

Документ подписан простой электронной подписью

Информация о владельце:

ФИО: Ушвицкий Лев Иванович

Должность: и.о. директора Института экономики и управления

Дата подписания: 28.05.2026 12:16:24

Уникальный программный ключ:

46f7031a7046958ffdb4e91f81e17726531a25a8

МИНИСТЕРСТВО НАУКИ И ВЫСШЕГО ОБРАЗОВАНИЯ РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ
Федеральное государственное автономное образовательное учреждение
высшего образования
«СЕВЕРО-КАВКАЗСКИЙ ФЕДЕРАЛЬНЫЙ УНИВЕРСИТЕТ»

УТВЕРЖДАЮ

Директор института
экономики и управления,
доктор экономических наук,
профессор
Л. И. Ушвицкий

ФОНД ОЦЕНОЧНЫХ СРЕДСТВ ПО ДИСЦИПЛИНЕ «Оценка рисков»

Специальность	38.05.01 Экономическая безопасность	
Специализация	Экономико-правовое обеспечение экономической безопасности	
Год начала обучения	2026	
Форма обучения	очная	заочная
Реализуется в семестре	4	4

Ставрополь, 2026

Введение

1. Назначение: Фонд оценочных средств по дисциплине «Оценка рисков» предназначен для контроля достижения обучающимися требуемых компетенций посредством оценивания полученных ими результатов обучения, соответствующих индикаторам достижения компетенций образовательной программы высшего образования «Экономико-правовое обеспечение экономической безопасности» по специальности 38.05.01 Экономическая безопасность.

2. ФОС является приложением к рабочей программе дисциплины «Оценка рисков»

3. Разработчик: Тер-Григорьянц А.А., доктор экономических наук, профессор, профессор кафедры экономической безопасности и аудита

4. Проведена экспертиза ФОС.

Члены экспертной группы:

Председатель: Куш Е.Н. - председатель УМК института экономики и управления.

Члены комиссии:

Пучкова Е. Е. - член УМК института экономики и управления, и.о. зам. директора по учебной работе;

Мезенцева Е.С. - член УМК института экономики и управления, доцент кафедры экономической безопасности и аудита

Представитель организации-работодателя: Догданов Д. В. - руководитель департамента аудита ООО «Русаудит»

Экспертное заключение: фонд оценочных средств по дисциплине «Оценка рисков» рекомендуется для оценки результатов обучения и уровня сформированности компетенций у обучающихся образовательной программы высшего образования «Экономико-правовое обеспечение экономической безопасности» по специальности 38.05.01 «Экономическая безопасность».

26 января 2026 г.

5. Срок действия ФОС определяется сроком реализации образовательной программы.

1. Описание критериев оценивания компетенции на различных этапах их формирования, описание шкал оценивания

Компетенция(ии), индикатор(ы)	Уровни сформированности компетенции(ий)			
	Минимальный уровень не достигнут (Неудовлетворительно) 2 балла	Минимальный уровень (удовлетворительно) 3 балла	Средний уровень (хорошо) 4 балла	Высокий уровень (отлично) 5 баллов
<i>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</i>				
Результаты обучения : на основе использования данных различных видов учета и отчетности, другой экономической информации использует методы и инструменты качественной и количественной оценки рисков с целью их прогнозирования, а также последующего предупреждения и нейтрализации ИД-2 ОПК-2	Не знает методы и инструменты качественной и количественной оценки рисков с целью их прогнозирования, а также последующего предупреждения и нейтрализации	Испытывает существенные трудности в процессе обработки необходимой информации, а также использования методов и инструментов качественной и количественной оценки рисков с целью их прогнозирования, последующего предупреждения и нейтрализации	Применяет методы и инструменты качественной и количественной оценки рисков с целью их прогнозирования, последующего предупреждения и на основе данных различных видов учета и отчетности, другой экономической информации на среднем уровне	Применяет на высоком уровне методы и инструменты оценки рисков с целью их прогнозирования, последующего предупреждения и нейтрализации на основе данных различных видов учета и отчетности, другой экономической информации
<i>ПК – 3 Способен проводить анализ возможных экономических рисков и давать им оценку, составлять и обосновывать прогнозы динамики развития основных угроз экономической безопасности</i>				
Результаты обучения : проводит оценку экономических рисков, позволяющую обосновывать управленческие решения исходя из необходимости предотвращения отрицательных	Не способен проводить оценку экономических рисков, позволяющую обосновывать управленческие решения исходя из необходимости предотвращения	Способен проводить оценку экономических рисков, позволяющую обосновывать управленческие решения исходя из необходимости предотвращения отрицательных результатов	Способен проводить оценку экономических рисков, позволяющую обосновывать управленческие решения исходя из	На высоком уровне использует методы и инструменты оценки экономических рисков для обоснования управленческих решений исходя из

результатов хозяйственной деятельности ИД-2 ПК-3	отрицательных результатов хозяйственной деятельности	хозяйственной деятельности на минимальном уровне	необходимости предотвращения отрицательных результатов хозяйственной деятельности на среднем уровне	необходимости предотвращения отрицательных результатов хозяйственной деятельности
---	--	--	---	---

Промежуточная аттестация проводится в форме экзамена (4 семестр).

Описание шкал оценивания

Результаты обучения по дисциплине «Оценка рисков», соотнесенные с индикаторами достижения компетенций ОПК-2 и ПК-3, оцениваются по пятибалльной системе: «отлично», «хорошо», «удовлетворительно» и «неудовлетворительно».

Оценивание уровня сформированности компетенции по дисциплине осуществляется на основе «Положения о проведении текущего контроля успеваемости и промежуточной аттестации обучающихся по образовательным программам высшего образования - программам бакалавриата, программам специалитета, программам магистратуры - в Федеральном государственном автономном образовательном учреждении высшего образования «Северо-Кавказский федеральный университет» в актуальной редакции.

Критерии выставления оценок

Оценка «отлично» выставляется студенту, если он глубоко и прочно усвоил программный материал, исчерпывающе, последовательно, четко и логически стройно его излагает, умеет тесно увязывать теорию с практикой, свободно справляется с вопросами и другими видами применения знаний, причем не затрудняется с ответом при видоизменении заданий, использует в ответе материал монографической литературы, правильно обосновывает принятое решение, владеет разносторонними навыками и приемами при ответе на практикоориентированные вопросы, принимает правильные управленческие решения, владеет навыками и приемами решения практических задач, выполняет тестовые задания на 100 процентов. Результаты обучения по дисциплине в рамках освоения компетенции ОПК-2 и ПК-3 достигнуты на высоком уровне.

Оценка «хорошо» выставляется студенту, если он твердо знает материал, грамотно и по существу излагает его, не допуская существенных неточностей в ответе на вопрос, правильно применяет теоретические положения при решении практических вопросов, владеет необходимыми навыками и приемами ответов на них, правильно применяет теоретические положения при решении практических задач, владеет необходимыми навыками и приемами их выполнения, выполняет тестовые задания на 70 процентов. Результаты обучения по дисциплине в рамках освоения компетенции ОПК-2 и ПК-3 достигнуты на хорошем уровне.

Оценка «удовлетворительно» выставляется студенту, если он имеет знания только основного материала, но не усвоил его деталей, допускает неточности, недостаточно правильные формулировки, нарушения логической последовательности в изложении программного материала, испытывает затруднения при ответе на вопросы и при выполнении практических заданий и решении кейс-задач, выполняет тестовые задания на

50 процентов. Результаты обучения по дисциплине в рамках освоения компетенции ОПК-2 и ПК-3 достигнуты на базовом уровне.

Оценка «неудовлетворительно» выставляется студенту, если он не знает значительной части программного материала, допускает существенные ошибки, неуверенно, с большими затруднениями отвечает на вопросы, допускает существенные ошибки при решении заданий практического уровня, выполняет тестовые задания на 49 процентов и ниже. Результаты обучения по дисциплине в рамках освоения компетенции ОПК-2 и ПК-3 не достигнуты.

2. Оценочные средства для проверки уровня сформированности компетенций

Номер задания	Правильный ответ	Содержание оценочного средства	Компетенция
		Тестовые задания	
1.	a)	В зависимости от возможности наступления отрицательных последствий и благоприятных исходов риски делятся на: a) чистые, спекулятивные b) внутренние, внешние c) оправданный, неоправданный	ОПК-2
2.	d)	В отличие от чистого риска спекулятивный риск предполагает: a) возможность наступления только неблагоприятных последствий b) возможность наступления только нейтральных последствий c) возможность наступления только благоприятных последствий d) возможность наступления благоприятных, нейтральных или неблагоприятных последствий	ОПК-2
3.	a)	Риск, связанный с платежеспособностью покупателя, относится к группе... a) коммерческих рисков b) политических рисков c) природных рисков	ОПК-2
4.	a)	Производственный риск: a) связан с особенностью производственного процесса конкретной организации, уровнем квалификации персонала b) несет потенциальную угрозу неполучения планируемого результата по причине войны c) связан с изменениями в нормативной и законодательной базе регионального планирования	ОПК-2
5.	a)	Договоры, заключаемые данной организацией с поставщиками, покупателями, подрядчиками, используются в качестве a) внутреннего источника информации, применяемого в процессе оценки рисков b) внешнего источника информации, применяемого в процессе выявления факторов риска c) не используются для оценки рисков	ОПК-2
6.	a)	Укажите потери, которые можно отнести к материальным:	ОПК-2

Номер задания	Правильный ответ	Содержание оценочного средства	Компетенция
		а) потери материалов б) уменьшение выручки вследствие снижения цен на реализуемую продукцию в) невыполнение сроков сдачи объекта г) потери рабочего времени	
7.	с)	Количественный анализ рисков базируется на... а) экспертной оценке рисков б) социальном опросе в) теории вероятности, математической статистике, теории исследования операций	ПК-3
8.	б)	Под идентификацией риска понимают... а) процесс количественной оценки рисков б) процесс нахождения, составления перечня и описания элементов риска в) процесс разработки методов убавления рисками	ПК-3
9.	б)	Каким образом рассчитывается мера риска с учетом вероятности? а) Мера риска = Вероятность - Последствия б) Мера риска = Вероятность * Последствия в) Мера риска = Вероятность * Положительные последствия	ПК-3
10.	а)	Свойство вероятности событий: а) сумма вероятностей всех событий равна 1 б) сумма вероятностей всех событий больше 1 в) сумма вероятностей всех событий меньше 1	ПК-3
11.	д)	Субъективный метод определения вероятности основан на.. а) вычислении наиболее ожидаемого результата события б) вычислении частоты, с которой тот или иной результат был получен в аналогичных условиях в) вычислении фактических данных, исходя из показателей случаев наступления события и общего числа вариаций г) суждении и личном опыте лица, принимающего решение	ПК-3
12.	б)	Выберите верное утверждение «Вероятность....» а) может принимать отрицательное значение только в случае невозможности наступления события	ПК-3

Номер задания	Правильный ответ	Содержание оценочного средства	Компетенция
		впоследствии b) принимает значение в интервале от 0 до 1, относящееся к случайному событию c) принимает значение в интервале от -1 до 1, относящееся к случайному событию и служит мерой риска d) не имеет количественного признака, оценивается только в качественных характеристиках	
13.	a)	Какие потери можно отнести к потерям времени a) невыполнение сроков сдачи объекта b) потери ценных бумаг c) выплата штрафа d) уплата дополнительных налогов	ПК-3
14.	a)	Если риск находится в "зеленой" области (область пренебрежимого риска) необходимо ли использование особых мер управления рисками: a) нет b) да	ПК-3
15.	a)	Укажите правильное утверждение, которое необходимо использовать в процессе выбора решения: a) чем выше коэффициент вариации, тем сильнее колеблемость, тем больше риск b) чем выше коэффициент вариации, тем сильнее колеблемость, тем меньше риск c) чем выше коэффициент вариации, тем меньше колеблемость, тем меньше риск	ПК-3
16.	b)	Размах вариации - это a) сумма максимального и минимального значений признака b) разность между максимальным и минимальным значениями признака c) сумма всех значений признака	ПК-3
17.	b)	В процессе применения метода построения дерева решений учитывается следующее условие: a) сумма вероятностей конечных исходов всех ветвей равна 0 b) сумма вероятностей конечных исходов всех ветвей равна 1 c) сумма вероятностей конечных исходов всех ветвей находится в пределах от (-1) до 1 d) сумма вероятностей конечных исходов всех ветвей находится в пределах от 0 до 1	ПК-3
18.	a)	Разработана ли единая рекомендованная форма реестра рисков: a) нет	ОПК-2

Номер задания	Правильный ответ	Содержание оценочного средства	Компетенция
		b) да	
19.	b)	Выбор решения в условиях риска предполагает, что... a) разные альтернативы не изучаются b) известны вероятности возможных вариантов ситуации c) вероятности возможных вариантов не изучаются	ОПК-2
20.	b)	Выбор предельно допустимого уровня риска зависит от a) одного фактора b) множества факторов c) не зависит ни от чего	ОПК-2
21.	a)	Статистический финансовый показатель, характеризующий степень изменчивости биржевых цен, называется... a) волатильность b) рентабельность c) ликвидность	ПК-3
22.	a)	В процессе оценки экспертных данных используются шкалы измерения: a) от 0 до 1, от 0 до 10, от 0 до 100 b) от 0 до 1 c) от 0 до 10 d) от 0 до 100	ПК-3
23.	c)	Требования к специализации и квалификации экспертов определяются на этапе... a) формирования вопросов и составление анкет b) анализа и обработки экспертных оценок c) подбора экспертов и формирование экспертных групп	ПК-3
24.	c)	Сущность концепции приемлемого риска: a) риск обязательно надо полностью устранять b) риском не следует управлять вовсе c) риск не обязательно полностью устранять, достаточно снизить его до приемлемого уровня, когда он перестает быть угрожающим	ОПК-2

Ном ер зада ния	Правильный ответ	Содержание оценочного средства	Компетен ция
25.	d)	К критериям, используемым при принятии решений в условиях полной неопределенности, <i>не</i> относится... а) критерий Вальда б) критерий пессимизма с) критерий Сэвиджа d) критерий Гауфа	ПК-3
26.	b)	В критерии Вальда под принятием решения в оптимальных условиях понимается: а) принятие решения, для которого выигрыш окажется минимальным из всех максимальных при различных вариантах б) принятие решения, для которого выигрыш окажется максимальным из всех минимальных при различных вариантах с) принятие альтернативного решения, т.к. неконтролируемые ситуации равновероятны	ПК-3
27.	a)	Критерий Сэвиджа предполагает а) из всех возможных вариантов матрицы решений выбирается та альтернатива, которая минимизирует размеры максимальных потерь по каждому из возможных решений б) из всех возможных вариантов матрицы решений выбирается та альтернатива, которая максимизирует размеры минимальных потерь по каждому из возможных решений с) из всех возможных вариантов матрицы решений выбирается та альтернатива, которая максимизирует размеры максимальных потерь по каждому из возможных решений	ПК-3
28.	a)	Критерий Гурвица позволяет руководствоваться при выборе рискового решения в условиях неопределенности а) некоторым средним результатом эффективности б) максимальным результатом эффективности с) минимальным результатом эффективности	ПК-3
29.	a)	Критерий крайнего оптимизма предполагает а) из всех возможных вариантов решений выбирается альтернатива, которая из всех самых благоприятных ситуаций развития событий имеет наибольшее из максимальных значений б) из всех возможных вариантов решений выбирается альтернатива, которая из всех самых неблагоприятных ситуаций развития событий имеет наибольшее из минимальных значений	ПК-3

Номер задания	Правильный ответ	Содержание оценочного средства	Компетенция
		с) из всех возможных вариантов решений выбирается альтернатива, которая из всех самых благоприятных ситуаций развития событий имеет наименьшее из минимальных значений	
		Вопросы к экзамену	
1.		Понятие риска	ОПК-2
2.		Основные концепции риска	ОПК-2
3.		Свойства и характеристики риска	ОПК-2
4.		Функции риска	ОПК-2
5.		Классификация рисков	ОПК-2
6.		Источники и причины рисков	ОПК-2
7.		Факторы риска	ОПК-2
8.		Общие положения оценки и анализа рисков	ОПК-2
9.		Задачи и этапы анализа рисков	ОПК-2
10.		Идентификация рисков и ситуаций рисков	ОПК-2
11.		Источники информации для анализа рисков	ОПК-2
12.		Качественный и количественный подходы к анализу рисков	ОПК-2
13.		Инструменты качественного анализа рисков	ОПК-2
14.		Вероятностный подход к оценке риска	ПК-3
15.		Методы определения вероятности событий	ПК-3
16.		Потери, ущерб, убытки как характеристики риска	ПК-3
17.		Критерии и показатели риска	ПК-3
18.		Дискретные и непрерывные модели рисков	ПК-3
19.		Экономико-математические методы оценки рисков	ПК-3
20.		Статистический метод оценки риска	ПК-3
21.		Сущность и значение сценарного анализа	ПК-3
22.		Аналитические подходы к анализу рисков	ПК-3
23.		Метод построения дерева решений, дерева событий, деревьев отказов	ПК-3
24.		Методы эквивалентов, аналогий	ПК-3

Ном ер зада ния	Правильный ответ	Содержание оценочного средства	Компетен ция						
25.		Сущность метода Монте-Карло	ПК-3						
26.		Анализ взаимосвязи между издержками и доходами при различных уровнях производства (расчет точки безубыточности, порога рентабельности)	ПК-3						
27.		Экспертные процедуры: виды и характеристика	ПК-3						
28.		Общая схема экспертизы	ПК-3						
29.		Формирование вопросов и составление анкет	ПК-3						
30.		Работа с экспертами	ПК-3						
31.		Анализ и обработка экспертных оценок	ПК-3						
32.		Метод «Дельфи»	ПК-3						
33.		Сущность концепции приемлемого риска	ОПК-2						
34.		Определение предельного уровня риска. Нормирование риска	ОПК-2						
35.		Зоны риска. Области риска	ОПК-2						
36.		Реестр рисков. Карты и матрицы рисков	ОПК-2						
37.		Критерии, используемые при принятии решений в условиях неопределенности	ПК-3						
38.		Принятие решений в условиях риска	ПК-3						
39.		Принятие решений в условиях неопределенности	ПК-3						
		Практические задачи							
1.		Выделите и систематизируйте положительные и отрицательные факторы риска предприятия, осуществляющего деятельность по производству молочной продукции. Составить блок-схему оценки рисков. Таблица – Факторы риска деятельности предприятия, осуществляющего производство молочной продукции (по характеру влияния) <table><tr><td>Положительные</td><td>Отрицательные</td></tr><tr><td>Не менее 5</td><td>Не менее 5</td></tr><tr><td></td><td></td></tr></table>	Положительные	Отрицательные	Не менее 5	Не менее 5			ОПК-2
Положительные	Отрицательные								
Не менее 5	Не менее 5								

Номер задания	Правильный ответ	Содержание оценочного средства	Компетенция																		
2.		Выделите и систематизируйте факторы риска по объектам воздействия Таблица – Факторы риска <table><tr><th>Риски</th><th>Факторы</th><th>Объект воздействия</th></tr><tr><td colspan="3">Внешние риски <i>Не менее 5</i></td></tr><tr><td></td><td></td><td></td></tr><tr><td></td><td></td><td></td></tr><tr><td colspan="3">Внутренние риски <i>Не менее 4</i></td></tr><tr><td></td><td></td><td></td></tr></table>	Риски	Факторы	Объект воздействия	Внешние риски <i>Не менее 5</i>									Внутренние риски <i>Не менее 4</i>						ОПК-2
Риски	Факторы	Объект воздействия																			
Внешние риски <i>Не менее 5</i>																					
Внутренние риски <i>Не менее 4</i>																					
3.		Используя инструментарий качественного анализа рисков выявите и систематизируйте причины и факторы потенциального хозяйственного риска, который может возникнуть при выращивании зерна.	ОПК-2																		
4.		Используя инструментарий качественного анализа рисков выявите и систематизируйте возможные общие и частные риски экономического агента, производящего компьютерную технику.	ОПК-2																		
5.		Рассматриваются два варианта вложения капитала. При первом варианте прибыль составляет 20 млн. руб., убыток – 9 млн. руб. По второму варианту прибыль составляет 22 млн. руб., а убыток – 10 млн. руб. Обосновать наименее рискованный вариант вложения капитала .	ПК-3																		
6.		Рассматриваются два инвестиционных проекта. Первый с вероятностью 70% обеспечивает прибыль 20 млн. руб. и с вероятностью ?% потери в сумме 6 млн. руб. Для второго проекта с вероятностью 80% возможно получить прибыль 16 млн. руб. и с вероятностью ?% понести потери в размере 5,5 млн. руб. Обосновать выбор инвестиционного проекта с позиции теории риска	ПК-3																		
7.		Фирма, производящая бытовую технику, провела анализ рынка нового холодильника. Если будет выпущена крупная партия холодильников, то при благоприятном рынке прибыль составит 350 тыс. руб., а при неблагоприятных условиях фирма понесет убытки в 190 тыс. руб. Небольшая партия техники в случае ее успешной реализации принесет фирме 50 тыс. руб. прибыли и 10 тыс. руб. убытков – при неблагоприятных внешних условиях. Вероятность благоприятного и неблагоприятного исходов фирма оценивает одинаково. Используйте дерево решений для того, чтобы помочь фирме выбрать наименее рискованную стратегию.	ПК-3																		
8.		Руководство предприятия решает, создавать ли для выпуска новой продукции (сухих гранул из	ПК-3																		

Номер задания	Правильный ответ	Содержание оценочного средства	Компетенция																					
		жом) крупное производство, малое предприятие или продать патент другой фирме. Размер выигрыша, который компания может получить, зависит от благоприятного состояния рынка (табл.1). Вероятность благоприятного и неблагоприятного состояний экономической среды равна 0,5. Построить дерево решений по стратегии развития компании. Таблица 1- Выигрыши (потери) компании при различных вариантах решения <table><tr><th rowspan="2">Номер стратегии</th><th rowspan="2">Действия компании</th><th colspan="2">Выигрыш, руб., при состоянии экономической среды</th></tr><tr><th>Благоприятном</th><th>Неблагоприятном</th></tr><tr><td>1</td><td>Строительство крупного предприятия</td><td>250 000</td><td>-190 000</td></tr><tr><td>2</td><td>Строительство малого предприятия</td><td>110 000</td><td>-25 000</td></tr><tr><td>3</td><td>Продажа патента</td><td>15 000</td><td>15 000</td></tr></table>	Номер стратегии	Действия компании	Выигрыш, руб., при состоянии экономической среды		Благоприятном	Неблагоприятном	1	Строительство крупного предприятия	250 000	-190 000	2	Строительство малого предприятия	110 000	-25 000	3	Продажа патента	15 000	15 000				
Номер стратегии	Действия компании	Выигрыш, руб., при состоянии экономической среды																						
		Благоприятном	Неблагоприятном																					
1	Строительство крупного предприятия	250 000	-190 000																					
2	Строительство малого предприятия	110 000	-25 000																					
3	Продажа патента	15 000	15 000																					
9.		При использовании новых форм сбыта продукции предприятие при продаже 80 единиц получило прибыль в размере 25 000 ден. ед., при продаже 60 единиц – 30 000 ден. ед. а при продаже еще 60 единиц – 20 тыс. ден. ед. Всего было реализовано 200 единиц продукции. В то же время при продаже продукции в традиционной форме прибыль в размере 25 тыс. ден. ед. была получена в 60 случаях из 200, в размере 30 тыс. ден. ед. – в 75 случаях и в размере 20 тыс. ден. ед. – в 65 случаях. Целесообразен ли переход предприятия на новые формы сбыта и почему?	ПК-3																					
10.		Предприятие рассматривает возможность участия в проектах Таблица 1 – Данные по результатам реализации проектов <table><tr><th>Показатель</th><th colspan="3">Проект А</th><th colspan="3">Проект Б</th></tr><tr><td>Вероятность события</td><td>0,3</td><td>0,6</td><td>?</td><td>0,3</td><td>0,3</td><td>?</td></tr><tr><td>Наличные поступления, млн. руб.</td><td>40</td><td>50</td><td>60</td><td>0</td><td>50</td><td>100</td></tr></table> Учитывая, что фирма имеет фиксированные платежи по долгам 40 млн. руб., какой проект должны	Показатель	Проект А			Проект Б			Вероятность события	0,3	0,6	?	0,3	0,3	?	Наличные поступления, млн. руб.	40	50	60	0	50	100	ПК-3
Показатель	Проект А			Проект Б																				
Вероятность события	0,3	0,6	?	0,3	0,3	?																		
Наличные поступления, млн. руб.	40	50	60	0	50	100																		

Номер задания	Правильный ответ	Содержание оценочного средства	Компетенция																																			
		выбрать акционеры и почему?																																				
11.		Коммерческая организация, производящая вычислительную технику, провела анализ рынка нового высокопроизводительного персонального компьютера. Если будет выпущена крупная партия компьютеров, то при благоприятном рынке прибыль составит 350 тыс. руб., а при неблагоприятных условиях фирма понесет убытки в 190 тыс. руб. Небольшая партия техники в случае ее успешной реализации принесет фирме 50 тыс. руб. прибыли и 10 тыс. руб. убытков – при неблагоприятных внешних условиях. Вероятность благоприятного и неблагоприятного исходов фирма оценивает в 60% и 40% соответственно. Выбрать наименее рискованный вариант стратегии развития коммерческой организации.	ПК-3																																			
12.		Имеются два варианта рискованного вложения капитала. По первому варианту ожидается получить прибыль 2 млн. руб. при вероятности 0,8. По второму варианту ожидается получить прибыль 2,8 млн. руб. при вероятности 0,6. Определить наименее рискованный вариант вложения капитала.	ПК-3																																			
13.		Рассматриваются две стратегии развития предприятия. При первом варианте прибыль составляет 15 млн. руб., убыток – 4 млн. руб. По второму варианту прибыль составляет 18 млн. руб., а убыток – 5 млн. руб. Вероятность получения прибыли 55%, убытка – 45%.Какой показатель позволит принять решение по выбору стратегии развития? Определить наименее рискованную стратегию.	ПК-3																																			
14.		Используя статистический способ оценки рисков, на основании данных таблицы 1 определить степень финансового риска и прогнозную рентабельность предприятия на 2021 год. Таблица 1- Рентабельность деятельности предприятия,% <table><tr><th rowspan="2">Показатель</th><th colspan="11">Годы</th></tr><tr><th>xx11</th><th>xx12</th><th>xx14</th><th>xx14</th><th>xx15</th><th>xx16</th><th>xx17</th><th>xx18</th><th>xx19</th><th>xx20</th><th>xx21</th></tr><tr><td>Рентабельность</td><td>16</td><td>7</td><td>16</td><td>4</td><td>13</td><td>15</td><td>15</td><td>8</td><td>12</td><td>20</td><td>?</td></tr></table>	Показатель	Годы											xx11	xx12	xx14	xx14	xx15	xx16	xx17	xx18	xx19	xx20	xx21	Рентабельность	16	7	16	4	13	15	15	8	12	20	?	ПК-3
Показатель	Годы																																					
	xx11	xx12	xx14	xx14	xx15	xx16	xx17	xx18	xx19	xx20	xx21																											
Рентабельность	16	7	16	4	13	15	15	8	12	20	?																											

Номер задания	Правильный ответ	Содержание оценочного средства	Компетенция																													
15.		Выбрать наименее рискованный вариант вложения в предприятие <table><tr><th rowspan="2">Квартал</th><th colspan="2">Предприятие «1»</th><th colspan="2">Предприятие «2»</th></tr><tr><th>Доход, ус.ед.</th><th>Доходность, %</th><th>Доход, ус.ед.</th><th>Доходность, %</th></tr><tr><td>1</td><td>8</td><td>11</td><td>25</td><td>6</td></tr><tr><td>2</td><td>12</td><td>19</td><td>44</td><td>7</td></tr><tr><td>3</td><td>13</td><td>13</td><td>33</td><td>9</td></tr><tr><td>4</td><td>24</td><td>11</td><td>17</td><td>9</td></tr></table>	Квартал	Предприятие «1»		Предприятие «2»		Доход, ус.ед.	Доходность, %	Доход, ус.ед.	Доходность, %	1	8	11	25	6	2	12	19	44	7	3	13	13	33	9	4	24	11	17	9	ПК-3
Квартал	Предприятие «1»			Предприятие «2»																												
	Доход, ус.ед.	Доходность, %	Доход, ус.ед.	Доходность, %																												
1	8	11	25	6																												
2	12	19	44	7																												
3	13	13	33	9																												
4	24	11	17	9																												
16.		Рассчитать показатель риска и выбрать наименее рисковый вариант вложения капитала. Таблица 1 – Варианты вложения капитала <table><tr><th rowspan="2">Показатели</th><th colspan="2">Вариант вложения капитала</th></tr><tr><th>первый</th><th>второй</th></tr><tr><td>Собственные средства, тыс. руб.</td><td>20 000</td><td>100 000</td></tr><tr><td>Максимально возможная сумма убытка, тыс. руб.</td><td>11 000</td><td>31 000</td></tr></table>	Показатели	Вариант вложения капитала		первый	второй	Собственные средства, тыс. руб.	20 000	100 000	Максимально возможная сумма убытка, тыс. руб.	11 000	31 000	ПК-3																		
Показатели	Вариант вложения капитала																															
	первый	второй																														
Собственные средства, тыс. руб.	20 000	100 000																														
Максимально возможная сумма убытка, тыс. руб.	11 000	31 000																														
17.		Предприятию необходимо оценить риск того, что поставщик поставит сырьё в срок при заключении договора поставки сырца. Исходные данные для анализа сведены в табл.1, при этом сделки с данными партнёрами предприятие заключались в течение 10 месяцев. Определить поставщика, характеризующегося наименьшим рисков неисполнения вовремя договора. Таблица 1- Срок выполнения договора поставщиком, дней	ПК-3																													

Номер задания	Правильный ответ	Содержание оценочного средства											Компетенция		
		Месяцы		1	2	3	4	5	6	7	8	9	10		
		Срок выполнения договора, дн.	Предприятие 1	70	39	58	75	80	120	70	42	50	80		
			Предприятие 2	50	63	32	89	61	45	31	51	55	50		