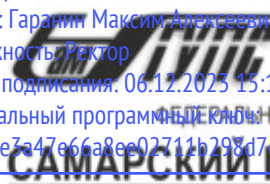


Документ подписан простой электронной подписью  
Информация о владельце:  
ФИО: Гарант Максим Алексеевич  
Должность: Ректор  
Дата подписания: 06.12.2023 15:18:28  
Уникальный программный ключ:  
7708e7a47e66a8ee02711b298d7e78bd1e40bf88

 **МИНИСТЕРСТВО ТРАНСПОРТА РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ**  
**ФЕДЕРАЛЬНОЕ АГЕНТСТВО ЖЕЛЕЗНОДОРОЖНОГО ТРАНСПОРТА**  
ФЕДЕРАЛЬНОЕ ГОСУДАРСТВЕННОЕ БЮДЖЕТНОЕ ОБРАЗОВАТЕЛЬНОЕ УЧРЕЖДЕНИЕ ВЫСШЕГО ОБРАЗОВАНИЯ  
**САМАРСКИЙ ГОСУДАРСТВЕННЫЙ УНИВЕРСИТЕТ ПУТЕЙ СООБЩЕНИЯ**

Приложение  
к рабочей программе дисциплины

## **ОЦЕНОЧНЫЕ МАТЕРИАЛЫ ДЛЯ ПРОМЕЖУТОЧНОЙ АТТЕСТАЦИИ ПО ДИСЦИПЛИНЕ (МОДУЛЮ)**

### **УПРАВЛЕНИЕ ЛОГИСТИЧЕСКИМИ РИСКАМИ**

---

*(наименование дисциплины(модуля))*

Направление подготовки / специальность

**38.04.02 Менеджмент**

---

*(код и наименование)*

Направленность (профиль)/специализация

**Логистика, управление цепями поставок**

---

*(наименование)*

## Содержание

1. Пояснительная записка.
2. Типовые контрольные задания или иные материалы для оценки знаний, умений, навыков и (или) опыта деятельности, характеризующих уровень сформированности компетенций.
3. Методические материалы, определяющие процедуру и критерии оценивания сформированности компетенций при проведении промежуточной аттестации.

## 1. Пояснительная записка

Цель промежуточной аттестации – оценивание промежуточных и окончательных результатов обучения по дисциплине, обеспечивающих достижение планируемых результатов освоения образовательной программы.

Формы промежуточной аттестации:

очная форма обучения – зачет с оценкой, 4 семестр.

заочная форма обучения – зачет с оценкой, 2 курс.

### Перечень компетенций, формируемых в процессе освоения дисциплины

Код и наименование компетенции	Код индикатора достижения компетенции
ПК-6: Способен оценивать риски, контролировать вероятность их наступления и масштаб последствий для операционных направлений логистической деятельности, финансовых потоков логистики	ПК-6.1: Разрабатывает, внедряет, осуществляет оперативное сопровождение использования интегрированных систем управления рисками

### Результаты обучения по дисциплине, соотнесенные с планируемыми результатами освоения образовательной программы

Код и наименование индикатора достижения компетенции	Результаты обучения по дисциплине	Оценочные материалы
ПК-6.1: Разрабатывает, внедряет, осуществляет оперативное сопровождение использования интегрированных систем управления рисками	Обучающийся знает: Принципы организации системы интегрированного управления рисками и основные функции и обязанности по интегрированному управлению рисками, мероприятия направленные на выполнение операционных заданий, своевременное выполнение поручений работниками, вовлеченными в оказание логистической услуги	Вопросы (№ 1-10)
	Обучающийся умеет: Осуществлять оперативное сопровождение использования интегрированных систем управления рисками, оценивать степень влияния мероприятий на выполнение операционных заданий, своевременное выполнение поручений работниками, вовлеченными в оказание логистической услуги	Задания (№ 1-4)
	Обучающийся владеет: навыками практической подготовки в разработке и внедрении интегрированных систем управления рисками, методами анализа мероприятий направленных на выполнение операционных заданий, своевременного выполнения поручений работниками, вовлеченными в оказание логистической услуги	Задания (5– 8)

Промежуточная аттестация (зачет с оценкой) проводится в одной из следующих форм:

- 1) собеседование;
- 2) выполнение заданий в ЭИОС СамГУПС.

## 2. Типовые контрольные задания или иные материалы для оценки знаний, умений, навыков и (или) опыта деятельности, характеризующих уровень сформированности компетенций

### 2.1 Типовые вопросы (тестовые задания) для оценки знаниевого образовательного результата

#### Проверяемый образовательный результат

Код и наименование индикатора достижения компетенции	Образовательный результат
ПК-6.1: Разрабатывает, внедряет, осуществляет оперативное сопровождение использования интегрированных систем управления рисками	Обучающийся знает: Принципы организации системы интегрированного управления рисками и основные функции и обязанности по интегрированному управлению рисками, мероприятия направленные на выполнение операционных заданий, своевременное выполнение поручений работниками, вовлеченными в оказание логистической услуги

#### **ПРИМЕРЫ ВОПРОСОВ**

##### 1. Что такое риск?

- а) разновидность ситуации, объективно содержащая высокую вероятность невозможности осуществления цели
- б) наличие факторов, при которых результаты действий не являются детерминированными, а степень возможного влияния этих факторов на результаты неизвестна
- в) следствие действия либо бездействия, в результате которого существует реальная возможность получения неопределенных результатов различного характера

##### 2. Выберите метод оценки риска, который используется в ситуациях, когда принимаемые решения сильно зависят от принятых ранее и определяют сценарии дальнейшего развития событий?

- а) имитационное моделирование
- б) вероятностный метод
- в) учет рисков при расчете чистой приведенной стоимости
- г) построение дерева решений
- д) анализ чувствительности
- е) метод сценариев

##### 3. Выберите метод оценки риска, который представляет собой серию численных экспериментов, призванных получить эмпирические оценки степени влияния различных факторов на некоторые зависящие от них результаты?

- а) учет рисков при расчете чистой приведенной стоимости
- б) анализ чувствительности
- в) построение дерева решений
- г) вероятностный метод
- д) метод сценариев
- е) имитационное моделирование

##### 4. Какие потери можно считать финансовыми?

- а) потери ценных бумаг
- б) потери сырья
- в) невыполнение сроков сдачи объекта
- г) выплата штрафа
- д) уплата дополнительных налогов
- е) уменьшение выручки вследствие снижения цен на реализуемую продукцию

##### 5. Факторы, которые влияют на уровень финансовых рисков подразделяются на:

- а) объектные и субъектные;
- б) позитивные и негативные;
- в) простые и сложные.

##### 6. Какие потери можно отнести к потерям времени

- а) невыполнение сроков сдачи объекта
- б) потери ценных бумаг
- в) выплата штрафа
- г) уменьшение выручки вследствие снижения цен на реализуемую продукцию

д) уплата дополнительных налогов

7. Как называется процесс использования механизмов уменьшения рисков? \_\_\_\_\_

- а) диверсификация;
- б) лимитирование;
- в) хеджирование.

8. Что такое анализ риска?

- а) систематизация множества рисков на основании каких-либо признаков и критериев, позволяющих объединить подмножества рисков в более общие понятия
- б) систематическое научное исследование степени риска, которому подвержены конкретные объекты, виды деятельности и проекты
- в) начальный этап системы мероприятий по управлению рисками, состоящий в систематическом выявлении рисков, характерных для определенного вида деятельности, и определении их характеристик

9. Что является принципом действия механизма диверсификации?

- а) избежание рисков;
- б) разделение рисков;
- в) снижение рисков.

10. Что такое идентификация риска? \_\_\_\_\_

- а) систематизация множества рисков на основании каких-либо признаков и критериев, позволяющих объединить подмножества рисков в более общие понятия
- б) начальный этап системы мероприятий по управлению рисками, состоящий в систематическом выявлении рисков, характерных для определенного вида деятельности, и определении их характеристик
- в) систематическое научное исследование степени риска, которому подвержены конкретные объекты, виды деятельности и проекты

## 2.2 Типовые задания для оценки навыкового образовательного результата

Проверяемый образовательный результат:

Код и наименование индикатора достижения компетенции	Образовательный результат
ПК-6.1: Разрабатывает, внедряет, осуществляет оперативное сопровождение использования интегрированных систем управления рисками	Обучающийся умеет: Осуществлять оперативное сопровождение использования интегрированных систем управления рисками, оценивать степень влияния мероприятий на выполнение операционных заданий, своевременное выполнение поручений работниками, вовлеченными в оказание логистической услуги

### Примеры заданий

#### Задание 1. Предложение об инвестировании

Фирма рассматривает предложение об инвестировании на один год своих свободных денежных средств в предприятие, занимающееся автоперевозками. Рентабельность этого предприятия, а следовательно, и рентабельность инвестиции фирмы зависит от возможного изменения тарифов (например, из-за соответствующего изменения цен на нефть). Пусть по оценкам экспертов в рамках анализа таких рисков соответственно необходимо учесть следующие возможные сценарии (в среднем за год):

1. С вероятностью 0,3 тарифы возрастут на 30% (событие A1).
2. С вероятностью 0,4 тарифы возрастут на 20% (событие A2).
3. С вероятностью 0,1 тарифы возрастут на 10% (событие A3).
4. С вероятностью 0,1 тарифы останутся на прежнем уровне (событие A4).
5. С вероятностью 0,1 тарифы снизятся на 10% (событие A5).

В соответствии с такими возможными вариантами развития событий (в среднем за год) ожидаются следующие поступления выплаты на каждую инвестируемую 1 000 у. е.:

Ситуации	A1	A2	A3	A4	A5
Выплаты	1500	1400	1200	1000	900

## ТРЕБУЕТСЯ

Руководство фирмы желает получить комментарии относительно ожидаемой рентабельности такого предложения в условиях риска.

### Задание 2. Выбор альтернативы

Фирма, занимающаяся морскими перевозками, имеет два предложения на один и тот же период времени. Ресурсы фирмы позволяют ей заключить только один контракт из двух, которые предлагаются (они представлены ниже). Условия этих контрактов включают соответствующие штрафные санкции из-за возможных случайных задержек доставки груза. При этом доход фирмы (обозначим его через  $Y$  - как прибыль от реализации контракта) с учетом имеющихся рисков можно представить следующим образом.

1. Для первого из этих контрактов доход/прибыль  $Y_1$  (в тыс у.е.) к концу периода представляется в виде:

$$Y_1 = 100 - X_1 - Z_1,$$

где

$X_1$  - случайные возможные потери из-за имеющих место забастовок докеров в соответствующем порту с нормальным законом распределения вероятностей  $N(20;10)$ ;

$Z_1$  - случайные потери (не зависящие от  $X_1$ ), обуславливаемые задержками в доставке из-за погодных условий, с равномерным законом распределения вероятностей  $R(0;10)$ .

2. Аналогичное представление для дохода/прибыли в рамках второго из рассматриваемых контрактов имеет вид:

$$Y_2 = 90 - X_2 - Z_2,$$

где случайные составляющие  $X_2$  и  $Z_2$  независимы между собой, причем  $X_2$  имеет нормальный закон распределения вероятностей  $N(15;3)$ , а  $Z_2$  имеет равномерный закон распределения  $R(0;4)$ .

## ТРЕБУЕТСЯ

выбрать наилучшее решение с учетом указанных рисков для случая, когда руководство фирмы (ЛПР) принимает решения на основе критерия EVC.

### Задание 3. Включение в портфель ценных бумаг

Финансовый аналитик должен обосновать включение в портфель дополнительной ценной бумаги, выбрав одну из двух ценных бумаг, историческая доходность которых за последние 5 лет представлена в следующей таблице.

Доходность акции А. %	14,75	7,23	15,66	18,45	12,14
Доходность акции В. %	20,33	10,85	5,22	22,41	19,23

### Задание 4. Инвестиционный проект

Посоветуйте инвестору, какой из двух инвестиционных проектов выбрать: проект А с вероятностью 0,6 принесет прибыль 15 млн рублей, и с вероятностью 0,4 принесет убытки в размере 5,5 млн рублей. Проект В с вероятностью 0,8 принесет прибыль 10 млн рублей, а с вероятностью 0,2 - потери 6 млн рублей.

достижения компетенции	
ПК-6.1: Разрабатывает, внедряет, осуществляет оперативное сопровождение использования интегрированных систем управления рисками	Обучающийся владеет: навыками практической подготовки в разработке и внедрении интегрированных систем управления рисками, методами анализа мероприятий направленных на выполнение операционных заданий, своевременного выполнения поручений работниками, вовлеченными в оказание логистической услуги

## Примеры заданий

### Задание 5. Финансовый проект

Необходимо принять решение об участии в одном из двух финансовых проектов, доходности которых зависят от состояния экономики страны. Варианты развития состояния экономики и соответствующие доходности проектов представлены в следующей таблице:

Состояние экономики	Вероятность	Доходность. %	
		Проект 1	Проект 2
Глубокий спад	0,05	-3	-2
Спад	0,2	6	9
Стагнация	0,5	11	12
Подъем	0,2	14	15
Быстрый рост	0,05	19	26

### Задание 6. Выбор вложений в бизнес

Предприниматель решает, в какой бизнес выгоднее вложиться: заняться бытовой техникой или выйти на рынок телекоммуникаций. При выборе первой альтернативы, при прочих равных условиях, через год случайный конечный доход реализуется с равными шансами в интервале от 37 тыс. у. е. до 73 тыс. у. е. При выборе второй альтернативы - в интервале от 40 тыс. у. е. до 69 тыс. у. е. Какой вид бизнеса выберет предприниматель?

### Задание 7. Выбор вида продукта для производства

Имеются объемы выручки от реализации продукции трех видов, они оцениваются как случайные величины с распределениями следующего вида:

Продукция вида А (тыс. у. е.)					
X	100	150	200	250	300
P	0,15	?	0,4	0,2	0,13

Продукция вида Б (тыс. у. е.)					
X	100	150	200	250	300
P	0,03	0,07	0,04	0,71	?

Продукция вида В (тыс. у. е.)					
X	100	150	200	250	300

Р	0,2	0,05	0,14	?	0,31
---	-----	------	------	---	------

### Задание 8. Оценка и сравнение риска

Доход для первой альтернативы принимается как случайный конечный экономический результат, значения которого с равными шансами реализуются в интервале от 100 до 250 тыс. у. е., а для второй - от 95 до 220 тыс. у. е. Оцените и сравните риски.

Проверяемый образовательный результат:

### **2.3. Перечень вопросов для подготовки обучающихся к промежуточной аттестации**

#### **Перечень вопросов к зачету**

1. Риск и особенности его проявления
2. Риск и устойчивость функционирования коммерческого предприятия
3. Классификация и системный классификатор рисков
4. Морфологический анализ рисков в базовых и нестандартных бизнес-ситуациях
5. Атрибуты процесса управления риском в коммерческих организациях
6. Концепция системы управления рисками в таможенной службе РФ
7. Виды потерь ресурсов и зоны риска
8. Методика определения размера убытков, причиненных нарушениями хозяйственных договоров.
9. Аналитическое представление альтернативных решений и отношения к риску.
10. Графическое представление решений в пространстве «риск-доход».
11. Аналитическое описание метода дерева решений
12. Применение процедур метода дерева решений
13. Управление рисками на основе перераспределении доли участия ЛПР в предложении бизнеса
14. Управление рисками за счет привлечения партнеров в формате концепции чистых рисков
15. Аналитические атрибуты процедур диверсификации.
16. Графическое представление процедур диверсификации
17. Модели страхования как модели диверсификации рисков
18. Выбор страхового контракта на основе дерева решений
19. Формализация модели на основе дерева решений
20. Оптимальное решение с учетом отношения к риску.



### 3. Методические материалы, определяющие процедуру и критерии оценивания сформированности компетенций при проведении промежуточной аттестации

#### Критерии формирования оценок по результатам выполнения заданий

**«Отлично/зачтено»** – ставится за работу, выполненную полностью без ошибок и недочетов.

**«Хорошо/зачтено»** – ставится за работу, выполненную полностью, но при наличии в ней не более одной негрубой ошибки и одного недочета, не более трех недочетов.

**«Удовлетворительно/зачтено»** – ставится за работу, если обучающийся правильно выполнил не менее 2/3 всей работы или допустил не более одной грубой ошибки и двух недочетов, не более одной грубой и одной негрубой ошибки, не более трех негрубых ошибок, одной негрубой ошибки и двух недочетов.

**«Неудовлетворительно/не зачтено»** – ставится за работу, если число ошибок и недочетов превысило норму для оценки «удовлетворительно» или правильно выполнено менее 2/3 всей работы.

*Виды ошибок:*

- *грубые ошибки: незнание основных понятий, правил, норм; незнание приемов решения задач; ошибки, показывающие неправильное понимание условия предложенного задания.*

- *негрубые ошибки: неточности формулировок, определений; нерациональный выбор хода решения.*

- *недочеты: нерациональные приемы выполнения задания; отдельные погрешности в формулировке выводов; небрежное выполнение задания.*

#### Критерии формирования оценок по ответам на вопросы, выполнению тестовых заданий

- оценка **«отлично»** выставляется обучающемуся, если количество правильных ответов на вопросы составляет 100 – 90% от общего объема заданных вопросов;

- оценка **«хорошо»** выставляется обучающемуся, если количество правильных ответов на вопросы – 89 – 76% от общего объема заданных вопросов;

- оценка **«удовлетворительно»** выставляется обучающемуся, если количество правильных ответов на тестовые вопросы – 75–60 % от общего объема заданных вопросов;

- оценка **«неудовлетворительно»** выставляется обучающемуся, если количество правильных ответов – менее 60% от общего объема заданных вопросов.

#### Критерии формирования оценок по зачету с оценкой

**«Отлично/зачтено»** – студент приобрел необходимые умения и навыки, продемонстрировал навык практического применения полученных знаний, не допустил логических и фактических ошибок

**«Хорошо/зачтено»** – студент приобрел необходимые умения и навыки, продемонстрировал навык практического применения полученных знаний; допустил незначительные ошибки и неточности.

**«Удовлетворительно/зачтено»** – студент допустил существенные ошибки.

**«Неудовлетворительно/не зачтено»** – студент демонстрирует фрагментарные знания изучаемого курса; отсутствуют необходимые умения и навыки, допущены грубые ошибки.

**При обучении с применением дистанционных технологий студент должен успешно пройти итоговый тест (набрать 60 и более процентов правильных ответов на вопросы теста), правильно ответить на вопросы билета, решить задачу или деловую игру. Сдача зачета происходит в режиме online с использованием видеоконференции в Teams.**