



Федеральное агентство по рыболовству
Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение
высшего образования
«Калининградский государственный технический университет»
(ФГБОУ ВО «КГТУ»)

УТВЕРЖДАЮ
Директор института

Фонд оценочных средств
(приложение к рабочей программе модуля)
РИСК-МЕНЕДЖМЕНТ

основной профессиональной образовательной программы бакалавриата
по направлению подготовки
38.03.02 МЕНЕДЖМЕНТ

Профиль программы
ПРОИЗВОДСТВЕННЫЙ МЕНЕДЖМЕНТ

ИНСТИТУТ
РАЗРАБОТЧИК

отраслевой экономики и управления
кафедра менеджмента

1 РЕЗУЛЬТАТЫ ОСВОЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ, ПЕРЕЧЕНЬ ОЦЕНОЧНЫХ СРЕДСТВ И КРИТЕРИИ ОЦЕНИВАНИЯ

1.1 Результаты освоения дисциплины

Таблица 1 – Планируемые результаты обучения по дисциплине, соотнесенные с установленными компетенциями

Код и наименование компетенции	Дисциплина	Результаты обучения (владения, умения и знания), соотнесенные с компетенциями
<p>ПК-2 Способен анализировать, регламентировать, оценивать с точки зрения эффективности процессы подразделений организации, разрабатывать мероприятия по совершенствованию процессов, рассчитывать эффективность реализации проекта внедрения или усовершенствования кросс-функциональных процессов или административных регламентов организации</p>	<p>Риск-менеджмент</p>	<p>Знать:</p> <ul style="list-style-type: none"> – методы сбора информации (наблюдения, фиксация данных, анкетирования, анализ документов и отчетной информации, изучение обратной связи от заинтересованных сторон); – методы проведения анализа собранной информации, необходимой для принятия управленческих решений; – принципы и методы трансляции целей организации в показатели ее деятельности. <p>Уметь:</p> <ul style="list-style-type: none"> – анализировать, систематизировать и обобщать информацию; – разрабатывать и презентовать планы мероприятий по минимизации рисков; – определять последовательность работ, распределять функции и ответственность между подразделениями организации для обеспечения минимизации рисков; – оценивать риски выбранных решений. <p>Владеть:</p> <ul style="list-style-type: none"> – методами управления рисками; – методами сбора, систематизации и документирования информации в целях минимизации рисков; – методами внедрения предложений по минимизации

		рисков.
--	--	---------

1.2 К оценочным средствам текущего контроля успеваемости относятся:

- тестовые задания закрытого и открытого типов.

К оценочным средствам для промежуточной аттестации относятся:

- расчетно-графическая работа, экзаменационные задания по дисциплине, представленные в виде тестовых заданий закрытого и открытого типов.

1.3 Критерии оценки результатов освоения дисциплины

Универсальная система оценивания результатов обучения включает в себя системы оценок: 1) «отлично», «хорошо», «удовлетворительно», «неудовлетворительно»; 2) «зачтено», «не зачтено»; 3) 100 – балльную/процентную систему и правило перевода оценок в пятибалльную систему (табл. 2).

Таблица 2 – Система оценок и критерии выставления оценки

Система оценок Критерий	2	3	4	5
	0-40%	41-60%	61-80 %	81-100 %
	«неудовлетворительно»	«удовлетворительно»	«хорошо»	«отлично»
	«не зачтено»	«зачтено»		
1 Системность и полнота знаний в отношении изучаемых объектов	Обладает частичными и разрозненными знаниями, которые не может научно- корректно связывать между собой (только некоторые из которых может связывать между собой)	Обладает минимальным набором знаний, необходимым для системного взгляда на изучаемый объект	Обладает набором знаний, достаточным для системного взгляда на изучаемый объект	Обладает полной знаний и системным взглядом на изучаемый объект
2 Работа с информацией	Не в состоянии находить необходимую информацию, либо в состоянии находить отдельные фрагменты информации в рамках поставленной задачи	Может найти необходимую информацию в рамках поставленной задачи	Может найти, интерпретировать и систематизировать необходимую информацию в рамках поставленной задачи	Может найти, систематизировать необходимую информацию, а также выявить новые, дополнительные источники информации в рамках поставленной задачи
3 Научное осмысление изучаемого явления, процесса, объекта	Не может делать научно корректных выводов из имеющихся у него сведений, в состоянии проанализировать	В состоянии осуществлять научно корректный анализ предоставленной информации	В состоянии осуществлять систематический и научно корректный анализ предоставленной	В состоянии осуществлять систематический и научно-корректный анализ предоставлен-

Система оценок Критерий	2	3	4	5
	0-40%	41-60%	61-80 %	81-100 %
	«неудовлетворительно»	«удовлетворительно»	«хорошо»	«отлично»
	«не зачтено»	«зачтено»		
	только некоторые из имеющихся у него сведений		информации, вовлекает в исследование новые релевантные задачи данные	ной информации, вовлекает в исследование новые релевантные поставленной задаче данные, предлагает новые ракурсы поставленной задачи
4 Освоение стандартных алгоритмов решения профессиональных задач	В состоянии решать только фрагменты поставленной задачи в соответствии с заданным алгоритмом, не освоил предложенный алгоритм, допускает ошибки	В состоянии решать поставленные задачи в соответствии с заданным алгоритмом	В состоянии решать поставленные задачи в соответствии с заданным алгоритмом, понимает основы предложенного алгоритма	Не только владеет алгоритмом и понимает его основы, но и предлагает новые решения в рамках поставленной задачи

2 ОЦЕНОЧНЫЕ СРЕДСТВА ДЛЯ ТЕКУЩЕЙ И ПРОМЕЖУТОЧНОЙ АТТЕСТАЦИИ

Компетенция ПК-2 Способен анализировать, регламентировать, оценивать с точки зрения эффективности процессы подразделений организации, разрабатывать мероприятия по совершенствованию процессов, рассчитывать эффективность реализации проекта внедрения или усовершенствования кросс-функциональных процессов или административных регламентов организации.

Тестовые задания закрытого типа:

1. Риск это –

- 1) неблагоприятное событие, влекущее за собой убыток;
- 2) все предпосылки, способные негативно повлиять на достижение стратегических целей в течение определенного временного промежутка;
- 3) вероятность наступления стихийных бедствий либо технических аварий;
- 4) вероятность провала программы продаж.

2. По сфере возникновения выделяют следующие типы рисков:

- 1) производственный риск;

- 2) внешний риск;
- 3) страхуемый риск;
- 4) **финансовый риск.**

3. Жизненный цикл любой материальной системы включает в себя восемь последовательно сменяющихся друг друга этапов. Установите эту последовательность –

1	рост
2	ликвидация
3	Порог чувствительности
4	спад
5	зрелость
6	внедрение
7	насыщение
8	крах

Ответ: 3, 6, 1, 5, 7, 4, 8, 2 / (Порог чувствительности; внедрение; рост; зрелость; насыщение; спад; крах; ликвидация)

4. По степени влияния мероприятий риск-менеджмента на результаты деятельности субъекта риска различают степени ограничения рисков – определите соответствующие им ситуации.

1	Снятие риска	А	все ситуации, в которых проведенные мероприятия позволяют частично компенсировать влияние риска на результаты данного направления деятельности
2	Принятие риска	Б	отказ от выполнения операции вследствие высоких рисков
3	Ограничение риска	В	ситуация, когда проведенные мероприятия позволяют полностью компенсировать воздействие факторов риска на результат деятельности
4	Фиксация риска	Г	
5	Избежание риска	Д	ситуация, когда риск влияет на результаты совершения сделки, однако отсутствуют способы снижения риска по данному направлению деятельности, либо они слишком дороги

Ответ: 5-Б; 1-В; 2-Д; 3-А

5. Сценарные методы измерения рисков – это

- 1) Методы, основанные на исчислении вероятности событий;
- 2) Метод, основанный на моделировании случайных колебаний одного или нескольких экономических показателей
- 3) **Методы, основанные на построении правдоподобных вариантов будущего (состояний среды), и возможных вариантов действий**

4) Оценка устойчивости фирмы, отдельных элементов активов, к значительным изменениям макроэкономического характера и экстремальным событиям.

6. Шаги по выявлению рисков, угрожающих существованию организации (построение карты рисков), включают определенную последовательность действий – установите ее:

1	составление шкалы величины риска и шкалы вероятности ущерба
2	идентификация рисков
3	построение плана действий
4	обновление карты рисков
5	выбор экспертов по рискам
6	количественное определение рисков

Ответ: (5, 1, 2, 6, 3, 4)* / (выбор экспертов по рискам, составление шкалы величины риска и шкалы вероятности ущерба, идентификация рисков, количественное определение рисков, построение плана действий, обновление карты рисков)*.

7. Стресс-тестирование – термин, описывающий различные:

- 1) методы оценки чувствительности портфеля к существенным изменениям макроэкономических показателей или к исключительным, но возможным событиям;
- 2) методы, которые используются финансовыми институтами для оценки своей уязвимости по отношению к исключительным, но возможным событиям;
- 3) оценки потенциального воздействия на финансовое состояние кредитной организации ряда заданных изменений в факторах риска, которые соответствуют исключительным, но вероятным событиям;
- 4) вероятностные подходы при оценке рискованных ситуаций.

8. Шкала рейтинга – это:

- 1) оценка, отнесение к тому или иному классу, разряду;
- 2) деление должников на группы риска в соответствии с выбранной системой группировки экономических показателей должников;
- 3) система группировки показателей, которая позволяет выставить однозначную оценку;
- 4) отнесение предприятия, физического лица-должника к определенной группе риска.

Тестовые задания открытого типа:

9. В _____ содержатся рекомендации по выбору и применению различных технологий, которые могут быть использованы для совершенствования понимания неопределенности и риска.

Ответ: стандарте*/ГОСТе*

10. Один из способов описания риска – это формирование набора последствий и их _____, которые могут возникнуть в результате определенных, но изменчивых событий.

Ответ: вероятностей

11. Емкость риска (или емкость принятия риска, risk-bearing capacity, RBC) - это _____ риск, который организация может принять с учетом своих финансовых и операционных возможностей.

Ответ: максимальный

12. Новое программное обеспечение должно быть проверено с использованием _____ модели с входами, имеющими известный выход, прежде чем перейти к тестированию более сложных моделей.

Ответ: простой

13. Зачастую риск можно контролировать только путем _____ факторов риска.

Ответ: изменения*/изменений*

14. _____ подходы используют для измерений последствий и вероятностей, которые выражаются в числовых (количественных) шкалах, в виде диапазонов или распределений.

Ответ: Количественные

15. _____ и полуколичественные технологии могут использоваться только для сравнения рисков с другими рисками, измеренными таким же образом, или с критериями, определенными на тех же условиях.

Ответ: Качественные

16. В соответствии с критерием Вальда наилучшим решением будет такая стратегия, которая обеспечивает _____ прибыль из множества наихудших вариантов.

Ответ: наибольшую*/максимальную*

17. Согласно критерия Сэвиджа выбирается такая стратегия, при которой величина упущенных потерь принимает _____ значение.

Ответ: минимальное */наименьшее*

18. В соответствии с критерием Гурвица для каждой стратегии рассчитывается _____ минимального (пропорционально доле пессимистов) и максимального (пропорционально доле оптимистов) выигрышей.

Ответ: сумма

19. _____ риск – возможность отклонения показателей экономической деятельности от ожидаемых значений, вероятность которого можно оценить количественно.

Ответ: Экономический*/бизнес*

20. _____ риск - возможность снижения финансовых показателей от запланированного значения, вероятность которого можно оценить количественно.

Ответ: Финансовый

21. _____ риск- возможность потерь вследствие технических ошибок, действий персонала, аварийных ситуаций, сбоев и т.д.

Ответ: Операционный*/технологический*

22. _____ риска – это визуальное изображение рисков организации, расположенных в прямоугольной таблице, по одной «оси» которой указана сила воздействия (значимость) риска, а по другой - вероятность его возникновения.

Ответ: Карта*/матрица*

23. Совокупность мероприятий, определяющих деятельность компании в целом, а также ее подразделений, менеджеров, отдельных работников с целью ограничения рисков для обеспечения надлежащего уровня надежности достижения результатов деятельности – это _____.

Ответ: система управления рисками

24. _____ – система группировки показателей, которая позволяет выставить однозначную оценку какому-либо лицу.

Ответ: Шкала рейтинга

3 ТИПОВЫЕ ЗАДАНИЯ НА КОНТРОЛЬНУЮ РАБОТУ, КУРСОВУЮ РАБОТУ/КУРСОВОЙ ПРОЕКТ, РАСЧЕТНО-ГРАФИЧЕСКУЮ РАБОТУ

3.1 Расчетно-графическая работа направлена на закрепление полученных теоретических знаний и приобретение умений и навыков в области сбора и систематизации информации, фиксации данных, проведения анкетирования, анализа информации, необходимой для принятия управленческих решений, разработки и презентации планов мероприятий по минимизации рисков и оценки рисков выбранных решений.

Варианты заданий для контрольной работы принимаются в соответствии с вариантами, приведенными в учебно-методическом пособии по изучению дисциплины.

Цель расчетно-графической работы: построить карту рисков организации в целях их фиксации и разработки комплекса мероприятий по их минимизации.

3.2 Типовые задания для построения карты рисков организации.

1. Выбор экспертов по рискам. В группу экспертов как правило включают менеджмент компании – тех специалистов, которые представляют реальные опасности, которые могут возникнуть и способны оценить негативные последствия этих ситуаций.

2. Составление шкалы величины риска и шкалы вероятности ущерба. На этом этапе эксперты договариваются о том, на какой ключевой показатель деятельности компании они будут ориентироваться в ходе оценки величины ущерба, и установить, какая величина потерь является критической для существования компании.

3. Идентификация рисков. Эксперты самостоятельно (или в команде) составляют список рисков, которые потенциально угрожают компании.

4. Количественное определение рисков. Эксперты самостоятельно описывают рисковые события, ранжируют величину потерь и их вероятность при наступлении рисков.

5. Обработка результатов анкетирования и построение карты рисков. По результатам анкетирования определяется средняя величина потерь и средняя вероятность потерь по каждому рисковому событию.

6. Выявления критических для организации рисков.

7. Разработка комплекса мероприятий по минимизации рисков.

4 СВЕДЕНИЯ О ФОНДЕ ОЦЕНОЧНЫХ СРЕДСТВ И ЕГО СОГЛАСОВАНИИ

Фонд оценочных средств для аттестации по дисциплине «Риск-менеджмент» представляет собой компонент основной профессиональной образовательной программы бакалавриата по направлению подготовки 38.03.02 «Менеджмент», программа «Производственный менеджмент».

Преподаватель-разработчик – Зиновьева А. Л. доцент, к.э.н.

Фонд оценочных средств рассмотрен и одобрен на заседании кафедры менеджмента (протокол № 11 от 14.05.2024 г.).

Заведующий кафедрой М


В. В. Дорофеева

Фонд оценочных средств рассмотрен и одобрен методической комиссией ИНОТЭКУ (протокол № 5 от 20.05.2024 г).

Фонд оценочных средств актуализирован, рассмотрен и одобрен методической комиссией ИНОТЭКУ (протокол № 8 от 28.08.2024 г).

Председатель методической комиссии


И.А. Крамаренко