268а-О (<http://nsau.edu.ru/file/104821>: режим доступа свободный).

**Паспорт
фонда оценочных средств**

№ п/п	Контролируемые разделы (темы) дисциплины	Код контролируемой компетенции (или ее части)	Наименование оценочного средства
1	Риск и проблемы устойчивости функционирования организации	ОПК-2, ПК-15	Коллоквиум Тест
2	Классификация рисков	ОПК-2, ПК-15	Коллоквиум Тест
3	Потери ресурсов при осуществлении предпринимательской деятельности в условиях неопределенности	ОПК-2, ПК-15	Коллоквиум Тест
4	Анализ системы управления риском	ОПК-2, ПК-15	Коллоквиум
5	Методы управления рисками	ОПК-2, ПК-15	Коллоквиум
6	Сравнение альтернативных решений в условиях риска	ОПК-2, ПК-15	Коллоквиум Тест
7	Управление рисками на основе страхования	ОПК-2, ПК-15	Коллоквиум Тест

ФГБОУ ВО Новосибирский ГАУ
Кафедра экономики
Вопросы для коллоквиумов
по дисциплине **Анализ и управление рисками**

Тема: Риск и проблемы устойчивости функционирования организации

1. Что такое риск? Что понимают под убытком, реальным ущербом и упущенной выгодой?
2. Что такое предпринимательский риск и факторы, на него влияющие?
3. Каковы источники возникновения и факторы риска в снабжении?
4. Каковы источники возникновения и факторы риска в производстве?
5. Каковы источники возникновения и факторы риска при сбыте продукции?
6. Что такое устойчивость предприятия и устойчивость среды?
7. Что такое колеблемость возможного результата и какими значениями коэффициента вариации характеризуется слабая, умеренная и высокая колеблемость?
8. Что понимают под хозяйственной, финансовой, информационной устойчивостью организации?

Тема: Классификация рисков

1. Дайте характеристику рисков по фактору возникновения и по длительности воздействия.
2. Дайте характеристику рисков в зависимости от возможного результата и по роду потерь.
3. Дайте характеристику рисков по степени влияния и от возможности страхования.
4. Дайте характеристику рисков по характеру прогнозирования и по характеру управленческих решений.
5. Дайте характеристику рисков от возможности диверсификации и по характеру взаимодействия с другими рисками.
6. Что такое системный классификатор, приведите состав рисков организации в соответствии с системным классификатором.
7. В чем сущность морфологического анализа рисков.

Тема: Потери ресурсов при осуществлении предпринимательской деятельности в условиях неопределенности

1. В чем выражаются материальные, трудовые, финансовые, потери времени и специальные виды потерь?
2. Приведите методику расчета ущерба (убытков) при уменьшении объема производства или реализации продукции (работ, услуг).
3. Приведите методику расчета ущерба (убытков) при различных последствиях нарушений условий договоров.

Тема: Анализ системы управления риском

1. Что такое риск-менеджмент?
2. Что такое управление риском, что является субъектом и объектом управления рисками?
3. Дайте характеристику этапа управления риском – идентификация риска.
4. Дайте характеристику этапа управления риском – оценка риска.
5. Какие существуют методы управления риском?
6. Дайте характеристику этапа управления риском – предотвращение и контролирование риска.
7. Дайте характеристику этапов управления риском – «финансирование» риска и оценка результатов.

Тема: Методы управления рисками

1. Дайте характеристику метода уклонение от риска.
2. Дайте характеристику метода диссипация риска.
3. Дайте характеристику метода диверсификация риска.
4. Дайте характеристику метода страхование риска.
5. Дайте характеристику метода поглощение риска (принятие риска на себя).
6. Дайте характеристику метода трансферт рисков.
7. Дайте характеристику метода лимитирование риска.

Тема: Сравнение альтернативных решений в условиях риска

Контрольные вопросы

1. В чем суть нейтрального, осторожного и склонного отношения к риску для ЛПР?
2. Приведите вид функции выбора при нейтральном отношении к риску ЛПР.
3. Приведите вид функции выбора, коэффициент индивидуального отношения к риску для ЛПР при осторожном отношении к риску.
4. Приведите вид функции выбора, коэффициент индивидуального отношения к риску для склонных к риску ЛПР.
5. В чем суть метода дерева решений?

Тема: Управление рисками на основе страхования

1. В чем сущность и содержание системы страхования?
2. Приведите особенности и виды страхования транспортных рисков
3. Приведите особенности страхования грузов.
4. В чем сущность модели страхования как модели диверсификации рисков?

Критерии оценки:

«Отлично» - теоретическое содержание курса освоено полностью, без пробелов, необходимые практические навыки работы с освоенным материалом сформированы, все

предусмотренные программой обучения учебные задания выполнены, качество их выполнения оценено числом баллов, близким к максимальному.

«Хорошо» - теоретическое содержание курса освоено полностью, без пробелов, необходимые практические навыки работы с освоенным материалом в основном сформированы недостаточно, все предусмотренные программой обучения учебные задания выполнены, качество выполнения ни одного из них не оценено минимальным числом баллов.

«Удовлетворительно» - теоретическое содержание курса освоено частично, но пробелы не носят существенного характера, необходимые практические навыки работы с освоенным материалом в основном сформированы, большинство предусмотренных программой обучения учебных заданий выполнены, некоторые из выполненных заданий, возможно содержат ошибки.

«Безусловно неудовлетворительно» - теоретическое содержание курса не освоено частично, необходимые практические навыки работы не сформированы, все выполненные учебные задания содержат грубые ошибки, дополнительная самостоятельная работа над материалом курса не приведет к какому-либо значимому повышению качества выполнения учебных заданий.

Составитель А.С. А.Ю. Стома «28» 04 2017 г.

ФГБОУ ВО Новосибирский ГАУ
Кафедра экономики
Фонд тестовых заданий
для проверки остаточных знаний
по дисциплине **Анализ и управление рисками**

1. Какое значение коэффициента вариации, которое отражает умеренную колеблемость, это:

- 1) менее 10%;
- 2) 10%-25%;
- 3) более 25%.

2. Риски, которые представляют собой взаимосвязанную группу рисков, в которой связь выражается в том, что возникновение одного риска повлечет за собой появление другого, это:

- 1) массовые;
- 2) индивидуальные;
- 3) системные риски.

3. В соответствии с системным классификатором, к рискам в зависимости от места в системе можно отнести:

- 1) индивидуальный риск;
- 2) инфраструктурный риск;
- 3) риски в процессе;
- 4) материальный риск.

4. Рисковая ситуация, это:

- 1) источник появления рискованной ситуации;
- 2) условия, в которых проявляются причины риска;
- 3) событие, обусловленное причинами и факторами риска, которое может привести к негативным или позитивным последствиям.

5. Факторы риска, это:

- 1) источник появления рискованной ситуации;
- 2) условия, в которых проявляются причины риска;
- 3) событие, обусловленное причинами и факторами риска, которое может привести к негативным или позитивным последствиям.

6. Выявление факторов, областей и видов рисков, отражает:

- 1) количественная оценка риска;
- 2) качественная оценка риска;
- 3) ранжирование риска.

7. Оценка рисков по бальной системе специалистами-экспертами, это суть метода количественной оценки риска:

- 1) дерево решений;
- 2) метода экспертных оценок;
- 3) анализа чувствительности;
- 4) анализ сценариев.

8. Исследование зависимости итоговых финансово-экономических показателей от заданных параметров, это суть метода количественной оценки риска:

- 1) дерево решений;
- 2) экспертных оценок;
- 3) анализ чувствительности;
- 4) анализ сценариев.

9. Способ ведения деятельности, при котором ущерб, в случае материализации риска ложиться полностью на его участника (ков), это метод управления риском:

- 1) страхование;
- 2) диссипация;
- 3) диверсификация;
- 4) поглощение.

10. Материальные виды потерь, выражаются в:

- 1) потерях рабочего времени, вызванных случайными, непредвиденными обстоятельствами;
- 2) дополнительных затратах или в прямых потерях оборудования, сырья, энергии и т.п.;
- 3) денежном ущербе, связанному с непредусмотренными платежами, выплатой штрафов, уплатой дополнительных налогов;
- 4) в нанесении ущерба здоровью и жизни людей, окружающей среде, престижу предпринимателя.

11. Трудовые потери выражаются в:

- 1) часах, днях, неделях, месяцах;
- 2) в физических единицах массы, объема, площади;
- 3) в человеко-часах, человеко-днях.

12. Материальные виды потерь выражаются в:

- 1) часах, днях, неделях, месяцах;
- 2) в физических единицах массы, объема, площади;
- 3) в человеко-часах, человеко-днях.

13. Потери времени выражаются в:

- 1) часах, днях, неделях, месяцах;
- 2) человеко-часах, человеко-днях;
- 3) физических единицах массы, объема, площади.

14. Область, которая характеризуется возможностью потерь, превышающих величину ожидаемой прибыли, это:

- 1) безрисковая зона;
- 2) зона допустимого риска;
- 3) зона критического риска;
- 4) зона катастрофического риска.

15. Для склонных к риску ЛПР, какой вид имеет формула расчета коэффициента индивидуального отношения к риску:

- 1) $k_r = (m_2 - m_1) / (\sigma_1^2 - \sigma_2^2)$;

- 2) $k_s = (m_1 - m_2) / (\sigma_2^2 - \sigma_1^2)$;
 3) нет верного варианта.

Ответы:

B1 – 2	B6 – 2	B11 – 3
B2 – 3	B7 – 2	B12 – 2
B3 – 3	B8 – 3	B13 – 1
B4 – 3	B9 – 4	B14 – 3
B5 – 2	B10 – 2	B15 – 1

Критерии оценки:

1. > 90 - 100% ответов верны – «отлично»
2. > 60% - ≤ 90% ответов верны – «хорошо»
3. > 45% - ≤ 60% ответов верны – «удовлетворительно»
4. ≤ 45% ответов верны – «неудовлетворительно»

Составитель А.Ю. Стома «28» ДЧ 2017 г.

**Перечень тем для контрольной работы
по дисциплине Анализ и управление рисками**

1. Понятие, функции и принципы риска, риск образующие факторы.
2. Классификация и морфологический анализ рисков.
3. Причины и факторы возникновения рисков в области снабжения.
4. Причины и факторы возникновения рисков при транспортировке.
5. Международный стандарт ISO 31000 «Риск-менеджмент. Принципы и руководство к внедрению». Содержание и краткая характеристика.
6. Процесс управления риском. Характеристика этапов.
7. Характеристика количественных методов оценки рисков.
8. Характеристика качественных методов оценки рисков.
9. Характеристика методов уменьшения рисков.
10. Виды потерь ресурсов и их характеристика.
11. Страхование рисков.
12. Учет альтернативных решений и отношения к риску при управлении рисками.

Критерии оценки:

- оценка «**зачтено**» выставляется студенту, если контрольная работа выполнена и защищена в установленный срок, все требования*, предъявляемые к работе выполнены, тема раскрыта в полном объеме и по существу, использован творческий подход, а при защите продемонстрировано хорошее знание темы;

- оценка «**не зачтено**» выставляется студенту, если требования, предъявляемые к работе не выполнены, не владеет материалом по теме.

*Требования к выполнению контрольной работы доводятся до студентов во время выдачи задания для выполнения контрольной работы.

Составитель А.Ю. Стома «28» 04 2017 г.

Перечень контрольных вопросов к зачету

по дисциплине Анализ и управление рисками

1. Что такое риск? Какими свойствами обладает риск, дайте их характеристику.
2. Основные источники и факторы возникновения риска при снабжении.
3. Основные источники и факторы возникновения риска в области производства.
4. Основные источники и факторы возникновения риска в области распределения.
5. Что такое устойчивость предприятия, устойчивость среды? Что такое колеблемость возможного результата и как ее можно измерить?
6. Что такое хозяйственная, финансовая и информационная устойчивость? Каковы последствия недостаточной и избыточной финансовой устойчивости?
7. Дайте характеристику рисков по факторам возникновения, длительности воздействия и по возможному результату.
8. Дайте характеристику рисков по степени влияния, по возможности страхования и по характеру прогнозирования.
9. Дайте характеристику рисков по характеру управленческих решений, в зависимости от возможности диверсификации.
10. В чем суть морфологического анализа рисков? Охарактеризуйте по основным признакам структуру системного классификатора рисков коммерческого предприятия.
11. Дайте характеристику потерь в предпринимательской деятельности.
12. Что такое область (зона) риска? Дайте их характеристику.
13. Дайте характеристику этапов по управлению рисками: идентификация риска и оценка риска.
14. Дайте характеристику этапа по управлению рисками: выбор методов и мер управления риском.
15. В чем сущность методов управления рисками – избежание рисков, диссипация риска, диверсификация рисков?
16. В чем сущность методов управления рисками – поглощение, трансферт и лимитирование рисков?
17. Дайте характеристику этапа по управлению рисками: предотвращение и контролирование риска.
18. Дайте характеристику этапов по управлению рисками: «финансирование» риска и оценка результатов.
19. В чем суть нейтрального, осторожного и склонного отношения к риску для ЛПР. Вид функций выбора при различном отношении к риску для ЛПР.
20. Выбор наилучшего решения в условиях риска на основе дерева решений.
21. В чем суть модели страхования как модели диверсификации рисков?

ФГБОУ ВО Новосибирский ГАУ
Кафедра экономики

Тестовые задания для проверки сформированности компетенций
по дисциплине «Анализ и управление рисками»

1.Общепрофессиональная компетенция: способностью находить организационно-управленческие решения и готовностью нести за них ответственность с позиций социальной значимости принимаемых решений (ОПК-2)

1. Страхование у нескольких страховщиков одного и того же интереса от одних и тех же опасностей, когда общая страховая сумма превышает страховую стоимость - это:

- 1) сострахование;
- 2) двойное страхование;
- 3) перестрахование;
- 4) самострахование.

2.В зависимости от результатов функционирования системы экологический риск выражается в:

- 1) утрате имущества из-за неблагоприятных природных условий, в результате хищений товарно-материальных ценностей, включая угон транспортных средств;
- 2) возмещении физического, материального и морального ущерба, который может быть нанесен юридическим и физическим лицам в процессе логистической деятельности;
- 3) ущербе, который может нанести окружающей среде организация в результате своей деятельности;
- 4) срыве поставок или недопоставке продукции, нарушениях сроков поставки, увеличении общих издержек вследствие нерациональности закупок, транспортировки, хранения и т.д.

3.Рисковая ситуация, это:

- 1)источник появления рискованной ситуации;
- 2)условия, в которых проявляются причины риска;
- 3)событие, обусловленное причинами и факторами риска, которое может привести к негативным или позитивным последствиям.

4. Если ЛПП рассчитывает на такой ожидаемый доход, который мог бы компенсировать соответствующий риск (в формате возможного отрицательного отклонения конечного экономического результата), то отношение к риску данного ЛПП можно охарактеризовать, как:

- 1)склонное;
- 2)нейтральное;
- 3)осторожное.

5. Область, которая характеризуется возможностью потерь, превышающих величину ожидаемой прибыли, это:

- 1) безрисковая зона;
- 2) зона допустимого риска;

- 3) зона критического риска;
- 4) зона катастрофического риска.

2. Профессиональная компетенция: умением проводить анализ рыночных и специфических рисков для принятия управленческих решений, в том числе при принятии решений об инвестировании и финансировании (ПК-15)

1. Оценка рисков по бальной системе специалистами-экспертами, это суть метода количественной оценки риска:

- 1) дерево решений;
- 2) метода экспертных оценок;
- 3) анализа чувствительности;
- 4) анализ сценариев.

2. Способ ведения деятельности, при котором ущерб, в случае материализации риска ложиться полностью на его участника (ков), это метод управления риском:

- 1) страхование;
- 2) диссипация;
- 3) диверсификация;
- 4) поглощение.

3. Материальные виды потерь выражаются в:

- 1) часах, днях, неделях, месяцах;
- 2) в физических единицах массы, объема, площади;
- 3) в человеко-часах, человеко-днях.

4. Какой вид имеет функция выбора для ЛПП при осторожном отношении к риску:

- 1) $f_s(\sigma; m) = m - k_s \sigma^2$;
- 2) $f_n(\sigma; m) = m$;
- 3) $f_r(\sigma; m) = m + k_r \sigma^2$

5. Исследование зависимости итоговых финансово-экономических показателей от заданных параметров, это суть метода количественной оценки риска:

- 1) дерево решений;
- 2) метода экспертных оценок;
- 3) анализа чувствительности;
- 4) анализ сценариев.

Критерии оценки:

1. > 90 - 100% ответов верны – «отлично»
2. > 60% - ≤ 90% ответов верны – «хорошо»
3. > 45% - ≤ 60% ответов верны – «удовлетворительно»
4. ≤ 45% ответов верны – «неудовлетворительно»

Составитель А.Ю. Стома «18» 04 2017 г.