Приложение 1

ФОНД ОЦЕНОЧНЫХ СРЕДСТВ ДЛЯ ПРОВЕДЕНИЯ ПРОМЕЖУТОЧНОЙ АТТЕСТАЦИИ

Дисциплины Б1.В.ДВ.01.01 «Оценка рисков»

Направление подготовки 38.03.02 «Менеджмент»

Профиль подготовки «Производственный менеджмент»

Квалификация выпускника бакалавр

ПАСПОРТ ФОНДА ОЦЕНОЧНЫХ СРЕДСТВ

дисциплины Б1.В.ДВ.01.01 «Оценка рисков»

№ п/п	Контролируемые разделы дисциплины	Код индикатора достижения компетенций	Наименование оценочного средства и иных материалов	Кол-во
1	В целом	ПК-1.3 ПК-2.3 ПК-5.2	Описание показателей и критериев оценивания сформированности компетенций, описание шкал оценивания	4
2			Типовые контрольные задания и иные материалы, необходимые для оценки знаний, умений, навыков и опыта деятельности, характеризующих этапы формирования компетенций в процессе освоения дисциплины	2
3			Методические материалы, определяющие процедуры оценивания знаний, умений, навыков и опыта деятельности, характеризующих этапы формирования компетенций	3

1. ОПИСАНИЕ ПОКАЗАТЕЛЕЙ И КРИТЕРИЕВ ОЦЕНИВАНИЯ СФОРМИРОВАННОСТИ КОМПЕТЕНЦИЙ, ОПИСАНИЕ ШКАЛ ОЦЕНИВАНИЯ

1.1 Описание шкалы оценивания сформированности компетенций

Сформированность компетенций по дисциплине оценивается 4-балльной шкалой: «отлично», «хорошо», «удовлетворительно», «неудовлетворительно».

1.2 Описание показателей и критериев оценивания сформированности компетенций по дисциплине, обеспечивающие достижение планируемых результатов освоения образовательной программы

Код компетенции (индикатора достижения компетенции)	Результат обучения по дисциплине	Критерии и показатели оценивания результатов обучения			
		«неудовлетворительно»	«удовлетворительно»	«хорошо»	«отлично»
1	2	3	4	5	6
ПК-1 (ПК-1.3)	знать сущность риска как объекта управления, характеристику и виды рисков; источники статистической информации и методы ее сбора и обработки, необходимые при оценке риска	Фрагментарные знания сущности риска как объекта управления, характеристики и видов рисков; источников статистической информации и методов ее сбора и обработки, необходимых при оценке риска / Отсутствие знаний	Неполные знания сущности риска как объекта управления, характеристики и видов рисков; источников статистической информации и методов ее сбора и обработки, необходимых при оценке риска	Сформированные, но содержащие отдельные пробелы знания сущности риска как объекта управления, характеристики и видов рисков; источников статистической информации и методов ее сбора и обработки, необходимых при оценке риска	Сформированные и систематические знания сущности риска как объекта управления, характеристики и видов рисков; источников статистической информации и методов ее сбора и обработки, необходимых при оценке риска
	уметь выявлять факторы риска и тип риска; осуществлять поиск, подготовку исходных данных в своей профессиональной деятельности	Фрагментарное умение выявлять факторы риска и тип риска; осуществлять поиск, подготовку исходных данных в своей профессиональной деятельности / Отсутствие умений	В целом успешное, но не систематическое умение выявлять факторы риска и тип риска; осуществлять поиск, подготовку исходных данных в своей профессиональной деятельности	В целом успешное, но содержащее отдельные пробелы умение выявлять факторы риска и тип риска; осуществлять поиск, подготовку исходных данных в своей профессиональной деятельности	Успешное и систематическое умение выявлять факторы риска и тип риска; осуществлять поиск, подготовку исходных данных в своей профессиональной деятельности

	владеть навыками выявления и идентификации факторов риска и видов риска для проведения расчетов и анализа экономических показателей деятельности организации	Фрагментарное владение навыками выявления и идентификации факторов риска и видов риска для проведения расчетов и анализа экономических показателей деятельности организации / Отсутствие навыков	В целом успешное, но не систематическое владение навыками выявления и идентификации факторов риска и видов риска для проведения расчетов и анализа экономических показателей деятельности организации	В целом успешное, но сопровождающееся отдельными ошибками применение навыков выявления и идентификации факторов риска и видов риска для проведения расчетов и анализа экономических показателей деятельности организации	Успешное и систематическое применение навыков выявления и идентификации факторов риска и видов риска для проведения расчетов и анализа экономических показателей деятельности организации
ПК-2 (ПК-2.3)	знать методы анализа исходных данных, необходимых при оценке риска; основные методы и показатели оценки рисков для разработки проектов и планов деятельности организации, в том числе в условиях неопределенности и рисков	Фрагментарные знания методов анализа исходных данных, необходимых при оценке риска; основных методов и показателей оценки рисков для разработки проектов и планов деятельности организации, в том числе в условиях неопределенности и рисков / Отсутствие знаний	Неполные знания методов анализа исходных данных, необходимых при оценке риска; основных методов и показателей оценки рисков для разработки проектов и планов деятельности организации, в том числе в условиях неопределенности и рисков	Сформированные, но содержащие отдельные пробелы знания методов анализа исходных данных, необходимых при оценке риска; основных методов и показателей оценки рисков для разработки проектов и планов деятельности организации, в том числе в условиях неопределенности и рисков	Сформированные и систематические знания методов анализа исходных данных, необходимых при оценке риска; основных методов и показателей оценки рисков для разработки проектов и планов деятельности организации, в том числе в условиях неопределенности и рисков
	уметь проводить качественный и количественный анализ и оценку рисков; применять на практике систему показателей оценки риска	Фрагментарное умение проводить качественный и количественный анализ и оценку рисков; применять на практике систему показателей оценки риска / Отсутствие умений	В целом успешное, но не систематическое умение проводить качественный и количественный анализ и оценку рисков; применять на практике систему показателей оценки риска	В целом успешное, но содержащее отдельные пробелы умение проводить качественный и количественный анализ и оценку рисков; применять на практике систему показателей оценки риска	Успешное и систематическое умение проводить качественный и количественный анализ и оценку рисков; применять на практике систему показателей оценки риска
	владеть навыками подготовки возмож-	Фрагментарное владение навыками подго-	В целом успешное, но не систематическое	В целом успешное, но сопровождающееся от-	Успешное и систематическое применение

	ных вариантов решений при разработке проектов и планов деятельности организации, в том числе в условиях неопределенности и рисков	товки возможных вариантов решений при разработке проектов и планов деятельности организации, в том числе в условиях неопределенности и рисков / Отсутствие навыков	владение навыками подготовки возможных вариантов решений при разработке проектов и планов деятельности организации, в том числе в условиях неопределенности и рисков	дельными ошибками применение навыков подготовки возможных вариантов решений при разработке проектов и планов деятельности организации, в том числе в условиях неопределенности и рисков	навыков подготовки возможных вариантов решений при разработке проектов и планов деятельности организации, в том числе в условиях неопределенности и рисков
ПК-5 (ПК-5.2)	знать методы анализа основные методы и показатели оценки рисков для принятия оптимальных управленческих решений; последствия рисков и способы управления рисками	Фрагментарные знания основных методов и показателей оценки рисков для принятия оптимальных управленческих решений; последствий рисков и способов управления рисками / Отсутствие знаний	Неполные знания основных методов и показателей оценки рисков для принятия оптимальных управленческих решений; последствий рисков и способов управления рисками	Сформированные, но содержащие отдельные пробелы знания основных методов и показателей оценки рисков для принятия оптимальных управленческих решений; последствий рисков и способов управления рисками	Сформированные и систематические знания основных методов и показателей оценки рисков для принятия оптимальных управленческих решений; последствий рисков и способов управления рисками
	уметь проводить анализ и оценку рисков при различных условиях инвестирования и финансирования, оценивать их последствия	Фрагментарное умение проводить анализ и оценку рисков при различных условиях инвестирования и финансирования, оценивать их последствия / Отсутствие умений	В целом успешное, но не систематическое умение проводить анализ и оценку рисков при различных условиях инвестирования и финансирования, оценивать их последствия	В целом успешное, но содержащее отдельные пробелы умение проводить анализ и оценку рисков при различных условиях инвестирования и финансирования, оценивать их последствия	Успешное и систематическое умение проводить анализ и оценку рисков при различных условиях инвестирования и финансирования, оценивать их последствия
	владеть современными методами анализа и оценки рисков; применения инструментов риск-менеджмента при принятии управлен-	Фрагментарное владение современными методами анализа и оценки рисков; применения инструментов риск-менеджмента при принятии управленческого	В целом успешное, но не систематическое владение современными методами анализа и оценки рисков; применения инструментов риск-	В целом успешное, но сопровождающееся отдельными ошибками применение современных методов анализа и оценки рисков; инструментов риск-	Успешное и систематическое применение современных методов анализа и оценки рисков; инструментов риск-менеджмента при принятии управленче-

	ческого решения	решения / Отсутствие навыков	менеджмента при принятии управленческого решения	менеджмента при принятии управленческого решения	ского решения

1.3 Описание шкалы оценивания освоения дисциплины в форме зачета с оценкой

Освоение дисциплины оценивается в форме зачета с оценкой 4-балльной шкалой: «отлично», «хорошо», «удовлетворительно», «неудовлетворительно».

1.4 Описание показателей и критериев оценивания компетенций дисциплины в форме зачета с оценкой

Критерии оценки знаний, умений и навыков при сдаче зачета с оценкой:

Оценка	Критерии
Отлично	ответы на вопросы четкие, обоснованные и полные, проявлена готовность к дискуссии, студент демонстрирует высокий уровень владения знаниями, умениями и навыками соответствующих компетенций, что позволяет ему решать широкий круг типовых и нетиповых задач, студент проявил высокую эрудицию и свободное владение материалом дисциплины
Хорошо	ответы на вопросы преимущественно правильные, но недостаточно четкие, студент способен самостоятельно воспроизводить и применять соответствующие знания, умения и навыки для решения типовых задач дисциплины, может выполнять поиск и использование новой информации для выполнения новых профессиональных действий на основе полностью освоенных знаний, умений и навыков соответствующих компетенций
Удовлетворительно	ответы на вопросы не полные, на некоторые ответ не получен, знания, умения, навыки сформированы на базовом уровне, студенты частично, с помощью извне (например, с использованием наводящих вопросов, ассоциативного ряда понятий и т.д.) могут воспроизводить и применять соответствующие знания, умения, навыки
Неудовлетворительно	на большую часть вопросов ответы не были получены, либо они показали полную некомпетентность студента в материале дисциплины, студент не способен самостоятельно, без помощи извне, воспроизводить и применять соответствующие знания, умения, навыки или знания, умения и навыки у студента не выявлены

2 ТИПОВЫЕ КОНТРОЛЬНЫЕ ЗАДАНИЯ И ИНЫЕ МАТЕРИАЛЫ, НЕОБХОДИМЫЕ ДЛЯ ОЦЕНКИ ЗНАНИЙ, УМЕНИЙ, НАВЫКОВ И ОПЫТА ДЕЯТЕЛЬНОСТИ, ХАРАКТЕРИЗУЮЩИХ ЭТАПЫ ФОРМИРОВАНИЯ КОМПЕТЕНЦИЙ В ПРОЦЕССЕ ОСВОЕНИЯ ОБРАЗОВАТЕЛЬНОЙ ПРОГРАММЫ

2.1 Список вопросов к зачету с оценкой

№ вопроса	Вопросы	Коды индикаторов достижения компетенций
1	2	3
1	Сущность риска как объекта управления	ПК-1.3; ПК-2.3 ПК-5.2
2	Концепция приемлемого риска	ПК-1.3; ПК-2.3 ПК-5.2
3	Цель и задачи риск-менеджмента	ПК-1.3; ПК-2.3 ПК-5.2
4	Риск-менеджмент как система управления	ПК-1.3; ПК-2.3 ПК-5.2
5	Выявление факторов риска: внешние факторы риска	ПК-1.3; ПК-2.3 ПК-5.2
6	Выявление факторов риска: внутренние факторы риска	ПК-1.3; ПК-2.3 ПК-5.2
7	Идентификация факторов риска	ПК-1.3; ПК-2.3 ПК-5.2
8	Основы построения системы факторов риска	ПК-1.3; ПК-2.3 ПК-5.2
9	Классификация рисков по однозначности последствий от наступления рискового события: чистые риски	ПК-1.3; ПК-2.3 ПК-5.2
10	Классификация рисков по однозначности последствий от наступления рискового события: спекулятивные (финансовые) риски	ПК-1.3; ПК-2.3 ПК-5.2
11	Потери и зоны риска	ПК-1.3; ПК-2.3 ПК-5.2
12	Методы качественной оценки рисков	ПК-1.3; ПК-2.3 ПК-5.2
13	Методы количественной оценки риска	ПК-1.3; ПК-2.3 ПК-5.2
14	Показатель риска. Соотношение доходности и риска	ПК-1.3; ПК-2.3 ПК-5.2
15	Система показателей оценки риска	ПК-1.3; ПК-2.3 ПК-5.2
16	Абсолютные показатели оценки риска: оценка риска структуры активов по степени их ликвидности	ПК-1.3; ПК-2.3 ПК-5.2
17	Абсолютные показатели оценки риска: оценка риска потери платежеспособности	ПК-1.3; ПК-2.3 ПК-5.2
18	Абсолютные показатели оценки риска: оценка риска потери финансовой устойчивости	ПК-1.3; ПК-2.3 ПК-5.2
19	Непосредственная оценка риска на основе относительных показателей	ПК-1.3; ПК-2.3 ПК-5.2
20	Опосредованная оценка риска на основе относительных показателей: оценка риска потери платежеспособности	ПК-1.3; ПК-2.3 ПК-5.2

21	Опосредованная оценка риска на основе относительных показателей: оценка риска потери финансовой устойчивости и независимости	ПК-1.3; ПК-2.3 ПК-5.2
22	Вероятностные показатели оценки риска	ПК-1.3; ПК-2.3 ПК-5.2
23	Статистические показатели оценки риска	ПК-1.3; ПК-2.3 ПК-5.2
24	Экспертные оценки риска	ПК-1.3; ПК-2.3 ПК-5.2
25	Факторы и модели оценки риска финансовой несостоятельности	ПК-1.3; ПК-2.3 ПК-5.2
26	Модели прогнозирования риска финансовой несостоятельности	ПК-1.3; ПК-2.3 ПК-5.2
27	Сущность и классификация рисков инвестиционного проекта	ПК-1.3; ПК-2.3 ПК-5.2
28	Аналитические подходы и процедуры оценки проектного риска	ПК-1.3; ПК-2.3 ПК-5.2
29	Особенности оценки эффективности проекта в условиях риска	ПК-1.3; ПК-2.3 ПК-5.2
30	Способы снижения инвестиционного риска	ПК-1.3; ПК-2.3 ПК-5.2
31	Механизмы нейтрализации риска	ПК-1.3; ПК-2.3 ПК-5.2
32	Средства разрешения риска. Уклонение от риска	ПК-1.3; ПК-2.3 ПК-5.2
33	Средства разрешения риска. Передача риска	ПК-1.3; ПК-2.3 ПК-5.2
34	Приемы снижения степени риска: диверсификация риска	ПК-1.3; ПК-2.3 ПК-5.2
35	Приемы снижения степени риска: лимитирование риска	ПК-1.3; ПК-2.3 ПК-5.2
36	Приемы снижения степени риска: самострахование риска	ПК-1.3; ПК-2.3 ПК-5.2
37	Приемы снижения степени риска: хеджирование риска	ПК-1.3; ПК-2.3 ПК-5.2
38	Приемы снижения степени риска: страхование риска	ПК-1.3; ПК-2.3 ПК-5.2
39	Методы компенсации риска	ПК-1.3; ПК-2.3 ПК-5.2
40	Политика управления рисками	ПК-1.3; ПК-2.3 ПК-5.2

2.2. Примерные варианты практических задач

1. Предпринимателю необходимо осуществить выбор между двумя решениями, в результате которых предполагается следующее вероятностное распределение значений прибыли. Осуществить выбор решения с помощью ожидаемого значения прибыли и коэффициента вариации. Охарактеризовать степень риска по каждому из решений.

	Решение 1				Решение 2			
Прибыль, тыс. руб.	100	200	250	400	180	210	240	250
Вероятность	0,2	0,3	0,4	0,1	0,2	0,3	0,4	0,1

2. Акции компании «А» имеют среднегодовую доходность в размере 13,5% и стандартное отклонение 21,3%. Акции компании «В» имеют среднегодовую доходность в размере 11,1% и стандартное отклонение 19,1%. Используя коэффициент вариации, определите степень рискованности данных акций и какой акции инвестор должен отдать предпочтение по критерию «риск-доходность».

3. Имеются данные о ценных бумагах производственных компаний А и В.

Состояние экономики	Вероятность состояния экономики	Доходность акций, %	
		А	В
Спад	0,2	8	12
Без изменений	0,3	9	14
Незначительный подъем	0,4	12	16
Существенный подъем	0,1	18	22

Необходимо рассчитать ожидаемую и среднюю доходность акций и показатели риска. Какая ценная бумага более предпочтительна я для инвестирования и почему?

4. При вложении капитала в мероприятие А из 10 случаев была получена прибыль: 14 млн. руб. – в одном случае; 12 млн. руб. – в одном случае; 10 млн. руб. – в одном случае; 8 млн. руб. – в одном случае; 6 млн. руб. – в одном случае; 5 млн. руб. – в двух случаях; 3 млн. руб. – в трех случаях. Требуется выбрать вариант вложения капитала исходя из средней ожидаемой прибыли, с учетом ее колеблемости. Дать характеристику степени колеблемости.

3 МЕТОДИЧЕСКИЕ МАТЕРИАЛЫ, ОПРЕДЕЛЯЮЩИЕ ПРОЦЕДУРЫ ОЦЕНИВАНИЯ ЗНАНИЙ, УМЕНИЙ, НАВЫКОВ И ОПЫТА ДЕЯТЕЛЬНОСТИ, ХАРАКТЕРИЗУЮЩИХ ЭТАПЫ ФОРМИРОВАНИЯ КОМПЕТЕНЦИЙ

1. Положение о текущем контроле и промежуточной аттестации обучающихся, осваивающих образовательные программы высшего образования – программы бакалавриата, программы специалитета, программы магистратуры СМК-П-02.01-04-21 / разраб. Т.А. Лашина. – Зерноград: Азово-Черноморский инженерный институт ФГБОУ ВО Донской ГАУ, 2021. – 15 с.

2. Положение о проведении текущего контроля и промежуточной аттестации обучающихся с применением электронного обучения, дистанционных образовательных технологий в условиях усиления санитарно-эпидемиологических мероприятий. СМК-П-02.01-02-23 / разраб. Т.А. Лашина. – Зерноград: Азово-Черноморский инженерный институт ФГБОУ ВО Донской ГАУ, 2023. – 8 с.

3. Рабочая программа дисциплины Б1.В.ДВ.01.01 «Оценка рисков» по направлению подготовки 38.03.02 «Менеджмент» / разраб. И.В. Украинцева. – Зерноград: Азово-Черноморский инженерный институт ФГБОУ ВО Донской ГАУ, 2025. – 28 с.