Приложение 1

ФОНД ОЦЕНОЧНЫХ СРЕДСТВ ДЛЯ ПРОВЕДЕНИЯ ПРОМЕЖУТОЧНОЙ АТТЕСТАЦИИ

Дисциплины Б1.В.13 «Оценка рисков»

Направление подготовки 38.03.04 Государственное и муниципальное управление

Профиль подготовки «Муниципальное управление»

Квалификация выпускника бакалавр

ПАСПОРТ ФОНДА ОЦЕНОЧНЫХ СРЕДСТВ

дисциплины Б1.В.13 «Оценка рисков»

№ п/п	Контролируемые разделы дисциплины	Код индикатора достижения компетенций	Наименование оценочного средства и иных материалов	Кол-во
1	В целом	УК-1.5 ПК-4.2	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

Компетенции на различных этапах их формирования оцениваются двумя оценками: «зачтено», «не зачтено».

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	
		«не зачтено»	«зачтено»
1	2	3	4
УК-1 (УК-1.5)	знать сущность риска как объекта управления, виды рисков; основные методы и показатели оценки рисков для решения поставленных задач, в том числе в условиях неопределенности и рисков	Фрагментарные знания сущности риска как объекта управления, видов рисков; основных методов и показателей оценки рисков для решения поставленных задач, в том числе в условиях неопределенности и рисков / Отсутствие знаний	Сформированные или неполные знания сущности риска как объекта управления, видов рисков; основных методов и показателей оценки рисков для решения поставленных задач, в том числе в условиях неопределенности и рисков
	уметь выявлять факторы риска и тип риска; осуществлять поиск, критический анализ и синтез информации; проводить качественный и количественный анализ и оценку рисков; применять на практике систему показателей оценки риска	Фрагментарное умение выявлять факторы риска и тип риска; осуществлять поиск, критический анализ и синтез информации; проводить качественный и количественный анализ и оценку рисков; применять на практике систему показателей оценки риска / Отсутствие умений	В целом успешное умение выявлять факторы риска и тип риска; осуществлять поиск, критический анализ и синтез информации; проводить качественный и количественный анализ и оценку рисков; применять на практике систему показателей оценки риска

1	2	3	4
УК-1 (УК-1.5)	владеть навыками выявления и идентификации факторов риска и видов риска; разработки возможных вариантов решения поставленной задачи, в том числе в условиях неопределенности и рисков; применения инструментов риск-менеджмента при реализации управленческого решения	Фрагментарное применение навыков выявления и идентификации факторов риска и видов риска; разработки возможных вариантов решения поставленной задачи, в том числе в условиях неопределенности и рисков; применения инструментов риск-менеджмента при реализации управленческого решения / Отсутствие навыков	В целом успешное применение навыков выявления и идентификации факторов риска и видов риска; разработки возможных вариантов решения поставленной задачи, в том числе в условиях неопределенности и рисков; применения инструментов риск-менеджмента при реализации управленческого решения
ПК-4 (ПК-4.2)	знать методы и показатели определения и оценки рисков социально-экономических и инвестиционных проектов; последствия рисков и способы управления рисками	Фрагментарные знания методов и показателей определения и оценки рисков социально-экономических и инвестиционных проектов; последствий рисков и способов управления рисками / Отсутствие знаний	Сформированные или неполные знания методов и показателей определения и оценки рисков социально-экономических и инвестиционных проектов; последствий рисков и способов управления рисками
	уметь проводить оценку рисков социально-экономических и инвестиционных проектов при различных условиях инвестирования и финансирования, оценивать их последствия	Фрагментарное умение проводить оценку рисков социально-экономических и инвестиционных проектов при различных условиях инвестирования и финансирования, оценивать их последствия / Отсутствие умений	В целом успешное умение проводить оценку рисков социально-экономических и инвестиционных проектов при различных условиях инвестирования и финансирования, оценивать их последствия
	владеть современными методами оценки и управления рисками социально-экономических и инвестиционных проектов	Фрагментарное применение современных методов оценки и управления рисками социально-экономических и инвестиционных проектов / Отсутствие навыков	В целом успешное применение современных методов оценки и управления рисками социально-экономических и инвестиционных проектов

1.3 Описание шкалы оценивания освоения дисциплины в форме зачета

Знания, умения, навыки обучающегося по дисциплине оцениваются оценками: «зачтено», «не зачтено».

1.4 Описание показателей и критериев оценивания компетенций дисциплины в форме зачета

Оценка	Критерии
Зачтено	выставляется студенту, если он выполнил установленный по дисциплине объем самостоятельных работ, а при ответах на вопросы подтверждает наличие необходимых знаний, умений и навыков не ниже экзаменационного критерия, соответствующего оценке «удовлетворительно»
Не зачтено	выставляется студенту, если он не выполнил установленный по дисциплине объем самостоятельных работ или, при выполненных самостоятельных работах, его ответы на поставленные вопросы соответствуют критерию экзаменационной оценки «неудовлетворительно»

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

№ вопроса	Вопросы	Коды индикаторов достижения компетенций
1	2	3
1	Сущность риска как объекта управления	УК-1.5; ПК-4.2
2	Концепция приемлемого риска	УК-1.5; ПК-4.2
3	Цель и задачи риск-менеджмента	УК-1.5; ПК-4.2
4	Риск-менеджмент как система управления	УК-1.5; ПК-4.2
5	Выявление факторов риска: внешние факторы риска	УК-1.5; ПК-4.2
6	Выявление факторов риска: внутренние факторы риска	УК-1.5; ПК-4.2
7	Идентификация факторов риска	УК-1.5; ПК-4.2
8	Основы построения системы факторов риска	УК-1.5; ПК-4.2
9	Классификация рисков по однозначности последствий от наступления рискового события: чистые риски	УК-1.5; ПК-4.2
10	Классификация рисков по однозначности последствий от наступления рискового события: спекулятивные (финансовые) риски	УК-1.5; ПК-4.2
11	Потери и зоны риска	УК-1.5; ПК-4.2
12	Методы качественной оценки рисков	УК-1.5; ПК-4.2
13	Методы количественной оценки риска	УК-1.5; ПК-4.2
14	Показатель риска. Соотношение доходности и риска	УК-1.5; ПК-4.2
15	Система показателей оценки риска	УК-1.5; ПК-4.2
16	Абсолютные показатели оценки риска: оценка риска структуры активов по степени их ликвидности	УК-1.5; ПК-4.2
17	Абсолютные показатели оценки риска: оценка риска потери платежеспособности	УК-1.5; ПК-4.2
18	Абсолютные показатели оценки риска: оценка риска потери финансовой устойчивости	УК-1.5; ПК-4.2

19	Непосредственная оценка риска на основе относительных показателей	УК-1.5; ПК-4.2
20	Опосредованная оценка риска на основе относительных показателей: оценка риска потери платежеспособности	УК-1.5; ПК-4.2
21	Опосредованная оценка риска на основе относительных показателей: оценка риска потери финансовой устойчивости и независимости	УК-1.5; ПК-4.2
22	Вероятностные показатели оценки риска	УК-1.5; ПК-4.2
23	Статистические показатели оценки риска	УК-1.5; ПК-4.2
24	Экспертные оценки риска	УК-1.5; ПК-4.2
25	Факторы и модели оценки риска финансовой несостоятельности	УК-1.5; ПК-4.2
26	Модели прогнозирования риска финансовой несостоятельности	УК-1.5; ПК-4.2
27	Сущность и классификация рисков инвестиционного проекта	УК-1.5; ПК-4.2
28	Аналитические подходы и процедуры оценки проектного риска	УК-1.5; ПК-4.2
29	Особенности оценки эффективности проекта в условиях риска	УК-1.5; ПК-4.2
30	Способы снижения инвестиционного риска	УК-1.5; ПК-4.2
31	Механизмы нейтрализации риска	УК-1.5; ПК-4.2
32	Средства разрешения риска. Уклонение от риска	УК-1.5; ПК-4.2
33	Средства разрешения риска. Передача риска	УК-1.5; ПК-4.2
34	Приемы снижения степени риска: диверсификация риска	УК-1.5; ПК-4.2
35	Приемы снижения степени риска: лимитирование риска	УК-1.5; ПК-4.2
36	Приемы снижения степени риска: самострахование риска	УК-1.5; ПК-4.2
37	Приемы снижения степени риска: хеджирование риска	УК-1.5; ПК-4.2
38	Приемы снижения степени риска: страхование риска	УК-1.5; ПК-4.2
39	Методы компенсации риска	УК-1.5; ПК-4.2
40	Политика управления рисками	УК-1.5; ПК-4.2

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.13 «Оценка рисков» по направлению подготовки 38.03.04 «Государственное и муниципальное управление» / разраб. И.В. Украинцева. – Зерноград: Азово-Черноморский инженерный институт ФГБОУ ВО Донской ГАУ, 2024. – 27 с.