

Документ подписан простой электронной подписью	МИНОБРАЗОВАНИЯ И НАУКИ РОССИИ		
Информация о владельце:	Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение высшего образования		
ФИО: Тюлегенова Раиса Рауфовна	Челябинский государственный университет» (ФГБОУ ВО «ЧелГУ»)		
Должность: Директор	Костанайский филиал		
Дата подписания: 31.07.2023 14:11:18	Кафедра экономики		
Уникальный программный ключ:	Фонд оценочных средств по дисциплине (модулю) «Управление рисками хозяйственной деятельности		
125b8acc44c5368c45bd8abf3dc3ced4a4ed767e8486e18dc8ae8b889439a47	предприятия		
по основной профессиональной образовательной программе высшего образования – программе бакалавриата «Менеджмент организации» по направлению подготовки 38.03.02 Менеджмент			
Версия документа - 1	стр. 1 из 16	Первый экземпляр _____	КОПИЯ № _____



УТВЕРЖДАЮ

Директор Костанайского филиала  
ФГБОУ ВО «ЧелГУ»

Р.А. Тюлегенова

25.05.2023 г.

**Фонд оценочных средств  
для промежуточной аттестации**

по дисциплине (модулю)

**Управление рисками хозяйственной деятельности предприятия**

Направление подготовки (специальность)  
**38.03.02 Менеджмент**

Направленность (профиль)  
**Менеджмент организации**

Присваиваемая квалификация  
**Бакалавр**

Форма обучения  
**Очная**

Год набора 2023

Костанай 2023



МИНОБРНАУКИ РОССИИ

Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение высшего образования

«Челябинский государственный университет» (ФГБОУ ВО «ЧелГУ»)

Костанайский филиал

Кафедра экономики

Фонд оценочных средств по дисциплине (модулю) «Управление рисками хозяйственной деятельности предприятия»

по основной профессиональной образовательной программе высшего образования – программе бакалавриата «Менеджмент организации» по направлению подготовки 38.03.02 Менеджмент

Версия документа - 1

стр. 2 из 16

Первый экземпляр \_\_\_\_\_

КОПИЯ № \_\_\_\_\_

### **Фонд оценочных средств принят**

Учёным советом Костанайского филиала ФГБОУ ВО «ЧелГУ»

Протокол заседания № 10 от «25» мая 2023 г.

Председатель учёного совета  
филиала

Р.А. Тюлегенова

Секретарь учёного совета  
филиала

Н.А. Кравченко

### **Фонд оценочных средств рекомендован**

Учебно-методическим советом Костанайского филиала ФГБОУ ВО «ЧелГУ»

Протокол заседания № 10 от «18» мая 2023 г.

Председатель  
Учебно-методического совета

Н.А. Нализко

### **Фонд оценочных средств разработан и рекомендован кафедрой экономики**

Протокол заседания № 9 от «10» мая 2023 г.

Заведующий кафедрой

Г.В. Панина

Автор (составитель)  
кандидат экономических наук, доцент кафедры экономики

Кулакова С.В.,



МИНОБРНАУКИ РОССИИ

Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение высшего образования «Челябинский государственный университет» (ФГБОУ ВО «ЧелГУ»)  
Костанайский филиал  
Кафедра экономики

Фонд оценочных средств по дисциплине (модулю) «Управление рисками хозяйственной деятельности предприятия»  
по основной профессиональной образовательной программе высшего образования – программе бакалавриата «Менеджмент организации» по направлению подготовки 38.03.02 Менеджмент

Версия документа - 1

стр. 3 из 16

Первый экземпляр \_\_\_\_\_

КОПИЯ № \_\_\_\_\_

## 1. ПАСПОРТ ФОНДА ОЦЕНОЧНЫХ СРЕДСТВ

Направление подготовки: 38.03.02 «Менеджмент»  
Направленность (профиль): Менеджмент организации  
Дисциплина: Управление рисками хозяйственной деятельности предприятия  
Триместр изучения: 11  
Форма (формы) промежуточной аттестации: экзамен

Оценивание результатов учебной деятельности обучающихся при изучении дисциплины осуществляется по балльно-рейтинговой системе

## 2. ПЕРЕЧЕНЬ ФОРМИРУЕМЫХ КОМПЕТЕНЦИЙ

### 2.1. Компетенции, закреплённые за дисциплиной

Изучение дисциплины «Управление рисками хозяйственной деятельности предприятия» направлено на формирование следующих компетенций:

Коды компетенции по ФГОС	Содержание компетенций согласно ФГОС	Индикаторы достижения компетенции согласно ОПОП	Перечень планируемых результатов обучения по дисциплине	
1	2	3	4	
ПК-4	Способен оценивать риски и предлагать мероприятия для предупреждения и снижения отрицательных последствий кризисных ситуаций	ПК-4.1. Применяет знания в области управления рисками, антикризисного управления и обеспечения безопасности деятельности организации для решения задач развития бизнеса	<i>Пороговый уровень</i>	<i>Знать:</i> общую терминологию в области обеспечения безопасности деятельности организации и антикризисного управления ею, элементы и принципы построения системы управления рисками
				<i>Уметь:</i> классифицировать риски, выявлять особенности их возникновения и управления, проводить диагностику существующей в организации практики управления рисками и предотвращения кризисов
			<i>Владеть:</i> навыками мониторинга системы управления рисками, методиками актуализации карт рисков по бизнес-процессам, направлениям бизнеса	
			<i>Продвинутый уровень</i>	<i>Знать:</i> концептуально-теоретические основы антикризисного управления, методы и средства обеспечения безопасности деятельности организации
				<i>Уметь:</i> применять аналитические приемы определения целесообразности принятия решений



МИНОБРНАУКИ РОССИИ

Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение высшего образования «Челябинский государственный университет» (ФГБОУ ВО «ЧелГУ»)  
Костанайский филиал  
Кафедра экономики

Фонд оценочных средств по дисциплине (модулю) «Управление рисками хозяйственной деятельности предприятия»  
по основной профессиональной образовательной программе высшего образования – программе бакалавриата «Менеджмент организации» по направлению подготовки 38.03.02 Менеджмент

Версия документа - 1

стр. 4 из 16

Первый экземпляр \_\_\_\_\_

КОПИЯ № \_\_\_\_\_

				<p>в области управления рисками, организовывать процесс управления рисками в организации с учетом отраслевых стандартов</p> <p><i>Владеть:</i> навыками разработки методической документации по управлению рисками, выработка единой методологии построения системы управления рисками, антикризисного управления с целью обеспечения безопасности деятельности организации</p>
			<p><i>Высокий уровень</i></p>	<p><i>Знать:</i> основные инструменты анализа существующих методов контроля рисков и управления рисками и их достаточности; инструменты анализа последствий рисков</p> <p><i>Уметь:</i> осуществлять расчеты, прогнозировать, тестировать и верифицировать методики управления рисками с учетом отраслевой специфики</p> <p><i>Владеть:</i> навыками использования специализированного программного обеспечения и информационно-аналитических систем для оценки рисков и управления ими, применяет интеграцию управления в чрезвычайных и кризисных ситуациях и управления непрерывностью бизнеса в качестве составляющей процесса управления рисками</p>
		<p>ПК-4.2. Осуществляет оценку рисков, предлагает обоснованные мероприятия по предупреждению и снижению отрицательных последствий кризисных ситуаций</p>	<p><i>Пороговый уровень</i></p>	<p><i>Знать:</i> основные понятия и классификацию рисков, их место и роль в деятельности организации</p> <p><i>Уметь:</i> анализировать природу риска и четко разграничивать их в зависимости от влияния факторов внешней и внутренней среды</p> <p><i>Владеть:</i> навыками анализа и оценки внутренних и внешних рисков с учётом экономической ситуации с целью недопущения кризисных ситуаций</p>
			<p><i>Продвинутый уровень</i></p>	<p><i>Знать:</i> принципы и правила выбора методов анализа и оценки рисков с позиции их идентификации по функциональным областям</p> <p><i>Уметь:</i> выстраивать шкалу оценки вероятности наступления опасного события и давать результирующее заключение значимости риска</p>



МИНОБРНАУКИ РОССИИ

Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение высшего образования  
«Челябинский государственный университет» (ФГБОУ ВО «ЧелГУ»)  
Костанайский филиал  
Кафедра экономики

Фонд оценочных средств по дисциплине (модулю) «Управление рисками хозяйственной деятельности предприятия»  
по основной профессиональной образовательной программе высшего образования – программе бакалавриата «Менеджмент организации» по направлению подготовки 38.03.02 Менеджмент

Версия документа - 1

стр. 5 из 16

Первый экземпляр \_\_\_\_\_

КОПИЯ № \_\_\_\_\_

				<i>Владеть:</i> навыками тестирования и верифицирования методики оценки рисков с позиции их идентификации по функциональным областям
			<i>Высокий уровень</i>	<i>Знать:</i> специфику и особенности оценки риска в реальном секторе экономики <i>Уметь:</i> применять современные подходы к определению риска, осуществлять мониторинг ключевых индикаторов, предлагает разработанные мероприятия по минимизации и снижению отрицательных последствий риска и кризисных ситуаций
				<i>Владеть:</i> навыками моделирования рисков и кризисов с целью их предупреждения и снижения



МИНОБРНАУКИ РОССИИ

Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение высшего образования  
«Челябинский государственный университет» (ФГБОУ ВО «ЧелГУ»)  
Костанайский филиал  
Кафедра экономики

Фонд оценочных средств по дисциплине (модулю) «Управление рисками хозяйственной деятельности предприятия»  
по основной профессиональной образовательной программе высшего образования – программе бакалавриата «Менеджмент организации» по направлению подготовки 38.03.02 Менеджмент

Версия документа - 1

стр. 6 из 16

Первый экземпляр \_\_\_\_\_

КОПИЯ № \_\_\_\_\_

### 3. СОДЕРЖАНИЕ ОЦЕНОЧНЫХ СРЕДСТВ ПО ДИСЦИПЛИНЕ

#### 3.1 Виды оценочных средств

№ п/п	Контролируемые индикаторы достижения компетенции / планируемые результаты обучения	Контролируемые темы/ разделы	Наименование оценочного средства для текущего и рубежного * контроля	Наименование оценочного средства на промежуточной аттестации/№ задания
1	ПК-4.1	Основные понятия управления рисками в хозяйственной деятельности организации	- построение дерева рисков на основе предложенной ситуации предприятия - комплексная письменная работа	Задания теста № 1-3 Задача № 1
2	ПК-4.1	Методы определения вероятности и последствий рисков	- составление матрицы оценки вероятности и последствий - комплексная письменная работа	Задания теста № 4-6 Задача № 2
3	ПК-4.1	Стратегии решений в условиях риска	- ситуационные задания - комплексная письменная работа	Задания теста № 7-9 Задача № 3
4	ПК-4.1 ПК-4.2	Обработка рисков. Система управления рисками и отчетностью в хозяйственной деятельности организации	- устный опрос, ситуационные задания, тестирование - комплексная письменная работа	Задания теста № 10-12 Задача № 4
5	ПК-4.1 ПК-4.2	Методы теории игр	- решение задач по методике «теории игр» - комплексная письменная работа	Задания теста № 13-15 Задача № 5
6	ПК-4.1 ПК-4.2	Анализ чувствительности проекта	- предложенного проекта предприятия - комплексная письменная работа	Задания теста № 16-18 Задача № 6
7	ПК-4.1 ПК-4.2	Методы минимизации проектных рисков	- устный опрос, ситуационные задания - комплексная письменная работа	Задания теста № 19-21 Задача № 7
8	ПК-4.1 ПК-4.2	Планирование реагирования на риски, мониторинг и контроль рисков	- мониторинг проблем предприятия, тестирование - комплексная письменная работа	Задания теста № 22-24 Задача № 8



МИНОБРНАУКИ РОССИИ

Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение высшего образования  
«Челябинский государственный университет» (ФГБОУ ВО «ЧелГУ»)  
Костанайский филиал  
Кафедра экономики

Фонд оценочных средств по дисциплине (модулю) «Управление рисками хозяйственной деятельности предприятия»  
по основной профессиональной образовательной программе высшего образования – программе бакалавриата «Менеджмент организации» по направлению подготовки 38.03.02 Менеджмент

Версия документа - 1

стр. 7 из 16

Первый экземпляр \_\_\_\_\_

КОПИЯ № \_\_\_\_\_

9	ПК-4.1 ПК-4.2	Оценка экономического эффекта от управления рисками. Управление рыночными рисками	- защита групповой слайд-презентации проекта - комплексная письменная работа	Задания теста № 25-27 Задача № 9
---	------------------	---	---	-------------------------------------

### 3.2 Содержание оценочных средств

Типовой перечень тестовых вопросов для экзамена

№ п/п	Формулировка вопроса	Варианты ответов (полужирным шрифтом – верные варианты)
<b>Основные понятия управления рисками в хозяйственной деятельности организации</b>		
1	Какие потери можно отнести к потерям времени	<b>A) невыполнение сроков сдачи объекта</b> B) потери ценных бумаг C) выплата штрафа D) уменьшение выручки вследствие снижения цен на реализуемую продукцию E) уплата дополнительных налогов
2	Выберите метод оценки риска, который реализуется путем введения поправки на риск или путем учета вероятности возникновения денежных потоков?	A) построение дерева решений B) метод сценариев <b>C) учет рисков при расчете чистой приведенной стоимости</b> D) анализ чувствительности E) вероятностный метод
3	Выберите метод оценки риска, который используется в ситуациях, когда принимаемые решения сильно зависят от принятых ранее и определяют сценарии дальнейшего развития событий?	A) имитационное моделирование B) вероятностный метод C) учет рисков при расчете чистой приведенной стоимости <b>D) построение дерева решений</b> E) анализ чувствительности
<b>Методы определения вероятности и последствий рисков</b>		
4	Выберите метод оценки риска, который представляет собой серию численных экспериментов, призванных получить эмпирические оценки степени влияния различных факторов на некоторые зависящие от них результаты?	A) учет рисков при расчете чистой приведенной стоимости B) анализ чувствительности C) построение дерева решений D) метод сценариев <b>E) имитационное моделирование</b>
5	Прогнозирование внешней обстановки относится к:	<b>A) методы компенсации рисков</b> B) методы уклонения от рисков C) методы локализации рисков D) методы диверсификации рисков E) методы обработки рисков
6	Распределение риска по этапам работы относится к:	A) методы компенсации рисков B) методы уклонения от рисков C) методы локализации рисков <b>D) методы диверсификации рисков</b> E) методы обработки рисков
<b>Стратегии решения в условиях рынка</b>		
7	Один из типов стратегии:	<b>A) экологическая</b> B) финансовая C) корпоративная



МИНОБРНАУКИ РОССИИ

Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение высшего образования  
«Челябинский государственный университет» (ФГБОУ ВО «ЧелГУ»)  
Костанайский филиал  
Кафедра экономики

Фонд оценочных средств по дисциплине (модулю) «Управление рисками хозяйственной деятельности предприятия»  
по основной профессиональной образовательной программе высшего образования – программе бакалавриата «Менеджмент организации» по направлению подготовки 38.03.02 Менеджмент

Версия документа - 1

стр. 8 из 16

Первый экземпляр \_\_\_\_\_

КОПИЯ № \_\_\_\_\_

		D) экономическая E) информационная
8	Один из типов стратегии:	A) технологическая B) конкурентная <b>C) ресурсная стратегия</b> D) экономическая E) природосберегательная
9	Какой из приведенных элементов относится к внутренней среде:	<b>A) сбыт и продвижение товаров</b> B) производство C) потребление товаров D) спрос E) конкуренция
<b>Обработка рисков. Система управления рисками и отчетностью в хозяйственной деятельности организации</b>		
10	В зависимости от понимания сущности риска и концепции управления рисками выбирается один из трех вариантов стратегии управления риском:	A) Рисковый, рискованный, умеренный; <b>B) Осторожный, взвешенный, рискованный;</b> C) Умеренный, сбалансированный, взвешенный; D) Сбалансированный, осторожный, опасный; E) Взвешенный, умеренный, рискованный.
11	Такой вариант выбирают фирмы, общая стратегия которых носит агрессивный характер такой выбор предполагает высокую склонность к риску, система управления рисками ориентирована на максимизацию прибыли. Несмотря на очевидную опасность этого варианта, именно такие стратегии позволяют существенно повысить конкурентоспособность, осуществить прорыв и, в конечном счете, обеспечивают прогресс в экономическом развитии:	<b>A) Рискованный;</b> B) Осторожный; C) Умеренный; D) Сбалансированный; E) Взвешенный.
12	Данный вариант предполагает максимальное уклонение от риска, снижение возможных убытков, избежание дополнительных расходов. Этому варианту вынуждены придерживаться фирмы, находящиеся в сложном финансовом положении, общая стратегия которых ориентирована на цели выживания.	A) Рискованный; B) Осторожный; <b>C) Умеренный;</b> D) Сбалансированный; E) Взвешенный.
<b>Методы теории игр</b>		
13	Теория игр сформировалась в самостоятельный раздел:	A) в конце 19 века B) в начале 20 века <b>C) в середине 20 века</b> D) в конце 20 века E) в начале 19 века
14	Ситуации, в которых интересы сторон не совпадают, называются:	A) игровыми <b>B) противоположными</b> C) конфликтными D) неопределенными E) периферийными
15	На какие данные опирается вероятность в теории игр и может быть рассчитана с достаточно высокой точностью.	A) На аналитические данные; <b>B) На статистические данные;</b> C) На математические данные; D) На данные налоговой службы; E) На финансовые данные.
<b>Анализ чувствительности проекта</b>		





МИНОБРНАУКИ РОССИИ

Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение высшего образования «Челябинский государственный университет» (ФГБОУ ВО «ЧелГУ»)  
Костанайский филиал  
Кафедра экономики

Фонд оценочных средств по дисциплине (модулю) «Управление рисками хозяйственной деятельности предприятия»  
по основной профессиональной образовательной программе высшего образования – программе бакалавриата «Менеджмент организации» по направлению подготовки 38.03.02 Менеджмент

Версия документа - 1

стр. 9 из 16

Первый экземпляр \_\_\_\_\_

КОПИЯ № \_\_\_\_\_

16	Абсолютный анализ чувствительности позволяет:	А) Определить наиболее критические переменные, которые в наибольшей степени могут повлиять на осуществимость и эффективность проекта; В) Оценить, как изменяются результирующие показатели реализации проекта при различных значениях заданных переменных, необходимых для расчета; С) Оценить влияние на проект возможного одновременного изменения нескольких переменных через вероятность каждого сценария; <b>Д) Определить численное отклонение результирующих показателей при изменении значений исходных переменных;</b> Е) Определить наиболее существенные для проекта исходные переменные; их изменение должно контролироваться в первую очередь.
17	В качестве варьируемых исходных переменных не принимают:	А) Объем продаж; В) Цену за единицу продукции; С) Инвестиционные затраты или их составляющие; D) График строительства; <b>Е) Цену за объем проделанной работы.</b>
18	К показателям эффективности не относится:	А) Внутренняя норма доходности; В) Чистый дисконтированный доход; С) Срок окупаемости; D) Индекс доходности; <b>Е) Индекс расходности.</b>
<b>Методы минимизации проектных рисков</b>		
19	Выберите одно из основных направлений действий по снижению проектного риска:	<b>А) Избежание появления возможных рисков;</b> В) Снижение появления риска; С) Избежание последствий риска; D) Осуществление контроля за управленческими решениями в процессе проектирования решений; Е) Осуществление контроля за управленческими решениями в процессе реализации проекта.
20	Специфическими факторами проявления рисков инвестиционных проектов для промышленных предприятий не являются:	А) Ограничения природных и земельных ресурсов, а также промышленной инфраструктуры; В) Низкая мотивация персонала; С) Высокий уровень риска в сфере управления; D) Высокое влияние экологических, социальных, политических факторов риска; <b>Е) Низкий уровень риска в сфере управления.</b>
21	В современной мировой экономической литературе наиболее часто выделяются три метода управления проектными рисками:	<b>А) Диверсификация, компенсация, страхование;</b> В) Самострахование, компенсация, перестрахование С) Диверсификация, сострахование, страхование; D) Компенсация, перестрахование, сострахование риска; Е) Модернизация, компенсация, диверсификация.
<b>Планирование и реагирование на риски, мониторинг и контроль рисков</b>		
22	Команда по разработке политики безопасности обычно включает следующее число человек:	А) от 2 до 5 <b>В) от 2 до 10</b> С) от 2 до 15 D) от 2 до 20 Е) от 2 до 25



МИНОБРНАУКИ РОССИИ

Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение высшего образования «Челябинский государственный университет» (ФГБОУ ВО «ЧелГУ»)  
Костанайский филиал  
Кафедра экономики

Фонд оценочных средств по дисциплине (модулю) «Управление рисками хозяйственной деятельности предприятия»  
по основной профессиональной образовательной программе высшего образования – программе бакалавриата «Менеджмент организации» по направлению подготовки 38.03.02 Менеджмент

Версия документа - 1

стр. 10 из 16

Первый экземпляр \_\_\_\_\_

КОПИЯ № \_\_\_\_\_

23	Основные обязанности пользователя данными входит следующее их число:	A) два B) три C) четыре D) пять E) шесть
24	Перенос последствий и управления риском на третью сторону. За это подразумевается уплата страховой премии:	A) Использование риска; B) Изменение рисков; C) <b>Передача риска;</b> D) Обновление риска; E) Совместное использование риска.
<b>Оценка экономического эффекта от управления рисками. Управление рыночными рисками</b>		
25	Это риск возможных потерь в результате неблагоприятного изменения процентных ставок по активам, пассивам и внебалансовым инструментам банка.	A) <b>Ценовой риск, валютный риск, процентный риск;</b> B) Экономический и финансовый риск; C) Валютный риск, денежный риск, финансовый риск; D) Финансовый риск, инновационный риск, ценовой риск; E) Финансовый риск, управленческий риск, модернизационный риск.
26	Управление рисками следует регламентировать специальным внутренним документом — программой по управлению рисками. Данная программа не включает в себя:	A) Определение понятия «риск», принятое на предприятии; B) Классификация и подробное описание основных видов рисков, с которыми может; C) <b>Задачи управления персоналом;</b> D) Принципы управления различными видами рисков; E) Организация управления рисками.
27	Назовите три существующих стандартных формы рыночных рисков:	A) Ценовой риск, валютный риск, процентный риск; B) Рыночный риск, кредитный риск, факторный риск; C) <b>Валютный риск, денежный риск, финансовый риск;</b> D) Финансовый риск, инновационный риск, ценовой риск E) Финансовый риск, управленческий риск, модернизационный риск.

#### Типовой перечень практических задач к экзамену

1. 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: Мероприятие Б.**



МИНОБРНАУКИ РОССИИ  
Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение высшего образования  
«Челябинский государственный университет» (ФГБОУ ВО «ЧелГУ»)  
Костанайский филиал  
Кафедра экономики

Фонд оценочных средств по дисциплине (модулю) «Управление рисками хозяйственной деятельности предприятия»  
по основной профессиональной образовательной программе высшего образования – программе бакалавриата «Менеджмент организации» по направлению подготовки 38.03.02 Менеджмент

Версия документа - 1

стр. 11 из 16

Первый экземпляр \_\_\_\_\_

КОПИЯ № \_\_\_\_\_

2. По исходным данным о деятельности двух предприятий установить, какому риску подвергаются эти предприятия и у кого из них возможны большие расходы.

Показатели	Ед. изм.	Значение
1. Постоянные годовые расходы предприятия.	тыс. руб.	600
2. Переменные расходы от годового объема продаж:		
- предприятие А;	%	13
- предприятие Б.	%	24
3. Запланированный объем продаж на год.	тыс. руб.	720
4. Возможное снижение спроса на продукцию каждого предприятия.	%	15

**Ответ:** При снижении спроса на 15% оба предприятия понесут убытки: предприятие А в размере 67,56 тыс. руб., а предприятие В – 134,88 тыс. руб. То есть в случае снижения спроса на 15% предприятия подвергнутся катастрофическому риску.

3. Рассмотрим проблему закупки угля для обогрева дома. Имеются следующие данные о количестве и ценах угля, необходимого зимой для отопления дома (табл. 3.4). Вероятности зим: мягкой - 0,35; обычной - 0,5; холодной - 0,15.

Зима	Количество угля, т	Средняя цена за 1 т в ф. ст.
Мягкая	4	7
Обычная	5	7,5
Холодная	6	8

**Ответ:** Склоняемся к варианту покупки угля для обычной зимы, так как согласно таблицы ожидаемая средняя плата за уголь по сравнению с вариантом для мягкой зимы возрастает на 3,5 %, а степень риска при этом оказывается почти в 2 раза меньшей (2,856 против 5,357). Отношение среднего квадратичного отклонения к математическому ожиданию (средний риск на затрачиваемый 1 ф. ст.) для обычной зимы составляет  $= 0,0915$  против аналогичного показателя для мягкой зимы, равного  $= 0,1777$ , т.е. вновь различие почти в 2 раза.

Эти соотношения и позволяют нам рекомендовать покупку угля, ориентируясь не на мягкую, а на обычную зиму.

4. Рассматривается вопрос о приобретении одной из двух машин, А и В. Ожидается, что их эксплуатация будет приносить доход в течение 2 и 3 лет соответственно. Альтернативные издержки равны 10 %. Вычислите чистую приведенную стоимость каждой машины. Какую машину следует купить?

Машина	Потоки денежных средств (тыс. р.)			
	C0	C1	C2	C3
А	-100	110	121	—
В	-120	110	121	133

**Ответ:** Следует выбрать машину В.

5. По данной Платежной матрице игры решите задачу, выявите в каких соотношениях необходимо распределить производство шоколада.



МИНОБРНАУКИ РОССИИ

Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение высшего образования  
«Челябинский государственный университет» (ФГБОУ ВО «ЧелГУ»)  
Костанайский филиал  
Кафедра экономики

Фонд оценочных средств по дисциплине (модулю) «Управление рисками хозяйственной деятельности предприятия»  
по основной профессиональной образовательной программе высшего образования – программе бакалавриата «Менеджмент организации» по направлению подготовки 38.03.02 Менеджмент

Версия документа - 1

стр. 12 из 16

Первый экземпляр \_\_\_\_\_

КОПИЯ № \_\_\_\_\_

	B1	B2
A1	5	4
A2	3	6

**Ответ: Мы можем сказать, что компании «Сладкий мир» следует распределить производство шоколада следующим образом: 75% от общего объема производства отдать производству молочного шоколада, а 25% - производству горького шоколада. Компания «Сладкоежка» на 40% должна производить молочный шоколад и на 60% - горький.**

6. Рассчитать анализ чувствительности инвестиционного проекта соответственно исходным данным.

Компания X запланировала срок реализации инвестиционного проекта – 1 год. Требуется проанализировать критические точки объема продаж, при котором NPV проекта = 0.

Исходные данные для расчета в тыс рублей:

стоимость 1 единицу продукции (p) – 800;

затраты на 1 единицу (VC) – 540;

годовые затраты постоянные (FC) – 24 363,15;

первоначальные инвестиции (IC) – 2 500 000;

годовая амортизация (D) – 550;

финансовый множитель (FM4) – 2,106%;

коэффициент налога на прибыль – 0,24.

**Ответ: компания выходит на уровень безубыточности при снижении объема продаж не менее чем на 23,77%; крайнее безопасное значение объема продаж составляет 6098,44 шт. в год.**

7. Инвестиционный проект рассчитан на 17 лет и требует капитальных вложений в размере 250000 млн. руб. В первые шесть лет никаких поступлений не ожидается, однако в последующие 12 лет ежегодный доход составит 50000 млн. руб. Следует ли принять этот проект, если коэффициент дисконтирования равен 18%?

**Ответ: 145 242 млн. руб. Поскольку получено положительное значение чистой текущей стоимости, вывод, что данный проект реализовать целесообразно.**

8. Выполнить диагностику целесообразности мероприятий по совершенствованию организации труда по данным таблицы:

Год	Денежный поток, тыс. ден. ед.	Коэффициент вероятности	Безостановочный денежный поток, тыс. ден. ед.	Коэффициент дисконтирования	Настоящая стоимость денежного потока, тыс. ден. ед.
1	50,9	0,90		0,743	
2	50,9	0,80		0,890	
3	50,9	0,65		0,840	
4	50,9	0,55		0,792	
5	50,9	0,40		0,750	

**Ответ:**

Год	Денежный	Коэффициент	Безостановочный	Коэффициент	Настоящая
-----	----------	-------------	-----------------	-------------	-----------



МИНОБРНАУКИ РОССИИ

Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение высшего образования  
«Челябинский государственный университет» (ФГБОУ ВО «ЧелГУ»)  
Костанайский филиал  
Кафедра экономики

Фонд оценочных средств по дисциплине (модулю) «Управление рисками хозяйственной деятельности предприятия»  
по основной профессиональной образовательной программе высшего образования – программе бакалавриата «Менеджмент организации» по направлению подготовки 38.03.02 Менеджмент

Версия документа - 1

стр. 13 из 16

Первый экземпляр \_\_\_\_\_

КОПИЯ № \_\_\_\_\_

	поток, тыс. ден. ед.	вероятности	денежный поток, тыс. ден. ед. (гр.2*гр.3)	дисконтирования	стоимость денежного потока, тыс. ден. ед. (гр.4*гр.5)
1	2	3	4	5	6
1	50,9	0,90	45,8	0,743	43,2
2	50,9	0,80	40,7	0,890	36,2
3	50,9	0,65	33,1	0,840	27,8
4	50,9	0,55	28,0	0,792	22,2
5	50,9	0,40	20,4	0,750	15,3
Итого	254,5		168,0		144,7

Таким образом, осуществление мероприятий по совершенствованию организации труда является целесообразным, поскольку настоящая стоимость денежного потока больше нуля.

9. Имеются три проекта А, В, С, начальная стоимость которых и планируемые потоки доходов по годам приведены в таблице:

Проект	С0	С1	С2	С3
А	120	60	40	80
В	130	70	40	70
С	140	80	30	60

Пусть приемлемый срок реализации каждого проекта составляет 2,5 года, а ставка дисконта оценивается в 15% годовых. Выберите проект, пользуясь правилом срока окупаемости. Обоснуйте свой выбор.

**Ответ: по проекту А: 2,67 года;**

**по проекту В: 2,84 года;**

**по проекту С: 3,19 года.**

Пользуясь правилом срока окупаемости, из нескольких взаимоисключающих проектов выбирают проект с минимальным сроком окупаемости, т.е. проект А. Тем не менее, и данный проект не удовлетворит инвестора, поскольку приемлемый срок реализации каждого проекта составляет 2,5 года.

#### 4. ПОРЯДОК ПРОВЕДЕНИЯ И КРИТЕРИИ ОЦЕНИВАНИЯ ПРОМЕЖУТОЧНОЙ АТТЕСТАЦИИ


##### 4.1 Порядок проведения промежуточной аттестации

Экзамен проводится в 2 этапа. На первом этапе студент решает тестовые вопросы закрытого типа. Продолжительность – 40 минут.

На втором этапе студент решает задачи. Продолжительность – 50 минут.

##### 4.2 Критерии оценивания промежуточной аттестации по видам оценочных средств

###### 4.2.1. Критерии оценивания теста

	МИНОБРНАУКИ РОССИИ Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение высшего образования «Челябинский государственный университет» (ФГБОУ ВО «ЧелГУ») Костанайский филиал Кафедра экономики		
	Фонд оценочных средств по дисциплине (модулю) «Управление рисками хозяйственной деятельности предприятия» по основной профессиональной образовательной программе высшего образования – программе бакалавриата «Менеджмент организации» по направлению подготовки 38.03.02 Менеджмент		
Версия документа - 1	стр. 14 из 16	Первый экземпляр _____	КОПИЯ № _____

Максимальный балл за тест - 20 баллов. Каждый правильный ответ оценивается в 1 балл.

Оценка	Отлично/ зачтено	Хорошо/ зачтено	Удовлетворительно/ зачтено	Неудовлетворительно/ незачтено
Баллы	18-20 баллов	15-17 баллов	16-10 баллов	9-0 баллов
Уровень освоения проверяемых компетенций	высокий	продвинутый	пороговый	недостаточный

#### 4.2.2. Критерии оценивания практических задач


Максимальный балл - 20 баллов.

Отлично/ зачтено/ 18-20 баллов	Хорошо/ зачтено/ 15-17 баллов	Удовлетворительно/ зачтено/ 16-10 баллов	Неудовлетворительно/ незачтено/ 9-0 баллов
Высокий уровень освоения проверяемых компетенций	Средний уровень освоения проверяемых компетенций	Базовый уровень освоения проверяемых компетенций	Недостаточный уровень освоения проверяемых компетенций
Составлен правильный алгоритм решения задач, в логическом рассуждении, в выборе формул и решении нет ошибок, получен верный ответ, задачи решены рациональным способом.	Составлен правильный алгоритм решения задач, в логическом рассуждении и решении нет существенных ошибок; правильно сделан выбор формул для решения; есть объяснение решения, но задача решена нерациональным способом или допущено не более двух несущественных ошибок, получен верный ответ.	Задание понято правильно, в логическом рассуждении нет существенных ошибок, но допущены существенные ошибки в выборе формул или в математических расчетах; задачи решены не полностью или в общем виде.	Задачи решены неправильно. Задачи не решены

#### 4.1. Результаты промежуточной аттестации и уровни сформированности компетенций

При подведении итогов учитываются результаты текущего и рубежного контролей, полученные баллы суммируются с баллами за каждый этап при прохождении промежуточной аттестации.

- менее 50% занятий – 0 баллов;
- 50 – 74% занятий – 15 баллов;

	МИНОБРНАУКИ РОССИИ Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение высшего образования «Челябинский государственный университет» (ФГБОУ ВО «ЧелГУ»)		
	Костанайский филиал Кафедра экономики		
Фонд оценочных средств по дисциплине (модулю) «Управление рисками хозяйственной деятельности предприятия» по основной профессиональной образовательной программе высшего образования – программе бакалавриата «Менеджмент организации» по направлению подготовки 38.03.02 Менеджмент			
Версия документа - 1	стр. 15 из 16	Первый экземпляр _____	КОПИЯ № _____

- 75 – 89% занятий – 18 баллов;

- 90 – 100% занятий – 20 баллов

Критерии выведения итоговой оценки за компоненты компетенций при проведении промежуточной аттестации в виде экзамена:

оценки «отлично» (А, А-; 4.0 – 3.67; 90 – 100%) или «зачтено» заслуживает студент, обнаруживший всестороннее, систематическое и глубокое знание программного материала, умение свободно выполнять задания, предусмотренные программой, усвоивший основную и знакомый с дополнительной литературой, рекомендованной программой. Оценка «отлично» выставляется студентам, усвоившим взаимосвязь основных понятий дисциплины в их значении для будущей профессиональной деятельности, проявившим творческие способности в понимании, изложении и использовании учебного материала;

оценки «хорошо» (В+, В, В-; 3.33 – 2.67; 75 – 89%) или «зачтено» заслуживает студент, обнаруживший полное знание программного материала, успешно выполняющий предусмотренные в программе задания, усвоивший основную литературу, рекомендованную в программе. Оценка «хорошо» выставляется студентам, показавшим систематический характер знаний по дисциплине и способным к их самостоятельному пополнению и обновлению в ходе дальнейшей учебной работы и профессиональной деятельности;

оценки «удовлетворительно» (С+, С, С-, D+, D; 2.33 – 1.0; 50 – 74%) или «зачтено» заслуживает студент, обнаруживший знание основного программного материала в объеме, необходимом для дальнейшей учёбы и предстоящей профессиональной деятельности, справляющийся с выполнением заданий, предусмотренных программой, знакомый с основной литературой, рекомендованной программой. «Удовлетворительно» выставляется студентам, допустившим погрешности не принципиального характера в ответе на экзамене и при выполнении экзаменационных заданий;

«неудовлетворительно» (F; 0; 0 – 49%) или «не зачтено» выставляется студенту, обнаружившему пробелы в знаниях основного программного материала, допустившему принципиальные ошибки в выполнении предусмотренных программой заданий. Как правило, оценка «неудовлетворительно» ставится студентам, которые не могут продолжить обучение или приступить к профессиональной деятельности по окончании вуза без дополнительных занятий по соответствующей дисциплине.

Уровни сформированности компетенций определяется следующим образом:

Высокий уровень сформированности компетенций соответствует оценке «отлично»:

- знает основные инструменты анализа существующих методов контроля рисков и управления рисками и их достаточности; инструменты анализа последствий рисков, специфику и особенности оценки риска в реальном секторе экономики; умеет применять современные подходы к определению риска, осуществлять мониторинг ключевых индикаторов, предлагает разработанные мероприятия по минимизации и снижению отрицательных последствий риска и кризисных ситуаций, осуществлять расчеты, прогнозировать, тестировать и верифицировать методики управления рисками с учетом отраслевой специфики; владеет навыками использования специализированного программного обеспечения и информационно-аналитических систем для оценки рисков и управления ими, применяет интеграцию управления в чрезвычайных и кризисных ситуациях и управления непрерывностью бизнеса в качестве составляющей процесса управления



МИНОБРНАУКИ РОССИИ

Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение высшего образования  
«Челябинский государственный университет» (ФГБОУ ВО «ЧелГУ»)  
Костанайский филиал  
Кафедра экономики

Фонд оценочных средств по дисциплине (модулю) «Управление рисками хозяйственной деятельности предприятия»  
по основной профессиональной образовательной программе высшего образования – программе бакалавриата «Менеджмент организации» по направлению подготовки 38.03.02 Менеджмент

Версия документа - 1

стр. 16 из 16

Первый экземпляр \_\_\_\_\_

КОПИЯ № \_\_\_\_\_

рисками.

Продвинутый уровень соответствует оценке «хорошо», предполагает формирование компетенций на более высоком уровне: формируется комплексное знание концептуально-теоретических основ антикризисного управления, методов и средств обеспечения безопасности деятельности организации; умение применять аналитические приемы определения целесообразности принятия решений в области управления рисками, организовывать процесс управления рисками в организации с учетом отраслевых стандартов; владение навыками разработки методической документации по управлению рисками, выработка единой методологии построения системы управления рисками, антикризисного управления с целью обеспечения безопасности деятельности организации;

- обучающийся знает принципы и правила выбора методов анализа и оценки рисков с позиции их идентификации по функциональным областям; умеет выстраивать шкалу оценки вероятности наступления опасного события и давать результирующее заключение значимости риска, владеет навыками тестирования и верифицирования методики оценки рисков с позиции их идентификации по функциональным областям.

Пороговый уровень соответствует оценке «удовлетворительно», предполагает формирование компетенций на начальном уровне: знание основных понятий и классификацию рисков, их место и роль в деятельности организации; умение анализировать природу риска и четко разграничивать их в зависимости от влияния факторов внешней и внутренней среды; владение навыками анализа и оценки внутренних и внешних рисков с учётом экономической ситуации с целью недопущения кризисных ситуаций.

- обучающийся владеет частично теоретическими основами дисциплины и научной терминологией, фрагментарно способен иллюстрировать ответ примерами, допускает несколько существенных ошибок в ответе.

Недостаточный уровень:

Обучающийся не знает основных положений вопроса, не ориентируется в основных понятиях, излагает материал с трудом, с грубыми фактическими и языковыми ошибками, либо отказывается от ответов на вопросы. Недостаточный уровень освоения проверяемых компетенций; знание особенностей ценообразования в масштабах различных отраслей народного хозяйства.