

Министерство сельского хозяйства Российской Федерации

**Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение
высшего образования
«ВОРОНЕЖСКИЙ ГОСУДАРСТВЕННЫЙ АГРАРНЫЙ УНИВЕРСИТЕТ
ИМЕНИ ИМПЕРАТОРА ПЕТРА I»**

«УТВЕРЖДАЮ»

Декан экономического факультета

Черных А.Н.

«16» июня 2026 г.



РАБОЧАЯ ПРОГРАММА ПО ДИСЦИПЛИНЕ

Б1.О.26 Оценка и управление рисками

Специальность 38.05.01 Экономическая безопасность

Специализация «Экономико-правовое обеспечение экономической безопасности»

Квалификация выпускника экономист

Факультет Экономический

Кафедра Экономики АПК

Разработчик(и) рабочей программы:

к.э.н., доцент кафедры
экономики АПК

Л.Д. Панкратова

Рабочая программа составлена в соответствии с Федеральным государственным образовательным стандартом высшего образования по специальности 38.05.01 Экономическая безопасность (уровень специалитета), утвержденного приказом Министерства образования и науки Российской Федерации от 14 апреля 2021 г. № 293.

Рабочая программа утверждена на заседании кафедры экономики АПК.
Протокол №8 от 14.05.2026 г.

Заведующий кафедрой



Медеяева З.П.

Рабочая программа рекомендована к использованию в учебном процессе методической комиссией экономического факультета.
Протокол №9 от 26.05.2026 г.

Председатель методической комиссии



Л.В. Брянцева

Рецензент: Финансовый директор ООО «Агротех-Гарант» Сотников В.С.

1. Общая характеристика дисциплины

1.1. Цель дисциплины

Цель изучения дисциплины – формирование комплекса теоретических знаний о содержании, видах и показателях рисков, а также формирование умений и навыков использования методов оценки и управления рисками.

1.2. Задачи дисциплины

Основные задачи дисциплины:

- формирование знаний о содержании, видах и показателях риска;
- изучение основных методов и способов управления рисками;
- формирование умений и навыков использования методов оценки рисков.

1.3. Предмет дисциплины

Предметом изучения дисциплины являются содержание, виды, показатели рисков, а также система методов оценки и управления рисками.

1.4. Место дисциплины в образовательной программе

Данная дисциплина относится к Блоку Б1 к части дисциплин, формируемым участниками образовательных отношений.

1.5. Взаимосвязь с другими дисциплинами

Изучение данной дисциплины связано с изучением таких дисциплин, как Б1.О.13 Экономическая безопасность, Б1.В.14. Выявление угроз экономической безопасности.

2. Планируемые результаты обучения по дисциплине

Дисциплина нацелена на формирование следующих компетенций:

Компетенция		Индикатор достижения компетенции	
код	содержание	код	содержание
ОПК-2	Способен осуществлять сбор, анализ и использование данных хозяйственного, налогового и бюджетного учетов, учетной документации, бухгалтерской (финансовой), налоговой и статистической отчетности в целях оценки эффективности и прогнозирования финансово-хозяйственной деятельности хозяйствующего субъекта, а также выявления, предупреждения, локализации и нейтрализации внутренних и внешних угроз и рисков	3.4	Знать источники информации для оценки внутренних и внешних угроз и рисков
		У.4	Уметь на основе анализа данных хозяйственного, налогового и бюджетного учетов, учетной документации, бухгалтерской (финансовой), налоговой и статистической отчетности оценивать влияние рисков на эффективность финансово-хозяйственной деятельности хозяйствующего субъекта
		Н.4	Иметь навыки использования современных методов сбора, обработки и анализа данных хозяйственного, налогового и бюджетного учетов, учетной документации, бухгалтерской (финансовой), налоговой и статистической отчетности в целях оценки влияния рисков на эффективность финансово-хозяйственной деятельности хозяйствующего субъекта
ПК-3	Способен составлять прогнозы динамики основных экономических показателей деятельности хозяйствующих субъектов с учетом возможных экономических рисков и угроз экономической безопасности	3.2	Знать основные экономические показатели деятельности хозяйствующих субъектов, используемые для оценки и управления рисками
		У.2	Уметь применять типовые методики прогнозирования рисков в деятельности хозяйствующих субъектов
		Н.2	Иметь навыки составления прогнозов возможных экономических рисков в деятельности хозяйствующих субъектов
ПК-6	Способен контролировать эффективность работы сотрудников и подразделений в сфере управления рисками	3.1	Знать ключевые показатели и методики оценки эффективности работы сотрудников и подразделений в сфере управления рисками
		У.1	Уметь применять методики оценки эффективности работы сотрудников и подразделений в сфере управления рисками
		Н.1	Иметь навыки определения ключевых показателей, позволяющих оценивать эффективность работы сотрудников и подразделений в сфере управления рисками
ПК-8	Способен применять методы проведения прикладных научных исследований в целях определения потенциальных и реальных угроз экономической безопасности организации	3.1	Знать методы оценки рисков в деятельности предприятий
		У.1	Уметь анализировать и обрабатывать результаты, полученные при исследовании рисков на предприятии
		Н.1	Иметь навыки определения потенциальных и реальных угроз экономической безопасности на основе оценки рисков в деятельности предприятий

3. Объём дисциплины и виды работ

3.1. Очная форма обучения

Показатели	Семестр	Всего
	9	
Общая трудоёмкость, з.е./ч	4 / 144	4 / 144
Общая контактная работа, ч	58.75	58.75
Общая самостоятельная работа, ч	85.25	85.25
Контактная работа при проведении учебных занятий, в т.ч. (ч)	58.00	58.00
лекции	30	30.00
практические	28	28.00
Самостоятельная работа при проведении учебных занятий, ч	67.50	67.50
Контактная работа при проведении промежуточной аттестации обучающихся, в т.ч. (ч)	0.75	0.75
групповые консультации	0.50	0.50
экзамен	0.25	0.25
Самостоятельная работа при промежуточной аттестации, в т.ч. (ч)	17.75	17.75
подготовка к экзамену	17.75	17.75
Форма промежуточной аттестации	экзамен	экзамен

3.2. Заочная форма обучения

Показатели	Семестр	Всего
	11	
Общая трудоёмкость, з.е./ч	4 / 144	4 / 144
Общая контактная работа, ч	16.75	16.75
Общая самостоятельная работа, ч	127.25	127.25
Контактная работа при проведении учебных занятий, в т.ч. (ч)	16.00	16.00
лекции	6	6.00
практические	10	10.00
Самостоятельная работа при проведении учебных занятий, ч	109.50	109.50
Контактная работа при проведении промежуточной аттестации обучающихся, в т.ч. (ч)	0.75	0.75
групповые консультации	0.50	0.50
экзамен	0.25	0.25
Самостоятельная работа при промежуточной аттестации, в т.ч. (ч)	17.75	17.75
подготовка к экзамену	17.75	17.75
Форма промежуточной аттестации	экзамен	экзамен

4. Содержание дисциплины

4.2. Содержание дисциплины в разрезе разделов и подразделов

Раздел 1. Сущность, виды рисков, природа их формирования.

Подраздел 1.1. Неопределенность и риск. Понятие неопределенности. Виды неопределенности. Различие между риском и неопределенностью. Основные концепции риска. Факторы риска. Функции риска.

Подраздел 1.2. Классификация рисков. Производственные, коммерческие и финансовые риски. Риски, связанные с покупательной способностью денег. Инвестиционные риски. Чистые и спекулятивные риски. Риски с точки зрения влияния на финансовое состояние предприятия. Внутренние и внешние риски. Системные и несистемные риски

Раздел 2. Методы и показатели оценки риска

Подраздел 2.1. Идентификация и концептуальные направления анализа и оценки риска. Основные аксиомы рискологии при анализе рисков. Порядок идентификации рисков. Информационное обеспечение анализа и оценки рисков. Принципы информационного обеспечения анализа и оценки рисков. Уровень толерантности к риску.

Подраздел 2.2. Качественные методы оценки риска. PEST-анализ. SWOT-анализ. HAZOP-анализ. Анализ дерева неисправности. Методы экспертных оценок.

Подраздел 2.3. Количественные методы оценки риска. Статистические методы. Расчетно-аналитические методы. Метод чувствительности критических соотношений. Определение точки безубыточности. Карта рисков.

Подраздел 2.4. Показатели меры риска. Среднее ожидаемое значение результата, среднее линейное и среднее квадратическое (стандартное) отклонение результата, дисперсия, размах вариации, коэффициент вариации, бетта-коэффициент. Критерии выбора в условиях полной неопределенности.

Раздел 3. Методы управления рисками.

Подраздел 3.1. Этапы процесса управления риском.

Подраздел 3.2. Методы уклонения от риска. Отказ от риска. Страхование. Трансфер риска. Опционы. Фьючерсы.

Подраздел 3.3. Методы локализации риска.

Подраздел 3.4. Методы диссипации риска. Виды интеграций: вертикальная, горизонтальная, круговая. Диверсификация видов деятельности, рынков сбыта, каналов поставок. Диссипация риска при формировании инвестиционного портфеля.

Подраздел 3.5. Методы компенсации риска. Стратегическое планирование. Прогнозирование внешней экономической обстановки. Мониторинг социально-экономической и нормативно-правовой среды. Активный целенаправленный маркетинг.

Подраздел 3.6. Методы финансирования риска. Источники средств для финансирования убытков, возникающих вследствие наступления рискованной ситуации.

4.2. Распределение контактной и самостоятельной работы при подготовке к занятиям по подразделам

4.2.1. Очная форма обучения

Разделы, подразделы дисциплины	Контактная работа			СР
	лекции	ЛЗ	ПЗ	
Раздел 1. Сущность, виды рисков, природа их формирования	8		4	12
Подраздел 1.1. Неопределенность и риск	4		2	4
Подраздел 1.2. Классификация рисков	4		2	8
Раздел 2. Методы и показатели оценки риска	12		16	31
Подраздел 2.1. Идентификация и концептуальные направления анализа и оценки риска	2		2	7
Подраздел 2.2. Качественные методы оценки риска	4		4	8
Подраздел 2.3. Количественные методы оценки риска	4		6	8
Подраздел 2.4. Показатели меры риска	2		4	8
Раздел 3. Методы управления рисками	10		8	24,5
Подраздел 3.1. Этапы процесса управления риском	1		1	4
Подраздел 3.2. Методы уклонения от риска	2		1	4
Подраздел 3.3. Методы локализации риска	1		1	4
Подраздел 3.4. Методы диссипации риска	2		2	4
Подраздел 3.5. Методы компенсации риска	2		1	4
Подраздел 3.6. Методы финансирования риска	2		2	4,5
Всего	30		28	67,5

4.2.2. Заочная форма обучения

Разделы, подразделы дисциплины	Контактная работа			СР
	лекции	ЛЗ	ПЗ	
Раздел 1. Сущность, виды рисков, природа их формирования	1		1	16
Подраздел 1.1. Неопределенность и риск	0,5		0,5	8
Подраздел 1.2. Классификация рисков	0,5		0,5	8
Раздел 2. Методы и показатели оценки риска	2,5		6	52
Подраздел 2.1. Идентификация и концептуальные направления анализа и оценки риска	0,5		-	10
Подраздел 2.2. Качественные методы оценки риска	0,5		2	14
Подраздел 2.3. Количественные методы оценки риска	1,5		2	16
Подраздел 2.4. Показатели меры риска	1		2	12
Раздел 3. Методы управления рисками	2,5		3	41,5
Подраздел 3.1. Этапы процесса управления риском	-		-	6
Подраздел 3.2. Методы уклонения от риска	0,5		0,5	6
Подраздел 3.3. Методы локализации риска	0,5		0,5	6
Подраздел 3.4. Методы диссипации риска	0,5		0,5	8
Подраздел 3.5. Методы компенсации риска	0,5		0,5	8
Подраздел 3.6. Методы финансирования риска	0,5		1	7,5
Всего	6		10	109,5

4.3. Перечень тем и учебно-методического обеспечения для самостоятельной работы обучающихся

№ п/п	Тема самостоятельной работы	Учебно-методическое обеспечение	Объём, ч	
			форма обучения	
			очная	заочная
1	Подраздел 1.1. Неопределенность и риск	Шапкин А. С. Экономические и финансовые риски. Оценка, управление, портфель инвестиций: учебное пособие / А. С. Шапкин, В. А. Шапкин. – 12-е изд. перераб. – Москва: Издательско-торговая корпорация «Дашков и К°», 2023. – 538 с. [ЭИ] [ЭБС Знаниум] URL: https://znanium.com/catalog/product/2041758 Авдийский В. И. Риски хозяйствующих субъектов: теоретические основы, методологии анализа, прогнозирования и управления [электронный ресурс]: Учебное пособие / В. И. Авдийский, В. М. Безденежных - Москва: Издательский дом "Альфа-М", 2018 - 368 с. [ЭИ] [ЭБС Знаниум] URL: https://znanium.ru/catalog/product/1863267	4	8
2	Подраздел 1.2. Классификация рисков	Шапкин А. С. Экономические и финансовые риски. Оценка, управление, портфель инвестиций: учебное пособие / А. С. Шапкин, В. А. Шапкин. – 12-е изд. перераб. – Москва: Издательско-торговая корпорация «Дашков и К°», 2023. – 538 с. [ЭИ] [ЭБС Знаниум] URL: https://znanium.com/catalog/product/2041758 Авдийский В. И. Риски хозяйствующих субъектов: теоретические основы, методологии анализа, прогнозирования и управления [электронный ресурс]: Учебное пособие / В. И. Авдийский, В. М. Безденежных - Москва: Издательский дом "Альфа-М", 2018 - 368 с. [ЭИ] [ЭБС Знаниум] URL: https://znanium.ru/catalog/product/1863267	8	8
3	Подраздел 2.1. Идентификация и концептуальные направления анализа и оценки риска	Авдийский В. И. Риски хозяйствующих субъектов: теоретические основы, методологии анализа, прогнозирования и управления [электронный ресурс]: Учебное пособие / В. И. Авдийский, В. М. Безденежных - Москва: Издательский дом "Альфа-М", 2018 - 368 с. [ЭИ] [ЭБС Знаниум] URL: https://znanium.ru/catalog/product/1863267 Шапкин А. С. Экономические и финансовые риски. Оценка, управление, портфель инвестиций: учебное пособие / А. С. Шапкин, В. А. Шапкин. – 12-е изд. перераб. – Москва: Издательско-торговая корпорация «Дашков и К°», 2023. – 538 с. [ЭИ] [ЭБС Знаниум] URL: https://znanium.com/catalog/product/2041758	7	10

4	Подраздел 2.2. Качественные методы оценки риска	Шапкин А. С. Экономические и финансовые риски. Оценка, управление, портфель инвестиций: учебное пособие / А. С. Шапкин, В. А. Шапкин. – 12-е изд. перераб. – Москва: Издательско-торговая корпорация «Дашков и К°», 2023. – 538 с. [ЭИ] [ЭБС Знаниум] URL: https://znanium.com/catalog/product/2041758	8	14
5	Подраздел 2.3. Количественные методы оценки риска	Шапкин А. С. Экономические и финансовые риски. Оценка, управление, портфель инвестиций: учебное пособие / А. С. Шапкин, В. А. Шапкин. – 12-е изд. перераб. – Москва: Издательско-торговая корпорация «Дашков и К°», 2023. – 538 с. [ЭИ] [ЭБС Знаниум] URL: https://znanium.com/catalog/product/2041758	8	16
6	Подраздел 2.4. Показатели меры риска	Шапкин А. С. Экономические и финансовые риски. Оценка, управление, портфель инвестиций: учебное пособие / А. С. Шапкин, В. А. Шапкин. – 12-е изд. перераб. – Москва: Издательско-торговая корпорация «Дашков и К°», 2023. – 538 с. [ЭИ] [ЭБС Знаниум] URL: https://znanium.com/catalog/product/2041758	8	12
7	Подраздел 3.1. Этапы процесса управления риском	Шапкин А. С. Экономические и финансовые риски. Оценка, управление, портфель инвестиций: практическое пособие / А. С. Шапкин, В. А. Шапкин. - 10-е изд., стер. — Москва : Издательско-торговая корпорация «Дашков и К°», 2020. - С. 273-286. - ISBN 978-5-394-03553-1. - Текст: электронный. - URL: https://znanium.com/catalog/product/1093535 Балдин, К. В. Управление рисками в инновационно-инвестиционной деятельности предприятия : учебное пособие / К. В. Балдин, И. И. Передеряев, Р. С. Голов. — 4-е изд., стер. — Москва : Издательско-торговая корпорация «Дашков и К°», 2019. - 418 с. - ISBN 978-5-394-03213-4. - Текст : электронный. - URL: https://znanium.com/catalog/product/1093188 Проектирование систем управления рисками хозяйствующих субъектов : учеб. пособие / В.И. Авдийский, В.М. Безденежных, А.В. Дадалко, В.В. Земсков, Н.Г. Синявский ; под общ. ред. А.В. Дадалко. — Москва : ИНФРА-М, 2019. — 203 с. + Доп. материалы [Электронный ресурс; Режим доступа http://new.znanium.com]. — (Высшее образование: Магистратура). — www.dx.doi.org/10.12737/23556 . - ISBN 978-5-16-012236-6. - Текст : электронный. - URL: https://znanium.com/catalog/product/1024505 .	4	6

8	Подраздел 3.2. Методы уклонения от риска	Шапкин А. С. Экономические и финансовые риски. Оценка, управление, портфель инвестиций: практическое пособие / А. С. Шапкин, В. А. Шапкин. - 10-е изд., стер. — Москва : Издательско-торговая корпорация «Дашков и К°», 2020. - С. 293-319. - ISBN 978-5-394-03553-1. - Текст: электронный. - URL: https://znanium.com/catalog/product/1093535 Балдин, К. В. Управление рисками в инновационно-инвестиционной деятельности предприятия : учебное пособие / К. В. Балдин, И. И. Передеряев, Р. С. Голов. — 4-е изд., стер. — Москва : Издательско-торговая корпорация «Дашков и К°», 2019. - 418 с. - ISBN 978-5-394-03213-4. - Текст : электронный. - URL: https://znanium.com/catalog/product/1093188 Проектирование систем управления рисками хозяйствующих субъектов : учеб. пособие / В.И. Авдийский, В.М. Безденежных, А.В. Дадалко, В.В. Земсков, Н.Г. Синявский ; под общ. ред. А.В. Дадалко. — Москва : ИНФРА-М, 2019. — 203 с. + Доп. материалы [Электронный ресурс; Режим доступа http://new.znanium.com]. — (Высшее образование: Магистратура). — www.dx.doi.org/10.12737/23556. - ISBN 978-5-16-012236-6. - Текст : электронный. - URL: https://znanium.com/catalog/product/1024505.	4	6
9	Подраздел 3.3. Методы локализации риска	Шапкин А. С. Экономические и финансовые риски. Оценка, управление, портфель инвестиций: практическое пособие / А. С. Шапкин, В. А. Шапкин. - 10-е изд., стер. — Москва : Издательско-торговая корпорация «Дашков и К°», 2020. - С. 293-319. - ISBN 978-5-394-03553-1. - Текст: электронный. - URL: https://znanium.com/catalog/product/1093535 Балдин, К. В. Управление рисками в инновационно-инвестиционной деятельности предприятия : учебное пособие / К. В. Балдин, И. И. Передеряев, Р. С. Голов. — 4-е изд., стер. — Москва : Издательско-торговая корпорация «Дашков и К°», 2019. - 418 с. - ISBN 978-5-394-03213-4. - Текст : электронный. - URL: https://znanium.com/catalog/product/1093188 Проектирование систем управления рисками хозяйствующих субъектов : учеб. пособие / В.И. Авдийский, В.М. Безденежных, А.В. Дадалко, В.В. Земсков, Н.Г. Синявский ; под общ. ред. А.В. Дадалко. — Москва : ИНФРА-М, 2019. — 203 с. + Доп. материалы [Электронный ресурс; Режим доступа http://new.znanium.com]. — (Высшее образование: Магистратура). — www.dx.doi.org/10.12737/23556. - ISBN 978-5-16-	4	6

		012236-6. - Текст : электронный. - URL: https://znanium.com/catalog/product/1024505 .		
10	Подраздел 3.4. Методы диссипации риска	Шапкин А. С. Экономические и финансовые риски. Оценка, управление, портфель инвестиций: практическое пособие / А. С. Шапкин, В. А. Шапкин. - 10-е изд., стер. — Москва : Издательско-торговая корпорация «Дашков и К°», 2020. - С. 286-292. - ISBN 978-5-394-03553-1. - Текст: электронный. - URL: https://znanium.com/catalog/product/1093535 Балдин, К. В. Управление рисками в инновационно-инвестиционной деятельности предприятия : учебное пособие / К. В. Балдин, И. И. Передеряев, Р. С. Голов. — 4-е изд., стер. — Москва : Издательско-торговая корпорация «Дашков и К°», 2019. - 418 с. - ISBN 978-5-394-03213-4. - Текст : электронный. - URL: https://znanium.com/catalog/product/1093188 Проектирование систем управления рисками хозяйствующих субъектов : учеб. пособие / В.И. Авдийский, В.М. Безденежных, А.В. Дадалко, В.В. Земсков, Н.Г. Синявский ; под общ. ред. А.В. Дадалко. — Москва : ИНФРА-М, 2019. — 203 с. + Доп. материалы [Электронный ресурс; Режим доступа http://new.znanium.com]. — (Высшее образование: Магистратура). — www.dx.doi.org/10.12737/23556. - ISBN 978-5-16-012236-6. - Текст : электронный. - URL: https://znanium.com/catalog/product/1024505.	4	8
11	Подраздел 3.5. Методы компенсации риска	Шапкин А. С. Экономические и финансовые риски. Оценка, управление, портфель инвестиций: практическое пособие / А. С. Шапкин, В. А. Шапкин. - 10-е изд., стер. — Москва : Издательско-торговая корпорация «Дашков и К°», 2020. - С. 286-292. - ISBN 978-5-394-03553-1. - Текст: электронный. - URL: https://znanium.com/catalog/product/1093535 Балдин, К. В. Управление рисками в инновационно-инвестиционной деятельности предприятия : учебное пособие / К. В. Балдин, И. И. Передеряев, Р. С. Голов. — 4-е изд., стер. — Москва : Издательско-торговая корпорация «Дашков и К°», 2019. - 418 с. - ISBN 978-5-394-03213-4. - Текст : электронный. - URL: https://znanium.com/catalog/product/1093188 Проектирование систем управления рисками хозяйствующих субъектов : учеб. пособие / В.И. Авдийский, В.М. Безденежных, А.В. Дадалко, В.В. Земсков, Н.Г. Синявский ; под общ. ред. А.В. Дадалко. — Москва : ИНФРА-М, 2019. — 203 с. +	4	8

		Доп. материалы [Электронный ресурс; Режим доступа http://new.znaniy.com]. — (Высшее образование: Магистратура). — www.dx.doi.org/10.12737/23556 . - ISBN 978-5-16-012236-6. - Текст : электронный. - URL: https://znaniy.com/catalog/product/1024505 .		
12	Подраздел 3.6. Методы финансирования риска	Шапкин А. С. Экономические и финансовые риски. Оценка, управление, портфель инвестиций: практическое пособие / А. С. Шапкин, В. А. Шапкин. - 10-е изд., стер. — Москва : Издательско-торговая корпорация «Дашков и К°», 2020. - С. 286-292. - ISBN 978-5-394-03553-1. - Текст: электронный. - URL: https://znaniy.com/catalog/product/1093535 Балдин, К. В. Управление рисками в инновационно-инвестиционной деятельности предприятия : учебное пособие / К. В. Балдин, И. И. Передеряев, Р. С. Голов. — 4-е изд., стер. — Москва : Издательско-торговая корпорация «Дашков и К°», 2019. - 418 с. - ISBN 978-5-394-03213-4. - Текст : электронный. - URL: https://znaniy.com/catalog/product/1093188 Проектирование систем управления рисками хозяйствующих субъектов : учеб. пособие / В.И. Авдийский, В.М. Безденежных, А.В. Дадалко, В.В. Земсков, Н.Г. Синявский ; под общ. ред. А.В. Дадалко. — Москва : ИНФРА-М, 2019. — 203 с. + Доп. материалы [Электронный ресурс; Режим доступа http://new.znaniy.com]. — (Высшее образование: Магистратура). — www.dx.doi.org/10.12737/23556. - ISBN 978-5-16-012236-6. - Текст : электронный. - URL: https://znaniy.com/catalog/product/1024505.	4,5	7,5
Всего			67,5	109,5

5. Фонд оценочных средств для проведения промежуточной аттестации

5.1. Этапы формирования компетенций

Подраздел дисциплины	Компетенция	Индикатор достижения компетенции
Подраздел 1.1. Неопределенность и риск	ОПК -2	З.4
Подраздел 1.2. Классификация рисков	ОПК -2	З.4
Подраздел 2.1. Идентификация и концептуальные направления анализа и оценки риска	ОПК -2	Н.4
	ПК-8	Н.1
Подраздел 2.2. Качественные методы оценки риска	ОПК -2	У.4
	ПК-6	З.1
	ПК-8	З.1
Подраздел 2.3. Количественные методы оценки риска	ОПК -2	Н.4
	ПК-3	У.2
	ПК-3	Н.2
	ПК-6	У.1
Подраздел 2.4. Показатели меры риска	ПК-3	З.2
	ПК-6	Н.1
	ПК-8	У.1
Подраздел 3.1. Этапы процесса управления риском	ОПК-2	У.4
	ПК-3	З.2
	ПК-3	Н.2
	ПК-6	З.1
	ПК-8	У.1
Подраздел 3.2. Методы уклонения от риска	ОПК-2	Н.4
	ПК-3	У.2
	ПК-3	Н.2
	ПК-8	У.1
	ПК-8	Н.1
Подраздел 3.3. Методы локализации риска	ОПК-2	Н.4
	ПК-3	У.2
	ПК-3	Н.2
	ПК-8	У.1
	ПК-8	Н.1
Подраздел 3.4. Методы диссипации риска	ОПК-2	Н.4
	ПК-3	У.2
	ПК-3	Н.2
	ПК-8	У.1
	ПК-8	Н.1
Подраздел 3.5. Методы компенсации риска	ОПК-2	Н.4
	ПК-3	У.2
	ПК-3	Н.2
	ПК-8	У.1
	ПК-8	Н.1
Подраздел 3.6. Методы финансирования риска	ОПК-2	Н.4
	ПК-3	У.2
	ПК-3	Н.2
	ПК-8	У.1
	ПК-8	Н.1

5.2. Шкалы и критерии оценивания достижения компетенций

5.2.1. Шкалы оценивания достижения компетенций

Вид оценки	Оценки			
Академическая оценка по 4-х балльной шкале	неудовлетворительно	удовлетворительно	хорошо	отлично

5.2.2. Критерии оценивания достижения компетенций

Критерии оценки на экзамене

Оценка, уровень достижения компетенций	Описание критериев
Отлично, высокий	Студент показал полные и глубокие знания программного материала, логично и аргументировано ответил на все вопросы экзаменационного билета, а также на дополнительные вопросы, способен самостоятельно решать сложные задачи дисциплины
Хорошо, продвинутый	Студент твердо знает программный материал, грамотно его излагает, не допускает существенных неточностей в ответе, достаточно полно ответил на вопросы экзаменационного билета и дополнительные вопросы, способен самостоятельно решать стандартные задачи дисциплины
Удовлетворительно, пороговый	Студент показал знание только основ программного материала, усвоил его поверхностно, но не допускал грубых ошибок или неточностей, требует наводящих вопросов для правильного ответа, не ответил на дополнительные вопросы, способен решать стандартные задачи дисциплины с помощью преподавателя
Неудовлетворительно, компетенция не освоена	Студент не знает основ программного материала, допускает грубые ошибки в ответе, не способен решать стандартные задачи дисциплины даже с помощью преподавателя

Критерии оценки тестов

Оценка, уровень достижения компетенций	Описание критериев
Зачтено, высокий	Содержание правильных ответов в тесте не менее 90%
Зачтено, продвинутый	Содержание правильных ответов в тесте не менее 75%
Зачтено, пороговый	Содержание правильных ответов в тесте не менее 50%
Не зачтено, компетенция не освоена	Содержание правильных ответов в тесте менее 50%

Критерии оценки устного опроса

Оценка, уровень достижения компетенций	Описание критериев
Зачтено, высокий	Студент демонстрирует уверенное знание материала, четко выражает свою точку зрения по рассматриваемому вопросу, приводя соответствующие примеры
Зачтено, продвинутый	Студент демонстрирует уверенное знание материала, но допускает отдельные погрешности в ответе
Зачтено, пороговый	Студент демонстрирует существенные пробелы в знаниях материала, допускает ошибки в ответах
Не зачтено, компетенция не освоена	Студент демонстрирует незнание материала, допускает грубые ошибки в ответах

Критерии оценки решения задач

Оценка, уровень достижения компетенций	Описание критериев
Зачтено, высокий	Студент уверенно знает методику и алгоритм решения задачи, не допускает ошибок при ее выполнении.
Зачтено, продвинутый	Студент в целом знает методику и алгоритм решения задачи, не допускает грубых ошибок при ее выполнении.
Зачтено, пороговый	Студент в целом знает методику и алгоритм решения задачи, допускает ошибок при ее выполнении, но способен исправить их при помощи преподавателя.
Не зачтено, компетенция не освоена	Студент не знает методику и алгоритм решения задачи, допускает грубые ошибки при ее выполнении, не способен исправить их при помощи преподавателя.

Критерии оценки научно-исследовательских работ

Оценка, уровень достижения компетенций	Описание критериев
Зачтено	Статья подготовлена, проверена на плагиат, получила положительную рецензию дипломного руководителя или преподавателя, имеющего опыт преподавания дисциплин управленческого цикла, принята для опубликования в научном журнале или сборнике материалов научно-практической конференции.
Не зачтено	Статья не подготовлена, не прошла проверку на плагиат, получила отрицательную рецензию дипломного руководителя или преподавателя, имеющего опыт преподавания дисциплин управленческого цикла, не принята для опубликования.

5.3. Материалы для оценки достижения компетенций

5.3.1. Оценочные материалы промежуточной аттестации

5.3.1.1. Вопросы к экзамену

№	Содержание	Компетенция	ИДК
1	Неопределенность и ее виды	ОПК -2	3.4
2	Неопределенность и риск: сущность и различия	ОПК -2	3.4
3	Основные концепции к понятию риска	ОПК -2	3.4
4	Функции риска	ОПК -2	3.4
5	Основные признаки рисков	ОПК -2	3.4
6	Основные классификации рисков	ОПК -2	3.4
7	Системные и диверсифицируемые риски	ОПК -2	3.4
8	Допустимый и критический риск: группировка рисков по уровню влияния на деятельность	ОПК -2	3.4
9	Виды финансовых рисков и их характеристика	ОПК -2	3.4
		ПК-3	3.2
10	Производственный риск: в чем его суть и основные причины	ОПК -2	3.4
		ПК-3	3.2
11	Коммерческий риск: в чем его суть и основные причины	ОПК -2	3.4
		ПК-3	3.2
12	Виды инвестиционных рисков и их характеристика	ОПК -2	3.4
		ПК-3	3.2
13	Чистые и спекулятивные риски	ОПК -2	3.4
		ПК-3	3.2
14	Риски, связанные с покупательной способностью денег	ОПК -2	3.4
		ПК-3	3.2
15	Внутренние и внешние источники информации при анализе рисков	ОПК -2	3.4
16	Информационное обеспечение анализа и оценки рисков	ОПК -2	3.4
17	Качественный анализ рисков	ОПК -2	3.4
		ПК-6	3.1
18	SWOT-анализ деятельности предприятия	ОПК -2	3.4
		ПК-3	3.2
		ПК-8	3.1
19	PEST-анализ	ОПК -2	3.4
		ПК-3	3.2
		ПК-8	3.1
20	Анализ дерева неисправностей	ОПК -2	3.4
		ПК-3	3.2
		ПК-8	3.1
21	Методы экспертных оценок	ОПК -2	3.4
		ПК-3	3.2
		ПК-8	3.1
22	Количественные методы оценки риска	ОПК -2	3.4
		ПК-3	3.2
		ПК-8	3.1
23	Анализ чувствительности	ОПК -2	3.4
		ПК-3	3.2
		ПК-8	3.1

24	Определение точки безубыточности	ОПК -2	3.4
		ПК-3	3.2
		ПК-8	3.1
25	Картографирование рисков	ОПК -2	3.4
		ПК-3	3.2
		ПК-8	3.1
26	Критерии выбора (принятия решений) в условиях полной неопределенности	ОПК -2	3.4
		ПК-3	3.2
		ПК-8	3.1
27	Показатели меры риска	ПК-3	3.2
		ПК-8	3.1
28	Среднее квадратическое отклонение как мера риска	ПК-3	3.2
		ПК-8	3.1
29	Бета-коэффициент как мера рыночного риска	ПК-3	3.2
		ПК-8	3.1
30	Коэффициент вариации	ПК-3	3.2
		ПК-8	3.1
31	Основные методы понижения рисков	ОПК -2	3.4
		ПК-3	3.2
		ПК-8	3.1
32	Методы уклонения от рисков	ОПК -2	3.4
		ПК-3	3.2
		ПК-8	3.1
33	Методы локализации риска	ОПК -2	3.4
		ПК-3	3.2
		ПК-8	3.1
34	Методы диссипации риска	ОПК -2	3.4
		ПК-3	3.2
		ПК-8	3.1
35	Методы компенсации риска	ОПК -2	3.4
		ПК-3	3.2
		ПК-8	3.1
36	Методы финансирования риска	ОПК -2	3.4
		ПК-3	3.2
		ПК-8	3.1
37	Страхование и хеджирование рисков	ОПК -2	3.4
		ПК-3	3.2
		ПК-8	3.1
38	Этапы процесса управления риском	ОПК -2	3.4
		ПК-6	3.1
39	Мониторинг системы управления риском	ОПК -2	3.4
		ПК-6	3.1
40	Опционы	ОПК -2	3.4
		ПК-3	3.2
		ПК-8	3.1
41	Фьючерсы	ОПК -2	3.4
		ПК-3	3.2
		ПК-8	3.1
42	Вертикальная интеграция предприятий	ОПК -2	3.4
43	Горизонтальная интеграция предприятий	ОПК -2	3.4

44	Круговая интеграция предприятий	ОПК -2	3.4
45	Кэптинговые организации	ОПК -2	3.4
46	Диверсификация видов хозяйственной деятельности	ОПК -2	3.4
		ПК-3	3.2

5.3.1.2. Задачи к экзамену

[illegible]

4	Имеются два инвестиционных проекта: ИП1 и ИП2 с одинаковой прогнозной суммой требуемых капитальных вложений. Величина планируемого дохода (тыс. руб.) неопределенна и приведена в виде распределения вероятностей (см. табл.). Определить, какой из проектов дает максимальное математическое ожидание дохода. Оценить рискованность каждого проекта, используя критерий отбора – «минимизация среднеквадратического отклонения и коэффициента вариации». Характеристика проектов по доходам и вероятностям его получения <table><tr><th colspan="2">Инвестиционный проект ИП1</th><th colspan="2">Инвестиционный проект ИП2</th></tr><tr><th>Доход, тыс. руб.</th><th>Вероятность</th><th>Доход, тыс. руб.</th><th>Вероятность</th></tr><tr><td>2600</td><td>0,15</td><td>1500</td><td>0,1</td></tr><tr><td>3100</td><td>0,2</td><td>2700</td><td>0,15</td></tr><tr><td>3500</td><td>0,35</td><td>4000</td><td>0,3</td></tr><tr><td>5000</td><td>0,2</td><td>5000</td><td>0,3</td></tr><tr><td>5900</td><td>0,1</td><td>5500</td><td>0,15</td></tr></table>	Инвестиционный проект ИП1		Инвестиционный проект ИП2		Доход, тыс. руб.	Вероятность	Доход, тыс. руб.	Вероятность	2600	0,15	1500	0,1	3100	0,2	2700	0,15	3500	0,35	4000	0,3	5000	0,2	5000	0,3	5900	0,1	5500	0,15	ОПК-2	Н.4
		Инвестиционный проект ИП1		Инвестиционный проект ИП2																											
		Доход, тыс. руб.	Вероятность	Доход, тыс. руб.	Вероятность																										
		2600	0,15	1500	0,1																										
		3100	0,2	2700	0,15																										
		3500	0,35	4000	0,3																										
		5000	0,2	5000	0,3																										
		5900	0,1	5500	0,15																										
		ПК-3	У.2																												
		ПК-8	У.1																												
ПК-8	Н.1																														
5	Руководство предприятия должно решить, сколько упаковок продукта следует производить в течение месяца. Вероятности того, что спрос на продукт в течение месяца будет 5, 6, 7 или 8 упаковок, равны соответственно 0,25; 0,25; 0,25; 0,25. Затраты на производство одной упаковки равны 36 тыс. руб. Предприятие продает каждую упаковку по цене 49 тыс. руб. Если упаковка не продается в течение месяца, то предприятие не получает дохода. Сколько упаковок следует производить в течение недели?	ОПК-2	У.4																												
		ОПК-2	Н.4																												
		ПК-3	У.2																												
		ПК-3	Н.2																												
		ПК-8	У.1																												
		ПК-8	Н.1																												
6	Необходимо определить, в каком количестве следует закупить холодильное оборудование для магазина. Заранее можно сказать, что потребуется, как минимум, пять единиц оборудования. Вероятность того, что потребуется пять единиц холодильного оборудования, составляет 0,4; вероятность того, что потребуется шесть единиц, – 0,35; вероятность того, что потребуется 7 единиц – 0,25. Если закупать оборудование заранее, то можно приобрести его по цене 190 тыс. руб./ед. Если потребуется дополнительно приобрести технику, то последующая докупка будет осуществляться по цене 220 тыс. руб./ед.	ОПК-2	У.4																												
		ОПК-2	Н.4																												
		ПК-3	У.2																												
		ПК-3	Н.2																												
		ПК-6	У.1																												
		ПК-8	У.1																												
7	Необходимо предоставить руководителю компании отчет о достоверности прогнозов в 1 полугодии анализируемого года, если за данный период специалисты по информационной безопасности прогнозировали появление 45 новых видов вредоносных программ, а в итоге системой мониторинга было обнаружено 60 новых вида вредоносных программ, причем 40 из них совпал с прогнозами специалистов.	ПК-3	У.2																												
		ПК-3	Н.2																												
		ПК-6	У.1																												
8	В первый год отделом антивирусных исследований было зафиксировано 864 новых видов вредоносных программ, во 2-м году – 901, в 3-м году – 925, в 4-м году – 985, в 5-м году – 1020, в 6-м - 1192. Как специалист по информационной безопасности, используя метод экстраполяции по сложившемуся среднегодовому темпу роста числа рассылок, сделайте прогноз относительно числа спам-рассылок на корпоративную почту компании на 7-й год.	ПК-3	У.2																												
		ПК-3	Н.2																												
		ПК-6	У.1																												
9	Специалисты отдела анализа угроз обследовали 4 компании и получили следующие результаты о зависимости между количеством каналов утечек	ПК-3	У.2																												
		ПК-3	Н.2																												

	и нанесенным ущербом:		ПК-6	Н.1																														
	<table><tr><td>Количество каналов утечек (шт.)</td><td>Нанесенный ущерб (тыс. руб.)</td></tr><tr><td>1</td><td>250</td></tr><tr><td>3</td><td>435</td></tr><tr><td>4</td><td>470</td></tr><tr><td>6</td><td>680</td></tr></table>	Количество каналов утечек (шт.)	Нанесенный ущерб (тыс. руб.)	1	250	3	435	4	470	6	680																							
Количество каналов утечек (шт.)	Нанесенный ущерб (тыс. руб.)																																	
1	250																																	
3	435																																	
4	470																																	
6	680																																	
	Используя линейную интерполяцию, найдите значение возможного ущерба, если в компании имеется 5 каналов утечек.																																	
10	На основе представленной информации спрогнозировать объем производства в натуральном выражении на 11-й и 12-й годы, используя метод скользящих средних (интервал сглаживания - 3 года). Оценить точность прогноза.		ПК-3	У.2																														
			ПК-3	Н.2																														
	<table><tr><td>Годы</td><td>1</td><td>2</td><td>3</td><td>4</td><td>5</td><td>6</td><td>7</td><td>8</td><td>9</td><td>10</td></tr><tr><td>Объем производства, шт.</td><td>170</td><td>780</td><td>195</td><td>210</td><td>200</td><td>225</td><td>260</td><td>210</td><td>190</td><td>230</td></tr></table>	Годы	1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	Объем производства, шт.	170	780	195	210	200	225	260	210	190	230											
Годы	1	2	3	4	5	6	7	8	9	10																								
Объем производства, шт.	170	780	195	210	200	225	260	210	190	230																								
11	Приведены следующие показатели бизнес-плана с горизонтом планирования 4 года. Объем реализации – 500 шт. Переменные издержки на единицу продукции – 15 тыс. руб. Постоянные затраты – 800 тыс. руб. Цена реализации единицы продукции – 24 тыс. руб. Цена капитала – 10%. Рассмотреть, как повлияют на размер ЧДД проекта изменение таких параметров, как объем реализации, переменные издержки на единицу продукции, постоянные издержки, цена реализации и цена капитала.		ПК-3	У.2																														
			ПК-3	Н.2																														
			ПК-8	У.1																														
			ПК-8	Н.1																														
12	Имеется набор данных о доходности проектов в нескольких отраслях. Определите, какой из проектов может быть выбран инвестором, использующим критерий MINIMAX? Информация об эффективности проектов в различных отраслях, %		ПК-3	У.2																														
			ПК-3	Н.2																														
			ПК-8	У.1																														
			ПК-8	Н.1																														
	<table><tr><td colspan="2" rowspan="2">Информация о проектах в различных отраслях</td><td colspan="4">Серия проектов в отрасли</td></tr><tr><td>1</td><td>2</td><td>3</td><td>4</td></tr><tr><td rowspan="4">Отрасль</td><td>А</td><td>15,3</td><td>9,2</td><td>15,7</td><td>10,4</td></tr><tr><td>Б</td><td>15,5</td><td>16,7</td><td>8,3</td><td>12,8</td></tr><tr><td>В</td><td>21,4</td><td>11</td><td>15,4</td><td>24,2</td></tr><tr><td>Г</td><td>9,8</td><td>20</td><td>13,6</td><td>15,2</td></tr></table>	Информация о проектах в различных отраслях		Серия проектов в отрасли				1	2	3	4	Отрасль	А	15,3	9,2	15,7	10,4	Б	15,5	16,7	8,3	12,8	В	21,4	11	15,4	24,2	Г	9,8	20	13,6	15,2		
Информация о проектах в различных отраслях				Серия проектов в отрасли																														
		1	2	3	4																													
Отрасль	А	15,3	9,2	15,7	10,4																													
	Б	15,5	16,7	8,3	12,8																													
	В	21,4	11	15,4	24,2																													
	Г	9,8	20	13,6	15,2																													

5.3.1.3. Вопросы к зачёту с оценкой

Не предусмотрен.

5.3.1.4. Вопросы к зачёту

Не предусмотрен.

5.3.1.5. Перечень тем курсовых проектов

Не предусмотрен.

5.3.1.6. Вопросы к защите курсового проекта

Не предусмотрен.

5.3.2. Оценочные материалы текущего контроля

5.3.2.1. Вопросы тестов

№	Содержание	Компетенция	ИДК
1.	Современное понятие «риск» ... а) используется для обозначения возможного материального ущерба; б) связано как с возможным материальным ущербом, так и с возможным выигрышем; в) отождествляется только с полученным материальным ущербом.	ОПК-2	3.4
2.	Как соотносятся понятие «неопределенность» и понятие «риск»? а) в реальной предпринимательской деятельности эти понятия являются синонимами; б) риск характеризует такую ситуацию, когда наступление некоторых событий может быть оценено количественно, а неопределенность предполагает невозможность оценки вероятности наступления таких событий; в) неопределенность характеризует условия внешней среды, а риск – действия предпринимателя, поэтому эти понятия не связаны.	ОПК-2	3.4
3.	В чем состоит регулятивная функция риска? а) в необходимости идентификации, оценки, управления риском по всем направлениям деятельности организации; б) в необходимости затрат на разработку средств на возмещение ущерба в случае наступления рискового события.	ОПК-2	3.4
4.	Деловая активность предприятия, маркетинговая стратегия, политика в области управления персоналом, производственный потенциал выступают а) внешними факторами риска; б) внутренними факторами риска.	ОПК-2	3.4
5.	Спекулятивные (динамические, коммерческие) риски а) всегда несут потери для предпринимательской деятельности; б) могут нести как потери, так и дополнительную прибыль; в) характеризуют дополнительные возможности получения прибыли.	ОПК-2	3.4
		ОПК-2	У.4
6.	Изменение курса валют, конъюнктуры рынка, налогового законодательства выступают факторами... а) чистых рисков; б) спекулятивных рисков.	ОПК-2	3.4
		ОПК-2	У.4
7.	Риск убытков, связанных с неэффективным использованием предприятием основных и оборотных средств, относится к: а) коммерческому риску;	ОПК-2	3.4

	б) производственному риску; в) финансовому риску; г) страховому риску.	ОПК-2	У.4
8.	К рискам, связанным с покупательной способностью денег, относятся: а) риски ликвидности, валютные, дефляционные, инфляционные риски; б) риск снижения доходности, риск прямых финансовых потерь, риск упущенной выгоды; в) инвестиционные и финансовые риски.	ОПК-2	3.4
		ОПК-2	У.4
9.	Кредитный риск представляет собой: а) опасность потерь коммерческими банками, кредитными учреждениями, инвестиционными институтами в результате превышения процентных ставок, выплачиваемых ими по привлеченным средствам, над ставками по предоставленным кредитам; б) риск неплатежа по коммерческим сделкам и риск недополучения комиссионного вознаграждения; в) опасность неуплаты заемщиком основного долга и процентов.	ОПК-2	3.4
		ОПК-2	У.4
10.	Риск неправильного выбора видов вложения капитала, вида ценных бумаг для инвестирования в сравнении с другими видами ценных бумаг при формировании инвестиционного портфеля представляет собой: а) селективный риск; б) биржевой риск; в) деловой риск; г) кредитный риск.	ОПК-2	3.4
		ОПК-2	У.4
11.	Идентификация рисков представляет собой: а) анализ существующих видов риска предпринимательской деятельности; б) оценку последствий рисков событий; в) установление видов, источников рисков и знание природы их происхождения с учетом специфики деятельности организации.	ОПК-2	3.4
12.	Какие риски могут принести дополнительную прибыль фирме? а) спекулятивные; б) чистые; в) ретроспективные; г) любые; д) реализация риска в принципе не может принести дополнительную прибыль компании.	ОПК-2	3.4
		ОПК-2	У.4
13.	Подразделение рисков на спекулятивные и чистые основано на: а) классификации субъектов риска; б) классификации объектов риска; в) характере оценки риска;	ОПК-2	3.4

	г) характере последствий риска.		
14.	По сфере возникновения выделяют следующие типы рисков: а) производственный риск; б) кадровый риск; в) информационный риск; г) финансовый риск; д) коммерческий риск.	ОПК-2	3.4
15.	Коммерческий риск – это риск, возникающий: а) на коммерческих предприятиях; б) при заключении коммерческих сделок; в) в процессе реализации товаров или услуг; г) в процессе производства товаров или услуг.	ОПК-2	3.4
		ОПК-2	У.4
16.	Относятся ли риски, связанные с транспортировкой товаров, к группе коммерческих рисков? а) да; б) нет; в) это зависит от характера транспортировки.	ОПК-2	3.4
		ОПК-2	У.4
17.	Какие из перечисленных видов риска включают финансовые риски? а) валютные; б) денежные; в) инвестиционные; г) проектные; д) риски распределения доходности.	ОПК-2	3.4
		ОПК-2	У.4
18.	Валютный риск связан с: а) покупкой и продажей валют; б) любыми потерями, обусловленными изменением курса иностранной валюты; в) обменом одной иностранной валюты на другую; г) ошибками при расчете кросс-курсов.	ОПК-2	3.4
		ОПК-2	У.4
19.	Инфляционный риск – это: а) риск увеличения темпов инфляции; б) риск инфляционных ожиданий; в) риск возникновения разницы в темпах инфляции на разных рынках сбыта.	ОПК-2	3.4
		ОПК-2	У.4
20.	Системный риск – это: а) риск ухудшения конъюнктуры какого-либо рынка; б) риск разрушения системы управления организацией; в) общая система рисков, которым подвергнута организация; г) система оценки и управления рисками.	ОПК-2	3.4
		ОПК-2	У.4
21.	Статистический метод количественной оценки риска: а) используется в случае, если имеется статистическая информация по анализируемому виду деятельности, и предполагает изучение статистики потерь и доходов; б) заключается в предположении, что имеется опытный эксперт, длительное время работавший в анализируемой сфере деятельности, который способен составить	ОПК-2	3.4
		ОПК-2	Н.4

	достаточно верное суждение о возможности (вероятности) наступления рискового случая; в) предполагает анализ информации по аналогичным проектам в прошлом, на основе чего вычисляется коэффициент вариации различных показателей эффективности.	ПК-8	3.1
22.	Метод аналогий как метод количественной оценки риска: а) используется в случае, если имеется статистическая информация по анализируемому виду деятельности, и предполагает изучение статистики потерь и доходов; б) заключается в предположении, что имеется опытный эксперт, длительное время работавший в анализируемой сфере деятельности, который способен составить достаточно верное суждение о возможности (вероятности) наступления рискового случая; в) предполагает анализ информации по аналогичным проектам в прошлом, на основе чего вычисляется коэффициент вариации различных показателей эффективности.	ОПК-2	3.4
		ПК-3	У.2
23.	Метод экспертных оценок как метод количественной оценки риска: а) используется в случае, если имеется статистическая информация по анализируемому виду деятельности, и предполагает изучение статистики потерь и доходов; б) заключается в предположении, что имеется опытный эксперт, длительное время работавший в анализируемой сфере деятельности, который способен составить достаточно верное суждение о возможности (вероятности) наступления рискового случая; в) предполагает анализ информации по аналогичным проектам в прошлом, на основе чего вычисляется коэффициент вариации различных показателей эффективности.	ОПК-2	3.4
		ПК-3	У.2
24.	Какой области риска соответствует область деятельности предприятия, в процессе которой возможные отклонения от ожидаемого результата незначимы и в целом позволяют субъекту удовлетворить его интересы? а) безрисковая деятельность; б) минимальный риск; в) повышенный риск; г) критический риск; д) недопустимый риск.	ОПК-2	3.4
25.	Какой области риска соответствует область деятельности предприятия, характеризующаяся неустойчивым состоянием деятельности субъекта, когда имеется угроза уменьшения его капитала, однако способна в целом обеспечить процесс простого воспроизводства? а) безрисковая деятельность; б) минимальный риск; в) повышенный риск; г) критический риск; д) недопустимый риск.	ОПК-2	3.4

26.	Какой области риска соответствует область деятельности, характеризующая неустойчивым состоянием деятельности субъекта, когда не только имеется угроза уменьшения капитала, но и опасность суженного воспроизводства? а) безрисковая деятельность; б) минимальный риск; в) повышенный риск; г) критический риск; д) недопустимый риск.	ОПК-2	3.4
27.	Какой области риска соответствует область кризисного состояния, при которой существует опасность утраты субъектом его капитала? а) безрисковая деятельность; б) минимальный риск; в) повышенный риск; г) критический риск; д) недопустимый риск.	ОПК-2	3.4
28.	При катастрофическом риске уровень возможной потери прибыли располагается в пределах: а) 0-25%; б) 25-50%; в) 50-70%; г) 70-100%.	ПК-3	3.2
		ПК-3	У.2
29.	Показатель, выражающий количество риска на единицу доходности и являющийся комплексным относительным показателем, который позволяет сравнивать результаты, выраженные в разных единицах измерения, называется: а) дисперсией; б) коэффициентом вариации; в) средним квадратическим отклонением.	ПК-3	3.2
30.	Вероятность наступления события – это: а) отношение количества событий определенного вида к общему количеству наблюдаемых событий в обследованной их совокупности; б) среднее ожидаемое значение анализируемого показателя, взвешенное по вероятности получения результата по каждому из наблюдений; в) среднее арифметическое отклонение (по модулю) анализируемого показателя от его средней величины; г) среднее арифметическое значение квадрата отклонения наблюдаемой величины от ее среднего значения; д) величина ($\pm$) отклонения анализируемого показателя от его среднего значения.	ОПК-2	3.4
		ПК-3	3.2
31.	Математическое ожидание – это: а) отношение количества событий определенного вида к общему количеству наблюдаемых событий в обследованной их совокупности; б) среднее ожидаемое значение анализируемого показателя	ОПК-2	3.4

	теля, взвешенное по вероятности получения результата по каждому из наблюдений; в) среднее арифметическое отклонение (по модулю) анализируемого показателя от его средней величины; г) среднее арифметическое значение квадрата отклонения наблюдаемой величины от ее среднего значения; д) величина ($\pm$) отклонения анализируемого показателя от его среднего значения.	ПК-3	3.2
32.	Среднее линейное отклонение – это: а) отношение количества событий определенного вида к общему количеству наблюдаемых событий в обследованной их совокупности; б) среднее ожидаемое значение анализируемого показателя, взвешенное по вероятности получения результата по каждому из наблюдений; в) среднее арифметическое отклонение (по модулю) анализируемого показателя от его средней величины; г) среднее арифметическое значение квадрата отклонения наблюдаемой величины от ее среднего значения; д) величина ($\pm$) отклонения анализируемого показателя от его среднего значения.	ОПК-2	3.4
		ПК-3	3.2
33.	Дисперсия – это: а) отношение количества событий определенного вида к общему количеству наблюдаемых событий в обследованной их совокупности; б) среднее ожидаемое значение анализируемого показателя, взвешенное по вероятности получения результата по каждому из наблюдений; в) среднее арифметическое отклонение (по модулю) анализируемого показателя от его средней величины; г) среднее арифметическое значение квадрата отклонения наблюдаемой величины от ее среднего значения; д) величина ($\pm$) отклонения анализируемого показателя от его среднего значения.	ОПК-2	3.4
		ПК-3	3.2
34.	Стандартное отклонение (среднеквадратическое отклонение) – это: а) отношение количества событий определенного вида к общему количеству наблюдаемых событий в обследованной их совокупности; б) величина ($\pm$) отклонения анализируемого показателя от его среднего значения; в) среднее ожидаемое значение анализируемого показателя, взвешенное по вероятности получения результата по каждому из наблюдений; г) относительная мера изменения показателя относительно его среднего значения.	ОПК-2	3.4
		ПК-3	3.2
35.	Коэффициент вариации – это: а) отношение количества событий определенного вида к общему количеству наблюдаемых событий в обследованной их совокупности;	ОПК-2	3.4

	б) величина ($\pm$) отклонения анализируемого показателя от его среднего значения; в) среднее ожидаемое значение анализируемого показателя, взвешенное по вероятности получения результата по каждому из наблюдений; г) относительная мера изменения показателя относительно его среднего значения.	ПК-3	3.2
36.	Размах вариации – это: а) величина ($\pm$) отклонения анализируемого показателя от его среднего значения; б) относительная мера изменения показателя относительно его среднего значения; в) среднее ожидаемое значение анализируемого показателя, взвешенное по вероятности получения результата по каждому из наблюдений; г) разница между максимальным и минимальным значением показателя.	ОПК-2	3.4
		ПК-3	3.2
37.	Коэффициент риска показывает: а) разницу между максимальным и минимальным значением показателя; б) соотношение максимально возможного объема убытка и объема собственных финансовых ресурсов инвестора; в) отношение количества событий определенного вида к общему количеству наблюдаемых событий в обследованной их совокупности; г) относительная мера изменения показателя относительно его среднего значения.	ОПК-2	3.4
		ПК-3	3.2
38.	Бета-коэффициент: а) отражает разницу между максимальным и минимальным значением показателя; б) показывает соотношение максимально возможного объема убытка и объема собственных финансовых ресурсов инвестора; в) является мерой рыночного риска акции, показывая изменчивость доходности отдельных вложений к доходности на рынке в среднем.	ОПК-2	3.4
		ПК-3	3.2
39.	Стандартное отклонение по анализируемому показателю составляет 2,5. Какова дисперсия? а) 1,25; б) 5; в) 6,25.	ПК-8	3.1
		ПК-8	У.1
40.	Значение коэффициента вариации 41% свидетельствует о: а) слабой колеблемости значений; б) умеренной колеблемости значений; в) высокой колеблемости значений.	ПК-8	3.1
		ПК-8	У.1
41.	Если среднеквадратическое отклонение показателя равно 3,54, а его среднее значение равно 15, каково значение коэффициента вариации? а) 4,237; б) 53,1; в) 0,236.	ПК-8	3.1
		ПК-8	У.1

42.	В основе какого критерия лежит предположение, что поскольку о ситуации в будущем ничего не известно, рассматриваемые варианты реализации ситуации можно считать равновероятными? а) критерий Сэвиджа; б) критерий Вальда; в) критерий Лапласа.	ПК-8	3.1
		ПК-8	У.1
43.	Значения стоимости произведенной продукции за анализируемый период составили, тыс. руб.: 100; 126; 220; 150; 121; 200. Размах вариации составит: а) 120; б) 21; в) 70.	ПК-8	3.1
		ПК-8	У.1
44.	При допустимом риске уровень возможной потери прибыли располагается в пределах: а) 0-25%; б) 25-50%; в) 50-70%; г) 70-100%.	ПК-3	3.2
		ПК-3	У.2
45.	Если дисперсия наблюдаемой величины равна 256, то каково значение среднего квадратического отклонения? а) 16; б) 128; в) 64.	ПК-8	3.1
		ПК-8	У.1
46.	Значения доходности ценной бумаги за анализируемый период составили: 10; 16; 22; 15; 21; 20. Размах вариации составит: а) 11; б) 10; в) 12.	ПК-8	3.1
		ПК-8	У.1
47.	Инвестор осуществляет выбор между тремя инвестиционными проектами с точки зрения минимизации уровня риска. Среднее квадратическое отклонение по первому проекту составляет 1,35; по второму проекту – 1,22; третьего проекта – 1,30. Какой проект выберет инвестор? а) первый; б) второй; в) третий.	ОПК-2	Н.4
		ПК-8	3.1
		ПК-8	У.1
48.	Значение коэффициента вариации 20% свидетельствует о: а) слабой колеблемости значений; б) умеренной колеблемости значений; в) высокой колеблемости значений.	ПК-8	3.1
		ПК-8	У.1
49.	Корректирующий коэффициент α , используемый при выборе решения по критерию Гурвица, называется: а) коэффициентом оптимизма; б) коэффициентом риска; в) коэффициентом предпочтения.	ПК-8	3.1
50.	SWOT-анализ позволяет: а) выделить сильные и слабые стороны, угрозы и возможности бизнеса;	ОПК-2	Н.4

	б) представить взаимосвязи в виде иерархической структуры факторов и главных показателей; в) представить все возможные сценарии и проанализировать все потенциальные риски.	ПК-8	3.1
51.	Количественный анализ риска: а) представляет собой анализ опасностей функционирования системы; б) базируется на определении числовых величин конкретных рисков и риска деятельности организации в целом; в) дает представление о внешней среде и деловом климате.	ОПК-2	Н.4
		ПК-8	3.1
52.	В условиях частичной неопределенности, как правило, используют: а) расчетно-аналитические; б) экспертные методы; в) вероятностные и статистические методы.	ПК-8	3.1
		ПК-8	У.1
53.	Частичный риск характеризуется: а) потерями прибыли в пределах допустимой зоны, когда предпринимательская деятельность сохраняет свою экономическую целесообразность; б) отклонением некоторых направлений деятельности, которые напрямую не привели к ощутимым потерям или изменениям; в) потерями, превышающими ожидаемую прибыль, которые могут привести к серьезным последствиям для бизнеса, но ресурсов предприятия достаточно для преодоления последствий риска; г) потерями, равными по стоимости имуществу предприятия, и наступлением неплатежеспособности предприятия.	ПК-8	3.1
		ПК-8	У.1
54.	Величина риска определяется как: а) произведение размера потерь организации, возникающих от проявления риска, и вероятности его реализации; б) отношение максимально возможной величины убытка от осуществления операции к величине собственных финансовых ресурсов; в) вероятность наступления рискованного события.	ПК-3	3.2
		ПК-8	3.1
		ПК-8	У.1
55.	Допустимый размер рисков, который организация готова взять на себя на данном этапе развития, представляет собой: а) коэффициент риска; б) чрезмерный риск; в) уровень толерантности к риску.	ПК-8	3.1
		ПК-8	У.1
56.	Изучение изменения прибыли от основной деятельности в ответ на изменения одного из параметров при условии, что другие параметры остаются неизменными, составляет основу такого метода, как: а) оценка целесообразности затрат; б) имитационное моделирование; в) анализ чувствительности; г) дерево решений.	ПК-8	3.1
		ПК-8	У.1

57.	Как интерпретируется оценка риска при помощи среднего линейного отклонения? а) этот показатель не отражает уровень риска; б) чем его размер ниже, тем выше уровень риска; в) чем его размер выше, тем выше уровень риска.	ПК-8	3.1
		ПК-8	У.1
58.	. Квадратный корень из дисперсии анализируемого показателя – это: а) среднее линейное отклонение; б) коэффициент вариации; в) стандартное отклонение.	ПК-3	3.2
		ПК-8	3.1
		ПК-8	У.1
59.	Значение коэффициента вариации 15% свидетельствует о: а) слабой колеблемости значений; б) умеренной колеблемости значений; в) высокой колеблемости значений.	ПК-8	3.1
		ПК-8	У.1
60.	Инвестор осуществляет выбор между тремя инвестиционными проектами с точки зрения минимизации уровня риска. Коэффициент вариации по первому проекту составляет 35%; по второму проекту – 22%; третьего проекта – 30%. Какой проект выберет инвестор? а) первый; б) второй; в) третий.	ПК-8	3.1
		ОПК-2	Н.4
61.	Критерий выбора MAXIMAX в условиях полной неопределенности: а) оценивает систему по максимальному значению эффективности и позволяет выбирать в качестве оптимального решения систему, обладающую эффективностью с наибольшим из максимумов; б) характеризует выбор, обладающий средними значениями эффективности и, следовательно, умеренным уровнем риска; в) минимизирует риск: среди всех вариантов с минимальными значениями эффективности выбираются лучшие; г) ориентирован не столько на минимизацию потерь, сколько на минимизацию сожалений по поводу упущенной прибыли; д) является компромиссным способом принятия решений, позволяющим принимать решения в промежуточных случаях между крайним оптимизмом и крайним пессимизмом.	ОПК-2	3.4
62.	Критерий выбора MINIMAX в условиях полной неопределенности: а) оценивает систему по максимальному значению эффективности и позволяет выбирать в качестве оптимального решения систему, обладающую эффективностью с наибольшим из максимумов; б) характеризует выбор, обладающий средними значениями эффективности и, следовательно, умеренным уровнем риска; в) минимизирует риск: среди всех вариантов с минимальными значениями эффективности выбираются	ОПК-2	3.4

	лучшие; г) ориентирован не столько на минимизацию потерь, сколько на минимизацию сожалений по поводу упущенной прибыли; д) является компромиссным способом принятия решений, позволяющим принимать решения в промежуточных случаях между крайним оптимизмом и крайним пессимизмом.		
63.	Критерий Сэвиджа условиях полной неопределенности: а) оценивает систему по максимальному значению эффективности и позволяет выбирать в качестве оптимального решения систему, обладающую эффективностью с наибольшим из максимумов; б) ориентирован не столько на минимизацию потерь, сколько на минимизацию сожалений по поводу упущенной прибыли; в) минимизирует риск: среди всех вариантов с минимальными значениями эффективности выбираются лучшие; г) характеризует выбор, обладающий средними значениями эффективности и, следовательно, умеренным уровнем риска; д) является компромиссным способом принятия решений, позволяющим принимать решения в промежуточных случаях между крайним оптимизмом и крайним пессимизмом.	ПК-3	3.2
64.	Критерий Гурвица условиях полной неопределенности: а) оценивает систему по максимальному значению эффективности и позволяет выбирать в качестве оптимального решения систему, обладающую эффективностью с наибольшим из максимумов; б) ориентирован не столько на минимизацию потерь, сколько на минимизацию сожалений по поводу упущенной прибыли; в) минимизирует риск: среди всех вариантов с минимальными значениями эффективности выбираются лучшие; г) характеризует выбор, обладающий средними значениями эффективности и, следовательно, умеренным уровнем риска; д) является компромиссным способом принятия решений, позволяющим принимать решения в промежуточных случаях между крайним оптимизмом и крайним пессимизмом.	ОПК-2	3.4
65.	Критерий выбора MAXIMIN в условиях полной неопределенности: а) оценивает систему по максимальному значению эффективности и позволяет выбирать в качестве оптимального решения систему, обладающую эффективностью с наибольшим из максимумов; б) характеризует выбор, обладающий средними значениями эффективности и, следовательно, умеренным	ОПК-2	3.4

	уровнем риска; в) минимизирует риск: среди всех вариантов с минимальными значениями эффективности выбираются лучшие; г) ориентирован не столько на минимизацию потерь, сколько на минимизацию сожалений по поводу упущенной прибыли; д) является компромиссным способом принятия решений, позволяющим принимать решения в промежуточных случаях между крайним оптимизмом и крайним пессимизмом.		
66.	Критерий выбора MINIMIN в условиях полной неопределенности: а) оценивает систему по максимальному значению эффективности и позволяет выбирать в качестве оптимального решения систему, обладающую эффективностью с наибольшим из максимумов; б) характеризует выбор, обладающий средними значениями эффективности и, следовательно, умеренным уровнем риска; в) минимизирует риск: среди всех вариантов с минимальными значениями эффективности выбираются лучшие; г) ориентирован не столько на минимизацию потерь, сколько на минимизацию сожалений по поводу упущенной прибыли; д) характеризует неприятие риска, отказ от риска.	ОПК-2	3.4
67.	Какие показатели не принимаются в расчет при оценке целесообразности затрат? а) процент доходности по финансовым вложениям; б) запас экономической прочности; в) критический объем производства (продаж).	ПК-8	3.1
		ПК-8	У.1
68.	Маржинальный доход рассчитывается как: а) сумма постоянных и переменных затрат; б) разница между выручкой от реализации и постоянными затратами; в) разница между выручкой от реализации и переменными затратами; г) сумма прибыли и переменных затрат.	ПК-8	3.1
		ПК-8	У.1
69.	Чем больше разница между фактическим объемом производства и критическим, тем: а) ниже финансовая устойчивость; б) выше финансовая устойчивость; в) этот показатель не связан с финансовой устойчивостью предприятия.	ПК-3	3.1
		ПК-8	У.1
70.	Толерантность к рискам – это: а) объем материальных потерь, которые не повлияют на деятельность организации, и она продолжит функционирование, покрывая необходимые текущие расходы; б) объем материальных потерь, которые существенно повлияют на деятельность организации, и она прекратит функционирование;	ПК-8	3.1

	в) отсутствие каких-либо материальных потерь в деятельности организации.		
71.	Отношение убытка от осуществления операции к величине собственных финансовых ресурсов представляет собой: а) коэффициент риска; б) величину риска; в) точку безубыточности; г) запас экономической прочности.	ПК-8	3.1
		ПК-8	У.1
72.	Какой метод изучает изменение одного из ключевых показателей деятельности предприятия в ответ на изменение одного из влияющих на него факторов при условии, что остальные факторы будут оставаться неизменными? а) оценка целесообразности затрат; б) анализ чувствительности; в) имитационное моделирование; г) определение точки безубыточности.	ПК-8	3.1
73.	Производственный леверидж показывает: а) степень влияния переменных затрат на прибыль при изменении объема производства; б) степень влияния постоянных затрат на прибыль при изменении объема производства; в) степень влияния изменения объема производства на величину постоянных и переменных затрат.	ПК-8	3.1
74.	При использовании такого метода анализа ассортиментного ряда выпускаемой продукции, как АВС-анализ в какую группу товаров относят товары с максимальной долей в общем объеме реализованной продукции? а) группа А; б) группа В; в) группа С.	ПК-8	3.1
75.	Методы управления рисками, основанные на четкой идентификации источников риска, носят название: а) методы диссипации риска; б) методы компенсации риска; в) методы уклонения от риска; г) методы локализации риска.	ПК-3	3.2
		ПК-8	3.1
76.	Методы управления рисками, предполагающие исключение рискованных ситуаций из бизнеса, носят название: а) методы диссипации риска; б) методы компенсации риска; в) методы уклонения от риска; г) методы локализации риска.	ПК-3	3.2
		ПК-8	3.1
77.	Методы управления рисками, относящиеся к упреждающим методам управления, носят название: а) методы диссипации риска; б) методы компенсации риска; в) методы уклонения от риска; г) методы локализации риска.	ПК-3	3.2
		ПК-8	3.1
78.	Методы управления рисками, связанные с распределением риска между стратегическими партнерами, носят название: а) методы диссипации риска; б) методы компенсации риска;	ПК-3	3.2
		ПК-8	3.1

	в) методы уклонения от риска; г) методы локализации риска.		
79.	Интеграция, предполагающая объединение с поставщиками, – это: а) вертикальная регрессивная (обратная) интеграция; б) вертикальная прогрессивная (прямая) интеграция; в) горизонтальная интеграция; г) круговая интеграция.	ПК-3	3.2
		ПК-8	3.1
80.	Финансирование под уступку денежного требования, подразумевающее передачу кредитного риска, это лежит в основе: а) биржевых сделок; б) строительных контрактов; в) контракта – поручительства; г) договора факторинга.	ПК-3	3.2
		ПК-8	3.1
81.	Интеграция, подразумевающая объединение с посредниками, образующими дистрибьюторскую сеть по сбыту продукции предприятия, – это: а) вертикальная регрессивная (обратная) интеграция; б) вертикальная прогрессивная (прямая) интеграция; в) горизонтальная интеграция; г) круговая интеграция.	ПК-3	3.2
		ПК-8	3.1
82.	Интеграция, предполагающая объединение с конкурентами, – это: а) вертикальная регрессивная (обратная) интеграция; б) вертикальная прогрессивная (прямая) интеграция; в) горизонтальная интеграция; г) круговая интеграция.	ПК-3	3.2
		ПК-8	3.1
83.	Объединение организаций, осуществляющих разные виды деятельности для достижения совместных стратегических целей, – это: а) вертикальная регрессивная (обратная) интеграция; б) вертикальная прогрессивная (прямая) интеграция; в) горизонтальная интеграция; г) круговая интеграция.	ПК-3	3.2
		ПК-8	3.1
84.	Процесс снижения риска за счет увеличения разнообразия видов деятельности, рынков сбыта или каналов поставок носит название: а) конвергенция; б) фокусирование; в) диверсификация; г) дифференцирование.	ПК-3	3.2
		ПК-8	3.1
85.	Снижение риска за счет увеличения количества поставщиков, позволяющего ослабить зависимость предприятия от конкретного поставщика, – это: а) диверсификация рынка сбыта (развитие рынка); б) диверсификация видов хозяйственной деятельности; в) диверсификация закупок; г) диверсификация инвестиций.	ПК-3	3.2
		ПК-8	3.1
86.	Снижение риска за счет распределения готовой продукции предприятия между несколькими рынками или контрагентами – это: а) диверсификация рынка сбыта (развитие рынка);	ПК-3	3.2
		ПК-8	3.1

	б) диверсификация видов хозяйственной деятельности; в) диверсификация закупок; г) диверсификация инвестиций.		
87.	Снижение риска за счет расширения ассортимента выпускаемой продукции, оказываемых услуг, спектра используемых технологий – это: а) диверсификация рынка сбыта (развитие рынка); б) диверсификация видов хозяйственной деятельности; в) диверсификация закупок; г) диверсификация инвестиций.	ПК-3	3.2
		ПК-8	3.1
88.	Диссипация риска при формировании инвестиционного портфеля, предполагающего реализацию одновременно нескольких проектов, носит название: а) диверсификация рынка сбыта (развитие рынка); б) диверсификация видов хозяйственной деятельности; в) диверсификация закупок; г) диверсификация инвестиций.	ПК-3	3.2
		ПК-8	3.1
89.	Прогнозирование внешней экономической обстановки, стратегическое планирование, мониторинг социально-экономической и нормативно-правовой среды, создание системы резервов – все это инструментарий: а) методов диссипации риска; б) методов компенсации риска; в) методов уклонения от риска; г) методов локализации риска.	ПК-3	3.2
		ПК-6	3.1
		ПК-6	У.1
		ПК-8	3.1
90.	При использовании метода «Передача риска» покрытие убытка происходит за счет: а) самострахования; б) резервов; в) займа; г) страхования.	ПК-3	3.2
		ПК-6	3.1
		ПК-6	У.1
		ПК-8	3.1
91.	К покрытию убытка на основе страхования прибегают в следующих случаях: а) инвестирование средств страховых фондов в пределах одной деловой единицы; б) сохранение прибыли внутри соответствующей группы; в) получение льгот по налогообложению (которые могут быть предусмотрены в ряде стран); г) если существуют большие совокупности рисков, вероятность реализации которых велика, а суммы предполагаемого ущерба небольшие.	ПК-3	3.2
		ПК-6	3.1
		ПК-6	У.1
		ПК-8	3.1
92.	При покрытии убытка из текущего дохода происходит ли на предприятии создание каких-либо фондов? а) да; б) нет; в) фонды могут быть созданы по решению руководства предприятия.	ПК-3	3.2
		ПК-6	3.1
		ПК-6	У.1
		ПК-8	3.1
93.	Примером покрытия ущерба за счет передачи ответственности на основе договора является: а) хеджирование; б) кэптиновые страховые организации; в) нестраховой пул;	ПК-3	3.2
		ПК-8	3.1

	г) самострахование.		
94.	Основным недостатком кэптиновых компаний является: а) использование этого инструмента возможно только после возникновения ущерба; б) возможность получения покрытия только незначительного ущерба; в) в случае ущерба кэптиновой компании, он распределяется между всеми участниками.	ПК-6	3.1
95.	При выборе метода покрытия убытка за счет использования займа особое внимание следует уделить исследованию: а) величины текущих денежных потоков организации; б) ликвидности и возвратности займа; в) порогового значения вероятного ущерба.	ПК-6	3.1
96.	Кэптиновая компания – это: а) нестраховая компания; б) другое название финансово-промышленной группы; в) это страховая компания, входящая в состав нестраховых организаций; г) компания-спонсор.	ПК-3	3.2
		ПК-8	3.1
97.	Концентрическая диверсификация – это: а) выпуск новых профильных продуктов и пополнение ассортимента товаров новыми образцами, которые с технической и маркетинговой точки зрения имеют сходство с товарами, которые уже выпускаются компанией; б) выпуск новой непрофильной продукции в периоды спада спроса на основную; в) освоение совершенно новых видов деятельности.	ПК-3	3.2
		ПК-8	3.1
98.	Горизонтальная диверсификация – это: а) выпуск новых профильных продуктов и пополнение ассортимента товаров новыми образцами, которые с технической и маркетинговой точки зрения имеют сходство с товарами, которые уже выпускаются компанией; б) выпуск новой непрофильной продукции в периоды спада спроса на основную; в) освоение совершенно новых видов деятельности.	ПК-3	3.2
		ПК-8	3.1
99.	Конгломеративная диверсификация – это: а) выпуск новых профильных продуктов и пополнение ассортимента товаров новыми образцами, которые с технической и маркетинговой точки зрения имеют сходство с товарами, которые уже выпускаются компанией; б) выпуск новой непрофильной продукции в периоды спада спроса на основную; в) освоение совершенно новых видов деятельности.	ПК-3	3.2
		ПК-8	3.1
100.	Контракт, который обязывает купить или продать актив в будущем по фиксированной цене в определённый срок, называется: а) фьючерс; б) опцион; в) контракт-поручительство;	ПК-3	3.2
		ПК-8	3.1

	г) договор факторинга.												
101.	Критерий, характеризующий выбор наиболее надежных видов деятельности с невысокой доходностью (MINI) из всех видов деятельности с высокой эффективностью (MAX), называется критерием	ПК-3	3.1										
102.	Корректирующий коэффициент α , используемый при выборе решения по критерию Гурвица, называется коэффициентом	ПК-3	3.1										
103.	Компромиссным критерием принятия решения в условиях неопределенности, позволяющим принимать решения в промежуточных случаях между крайним оптимизмом и крайним пессимизмом, является критерий	ПК-3	3.1										
104.	В основе критерия лежит предположение, что поскольку о ситуации в будущем ничего не известно, рассматриваемые варианты реализации ситуации можно считать равновероятными	ПК-3	3.1										
105.	Значения стоимости произведенной продукции за анализируемый период составили, тыс. руб.: 100; 126; 220; 150; 121; 200. Определите размах вариации. Ответ запишите числом без указания единиц измерения.	ПК-8	3.1										
106.	Если значение среднеквадратического отклонения показателя составляет 6,55, а среднее значение этого показателя – 24, каково значение коэффициента вариации? Ответ запишите числом с точностью до 2 знаков после запятой без указания единиц измерения.	ПК-8	3.1										
107.	Если убыток от осуществления операции составил 1 млн. руб., а величина собственных финансовых ресурсов – 15 млн. руб., то коэффициент риска составит _____. Ответ запишите числом с точностью до 3 знаков после запятой без указания единиц измерения.	ПК-8	3.1										
108.	Как характеризуется уровень риска акции при значении бета-коэффициента больше 1? Уровень риска_____.	ОПК-2	У.4										
109.	Представлен вариант вложения капитала, имеющий следующие характеристики: Средняя величина дохода составляет 50 тыс. руб. Доход при этом колеблется от 25 тыс. руб. до 75 тыс. руб. Вероятность получения дохода в размере 25 тыс. руб. – 0,4; вероятность получения дохода в размере 75 тыс. руб. – 0,3. Рассчитать коэффициент вариации. Ответ запишите числом с точностью до 1 знака после запятой без указания единиц измерения.	ПК-8	У.1										
110.	Имеется инвестиционный проект, величина планируемого дохода (тыс. руб.) по которому приведена в виде распределения вероятностей (см. таблицу). Определить математическое ожидание дохода (тыс. руб.). <table><tr><td>Доход, тыс. руб.</td><td>Вероятность</td></tr><tr><td>2500</td><td>0,15</td></tr><tr><td>3000</td><td>0,20</td></tr><tr><td>3500</td><td>0,35</td></tr><tr><td>5000</td><td>0,20</td></tr></table>	Доход, тыс. руб.	Вероятность	2500	0,15	3000	0,20	3500	0,35	5000	0,20	ПК-8	У.1
Доход, тыс. руб.	Вероятность												
2500	0,15												
3000	0,20												
3500	0,35												
5000	0,20												

	6000	0,10		
	Ответ запишите целым числом без указания единиц измерения.			
111.	Хозяйствующий субъект решил заключить трехмесячный срочный форвардный контракт на покупку 10 тыс. долл. США по форвардному курсу 77,20 руб. за 1 долл. Следовательно, затраты на покупку валюты по контракту составили 772 тыс. руб. Рассмотрите процесс хеджирования с помощью форвардной операции и определите экономию денежных ресурсов (в рублях), если через три месяца на день исполнения контракта курс составит 77,80 руб. за долл. Ответ запишите целым числом без указания единиц измерения.		ПК-3	У.2
112.	Интеграция, подразумевающая объединение с посредниками, образующими дистрибьюторскую сеть по сбыту продукции предприятия, – это вертикальная _____ интеграция.		ПК-6	У.2
113.	Ценная бумага, дающая покупателю право, но не обязательство, купить или продать указанный актив по определенной цене до определенной даты, называется _____.		ПК-6	3.1
114.	Контракт, который обязывает купить или продать актив в будущем по фиксированной цене в определённый срок, называется _____.		ПК-6	3.1
115.	Объединение организаций, осуществляющих разные виды деятельности для достижения совместных стратегических целей, – это _____ интеграция.		ПК-6	3.1
116.	Согласно данным бизнес-плана, чистый денежный приток по проекту составит 1300 тыс. руб. Расчеты показали, что при уменьшении физического объема реализации на 5% чистый денежный приток составит 1040 тыс. руб. Какова чувствительность проекта к изменению физического объема продаж (в процентах)? Ответ запишите целым числом без указания единиц измерения.		ОПК-2	У.4
117.	При использовании такого метода анализа ассортиментного ряда выпускаемой продукции, как АВС-анализ, в какую группу товаров –А, В или С – относят товары с максимальной долей в общем объеме реализованной продукции? В ответе укажите только код группы товаров А, В или С.		ОПК-2	У.4
118.	Если предприятие, имеющее значение эффекта производственного левериджа, равное 7, увеличит выручку от реализации на 1%, то при этом его прибыль от продаж вырастет на%.		ОПК-2	У.4
119.	Методы от риска предполагают исключение рисков-вых ситуаций из бизнеса		ПК-6	У.1
120.	Риск увеличения темпов инфляции представляет собой..... риск		ОПК-2	3.4

5.3.2.2. Вопросы для устного опроса

№	Содержание	Компетенция	ИДК
1	Дайте определение неопределенности	ОПК-2	3.4
		ПК-3	3.2
2	Что такое истинная неопределенность?	ОПК-2	3.4
		ПК-3	3.2
3	Что такое системная неопределенность?	ОПК-2	3.4
		ПК-3	3.2
4	Чем вызывается информационная неопределенность?	ОПК-2	3.4
		ПК-3	3.2
5	Какова прогнозируемость будущего в условиях полной неопределенности?	ОПК-2	3.4
		ПК-3	3.2
6	Что такое частичная неопределенность?	ОПК-2	3.4
		ПК-3	3.2
7	Какова возможность прогнозировать события в будущем в условиях полной определенности?	ОПК-2	3.4
		ПК-3	3.2
8	В чем суть информационного подхода к различию между риском и неопределенностью?	ОПК-2	3.4
9	В чем суть оценочного подхода к различию между риском и неопределенностью?	ОПК-2	3.4
10	Каковы основные концепции к пониманию риска?	ОПК-2	3.4
11	В чем суть концепции объективной природы риска?	ОПК-2	3.4
12	В чем суть концепции субъективной природы риска?	ОПК-2	3.4
	В чем суть концепции объективно-субъективной природы риска?	ОПК-2	3.4
13	Назовите факторы риска.	ОПК-2	3.4
		ПК-3	3.2
14	В чем проявляется аналитическая функция риска?	ОПК-2	3.4
15	В чем суть инновационной функции риска?	ОПК-2	3.4
16	В чем проявляется регулятивная функция риска?	ОПК-2	3.4
17	В чем суть защитной функции риска?	ОПК-2	3.4
18	Приведите пример внутренних рисков по отношению к предприятию.	ОПК-2	3.4
		ПК-3	3.2
19	Приведите пример внешних рисков по отношению к предприятию.	ОПК-2	3.4
		ПК-3	3.2
20	Какие выделяют риски по возможности страхования?	ОПК-2	3.4
21	Что такое чистые риски?	ОПК-2	3.4
		ПК-3	3.2
22	В чем суть спекулятивных рисков?	ОПК-2	3.4
		ПК-3	3.2
23	Какие риски выделяют по времени возникновения?	ОПК-2	3.4
		ПК-3	3.2
24	Какие риски выделяют по сфере деятельности?	ОПК-2	3.4
		ПК-3	3.2
25	Какими из двух групп рисков можно управлять – системными или несистемными?	ОПК-2	3.4
		ПК-3	3.2
26	Назовите возможные причины возникновения производственных рисков.	ОПК-2	3.4
		ПК-3	3.2
27	Что такое производственный риск?	ОПК-2	3.4

		ПК-3	3.2
28	Назовите основные причины коммерческого риска	ОПК-2	3.4
		ПК-3	3.2
29	С чем связаны финансовые риски?	ОПК-2	3.4
		ПК-3	3.2
30	В чем суть риска упущенной выгоды?	ОПК-2	3.4
31	К какому виду риска – производственному или коммерческому - относится риск, связанный с транспортировкой товара?	ОПК-2	3.4
		ПК-3	3.2
32	К какому виду риска относится увеличение материальных затрат из-за перерасхода материалов и сырья?	ОПК-2	3.4
		ОПК-2	У.4
		ПК-3	3.2
33	Что показывает среднеквадратическое отклонение при оценке риска?	ОПК-2	3.4
		ОПК-2	У.4
34	Что вы понимаете под вероятностью наступления события?	ОПК-2	3.4
35	Какой показатель показывает, как курс ценной бумаги реагирует на изменения рынка в целом?	ОПК-2	3.4
36	В чем суть критерия МАХІМАХ при выборе оптимального решения?	ОПК-2	3.4
37	В чем отличие критерия Лапласа от критерия среднего выигрыша?	ОПК-2	3.4
38	Когда применяется метод аналогий при оценке риска?	ОПК-2	3.4
39	В чем суть SWOT- анализа?	ОПК-2	3.4
		ПК-3	У.2
40	Каковы цели количественной оценки риска?	ОПК-2	3.4
41	Для чего составляется карта рисков?	ОПК-2	3.4
42	Как вы понимаете уровень толерантности к риску?	ОПК-2	3.4
43	В чем суть метода чувствительности критических соотношений?	ОПК-2	3.4
44	Что такое критический объем производства?	ОПК-2	3.4
		ОПК-2	У.4
45	Что такое запас экономической прочности?	ОПК-2	3.4
		ОПК-2	У.4
46	В чем заключается эффект производственного левириджа?	ОПК-2	3.4
47	Анализ каких факторов включает PEST-анализ?	ОПК-2	3.4
		ПК-3	У.2
48	Что такое сокращение риска?	ПК-8	3.1
49	Что такое передача риска?	ПК-8	3.1
50	Какие методы управления рисками относят к дособытийным?	ПК-8	3.1
51	Какие методы управления риском относят к послесобытийным?	ПК-8	3.1
52	В чем заключается принцип результативности системы риск-менеджмента?	ПК-6	3.1
		ПК-8	3.1
53	Приведите пример передачи риска.	ПК-8	3.1
54	Что такое опцион?	ПК-8	3.1
55	Назовите отличие опциона от фьючерса.	ПК-8	3.1
56	В каких случаях используются методы локализации риска?	ПК-8	3.1
		ПК-8	Н.1
57	В чем заключается диссипация риска при формировании инвестиционного портфеля?	ПК-8	3.1
		ПК-8	У.1

58	Приведите пример методов компенсации риска.	ПК-8	3.1
59	В каких случаях можно покрывать убыток из текущего дохода?	ПК-8	3.1
60	В чем суть самострахования?	ПК-8	3.1
61	Как рассчитать коэффициент вариации?	ПК-8	3.1
62	Как интерпретировать значение бета-коэффициента?	ПК-8	У.1
		ПК-8	Н.1
63	Как рассчитать среднеквадратическое отклонение?	ОПК-2	Н.1
64	Какой метод вы можете предложить для оценки рисков решений, имеющих обозримое количество вариантов развития?	ОПК-2	Н.1
65	На каком уровне вы оцените риск принятия управленческого решения, в результате которого потери не превысят ожидаемой прибыли?	ПК-6	3.1
		ПК-6	У.1
		ПК-6	Н.1
66	На каком уровне вы оцените риск принятия управленческого решения, в результате которого потери значительно превысят ожидаемую прибыль?	ПК-6	3.1
		ПК-6	У.1
		ПК-6	Н.1
67	Как можно оценить эффективность системы управления рисками, если за анализируемый период риски не реализовались, а расходы на функционирование системы управления рисками были осуществлены?	ПК-6	3.1
		ПК-6	У.1
		ПК-6	Н.1

5.3.2.3. Задачи для проверки умений и навыков

№	Содержание	Компетенция	ИДК																								
1	Имеются два инвестиционных проекта с одинаковой прогнозной суммой требуемых капитальных вложений. Величина планируемого дохода не определена и приведена в виде распределения вероятностей (табл.). Оценить рискованность каждого проекта, используя критерий отбора – «максимизация математического ожидания дохода». Характеристика проектов по доходам и вероятностям его получения: Инвестиционный проект 1 <table><tr><th>Доход, тыс. руб.</th><th>Вероятность</th></tr><tr><td>2500</td><td>0,15</td></tr><tr><td>3000</td><td>0,20</td></tr><tr><td>3500</td><td>0,35</td></tr><tr><td>5000</td><td>0,20</td></tr><tr><td>6000</td><td>0,10</td></tr></table> Инвестиционный проект 2 <table><tr><th>Доход, тыс. руб.</th><th>Вероятность</th></tr><tr><td>1500</td><td>0,10</td></tr><tr><td>2500</td><td>0,15</td></tr><tr><td>4000</td><td>0,30</td></tr><tr><td>5000</td><td>0,30</td></tr><tr><td>7000</td><td>0,15</td></tr></table>	Доход, тыс. руб.	Вероятность	2500	0,15	3000	0,20	3500	0,35	5000	0,20	6000	0,10	Доход, тыс. руб.	Вероятность	1500	0,10	2500	0,15	4000	0,30	5000	0,30	7000	0,15	ОПК-2	У.4
		Доход, тыс. руб.	Вероятность																								
		2500	0,15																								
		3000	0,20																								
		3500	0,35																								
		5000	0,20																								
		6000	0,10																								
Доход, тыс. руб.	Вероятность																										
1500	0,10																										
2500	0,15																										
4000	0,30																										
5000	0,30																										
7000	0,15																										
ОПК-2	Н.4																										
ПК-3	У.2																										
ПК-3	Н.2																										
ПК-8	У.1																										
ПК-8	Н.1																										
2	Имеется два альтернативных варианта финансовых вложений с характеристиками, представленными в таблице.	ОПК-2	У.4																								

	Оцените варианты финансовых вложений инвестора с целью минимизации риска, используя методику вероятного распределения доходности.			ОПК-2	Н.4										
				ПК-3	У.2										
				ПК-3	Н.2										
				ПК-8	У.1										
				ПК-8	Н.1										
3	Известно, что при вложении капитала в проект А из 120 случаев прибыль 13 тыс. руб. была получена в 48 случаях (вероятность 0,4), прибыль 20 тыс. руб. – в 42 случаях (вероятность 0,35) и прибыль 12 тыс. руб. – в 30 случаях (вероятность 0,25). При вложении капитала в проект Б прибыль в размере 15 тыс. руб. была получена в 24 случаях, 20 тыс. руб. – в 40 случаях, 28 тыс. руб. – в 16 случаях. Рассчитать среднее ожидаемое значение прибыли по двум проектам, а также оценить колеблемость возможного результата с помощью среднего квадратического отклонения и коэффициента вариации.			ОПК-2	У.4										
				ОПК-2	Н.4										
				ПК-3	У.2										
				ПК-3	Н.2										
				ПК-8	У.1										
				ПК-8	Н.1										
4	Известно, что в 2015 году на серверы вашей компании было осуществлено 245 DDoS-атак, в 2016 году – 315, в 2017 году – 298, в 2018 году – 306, в 2019 году – 379, в 2020 году – 376. Как специалист по информационной безопасности, используя метод экстраполяции по сложившемуся среднегодовому темпу роста числа атак, сделайте прогноз относительно числа DDoS-атак на серверы вашей компании в 2021 году.			ОПК-2	У.4										
				ОПК-2	Н.4										
				ПК-3	У.2										
				ПК-3	Н.2										
				ПК-8	У.1										
				ПК-8	Н.1										
5	Специалисты отдела анализа угроз обследовали 4 компании и получили следующие результаты о зависимости между количеством каналов утечек и нанесенным ущербом: <table><tr><td>Количество каналов утечек (шт.)</td><td>Нанесенный ущерб (тыс. руб.)</td></tr><tr><td>3</td><td>95</td></tr><tr><td>4</td><td>120</td></tr><tr><td>5</td><td>145</td></tr><tr><td>6</td><td>190</td></tr></table> Как специалист по информационной безопасности, используя простую модель линейной регрессии, найдите прогнозное значение возможного ущерба, если в компании число каналов утечек будет сведено до 2.	Количество каналов утечек (шт.)	Нанесенный ущерб (тыс. руб.)	3	95	4	120	5	145	6	190			ОПК-2	У.4
		Количество каналов утечек (шт.)	Нанесенный ущерб (тыс. руб.)												
		3	95												
		4	120												
		5	145												
		6	190												
				ОПК-2	Н.4										
				ПК-3	У.2										
				ПК-3	Н.2										
				ПК-8	У.1										
		ПК-8	Н.1												
6	Необходимо предоставить руководителю компании отчет о достоверности прогнозов в 1 полугодии 2021 года, если за анализируемый период специалисты по информационной безопасности прогнозировали появление 48 новых видов вредоносных программ, а в итоге системой мониторинга было обнаружено 62 новых вида вредоносных программ, причем 40 из них совпал с прогнозами специалистов.			ОПК-2	У.4										
				ОПК-2	Н.4										
				ПК-3	У.2										
				ПК-3	Н.2										
				ПК-6	У.1										
				ПК-6	Н.1										
				ПК-8	У.1										

		ПК-8	Н.1																															
7	По оценкам отдела анализа уязвимостей, вероятность роста числа DDoS-атак в ближайшее время равна 0,85. Из прошлого опыта известно, что положительные прогнозы отдела анализа уязвимостей компании сбываются в 75% случаях, а отрицательные – в 60% случаях. Как специалист по информационной безопасности, используя метод дерева вероятностей, определите вероятность роста числа DDoS-атак в ближайшее время для предоставления этих данных руководству компании.	ОПК-2	У.4																															
		ОПК-2	Н.4																															
		ПК-3	У.2																															
		ПК-3	Н.2																															
		ПК-8	У.1																															
		ПК-8	Н.1																															
8	Специалисты отдела анализа угроз обследовали 4 компании и получили следующие результаты о зависимости между количеством каналов утечек и нанесенным ущербом: <table><tr><th>Количество каналов утечек (шт.)</th><th>Нанесенный ущерб (тыс. руб.)</th></tr><tr><td>1</td><td>250</td></tr><tr><td>3</td><td>435</td></tr><tr><td>4</td><td>470</td></tr><tr><td>6</td><td>680</td></tr></table> Используя линейную интерполяцию, найдите значение возможного ущерба, если в компании имеется 5 каналов утечек.	Количество каналов утечек (шт.)	Нанесенный ущерб (тыс. руб.)	1	250	3	435	4	470	6	680	ОПК-2	У.4																					
		Количество каналов утечек (шт.)	Нанесенный ущерб (тыс. руб.)																															
		1	250																															
		3	435																															
		4	470																															
		6	680																															
ОПК-2	Н.4																																	
ПК-3	У.2																																	
ПК-3	Н.2																																	
ПК-8	У.1																																	
ПК-8	Н.1																																	
9	Известно число утечек конфиденциальной информации из государственных органов региона за последние 5 месяцев: <table><tr><th>Месяц</th><th>Число утечек</th></tr><tr><td>1</td><td>12</td></tr><tr><td>2</td><td>8</td></tr><tr><td>3</td><td>13</td></tr><tr><td>4</td><td>13</td></tr><tr><td>5</td><td>17</td></tr></table> На 1-ый месяц специалистами по информационной безопасности был дан прогноз – 14 утечек конфиденциальной информации. Используя простую модель экспоненциального сглаживания, дайте прогноз относительно числа утечек на 6-ой месяц, если задана константа сглаживания $\alpha = 0,65$.	Месяц	Число утечек	1	12	2	8	3	13	4	13	5	17	ОПК-2	У.4																			
		Месяц	Число утечек																															
		1	12																															
		2	8																															
		3	13																															
		4	13																															
5	17																																	
ОПК-2	Н.4																																	
ПК-3	У.2																																	
ПК-3	Н.2																																	
ПК-8	У.1																																	
ПК-8	Н.1																																	
10	Имеется набор данных о доходности проектов в нескольких отраслях. Определите, какой из проектов может быть признан наименее рискованным (критерий MINIMIN) в условиях отсутствия количественных оценок риска? Информация об эффективности проектов в различных отраслях, % <table><tr><th colspan="2" rowspan="2">Информации о проектах в различных отраслях</th><th colspan="4">Серия проектов в отрасли</th></tr><tr><th>1</th><th>2</th><th>3</th><th>4</th></tr><tr><td rowspan="4">Отрасль</td><td>А</td><td>15,3</td><td>9,2</td><td>15,7</td><td>10,4</td></tr><tr><td>Б</td><td>15,5</td><td>16,7</td><td>8,3</td><td>12,8</td></tr><tr><td>В</td><td>21,4</td><td>11</td><td>15,4</td><td>24,2</td></tr><tr><td>Г</td><td>9,8</td><td>20</td><td>13,6</td><td>15,2</td></tr></table>	Информации о проектах в различных отраслях		Серия проектов в отрасли				1	2	3	4	Отрасль	А	15,3	9,2	15,7	10,4	Б	15,5	16,7	8,3	12,8	В	21,4	11	15,4	24,2	Г	9,8	20	13,6	15,2	ОПК-2	У.4
				Информации о проектах в различных отраслях		Серия проектов в отрасли																												
		1	2			3	4																											
		Отрасль	А	15,3	9,2	15,7	10,4																											
			Б	15,5	16,7	8,3	12,8																											
			В	21,4	11	15,4	24,2																											
			Г	9,8	20	13,6	15,2																											
		ОПК-2	Н.4																															
ПК-3	У.2																																	
ПК-3	Н.2																																	
ПК-6	У.1																																	
ПК-6	Н.1																																	
ПК-8	У.1																																	
ПК-8	Н.1																																	
11	Имеется набор данных о доходности проектов в нескольких отраслях. Определите, какой из проектов может быть выбран инвестором, использующим критерий MINIMAX?	ОПК-2	У.4																															
		ОПК-2	Н.4																															

	Информация об эффективности проектов в различных отраслях, %						ПК-3	У.2
	Информация о проектах в различных отраслях		Серия проектов в отрасли				ПК-3	Н.2
			1	2	3	4	ПК-6	У.1
	Отрасль	А	15,3	9,2	15,7	10,4	ПК-6	Н.1
		Б	15,5	16,7	8,3	12,8	ПК-8	У.1
		В	21,4	11	15,4	24,2	ПК-8	Н.1
		Г	9,8	20	13,6	15,2		
12	Имеется набор данных о доходности проектов в нескольких отраслях. Определите, какой из проектов может быть выбран инвестором, использующим критерий MAXIMIN?						ОПК-2	У.4
	Информация об эффективности проектов в различных отраслях, %						ОПК-2	Н.4
	Информация о проектах в различных отраслях		Серия проектов в отрасли				ПК-3	У.2
			1	2	3	4	ПК-3	Н.2
	Отрасль	А	15,3	9,2	15,7	10,4	ПК-6	У.1
		Б	15,5	16,7	8,3	12,8	ПК-6	Н.1
		В	21,4	11	15,4	24,2	ПК-8	У.1
		Г	9,8	20	13,6	15,2	ПК-8	Н.1
13	Имеется набор данных о доходности проектов в нескольких отраслях. Определите, какой из проектов может быть выбран инвестором, использующим критерий MAXIMAX?						ОПК-2	У.4
	Информация об эффективности проектов в различных отраслях, %						ОПК-2	Н.4
	Информация о проектах в различных отраслях		Серия проектов в отрасли				ПК-3	У.2
			1	2	3	4	ПК-3	Н.2
	Отрасль	А	15,3	9,2	15,7	10,4	ПК-6	У.1
		Б	15,5	16,7	8,3	12,8	ПК-6	Н.1
		В	21,4	11	15,4	24,2	ПК-8	У.1
		Г	9,8	20	13,6	15,2	ПК-8	Н.1

5.3.2.4. Перечень тем рефератов, контрольных, расчетно-графических работ

Не предусмотрены

5.3.2.5. Вопросы для контрольной (расчетно-графической) работы

Не предусмотрены

5.4. Система оценивания достижения компетенций

5.4.1. Оценка достижения компетенций в ходе промежуточной аттестации

Компетенция ОПК-2 Способен осуществлять сбор, анализ и использование данных хозяйственного, налогового и бюджетного учетов, учетной документации, бухгалтерской (финансовой), налоговой и статистической отчетности в целях оценки эффективности и прогнозирования финансово-хозяйственной деятельности хозяйствующего субъекта, а также выявления, предупреждения, локализации и нейтрализации внутренних и внешних угроз и рисков			
Индикаторы достижения компетенции ОПК-2		Номера вопросов и задач	
Код	Содержание	вопросы к экзамену	задачи к экзамену
3.4	Знать основные индикаторы и показатели, применяемые при разработке планов развития организации, с использованием которых выявляются угрозы экономической безопасности	1-26, 31-46	
У.4	Уметь на основе анализа данных хозяйственного, налогового и бюджетного учетов, учетной документации, бухгалтерской (финансовой), налоговой и статистической отчетности оценивать влияние рисков на эффективность финансово-хозяйственной деятельности хозяйствующего субъекта		1-3, 5-6
Н.4	Иметь навыки использования современных методов сбора, обработки и анализа данных хозяйственного, налогового и бюджетного учетов, учетной документации, бухгалтерской (финансовой), налоговой и статистической отчетности в целях оценки влияния рисков на эффективность финансово-хозяйственной деятельности хозяйствующего субъекта		1-6
Компетенция ПК-3 Способен составлять прогнозы динамики основных экономических показателей деятельности хозяйствующих субъектов с учетом возможных экономических рисков и угроз экономической безопасности			
Индикаторы достижения компетенции ПК-3		Номера вопросов и задач	
Код	Содержание	вопросы к экзамену	задачи к экзамену
3.2	Знать основные экономические показатели деятельности хозяйствующих субъектов, используемые для оценки и управления рисками	9-14, 18-37, 40-41, 46	
У.2	Уметь применять типовые методики прогнозирования рисков в деятельности хозяйствующих субъектов		1-12
Н.2	Иметь навыки составления прогнозов возможных экономических рисков в деятельности хозяйствующих субъектов		1-3, 5-12
Компетенция ПК-6 Способен контролировать эффективность работы сотрудников и подразделений в сфере управления рисками			
Индикаторы достижения компетенции ПК-6		Номера вопросов и задач	
3.1	Знать ключевые показатели и методики оценки эффективности работы сотрудников и подразделений в сфере управления рисками	17, 38-39	
У.1	Уметь применять методики оценки эффективности работы сотрудников и подразделений в сфере управления рисками		1, 6-8
Н.1	Иметь навыки определения ключевых показателей, позволяющих оценивать эффективность работы сотрудников и		9

	подразделений в сфере управления рисками		
Компетенция ПК-8 Способен применять методы проведения прикладных научных исследований в целях определения потенциальных и реальных угроз экономической безопасности организации			
Индикаторы достижения компетенции ПК-8		Номера вопросов и задач	
3.1	Знать методы оценки рисков в деятельности предприятий	18-37, 40-41	
У.1	Уметь анализировать и обрабатывать результаты, полученные при исследовании рисков на предприятии		4-6, 11-12
Н.1	Иметь навыки определения потенциальных и реальных угроз экономической безопасности на основе оценки рисков в деятельности предприятий		4-6, 11-12

5.4.2. Оценка достижения компетенций в ходе текущего контроля

Компетенция ОПК-2 Способен осуществлять сбор, анализ и использование данных хозяйственного, налогового и бюджетного учетов, учетной документации, бухгалтерской (финансовой), налоговой и статистической отчетности в целях оценки эффективности и прогнозирования финансово-хозяйственной деятельности хозяйствующего субъекта, а также выявления, предупреждения, локализации и нейтрализации внутренних и внешних угроз и рисков				
Индикаторы достижения компетенции ОПК-2		Номера вопросов и задач		
Код	Содержание	тесты	вопросы для устного опроса	задачи для проверки умений и навыков
3.4	Знать основные индикаторы и показатели, применяемые при разработке планов развития организации, с использованием которых выявляются угрозы экономической безопасности	1-27, 30-38, 61-66	1-47, 63-64	
У.4	Уметь на основе анализа данных хозяйственного, налогового и бюджетного учетов, учетной документации, бухгалтерской (финансовой), налоговой и статистической отчетности оценивать влияние рисков на эффективность финансово-хозяйственной деятельности хозяйствующего субъекта	5-10, 12, 15-20	32-33, 44-45	1-13
Н.4	Иметь навыки использования современных методов сбора, обработки и анализа данных хозяйственного, налогового и бюджетного учетов, учетной документации, бухгалтерской (финансовой), налоговой и статистической отчетности в целях оценки влияния рисков на эффективность финансово-хозяйственной деятельности хозяйствующего субъекта	21, 47, 50-51, 60		1-13
Компетенция ПК-3 Способен составлять прогнозы динамики основных экономических показателей деятельности хозяйствующих субъектов с учетом возможных экономических рисков и угроз экономической безопасности				
Индикаторы достижения компетенции ПК-3		Номера вопросов и задач		
Код	Содержание	тесты	вопросы для устного	задачи для провер-

			опроса	ки уме- ний и навыков
3.2	Знать основные экономические показатели деятельности хозяйствующих субъектов, используемые для оценки и управления рисками	28-38, 44, 54, 58, 75- 100	1-7, 13, 18-19, 21- 29, 31-32	
У.2	Уметь применять типовые методики прогнозирования рисков в деятельности хозяйствующих субъектов	21-23, 28, 44	39,47	1-13
Н.2	Иметь навыки составления прогнозов возможных экономических рисков в деятельности хозяйствующих субъектов			1-13
Компетенция ПК-6 Способен контролировать эффективность работы сотрудников и подразделений в сфере управления рисками				
Индикаторы достижения компетенции ПК-6		Номера вопросов и задач		
Код	Содержание	тесты	вопросы для устно- го опроса	задачи для про- верки умений и навы- навы- ков
3.1	Знать ключевые показатели и методики оценки эффективности работы сотрудников и подразделений в сфере управления рисками	89-92	52, 65-67	
У.1	Уметь применять методики оценки эффективности работы сотрудников и подразделений в сфере управления рисками	89-92	65-67	6, 10- 13
Н.1	Иметь навыки определения ключевых показателей, позволяющих оценивать эффективность работы сотрудников и подразделений в сфере управления рисками		65-67	6, 10- 13
Компетенция ПК-8 Способен применять методы проведения прикладных научных исследований в целях определения потенциальных и реальных угроз экономической безопасности организации				
Индикаторы достижения компетенции ПК-8		Номера вопросов и задач		
Код	Содержание	тесты	вопросы для уст- ного опроса	задачи для провер- ки уме- ний и навыков
3.1	Знать методы оценки рисков в деятельности предприятий	39-43, 45- 60, 67-100	48-62	
У.1	Уметь анализировать и обрабатывать результаты, полученные при исследовании рисков на предприятии	39-48, 52- 59, 67-69, 71	57, 62	1-13
Н.1	Иметь навыки определения потенциальных и реальных угроз экономической безопасности на основе оценки рисков в деятельности предприятий		56	1-13

6. Учебно-методическое обеспечение дисциплины

6.1. Рекомендуемая литература

Тип рекоменда- ций	Перечень и реквизиты литературы (автор, название, год и место издания)	Количество экз. в биб- лиотеке
1	2	3
2.1. Учебные издания	Авдийский В. И. Проектирование систем управления рисками хозяйствующих субъектов [электронный ресурс]: Учебное пособие / В. И. Авдийский, В. М. Безденежных, А. В. Дадалко, В.В. Земсков, Н. Г. Синявский; Артнис - Москва: ООО "Научно-издательский центр ИНФРА-М", 2022 - 203 с. [ЭИ] [ЭБС Знаниум] URL: https://znanium.com/catalog/document?id=400713	-
	Авдийский В. И. Риски хозяйствующих субъектов: теоретические основы, методологии анализа, прогнозирования и управления [электронный ресурс]: Учебное пособие / В. И. Авдийский, В. М. Безденежных - Москва: Издательский дом "Альфа-М", 2018 - 368 с. [ЭИ] [ЭБС Знаниум] URL: https://znanium.com/catalog/document?id=369980	-
	Балдин К. В. Управление рисками в инновационно-инвестиционной деятельности предприятия [электронный ресурс]: Учебное пособие / К. В. Балдин, И. И. Передеряев, Р. С. Голов; Российская таможенная академия; МПСУ ОАНО ВО - Москва: Издательско-торговая корпорация "Дашков и К", 2023 - 418 с. [ЭИ] [ЭБС Знаниум] URL: https://znanium.com/catalog/document?id=432119	-
	Савицкая Г. В. Анализ эффективности и рисков предпринимательской деятельности: Методологические аспекты: [электронный ресурс]: Монография / Г. В. Савицкая - Москва: ООО "Научно-издательский центр ИНФРА-М", 2022 - 291 с. [ЭИ] [ЭБС Знаниум] URL: https://znanium.com/catalog/document?id=391394	-
	Серебрякова Т. Ю. Риски организации: их учет, анализ и контроль [электронный ресурс]: Монография / Т. Ю. Серебрякова, О. Г. Гордеева - Москва: ООО "Научно-издательский центр ИНФРА-М", 2020 - 233 с. [ЭИ] [ЭБС Знаниум] URL: https://znanium.com/catalog/document?id=353522	-
	Шапкин А. С. Экономические и финансовые риски. Оценка, управление, портфель инвестиций [электронный ресурс]: Учебное пособие / А. С. Шапкин, В. А. Шапкин; Новосибирский национальный исследовательский государственный университет - Москва: Издательско-торговая корпорация "Дашков и К", 2023 - 538 с. [ЭИ] [ЭБС Знаниум] URL: https://znanium.com/catalog/document?id=429160	-
2.2. Методические издания	Оценка и управление рисками [Электронный ресурс]: методические указания по освоению дисциплины и самостоятельной работе для обучающихся по специальности 38.05.01 «Экономическая безопасность» / Воронежский государственный аг-	1

Тип рекоменда- ций	Перечень и реквизиты литературы (автор, название, год и место издания)	Количество экз. в биб- лиотеке
1	2	3
	рарный университет ; [сост. Л. Д. Панкратова] - Воронеж: Во- ронезский государственный аграрный университет, 2022 [ПТ] URL: http://catalog.vsau.ru/elib/metod/m167786.pdf	
2.3. Периодиче- ские издания	АПК : экономика, управление: ежемесячный теоретический и научно-практический журнал - Москва: Агропромиздат, 1988-	1
	Вестник Воронежского государственного аграрного универ- ситета: теоретический и научно-практический журнал / Воро- неж. гос. аграр. ун-т - Воронеж: ВГАУ, 1998-	1
	Проблемы современной экономики: Евразийский междуна- родный научно-аналитический журнал / Учредитель : ООО "НПК "РОСТ" - Санкт-Петербург: НПК "РОСТ", 2012	1
	Экономический анализ: Теория и практика: научно- практический и аналитический журнал - Москва: Финанс- пресс, 2007-	1

6.2. Ресурсы сети Интернет

6.2.1. Электронные библиотечные системы

№	Название	Размещение
1	Лань	https://e.lanbook.com
2	ZNANIUM.COM	http://znanium.com/
3	Национальная электронная библиотека (НЭБ)	https://rusneb.ru/
4	E-library	https://elibrary.ru/
5	Электронная библиотека ВГАУ	http://library.vsau.ru/

6.2.2. Профессиональные базы данных и информационные системы

№	Название	Адрес доступа
1	Единая межведомственная информационно- статистическая система	https://fedstat.ru/
2	База данных показателей муниципальных образо- ваний	http://www.gks.ru/free_doc/new_sit_e/bd_munst/munst.htm
3	База данных ФАОСТАТ	http://www.fao.org/faostat/ru/
4	Портал открытых данных РФ	https://data.gov.ru/
5	Портал государственных услуг	https://www.gosuslugi.ru/
6	Единая информационная система в сфере закупок	http://zakupki.gov.ru
7	Электронный сервис "Прозрачный бизнес"	https://pb.nalog.ru
8	Справочная правовая система Консультант Плюс	http://www.consultant.ru/
9	Справочная правовая система Гарант	http://ivo.garant.ru
10	Федеральная государственная система территори- ального планирования	https://fgistp.economy.gov.ru/
11	Аграрная российская информационная система.	http://www.aris.ru/
12	Информационная система по сельскохозяйствен- ным наукам и технологиям	http://agris.fao.org/

6.2.3. Сайты и информационные порталы

Не предусмотрены.

7. Материально-техническое и программное обеспечение дисциплины

7.1. Помещения для ведения образовательного процесса и оборудование

Наименование помещений для проведения всех видов учебной деятельности, предусмотренной учебным планом, в том числе помещения для самостоятельной работы, с указанием перечня основного оборудования, учебно-наглядных пособий и используемого программного обеспечения	Адрес (местоположение) помещений для проведения всех видов учебной деятельности, предусмотренной учебным планом (в случае реализации образовательной программы в сетевой форме дополнительно указывается наименование организации, с которой заключен договор)
Учебная аудитория для проведения учебных занятий: комплект учебной мебели, демонстрационное оборудование и учебно-наглядные пособия, презентационное оборудование, используемое программное обеспечение: MS Windows; Office MS Windows / Open Office; Adobe Reader / DjVu Reader; Яндекс Браузер / Mozilla Firefox / Internet Explorer; DrWeb ES; 7-Zip; Media Player Classic	394087, Российская Федерация, Воронежская область, городской округ город Воронеж, город Воронеж, улица Мичурина, дом 1
Учебная аудитория для проведения учебных занятий: комплект учебной мебели, демонстрационное оборудование и учебно-наглядные пособия, компьютеры в аудитории с выходом в локальную сеть и Интернет; доступ к справочно-правовым системам «Гарант» и «Консультант Плюс»; электронные учебно-методические материалы; видеопроекционное оборудование для презентаций; используемое программное обеспечение: MS Windows; Office MS Windows / Open Office; Adobe Reader / DjVu Reader; Яндекс Браузер / Mozilla Firefox / Internet Explorer; DrWeb ES; 7-Zip; Media Player Classic	394087, Российская Федерация, Воронежская область, городской округ город Воронеж, город Воронеж, улица Мичурина, дом 1
Учебная аудитория для проведения учебных занятий: текущего контроля и промежуточной аттестации: комплект учебной мебели, демонстрационное оборудование и учебно-наглядные пособия, компьютерная техника с возможностью подключения к сети «Интернет» и обеспечением доступа в электронную информационно-образовательную среду, используемое программное обеспечение: MS Windows; Office MS Windows / Open Office; Adobe Reader / DjVu Reader; Яндекс Браузер / Mozilla Firefox / Internet Explorer; DrWeb ES; 7-Zip; Media Player Classic, AST Test	394087, Российская Федерация, Воронежская область, городской округ город Воронеж, город Воронеж, улица Мичурина, дом 1
Учебная аудитория для проведения учебных занятий: групповых и индивидуальных консультаций: комплект учебной мебели, компьютеры, принтеры, сканер, используемое программное обеспечение: MS Windows; Office MS Windows / Open Office; Adobe Reader / DjVu Reader; Яндекс Браузер / Mozilla Firefox / Internet Explorer; DrWeb ES; 7-Zip; Media Player Classic	394087, Российская Федерация, Воронежская область, городской округ город Воронеж, город Воронеж, улица Мичурина, дом 1
Помещение для самостоятельной работы: комплект учебной мебели, компьютерная техника с возможностью под-	394087, Российская Федерация, Воронежская область, городской

ключения к сети "Интернет" и обеспечением доступа в электронную информационно-образовательную среду, используемое программное обеспечение: MS Windows; Office MS Windows / Open Office; Adobe Reader / DjVu Reader; Яндекс Браузер / Mozilla Firefox / Internet Explorer; DrWeb ES; 7-Zip; Media Player Classic	округ город Воронеж, город Воронеж, улица Мичурина, дом 1, ауд. 113, 115, 116, 119 120, 122, 123а, 126, 219, 220, 224, 241, 273 (с 16.00 до 20.00)
Помещение для самостоятельной работы: комплект учебной мебели, компьютерная техника с возможностью подключения к сети "Интернет" и обеспечением доступа в электронную информационно-образовательную среду, используемое программное обеспечение: MS Windows; Office MS Windows / Open Office; Adobe Reader / DjVu Reader; Яндекс Браузер / Mozilla Firefox / Internet Explorer; DrWeb ES; 7-Zip; Media Player Classic	394087, Российская Федерация, Воронежская область, городской округ город Воронеж, город Воронеж, улица Мичурина, дом 1, ауд. 232 а

7.2. Программное обеспечение

7.2.1. Программное обеспечение общего назначения

№	Название	Размещение
1	Операционные системы MS Windows /Linux /Ред ОС	ПК в локальной сети ВГАУ
2	Пакеты офисных приложений MS Office / OpenOffice/LibreOffice	ПК в локальной сети ВГАУ
3	Программы для просмотра файлов Adobe Reader / DjVu Reader	ПК в локальной сети ВГАУ
4	Браузеры Яндекс Браузер / Mozilla Firefox / Microsoft Edge	ПК в локальной сети ВГАУ
5	Антивирусная программа DrWeb ES	ПК в локальной сети ВГАУ
6	Программа-архиватор 7-Zip	ПК в локальной сети ВГАУ
7	Мультимедиа проигрыватель MediaPlayer Classic	ПК в локальной сети ВГАУ
8	Платформа онлайн-обучения eLearning server	ПК в локальной сети ВГАУ
9	Система компьютерного тестирования AST Test	ПК в локальной сети ВГАУ

7.2.2. Специализированное программное обеспечение

Для проведения практических занятий требуются компьютерные классы по следующим причинам.

1. Для выполнения заданий по расчету некоторых показателей риска необходимо использовать большой объем исходных данных за несколько лет. Для поиска соответствующих данных нужно использовать поисковые системы.
2. Обработка и анализ информации осуществляется с помощью функций Excel.

8. Междисциплинарные связи

Дисциплина, с которой необходимо согласование	Кафедра, на которой препода- ется дисциплина	Подпись заведующего ка- федрой
Экономическая безопасность	экономики АПК	
Выявление угроз экономиче- ской безопасности	экономики АПК	

Приложение 1

Лист изменений рабочей программы

Номер измене- ния	Номер протокола заседания кафедры и дата	Страницы с изменениями	Перечень откор- ректированных пунктов	Подпись заведующего кафедрой

Приложение 2

**Лист периодических проверок рабочей программы
и информация о внесенных изменениях**

[illegible]