

**ФЕДЕРАЛЬНОЕ ГОСУДАРСТВЕННОЕ БЮДЖЕТНОЕ ОБРАЗОВАТЕЛЬНОЕ  
УЧРЕЖДЕНИЕ ВЫСШЕГО ОБРАЗОВАНИЯ  
СТАВРОПОЛЬСКИЙ ГОСУДАРСТВЕННЫЙ АГРАРНЫЙ УНИВЕРСИТЕТ**

**УТВЕРЖДАЮ**

Директор/Декан  
института экономики, финансов и  
управления в АПК  
Гунько Юлия Александровна

\_\_\_\_\_  
\_\_\_\_\_  
« \_\_\_\_ » \_\_\_\_\_ 20\_\_ г.

**ФОНД ОЦЕНОЧНЫХ СРЕДСТВ (ОЦЕНОЧНЫХ МАТЕРИАЛОВ)**

**ФТД.04 Оценка рисков в проектном менеджменте**

38.04.01 Экономика

Экономическая безопасность и финансовая разведка

магистр

заочная

# 1. Перечень планируемых результатов обучения по дисциплине, соотнесенных с планируемыми результатами освоения образовательной программы

Процесс изучения дисциплины направлен на формирование следующих компетенций ОП ВО и овладение следующими результатами обучения по дисциплине:

Код и наименование компетенции	Код и наименование индикатора достижения	Перечень планируемых результатов обучения по дисциплине
ПК-3 Способен определять направление развития организации	ПК-3.1 Владеет методами анализа информации, проводит анализ деятельности организации и оценивает ее текущее состояние	<b>знает</b> Методы сбора и обработки информации для анализа деятельности организаций
		<b>умеет</b> Составлять объективную оценку текущего состояния организации на основании собранных данных
		<b>владеет навыками</b> Инструментами и технологиями автоматизированного анализа больших массивов данных
УК-1 Способен осуществлять критический анализ проблемных ситуаций на основе системного подхода, вырабатывать стратегию действий	УК-1.1 Анализирует проблемную ситуацию как систему, выявляя ее составляющие и связи между ними	<b>знает</b> Теоретические основы системного подхода и методологию анализа сложных ситуаций.
		<b>умеет</b> Формулировать проблему как целостную систему, выделяя её компоненты и подсистемы.
		<b>владеет навыками</b> Навыками построения графических моделей (карты проблем, диаграммы Исикава, сетевые модели).
УК-1 Способен осуществлять критический анализ проблемных ситуаций на основе системного подхода, вырабатывать стратегию действий	УК-1.2 Осуществляет поиск вариантов решения поставленной проблемной ситуации на основе доступных источников информации. Разрабатывает стратегию действий и предлагает направления ее реализации	<b>знает</b> Принципы эффективного поиска и отбора информации из различных источников (базы данных, интернет-ресурсы, внутренние корпоративные документы)
		<b>умеет</b> Проводить глубокий анализ доступной информации для выявления лучших подходов к решению конкретной проблемы
		<b>владеет навыками</b> Методами формирования и представления результатов исследовательского поиска

## 2. Перечень оценочных средств по дисциплине

№	Наименование раздела/темы	Курс	Код индикаторов достижения компетенций	Оценочное средство проверки результатов достижения индикаторов компетенций
1.	1 раздел. Оценка бизнеса в условиях риска			
1.1.	Сущность и классификация финансовых рисков при угрозе экономической безопасности	1	УК-1.1, УК-1.2, ПК-3.1	Устный опрос, Тест
1.2.	Понятие экономического риска предприятия и сущность проектного менеджмента	1	УК-1.1, УК-1.2, ПК-3.1	Устный опрос, Тест
1.3.	Терминология и базовые показатели проектного менеджмента	1	УК-1.1, УК-1.2, ПК-3.1	Устный опрос, Тест
1.4.	Контрольная точка № 1	1	УК-1.1, УК-1.2, ПК-3.1	Контрольная работа
1.5.	Эффект финансового и операционного рычага и оценка совокупного риска	1	УК-1.1, УК-1.2, ПК-3.1	Устный опрос, Тест
1.6.	Денежные потоки предприятия	1	УК-1.1, УК-1.2, ПК-3.1	Устный опрос, Тест
1.7.	Комплексное оперативное управление оборотными активами и краткосрочными обязательствами предприятия	1	УК-1.1, УК-1.2, ПК-3.1	Устный опрос, Тест
1.8.	Контрольная точка № 2	1	УК-1.1, УК-1.2, ПК-3.1	Контрольная работа
1.9.	Управление структурой капитала, стоимость капитала	1	УК-1.1, УК-1.2, ПК-3.1	Устный опрос, Тест
1.10.	Дивидендная политика на предприятиях	1	УК-1.1, УК-1.2, ПК-3.1	Устный опрос, Тест
1.11.	Финансовое планирование и прогнозирование в условиях экономической безопасности	1	УК-1.1, УК-1.2, ПК-3.1	Устный опрос, Тест
1.12.	Контрольная точка №3	1	УК-1.1, УК-1.2, ПК-3.1	Контрольная работа
1.13.	Промежуточная аттестация	1	УК-1.1, УК-1.2, ПК-3.1	Практико-ориентированные задачи и ситуационные задачи, Разноуровневые задачи и задания
	Промежуточная аттестация			За

## 3. Оценочные средства (оценочные материалы)

Примерный перечень оценочных средств для текущего контроля успеваемости и промежуточной аттестации

№ п/п	Наименование оценочного средства	Краткая характеристика оценочного средства	Представление оценочного средства в фонде (Оценочные материалы)
Текущий контроль			
Для оценки знаний			
1	Устный опрос	Средство контроля знаний студентов, способствующее установлению непосредственного контакта между преподавателем и студентом, в процессе которого преподаватель получает широкие возможности для изучения индивидуальных особенностей усвоения студентами учебного материала.	Перечень вопросов для устного опроса
Для оценки умений			
2	Контрольная работа	Средство проверки умений применять полученные знания для решения задач определенного типа по теме или разделу	Комплект контрольных заданий по вариантам
3	Практико-ориентированные задачи и ситуационные задачи	Задачи направленные на использование приобретенных знаний и умений в практической деятельности и повседневной жизни	Комплект практико-ориентированных и ситуационных задач
Для оценки навыков			
Промежуточная аттестация			
4	Зачет	Средство контроля усвоения учебного материала практических и семинарских занятий, успешного прохождения практик и выполнения в процессе этих практик всех учебных поручений в соответствии с утвержденной программой с выставлением оценки в виде «зачтено», «незачтено».	Перечень вопросов к зачету

**4. Примерный фонд оценочных средств для проведения текущего контроля и промежуточной аттестации обучающихся по дисциплине (модулю) "Оценка рисков в проектном менеджменте"**

*Примерные оценочные материалы для текущего контроля успеваемости*

Тема 1. Риск как экономическая категория, его сущность.

1. Понятие риска.
2. Причины возникновения экономического риска.
3. Классификация рисков.
4. Управление риском.

Тема 2. Методы оценки экономических рисков.

1. Методы теории математических игр.
2. Методы теории вероятностей.
3. Методы математической статистики.
4. Методы теории статистических решений.
5. Методы математического программирования.

Тема 3. Количественные оценки экономического риска в условиях неопределенности.

1. Принятие оптимальных решений в условиях неопределенности.
2. Матричные игры.
3. Понятие игры с природой.
4. Критерии оптимальности в условиях полной неопределенности.
5. Матрицы последствий и матрицы рисков.
6. Анализ связанной группы решений в условиях полной неопределенности.
7. Анализ связанной группы решений в условиях частичной неопределенности.
8. Оптимальность по Парето двухкритериальных финансовых операций в условиях

неопределенности

Тема 4. Статистические методы принятия решений в условиях риска.

1. Измерители и показатели финансовых рисков.
2. Комбинации ожидаемого значения и дисперсии как критерий риска.
3. Учет влияния асимметрии распределения вероятностей на риски.

Тема 5. Инвестиционные риски.

1. Методы вычисления VAR: аналитический (метод вариации-ковариации), историческое моделирование и статистическое моделирование (метод Монте-Карло).
2. Алгоритмы расчета интегрального инвестиционного риска.
3. Формирование оптимального инвестиционного портфеля.

Тема 6. Оценка риска на основе анализа безубыточности предприятия.

1. Анализ безубыточности.
2. Количественная оценка риска банкротства предприятия.

Тема 7. Кредитные риски.

1. Факторы, способствующие возникновению кредитных рисков.
2. Анализ кредитных рисков.
3. Приемы уменьшения кредитных рисков.
4. Эффективная процентная ставка.
5. Нарращение и выплата процентов в потребительском кредите.
6. Кредитные гарантии.

***Примерные оценочные материалы  
для проведения промежуточной аттестации (зачет, экзамен)  
по итогам освоения дисциплины (модуля)***

Вопросы к зачету

1. Дайте определение проекта.
2. В чем заключается отличие проектной деятельности от текущей оперативной работы?
3. Что такое «тройное ограничение проекта»?
4. Дайте определение риска проекта.
5. Укажите основные параметры рисков проекта.
6. Как влияет процесс определения требований проекта на риски проекта?
7. В чем заключается суть управления содержанием проекта?
8. Как влияет процесс управления содержанием проекта на риски проекта?
9. Как влияют процессы управления сроками проекта на риски проекта?
10. Как влияют процессы управления стоимостью проекта на риски проекта?

11. Дайте характеристику метода освоенного объема.
12. За счет чего использование метода освоенного объема позволяет снизить риски проекта?
13. Охарактеризуйте основные проблемы формирования бюджета проекта.
14. Опишите процессы управления качеством проекта в контексте риск-менеджмента.
15. Как идентификация участников проекта влияет на риски проекта?
16. Как коммуникации проекта влияют на риск проекта?
17. В чем суть процессов управления поставками проекта? Как они влияют на риски проекта?
18. Дайте характеристику процессов управления рисками проекта.
19. Охарактеризуйте процесс идентификации рисков проекта.
20. Опишите основные особенности качественного анализа рисков проекта.
21. В чем суть качественного анализа рисков проекта?
22. Опишите процесс планирования реагирования на риски.
23. Неопределенность как важнейшая характеристика проекта.
24. Существующие подходы к понятию «риск».
25. Основные признаки риска.
26. Классификации рисков.
27. Характеристика подходов к понятию «возможность».
28. Взаимосвязь рисков и возможностей.
29. Количественная оценка рисков с помощью показателей вариации (коэффициент корреляции).
30. Анализ чувствительности в риск-менеджменте.
31. Оценка рисков методом сценариев.
32. Оценка рисков методом имитационного моделирования Монте-Карло

1. К содержанию группы методов снижения риска не относятся:
  - а) управление активами и пассивами;
  - б) самострахование;
  - в) хеджирование;
  - г) методы предотвращения;
  - д) диверсификация;
  - е) активный риск-менеджмент.
2. К группе методов переноса риска относятся:
  - а) страхование;
  - б) диверсификация;
  - в) активный риск-менеджмент;
  - г) лимитирование;
  - д) локализация;
  - е) гарантия.
3. Метод переноса риска можно по-другому назвать:
  - а) метод отказа от риска;
  - б) метод снижения риска;
  - в) метод предупреждения риска;
  - г) метод передачи риска;
  - д) метод страхования риска;
  - е) метод резервирования риска.
4. Самым надежным методом управления рисками как с точки зрения субъекта экономики, так и с точки зрения всей экономики в целом, является:
  - а) метод снижения риска;
  - б) метод принятия риска;
  - в) метод резервирования риска;
  - г) метод внутреннего страхования риска;
  - д) метод переноса риска;
  - е) метод трансферта риска.
5. К основным направлениям метода переноса риска можно отнести:

- а) заключение договора поручительства;
- б) передача рисков поставщикам сырья;
- в) диверсификация риска;
- г) локализация последствий риска;
- д) хеджирование;
- е) диссипация рисков.

6. Метод, который осуществляется путем переноса хозяйственной деятельности, связанной с повышенным инвестиционным риском, в пределы небольшого дочернего субъекта экономики – это:

- а) диверсификация риска;
- б) распределение риска;
- в) локализация риска;
- г) резервирование риска;
- д) внутреннее страхование риска;
- е) лимитирование риска.

7. Диверсификация риска предполагает:

- а) перераспределение риска во времени;
- б) перераспределение риска в пространстве;
- в) снижение степени риска и потерь;
- г) перенос рисковой деятельности в пределы небольшого дочернего предприятия;
- д) нейтрализацию риска;
- е) передачу риска партнерам по отдельным хозяйственным операциям путем заключения

кон-трактов.

8. Метод диверсификации риска можно по-другому назвать как:

- а) распределение риска;
- б) локализация риска;
- в) перенос риска;
- г) трансферт риска;
- д) снижение степени риска;
- е) диссипация риска.

9. Диверсификация рисков в пространстве достигается следующими путями:

- а) перераспределением риска между участниками хозяйственного процесса;
- б) диверсификацией деятельности;
- в) снижением степени риска;
- г) трансфертом риска;
- д) дробление рынка сбыта;
- е) дробление рынка поставщиков.

10. Метод управления активами и пассивами состоит в том, что:

- а) он имеет целью тщательно сбалансировать наличные средства;
- б) его цель – свести к минимуму изменения в получаемом доходе и прибыли;
- в) он направлен на избежание чрезмерного риска путем динамического регулирования основ-ных параметров вложения капитала;
- г) он предполагает ценовое регулирование посредством выработки ценовой стратегии пред-приятия;
- д) он предполагает лимитирование риска;
- е) он предполагает нейтрализацию риска через передачу части риска партнерам.

**Темы письменных работ (эссе, рефераты, курсовые работы и др.)**

## Темы рефератов

1. Эволюция управления рисками: концепции, подходы и их условия.
2. Классификация рисков: виды, принципы, использование.
3. Прогнозирование, планирование и теория риска.
4. Принятие предпринимательских решений в условиях риска.
5. Факторы неопределенности в условиях рыночной экономики.
6. Виды рисков и способы их оценки.
7. Методы оценки эффективности управления рисками.
8. Методы оценки рисков предприятий.
9. Использование количественных методов анализа и оценки рисков.
10. Использование качественных методов анализа и оценки рисков.
11. Прогнозирование потерь от реализации рисков: принципы, подходы, методы.
12. Методы измерения рисков.
13. Модели оценки предпринимательских рисков.
14. Методы оценки рыночных и операционных рисков.
15. Использование специфических методов определения степени и меры риска.
16. Экспертные методы оценки рисков.
17. Организация и использование экспертных методов оценки риска.
18. Методы индивидуальной и групповой экспертных оценок: сходства и различия.
19. Подбор экспертов и формирование экспертных групп.
20. Принципы составления анкет для экспертного опроса.
21. Этапы процесса управления риском.
22. Учет рисков в бизнес-планировании.
23. Инновационные технологии в управлении рисками.
24. Роль субъективных факторов в управлении рисками.
25. Правовое обеспечение деятельности по управлению рисками в РФ.
26. Управление рисками в малом предпринимательстве.
27. Организация управления рисками на промышленном предприятии.
28. Организация управления рисками в финансово-кредитном учреждении.
29. Особенности управления рисками финансово-промышленной группы.
30. Особенности управления рисками транснациональной корпорации.