



Основы риск-менеджмента.dor_БАК_24-114-Б

- 1) Первым этапом риск-менеджмента является ... рисков
- 2) Культура риск-менеджмента включает в себя ...
- 3) Принятие рисков в контексте риск-менеджмента означает ...
- 4) В качестве меры для смягчения рисков используют ...
- 5) Установите соответствие понятия и его значения:
- 6) Факторы, способствующие эффективной культуре риск-менеджмента, называются включают в себя ... и открытость в обсуждении рисков
- 7) Пример внешних рисков – ...
- 8) Для управления финансовыми рисками называются используется такой инструмент, как ...
- 9) Установите правильную хронологическую последовательность работ исследователей и практиков, которые внесли значительный вклад в развитие риск менеджмента:
- 10) В ряду мер предосторожности, применяемых для смягчения операционных рисков, можно назвать ...
- 11) Методы качественного анализа риска основаны на ... данных
- 12) Метод ... относится к методам количественной оценки риска
- 13) NPV – это показатель ...
- 14) Качественная оценка риска при помощи метода «консенсус экспертов» заключается в ...
- 15) Для определения вероятности отказов и их последствий используются методы количественной оценки риска, такие как ...
- 16) Качественный анализ риска – это ...
- 17) Метод моделирования Монте-Карло используется для ... оценки риска





- 18) Для проведения качественного анализа риска необходимо ... (укажите 2 варианта ответа)
- 19) Установите правильную последовательность этапов проведения SWIFT-анализа:
- 20) Установите соответствие методов и их характеристик:
- 21) Управленческое решение в условиях риска – это решение, ...
- 22) При принятии управленческих решений в условиях неопределенности используют ...
- 23) Уменьшение рисков при принятии управленческих решений в условиях неопределенности достигается путем ...
- 24) Связь концепции управления рисками с принятием управленческих решений заключается в ...
- 25) Установите правильную последовательность этапов расчета вероятностей по теореме Байеса:
- 26) Степень ... в контексте оценки проектов – это оценка вероятности возникновения нежелательных событий и их влияние на проект
- 27) Метод анализа ... позволяет определить, какие факторы оказывают наибольшее влияние на степень риска проекта
- 28) Установите соответствие между понятием и его характеристикой:
- 29) Критерий принятия решений, являющийся наиболее консервативным, так как учитывает только наихудший случай, называется критерием ...
- 30) Для достижения равновесной ситуации в риск-менеджменте необходимо учитывать ...
- 31) Способность компании конкурировать с другими на рынке – это ...
- 32) Основными типами конкуренции, по мнению экономистов, являются ...
- 33) Установите правильную последовательность этапов применения метода смешанных стратегий:
- 34) Установите соответствие между бизнес-юнитами и их характеристиками:
- 35) Метод принятия решений, который используется в риск-менеджменте в условиях конкуренции, – это ...





- 36 В платежной матрице содержатся такие элементы, как ...
- 37 Основное предназначение платежной матрицы в теории игр – ...
- 38 Принцип работы итерационного метода Брауна заключается в том, что ...
- 39 ... стратегии в теории игр представляют собой оптимальные стратегии, в которых игроки выбирают свои действия по определенной вероятностной схеме
- 40 Главное свойство оптимальных смешанных стратегий в теории игр: они ...
- 41 Основные функции управления рисками в организационной структуре общего менеджмента – это ...
- 42 Во внутренние ограничения системы управления рисками входят такие элементы, как ... (укажите 2 варианта ответа)
- 43 Эффективная внутренняя аудитория системы управления рисками играет роль ...
- 44 При выборе методов управления рисками учитываются такие факторы, как ... (укажите 3 варианта ответа)
- 45 Для управления финансовыми рисками используют такие методы, как ... (укажите 3 варианта ответа)
- 46 Установите соответствие между основными целями системы управления риском в организации и их описаниями
- 47 Существуют такие основные типы ключевых показателей эффективности (KPI), как ... (укажите 3 варианта ответа)
- 48 Установите правильный порядок внедрения системы риск-менеджмента в организацию:
- 49 Задачи системы управления рисками включают ... (укажите 3 варианта ответа)
- 50 Процессы внедрения и функционирования риск-менеджмента прописаны в стандарте ...
- 51 Оценка рисков в рамках риск-менеджмента представляет собой ...
- 52 Мониторинг рисков является важным элементом риск-менеджмента для ...
- 53 К операционным рискам относят ... (укажите 2 варианта ответа)



- 54) Подход в управлении рисками, предполагающий предотвращение возможных угроз путем изменения бизнес-стратегии, – это ... рисков
- 55) Установите правильную последовательность этапов риск-менеджмента:
- 56) На успешность стратегии управления рисками оказывают влияние такие факторы, как ... (укажите 2 варианта ответа)
- 57) Установите соответствие между именами основоположников риск-менеджмента и их разработками:
- 58) Соотнесите подходы в управлении рисками с их описаниями:
- 59) Установите правильную последовательность компонентов риск-менеджмента по стандартам COSO:
- 60) Риск, который связан с принятием инвестиционных решений, направленных на получение высокой доходности за счет агрессивных или спекулятивных стратегий, – это ... риск
- 61) Для качественного анализа риска применяют такие методы, как ... (укажите 3 варианта ответа)
- 62) Метод ... позволят оценить влияние неопределенности на результаты проекта, используя случайные числа
- 63) Количественная оценка риска позволяет ... (укажите 3 варианта ответа)
- 64) Основное отличие количественного анализа от качественного анализа риска заключается в том, что количественный анализ ...
- 65) Инструментом качественного анализа, используемым для оценки вероятности и воздействия рисков, является ... – таблица, в которую заносятся наиболее значимые пороговые значения вероятностей возникновения рисков и пороговые значения последствий этих рисков
- 66) В числе факторов, отрицательно влияющих на результаты количественной оценки риска, – ... (укажите 2 варианта ответа)
- 67) Установите правильную последовательность элементов схемы проведения экспертизы для численной оценки неизвестного показателя:
- 68) Установите правильную последовательность этапов проведения анализа опасностей (РНА):





- 69) Установите соответствие методов анализа целесообразности затрат в риск-менеджменте и описаний этих методов:
- 70) Установите соответствие метода и его описания:
- 71) При принятии управленческих решений в условиях неопределенности используют ...
- 72) Платежная ... – это инструмент, используемый в теории игр для представления выигрышей или потерь различных игроков в различных ситуациях
- 73) В числе задач, решаемых с помощью метода Монте-Карло, – ...
- 74) Установите правильную последовательность этапов построение GARCH-модели:
- 75) Сравнительная оценка проектов по степени риска – это процесс ... анализа различных инвестиционных или бизнес-проектов с целью определения уровня риска, связанного с их реализацией
- 76) ... денежных потоков – это показатель, позволяющий сравнивать риски различных проектов
- 77) Установите соответствие между критерием и его характеристикой:
- 78) Равновесная ситуация в контексте риск-менеджмента – это состояние, при котором ...
- 79) Установите соответствие элементов теории игр при принятии решений в условиях неопределенности и их описаний:
- 80) Установите правильную последовательность шагов расчета модельного VaR с применением метода Монте-Карло:
- 81) ... принятие решений – это принятие решений на основе долгосрочных целей
- 82) Метод Брауна – это...
- 83) Установите соответствие между бизнес-юнитами и их характеристиками:
- 84) Платежная матрица в условиях конкуренции представляет собой...
- 85) Установите правильную последовательность этапов реализации итерационного метода Брауна:





- 86) Установите правильную пошаговую последовательность действий при использовании метода разработки стратегий Ансоффа для продукта:
- 87) Основной критерий для остановки итерационного метода Брауна: остановиться, если ...
- 88) Итерационный метод Брауна может не использоваться при наличии ограничений на ...
- 89) Установите соответствие пяти основных факторов анализа Майкла Портера и их описаний:
- 90) Причина полезности применения смешанных стратегий в теории игр – в том, что они ...
- 91) Говоря о том, какое место занимает управление рисками в организационной структуре общего менеджмента, можно утверждать, что управление рисками ...
- 92) Управление рисками для общего менеджмента организации способствует ... (укажите 2 варианта ответа)
- 93) ... управления риском представляет собой процесс делегирования функций по управлению рисками специализированным внешним сторонам или фирмам-партнерам
- 94) Адекватная и своевременная отчетность в системе управления рисками включает в себя ... (укажите 2 варианта ответа)
- 95) Установите соответствие между внутренними ограничениями и их характеристиками:
- 96) ... стоимость (или NPV) – это финансовый показатель, используемый для измерения потенциальной прибыли от инвестиции или проекта
- 97) KPI (Key Performance Indicators) ...
- 98) Установите правильную последовательность шагов процесса совершенствования системы управления:
- 99) Установите правильную последовательность шагов компании для минимизации воздействия ограничений на свою систему управления рисками:
- 100) Установите соответствие нормативной документации с ее описанием:





- 101) Вы являетесь менеджером по риск-менеджменту в крупной корпорации, которая активно работает на международном уровне в сфере торговли. Вам поручено провести анализ операционных рисков для нового отдела, который будет ответственен за развитие новой продуктовой линии компании. С какими операционными рисками может столкнуться компания?
- 102) Вы являетесь специалистом по риск-менеджменту в крупной корпорации, которая активно работает на международном уровне в сфере производства. Недавно на производстве произошла авария, которая привела к остановке производства и потере прибыли. Разработайте план управления рисками, включая меры предотвращения, смягчения и передачи рисков, а также оценку потенциальных рисков.
- 103) Вы являетесь специалистом по риск-менеджменту в крупной корпорации, активно функционирующей в банковской сфере, в банке «Надежда». Недавно программное обеспечение банка дало сбой, тем самым работа всех филиалов была приостановлена на целый день. Руководство компании дало вам поручение – сформировать предложение по контролю рисков. Какие инструменты и методы риск-менеджмента могут применяться для его контроля?
- 104) Вы работаете в отделе риск-менеджмента банка. Вам поручено провести оценку риска внедрения новой банковской услуги, связанной с онлайн-платежами через мобильное приложение. Имеются следующие вводные данные ожидаемых потерь: - ожидаемые потери от сбоев – 100 000 у.е.; - кибератаки – 5 % от сбоев; - потери доверия клиентов – в 10 раз больше, чем ожидаемые потери от сбоев; - ожидаемые потери от изменений в законодательстве – 50 000 у.е.; Найдите сумму общих ожидаемых потерь.
- 105) Компания «Инновационные технологии» рассматривает проект разработки нового программного обеспечения. Управление компании хочет оценить риски и потенциальную доходность проекта, чтобы сделать правильное решение о предоставлении финансирования. При этом известно, что бета-коэффициент равен 1,2; безрисковая ставка – 5 %; ожидаемая доходность рынка – 10 %. Определите коэффициент риска, используя CAPM (Capital Asset Pricing Model).





- 106) Компания «Инновационные технологии» планирует внедрить новый проект по разработке мобильного приложения. Для оценки финансовой эффективности проекта необходимо рассчитать чистую приведенную стоимость (NPV). Общий объем инвестиций в проект составляет 500 000 руб. Ожидаемые денежные поступления от проекта за три года (годовые) будут равны: первый год – 200 000 руб.; второй год – 300 000 руб.; третий год – 400 000 руб. Стоимость капитала компании составляет 10 %. Рассчитайте чистую приведенную стоимость проекта.
- 107) Требуется рассчитать вероятность выпадения сумм с помощью метода Монте-Карло, имея вводные данные: - общее количество бросков – 1 000; - сумма 2 выпала 24 раз; - сумма 6 выпала 56 раз; - сумма 12 выпала 18 раз. Рассчитайте вероятность выпадения сумм от 2 до 12. Найдите сумму вероятностей по 3 условиям.
- 108) Рассмотрим ситуацию в игре, где существует альтернатива с разными вероятностями и возможными результатами: - вероятность успеха – 0,4; - выигрыш в случае успеха – 2 000 долл.; - выигрыш в случае неудачи: – 500 долл. Рассчитайте ожидаемую монетарную ценность (EMV).
- 109) Рассмотрим ситуацию в игре, где существует альтернатива с разными вероятностями и возможными результатами: - вероятность успеха – 0,6; - выигрыш в случае успеха – 1 000 долл.; - выигрыш в случае неудачи – 0 долл. Рассчитайте ожидаемую монетарную ценность (EMV).
- 110) Дано уравнение: $f(x) = x^3 - 2x - 5$. Начальное приближение: $(x_0 = 2)$. Шаг итерации: $(h = 0.1)$. Рассчитайте приближенное значение корня уравнения $(f(x) = 0)$ с использованием итерационного метода Брауна.
- 111) На занятии зашел разговор о разных видах конкуренции. Студент Иванов утверждал, что прямая конкуренция – это конкуренция между компаниями, предлагающими аналогичные товары или услуги. Студент Петров высказал мнение, что косвенная конкуренция – это конкуренция между рыночной средой и бизнес-процессами. Студент Степанов высказал мнение, что потенциальная конкуренция – это конкуренция с компаниями, которые могут использовать страхование для покрытия определенных рисков. Кто из студентов прав?





- 112) Вы являетесь менеджером компании, которая планирует выпуск нового продукта на рынок. У вас есть два варианта разработки и выпуска продукта. Альтернатива 1: - инвестиция: 100 000 долл.; - ожидаемая прибыль: 50 000 долл. Альтернатива 2: - инвестиция: 150 000 долл.; - ожидаемая прибыль: 80 000 долл. Проведите анализ возможных альтернатив и определите, какой вариант является наилучшим с точки зрения финансовых показателей.
- 113) Вы – финансовый аналитик в крупной компании, и вашей задачей является проведение анализа денежного потока для нового проекта. Вам предоставлены данные о денежных поступлениях и платежах по проекту. Вам требуется рассчитать и проанализировать основные показатели денежного потока. Данные о денежных потоках по проекту: - Первоначальные инвестиции: 500 000 долл. - Денежные поступления от продаж: Год 1 – 200 000 долл. Год 2 – 300 000 долл. Год 3 – 400 000 долл. - Операционные затраты: Год 1 – 50 000 долл. Год 2 – 70 000 долл. Год 3 – 100 000 долл. - Налоги на прибыль – предположим, что ставка налога составляет 20 % от чистой прибыли. Используя предоставленные финансовые данные, рассчитайте: - чистый денежный поток (чистую прибыль плюс начисленные амортизационные отчисления) для каждого года; - чистый дисконтированный денежный поток (DNPV) на основе ставки дисконтирования 10 %.

