

МИНИСТЕРСТВО НАУКИ И ВЫСШЕГО ОБРАЗОВАНИЯ
РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ
ФЕДЕРАЛЬНОЕ ГОСУДАРСТВЕННОЕ БЮДЖЕТНОЕ
ОБРАЗОВАТЕЛЬНОЕ УЧРЕЖДЕНИЕ ВЫСШЕГО ОБРАЗОВАНИЯ
«ЛУГАНСКИЙ ГОСУДАРСТВЕННЫЙ УНИВЕРСИТЕТ
ИМЕНИ ВЛАДИМИРА ДАЛЯ»

Институт управления и государственной службы
Кафедра менеджмента и экономической безопасности



УТВЕРЖДАЮ

Директор института управления и
государственной службы

Р.Г. Харьковский

(подпись)

«25» февраля 2025 года

ФОНД ОЦЕНОЧНЫХ СРЕДСТВ

по учебной дисциплине

Риск-менеджмент

(наименование учебной дисциплины, практики)

38.03.02 Менеджмент

(код и наименование направления подготовки (специальности))

«Менеджмент организаций»

(наименование профиля подготовки (специальности, магистерской программы); при отсутствии ставится прочерк)

Разработчики:

доцент _____ Воробьева Н.В.

(подпись)

ФОС рассмотрен и одобрен на заседании кафедры менеджмента и
экономической безопасности от «5» февраля 2025 г., протокол № 7

Заведующий кафедрой
менеджмента и экономической
безопасности

(подпись)

В.Н. Тисунова

Луганск 2025 г.

**Комплект оценочных материалов по дисциплине
«Риск-менеджмент»**

Задания закрытого типа

Задания закрытого типа на выбор правильного ответа

1. Выберите один правильный ответ

Выберите определение, относящееся к понятию риск-менеджмент:

А) это специфическая область менеджмента, которая требует знаний предметной области деятельности фирмы, страхового дела, анализа хозяйственной деятельности предприятия, математических методов оптимизации экономических знаний

Б) это совокупность разного рода мероприятий для снижения угрозы ошибок в процессе принятия решений и сокращения возможных негативных последствий этих решений на разных стадиях функционирования фирмы

В) это искусство управления риском в неопределенной хозяйственной ситуации, основанное на прогнозировании риска и приемах его снижения

Правильный ответ: А

Компетенции (индикаторы): ПК-8 (ПК-8.1)

2. Выберите один правильный ответ

Ситуация риска – это

А) когда вероятность наступления результатов можно просчитать

Б) нет возможности количественно определить вероятность случайного события

В) разновидность неопределенной ситуации

Г) когда вероятность наступления результатов решения нельзя предугадать

Правильный ответ: А

Компетенции (индикаторы): ПК-8 (ПК-8.1)

3. Выберите один правильный ответ

Какой из перечисленных этапов является заключительным в процессе оценки рисков?

А) идентификация рисков

Б) анализ рисков

В) мониторинг и контроль рисков

Г) разработка мер по снижению рисков

Правильный ответ: В

Компетенции (индикаторы): ПК-8 (ПК-8.1)

4. Выберите один правильный ответ

Какой из перечисленных методов относится к качественным методам оценки рисков?

А) математическое моделирование

Б) регрессионный анализ

В) монте-Карло моделирование

Г) SWOT-анализ

Правильный ответ: Г

Компетенции (индикаторы): ПК-8 (ПК-8.1)

Задания закрытого типа на установление соответствия

1. Установите соответствие между методами оценки рисков и их описанием:

Методы оценки	Описание
1) Качественный анализ	А) Оценка рисков на основе числовых данных и вероятностей
2) Количественный анализ	Б) Оценка рисков на основе экспертных мнений и интуиции
3) SWOT-анализ	В) Моделирование различных ситуаций для оценки последствий
4) Сценарный анализ	Г) Анализ сильных и слабых сторон, возможностей и угроз

Правильный ответ: 1-Б, 2-А, 3-Г, 4-В

Компетенции (индикаторы): ПК-8 (ПК-8.1)

2. Установите соответствие между методами снижения рисков и их примерами:

Методы	Примеры
1) Страхование	А) Снижение риска за счет распределения инвестиций
2) Диверсификация	Б) Создание финансового запаса для покрытия убытков
3) Резервирование средств	В) Защита от колебаний цен на рынке
4) Хеджирование	Г) Передача риска страховой компании

Правильный ответ: 1-Г, 2-А, 3-Б, 4-В

Компетенции (индикаторы): ПК-8 (ПК-8.1)

3. Установите соответствие между типами рисков и примерами:

Тип риска	Пример
-----------	--------

- | | |
|-------------------------|---|
| 1) Внешний риск | А) Неправильный выбор направления развития компании |
| 2) Внутренний риск | Б) Кибератака на информационные системы |
| 3) Стратегический риск | В) Устаревшее оборудование |
| 4) Технологический риск | Г) Изменение налогового законодательства |

Правильный ответ: 1-Г, 2-В, 3-А, 4-Б

Компетенции (индикаторы): ПК-8 (ПК-8.1)

4. Установите соответствие между терминами и их определениями:

- | Термин | Определение |
|-------------------------------|--|
| 1) Коэффициент вариации | А) Общий термин, описывающий степень изменчивости или разброса значений в данных. |
| 2) Среднее ожидаемое значение | Б) Мера разброса данных, показывающая, насколько значения отклоняются от среднего. |
| 3) Дисперсия | В) Мера относительной изменчивости данных, рассчитываемая как отношение стандартного отклонения к среднему значению. |
| 4) Колеблемость | Г) Среднее значение случайной величины, взвешенное по вероятностям возможных исходов. |

Правильный ответ: 1-В, 2-Г, 3-Б, 4-А

Компетенции (индикаторы): ПК-8 (ПК-8.1)

Задания закрытого типа на установление правильной последовательности

1. Установите правильную последовательность шагов при проведении качественного анализа рисков:

- А) сбор экспертных мнений
- Б) идентификация рисков
- В) ранжирование рисков по степени важности
- Г) документирование результатов

Правильный ответ: Б, А, В, Г

Компетенции (индикаторы): ПК-8 (ПК-8.1)

2. Установите правильную последовательность шагов при проведении количественного анализа рисков:

А) построение математической модели
Б) интерпретация результатов
В) сбор данных
Г) расчет вероятности и последствий рисков
Правильный ответ: В, А, Г, Б
Компетенции (индикаторы): ПК-8 (ПК-8.1)

3. Установите правильную последовательность применения методов оценки риска:

А) построение карты предпочтений
Б) расчет коэффициента вариации
В) количественный анализ
Г) качественный анализ
Правильный ответ: Г, В, А, Б
Компетенции (индикаторы): ПК-8 (ПК-8.1)

4. Установите правильную последовательность этапов внедрения системы управления рисками:

А) разработка политики управления рисками
Б) запуск системы и мониторинг
В) определение целей и задач системы
Г) обучение сотрудников
Правильный ответ: В, А, Г, Б
Компетенции (индикаторы): ПК-8 (ПК-8.1)

Задания открытого типа

Задания открытого типа на дополнение

1. Напишите пропущенное слово (словосочетание).

Процесс выявления потенциальных угроз и уязвимостей называется _____.

Правильный ответ: идентификация рисков

Компетенции (индикаторы): ПК-8 (ПК-8.1)

2. Напишите пропущенное слово (словосочетание).

Процесс анализа и определения вероятности наступления неблагоприятных событий, а также оценки их потенциального воздействия на достижение целей организации или проекта называется _____.

Правильный ответ: оценка рисков

Компетенции (индикаторы): ПК-8 (ПК-8.1)

3. Напишите пропущенное слово (словосочетание).

Процесс постоянного отслеживания изменений в рисках называется _____.

Правильный ответ: мониторинг рисков

Компетенции (индикаторы): ПК-8 (ПК-8.1)

4. *Напишите пропущенное слово (словосочетание).*

Направление регулирования степени риска, которое предполагает передачу ответственности за риск третьим лицам называется _____.

Правильный ответ: передача риска

Компетенции (индикаторы): ПК-8 (ПК-8.1)

Задания открытого типа с кратким свободным ответом

1. *Ответьте на вопрос:*

Какой инструмент управления рисками предполагает создание финансового запаса для покрытия убытков?

Правильный ответ: резервирование средств

Компетенции (индикаторы): ПК-8 (ПК-8.1)

2. *Ответьте на вопрос:*

Как называется риск, связанный с неэффективными внутренними процессами компании?

Правильный ответ: операционный риск

Компетенции (индикаторы): ПК-8 (ПК-8.1)

3. *Ответьте на вопрос:*

Какой графический инструмент используется для анализа и принятия решений в условиях неопределенности?

Правильный ответ: дерево решений

Компетенции (индикаторы): ПК-8 (ПК-8.1)

4. *Ответьте на вопрос:*

Как называется риск, возникающий в процессе реализации товаров и услуг, зависящий от динамики продвижения товаров и услуг на рынке?

Правильный ответ: коммерческий риск.

Компетенции (индикаторы): ПК-8 (ПК-8.1)

Задания открытого типа с развернутым ответом

1. *Дайте развернутый ответ на вопрос:*

Перечислите основные функции риска.

Время выполнения задания: 10 минут.

Ожидаемый результат: стимулирующая функция, защитная функция, регулирующая функция, инновационная функция, адаптивная функция, информационная функция, распределительная функция, контрольная функция, мотивационная функция, социальная функция, экономическая функция.

Критерии оценивания: наличие в ответе не менее шести функций.

Компетенции (индикаторы): ПК-8 (ПК-8.1)

2. Дайте развернутый ответ на вопрос:

Перечислите, что относится к внутренним факторам, влияющих на результаты предпринимательской деятельности и уровень риска.

Время выполнения задания: 10 минут.

Ожидаемый результат: система мотивации; состояние технико-технологической базы производства и характер инновационных процессов; объем реализации; производительность труда; недостаточная патентная защищенность продукции предприятия и технологии ее производства, что приведет к выпуску аналогичной продукции конкурентами; ошибки в разработке стратегии деятельности предприятия.

Критерии оценивания: наличие в ответе не менее четырех факторов.

Компетенции (индикаторы): ПК-8 (ПК-8.1)

3. Дайте развернутый ответ на вопрос:

Дайте определение понятию минимизация риска. Перечислите основные аспекты минимизации рисков.

Время выполнения задания: 10 минут.

Ожидаемый результат: минимизация риска — это процесс снижения вероятности наступления неблагоприятных событий и уменьшения их потенциального негативного воздействия на деятельность организации. Основные аспекты: идентификация рисков, оценка рисков, разработка стратегий минимизации, реализация стратегий, мониторинг и контроль.

Критерии оценивания: наличие в ответе не менее четырех аспектов.

Компетенции (индикаторы): ПК-8 (ПК-8.1)

Экспертное заключение

Представленный фонд оценочных средств (далее – ФОС) по дисциплине «Риск-менеджмент» соответствует требованиям ФГОС ВО.

Предлагаемые формы и средства текущего и промежуточного контроля адекватны целям и задачам реализации основной профессиональной образовательной программы по направлению подготовки 38.03.02 Менеджмент, профиль «Менеджмент организаций».

Оценочные средства для текущего контроля успеваемости, промежуточной аттестации по итогам освоения дисциплины представлены в полном объеме.

Виды оценочных средств, включенные в представленный фонд, отвечают основным принципам формирования ФОС.

Разработанный и представленный для экспертизы фонд оценочных средств рекомендуется к использованию в процессе подготовки обучающихся по указанному направлению.

Председатель учебно-методической комиссии
института управления и государственной службы _____ Студеникина В.П.

Лист изменений и дополнений

№ п/п	Виды дополнений и изменений	Дата и номер протокола заседания кафедры (кафедр), на котором были рассмотрены и одобрены изменения и дополнения	Подпись (с расшифровкой) заведующего кафедрой (заведующих кафедрами)