



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)
«ОЦЕНКА И УПРАВЛЕНИЕ РИСКАМИ»

основной профессиональной образовательной программы специалитета
по специальности
38.05.01 ЭКОНОМИЧЕСКАЯ БЕЗОПАСНОСТЬ

ИНСТИТУТ
РАЗРАБОТЧИК

отраслевой экономики и управления
кафедра экономики и финансов

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
ПК-2: Способен проводить внутренний аудит деятельности организации, выявлять риски и угрозы экономической безопасности, формировать интегрированную систему управления рисками, разрабатывать и реализовывать стратегию обеспечения стабильного функционирования системы экономической безопасности организации	Оценка и управление рисками	<p>Знать:</p> <ul style="list-style-type: none"> - категорийно-понятийный аппарат управления рисками; - сущность и виды карт рисков; - методы предупреждения и снижения рисков; - основные виды страхования и их место в управлении конкретными видами рисков; <p>Уметь:</p> <ul style="list-style-type: none"> - использовать источники для сбора и обработки информации в области управления рисками; - разрабатывать карты риска; - представлять информацию о рисках по разным стандартам риск-менеджмента; - анализировать правила страховых организаций и выбирать способы защиты от рисков с помощью страхования; <p>Владеть:</p> <ul style="list-style-type: none"> - методами построения рискографии предприятия (организации); - способами оценки и управления рисками; - моделями анализа рисков, портфелей, банкротств.

1.2 Промежуточная аттестация по дисциплине проводится в форме и экзамена в 9 семестре. При необходимости тестовые задания закрытого и открытого типов могут быть использованы для проведения текущей аттестации.

1.3 К оценочным средствам текущего контроля успеваемости относятся:

– тестовые задания открытого и закрытого типов.

К оценочным средствам для промежуточной аттестации относятся:

– типовые задания по расчетно-графической работе;

– экзаменационные задания по дисциплине, представленные в виде тестовых заданий закрытого и открытого типов.

1.4 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	2	3	4	5
	0-40%	41-60%	61-80 %	81-100 %
Критерий	«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 системой 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 только некоторые из имеющихся у него сведений	В состоянии осуществлять научно корректный анализ предоставленной информации	В состоянии осуществлять систематический и научно корректный анализ предоставленной информации, вовлекает в исследование новые релевантные задачи данные	В состоянии осуществлять систематический и научно корректный анализ предоставленной 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

1.5 Оценивание тестовых заданий закрытого типа осуществляется по системе зачтено/ не зачтено («зачтено» – 41-100% правильных ответов; «не зачтено» – менее 40 % правильных ответов) или пятибалльной системе (оценка «неудовлетворительно» - менее 40 % правильных ответов; оценка «удовлетворительно» - от 41 до 60 % правильных ответов; оценка «хорошо» - от 61 до 80% правильных ответов; оценка «отлично» - от 81 до 100 % правильных ответов).

Тестовые задания открытого типа оцениваются по системе «зачтено/ не зачтено». Оценивается верность ответа по существу вопроса, при этом не учитывается порядок слов в словосочетании, верность окончаний, падежи.

2 ОЦЕНОЧНЫЕ СРЕДСТВА ДЛЯ ТЕКУЩЕЙ И ПРОМЕЖУТОЧНОЙ АТТЕСТАЦИИ

Компетенция ПК-2: Способен проводить внутренний аудит деятельности организации, выявлять риски и угрозы экономической безопасности, формировать интегрированную систему управления рисками, разрабатывать и реализовывать стратегию обеспечения стабильного функционирования системы экономической безопасности организации.

Тестовые задания открытого типа

1. Следствие влияния неопределенности на достижение поставленных целей называется

Ответ: риск

2. Скоординированные действия по руководству и управлению организацией в области риска

Ответ: менеджмент риска / риск-менеджмент

3. Потенциальный источник опасности, вреда и т.д.

Ответ: угроза

4. Источником риска является

Ответ: неопределенность

5. Меры, направленные на изменение риска

Ответ: управление / управление риском

6. Процесс сравнения результатов анализа риска с критериями риска для определения приемлемости риска

Ответ: сравнительная оценка риска / сравнительная оценка*

7. Объект или деятельность, которые самостоятельно или в комбинации с другими обладают возможностью повышения риска

Ответ: источник риска / источник*

8. Совокупность действий, повторяемых во времени, с конкретным началом и концом, целью которого является создание ценности для потребителя

Ответ: процесс / бизнес*процесс

9. Рыночный риск реализуется в случае, когда стоимость актива

Ответ: уменьшилась / снизилась / сократилась

10. Изменение ключевой ставки Центрального банка генерирует риск

Ответ: процентный

11. риск – риск возникновения убытков вследствие неисполнения, несвоевременного либо неполного исполнения должником финансовых обязательств в соответствии с условиями договора

Ответ: кредитный

12. Увеличение рисков, связанных с ДОЛГОВОЙ ценной бумагой, приводит к доходности

Ответ: росту / увеличению

13. Сравнение идентифицированного и проанализированного риска с установленными критериями приемлемости риска

Ответ: оценка риска / оценка*

14. Поиск, распознавание и описание риска, который может помочь или помешать организации достичь своих целей

Ответ: идентификация риска / идентификация*

15. Рассмотрение неопределенностей, источников риска, последствий, вероятности, событий, сценариев, методов управления риском и их эффективности.

Ответ: анализ риска / анализ*

16. Процесс выбора и осуществления мер по модификации или сокращению риска

Ответ: обработка риска / обработка*

17. Риск, остающийся после его обработки

Ответ: остаточный риск

18. Совокупность факторов, по сопоставлению с которыми оценивают значимость риска

Ответ: критерий риска / критерий*

19. Процесс, охватывающий идентификацию риска, анализ риска и сравнительную оценку риска

Ответ: оценка риска / оценка*

20. Действия, предпринятые для уменьшения вероятности негативных последствий или того и другого вместе, связанных с риском.

Ответ: снижение риска / снижение*

21. Риск, остающийся после обработки риска

Ответ: остаточный*

22. Риск, являющийся для организации приемлемым и не угрожающим достижению целей, стоящих перед организацией.

Ответ: допустимый***Тестовые задания закрытого типа:**

23. Численное определение величин отдельных рисков и риска проекта в целом.

1) Количественный анализ рисков

2) Качественный анализ рисков

3) Коэффициент вариации

4) Коэффициент корреляции

24. Средневзвешенное всех возможных результатов, где в качестве весов используются вероятности их достижения

1) Математическое ожидание

2) Дисперсия

3) Коэффициент вариации

4) Коэффициент корреляции

25. Мера риска, рассчитываемая как средневзвешенное квадратов отклонений случайной величины от её математического ожидания (т. е. отклонений действительных результатов от ожидаемых) – мера разброса.

1) Математическое ожидание

2) Дисперсия

- 3) Коэффициент вариации
- 4) Коэффициент корреляции

26. Показатель, демонстрирующий связь между переменными, состоящую в изменении средней величины одного из них в зависимости от изменения другого

- 1) Математическое ожидание
- 2) Дисперсия
- 3) Коэффициент вариации
- 4) Коэффициент корреляции**

27. Элементами процесса менеджмента риска, в соответствии с ИСО 31000 являются:

- 1) Обучение персонала методам менеджмента качества
- 2) Формирование кружков качества
- 3) Оценка риска (включая идентификацию риска, анализ риска и сравнительную оценку риска)**
- 4) Обработка риска**

28. Процесс определения элементов риска, составления их перечня и описания каждого из элементов риска.

- 1) Оценка риска
- 2) Идентификация риска**
- 3) Мониторинг риска
- 4) Менеджмент риска

29. Вероятность возникновения неблагоприятных финансовых последствий в форме потери дохода и капитала в ситуации неопределенности условий осуществления его финансовой деятельности.

- 1) Инфляционный риск
- 2) Природный риск
- 3) Финансовый риск**
- 4) Инвестиционный риск

30. Установите соответствие между рисками и связанными с ними факторами

1	Политический риск	А	уровень доходов населения
2	Экономический риск	Б	финансовое состояние предприятия
3	Технический риск	В	недостаточная информация о потребителях
4	Финансовый риск	Г	отраслевая специфика используемого оборудования
5	Маркетинговый риск	Д	социальное законодательство
		Е	защита активов от природных угроз

Ответ: 1–Д, 2–А, 3–Г, 4–Б, 5–В

31. Установите соответствие между финансовыми инструментами и присущими им рисками

1	акции	А	кредитный риск
2	облигации	Б	риск ликвидности
3	депозиты	В	фондовый риск
4	интервальный ПИФ	Г	процентный риск
		Д	операционный риск

Ответ: 1–В, 2–А, 3–Г, 4–Б

32. Укажите последовательность, в которой производится управление рисками

1	Подготовка решений по обработке рисков
2	Идентификация факторов рисков
3	Оценка
4	Мониторинг и контроль
5	Планирование

Ответ: 52314

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 получения актуальных данных об анализе, оценке и управления рисками с использованием вычислительной техники.

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

Цель расчетно-графической работы: провести анализ показателей рисков деятельности предприятия, оценить риски..

3.2 Типовые задания для проведения анализа.

1. Произвести расчет показателей, характеризующих риск деятельности предприятия по данным о его чистой прибыли, включая расчет среднего значения прибыли и стандартного отклонения.

2. Произвести расчет показателей рисков для двух сельскохозяйственных культур по данным о их доходности (марже), оценить риск производства каждой из культур как:

А) величину среднего ожидаемого убытка;

Б) величину среднеквадратического отклонения

Дать рекомендации по производству продукции.

3. Выбрать наименее рисковый из трех вариантов вложения капитала.

4. Оценить уровень операционных рисков компании на основании представленных данных.

5. Получить с сайта InvestFunds.ru данные об изменении курсов ценной бумаги за установленный период.

Рассчитать стандартное отклонение, относительное стандартное отклонение и стоимость под риском (VaR) для выбранной ценной бумаги.

4 СВЕДЕНИЯ О ФОНДЕ ОЦЕНОЧНЫХ СРЕДСТВ И ЕГО СОГЛАСОВАНИИ

Фонд оценочных средств для аттестации по дисциплине «Оценка и управление рисками» представляет собой компонент основной профессиональной образовательной программы специалитета по специальности 38.05.01 – Экономическая безопасность.

Преподаватель-разработчик – к.э.н. В.И. Кузин.

Фонд оценочных средств рассмотрен и одобрен заведующим кафедрой экономики и финансов

Заведующий кафедрой _____ А.Г. Мнацаканян

Фонд оценочных средств рассмотрен и одобрен заведующим кафедрой экономической безопасности.

Заведующий кафедрой _____ Т.Е. Степанова

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