

| | | | |
|--|--|------------------------|--------------|
| Документ подписан простой электронной подписью | МИНОБРАЗОВАНИЯ И НАУКИ РОССИИ | | |
| Информация о владельце: | Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение высшего образования | | |
| ФИО: Нализко Наталья Александровна | «Челябинский государственный университет» (ФГБОУ ВО «ЧелГУ») | | |
| Должность: Директор | Костанайский филиал | | |
| Дата подписания: 12.09.2024 12:05:17 | Кафедра экономики | | |
| Уникальный программный ключ: 25467908655c9e0abdc452e51caba97c16e41c1d | Фонд оценочных средств по дисциплине (модулю) «Управление рисками хозяйственной деятельности» в 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 № ____ |

УТВЕРЖДЕН
Решением ученого совета филиала
Председатель ученого совета
_____ 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, 2024

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

ГВ. Панина

Автор (составитель)
Старший преподаватель кафедры экономики

Селенёва Т.О.

| | | | |
|---|--------------|------------------------|--------------|
| 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> | <p><i>Знать:</i> общую терминологию в области обеспечения безопасности деятельности организации и антикризисного управления ею, элементы и принципы построения системы управления рисками</p> <p><i>Уметь:</i> классифицировать риски, выявлять особенности их возникновения и управления, проводить диагностику существующей в организации практики управления рисками и предотвращения кризисов</p> <p><i>Владеть:</i> навыками мониторинга системы управления рисками, методиками актуализации карт рисков по бизнес-процессам, направлениям бизнеса</p> |
| | | | <i>Продвинутый уровень</i> | <p><i>Знать:</i> концептуально-теоретические основы антикризисного управления, методы и средства обеспечения безопасности деятельности организации</p> <p><i>Уметь:</i> применять аналитические приемы определения целесообразности принятия решений</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. 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> |
| | | ПК-4.2. Осуществляет оценку рисков, предлагает обоснованные мероприятия по предупреждению и снижению отрицательных последствий кризисных ситуаций | <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> |

| | | |
|--|--|--|
| | | |
|--|--|--|

Уметь: выстраивать шкалу оценки вероятности наступления опасного события и давать результирующее заключение значимости риска

| | | | |
|---|--------------|------------------------|--------------|
| 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 № 2224 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 № 2527 Задача № 9 |
|---|------------------|---|---|------------------------------------|

* Рубежный контроль предусмотрен у студентов очной формы обучения

3.2. Содержание оценочных средств

Типовой перечень тестовых вопросов для экзамена

| № п/п | Формулировка вопроса | Варианты ответов (полужирным шрифтом - верные варианты) |
|---|---|--|
| Основные понятия управления рисками в хозяйственной деятельности организации | | |
| 1 | Какие потери можно отнести к потерям времени | A) невыполнение сроков сдачи объекта 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 C) учет рисков при расчете чистой приведенной стоимости 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 D) построение дерева решений E) анализ чувствительности |
| Методы определения вероятности и последствий рисков | | |
| 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 E) имитационное моделирование |
| 5 | Прогнозирование внешней обстановки относится к: | A) методы компенсации рисков 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 D) методы диверсификации рисков E) методы обработки рисков |

Стратегии решения в условиях рынка

| | | |
|---|--------------------------|-----------------------------------|
| 7 | Один из типов стратегии: | А) экологическая В) финансовая |
|---|--------------------------|-----------------------------------|

| | | | |
|---|--------------|------------------------|--------------|
| 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 № ____ |

| | | |
|--|--|--|
| | | С) корпоративная D) экономическая E) информационная |
| 8 | Один из типов стратегии: | A) технологическая B) конкурентная C) ресурсная стратегия D) экономическая E) природосберегательная |
| 9 | Какой из приведенных элементов относится к внутренней среде: | A) сбыт и продвижение товаров B) производство C) потребление товаров D) спрос E) конкуренция |
| O) обработка рисков. Система управления рисками и отчетностью в хозяйственной деятельности организации | | |
| 10 | В зависимости от понимания сущности риска и концепции управления рисками выбирается один из трех вариантов стратегии управления риском: | A) Рисковый, рискованный, умеренный; B) Осторожный, взвешенный рискованный; C) Умеренный сбалансированный, взвешенный; D) Сбалансированный осторожный, опасный; E) Взвешенный, умеренный, рисковый. |
| 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: | A) Рискованный; 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; C) Умеренный; D) Сбалансированный; E) Взвешенный. |
| Методы теории игр | | |
| 13 | Теория игр сформировалась в самостоятельный раздел: | A) в конце 19 века B) в начале 20 века C) в середине 20 века D) в конце 20 века E) в начале 19 века |
| 14 | Ситуации, в которых интересы сторон не совпадают, называются: | A) игровыми B) противоположными C) конфликтными D) неопределенными E) периферийными |

| | | |
|----|---|--|
| 15 | На какие данные опирается вероятность в теории игр и может быть рассчитана с достаточной высокой точностью. | A) На аналитические данные; B) На статистические данные; C) На математические данные; D) На данные налоговой службы; E) На финансовые данные. |
|----|---|--|

| | | | |
|---|--------------|------------------------|--------------|
| 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 № ____ |

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

| | | |
|----|--|--|
| 22 | Команда по разработке политики безопасности обычно включает следующее число человек: | A) от 2 до 5 B) от 2 до 10 C) от 2 до 15 D) от 2 до 20 |
|----|--|--|

| | | | |
|---|---------------|------------------------|--------------|
| 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 № ____ |

| | | |
|---|--|--|
| | | Е) от 2 до 25 |
| 23 | Основные обязанности пользователя данными входит следующее их число: | А) два В) три С) четыре D) пять E) шесть |
| 24 | Перенос последствий и управления риском на третью сторону. За это подразумевается уплата страховой премии: | А) Использование риска; В) Изменение рисков; С) Передача риска; D) Обновление риска; E) Совместное использование риска. |
| Оценка экономического эффекта от управления рисками. Управление рыночными рисками | | |
| 25 | Это риск возможных потерь в результате неблагоприятного изменения процентных ставок по активам, пассивам и внебалансовым инструментам банка. | А) Ценовой риск, валютный риск, процентный риск; В) Экономический и финансовый риск; С) 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: | А) Определение понятия «риск», принятое на предприятии; В) Классификация и подробное описание основных видов рисков, с которыми может; С) Задачи управления персоналом; D) Принципы управления различными видами рисков; E) Организация управления рисками. |
| 27 | Назовите три существующих стандартных формы рыночных рисков: | А) Ценовой риск, валютный риск, процентный риск; В) Рыночный риск, кредитный риск, факторный риск; С) Валютный риск, денежный риск, финансовый риск; 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 |
|---|-----------|----------|
| Постоянные годовые расходы предприятия. | тыс. руб. | 600 |
| 2. Переменные расходы от годового объема продаж: - предприятие А; - предприятие Б. | % % | 13 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.

10. ПОРЯДОК ПРОВЕДЕНИЯ И КРИТЕРИИ ОЦЕНИВАНИЯ ПРОМЕЖУТОЧНОЙ АТТЕСТАЦИИ

10.1 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.

10.2 Критерии оценивания промежуточной аттестации по видам оценочных средств

10.2.1. 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 | недо статочный |

10.2.2. 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 |

| | | | |
|---|---------------|------------------------|--------------|
| 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 № ____ |

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;

- 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%) 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%) 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%) заслуживает студент, обнаруживший знание основного программного материала в объёме, 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 непринципиального характера в ответе на экзамене и при выполнении экзаменационных заданий;

«неудовлетворительно» (F; 0; 0 - 49%) 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

| | | | |
|---|---------------|------------------------|--------------|
| 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 № ____ |

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 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.