



Федеральное агентство по рыболовству
Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение
высшего образования
«Калининградский государственный технический университет»
(ФГБОУ ВО «КГТУ»)

УТВЕРЖДАЮ
Начальник УРОПС

Фонд оценочных средств
(приложение к рабочей программе модуля)
**«МОНИТОРИНГ И ПРЕДУПРЕЖДЕНИЕ РИСКОВ ЭКОНОМИЧЕСКОЙ
БЕЗОПАСНОСТИ»**

основной профессиональной образовательной программы специалитета
по специальности

38.05.01 ЭКОНОМИЧЕСКАЯ БЕЗОПАСНОСТЬ

Профиль (специализация) программы
**«ЭКОНОМИКО-ПРАВОВОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ ЭКОНОМИЧЕСКОЙ
БЕЗОПАСНОСТИ»**

ИНСТИТУТ
РАЗРАБОТЧИК

отраслевой экономики и управления
кафедра экономической безопасности

1 РЕЗУЛЬТАТЫ ОСВОЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ

Таблица 1 – Планируемые результаты обучения по дисциплине, соотнесенные с установленными индикаторами достижения компетенций

Код и наименование компетенции	Индикаторы достижения компетенции	Дисциплина	Результаты обучения (владения, умения и знания), соотнесенные с компетенциями/индикаторами достижения компетенции
<p>ПК-2: Способен организовывать методическое обеспечение, поддержание и координацию процесса управления рисками.</p>	<p>ПК-2.1: Формирует методические основы интегральной системы управления рисками.</p>	<p>Мониторинг и предупреждение рисков экономической безопасности</p>	<p><u>Знать:</u></p> <ul style="list-style-type: none"> - классификацию рисков, виды рисков, возникающих в результате взаимодействия предприятия с основными контрагентами; - причины и источники возникновения рисков; - место и роль рисков в экономической деятельности организации; - методы идентификации и оценки экономических рисков; - методы мониторинга, прогноза и предупреждения рисков экономической безопасности в процессе предпринимательской деятельности; <p><u>Уметь:</u></p> <ul style="list-style-type: none"> - проводить мониторинг возможных экономических рисков и давать им оценку; - идентифицировать риски предпринимательской деятельности; - дифференцировать области хозяйствования по степени влияния факторов риска на экономическую безопасность предприятия; - составлять и обосновывать прогнозы динамики развития основных угроз экономической безопасности; - разрабатывать мероприятия по предупреждению рисков экономической безопасности для предприятий; - принимать эффективные решения по управлению и снижению рисков экономической безопасности; <p><u>Владеть:</u></p> <ul style="list-style-type: none"> - навыками количественного и качественного анализа экономических

Код и наименование компетенции	Индикаторы достижения компетенции	Дисциплина	Результаты обучения (владения, умения и знания), соотнесенные с компетенциями/индикаторами достижения компетенции
			рисков; - навыками управления рисками экономической безопасности предприятия; - навыками получения и обработки информации, необходимой для мониторинга рисков и принятия соответствующих управленческих решений; - навыками предупреждения и снижения рисков экономической безопасности

2 ПЕРЕЧЕНЬ ОЦЕНОЧНЫХ СРЕДСТВ ДЛЯ ПОЭТАПНОГО ФОРМИРОВАНИЯ РЕЗУЛЬТАТОВ ОСВОЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ (ТЕКУЩИЙ КОНТРОЛЬ) И ПРОМЕЖУТОЧНОЙ АТТЕСТАЦИИ

2.1 Для оценки результатов освоения дисциплины используются:

- оценочные средства текущего контроля успеваемости;
- оценочные средства для промежуточной аттестации по дисциплине.

2.2 К оценочным средствам текущего контроля успеваемости относятся:

- тестовые задания;
- задания по темам практических занятий.

2.3 К оценочным средствам для промежуточной аттестации по дисциплине, проводимой в форме экзамена, относятся:

- задания по выполнению курсовой работы;
- вопросы для промежуточной аттестации (экзамен) по дисциплине.

3 ОЦЕНОЧНЫЕ СРЕДСТВА ТЕКУЩЕГО КОНТРОЛЯ УСПЕВАЕМОСТИ

3.1 Тестовые задания используются для оценки освоения теоретического материала студентами всех форм обучения. Тестирование обучающихся проводится на последнем практическом занятии согласно установленному варианту (приложение №1). Тестовое задание предусматривает выбор одного правильного ответа на поставленный вопрос из трех предлагаемых вариантов ответа.

Оценка теста определяется количеством правильных ответов и соответствует следующему диапазону (%):

«Отлично» - 86-100% правильных ответов в тесте;

«Хорошо» - 71-85% правильных ответов в тесте;

«Удовлетворительно» - 51-70% правильных ответов в тесте;

«Неудовлетворительно» - 50% и менее правильных ответов в тесте.

В приложении №7 приведены ключи правильных ответов к тестовым заданиям.

3.2 В приложении №4 приведены типовые задания для проведения практических занятий, предусмотренных рабочей программой дисциплины. Оценка результатов выполнения задания по каждой практической работе производится при представлении студентом выполненной работы и на основании его ответов на вопросы по тематике практической работы. Студент, самостоятельно выполнивший задание и продемонстрировавший знание использованных им средств и приемов теоретических основ мониторинга и предупреждения рисков экономической безопасности получает по практической работе оценку «зачтено».

4 ОЦЕНОЧНЫЕ СРЕДСТВА ДЛЯ ПРОМЕЖУТОЧНОЙ АТТЕСТАЦИИ ПО ДИСЦИПЛИНЕ

4.1 В приложении №2 представлены темы курсовой работы. В приложении №3 - типовые задания по выполнению курсовой работы. Курсовая работа выполняется студентами согласно соответствующего учебно-методического пособия, и представляет собой разработку, конкретизирующую отдельные вопросы курса. Основная цель курсовой работы – закрепление, расширение и углубление знаний, полученных в теоретическом курсе, приобретение навыков разработки практических рекомендаций в условиях большей, чем на практических занятиях, самостоятельности. Задание на курсовую работу выдается в начале семестра. Оценка за курсовую работу учитывается при итоговой аттестации по дисциплине.

Оценка курсовой работы («отлично», «хорошо», «удовлетворительно» или «неудовлетворительно») является экспертной и зависит от уровня усвоения и изложения студентом выбранной темы, наличия и сущности ошибок, допущенных студентом.

«Отлично» - ставится, если в работе присутствуют элементы научного творчества, используется современный теоретический и статистический материал по теме исследования, делается самостоятельный его анализ на основе знаний по данной теме, делаются самостоятельные выводы, дается аргументированная критика; студент правильно и уверенно отвечает на все вопросы рецензента. Отзыв руководителя положительный.

«Хорошо» - ставится, если в работе используется современный теоретический и статистический материал по теме исследования, полно и всесторонне освещены вопросы темы, делаются самостоятельные выводы, однако отсутствует должная степень творчества; студент в целом правильно, но не всегда уверенно отвечает на вопросы рецензента. Отзыв руководителя положительный.

«Удовлетворительно» - ставится, если в работе используется современный теоретический и статистический материал по теме исследования, недостаточно полно освещены вопросы темы, отсутствуют самостоятельные выводы; студент не всегда может дать объяснения выводам, правильно отвечает не на все вопросы рецензента. Отзыв руководителя с замечаниями.

«Неудовлетворительно» - ставится, если в работе используется устаревший теоретический и статистический материал, недостаточно полно освещены вопросы темы, выводы отсутствуют либо не верны; студент не владеет материалом работы, не в состоянии дать объяснение выводам и положениям данной работы, не может ответить на вопросы рецензента.

4.2 Промежуточная аттестация по дисциплине проводится в форме экзамена.

К экзамену допускаются студенты:

- получившие положительную оценку по результатам выполнения тестовых заданий;
- получившие положительную оценку по результатам выполнения практических работ.

В приложении №5 приведены экзаменационные вопросы по дисциплине, а в приложении №6 - типовые экзаменационные задания по мониторингу и предупреждению рисков экономической безопасности. Экзаменационный билет включает два вопроса и задачу.

Экзаменационная оценка («отлично», «хорошо», «удовлетворительно» или «неудовлетворительно») зависит от уровня освоения студентом тем дисциплины (наличия и сущности ошибок, допущенных студентом при ответе на экзаменационный вопрос, выполнении им экзаменационного задания).

Критерии оценивания зачета / экзамена по дисциплине

Универсальная система оценивания результатов обучения включает в себя системы оценок: 1) «отлично», «хорошо», «удовлетворительно», «неудовлетворительно»; 2) «зачтено», «не зачтено»; 3) 100 - балльную (процентную) систему и правило перевода оценок в пятибалльную систему (таблица 2).

Таблица 2 – Система оценок и критерии выставления оценки

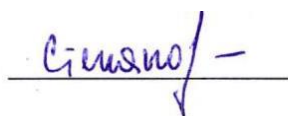
Система оценок Критерий	2	3	4	5
	0-40%	41-60%	61-80 %	81-100 %
	«неудовлетворительно»	«удовлетворительно»	«хорошо»	«отлично»
	«не зачтено»	«зачтено»		
1. Системность и полнота знаний в отношении изучаемых объектов	Обладает частичными и разрозненными знаниями, которые не может научно-корректно связывать между собой (только некоторые из которых может связывать между собой)	Обладает минимальным набором знаний, необходимым для системного взгляда на изучаемый объект	Обладает набором знаний, достаточным для системного взгляда на изучаемый объект	Обладает полнотой знаний и системным взглядом на изучаемый объект
2. Работа с информацией	Не в состоянии найти необходимую информацию, либо в состоянии находить отдельные фрагменты информации в рамках поставленной задачи	Может найти необходимую информацию в рамках поставленной задачи	Может найти, интерпретировать и систематизировать необходимую информацию в рамках поставленной задачи	Может найти, систематизировать необходимую информацию, а также выявить новые, дополнительные источники информации в рамках поставленной задачи
3. Научное осмысление изучаемого явления, процесса, объекта	Не может делать научно корректных выводов из имеющихся у него сведений, в состоянии проанализировать только некоторые из имеющихся у него сведений	В состоянии осуществлять научно корректный анализ предоставленной информации	В состоянии осуществлять систематический и научно корректный анализ предоставленной информации, вовлекает в исследование новые релевантные задачи данные	В состоянии осуществлять систематический и научно корректный анализ предоставленной информации, вовлекает в исследование новые релевантные поставленной задаче данные, предлагает новые ракурсы поставленной задачи
4. Освоение стандартных алгоритмов решения профессиональных задач	В состоянии решать только фрагменты поставленной задачи в соответствии с заданным алгоритмом, не освоил предложенный алгоритм, допускает ошибки	В состоянии решать поставленные задачи в соответствии с заданным алгоритмом	В состоянии решать поставленные задачи в соответствии с заданным алгоритмом, понимает основы предложенного алгоритма	Не только владеет алгоритмом и понимает его основы, но и предлагает новые решения в рамках поставленной задачи

5 СВЕДЕНИЯ О ФОНДЕ ОЦЕНОЧНЫХ СРЕДСТВ И ЕГО СОГЛАСОВАНИИ

Фонд оценочных средств для аттестации по дисциплине «Мониторинг и предупреждение рисков экономической безопасности» представляет собой компонент основной профессиональной образовательной программы специалитета по специальности 38.05.01 Экономическая безопасность (специализация «Экономико-правовое обеспечение экономической безопасности»).

Фонд оценочных средств рассмотрен и одобрен на заседании кафедры экономической безопасности (протокол № 9 от 26.04.2022).

Заведующая кафедрой



Т.Е. Степанова

**ТЕСТОВЫЕ ЗАДАНИЯ ПО ДИСЦИПЛИНЕ
«МОНИТОРИНГ И ПРЕДУПРЕЖДЕНИЕ РИСКОВ ЭКОНОМИЧЕСКОЙ
БЕЗОПАСНОСТИ»**

Вариант 1

1. Вероятность недополучения доходов запланированного уровня в условиях неопределенности, сопутствующей деятельности предприятия – это ...

- а) риск;
- б) неопределенность;
- в) случайность.

2. Из перечисленного к причинам и источникам вероятности и риска относятся:

- а) характер деятельности предприятия;
- б) спонтанность природных процессов и явлений;
- в) осознанные или неосознанные действия персонала организации.

3. Дифференцировать области хозяйствования по степени влияния факторов риска на экономическую безопасность предприятия позволяет:

- а) кривая безразличия;
- б) кривая риска;
- в) кривая распределения вероятностей.

4. В ходе количественного анализа в случаях полной неопределенности используются оценка риска в ...

- а) относительных и средних величинах;
- б) вероятностных и статистических величинах;
- в) экспертных оценках.

5. При осуществлении качественного анализа необходимым является ...

- а) выявление факторов, влияющих на рост степени риска;
- б) выявление и оценка вероятности наступления рискового события;
- в) выявление и оценка возможного ущерба от реализации рискового события.

6. В зависимости от возможности снижения выделяют следующие виды рисков:

- а) частичные, допустимые, критические, катастрофические;
- б) диверсифицируемые и недиверсифицируемые;
- в) несистематические и систематические.

7. Определение вероятности возникновения потерь на основе данных предшествующего периода составляет суть следующего метода мониторинга и оценки рисков ЭБС:

- а) статистического;
- б) аналитического;
- в) экспертного.

8. Графическое изображение последовательности решений и состояний окружающей среды с указанием соответствующих вероятностей и выигрышей для любых комбинаций альтернатив и состояний сред - ...

- а) анализ чувствительности;
- б) анализ сценариев;
- в) метод «дерева решений».

9. Наиболее эффективным, но и наиболее затратным является следующий подход к управлению рисками экономической безопасности:

- а) активный;
- б) репрессивный;
- в) адаптивный.

10. В ходе формирования методологических основ интегральной системы управления рисками главной ее целью является:

- а) стабильность положения на рынке;
- б) сохранение кадрового потенциала;
- в) успешное функционирование в условиях неопределенности.

11. Методы управления рисками, основанные на четкой идентификации источников риска, носят название методов ...

- а) диссипации;
- б) компенсации;
- в) локализации.

12. Процесс снижения риска за счет увеличения разнообразия видов деятельности, рынков сбыта или каналов поставок носит название:

- а) конвергенция;
- б) фокусирование;
- в) диверсификация.

13. К принципам инвестиционного управления рисками не относится:

- а) полезность;
- б) достаточность;
- в) эффективность управления.

14. Совокупность мотивов, средств и способов реализации угрозы - ...

- а) угроза экономической безопасности;
- б) механизм реализации угрозы;
- в) уровень угрозы.

15. Главной задачей системы мониторинга показателей экономической безопасности предприятия является:

- а) формирование системы информационно-аналитического обеспечения;
- б) внесение корректив в процесс управления рисками;
- в) выявление угроз и прогнозирование их последствий.

Вариант 2

1. Риск как экономической категории свойственна характеристика, определяющая его место и роль в экономической деятельности предприятия - ...

- а) объективность;
- б) противоречивость;
- в) субъективность.

2. В представленном ниже перечне причинами и источниками вероятности и риска являются:

- а) вероятностный характер НТП;
- б) действия конкурирующих организаций;
- в) деятельность государства в лице фискальных органов.

3. В ходе мониторинга возможных экономических рисков и их оценки проект А выбирается в случае соблюдения условий:

- а) $M_a < M_b$, $S_a < S_b$;
- б) $M_a > M_b$, $S_a > S_b$;
- в) $M_a > M_b$, $S_a < S_b$.

4. Относительные показатели количественного анализа рисков являются по отношению к абсолютным показателям:

- а) первичными;
- б) вторичными;
- в) равнозначными.

5. В ходе идентификации рисков к признакам их классификации не относят:

- а) степень ущерба;
- б) время возникновения;
- в) местоположение источника.

6. Метод мониторинга и оценки рисков ЭБС, в основе которого лежит определение объема производства, необходимого для возмещения понесенных затрат – ...

- а) анализ точки безубыточности;
- б) анализ чувствительности;
- в) анализ сценариев.

7. В том случае, когда другие методы мониторинга и оценки риска неприемлемы, используют методы ...

- а) статистические;
- б) аналитические;
- в) экспертных оценок.

8. Основопологающим принципом управления рисками из перечисленных является:

- а) сопоставимость уровня принимаемых рисков с уровнем доходности проводимых операций;
- б) сопоставимость уровня принимаемых рисков с возможными потерями предприятия;
- в) сопоставимость уровня принимаемых рисков с затратами предприятия.

9. Методом прогноза и снижения рисков экономической безопасности в процессе предпринимательской деятельности является:

- а) регулярная оценка платежеспособности предприятия;
- б) уклонение от налогов;
- в) получение краткосрочного кредита под повышенный процент.

10. Причина того, что классификация методов управления рисками является относительно условной - ...

- а) отсутствие достаточного методологического аппарата;
- б) в реальной жизни сферы применения методов переплетаются;
- в) не всегда менеджеры могут определить сферы применения.

11. Методы управления рисками, относящиеся к упреждающим методам управления, носят название методов ...

- а) диссипации;
- б) компенсации;

в) локализации.

12. Снижение риска за счет увеличения количества поставщиков, позволяющего ослабить зависимость предприятия от конкретного поставщика, - это диверсификация ...

а) рынка сбыта;

б) видов хозяйственной деятельности;

в) закупок.

13. Схематичное представление опасностей, с которыми фирма сталкивается в результате проведения каких-либо действий, а также воздействия внешнего окружения и финансовые отношения - ...

а) картографирование;

б) апробация рисков;

в) визуализация рисков.

14. Система наблюдений за состоянием основных показателей ЭБС предприятия для своевременного выявления последствий негативных процессов - ...

а) угроза экономической безопасности;

б) мониторинг рисков;

в) уровень угрозы.

15. В ходе формирования методологических основ интегральной системы управления рисками к показателям рисков финансовой сферы относят:

а) уровень загруженности производственных мощностей;

б) доля инновационной продукции;

в) соотношение выручки и себестоимости.

Вариант 3

1. К источникам риска экономической безопасности относятся:

а) невозможность однозначного познания объекта;

б) альтернативность, т.е. необходимости выбора из нескольких возможных вариантов;

в) ограниченность (недостаточность) материальных, финансовых, трудовых ресурсов.

2. К методам идентификации и оценки экономических рисков в условиях частичной неопределенности относятся:

а) расчетно-аналитические;

б) статистические;

в) экспертные.

3. Систематизация множества рисков на основании факторов и критериев, позволяющих объединить подмножества рисков в более общие понятия - ...

- а) рационализация;
- б) оптимизация;
- в) классификация.

4. Качественный анализ риска не включает следующую методику:

- а) факторный анализ;
- б) SWOT-анализ;
- в) PEST-анализ.

5. По степени ущерба выделяют следующие виды рисков:

- а) диверсифицируемые и недиверсифицируемые;
- б) частичные, допустимые, критические, катастрофические;
- в) несистематические и систематические.

6. Метод, показывающий, насколько изменится чистая сегодняшняя стоимость проекта в ответ на изменение одной входной переменной, при том что все остальные условия не меняются – это...

- а) анализ точки безубыточности;
- б) анализ сценариев;
- в) анализ чувствительности.

7. Метод, который включает одновременное (параллельное) изменение факторов, влияющих на риск - ...

- а) анализ точки безубыточности;
- б) анализ сценариев;
- в) метод β -коэффициента.

8. Для принятия эффективного решения по управлению и снижению рисков экономической безопасности определяющей целью выбирают ...

- а) избежание катастрофы;
- б) извлечение выгод;
- в) минимизацию затрат, связанных с риском.

9. Под нормальным понимается такое функционирование предприятия, которое в существующих внешних условиях обеспечивает достижение им поставленных целей ... образом или достаточно близким к нему.

- а) эффективным;

б) рациональным;

в) оптимальным.

10. Методы предупреждения рисков экономической безопасности в предпринимательской деятельности, предполагающие исключение рисков ситуации из бизнеса носят название методов:

а) диссипации;

б) уклонения от рисков;

в) компенсации.

11. Методы управления рисками, связанные с распределением риска между стратегическими партнерами, носят название методов:

а) диссипации;

б) компенсации рисков;

в) локализации рисков.

12. Снижение риска за счет распределения готовой продукции предприятия между несколькими контрагентами, - это ...

а) диверсификация рынка сбыта (развитие рынка);

б) диверсификация закупок;

в) диверсификация видов хозяйственной деятельности.

13. Наглядное изображение на графиках и картинках, подчеркивающее важные, существенные стороны соответствующих рисков - ...

а) картографирование;

б) апробация;

в) визуализация.

14. Отражают последствия рисков событий в виде стоимостного (денежного) или материально-вещественного (физического) выражения ...

а) относительные показатели;

б) абсолютные показатели;

в) вероятностные показатели.

15. В ходе формирования методологических основ интегральной системы управления рисками к показателям экономической безопасности социальной сферы относят:

а) уровень загруженности производственных мощностей;

б) доля инновационной продукции;

в) доля работников с высшим и средним образованием.

ТЕМЫ КУРСОВЫХ РАБОТ ПО ДИСЦИПЛИНЕ «МОНИТОРИНГ И ПРЕДУПРЕЖДЕНИЕ РИСКОВ ЭКОНОМИЧЕСКОЙ БЕЗОПАСНОСТИ»

1. Диагностика финансового состояния как элемент системы предупреждения рисков экономической безопасности организации.
2. Особенности проявления рисков в коммерческой деятельности предприятия в ... (сфера деятельности на выбор студента).
3. Концепция приемлемого риска и ее использование в обеспечение экономической безопасности предприятия.
4. Оценка и механизм нейтрализации внешних рисков экономической безопасности предприятия.
5. Оценка и механизм нейтрализации внутренних рисков экономической безопасности предприятия.
6. Качественный подход к оценке рисков экономической безопасности. SWOT-анализ как метод качественной оценки рисков предприятия.
7. Качественный подход к оценке рисков экономической безопасности. PEST-анализ как метод качественной оценки рисков предприятия.
8. Качественный подход к оценке рисков экономической безопасности. GETS-анализ как метод качественной оценки рисков предприятия.
9. Характеристика статистических методов количественной оценки рисков экономической безопасности на примере...
10. Характеристика экспертных методов количественной оценки рисков экономической безопасности на примере...
11. Метод аналогий и его использование при количественной оценке рисков экономической безопасности коммерческой организации.
12. Анализ чувствительности как метод оценки рисков экономической безопасности коммерческой организации.
13. Анализ сценариев как метод оценки рисков экономической безопасности коммерческой организации.
14. Метод ставки процента с поправкой на риск и его применение для оценки рисков экономической безопасности коммерческой организации.

15. Метод «дерева решений» и его применение для оценки рисков экономической безопасности коммерческой организации.
16. Управление рисками в коммерческой деятельности производственного предприятия.
17. Управление рисками в коммерческой деятельности предприятия РХК.
18. Управление рисками в коммерческой деятельности сельскохозяйственного предприятия.
19. Управление рисками в коммерческой деятельности строительного предприятия.
20. Управление рисками в коммерческой деятельности торгового предприятия.
21. Информационное обеспечение системы управления рисками организации.
22. Основные методы снижения рисков экономической безопасности организации.
23. Организация управления рисками экономической безопасности в масштабе предприятия.
24. Методы и инструментарий управления рисками экономической безопасности предприятия крупного бизнеса.
25. Методологические подходы к выявлению рисков экономической безопасности банка.
26. Методы социально-экономического прогнозирования рисков экономической безопасности предприятия.
27. Статистические методы прогнозирования рисков экономической безопасности организации.
28. Экспертные методы прогнозирования рисков экономической безопасности организации.
29. Прогнозирование рисков предприятия и современные компьютерные технологии.
30. Сценарные экспертные подходы к прогнозированию рисков экономической безопасности предприятия.
31. Оценка эффективности методов управления рисками экономической безопасности предприятия.
32. Проблемы разработки и применения пороговых значения рисков экономической безопасности экономической системы (на уровне государства, региона, предприятия – на выбор студента).
33. Методы расчета и анализа рисков на основе показателей финансово-хозяйственной деятельности организации.

34. Модели определения и оценки риска банкротства современного предприятия.
35. Мониторинг рисков и угроз экономической безопасности предприятия.
36. Система технико-экономических показателей оценки рисков экономической безопасности предприятия промышленности с учетом специфики его функционирования.
37. Система технико-экономических показателей оценки рисков экономической безопасности агропромышленного предприятия с учетом специфики его функционирования.
38. Система технико-экономических показателей оценки рисков экономической безопасности предприятия рыбного хозяйства с учетом специфики его функционирования.
39. Оценка эффективности мероприятий по нейтрализации рисков экономической безопасности предприятия (на примере ...).
40. Прогноз динамики развития основных рисков и угроз экономической безопасности предприятия.
41. Создание системы измерения и отслеживания параметров, характеризующих состояние экономической безопасности предприятия.
43. Исследование тенденций изменения основных показателей экономической безопасности, выявление рисков и угроз и прогнозирование их последствий.
44. Оценка эффективности мероприятий по нейтрализации рисков экономической безопасности предприятия (на примере ...).
45. Страхование как механизм нейтрализации рисков экономической безопасности (на примере...).
46. Распределение как инструмент управления рисками экономической безопасности.
47. Диверсификация как инструмент управления рисками экономической безопасности.
46. Оценка основных и специфических рисков экономической безопасности предприятия сельского хозяйства Калининградской области.
47. Оценка экономической эффективности и внутренних рисков производственного предприятия на примере ...
48. Оценка экономической эффективности и внешних рисков производственного предприятия на примере ...
49. Оценка основных и специфических рисков экономической безопасности предприятий рыбохозяйственного комплекса Калининградской области.
50. Логистические риски как фактор дестабилизации экономической безопасности предприятия.

51. Финансовые риски как фактор дестабилизации экономической безопасности предприятия.

52. Коммерческие риски как фактор дестабилизации экономической безопасности предприятия.

53. Транспортные риски как фактор дестабилизации экономической безопасности предприятия.

54. Технические риски как фактор дестабилизации экономической безопасности предприятия.

55. Оценка кредитных рисков и механизмы их нейтрализации (на примере ...).

56. Оценка производственных рисков и механизмы их нейтрализации (на примере ...).

57. Оценка экологических рисков и механизмы их нейтрализации (на примере ...).

58. Оценка информационных рисков и механизмы их нейтрализации (на примере ...).

59. Оценка инвестиционных рисков и механизмы их нейтрализации (на примере ...).

60. Анализ системы показателей эффективности и рисков электронной торговли.

ТИПОВЫЕ ЗАДАНИЯ ВЫПОЛНЕНИЮ КУРСОВЫХ РАБОТ ПО ДИСЦИПЛИНЕ «МОНИТОРИНГ И ПРЕДУПРЕЖДЕНИЕ РИСКОВ ЭКОНОМИЧЕСКОЙ БЕЗОПАСНОСТИ»

Тема 1. Анализ чувствительности как метод количественной оценки рисков экономической безопасности без учета закона распределения вероятностей

Студенту необходимо раскрыть тему по следующему плану:

Введение

1 Анализ чувствительности как метод количественной оценки рисков экономической безопасности

1.1 Роль количественной оценки рисков в обеспечении экономической безопасности предприятия.

1.2 Характеристика основных методов количественной оценки рисков и неопределенности

1.3 Анализ чувствительности как метод количественной оценки риска, его преимущества и недостатки

2 Практическое применение анализа чувствительности для оценки рисков экономической безопасности предприятия

2.1 Общая характеристика предприятия

2.2 Описание проекта и определение рейтинга факторов, проверяемых на риск

2.3 Определение показателей чувствительности и прогнозируемости переменных проекта, построение матрицы

Заключение

Тема 2. SWOT-анализ как метод качественной оценки рисков экономической безопасности

Студенту необходимо раскрыть тему по следующему плану:

Введение

1 SWOT-анализ как метод качественной оценки рисков экономической безопасности

1.1 Роль качественной оценки рисков в обеспечении экономической безопасности предприятия.

1.2 Характеристика основных методов качественной оценки рисков и неопределенности

1.3 SWOT-анализ как метод качественной оценки риска, его преимущества и недостатки

2 Практическое применение SWOT-анализа для оценки рисков экономической безопасности предприятия

2.1 Общая характеристика предприятия и результатов его деятельности

2.2 Анализ внутренних и внешних факторов, влияющих на степень риска бизнеса

2.3 Построение матрицы SWOT-анализа рисков экономической безопасности предприятия

Заключение

Тема 3. Страхование как механизм нейтрализации рисков предприятия (на примере ...)

Студенту необходимо раскрыть тему по следующему плану:

Введение

1 Теоретические аспекты страхования как механизма нейтрализации рисков предприятия

1.1 Методы управления рисками предприятия и особенности их нейтрализации

1.2 Роль и место страхования в системе экономической безопасности предприятия

1.3 Особенности применения страхования как механизма нейтрализации рисков предприятия

2 Оценка использования страхования как механизма нейтрализации рисков ООО ...

2.1 Общая характеристика деятельности предприятия и анализ его эффективности

2.2 Оценка текущего состояния экономической безопасности предприятия

2.3 Оценка использования страхования на предприятии с целью нейтрализации рисков его деятельности

3 Совершенствование использования страхования как механизма нейтрализации рисков ООО ...

3.1 Мероприятия по совершенствованию использования страхования как механизма нейтрализации рисков предприятия

3.2. Оценка эффективности предложенных мероприятий

Заключение

ТИПОВЫЕ ЗАДАНИЯ ДЛЯ ПРОВЕДЕНИЯ ПРАКТИЧЕСКИХ ЗАНЯТИЙ ПО ДИСЦИПЛИНЕ «МОНИТОРИНГ И ПРЕДУПРЕЖДЕНИЕ РИСКОВ ЭКОНОМИЧЕСКОЙ БЕЗОПАСНОСТИ»

Практическая работа № 2. Анализ и оценка экономических рисков

Задание 1

Вставьте в пропуски номера приведенных внизу страницы слов и выражений, подходящих по смыслу:

1. Различают следующие виды вероятности: (), (), (), ().
2. По времени возникновения неопределенность бывает (), () и (),
3. С точки зрения вероятности осуществления событий выделяют следующие виды неопределенности: (), (), ().
4. Согласно К. Марксу у капиталиста существует два главных источника получения сверхприбыли: () и ().
5. По степени причинения ущерба выделяют следующие виды рисков: (), (), (), ().
6. Джон Стюарт Милль рассматривал предпринимательскую прибыль как сумму трех слагаемых: (), (), ().
7. Корпоративные ресурсы включают следующие ресурсы: (), (), (), (), (), (), ().
8. Г. Фон Мангольд разделил понятия: () и ().
9. Выделяют две основные функции рисков: () и ().
10. Примерная структура функциональных составляющих экономической безопасности предприятия: (), (), (), (), (), (), ().

Ответы: 1. производство на рынок; 2. заработная плата капиталиста; 3. прав; 4. полная неопределенность; 5. финансовая; 6. внедрение нового оборудования; 7. статистическая; 8. интеллектуальная и кадровая; 9. ретроспективная; 10. техники и оборудования; 11. защитная; 12. катастрофический; 13. частичная неопределенность; 14. технико-технологическая; 15. производство на заказ; 16. объективная; 17. политико-правовая; 18. доля (%) на вложенный капитал; 19. информации и технологии; 20. перспективная; 21. критический; 22. экологическая; 23. субъективная; 24. частичный; 25. принуждение рабочей силы к более напряженному труду; 26. информационная; 27. персонала; 28. полная определенность; 29. силовая; 30 регулирующая; 31. плата за риск; 32. допустимый; 33. текущая; 34. математическая априорная; 35. капитала.

Задание 2

Решить следующие задачи:

Задача 1

Пусть имеются два инвестиционных проекта: А и Б. Первый с вероятностью 0,65 обеспечивает прибыль 12 млн. руб., однако с вероятностью 0,35 можно потерять 4 млн. руб.

Для второго проекта с вероятностью 0,75 можно получить прибыль 10 млн. руб. и с вероятностью, равной 0,25, потерять 5,5 млн. руб. Какой проект выбрать?

Задача 2

Пусть имеются два инвестиционных проекта: А и Б. Первый с вероятностью 0,67 обеспечивает прибыль 15 млн. руб., однако с вероятностью 0,33 можно потерять 7,5 млн. руб. Для второго проекта с вероятностью 0,73 можно получить прибыль 14 млн. руб. и с вероятностью, равной 0,27, потерять 6,3 млн. руб. Какой проект выбрать?

Задача 3

Пусть имеются два инвестиционных проекта: А и Б. Первый с вероятностью 0,71 обеспечивает прибыль 13,5 млн. руб., однако с вероятностью 0,29 можно потерять 6,8 млн. руб. Для второго проекта с вероятностью 0,7 можно получить прибыль 12,5 млн. руб. и с вероятностью, равной 0,3 потерять 6,2 млн. руб. Какой проект выбрать?

Задача 4

Пусть имеются два инвестиционных проекта: А и Б. Первый с вероятностью 0,8 обеспечивает прибыль 11,5 млн. руб., однако с вероятностью 0,2 можно потерять 5 млн. руб. Для второго проекта с вероятностью 0,78 можно получить прибыль 12 млн. руб. и с вероятностью, равной 0,22 потерять 5,5 млн. руб. Какой проект выбрать?

Практическая работа № 4. Количественный анализ рисков без учета закона распределения вероятностей

Задание 1

Решите представленные ниже задачи

Задача 1

Определите точку безубыточности проекта, если планируемая цена единицы продукции 8,3 руб., переменные издержки на единицу продукции 7,0 руб., постоянные издержки 237900 руб. Планируемый объем производства 250000 ед.

Задача 2

Определите точку безубыточности проекта, если планируемая цена единицы продукции 11,5 руб., переменные издержки на единицу продукции 8,5 руб., постоянные издержки 465000 руб. Планируемый объем производства 275000 ед.

Задача 3

Определите точку безубыточности проекта, если планируемая цена единицы продукции 17,2 руб., переменные издержки на единицу продукции 10,5 руб., постоянные издержки 486990 руб. Планируемый объем производства 97000 ед.

Задание 2

Оптовая база имеет годовой грузооборот 1000 тонн. Средняя цена 1 тонны груза составляет 15 тыс. руб., постоянные затраты равны 6000 тыс. руб., переменные – 6000 тыс. руб. На основании ниже представленных данных (таблица 3) о расходах на содержание и эксплуатацию имеющегося погрузочно-разгрузочного оборудования до и после капитального ремонта оборудования принять решение о его проведении.

Необходимо учесть, что после проведения капитального ремонта оборудования грузооборот склада увеличиться на 10%.

Таблица 3 – Расходы по статьям содержания и эксплуатации оборудования, тыс. руб.

Статьи РСЭО	До капремонта	После капремонта
Амортизация оборудования и транспортных средств	277,5	277,5
Эксплуатация оборудования и транспортных средств (без расходов на текущий ремонт)	367,5	404,2
Текущий ремонт оборудования и транспортных средств	214,6	236,0
Внутрискладское перемещение грузов	132,0	145,2
Износ малоценного и быстроизнашивающегося инструмента	486,0	534,6
Прочие расходы	22,5	24,7
Всего расходов	1500,0	1622,2

Задание 3

Решить представленные ниже задачи

Задача 1

Ставка, свободная от риска R_f составляет 4%, рыночная премия риска 8,6% и конкретный вид акций имеет $\beta=1,3$. Основываясь на модели САМР, определите ожидаемую доходность акций. Какой была бы ожидаемая доходность, если бы β удвоилась?

Задача 2

Ставка, свободная от риска R_f составляет 5%, рыночная премия риска 9,5% и конкретный вид акций имеет $\beta=1,27$. Основываясь на модели САМР, определите ожидаемую доходность акций. Какой была бы ожидаемая доходность, если бы β возросла в 1,5 раза?

Задача 3

Ставка, свободная от риска R_f составляет 6,5%, рыночная премия риска 7,5% и конкретный вид акций имеет $\beta=1,35$. Основываясь на модели САМР, определите ожидаемую доходность акций. Какой была бы ожидаемая доходность, если бы β возросла в 1,9 раза?

Задача 4

Предприятие использует для финансирования своей деятельности собственный капитал (обыкновенные акции) и заемный капитал (кредит банка). Стоимость кредита – 15% годовых, стоимость собственного капитала (доходность альтернативных вложений) – 20%. Определите средневзвешенную стоимость капитала, если удельный вес заемных средств составляет 30%.

Задача 5

Предприятие использует для финансирования своей деятельности собственный капитал (обыкновенные акции) и заемный капитал (кредит банка). Стоимость кредита – 13% годовых, стоимость собственного капитала (доходность альтернативных вложений) – 22%. Определите средневзвешенную стоимость капитала, если удельный вес заемных средств составляет 35%.

Практическая работа № 6. Методы управления рисками

Задание 1

Решить представленные ниже задачи.

Задача 1

Предприятие планирует осуществить платежи в сумме 10000 долл. через три месяца. Спот-курс – 15 руб. за долл., форвардный курс – 16,5 руб. за долл. Цена исполнения валютного опциона call 16,5 руб., премия – 30 коп. за долл. текущий курс через три месяца – 17,8 руб. за долл.

Определить результаты:

- 1) отказа предприятия от хеджирования;
- 2) хеджирования с помощью форвардной операции;
- 3) хеджирования с помощью опциона.

Задача 2

Предприятие предполагает через три месяца произвести платежи в размере 10 тыс. долл. Оно приобретает опцион на покупку долларов с параметрами: сумма 10 тыс. долл., срок три месяца, курс опциона – 30 руб. за долл., премия 0,93 руб. за долл.

Определить затраты хозяйствующего субъекта и его действия, если:

- а) курс валюты снизиться до 29,5 руб. за долл.;
- б) курс валюты увеличиться до 30,5 руб. за долл.

Задача 3

Хозяйствующий субъект предполагает через три месяца произвести платежи в размере 11500 евро. Он заключает форвардный контракт с параметрами: сумма 11500 евро, срок три месяца, курс 34,0 руб. за евро.

Определить затраты хозяйствующего субъекта и его действия, если:

- а) курс валюты снизиться до 33,5 руб. за евро;
- б) курс валюты увеличиться до 34,9 руб. за евро.

Задание 2

Вставьте в пропуски номера приведенных внизу страницы слов и выражений, подходящих по смыслу:

1. По подходам к минимизации (снижению) выделяют следующие виды риска: (), (), (), ().
2. Правило «пяти С» предполагает учет таких критериев, как: (), (), (), (), ().
3. В настоящее время существуют следующие ветви страхования: (), (), ().
4. К методам диссипации рисков относятся две группы: () и ().
5. Анализ имеющейся литературы по этой теме позволяет сделать вывод о существовании четырех основных групп методов управления риском: (), (), (), ().
6. В области управления рисками экономической безопасности основными являются следующие виды хеджирования: (), (), ().
7. К методам компенсации риска относятся: (), (), (), (), (), ().
8. Принципами информационного обеспечения системы управления рисками являются: (), (), (), ().
9. К недостаткам информации, полученной из внутренних источников относятся: (), () и ().

10. Наиболее распространенными методами наглядного изображения рисков ЭБС являются () и ().

Ответы: 1. личность; 2. прогнозирование внешней экономической обстановки; 3. избежание; 4. уклонение; 5. с использованием опционов; 6. диссипация; 7. личное; 8. полезность; 9. активный маркетинг; 10. изменение тенденций; 11. с использованием фьючерсных контрактов; 12. имущество; 13. диссипация; 14. мониторинг социально-экономической и нормативно-правовой среды; 15. эффективность; 16. снижение; 17. визуализация; 18. обеспечение; 19. имущественное; 20. создание системы резервов; 21. ограниченность объема; 22. распределение; 23. финансовые возможности; 24. с использованием операции «своп»; 25. достоверность; 26. компенсация; 27. искажение данных; 28. принятие на себя; 29. привлечение внешних ресурсов; 30 ответственности; 31. передача третьим лицам; 32. стратегическое планирование; 33. доступность; 34. локализация; 35. общие условия; 36. картографирование.

**ВОПРОСЫ ДЛЯ ПРОВЕДЕНИЯ ПРОМЕЖУТОЧНОЙ АТТЕСТАЦИИ (ЭКЗАМЕН)
ПО ДИСЦИПЛИНЕ «МОНИТОРИНГ И ПРЕДУПРЕЖДЕНИЕ РИСКОВ
ЭКОНОМИЧЕСКОЙ БЕЗОПАСНОСТИ»**

1. Экономическая безопасность хозяйствующих субъектов и источники угроз.
2. Основные понятия курса: риск и неопределенность.
3. Теория рисков в предпринимательстве и ее развитие.
4. Классификация рисков экономической безопасности.
5. Характеристика основных рисков в бизнесе.
6. Основные риски предпринимательской деятельности.
7. Общеметодологические подходы к оценке риска: основные определения и подходы.
8. Статистические методы оценки рисков.
9. Кривая рисков и ее построение.
10. Степень риска и меры риска.
11. Шкалы риска и характеристика их градаций.
12. Абсолютные и относительные показатели оценки риска.
13. Вероятностные и статистические показатели риска.
14. Концепция приемлемого риска. Нормирование рисков.
15. Концепция приемлемого риска и экономическая безопасность предприятия.
16. Качественный анализ и факторы, влияющие на степень риска.
17. Инструменты качественного анализа.
18. Общая характеристика методов количественной оценки рисков.
19. Анализ точки безубыточности как метод количественной оценки рисков.
20. Анализ чувствительности как метод количественной оценки рисков.
21. Анализ сценариев как метод количественной оценки рисков.
22. Методы ставки процента с поправкой на риск: агрегированные методы. Метод β -коэффициента.
23. Методы ставки процента с поправкой на риск: агрегированные методы. Метод средневзвешенной стоимости капитала.
24. Методы ставки процента с поправкой на риск: кумулятивный метод.
25. Оценка рисков экономической безопасности с помощью метода «дерево решений».

26. Наиболее распространенные показатели совокупного риска экономической безопасности проекта.
27. Основные принципы, правила и приемы управления рисками. Этапы процесса управления риском.
28. Содержание и основные этапы идентификации и анализа рисков экономической безопасности.
29. Принципы информационного обеспечения системы управления рисками. Картографирование рисков.
30. Структура и содержание информационной системы, обеспечивающей процесс идентификации и анализа рисков.
31. Визуализация рисков экономической безопасности.
32. Мониторинг угроз экономической безопасности предприятия.
33. Система технико-экономических показателей оценки экономической безопасности предприятия. Комплексная оценка финансовой устойчивости.
34. Система технико-экономических показателей оценки экономической безопасности предприятия. Оценка уровня развития предприятия.
35. Оценка пороговых значений показателей экономической безопасности.
36. Прогноз динамики развития основных угроз экономической безопасности.
37. Создание системы измерения и отслеживания параметров, характеризующих состояние предприятия.
38. Выявление тенденций изменения основных показателей экономической безопасности, выявление угроз и прогнозирование их последствий.
39. Методы предупреждения экономических рисков.
40. Методы локализации и диссипации риска.
41. Методы компенсации, распределения и ограничения рисков.
42. Взаимосвязь понятий «риск», «вероятность», неопределенность.
43. Особенности проявления риска на практике.
44. Рисковый капитал и его роль в обеспечении экономической безопасности предприятия.
45. Управление риском: цели и задачи.
46. Классификация методов управления рисками.
47. Практический инструментарий управления рисками.
48. Источники рисков и угроз экономической безопасности хозяйствующих субъектов.

49. Принцип «четырех ролей» и предупреждение рисков экономической безопасности.

50. Предупреждение рисков экономической безопасности предприятия

**ТИПОВЫЕ ЭКЗАМЕНАЦИОННЫЕ ЗАДАНИЯ ДЛЯ ПРОМЕЖУТОЧНОЙ
АТТЕСТАЦИИ ПО ДИСЦИПЛИНЕ «МОНИТОРИНГ И ПРЕДУПРЕЖДЕНИЕ
РИСКОВ ЭКОНОМИЧЕСКОЙ БЕЗОПАСНОСТИ»**

Задача 1

Пусть имеются два инвестиционных проекта: А и Б. Первый с вероятностью 0,6 обеспечивает прибыль 12 млн. руб., однако с вероятностью 0,4 можно потерять 4 млн. руб.

Для второго проекта с вероятностью 0,75 можно получить прибыль 10 млн. руб. и с вероятностью, равной 0,25, потерять 5,5 млн. руб. Какой проект выбрать?

Задача 2

Пусть имеются два инвестиционных проекта: А и Б. Первый с вероятностью 0,65 обеспечивает прибыль 15 млн. руб., однако с вероятностью 0,35 можно потерять 7,5 млн. руб.

Для второго проекта с вероятностью 0,73 можно получить прибыль 14 млн. руб. и с вероятностью, равной 0,27, потерять 6,3 млн. руб. Какой проект выбрать?

Задача 3

Пусть имеются два инвестиционных проекта: А и Б. Первый с вероятностью 0,7 обеспечивает прибыль 13,5 млн. руб., однако с вероятностью 0,3 можно потерять 6,8 млн. руб.

Для второго проекта с вероятностью 0,7 можно получить прибыль 12,5 млн. руб. и с вероятностью, равной 0,3 потерять 6,2 млн. руб. Какой проект выбрать?

Задача 4

Пусть имеются два инвестиционных проекта: А и Б. Первый с вероятностью 0,8 обеспечивает прибыль 11,5 млн. руб., однако с вероятностью 0,2 можно потерять 5 млн. руб.

Для второго проекта с вероятностью 0,75 можно получить прибыль 12 млн. руб. и с вероятностью, равной 0,25 потерять 5,5 млн. руб. Какой проект выбрать?

Задача 5

Пусть имеются два инвестиционных проекта: А и Б. Первый с вероятностью 0,8 обеспечивает прибыль 11 млн. руб., однако с вероятностью 0,2 можно потерять 6 млн. руб.

Для второго проекта с вероятностью 0,75 можно получить прибыль 13 млн. руб. и с вероятностью, равной 0,25 потерять 5,5 млн. руб. Какой проект выбрать?

Задача 6

Корпорация хочет определить ожидаемую доходность актива Х. На основе уравнения регрессии было найдено значение β -коэффициента +1,5. Норма доходности безрискового актива равна 8%. Доходность рыночного портфеля обыкновенных акций равна 12%. Найти ожидаемую доходность актива.

Задача 7

Корпорация хочет определить ожидаемую доходность актива Х (обыкновенная акция другой корпорации). На основе уравнения регрессии было найдено значение β -коэффициента +1,45. Норма доходности безрискового актива равна 9%. Доходность рыночного портфеля обыкновенных акций равна 12,5%. Найти ожидаемую доходность актива.

Задача 8

Корпорация хочет определить ожидаемую доходность актива Х. На основе уравнения регрессии было найдено значение β -коэффициента +1,6. Норма доходности безрискового актива равна 9%. Доходность рыночного портфеля обыкновенных акций равна 12,6%. Найти ожидаемую доходность актива.

Задача 9

Корпорация хочет определить ожидаемую доходность актива Х (обыкновенная акция другой корпорации). На основе уравнения регрессии было найдено значение β -коэффициента +1,55. Норма доходности безрискового актива равна 7,5%. Доходность рыночного портфеля обыкновенных акций равна 15%. Найти ожидаемую доходность актива.

Задача 10

Корпорация хочет определить ожидаемую доходность актива Х. На основе уравнения регрессии было найдено значение β -коэффициента +1,35. Норма доходности безрискового

актива равна 7%. Доходность рыночного портфеля обыкновенных акций равна 13%. Найти ожидаемую доходность актива.

Задача 11

Компания производит продукт А. Величина постоянных затрат 200000 руб. для данного производства. Максимально возможный объем выпуска продукции составляет 1000 ед. Единица продукции реализуется по цене 750 руб., переменные затраты составляют 250 руб. за единицу продукции. Найти точку безубыточности.

Задача 12

Компания производит продукт А. Величина постоянных затрат 250000 руб. для данного производства. Максимально возможный объем выпуска продукции составляет 1200 ед. Единица продукции реализуется по цене 775 руб., переменные затраты составляют 250 руб. за единицу продукции. Найти точку безубыточности.

Задача 13

Компания производит продукт А. Величина постоянных затрат 225000 руб. для данного производства. Максимально возможный объем выпуска продукции составляет 1100 ед. Единица продукции реализуется по цене 780 руб., переменные затраты составляют 245 руб. за единицу продукции. Найти точку безубыточности.

Задача 14

Компания производит продукт А. Величина постоянных затрат 240000 руб. для данного производства. Максимально возможный объем выпуска продукции составляет 1300 ед. Единица продукции реализуется по цене 700 руб., переменные затраты составляют 250 руб. за единицу продукции. Найти точку безубыточности.

Задача 15

Компания производит продукт А. Величина постоянных затрат 240000 руб. для данного производства. Максимально возможный объем выпуска продукции составляет 1250 ед. Единица продукции реализуется по цене 850 руб., переменные затраты составляют 300 руб. за единицу продукции. Найти точку безубыточности.