

Документ подписан простой электронной подписью

Информация о владельце:

ФИО: Мусаев Матвей Шавагович

Должность: Ректор

Дата подписания: 11.09.2023 10:38:21

Уникальный программный ключ:

236bcc35c296f119d0aa1dc228300210b52d0bc07971a868d5a582319fa4304cc

**МИНИСТЕРСТВО НАУКИ И ВЫСШЕГО ОБРАЗОВАНИЯ РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ
ФЕДЕРАЛЬНОЕ ГОСУДАРСТВЕННОЕ БЮДЖЕТНОЕ ОБРАЗОВАТЕЛЬНОЕ
УЧРЕЖДЕНИЕ ВЫСШЕГО ОБРАЗОВАНИЯ
«ГРОЗНЕНСКИЙ ГОСУДАРСТВЕННЫЙ НЕФТЯНОЙ ТЕХНИЧЕСКИЙ УНИВЕРСИТЕТ
ИМЕНИ АКАДЕМИКА М.Д. МИЛЛИОНЩИКОВА»**

Кафедра Экономика и управление на предприятии»

УТВЕРЖДЕН

на заседании кафедры

«17» сентя 2023 г., протокол № 9

Заведующий кафедрой

Т.В. Якубов

(подпись)

ФОНД ОЦЕНОЧНЫХ СРЕДСТВ ПО УЧЕБНОЙ ДИСЦИПЛИНЕ

«Экономические риски деятельности предприятий»

(наименование дисциплины)

Специальность подготовки

38.05.01 Экономика

код и наименование направления/ специальности подготовки)

Специализация

«Экономическая безопасность организации»

(наименование специализации / профиля подготовки)

Квалификация

специалист

(специалист / бакалавр / магистр)

Составитель Л.А. Мусаев

Грозный –2023

**ПАСПОРТ
ФОНДА ОЦЕНОЧНЫХ СРЕДСТВ ПО УЧЕБНОЙ ДИСЦИПЛИНЕ**

«Управление рисками организации»

№ п/п	Контролируемые разделы (темы) дисциплины	Код контролируемой компетенции (или ее части)	Наименование оценочного средства
1.	Неопределенность и риск	ПК-6.2	Собеседование Контрольная работа Зачетная работа
2.	Теория риска: функции и характерные черты риска	ПК-6.2	Собеседование Контрольная работа Зачетная работа
3.	Принципы менеджмента риска. Классификация рисков	ПК-6.2	Собеседование Контрольная работа Зачетная работа
4.	Система риск-менеджмента	ПК-6.2	Собеседование Контрольная работа Зачетная работа
5.	Процесс менеджмента риска	ПК-6.2	Собеседование Контрольная работа Зачетная работа
6.	Методы управления рисками	ПК-6.2	Собеседование Контрольная работа Зачетная работа
7.	Анализ рисков	ПК-6.2	Собеседование Контрольная работа Экзаменационная работа
8.	Измерители риска	ПК-6.2	Собеседование Контрольная работа Экзаменационная работа
9.	Менеджмент предпринимательских рисков: понятие, сущность и содержание.	ПК-6.2	Собеседование Контрольная работа Экзаменационная работа
10.	Факторы макро- и микросреды предпринимательства. Классификация предпринимательских рисков	ПК-6.2	Собеседование Контрольная работа Экзаменационная

			работа
11.	Международные стандарты риск менеджмента: ISO 31000:2009 Risk management - Principles and guidelines; ISO/IEC 31010:2009 Risk management; ISO Guide 73:2009 Risk management	ПК-6.2	Собеседование Контрольная работа Экзаменационная работа
12.	Управление финансовыми рисками	ПК-6.2	Собеседование Контрольная работа Экзаменационная работа
13.	Управление нефинансовыми рисками	ПК-6.2	Собеседование Контрольная работа Экзаменационная работа
14.	Особенности и практика управления информационными рисками на основе цикла Демига	ПК-6.2	Собеседование Контрольная работа Экзаменационная работа

Профессиональные:

- анализирует и проводит количественную оценку рисков с позиции их идентификации по функциональным областям; оценивает комплексный уровень рисков и значимость его воздействия на предприятие (ПК-6.2).

ФОНД ОЦЕНОЧНЫХ СРЕДСТВ

для текущего контроля

по дисциплине

«Управление рисками организации»

ПЕРЕЧЕНЬ ОЦЕНОЧНЫХ СРЕДСТВ

№ п/п	Наименование оценочного средства	Краткая характеристика оценочного средства	Представление оценочного средства в фонде
1.	<i>Собеседование</i>	Средство контроля, организованное как специальная беседа преподавателя с обучающимся на темы, связанные с изучаемой дисциплиной, и рассчитанное на выяснение объема знаний, обучающегося по определенному разделу, теме, проблеме и т.п.	Вопросы для собеседования
2.	<i>Контрольная работа</i>	Средство проверки умений применять полученные знания для решения задач определенного типа по теме или разделу учебной дисциплины	Комплект контрольных заданий по вариантам

ВОПРОСЫ ДЛЯ СОБЕСЕДОВАНИЯ К ТЕКУЩЕМУ КОНТРОЛЮ

1. Понятие и области проявления неопределенности. (ПК-6.2)
2. Признаки классификации неопределенностей. (ПК-6.2)
3. Типы (виды) неопределенности при принятии решения. (ПК-6.2)
4. Теории риска. (ПК-6.2)
5. Функции риска. (ПК-6.2)
6. Какие принципы управления рисками предлагает Международный стандарт ISO 31000:2009? (ПК-6.2)
7. Понятие и содержание системы риск-менеджмента. (ПК-6.2)
8. Система лимитов на риск. (ПК-6.2)
9. Режимы функционирования системы риск-менеджмента. (ПК-6.2)
10. Что вы понимаете под процессом управления рисками? Чем он может помочь менеджерам? (ПК-6.2)
11. Этапы процесса управления рисками, предложенные западными исследователями. (ПК-6.2)
12. Процесс менеджмента риска согласно Международному стандарту ISO 31000:2009. (ПК-6.2)
13. Определение методов управления рисками. (ПК-6.2)
14. Методы уклонения от рисков. (ПК-6.2)
15. Методы локализации рисков. (ПК-6.2)
16. Методы диверсификации рисков. (ПК-6.2)
17. Методы компенсации риска. (ПК-6.2)
18. Основная цель анализа рисков. Что включает в себя анализ рисков? (ПК-6.2)
19. Концепции анализа рисков, различающихся по исследуемым сферам его проявления. (ПК-6.2)
20. Содержание анализа рисков на стратегическом, тактическом и оперативном уровнях. (ПК-6.2)
21. Блок-схема анализа риска. (ПК-6.2)
22. Виды анализов риска. (ПК-6.2)
23. Качественный анализ риска. (ПК-6.2)
24. Количественный анализ рисков. (ПК-6.2)
25. Методы количественного анализа риска. (ПК-6.2)
26. Метод имитационного моделирования Монте-Карло. (ПК-6.2)
27. Этапы анализа рисков. (ПК-6.2)
28. Содержание процесса управления активами и пассивами коммерческого банка. (ПК-6.2)
29. Управление дисбалансом. (ПК-6.2)
30. Управление стоимостью капитала банка. (ПК-6.2)
31. Качественные измерители риска. (ПК-6.2)
32. Количественные измерители риска. (ПК-6.2)
33. Теория нечетких множеств в оценке степени риска. (ПК-6.2)
34. Метод бальной оценки уровня (степени) риска в деятельности организации. (ПК-6.2)
35. Основные подходы к управлению ресурсами банка. (ПК-6.2)
36. Алгоритм процесса управления ресурсами. (ПК-6.2)
37. Управление собственными средствами. (ПК-6.2)
38. Управление собственным капиталом банка. (ПК-6.2)
39. Этапы процесса планирования капитала. (ПК-6.2)
40. Управление привлеченными ресурсами. (ПК-6.2)
41. Международные стандарты риск менеджмента. Содержание стандарта ISO 31000: 2009. (ПК-6.2)
42. Для чего предназначен стандарт ISO 31000? (ПК-6.2)

43. Стандарт риск менеджмента FERMA: регламент управления риском, содержание стандарта. (ПК-6.2)
44. Понятие ликвидности, ее значимость для банка. (ПК-6.2).
45. Регулирование ликвидности со стороны ЦБ РФ. (ПК-6.2)
46. Методы управления ликвидностью. (ПК-6.2)
47. Модель оперативного управления ликвидностью. (ПК-6.2)
48. Понятие «финансовый риск». Факторы финансовых рисков. (ПК-6.2)
49. Классификация финансовых рисков в деятельности коммерческой организации. (ПК-6.2)
50. Суть и подходы в управлении финансовыми рисками. (ПК-6.2)
51. Понятие и классификация нефинансовых рисков. (ПК-6.2)
52. Общие принципы управления нефинансовыми рисками. (ПК-6.2)
53. Понятие и сущность информационного риска. (ПК-6.2)
54. Информационная система и её элементы. (ПК-6.2)
55. Модель нарушителя. (ПК-6.2)

КРИТЕРИИ ОЦЕНКИ (В РАМКАХ ТЕКУЩЕГО КОНТРОЛЯ)

- *оценка «неудовлетворительно» выставляется студенту, если дан неполный ответ*, представляющий собой разрозненные знания по теме вопроса с существенными ошибками в определениях. Дополнительные и уточняющие вопросы преподавателя не приводят к коррекции ответа студента на поставленный вопрос.

- *оценка «удовлетворительно» выставляется студенту, если дан недостаточно полный и недостаточно развернутый ответ*. Логика и последовательность изложения имеют нарушения. Допущены ошибки в раскрытии понятий, употреблении терминов. Студент не способен самостоятельно выделить существенные и несущественные признаки и причинно-следственные связи.

- *оценка «хорошо» выставляется студенту, если дан полный, но недостаточно последовательный ответ на поставленный вопрос*, но при этом показано умение выделить существенные и несущественные признаки и причинно-следственные связи. Ответ логичен и изложен в терминах науки. Могут быть допущены 1-2 ошибки в определении основных понятий, которые студент затрудняется исправить самостоятельно.

- *оценка «отлично» выставляется студенту, если дан полный, развернутый ответ* на поставленный вопрос, показано умение выделить существенные и несущественные признаки, причинно-следственные связи. Ответ четко структурирован, логичен, изложен в терминах науки.

КОНТРОЛЬНЫЕ ЗАДАНИЯ К ТЕКУЩЕМУ КОНТРОЛЮ (Образец)

1. Образец тестовых заданий

1. По степени неопределенность подразделяется на:
 - а) устранимая и неустранимая;
 - б) параметрическая, структурная и ситуационная;
 - в) вероятностная, лингвистическая, интервальная и полная.

2. Разновидности теории риска:
 - а) классическая, неоклассическая и кейнсианская;
 - б) рыночная, плановая и директивная;
 - в) административно-хозяйственная и плановая

3. Стадии риска:
 - а) зарождение, рост, падение;
 - б) выпуск; обращение, гашение;
 - в) рисковая ситуация, действие, результат.

4. Функции риска:
 - а) регулятивная, защитная, компенсирующая и социально-экономическая
 - б) распределительная, регулирующая и контрольная;
 - в) распределительная и контрольная

5. Какие черты не свойственны риску:
 - а) альтернативность
 - б) безразличность
 - в) целесообразность
 - г) всеобщность
 - д) факторность
 - е) ситуационность

6. Нейтивные рискообразующие факторы – это факторы:
 - а) воздействующие только на конкретный вид риска
 - б) оказывающие влияние на риски сразу нескольких видов

7. По времени возникновения риски распределяются на:
 - а) ситуационные, плановые и оперативные,
 - б) ретроспективные, текущие и перспективные
 - в) финансовые и предпринимательские

8. По характеру последствий риски подразделяют на:
 - а) коммерческие и политические
 - б) прямые и финансовые
 - в) чистые и спекулятивные
 - г) чистые и селективные
 - д) производственные и коммерческие

9. Какие методы управления и анализа риска используют в условиях полной неопределенности:
 - а) финансовые
 - б) диссипации

- в) статистические
- г) математические
- д) экспертные

10. Риск потерь в процессе финансово – хозяйственной деятельности это:

- а) спекулятивные риски
- б) производственный риск
- в) коммерческий риск
- г) финансовый риск

11. Что выступает товаром в финансовом предпринимательстве?

- а) деньги и валюта;
- б) ценные бумаги и производные финансовые инструменты;
- в) а и б вместе взятые.

12. Какому типу рисков относится финансовый риск?

- а) чистых рисков;
- б) спекулятивных рисков;
- в) а и б вместе взятых.

13. Какие существуют факторы финансовых рисков?

- а) объективные;
- б) субъективные;
- в) а и б вместе взятые.

14. Какие подходы выделяют при расчете VAR?

- а) эмпирический;
- б) логический;
- в) оценочный;
- г) ранжирование;
- д) параметрический.

15. Кто является владельцем финансовых рисков в организации?

- а) менеджмент;
- б) собственник;
- в) а и б вместе взятые.

16. В чем специфичность проявления рыночных рисков?

- а) нестабильности развития отрасли экономики;
- б) нестабильности финансовых рынков;
- в) а и б вместе взятые.

17. С каким финансовым инструментом законодательно принято связывать валютный риск?

- а) облигация;
- б) акция;
- в) валюта.

18. С каким финансовым инструментом законодательно принято связывать процентный риск?

- а) облигация;
- б) акция;
- в) валюта.

9. С каким финансовым инструментом законодательно принято связывать фондовый риск?

- а) облигация;
- б) акция;
- в) валюта.

20. Какие существуют методы защиты от финансовых рисков?

- а) физическая защита;
- б) экономическая защита;
- в) а и б вместе взяты.

2. Образец контрольных заданий

Задача

Имеются два варианта вложения средств: в мероприятие А и в мероприятие Б. Исходные данные приведены в таблице. Определить вариант с меньшей степенью риска.

Таблица 1.1 – Исходные данные к задаче

Номер события	Полученная прибыль, тыс. руб.	Число случаев наблюдения
Мероприятие А		
1	25	48
2	20	36
3	30	36
Итого:	-	120
Мероприятие Б		
1	40	30
2	15	50
3	30	20
Итого:	-	100

Для решения данной задачи воспользуемся формулами (1), (2), т.е. основными критериями для оценки степени риска. Обозначим прибыль за x , число случаев наблюдения – за n . Составим таблицу следующего характера.

Таблица 1.2 – Основные показатели для расчета

Номер события	Прибыль, тыс. руб., x	Число наблюдения, n_i	$(x - \bar{x})$	$(x - \bar{x})^2$	$(x - \bar{x})^2 \times n$
Мероприятие А					
1	25	48	-	-	-
2	20	36	-5	25	25 * 36=900
3	30	36	+5	25	25 * 36=900
Итого	$\bar{x} = 25$	120	-	-	1800
Мероприятие Б					
1	40	30	+10	100	100*30=3000
2	15	50			
3	30	20	-15	225	225 * 20=4500
Итого	$\bar{x} = 30$	100	-	-	7500

Среднее арифметическое для мероприятия А рассчитано следующим образом:

$$\bar{x} = \frac{25 \cdot 48 + 20 \cdot 36 + 30 \cdot 36}{120} = 25$$

Рассчитаем среднеквадратичное отклонение и коэффициент вариации:

$$\sigma_A = \sqrt{\frac{1800}{120}} = \pm 3,87 \text{ (для мероприятия А);}$$

$$\sigma_B = \sqrt{\frac{7500}{100}} = \pm 8,7 \text{ (для мероприятия Б).}$$

Коэффициент вариации:

$$V_A = \frac{\pm 3,87}{25} \cdot 100\% = \pm 15,5\% \text{ (для мероприятия А);}$$

$$V_B = \frac{\pm 8,7}{30} \cdot 100\% = 29\% \text{ (для мероприятия Б).}$$

Ответ: таким образом, в результате расчета предпочтителен вариант вложения капитала в мероприятие А, так как для этого варианта характерна умеренная колеблемость показателей прибыли, и меньше среднеквадратичное отклонение.

Задача

Провести обзор риск-менеджмента в публичной компании на современном этапе

Задача

Изучите систему нормативных актов ЦБ, выделите основные виды рисков публичной компании.

Задача

Проанализируйте на основании бухгалтерской отчетности структуру активов и пассивов публичной компании, отчет о прибыли и убытках.

Сделать соответствующие выводы.

Задача

Определить причины изменения показателей отчетности публичной компании и выявить дальнейшие тенденции.

Сделать соответствующие выводы.

Задача

За смену бригада вырабатывает 8 тонн цемента, из которых производится 200 м² тротуарной плитки. Средняя стоимость 1 м² плитки равна 350 рублей. Снижение намеченных объемов производства и реализации продукции вследствие отсутствия необходимого количества сырья ведет к недополучению запланированной выручки. Вероятность ущерба из-за нарушения условий контракта составляет 0,6. Вероятные потери (Y) за сутки в этом случае в стоимостном выражении определяются произведением объема выпуска продукции и цены реализации единицы продукции $Y = 200 \times 350 = 70000$ рублей. Рассчитать степень риска упущенной выгоды предприятия.

Задача

Первоначальные инвестиции компании в реализацию проекта составили 3 000 у.е. Безрисковая дисконтная ставка составляет 10%. Плата за риск – 5%. Динамика чистых денежных потоков представлена в табл. 3. Рассчитайте эффективность проекта с учетом и без учета риска.

Таблица 1 Динамика чистых денежных потоков

Год	1	2	3	4	5
Стоимость денежного потока, у.е.	1 100	2 200	2 000	- 400	- 1 000

Задача

В таблице 2 представлены данные по объемам реализации компании. Рассчитайте

вероятность каждого значения временного ряда, а также следующие показатели его динамики:

- 1) размах вариации
- 2) математическое ожидание
- 3) дисперсия
- 4) среднеквадратическое отклонение
- 5) коэффициент вариации

Таблица 2 — Объем реализации компании в стоимостном выражении

Месяц	янв	фев	мар	апр	май	июн	июл	авг
Объем реализации, тыс. у.е.	120	115	135	120	158	115	100	120

Критерии оценки (в рамках текущей аттестации)

Регламентом БРС ГГНТУ предусмотрено 15 баллов за текущую аттестацию. Критерии оценки разработаны, исходя из разделения баллов: 10 баллов за освоение теоретических вопросов дисциплины, 5 баллов – за выполнение практических заданий.

Критерии оценки ответов на теоретические вопросы:

- 0 баллов выставляется студенту, если дан неполный ответ, представляющий собой разрозненные знания по теме вопроса с существенными ошибками в определениях. Присутствуют фрагментарность, нелогичность изложения. Студент не осознает связь данного понятия, теории, явления с другими объектами дисциплины. Отсутствуют выводы, конкретизация и доказательность изложения. Речь неграмотная. Дополнительные и уточняющие вопросы преподавателя не приводят к коррекции ответа студента не только на поставленный вопрос, но и на другие вопросы дисциплины.

- 1-2 баллов выставляется студенту, если дан недостаточно полный и недостаточно развернутый ответ. Логика и последовательность изложения имеют нарушения. Допущены ошибки в раскрытии понятий, употреблении терминов. Студент не способен самостоятельно выделить существенные и несущественные признаки и причинно-следственные связи. Студент может конкретизировать обобщенные знания, доказав на примерах их основные положения только с помощью преподавателя. Речевое оформление требует поправок, коррекции.

- 3-4 баллов выставляется студенту, если дан полный, но недостаточно последовательный ответ на поставленный вопрос, но при этом показано умение выделить существенные и несущественные признаки и причинно-следственные связи. Ответ логичен и изложен в терминах науки. Могут быть допущены 1–2 ошибки в определении основных понятий, которые студент затрудняется исправить самостоятельно.

- 5-6 баллов выставляется студенту, если дан полный, развернутый ответ на поставленный вопрос, показано умение выделить существенные и несущественные признаки, причинно-следственные связи. Ответ четко структурирован, логичен, изложен в терминах науки. Однако допущены незначительные ошибки или недочеты, исправленные студентом с помощью «наводящих» вопросов преподавателя.

- 7-8 баллов выставляется студенту, если дан полный, развернутый ответ на поставленный вопрос, доказательно раскрыты основные положения темы; в ответе прослеживается четкая структура, логическая последовательность, отражающая сущность раскрываемых понятий, теорий, явлений. Ответ изложен литературным языком в терминах науки. В ответе допущены недочеты, исправленные студентом с помощью преподавателя

- 9 баллов выставляется студенту, если дан полный, развернутый ответ на поставленный вопрос, показана совокупность осознанных знаний об объекте, доказательно раскрыты основные положения темы; в ответе прослеживается четкая структура, логическая последовательность, отражающая сущность раскрываемых понятий, теорий, явлений. Знание об объекте демонстрируется на фоне понимания его в системе данной науки и междисциплинарных связей. Ответ изложен литературным языком в терминах науки. Могут быть допущены недочеты в определении понятий, исправленные студентом самостоятельно в процессе ответа.

- 10 баллов выставляется студенту, если дан полный, развернутый ответ на поставленный вопрос, показана совокупность осознанных знаний об объекте, проявляющаяся в свободном оперировании понятиями, умении выделить существенные и несущественные его признаки, причинно-следственные связи. Знание об объекте демонстрируется на фоне понимания его в системе данной науки и междисциплинарных связей. Ответ формулируется в терминах науки, изложен литературным языком, логичен, доказателен, демонстрирует авторскую позицию студента.

Баллы за тему выводятся как средний балл по заданным студенту вопросам, не считая количество «наводящих» и уточняющих вопросов.

Баллы за текущую аттестацию выводятся как средний балл по всем темам.

ФОНД ОЦЕНОЧНЫХ СРЕДСТВ

для промежуточного контроля

по дисциплине

«Управление рисками организации»

ПЕРЕЧЕНЬ ОЦЕНОЧНЫХ СРЕДСТВ

/п	Наименование оценочного средства	Краткая характеристика оценочного средства	Представл ение оценочного средства в фонде
.	<i>Зачетная работа</i>	Средство контроля усвоения учебного материала дисциплины	Вопросы к зачету. Комплект билетов к экзамену

**ГРОЗНЕНСКИЙ ГОСУДАРСТВЕННЫЙ НЕФТЯНОЙ ТЕХНИЧЕСКИЙ
УНИВЕРСИТЕТ ИМЕНИ АКАДЕМИКА М.Д. МИЛЛИОНЩИКОВА**

Институт ЦЭ и ТП

Кафедра «Экономика и управление на предприятии»

ВОПРОСЫ К ЗАЧЕТУ ПО ДИСЦИПЛИНЕ

«Управление рисками организации»

1. Понятие и области проявления неопределённости. (ПК-6.2)
2. Признаки классификации неопределенностей. (ПК-6.2)
3. Типы (виды) неопределенности при принятии решения. (ПК-6.2)
4. Источники неопределенности. (ПК-6.2)
5. Взаимосвязь категорий «неопределенность» - «риск» - «потеря». (ПК-6.2)
6. Отличительные особенности понятий «неопределенность» и «риск». (ПК-6.2)
7. Классическая теория риска, неоклассическая теория риска и кейнсианская теория риска. (ПК-6.2)
8. Теория риска в советской экономической науке. (ПК-6.2)
9. Подходы современных экономических теорий в определении «риска». (ПК-6.2)
10. Основные факторы неопределенности, препятствующие хозяйственной и инвестиционной деятельности в России. (ПК-6.2)
11. Три подхода экономических теорий в определении понятия «риск». (ПК-6.2)
12. Функции риска. (ПК-6.2)
13. Характерные черты риска. (ПК-6.2)
14. Формирование системы принципов управления рисками. (ПК-6.2)
15. основополагающие принципы управления рисками, которым надлежит следовать субъекту управления. (ПК-6.2)
16. Принципы, предлагаемые Международным стандартом ISO 31000:2009. (ПК-6.2)
17. Классификация рисков по времени возникновения. (ПК-6.2)
18. Классификации рисков по факторам возникновения. (ПК-6.2)
19. Классификация рисков по характеру последствий (экономического результата). (ПК-6.2)
20. Классификация рисков по сфере возникновения. (ПК-6.2)
21. Классификация рисков по уровню последствия. (ПК-6.2)

Комплект билетов к зачету

ГРОЗНЕНСКИЙ ГОСУДАРСТВЕННЫЙ НЕФТЯНОЙ ТЕХНИЧЕСКИЙ УНИВЕРСИТЕТ
им. академика М.Д. Миллионщикова

БИЛЕТ №1

Дисциплина Управление рисками организации

Институт ИЦЭиТП группа ЭБ семестр 9

1. Понятие и области проявления неопределённости.
2. Функции риска. Характерные черты риска

УТВЕРЖДАЮ:

« ___ » _____ 20__ г. *Зав. кафедрой*

ГРОЗНЕНСКИЙ ГОСУДАРСТВЕННЫЙ НЕФТЯНОЙ ТЕХНИЧЕСКИЙ УНИВЕРСИТЕТ
им. академика М.Д. Миллионщикова

БИЛЕТ №2

Дисциплина Управление рисками организации

Институт ИЦЭиТП группа ЭБ семестр 9

1. Признаки классификации неопределенностей.
2. Формирование системы принципов управления рисками.

УТВЕРЖДАЮ:

« ___ » _____ 20__ г. *Зав. кафедрой*

ГРОЗНЕНСКИЙ ГОСУДАРСТВЕННЫЙ НЕФТЯНОЙ ТЕХНИЧЕСКИЙ УНИВЕРСИТЕТ
им. академика М.Д. Миллионщикова

БИЛЕТ №3

Дисциплина Управление рисками организации

Институт ИЦЭиТП группа ЭБ семестр 9

1. Типы (виды) неопределенности при принятии решения.
2. основополагающие принципы управления рисками, которым надлежит следовать субъекту управления.

УТВЕРЖДАЮ:

« ___ » _____ 20__ г. *Зав. кафедрой*

**ГРОЗНЕНСКИЙ ГОСУДАРСТВЕННЫЙ НЕФТЯНОЙ ТЕХНИЧЕСКИЙ УНИВЕРСИТЕТ
им. академика М.Д. Миллионщикова**

БИЛЕТ №4

Дисциплина Управление рисками организации

Институт ИЦЭиТП

группа ЭБ семестр 9

1. Источники неопределенности.
2. Принципы, предлагаемые Международным стандартом ISO 31000:2009

УТВЕРЖДАЮ:

« » 20 г.

Зав. кафедрой

**ГРОЗНЕНСКИЙ ГОСУДАРСТВЕННЫЙ НЕФТЯНОЙ ТЕХНИЧЕСКИЙ УНИВЕРСИТЕТ
им. академика М.Д. Миллионщикова**

БИЛЕТ №5

Дисциплина Управление рисками организации

Институт ИЦЭиТП

группа ЭБ семестр 9

1. Взаимосвязь категорий «неопределенность» - «риск» - «потеря»..
2. Классификация рисков по времени возникновения

УТВЕРЖДАЮ:

« » 20 г.

Зав. кафедрой

**ГРОЗНЕНСКИЙ ГОСУДАРСТВЕННЫЙ НЕФТЯНОЙ ТЕХНИЧЕСКИЙ УНИВЕРСИТЕТ
им. академика М.Д. Миллионщикова**

БИЛЕТ №6

Дисциплина Управление рисками организации

Институт ИЦЭиТП

группа ЭБ семестр 9

1. Отличительные особенности понятий «неопределенность» и «риск».
2. Классификации рисков по факторам возникновения

УТВЕРЖДАЮ:

« » 20 г.

Зав. кафедрой

ГРОЗНЕНСКИЙ ГОСУДАРСТВЕННЫЙ НЕФТЯНОЙ ТЕХНИЧЕСКИЙ УНИВЕРСИТЕТ
им. академика М.Д. Миллионщикова

БИЛЕТ №7

Дисциплина Управление рисками организации

Институт ИЦЭиТП

группа ЭБ семестр 9

1. Классическая теория риска, неоклассическая теория риска и кейнсианская теория риска.
2. Классификация рисков по характеру последствий (экономического результата).

УТВЕРЖДАЮ:

« ____ » _____ 20__ г.

Зав. кафедрой

ГРОЗНЕНСКИЙ ГОСУДАРСТВЕННЫЙ НЕФТЯНОЙ ТЕХНИЧЕСКИЙ УНИВЕРСИТЕТ
им. академика М.Д. Миллионщикова

БИЛЕТ №8

Дисциплина Управление рисками организации

Институт ИЦЭиТП

группа ЭБ семестр 9

1. Теория риска в советской экономической науке.
2. Классификация рисков по сфере возникновения

УТВЕРЖДАЮ:

« ____ » _____ 20__ г.

Зав. кафедрой

ГРОЗНЕНСКИЙ ГОСУДАРСТВЕННЫЙ НЕФТЯНОЙ ТЕХНИЧЕСКИЙ УНИВЕРСИТЕТ
им. академика М.Д. Миллионщикова

БИЛЕТ №9

Дисциплина Управление рисками организации

Институт ИЦЭиТП

группа ЭБ семестр 9

1. Подходы современных экономических теорий в определении «риска»
2. Классификация рисков по уровню последствия

УТВЕРЖДАЮ:

« ____ » _____ 20__ г.

Зав. кафедрой

ГРОЗНЕНСКИЙ ГОСУДАРСТВЕННЫЙ НЕФТЯНОЙ ТЕХНИЧЕСКИЙ УНИВЕРСИТЕТ
им. академика М.Д. Миллионщикова

БИЛЕТ №10

Дисциплина Управление рисками организации

Институт ИЦЭиТП

группа ЭБ семестр 9

1. Основные факторы неопределенности, препятствующие хозяйственной и инвестиционной деятельности в России
2. Формирование системы принципов управления рисками

УТВЕРЖДАЮ:

« » 20 г.

Зав. кафедрой

ПЕРЕЧЕНЬ ОЦЕНОЧНЫХ СРЕДСТВ

/п	Наименование оценочного средства	Краткая характеристика оценочного средства	Представл ение оценочного средства в фонде
.	<i>Экзаменационная работа</i>	Средство контроля усвоения учебного материала дисциплины	Вопросы к экзамену. Комплект билетов к экзамену

ВОПРОСЫ К ЭКЗАМЕНУ ПО ДИСЦИПЛИНЕ

«Управление рисками организации»

1. Система лимитов на риск. (ПК-6.2)
2. Лимит допустимого риска для организации. (ПК-6.2)
3. Лимиты на риск по направлениям деятельности организации. Лимиты ответственности за управление риском. (ПК-6.2)
4. Лимиты существенности для учёта рисков. Лимиты уровня существенности для целей организации. (ПК-6.2)
5. Процесс менеджмента риска согласно Международному стандарту ISO 31000:2009. Стадии процесса управления риском. (ПК-6.2)
6. Дособытийные методы управления рисками. Послесобытийные методы управления рисками. (ПК-6.2)
7. Организационные методы управления рисками. (ПК-6.2)
8. Методы уклонения от рисков. Методы локализации рисков. (ПК-6.2)
9. Методы диверсификации рисков. Методы компенсации риска. (ПК-6.2)
10. Кредитные риски. (ПК-6.2)
11. Понятие «финансовый риск». Факторы финансовых рисков. (ПК-6.2)
12. Риски, связанные с покупательной способностью денег. (ПК-6.2)
13. Сущность основных видов финансовых рисков. (ПК-6.2)
14. Подходы к управлению финансовыми рисками. (ПК-6.2)
15. Методы (способы) управления финансовыми рисками. (ПК-6.2)
16. Принципы управления финансовыми рисками. (ПК-6.2)
17. Стратегии нейтрализации финансовых рисков. (ПК-6.2)
18. Оценка и измерение финансовых рисков. (ПК-6.2)
19. Понятие и классификация нефинансовых рисков. Общие принципы управления нефинансовыми рисками. (ПК-6.2)
20. Подходы к оценке нефинансовых рисков. (ПК-6.2)
21. Нефинансовые риски текущей деятельности организации.. (ПК-6.2)
22. Понятие и содержание системы менеджмента риска. (ПК-6.2)
23. Взаимосвязь ликвидности баланса, ликвидности деятельности и платежеспособности организации. (ПК-6.2)
24. Сущность и содержание системы лимитов на риск. (ПК-6.2)
25. Многофакторные линейные модели оценки риска. (ПК-6.2)
26. Сущность и содержание системы лимитов на риск. (ПК-6.2)
27. Многофакторные линейные модели оценки риска. (ПК-6.2)
28. Система риск-менеджмента кредитного портфеля банка. (ПК-6.2)
29. Система лимитов на риск. (ПК-6.2)
30. Понятие и сущность информационного риска. (ПК-6.2)
31. Источники, причины и факторы информационных рисков. (ПК-6.2)

Комплект билетов к экзамену

ГРОЗНЕНСКИЙ ГОСУДАРСТВЕННЫЙ НЕФТЯНОЙ ТЕХНИЧЕСКИЙ УНИВЕРСИТЕТ
им. академика М.Д. Миллионщикова

БИЛЕТ №1

Дисциплина Управление рисками организации

Институт ИЦЭиТП группа ЭБ семестр 9

1. Процесс менеджмента риска согласно Международному стандарту ISO 31000:2009. Стадии процесса управления риском.
2. Оценка и измерение финансовых рисков

УТВЕРЖДАЮ:

« » 20 г. *Зав. кафедрой*

ГРОЗНЕНСКИЙ ГОСУДАРСТВЕННЫЙ НЕФТЯНОЙ ТЕХНИЧЕСКИЙ УНИВЕРСИТЕТ
им. академика М.Д. Миллионщикова

БИЛЕТ №2

Дисциплина Управление рисками организации

Институт ИЦЭиТП группа ЭБ семестр 9

1. Организационные методы управления рисками.
2. Подходы к оценке нефинансовых рисков.

УТВЕРЖДАЮ:

« » 20 г. *Зав. кафедрой*

ГРОЗНЕНСКИЙ ГОСУДАРСТВЕННЫЙ НЕФТЯНОЙ ТЕХНИЧЕСКИЙ УНИВЕРСИТЕТ
им. академика М.Д. Миллионщикова

БИЛЕТ №3

Дисциплина Управление рисками организации

Институт ИЦЭиТП группа ЭБ семестр 9

1. Система лимитов на риск.
2. Нефинансовые риски текущей деятельности организации..

УТВЕРЖДАЮ:

« » 20 г. *Зав. кафедрой*

**ГРОЗНЕНСКИЙ ГОСУДАРСТВЕННЫЙ НЕФТЯНОЙ ТЕХНИЧЕСКИЙ УНИВЕРСИТЕТ
им. академика М.Д. Миллионщикова**

БИЛЕТ №4

Дисциплина Управление рисками организации

Институт ИЦЭиТП

группа ЭБ семестр 9

1. Лимиты существенности для учёта рисков. Лимиты уровня существенности для целей организации.
2. Методы (способы) управления финансовыми рисками

УТВЕРЖДАЮ:

« » 20 г.

Зав. кафедрой

**ГРОЗНЕНСКИЙ ГОСУДАРСТВЕННЫЙ НЕФТЯНОЙ ТЕХНИЧЕСКИЙ УНИВЕРСИТЕТ
им. академика М.Д. Миллионщикова**

БИЛЕТ №5

Дисциплина Управление рисками организации

Институт ИЦЭиТП

группа ЭБ семестр 9

1. Лимит допустимого риска для организации
2. Принципы управления финансовыми рисками

УТВЕРЖДАЮ:

« » 20 г.

Зав. кафедрой

**ГРОЗНЕНСКИЙ ГОСУДАРСТВЕННЫЙ НЕФТЯНОЙ ТЕХНИЧЕСКИЙ УНИВЕРСИТЕТ
им. академика М.Д. Миллионщикова**

БИЛЕТ №6

Дисциплина Управление рисками организации

Институт ИЦЭиТП

группа ЭБ семестр 9

1. Дособытийные методы управления рисками. Послесобытийные методы управления рисками.
2. Многофакторные линейные модели оценки риска.

УТВЕРЖДАЮ:

« » 20 г.

Зав. кафедрой

ГРОЗНЕНСКИЙ ГОСУДАРСТВЕННЫЙ НЕФТЯНОЙ ТЕХНИЧЕСКИЙ УНИВЕРСИТЕТ
им. академика М.Д. Миллионщикова

БИЛЕТ №7

Дисциплина Управление рисками организации

Институт ИЦЭиТП

группа _____ **ЭБ семестр 9**

1. Методы уклонения от рисков. Методы локализации рисков
2. Многофакторные линейные модели оценки риска

УТВЕРЖДАЮ:

« ____ » _____ 20__ г.

Зав. кафедрой

ГРОЗНЕНСКИЙ ГОСУДАРСТВЕННЫЙ НЕФТЯНОЙ ТЕХНИЧЕСКИЙ УНИВЕРСИТЕТ
им. академика М.Д. Миллионщикова

БИЛЕТ №8

Дисциплина Управление рисками организации

Институт ИЦЭиТП

группа _____ **ЭБ семестр 9**

1. Лимиты на риск по направлениям деятельности организации. Лимиты ответственности за управление риском.
2. Понятие и сущность информационного риска.

УТВЕРЖДАЮ:

« ____ » _____ 20__ г.

Зав. кафедрой

ГРОЗНЕНСКИЙ ГОСУДАРСТВЕННЫЙ НЕФТЯНОЙ ТЕХНИЧЕСКИЙ УНИВЕРСИТЕТ
им. академика М.Д. Миллионщикова

БИЛЕТ №9

Дисциплина Управление рисками организации

Институт ИЦЭиТП

группа _____ **ЭБ семестр 9**

1. Понятие «финансовый риск». Факторы финансовых рисков
2. Понятие и содержание системы менеджмента риска.
- 3.

УТВЕРЖДАЮ:

« ____ » _____ 20__ г.

Зав. кафедрой

ГРОЗНЕНСКИЙ ГОСУДАРСТВЕННЫЙ НЕФТЯНОЙ ТЕХНИЧЕСКИЙ УНИВЕРСИТЕТ
им. академика М.Д. Миллионщикова

БИЛЕТ №10

Дисциплина Управление рисками организации

Институт ИЦЭиТП

группа ЭБ семестр 9

1. Подходы к управлению финансовыми рисками
2. Источники, причины и факторы информационных рисков

УТВЕРЖДАЮ:

« » 20 г.

Зав. кафедрой

КРИТЕРИИ ОЦЕНКИ (В РАМКАХ ПРОМЕЖУТОЧНОГО КОНТРОЛЯ)

- оценка **«отлично»** выставляется студенту, если теоретическое содержание дисциплины 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;

- оценка **«хорошо»** выставляется студенту, если теоретическое содержание курса освоено полностью, без пробелов, некоторые практические навыки работы с освоенным материалом сформированы недостаточно, все предусмотренные программой обучения учебные задания выполнены, качество выполнения ни одного из них не оценено минимальным числом баллов, некоторые виды заданий выполнены с ошибками;

- оценка **«удовлетворительно»** выставляется студенту, если 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;

- оценка **«неудовлетворительно»** выставляется студенту, если теоретическое содержание курса освоено частично, необходимые практические навыки работы не сформированы, большинство предусмотренных программой обучения учебных заданий не выполнено, либо качество их выполнения оценено числом баллов, близким к минимальному; при дополнительной самостоятельной работе над материалом курса возможно повышение качества выполнения учебных заданий.