

**ФГБОУ ВО Новосибирский ГАУ**  
**Кафедра финансов и статистики**

ЗК ф. 03-51

«12» мая 20 18 г.

**УТВЕРЖДЕН**

Протокол от «12» мая 20 18 г. № 10  
Заведующий кафедрой

 С.А. Шелковников  
(подпись)

**ФОНД**  
**ОЦЕНОЧНЫХ СРЕДСТВ**

**Б1.В.ДВ.5.1**  
**АНАЛИЗ РИСКА**

**38.03.01 Экономика**

Новосибирск 2017

**Паспорт  
фонда оценочных средств**

№ п/п	Контролируемые темы дисциплины	Код контролируемой компетенции (или ее части)	Наименование оценочного средства
1	Теоретические основы анализа и управления рисками	ПК-1	Тест
2	Методика анализа риска	ПК-1, ПК-11	Кейс-задание, Контрольная работа
3	Практика анализа и управления рисками	ПК-1, ПК-11	Контрольная работа

**ФГБОУ ВО Новосибирский ГАУ**  
Кафедра финансов и статистики

**Фонд тестовых заданий**

по дисциплине «Анализ риска»

Раздел. Теоретические основы анализа и управления рисками

**Вариант 1**

1. Какие субъекты могут сталкиваться с экономическим риском:
  - а) отдельный человек;
  - б) группа людей;
  - в) предприятие;
  - г) любой субъект.
2. Что понимается под риском применительно к предпринимательской деятельности:
  - а) возможность недополучения прибыли или дохода;
  - б) подверженность лица, принимающего решения, возможным потерям или убыткам в стремлении достичь более предпочтительного результата в планируемой акции;
  - в) характеристика проявления ущерба – частота возникновения или/и тяжесть (размер) ущерба.
3. Какой критерий не является элементом классификации по характеристике опасности, связанной с риском:
  - а) классификация по типу объекта;
  - б) классификация по причине (природе) ущерба;
  - в) классификация по месту появления рисков;
  - г) классификация по типичности отрицательных последствий.
4. Сознательность риска в экономической деятельности означает:
  - а) наличие рискующего, осуществляющего выбор в рискованной ситуации и несущего ответственность за последствия своего выбора;
  - б) наличие субъекта, инвестирующего заемные средства в рискованный проект;
  - в) наличие индивида, осуществляющего подготовку решения в рискованной ситуации.
5. В каждом виде финансового риска выделяют компоненты:
  - а) диверсифицируемый и недиверсифицируемый риск;
  - б) хеджируемый и нехеджируемый риск;
  - в) страхуемый и нестрахуемый риск.

**Вариант 2**

1. По уровню экономической системы, на которой функционирует экономический объект, подверженный риску, выделяют виды риска:
  - а) макро- и мезоуровневые риски;

- б) макро-, микро- и мезоуровневые риски;
- в) макро- и микроуровневые риски.
- 2. Управление риском должно осуществляться на основе
  - а) прямой связи;
  - б) обратной связи;
  - в) косвенной связи.
- 3. Какое правило не применяется в стратегии риск-менеджмента:
  - а) максимум выигрыша;
  - б) оптимальная вероятность результата;
  - в) оптимальная колеблемость результата;
  - г) отсутствие вероятности положительного результата;
  - д) оптимальное сочетание выигрыша и величины риска.
- 4. В каких случаях применяется рассеянный подход к управлению рисками организации:
  - а) функциональные и "производственные" единицы организации работают весьма независимо;
  - б) риск рассматривается в большей степени как дополнительные возможности в развитии организации;
  - в) реализуемые на практике бизнес-действия сосредоточиваются на финансах.
- 5. Что предполагает идентификация и анализ рисков:
  - а) анализ конкретных причин возникновения неблагоприятных событий и их отрицательных последствий;
  - б) проведение качественного, а затем и количественного изучения рисков;
  - в) разработку мероприятий по управлению рисками.

Критерии оценки:

- 90% и более правильных ответов – 5 баллов;
- 70% и более правильных ответов – 4 балла;
- 40% и более правильных ответов – 3 балла;
- менее 40% правильных ответов – 2 балла.

Составитель \_\_\_\_\_ Г.В. Исаева

« 12 » \_\_\_\_\_ 2018 г.



**ФГБОУ ВО Новосибирский ГАУ**  
Кафедра финансов и статистики

**Кейс-задача**

по дисциплине «Анализ риска»  
Раздел. Методика анализа риска

**Задание:**

При вложении капитала в мероприятие А из 120 случаев прибыль в 25 тыс. р. может быть получена в 48 случаях; 20 тыс. р. в 36 случаях; 30 тыс. р. в 36 случаях. При вложении капитала в мероприятие Б из 100 случаев прибыль в 40 тыс. р. может быть получена в 30 случаях; 30 тыс. р. в 50 случаях; 15 тыс. р. в 20 случаях.

Определить среднее ожидаемое значение прибыли от вложения в мероприятие А и в мероприятие Б; дисперсию по мероприятию А и по мероприятию Б; среднее квадратическое отклонение по мероприятию А и по мероприятию Б; коэффициент вариации по мероприятию А и по мероприятию Б.

Определить, в какое мероприятие выгоднее вкладывать денежные средства: в мероприятие А или в мероприятие Б? Ответ обоснуйте.

**Критерии оценки:**

- оценка «зачтено» выставляется, если студент правильно и в полном объеме решает задание;
- оценка «не зачтено» выставляется во всех других случаях, и студент обязан решить задания в соответствии с замечаниями преподавателя.

Составитель \_\_\_\_\_ И \_\_\_\_\_ Г.В. Исаева

« 12 » \_\_\_\_\_ май \_\_\_\_\_ 2018 г.

**ФГБОУ ВО Новосибирский ГАУ**  
**Кафедра финансов и статистики**

**Комплект заданий для контрольной работы**  
по дисциплине «Анализ риска»  
Раздел. Методика анализа риска  
Тема: «Методы минимизации риска»

**Вариант 1**

**Задание 1.** Какова методика выбора наиболее оптимального способа снижения риска?

**Задание 2.** Фирма заказала конденсаторы. Если будет заказано 100 штук, то по цене 200 руб. за одну штуку, а если только 50 штук, то по 250 руб. за штуку. Но фирма не уверена, сколько конденсаторов она продаст потребителю. Существуют данные, что будет продано 50% из 200 штук и 50% из 50 штук. Какую прибыль получит фирма?

**Вариант 2**

**Задание 1.** Дайте общую характеристику путям и методам снижения рисков

**Задание 2.** В таблице указаны вероятности получения прибыли для двух вариантов инвестирования. Сравните предложенные варианты и укажите наиболее рисковый.

Прибыль, млн руб.	-2	-1	0	1	2	4
Вариант 1	0,1	0,1	0,3	0,22	0,3	0,1
Вариант 2	0,1	0,12	0,1	0,2	0,2	0,2

Критерии оценки:

- 5 баллов выставляется студенту, если студент правильно и в полном объеме выполняет 2 задания;
- 4 балла - студент правильно и в полном объеме выполняет 1 задание;
- 3 балла - студент не в полном объеме выполняет 1 задание;
- 2 балла - студент не правильно выполняет задания.

Составитель \_\_\_\_\_  Г.В. Исаева

« 12 » \_\_\_\_\_ май 2017 г.

**ФГБОУ ВО Новосибирский ГАУ**  
Кафедра финансов и статистики

**Комплект заданий для контрольной работы**

по дисциплине «Анализ риска»

Раздел. Практика анализа и управления рисками

Тема: «Управление рисками на предприятиях АПК»

**Вариант 1**

**Задание 1.** В чем выражается специфика управления в условиях риска?

**Задание 2.** Инвестиционная компания разместила на рынке 4-летнюю облигацию с 12% купоном и номиналом 1500 руб. по цене номинала. Вырученные от продажи денежные средства планируется разместить в следующие виды активов:

- вексель Б, 3-голичный, номиналом 2000 руб., продается на рынке с доходностью 13%. Требуется сформировать портфель активов, иммунизированный по отношению к процентной ставке, используя дюрацию.

Рассчитайте дюрацию обязательства.

**Вариант 2**

**Задание 1.** Каким образом осуществляется принятие решения о выборе метода управления риском?

**Задание 2.** Инвестиционная компания разместила на рынке 4-летнюю облигацию с 12% купоном и номиналом 1500 руб. по цене номинала. Вырученные от продажи денежные средства планируется разместить в следующие виды активов:

- облигация А, с купоном в 15%, срок погашения 10 лет, цена на рынке совпадает с номиналом;

Рассчитайте дюрацию обязательства.

Критерии оценки:

- 5 баллов выставляется студенту, если студент правильно и в полном объеме выполняет 2 задания;
- 4 балла - студент правильно и в полном объеме выполняет 1 задание;
- 3 балла - студент не в полном объеме выполняет 1 задание;
- 2 балла - студент не правильно выполняет задания.

Составитель \_\_\_\_\_ И \_\_\_\_\_ Г.В. Исаева

« 12 » \_\_\_\_\_ мая \_\_\_\_\_ 2018 г.