

Документ подписан простой электронной подписью	МИНОВ НАУКИ РОССИИ		
Информация о владельце:	Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение высшего образования «Челябинский государственный университет» (ФГБОУ ВО «ЧелГУ») Костанайский филиал		
ФИО: Наливо Наталья Александровна	Кафедра экономики		
Должность: Директор			
Дата подписания: 12.09.2024 16:42:08	Фонд оценочных средств по дисциплине (модулю) «Управление логистическими рисками» по основной профессиональной образовательной программе высшего образования - программе бакалавриата «Логистика» по направлению подготовки 38.03.02 Менеджмент		
Уникальный программный ключ: 25467908655d9e0abd452e51caba97c16aa1bca			
Версия документа - 1	стр. 1 из 17	Экземпляр _____	КОПИЯ № _____

УТВЕРЖДЕН

Решением ученого совета филиала

Председатель ученого совета

_____ Р.А. Тюлегенова

25.05.2023 г.

**Фонд оценочных средств
для рубежного контроля**

по дисциплине (модулю)

Управление логистическими рисками

Направление подготовки (специальность)

38.03.02 Менеджмент

Направленность (профиль)

Логистика

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 логистическими рисками» по основной профессиональной образовательной программе высшего образования - программе бакалавриата «Логистика» по направлению подготовки 38.03.02 Менеджмент			
Версия документа - 1	стр. 2 из 17	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)
кафедры экономики, кандидат экономических наук

Фадеев А.А., доцент

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 логистическими рисками» по основной профессиональной образовательной программе высшего образования - программе бакалавриата «Логистика» по направлению подготовки 38.03.02 Менеджмент			
Версия документа - 1	стр. 3 из 17	Экземпляр _____	КОПИЯ № _____

1. ПАСПОРТ ФОНДА ОЦЕНОЧНЫХ СРЕДСТВ

Направление подготовки: 38.03.02 Менеджмент
 Направленность (профиль): Логистика
 Дисциплина: Управление логистическими рисками
 Триместр изучения: 9
 Форма (формы) рубежного контроля: комплексная письменная работа
 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 логистическими рисками» направлено на формирование следующих компетенций:

Коды компетенции (по ФГОС)	Результаты освоения ОПОП Содержание компетенций согласно ФГОС	Индикаторы достижения компетенции согласно ОПОП	Перечень планируемых результатов обучения по дисциплине	
1	2	3	4	
ПК-1	Способен управлять бизнес-процессами организации с использованием современных подходов	ПК-1.1. Показывает навыки управления бизнес-процессами организации и документального оформления управленческих решений	<i>Пороговый уровень</i>	<p><i>Знать:</i> содержание и закономерности развития бизнес-процессов, принципы рациональной организации документационного обеспечения управления</p> <p><i>Уметь:</i> идентифицировать и классифицировать бизнес-процессы для управления, анализировать документооборот и документопотоки по количественным и качественным критериям</p> <p><i>Владеть:</i> методами выделения и описания бизнес-процессов, а также документального обеспечения управленческих решений</p>
			<i>Продвинутый уровень</i>	<p><i>Знать:</i> методы управления основными бизнес-процессами, виды и формы организационно-управленческой документации.</p> <p><i>Уметь:</i> анализировать бизнес-процессы и интерпретировать информацию, получаемую в результате этого анализа, составлять</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 логистическими рисками» по основной профессиональной образовательной программе высшего образования - программе бакалавриата «Логистика» по направлению подготовки 38.03.02 Менеджмент			
Версия документа - 1	стр. 4 из 17	Экземпляр _____	КОПИЯ № ____

			<p><i>Владеть:</i> методами управления бизнес-процессами; навыками выбора ключевых показателей бизнес-процессов, составления и оформления документов</p>
		<p><i>Высокий уровень</i></p>	<p><i>Знать:</i> основные принципы методик совершенствования бизнес-процессов и современные технологии документационного обеспечения управления</p> <p><i>Уметь:</i> решать задачи, связанные с совершенствованием и внедрением бизнес-процессов, использовать информационные технологии при проведении моделирования и оптимизации бизнес-процессов, оперировать знаниями, полученными при подготовке организационно-управленческой документации</p> <p><i>Владеть:</i> методами проектирования бизнес-процессов, программными средствами моделирования и анализа бизнес-процессов, методикой составления проектов основных управленческих документов</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 логистическими рисками» по основной профессиональной образовательной программе высшего образования - программе бакалавриата «Логистика» по направлению подготовки 38.03.02 Менеджмент			
Версия документа - 1	стр. 5 из 17	Экземпляр _____	КОПИЯ № ____

3. ОЦЕНОЧНЫЕ СРЕДСТВА ДЛЯ ПРОВЕДЕНИЯ РУБЕЖНОГО КОНТРОЛЯ

Рубежный контроль проводится с целью определения степени сформированности отдельных компетенций обучающихся по завершению освоения очередного раздела курса.

3.1. Виды оценочных средств

№ п/п	Код компетенции/ планируемые результаты обучения	Контролируемые темы/ разделы	Наименование оценочного средства для текущего контроля	Наименование оценочного средства для рубежного контроля
1	ОПК-2	Риск и проблемы устойчивости функционирования организации	устный опрос, презентация групповых заданий	Задания теста № 1-5 Задача № 1-3
2	ОПК-2, ПК-4	Классификация и морфологический анализ рисков	фронтальный опрос, обсуждение докладов	Задания теста № 6-10 Задача № 4-5
4	ОПК-2, ПК-7	Потери ресурсов при осуществлении предпринимательской деятельности в условиях неопределенности	фронтальный опрос, презентация групповых заданий, тестирование	Задания теста № 11-15 Задача № 6-7
5	ОПК-2, ПК-8	Система управления риском	презентация групповых заданий, решение ситуационных задач.	Задания теста № 16-20 Задача № 8-9
7	ПК-4, ПК -7	Методы управления рисками	фронтальный опрос, презентация групповых работ, решение ситуационных задач, контрольная	Задания теста № 21-25 Задача № 10
8	ОПК-2	Сравнение альтернативных решений в условиях риска	тестирование, выполнение группового задания, практическое задание.	Задания теста № 26-30 Задача № 11-12
9	ОПК-2 ПК-8	Управление рисками на основе страхования	форма контроля: устный опрос, презентация групповых заданий, тестирование.	Задания теста № 31-35 Задача № 13-14

3.2. Содержание оценочных средств

Рубежный контроль № 1

Примерный перечень тестовых заданий

№ п/п	Формулировка вопроса	Варианты ответов
Тема 1. Риск и проблемы устойчивости функционирования организации		
1	Риски, которые могут нести в себе как потери,	А) Чистыми;

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 логистическими рисками» по основной профессиональной образовательной программе высшего образования - программе бакалавриата «Логистика» по направлению подготовки 38.03.02 Менеджмент			
Версия документа - 1	стр. 6 из 17	Экземпляр _____	КОПИЯ № ____

	так и дополнительную прибыль, называются	В) Критическими; С) Спекулятивными; D) Внешними; E) Внутренними
2	Логическим продолжением работы службы риск-менеджмента должно стать формирование программы мероприятий по управлению рисками, при разработке которых должно быть учтено следующее:	A) Предполагаемые этапы развития критической ситуации; B) Себестоимость производства продукции; С) Размер возможного ущерба и его вероятность; D) Финансово - производственные планы предприятия и размеры возможных доходов; E) Финансово - производственные планы предприятия и размеры возможных расходов.
3	Для снижения степени риска применяются различные приёмы. Какой из ниже перечисленных не является наиболее распространённым приёмом?	A) Диверсификация; B) Перестрахование; C) Лимитирование; D) Самострахование; E) Страхование.
4	Существенное влияние на специфику и содержание стратегии риск-менеджмента оказывает уровень управления, на котором указанная стратегия разрабатывается и реализуется. На сегодняшний день в зависимости от уровня управления принято выделять три основных вида стратегии:	A) Портфельная, деловая и функциональная; B) Минимальная, максимальная, средняя; C) Высшая, низшая, средняя; D) Универсальная, уникальная, общая; E) Портфельная, оптимальная, универсальная.
5	Риски, которые практически всегда несут в себе потери, называются	A) Чистыми; B) Критическими; C) Спекулятивными; D) Внешними; E) Внутренними
Тема 2. Классификация и морфологический анализ рисков		
6	Анализ последствий используется для оценки вероятного воздействия, которое вызывается нежелательным событием. Анализ последствий не должен:	A) Основываться на выбранных нежелательных событиях; B) Описывать любые последствия, являющиеся результатом нежелательных событий; C) Учитывать существующие меры, направленные на смягчение последствий, наряду со всеми соответствующими условиями, оказывающими влияние на последствия; D) Устанавливать методы предотвращения данного риска; E) Рассматривать и учитывать как немедленные последствия, так и те, которые могут.
7	Для выработки плана анализа риска область применения анализа риска должна быть определена и документально установлена. Что не должно включаться в список этапов для определения области применения анализа риска?	A) Описание оснований и/или проблем, повлекших проведение анализа риска. Это предусматривает: B) Описание исследуемой системы; С) Разработка финансового механизма предприятия; D) Описание используемых предположений и ограничивающих условий при проведении анализа; E) Разработка формулировок решений, которые могут быть приняты, описание требуемых выходных данных, полученных по результатам исследований и от лиц, принимающих решения.

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 логистическими рисками» по основной профессиональной образовательной программе высшего образования - программе бакалавриата «Логистика» по направлению подготовки 38.03.02 Менеджмент			
Версия документа - 1	стр. 7 из 17	Экземпляр _____	КОПИЯ № ____

8	Независимо от своей направленности конкурентная стратегия всегда рассматривает два основных вопроса: 1. Цель деятельности компании на рынке. 2. Тип конкурентного преимущества, которым компания пытается заниматься. Какое количество видов конкурентной стратегии компании существует на сегодняшний день:	А) 5; Б) 3; С) 4; Д) 2; Е) 6.
9	Отметьте потери, которые можно отнести к материальным	А) Уменьшение выручки вследствие снижения цен на реализуемую продукцию Б) Невыполнение сроков сдачи объекта С) Потери рабочего времени Д) Потери материалов Е) Уплата дополнительных налогов
10	Отметьте потери, которые можно отнести к специальным потерям	А) Выплата штрафа Б) Ущерб здоровью С) Уменьшение выручки вследствие снижения цен на реализуемую продукцию Д) Потери ценных бумаг Е) Потери сырья

Примерный перечень практических заданий

Задача № 1. Производственная компания планирует выпуск новой продукции. Прогнозируемый годовой спрос составляет 600 ед. Постоянные затраты, связанные с выпуском такого объема продукции, находятся на уровне 12000 руб. в год. Планируемые переменные расходы на единицу продукта составляют 42 руб. Анализ конкурентных компаний, выпускающих аналогичную продукцию, показал, что средний уровень отпускных цен составляет 67 руб. за единицу. Необходимо определить «точку безубыточности» в натуральном и стоимостном выражении.

Ответ: 32160 руб. и 480 ед.

Задача № 2. 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.

Задача № 3. Используя данные предыдущего примера, необходимо рассчитать запас финансовой прочности данного предприятия (в стоимостном выражении и в процентах), а также воздействие производственного рычага на прибыль, если известно, что рост доходов составит 7,2%.

Ответ: 36%.

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 логистическими рисками» по основной профессиональной образовательной программе высшего образования - программе бакалавриата «Логистика» по направлению подготовки 38.03.02 Менеджмент			
Версия документа - 1	стр. 8 из 17	Экземпляр _____	КОПИЯ № ____

Задача № 4. Инвестор купил акции компании А на 600 тыс. долл., компании В на 400 тыс. долл. Стандартное отклонение доходности акции компании А в расчете на день составляет 1,4%, компании В - 1,55%. Курс 1 долл. = 28 руб. Стандартное отклонение валютного курса в расчете на один день 0,43%, коэффициент ковариации между курсом доллара и доходностью акции компании А равен 0,0903, доходность компании В - 0,05332. Ковариация доходностей акции компании А и В равна 1,736. Определить стандартное отклонение доходности портфеля в расчете на один день.

Ответ: 0,71%

Задачи № 5. Компания «Российский сыр» - небольшой производитель различных продуктов из сыра на экспорт. Один из продуктов - сырная паста - поставляется в страны ближнего зарубежья. Генеральный директор должен решить, сколько ящиков сырной пасты следует производить в течение месяца. Вероятности того, что спрос на сырную пасту в течение месяца будет 6, 7, 8 или 9 ящиков, равны соответственно 0,1; 0,3; 0,5; 0,1.

Затраты на производство одного ящика равны 45 дол. Компания продает каждый ящик по цене 95 дол. Если ящик с сырной пастой не продается в течение месяца, то она портится и компания не получает дохода. Сколько ящиков следует производить в течение месяца?

Ответ: Из представленных результатов расчетов с учетом полученных показателей рисков - средних квадратичных отклонении - очевидно, что производить 9 ящиков при любых обстоятельствах нецелесообразно, ибо средняя ожидаемая прибыль, равная 317, меньше, чем для 8 ящиков (352,5), а среднее квадратичное отклонение (76) для 9 ящиков больше аналогичного показателя для 8 ящиков (63,73). А вот целесообразно ли производство 8 ящиков по сравнению с 7 или 6 - неочевидно, так как риск при производстве 8 ящиков (63,73) больше, чем при производстве 7 ящиков (28,5) и тем более 6 ящиков. Вся информация с учетом ожидаемых прибылей и рисков налицо. Решение должен принимать генеральный директор компании «Российский сыр» с учетом его опыта, склонности к риску и степени достоверности показателей вероятностей спроса: 0,1; 0,3; 0,5; 0,1.

Рубежный контроль № 2.

Примерный перечень тестовых заданий

№ п/п	Формулировка вопроса	Варианты ответов
Тема 3. Потери ресурсов при осуществлении предпринимательской деятельности в условиях неопределенности		
11	Независимо от своей направленности конкурентная стратегия всегда рассматривает два основных вопроса: 1. Цель деятельности компании на рынке. 2. Тип конкурентного преимущества, которым компания пытается заниматься. Какое количество видов конкурентной стратегии компании существует на сегодняшний день:	A) 5; B) 3; C) 4; D) 2; E) 6.
12	В зависимости от понимания сущности риска и концепции управления рисками выбирается один из трех вариантов стратегии управления	A) Рисковый, рискованный, умеренный; B) Осторожный, взвешенный рискованный; C) Умеренный сбалансированный, взвешенный;

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 логистическими рисками» по основной профессиональной образовательной программе высшего образования - программе бакалавриата «Логистика» по направлению подготовки 38.03.02 Менеджмент			
Версия документа - 1	стр. 9 из 17	Экземпляр _____	КОПИЯ № ____

	риском:	D) Сбалансированный осторожный, опасный; E) Взвешенный, умеренный, рисковый.
13	Абсолютный анализ чувствительности позволяет:	A) Определить наиболее критические переменные, которые в наибольшей степени могут повлиять на осуществимость и эффективность проекта; B) Оценить, как изменяются результирующие показатели реализации проекта при различных значениях заданных переменных, необходимых для расчета; C) Оценить влияние на проект возможного одновременного изменения нескольких переменных через вероятность каждого сценария; D) Определить численное отклонение результирующих показателей при изменении значений исходных переменных; E) Определить наиболее существенные для проекта исходные переменные; их изменение должно контролироваться в первую очередь.
14	Предусматривает торгово-обменные операции по купле-продаже товаров такой вид предпринимательства:	A) Финансовое B) Коммерческое C) Производственное D) Денежное E) Правовое
15	Одно из ключевых, которое определяет понятие «предпринимательство»:	A) Возвращение B) Убыль C) П Прибыль D) Рентабельность E) Маржа
Тема 4. Система управления риском		
16	На какие данные опирается вероятность в теории игр и может быть рассчитана с достаточно высокой точностью.	A) На аналитические данные; B) На статистические данные; C) На математические данные; D) На данные налоговой службы; E) На финансовые данные.
17	Центральным понятием теории игр является понятие конфликта.	A) Издержек; B) Теорий; C) Конфликта; D) Игр; E) Риска
18	К показателям эффективности не относится:	A) Внутренняя норма доходности; B) Чистый дисконтированный доход; C) Срок окупаемости; D) Индекс доходности; E) Индекс расходности.
19	В основе какой из ниже предложенных операции лежит обмен финансовыми активами или обязательствами для улучшения их структуры и снижения возможных потерь:	A) Своп; B) Хеджирование; C) Спот; D) Репо; E) Страхование.
20	Как называются риски, которые обусловлены деятельностью самого предприятия и его контактной аудиторией?	A) Внешними; B) Внутренними; C) Чистыми; D) Открытыми;

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 логистическими рисками» по основной профессиональной образовательной программе высшего образования - программе бакалавриата «Логистика» по направлению подготовки 38.03.02 Менеджмент			
Версия документа - 1	стр. 10 из 17	Экземпляр _____	КОПИЯ № ____

| Е) Закрытыми;

Примерный перечень практических заданий

Задача № 6. За выполненную работу предприниматель должен получить 600 тыс. руб. Заказчик не имеет возможности рассчитаться в данный момент и предлагает отложить срок уплаты на 2 года, по истечении которых он обязуется выплатить 730 тыс. руб. Выгодно ли это предпринимателю, если приемлемая норма прибыли составляет 10%? Какова минимальная ставка, которая делает подобные условия невыгодными для предпринимателя?

Ответ: Минимальная ставка, которая делает условия невыгодными для предпринимателя, равна 10,3 % годовых.

Задача № 7. 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.

Задача № 8. АО «Фото и цвет» - небольшой производитель химических реактивов и оборудования, которые используются некоторыми фотостудиями при изготовлении 35-мм фильмов. Один из продуктов, который предлагает «Фото и цвет», - ВС-6. Президент АО продает в течение недели 11, 12 или 13 ящиков ВС-6. От продажи каждого ящика АО получает 35 дол. прибыли. Как и многие фотографические реактивы, ВС-6 имеет очень малый срок годности. Поэтому, если ящик не продан к концу недели, он должен быть уничтожен. Каждый ящик обходится предприятию в 56 дол. Вероятности продать 11, 12 и 13 ящиков в течение недели равны соответственно 0,45; 0,35; 0,2. Как вы советуете поступить? Как вы порекомендуете поступить, если бы «Фото и цвет» мог сделать ВС-6 с добавкой, значительно продлевающей срок его годности?

Ответ: наибольшая из средних ожидаемых прибылей (385 дол.) отвечает при заданных возможностях спроса производству 11 ящиков ВС-6.

Производство 11 ящиков в неделю и следует рекомендовать АО «Фото и цвет», ибо показатель риска - среднее квадратичное отклонение, как нетрудно убедиться - минимален при максимальной средней ожидаемой прибыли.

Если срок службы химического реактива будет удлинён, то его производство даже при прежнем спросе можно увеличить, частично поставляя на склад для последующей реализации.

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 логистическими рисками» по основной профессиональной образовательной программе высшего образования - программе бакалавриата «Логистика» по направлению подготовки 38.03.02 Менеджмент			
Версия документа - 1	стр. 11 из 17	Экземпляр _____	КОПИЯ № ____

Задача № 9. На вашем счёте в банке 15 млн. руб. Банковская ставка по депозитам равна 12% годовых. Вам предлагают войти всем капиталом в организацию совместного предприятия, обещая удвоение капитала через 5 лет. Принимать ли это предложение?

Ответ: Если мы войдем всем капиталом в организацию совместного предприятия, то наш капитал удвоится:

$$F = 15 \times 2 = 30 \text{ млн. руб.}$$

Следует принять данное предложение и не вкладывать деньги в банк.

Рубежный контроль № 3

Примерный перечень тестовых заданий

№ п/п	Формулировка вопроса	Варианты ответов
Тема 5. Методы управления рисками		
21	Выберите одно из основных направлений действий по снижению проектного риска:	A) Избежание появления возможных рисков; B) Снижение появления риска; C) Избежание последствий риска; D) Осуществление контроля за управленческими решениями в процессе проектирования решений; E) Осуществление контроля за управленческими решениями в процессе реализации проекта.
22	В современной мировой экономической литературе наиболее часто выделяются три метода управления проектными рисками:	A) Диверсификация, компенсация, страхование; B) Самострахование, компенсация, перестрахование C) Диверсификация, сострахование, страхование; D) Компенсация, перестрахование, сострахование риска; E) Модернизация, компенсация, диверсификация.
23	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) Задачи управления персоналом; D) Принципы управления различными видами рисков; E) Организация управления рисками.
24	Какой из перечисленных методов оценки риска основан на расчетах и анализе статистических показателей?	A) Вероятностный метод B) Построение дерева решений C) Метод сценариев D) Анализ чувствительности E) Учет рисков при расчете чистой приведенной стоимости
25	Какой из перечисленных методов оценки риска реализуется путем введения поправки на риск или путем учета вероятности возникновения денежных потоков?	A) Вероятностный метод B) Построение дерева решений C) Метод сценариев D) Анализ чувствительности E) Учет рисков при расчете чистой приведенной стоимости
Тема 6. Сравнение альтернативных решений в условиях риска		
26	Перенос последствий и управления риском на третью сторону. За это подразумевается уплата страховой премии:	A) Использование риска; B) Изменение рисков; C) Передача риска; D) Обновление 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 логистическими рисками» по основной профессиональной образовательной программе высшего образования - программе бакалавриата «Логистика» по направлению подготовки 38.03.02 Менеджмент			
Версия документа - 1	стр. 12 из 17	Экземпляр _____	КОПИЯ № ____

		Е) Совместное использование риска.
27 это - результат процесса планирования рисков	А) План управления рисками; В) Реестр рисков; С) Управление реестра рисков; D) Процесс количественного анализа рисков; E) Уклонение от риска.
28	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.
29	В максимальном использовании факторов внешней и внутренней среды объекта как системы, в приспособлении методов и параметров прогнозирования к этим факторам, заключается принцип ... организации работ по прогнозированию:	А) Адаптивности; В) Альтернативности; С) Адекватности; D) Абстрактности; E) Реальности.
30	Система заключения срочных контрактов и сделок, учитывающая вероятностные в будущем изменения обменных валютных курсов и преследующая цель - избежать неблагоприятных последствий этих изменений, представляет собой прием:	А) Приобретения контроля над деятельностью в связанных областях; В) Хеджирования; С) Страхования от валютных рисков; D) Управления денежными потоками; E) Группирования.
Тема 7. Управление рисками на основе страхования		
31	При страховании кредитного риска кредитоспособность заемщика проверяется на предмет:	А) платежеспособности; B) обеспеченности собственными средствами; C) количества заключенных договоров подряда; D) психологического климата коллектива; E) состояния и работоспособности оборудования.
32	Оплаченная стоимость погибшего или обесцененной части поврежденного имущества по страховой оценке называется:	А) страховым ущербом В) страховым тарифом С) страховой выплатой D) страховой премией (взносом, платежом) E) риторно
33	Двустороннее соглашение между страхователем и страховщиком называется:	А) страховым полюсом В) договором страхования С) страховым обеспечением D) зеленой картой E) страховым актом
34	Объектами страхования инвестиций могут быть:	А) акции, облигации, ценные бумаги, права участия; В) проводимые избирательные компании; С) прямые инвестиции в производственную деятельность; D) имущественные права, связанные с лицензированием, международным лизингом; E) содержание управленческих структур.
35	Нетто-ставка - это:	А) цена страхового риска и целиком предназначена для создания страхового фонда

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 логистическими рисками» по основной профессиональной образовательной программе высшего образования - программе бакалавриата «Логистика» по направлению подготовки 38.03.02 Менеджмент			
Версия документа - 1	стр. 13 из 17	Экземпляр _____	КОПИЯ № ____

		В) отношение числа благоприятных для события случаев к общему числу всех равновероятных случаев С) тарифная ставка, по которой заключается договор страхования D) расходы страховщика по организации и проведению страхового дела, включая отчисления в запасные фонды и прибыль E) расходы страховщика по организации и проведению страхового дела
--	--	--

Примерный перечень практических заданий

Задача № 10. Провести оценку риска двух инвестиционных проектов. Первый с вероятностью 0,7 обеспечивает прибыль 150 тыс. руб., однако с вероятностью 0,3 можно потерять 16,7 тыс. руб. Для второго проекта с вероятностью 0,6 можно получить прибыль 180 тыс. руб. и с вероятностью 0,4 потерять 20,0 тыс. руб. Какой проект выбрать?

Ответ: Второй

Задача № 11. Специфическими факторами проявления рисков инвестиционных проектов для промышленных предприятий является низкая мотивация персонала предприятия, одной из причин низкой мотивации является низкая заработная плата, для оценки мотивации необходимо рассчитать заработную плату работников предприятия. Работник-повременщик 3 разряда отработал за месяц 22 дня. Часовая тарифная ставка 1 разряда - 1,320 ден. ед., тарифный коэффициент 3 разряда - 1,2. Средняя продолжительность рабочего дня - 8 часов. За отсутствие простоев оборудования работнику выплачивается премия в размере 15% месячного тарифного заработка. Необходимо вычислить месячную заработную плату работника при повременно-премиальной системе оплаты труда.

Ответ: Определяем часовую тарифную ставку 3 разряда, для этого часовую тарифную ставку 1 разряда следует умножить на тарифный коэффициент 3 разряда: $1,320 \cdot 1,2 = 1,584$ ден. ед./час.

Определяем месячную тарифную заработную плату, исходя из часовой тарифной ставки 3 разряда и количества отработанных за месяц часов ($22 \cdot 8 = 176$): $1,584 \cdot 176 = 278,78$ ден. ед./месяц.

Премия за отсутствие простоев составляет:

$278,78 \cdot 0,15 = 41,82$ ден. ед./месяц.

Общая сумма месячной заработной платы с премией составляет:

$278,78 + 41,82 = 320,60$ ден. ед./месяц.

Задача № 12. Проанализировать внутреннюю среду предприятия и определить возможные действия по нейтрализации негативного влияния факторов, приведенных в таблице:

№	Фактор	Оценка	Вес	Направление влияния
1	Рентабельность	10	0,25	-
2	Оборудование и технология	9	0,25	-
3	Доля рынка предприятия	7	0,10	-
4	Квалификация производственного персонала	7	0,10	+
5	Рациональная организационная структура организации	6	0,10	+
5	Имидж	6	0,10	-

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 логистическими рисками» по основной профессиональной образовательной программе высшего образования - программе бакалавриата «Логистика» по направлению подготовки 38.03.02 Менеджмент			
Версия документа - 1	стр. 14 из 17	Экземпляр _____	КОПИЯ № _____

Ответ: Позитивное влияние факторов внутренней среды на деятельность предприятия с учетом их значимости составляет: $7*0,1+6*0,01=1,3$ баллов.

Негативное влияние факторов внутренней среды на деятельность предприятия с учетом их значимости составляет: $10*0,25+9*0,25+7*0,1+6*0,1+7*0,1=6,75$ баллов.

Предприятию целесообразно, прежде всего, заменить оборудование на более прогрессивное. В таком случае и при наличии квалифицированного персонала и рациональной организационной структуры у предприятия вполне может появиться возможность улучшить качество выпускаемой продукции, что, в свою очередь, улучшит имидж предприятия, будет способствовать увеличению доли рынка и в конечном итоге приведет к увеличению рентабельности.

Задача № 13. Рассчитаем лимит на сумму сделки по реализации продукции. По условиям сделки компания должна поставить продукцию покупателю через несколько месяцев после заключения договора по заранее оговоренной цене.

Капитал компании составляет 100 млн. долл. США; максимально допустимый утвержденный размер единовременных потерь компании - 20% от капитала, то есть 20 млн. долл. США. На основании исторического анализа, проведенного риск-менеджером, было определено, что максимальный размер потерь при заключении подобной сделки может составлять 50% от размера сделки.

Ответ: Лимит сделки будет равен 40 млн. долл. США (100 млн. долл. США x 20% : 50%).

Таким образом, максимальный размер потерь по сделке в случае наступления наихудшего из возможных рыночных сценариев мы определили как 50%. Другими словами, при максимально допустимом размере потерь в 20 млн. долл. США мы можем заключить сделку на сумму 40 млн. долл. США.

Задача № 14. Инвестиции в бизнес составили 500 тыс. рублей. Ожидаемые доходы (CF_i) за 5 лет составят: 2017год - 100 тыс. рублей. 2018 год - 150 тыс. рублей; 2019 год - 200 тыс. рублей. 2020 год - 250 тыс. рублей; 2021 год - 300 тыс. рублей. Ставка дисконтирования 20%.

Обосновать целесообразность проекта и рассчитать: 1. Чистый дисконтированный доход (NPV) за 5 лет; 2. Индекс рентабельности инвестиций (PI); 3. Сроки окупаемости простой и дисконтированный; 4. Внутреннюю норму доходности (IRR).

Ответ: NPV = -20896 рублей.

IRR = 23,39%.

4. ПОРЯДОК ПРОВЕДЕНИЯ И КРИТЕРИИ ОЦЕНИВАНИЯ РУБЕЖНОГО КОНТРОЛЯ

4.1. Порядок проведения рубежного контроля

Рубежный контроль проводится в 2 этапа. На первом этапе студент решает тесты. Продолжительность - 40 минут. На втором этапе студент решает практические задания: выбирает инструментальные средства для обработки экономических данных в соответствии с поставленной задачей, анализирует результаты расчетов и обосновывает полученные выводы. Продолжительность - 50 минут.

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 логистическими рисками» по основной профессиональной образовательной программе высшего образования - программе бакалавриата «Логистика» по направлению подготовки 38.03.02 Менеджмент			
Версия документа - 1	стр. 15 из 17	Экземпляр _____	КОПИЯ № ____

4.2. Критерии оценивания рубежного контроля по видам оценочных средств

4.2.1 Критерии оценивания практических заданий

Максимальный балл - 10 баллов.

Отлично/ зачтено/ 8-10 баллов	Хорошо/ зачтено/ 5-7 баллов	Удовлетворительно/зачтено/ 6-3 баллов	Неудовлетворительно/ незачтено/ 3-0 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 задачи, в логическом рассуждении, в выборе формул и решении нет ошибок, получен верный ответ, задача решена рациональным способом.	Составлен правильный алгоритм решения задачи, 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; задача решена не полностью или в общем виде.	Задача решена неправильно. Задача не решена

4.2.2 . Критерии оценивания теста

Максимальный балл за тест - 10 баллов. Каждый правильный ответ оценивается в 0,5 балла.

Оценка	Отлично/ зачтено	Хорошо/ зачтено	Удовлетворительно/ зачтено	Неудовлетворительно/ незачтено
Баллы	8-10 баллов	5-7 баллов	6-3 баллов	3-0 баллов
Уровень освоения проверяемых компетенций	высокий	продвинутый	пороговый	недостаточный

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 логистическими рисками» по основной профессиональной образовательной программе высшего образования - программе бакалавриата «Логистика» по направлению подготовки 38.03.02 Менеджмент			
Версия документа - 1	стр. 16 из 17	Экземпляр _____	КОПИЯ № ____

4.3. Результаты рубежного контроля и уровни сформированности компетенций

При подведении итогов учитываются результаты текущего контроля. Полученные за текущий контроль баллы суммируются с баллами, полученными за каждый этап при прохождении рубежного контроля.

Критерии оценивания уровня освоения дисциплинарных компетенций на рубежном контроле:

«отлично» (А, А-; 4.0 - 3.67; 90 - 100%) - студент полностью выполнил задание, показал отличные знания и умения в рамках усвоенного учебного материала, работа оформлена аккуратно и в соответствии с предъявляемыми требованиями.

«хорошо» (В+, В, В-; 3.33 - 2.67; 75 - 89%) - студент полностью выполнил задание, показал хорошие знания и умения, но не смог обосновать оптимальность предложенного решения, есть недостатки в оформлении работы.

«удовлетворительно» (С+, С, С-, D+, D; 2.33 - 1.0; 50 - 74%) - студент полностью выполнил задание, но допустил существенные неточности, не проявил умения правильно интерпретировать полученные результаты, качество оформления работы имеет недостаточный уровень.

«неудовлетворительно» (F; 0; 0 - 49%) - студент не полностью выполнил задание, при этом проявил недостаточный уровень знаний и умений, а также не способен пояснить полученный результат.

Особенности проведения процедуры оценивания результатов обучения инвалидов и лиц с ограниченными возможностями здоровья обозначены в рабочей программе дисциплины (модуля).

Уровни сформированности компетенций определяется следующим образом:

1. Высокий уровень сформированности компетенций соответствует оценке «отлично», предполагает формирование компетенций на высоком уровне, формируется знание системы структуризации логистических каналов и цепи их распределения с учетом всевозможных рисков, классификации рисков, методы анализа рисков, принципов целеполагания, видов и методов организационного планирования и основные бизнес- процессы в организации в момент разработки основных логистических направлений с учетом рисков; умение выбирать наиболее приемлемую альтернативу решения логистической проблемы по результатам комплексного анализа рисков, определять зависимость риска и уровня дохода для финансовых сделок, анализировать уровень риска в логистике, составлять бизнес-планы для различных видов деятельности организации (продукции, услуг), предусматривать трудности, которые могут помешать практическому выполнению бизнес-планов с учетом логистических маршрутов и возможных рисков, оформлять документально логистические решения с учетом оценки рисков; владение

- обучающийся в полной мере владеет теоретическими основами дисциплины и научной терминологией, грамотно излагает материал и способен иллюстрировать ответ примерами, фактами, данными научных исследований, применять теоретические знания для решения практических задач.

2. Продвинутый уровень соответствует оценке «хорошо», предполагает формирование компетенций на более высоком уровне: формируется знание логистических каналов и цепи в распределении, основных показателей финансовой устойчивости, ликвидности и

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 логистическими рисками» по основной профессиональной образовательной программе высшего образования - программе бакалавриата «Логистика» по направлению подготовки 38.03.02 Менеджмент			
Версия документа - 1	стр. 17 из 17	Экземпляр _____	КОПИЯ № ____

платежеспособности, деловой и рыночной активности, эффективности и рентабельности, взаимосвязи между функциональными стратегиями компаний с учетом рисков в логистике, формы и виды технологических, продуктовых инноваций и организационных изменений в сфере логистики и управления рисками; умение формулировать возникшую логистическую проблему, строить альтернативы решения возникшей логистической проблемы при анализе рисков, анализировать полученные данные и синтезировать верные управленческие решения финансового характера, анализировать финансовую отчетность и составлять финансовый прогноз развития организации, оценивать финансовое положение фирмы и соответствие имеющихся финансовых и материальных ресурсов возможностям достижения поставленных целей в логистике, внедрять технологические и продуктовые инновации и организационные изменения в сфере логистики с учетом всевозможных рисков; владение методами и приемами отбора вариантов решений в различных проблемных ситуациях и быть способным нести за них ответственность с позиций социальной значимости принимаемых решений, методами оценки текущих и будущих финансовых потоков полученных в результате грамотного логистического управления и минимизации рисков, основными методами, способами и средствами формулирования и реализации стратегии на уровне бизнес-единицы организации в сфере логистики, навыками разработки и оформления логистических решений в операционной деятельности при внедрении технологических изменений с учетом рисков.

- обучающийся владеет теоретическими основами дисциплины и научной терминологией, грамотно излагает материал и способен иллюстрировать ответ примерами, фактами, данными научных исследований, применять теоретические знания для решения практических задач, но допускает отдельные несущественные ошибки.

3. Пороговый уровень соответствует оценке «удовлетворительно», предполагает формирование компетенций на начальном уровне: формируются организационно-управленческие решения области распределения продукции и услуг, знать методику экономического обоснования решений финансового характера, основы стратегического, тактического и оперативного планирования, методы принятия логистических решений в операционной деятельности организации; умение использовать организационно-управленческих решений с позиций социальной значимости принимаемых решений в области распределения продукции и услуг, оценивать принимаемые финансовые решения с точки зрения их влияния на создание ценности (стоимости компании) с учетом логистических рисков, использования информации, полученной в результате исследований и сравнительного анализа, разрабатывать и внедрять логистические решения в управление операционной деятельностью предприятия; владение.

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

4. 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 в масштабах различных отраслей народного хозяйства.

