

Министерство науки и высшего образования Российской Федерации
НАЦИОНАЛЬНЫЙ ИССЛЕДОВАТЕЛЬСКИЙ
ТОМСКИЙ ГОСУДАРСТВЕННЫЙ УНИВЕРСИТЕТ (НИ ТГУ)

Факультет инновационных технологий

УТВЕРЖДАЮ:
Руководитель ОПОП


В. И. Сырямкин
« 13 » мая 2023 г.

Оценочные материалы
текущего контроля и промежуточной аттестации по дисциплине

Риск-менеджмент

по направлению подготовки

27.03.02 Управление качеством

Направленность (профиль) подготовки:

Управление качеством в производственно-технологических системах

Форма обучения

Очная

Квалификация

Бакалавр

1. Планируемые результаты освоения дисциплины

Результаты освоения дисциплины (индикатор достижения компетенции)	Планируемые образовательные результаты (ОР) обучения по дисциплине
ИОПК-10.1. Владеет методами анализа и оценки рисков	ОР 10.1.1 Знает основы риск-менеджмента и стандарты по управлению рисками; умеет выявлять риски в процессах, при решении задач ОР 10.1.2 Владеет методами и инструментами количественного и качественного анализа рисков при управлении качеством
ИОПК-10.2. Разрабатывает корректирующие и предупреждающие действия на основе оценки рисков	ОР 10.2.1 Применяет понятия корректирующих и предупреждающих действий для минимизации рисков ОР 10.2.2 Умеет разрабатывать мероприятия по управлению рисками и оценивать их эффективность

2. Этапы достижения образовательных результатов в процессе освоения дисциплины

№	Темы дисциплин	Образовательные результаты	Формы текущего контроля и промежуточной аттестации
1.	Тема 1 Развитие исследований в области анализа и оценки риска в системе менеджмента качества	ОР 10.1.1 ОР 10.1.2	Текущий контроль: контроль посещаемости, устный опрос; выполнение и защита практической работы; Промежуточная аттестация: зачет с оценкой (тестовый опрос)
2.	Тема 2 Регламентация системы управления рисками на различных уровнях	ОР 10.1.1 ОР 10.1.2	Текущий контроль: контроль посещаемости, устный опрос; выполнение и защита практической работы; Промежуточная аттестация: зачет с оценкой (тестовый опрос)
3.	Тема 3 Оценка риска в системе менеджмента качества. Основные этапы анализа риска. Технологии оценки риска	ОР 10.2.1 ОР 10.2.2	Текущий контроль: контроль посещаемости, устный опрос; выполнение и защита практической работы; Промежуточная аттестация: зачет с оценкой (тестовый опрос)
4.	Тема 4. Управление рисками организация системы риск-менеджмента. Методы воздействия на риск	ОР 10.2.1 ОР 10.2.2	Текущий контроль: контроль посещаемости, устный опрос; выполнение и защита практической работы; Промежуточная аттестация: зачет с оценкой (тестовый опрос)

3. Оценочные средства для проведения текущего контроля и методические материалы, определяющие процедуру их оценивания

Текущий контроль проводится в течение семестра с целью определения уровня усвоения обучающимися знаний, формирования умений и навыков, своевременного выявления преподавателем недостатков в подготовке обучающихся и принятия необходимых мер по ее корректировке, а также для совершенствования методики обучения, организации учебной работы, и фиксируется в форме контрольной точки не менее одного раза в семестр.

3.1. Вопросы к семинару

Примеры вопросов к семинару.

1. Предлагается следующий перечень рисков:
возникновения сбоев в поставках сырья;
снижения спроса на производимую продукцию;
непринятия рынком нового товара;
потери прибыли в результате снижения рыночных цен на производимую продукцию;
поражения вирусом компьютерных сетей компании;
утечки информации, представляющей коммерческую тайну;
появления на рынке нового сильного конкурента;
потери платежеспособности;
превышения спросом производственных мощностей предприятия;
поставки низкокачественных материалов поставщиком (с большой долей брака);
ухода с рынка основного промышленного потребителя
продукции предприятия;
ухода ведущих специалистов компании.
Требуется определить, к какой классификационной группе относится каждый из перечисленных видов рисков.
2. Какие новые виды рисков появились в последнее время?

Методические рекомендации по подготовке к семинару. Студент должен внимательно ознакомиться с лекционным материалом и литературой, рекомендованной для подготовки к семинару. Список литературы для подготовки к семинару приведен в вопросах к семинару и размещен – <https://moodle.tsu.ru/course/view.php?id=19870>

Критерии оценивания. Максимальная оценка за семинар 12 баллов: студент отвечает на вопросы полно и обстоятельно, приводит примеры, аргументирует свой ответ, проявляет активность. Если студент демонстрирует знание материала, но некоторые критерии полного ответа отсутствуют, оценка снижается на 1- 3 балла.

3.2 Выполнение и защита практических работ.

Примеры практических заданий.

1. Определить риск актива/портфеля путём вычисления максимального процентного отклонения актива, или его стоимости, с заданной вероятностью за определённый период времени, с использованием метода «Стоимость под риском». Входными данными являются стоимость активов организации за исторический промежуток времени. Работа проводится в программе «Excel», методические рекомендации и пример расчета приведены в методических указаниях в электронном курсе

2. Провести ранжирование рисков методом экспертных оценок; составить реестр риска для одного из видов производственной деятельности согласно номеру варианта;

Все работы приведены в электронном курсе. <https://moodle.tsu.ru/course/view.php?id=19870> Работа считается выполненной на 5 баллов (максимальная оценка), если расчеты проведены правильно, файл с расчетами прикреплен или расчеты понятны из текста отчета, если работа оформлена по правилам, если на вопросы приведены правильные ответы. В случае отсутствия некоторых критериев оценка снижается на 1-3 балла.

4. Оценочные средства для проведения промежуточной аттестации

Тестирование проводится письменно. За каждый правильный ответ начисляется 1 балл. Максимальное число баллов 20. В каждом тесте возможен 1 правильный ответ.

1. Современное понятие «риск» ...

- А. Используется для обозначения возможного материального ущерба;
- Б. Связано как с возможным материальным ущербом, так и с возможным выигрышем;
- В. отождествляется только с полученным материальным ущербом.

2. Объективная вероятность наступления рискованного события...

- А. Основана на предположении о возможности получения определенного эффекта;
- Б. Базируется на расчете частоты, с которой происходит процесс или явление.

3. Назовите основные причины, ограничивающие практическое применение статистических данных для определения вероятностей наступления событий

- А. Недостаточный объем статистических данных или их отсутствие;
- Б. Влияние субъективных особенностей исследователя;
- В. Наличие неопределенности в реальных условиях предпринимательской деятельности.

4. Как соотносятся понятие «неопределенность» и понятие «риск»?

- А. В реальной предпринимательской деятельности эти понятия являются синонимами;
- Б. Риск характеризует такую ситуацию, когда наступление некоторых событий может быть оценено количественно, а неопределенность предполагает невозможность оценки вероятности наступления таких событий;
- В. Неопределенность характеризует условия внешней среды, а риск – действия предпринимателя, поэтому эти понятия не связаны.

5. В чем состоит регулятивная функция риска?

- А. В необходимости идентификации, оценки, управления риском по всем направлениям деятельности организации;
- Б. В необходимости затрат на возмещение ущерба в случае наступления рискованного события.

6. Деловая активность предприятия, маркетинговая стратегия, политика в области управления персоналом, производственный потенциал выступают

- А. Внешними факторами риска;
- Б. Внутренними факторами риска.

7. Спекулятивные (динамические, коммерческие) риски -

- А. Всегда несут потери для предпринимательской деятельности;
- Б. Могут нести как потери, так и дополнительную прибыль;
- В. Характеризуют дополнительные возможности получения прибыли.

8. Изменение курса валют, конъюнктуры рынка, налогового законодательства выступают факторами...

- А. Чистых рисков;
- Б. Спекулятивных рисков.

9. Риск убытков, связанных с неэффективным использованием предприятием основных и оборотных средств, относится к:

- А. Коммерческому риску;
- Б. Производственному риску;
- В. Финансовому риску;
- Г. Страховому риску.

10. К рискам, связанным с покупательной способностью денег, относятся:

- А. Риски ликвидности, валютные, дефляционные, инфляционные риски;
- Б. Риск снижения доходности, риск прямых финансовых потерь, риск упущенной выгоды;
- В. Инвестиционные и финансовые риски.

11. Кредитный риск представляет собой:

- А. Опасность потерь коммерческими банками, кредитными учреждениями, инвестиционными институтами в результате превышения процентных ставок, выплачиваемых ими по привлеченным средствам, над ставками по предоставленным кредитам;
- Б. Риск неплатежа по коммерческим сделкам и риск недополучения комиссионного вознаграждения;
- В. Опасность неуплаты заемщиком основного долга и процентов.

12. Риск неправильного выбора видов вложения капитала, вида ценных бумаг для инвестирования в сравнении с другими видами ценных бумаг при формировании инвестиционного портфеля представляет собой:

- А. Селективный риск;
- Б. Биржевой риск;
- В. Деловой риск;
- Г. Кредитный риск.

13. Идентификация рисков представляет собой:

- А. Анализ существующих видов риска предпринимательской деятельности;
- Б. Оценку последствий рисков событий;
- В. Установление видов, источников рисков и знание природы их происхождения с учетом специфики деятельности организации.

26. Какая информация характеризует условие определенности при принятии рискованных решений?

- А. Статистические и финансовые показатели деятельности организации;
- Б. Информация о факторах и условиях принятия рискованного решения;
- В. Информация об экспертной оценке ситуации.

15. Абсолютные показатели оценки риска основаны на:

- А. Распределении прогнозируемых значений показателей;
- Б. Субъективных оценках величины риска;
- В. Фактических показателях финансовой документации.

16. Риск ликвидности представляет собой:

- А. Опасность потери стабильности финансового положения из-за низкой доли собственного капитала в общей сумме используемых финансовых средств;
- Б. Риск временных потерь и потерь первоначальной стоимости при превращении активов в наличные денежные средства;
- В. Риск неспособности фирмы покрывать свои финансовые обязательства своими активами.

17. Оценка риска потери платежеспособности основана на:

- А. Анализе и сопоставлении групп активов и пассивов баланса, сформированных по степени риска;
- Б. Оценке собственных и заемных средств предприятия;
- В. Оценке оборотных средств и источников их формирования.

18. Коэффициент риска, шкалы риска и системы нормативов относятся к:

- А. Абсолютным показателям риска;
- Б. Относительным показателям риска;
- В. Статистическим показателям риска.

19. Величина коэффициента риска в пределах от 0,3 до 0,6 характеризует:

- А. Минимальный уровень риска;
- Б. Допустимый уровень риска;
- В. Высокий уровень риска;
- Г. Недопустимый уровень риска.

20. Ситуация, когда информация о рисковом событии существует в виде частоты (вероятности) его появления, называется:

- А. Ситуацией определенности;
- Б. Ситуацией риска (частичной неопределенности);
- В. Ситуацией неопределенности.