

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

УТВЕРЖДАЮ

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

«__» _____ 20__ г.

ФОНД ОЦЕНОЧНЫХ СРЕДСТВ (ОЦЕНОЧНЫХ МАТЕРИАЛОВ)

Б1.В.16 Стратегическое управление рисками

38.05.01 Экономическая безопасность

Экономико-правовое обеспечение безопасности государства и бизнеса

экономист

очная

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 раскрыть информацию о рисках организации в отчетах для внешних сторон, связанных с требованиями регуляторов и достижением стратегических целей или принимаемыми стратегическими решениями	ПК-3.1 Осуществляет раскрытие информации о рисках организации в отчетах для внешних сторон	знает Перечень заинтересованных сторон (08.018 F/02.7 Зн.2) Законодательство Российской Федерации по виду деятельности организации и требования (рекомендации) в области управления рисками (08.018 F/02.7 Зн.3) Защита персональных данных (08.018 F/02.7 Зн.9)
		умеет Определять заинтересованные стороны в реализации риск-ориентированного управления в организации на уровне акционеров, совета директоров, партнеров, руководства организации (08.018 F/02.7 У.1) Применять подходы безопасной работы в информационно-телекоммуникационной сети «Интернет» (защита персональных данных, антивирусная защита, информационная гигиена)(08.018 F/02.7 У.5)
		владеет навыками Определение заинтересованных сторон на уровне акционеров, совета директоров, партнеров, руководства организации для раскрытия информации о рисках (08.018 F/02.7 ТД.1)
ПК-3 Способен раскрыть информацию о рисках организации в отчетах для внешних сторон, связанных с требованиями регуляторов и достижением стратегических целей или принимаемыми стратегическими решениями	ПК-3.2 Определяет предельно допустимые уровни риска, соответствующие требованиям регуляторов и достижению стратегических целей	знает Международные и российские стандарты по риск-менеджменту и риск-ориентированному управлению организацией (08.018 F/02.7 Зн.1) Организация внешней и внутренней отчетности организации, бизнес-подразделений (08.018 F/02.7 Зн.4) Состав, форма и порядок формирования отчетности с учетом рисков (08.018 F/02.7 Зн.5)
		умеет Организовывать работы по раскрытию информации о рисках в отчетах для внешних сторон, связанных с требованиями регуляторов и достижением стратегических целей или с принимаемыми стратегическими решениями (08.018 F/02.7 У.2)
		владеет навыками Организация работы по раскрытию информации о рисках в отчетах для внешних сторон, связанных с требованиями регуляторов и достижением стратегических целей или с принимаемыми стратегическими решениями (08.018 F/02.7 ТД.2)
ПК-3 Способен раскрыть информацию о рисках организации в отчетах для внешних сторон,	ПК-3.3 Защищает интересы собственников	знает Международные и российские стандарты по риск-менеджменту и риск-ориентированному управлению организацией (08.018 F/02.7 Зн.1)

связанных с требованиями регуляторов достижением стратегических целей или принимаемыми стратегическими решениями	, прочих стейкхолдеров по ключевым вопросам управления рисками, связанных с достижением стратегических целей или принимаемым и стратегическими решениями	умеет Выстраивать коммуникации с заинтересованными сторонами (08.018 F/02.7 У.3) владеет навыками Организация работы по раскрытию информации о рисках в отчетах для внешних сторон, связанных с требованиями регуляторов и достижением стратегических целей или с принимаемыми стратегическими решениями (08.018 F/02.7 ТД.2) Создание каналов коммуникации для передачи и эскалации информации в области управления рисками с акционерами, советом директоров, партнерами, руководством организации (08.018 F/02.7 ТД.3)
ПК-4 Способен планировать, внедрять и реализовывать риск-ориентированный подход к управлению организацией, целеполагание и программы мотивации с учетом рисков, постановку целей для внедрения риск-менеджмента	ПК-4.1 Способен планировать риск-ориентированный подход к управлению организацией, целеполагание и программы мотивации с учетом рисков, постановку целей для внедрения риск-менеджмента	знает Корпоративные финансы, теория вероятности и математическая статистика, корпоративное управление, поведенческая экономика, нейроэкономика и теория принятия решений (08.018 F/01.7 Зн.4) Организация управленческой отчетности организации, отдельных бизнес-процессов, проектов, решений (08.018 F/01.7 Зн.5) Цели организации, цели и задачи бизнес-процессов, цели ключевых управленческих решений (08.018 F/01.7 Зн.6) умеет Формировать концепции реализации риск-ориентированного подхода в организации (08.018 F/01.7 У.3) владеет навыками Формирование и согласование концепции развития риск-ориентированного подхода к управлению организацией, ключевых целей, задач и шагов внедрения риск-ориентированного управления, включая встраивание рисков в существующие инструменты планирования: финансовые модели, планы-графики реализации проектов, инструменты, связанные с бизнес-процессами или принимаемыми решениями, инструменты формирования и мониторинга реализации мотивационной программы (08.018 F/01.7 ТД.3)
ПК-4 Способен планировать, внедрять и реализовывать риск-ориентированный подход к управлению организацией, целеполагание и программы мотивации с учетом рисков, постановку целей для внедрения риск-менеджмента	ПК-4.2 Способен внедрять риск-ориентированный подход к управлению организацией, целеполагание и программы мотивации с учетом	знает Подходы к управлению, методы и инструменты управления рисками, в том числе оценки рисков, включая идентификацию и анализ влияния рисков на цели организации и ключевые показатели деятельности, приоритизации рисков, определения критериев существенности (08.018 F/01.7 Зн.9) Состав, форма и порядок формирования отчетности с учетом рисков (08.018 F/01.7 Зн.10) Методы формирования дорожной карты внедрения риск-ориентированного подхода к управлению организацией (08.018 F/01.7 Зн.13)

	рисков, постановку целей для внедрения риск-менеджмента		умеет Формировать и представлять отчеты о внедрении риск-ориентированного подхода к управлению организацией заинтересованным сторонам (08.018 F/01.7 У.4) Изучать лучшую практику внедрения риск-ориентированного управления на предмет применения в организации (08.018 F/01.7 У.9)
			владеет навыками Согласование внутренних методологических и организационно-распорядительных документов по управлению рисками (политика, принципы, цели, задачи) (08.018 F/01.7 ТД.4)
ПК-4 Способен планировать, внедрять и реализовывать риск-ориентированный подход к управлению организацией, целеполагание и программы мотивации с учетом рисков, постановку целей для внедрения риск-менеджмента	ПК-4.3 Способен реализовывать риск-ориентированный подход к управлению организацией, целеполагание и программы мотивации с учетом рисков, постановку целей для внедрения риск-менеджмента		знает Подходы к реализации и методы реализации риск-ориентированного управления организацией (08.018 F/01.7 Зн.12) Принципы соблюдения информационной безопасности, сохранения конфиденциальности данных (08.018 F/01.7 Зн.21)
			умеет Вносить предложения по изменению и совершенствованию стратегии управления рисками Формировать и анализировать показатели эффективности управления рисками
			владеет навыками Предоставление и согласование с заинтересованными сторонами дорожной карты внедрения риск-ориентированного подхода к управлению организацией с определением необходимых ресурсов, ролей и ответственности, а также отчетов о ее реализации (08.018 F/01.7 ТД.5) Выбор программного обеспечения для реализации риск-ориентированного управления организацией и координация работы по внедрению (08.018 F/01.7 ТД.6)

2. Перечень оценочных средств по дисциплине

№	Наименование раздела/темы	Семестр	Код индикаторов достижения компетенций	Оценочное средство проверки результатов достижения индикаторов компетенций
1.	1 раздел. Стратегическое управление рисками			
1.1.	Прединвестиционное проектирование	8	ПК-4.1, ПК-4.2, ПК-4.3, ПК-3.1, ПК-3.2, ПК-3.3	Собеседование

1.2.	Проектное финансирование	8	ПК-4.1, ПК-4.2, ПК-4.3, ПК-3.1, ПК-3.2, ПК-3.3	Тест
1.3.	Контрольная точка №1	8	ПК-4.1, ПК-4.2, ПК-4.3, ПК-3.1, ПК-3.2, ПК-3.3	Контрольная работа
1.4.	Управление материальными ресурсами проекта	8	ПК-4.1, ПК-4.2, ПК-4.3, ПК-3.1, ПК-3.2, ПК-3.3	Устный опрос
1.5.	Управление рисками проекта	8	ПК-4.1, ПК-4.2, ПК-4.3, ПК-3.1, ПК-3.2, ПК-3.3	Тест
1.6.	Контрольная точка №2	8	ПК-4.1, ПК-4.2, ПК-4.3, ПК-3.1, ПК-3.2, ПК-3.3	Контрольная работа
1.7.	Управление стоимостью проекта	8	ПК-4.1, ПК-4.2, ПК-4.3, ПК-3.1, ПК-3.2, ПК-3.3	Собеседование
1.8.	Оценка эффективности инвестиционных проектов	8	ПК-4.1, ПК-4.2, ПК-4.3, ПК-3.1, ПК-3.2, ПК-3.3	Тест
1.9.	Контрольная точка №3	8	ПК-4.1, ПК-4.2, ПК-4.3, ПК-3.1, ПК-3.2, ПК-3.3	Контрольная работа
1.10.	Промежуточная аттестация	8	ПК-4.1, ПК-4.2, ПК-4.3, ПК-3.1, ПК-3.2, ПК-3.3	Практико-ориентированные задачи и ситуационные задачи
	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	Собеседование	Средство контроля, организованное как специальная беседа преподавателя с обучающимся на темы, связанные с изучаемой дисциплиной, и рассчитанное на выяснение объема знаний обучающегося по определенному разделу, теме, проблеме и т.п.	Вопросы по темам/разделам дисциплины

2	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
3	Тест	Система стандартизированных заданий, позволяющая автоматизировать процедуру измерения уровня знаний и умений обучающегося.	Фонд тестовых заданий
Для оценки умений			
4	Контрольная работа	Средство проверки умений применять полученные знания для решения задач определенного типа по теме или разделу	Комплект контрольных заданий по вариантам
5	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			
6	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) "Стратегическое управление рисками"

Примерные оценочные материалы для текущего контроля успеваемости

Комплект вопросов для собеседования

Тема 1. Прединвестиционное проектирование

1. Содержательная характеристика прединвестиционной подготовки проекта
2. Состав работ в разрезе основных этапов прединвестиционной подготовки проекта
3. Основы технико-экономического обоснования проектов
4. Назначение и состав разделов бизнес-плана проекта

Тема 2. Проектное финансирование

1. Понятие, сущность и роль проектного финансирования
2. Участники проектного финансирования и их функции
3. Развитие проектного финансирования и его особенности
4. Законодательная база проектного финансирования

Тема 3. Управление материальными ресурсами проекта

1. Процессы управления материальными ресурсами проекта
2. Управление закупками ресурсов
3. Управление снабжением ресурсами

Тема 4. Управление рисками проекта

1. Сущность неопределенности и риска в управлении проектами
2. Классификация рисков
3. Виды и методы анализа рисков
4. Методы снижения риска проекта

Тема 5. Управление стоимостью проекта

1. Процесс управления стоимостью проекта
2. Методы планирования стоимости проекта

Тема 6. Оценка эффективности инвестиционных проектов

1. Основные принципы и общая схема оценки эффективности инвестиционного проекта
2. Определение показателей эффективности инвестиционного проекта

Типовая кейс-задача

Этапы работы с кейсом.

1. Этап введения в изучаемую проблему

Пусть задано 3 инвестиционных проекта, данные по которым приведены в таблице.

Определить наименее рискованный проект.

Проект Прибыль,

ден. ед. Число случаев, n

Общее число случаев, N Доля вероятности, p_i

А 15

30

35

-20

-40 7

11

6

4

2 30

30

30

30

30

Б 65

45

20

-15

-25 0,2

0,4

0,1

0,2

0,1

В	50
30	
15	
-10	
-20	10
15	
20	
10	
5	60
60	
60	
60	
60	

2. Анализ ситуации.

Подгруппы обучающихся (по 3-5 человек) проводят анализ представленной информации, совершает предварительные расчеты показателей на основании наиболее подходящих, по их мнению, методик оценки и качественной интерпретации показателей.

3. Этап презентации.

Каждая подгруппа представляет альтернативные результаты исследования к обсуждению.

4. Этап общей дискуссии.

Представленные альтернативные варианты решения обсуждаются в ходе общей дискуссии. Оцениваются преимущества и недостатки.

5. Этап подведения итогов.

На основании приведенных решений делается качественная характеристика полученных результатов.

Типовые контрольные точки

Контрольная точка № 1 в 2 вариантах

Тестовые задания (оценка знаний: 3 балла)

1. Прединвестиционная подготовка проекта включает следующие виды работ:

- а) разработку концепции проекта;
- б) разработку технико-экономического обоснования (ТЭО) инвестиций;
- в) необходимые мероприятия по разработке проекта;
- г) разработку бизнес-плана.

2. Инвестиционный проект – это:

- а) система организационно-правовых и финансовых документов;
- б) комплекс мероприятий, обеспечивающий достижение поставленных целей;
- в) документ, снижающий риск инвестиционной деятельности.

3. Основная цель инвестиционного проекта – это:

- а) максимизация объема выпускаемой продукции;
- б) минимизация затрат на потребление ресурсов;
- в) техническая эффективность проекта, обеспечивающая выход на рынок с качественной (конкурентоспособной) продукцией;
- г) максимизация прибыли.

4. В прединвестиционной фазе происходит:

- а) ввод в действие основного оборудования;
- б) создание постоянных активов предприятия;
- в) выбор поставщиков сырья и оборудования;
- г) закупка оборудования;
- д) разработка бизнес-плана инвестиционного проекта.

5. Кого затрагивает в меньшей степени бизнес-план инвестиционного проекта?

- а) инвесторов;
- б) предпринимателей;
- в) персонал предприятий.

6. Какое из определений проектного финансирования не является верным:

- а) проектное финансирование - это финансирование, при котором инвестиционный проект представляет собой самокупаемую хозяйственную единицу;
- б) проектное финансирование – это целый комплекс способов для предоставления различных финансовых средств;
- в) проектное финансирование – это финансирование проектов;
- г) проектное финансирование – это особый способ обеспечения инвестиционного проекта реальными деньгами.

7. Какие из перечисленных принципов относятся к принципам проектного финансирования:

- а) принцип доходности;
- б) принцип целевого использования;
- в) принцип дифференцированности;
- г) принцип качества обеспечения по кредиту.

8. Согласно, какому принципу заёмщик обязан заплатить кредитору за пользование денежными средствами фиксированную сумму, которую определяют исходя из процентной ставки по ссуде:

- а) принцип приоритета денежного потока над активами;
- б) принцип доходности;
- в) принцип целевого использования;
- г) принцип обособленности проекта.

9. Кто из перечисленных субъектов может выступать в качестве участника проектного финансирования:

- а) управляющие проектом;
- б) государство;
- в) поставщики, подрядчики;
- г) все перечисленные;
- д) никто из перечисленных.

10. Кем из возможных участников проекта выдаются необходимые разрешительные документы на осуществление закупок:

- а) управляющим проекта;
- б) поставщиками и подрядчиками;
- в) спонсорами проекта;
- г) правительством страны.

Практико-ориентированные задачи:

Имеются данные о величине валового регионального продукта в основных ценах (значение показателя за год), млрд рублей:

2010	2011	2012	2013	2014	2015	2016	средняя численность населения, млн. человек			
Центральный	федеральный	округ				13444,44	16062,12	17432,29		
19160,91	20866,36	22663,76				24135,02	38,43			
Северо-Западный	федеральный	округ			3943,05	4785,46	5247,51	5553,39	5945,31	7204,80
7803,75	13,62									
Северо-Кавказский	федеральный	округ			891,83	1066,32	1209,04	1397,67	1577,95	1709,05
1797,97	9,43									
Ставропольский край		330,79	396,79	431,75	480,91	540,80	621,20	651,93	2,79	
Сибирский	федеральный	округ	4131,40	4802,93	5186,81	5540,60	6134,02	6821,59	7133,87	19,26

Типовая практико-ориентированная задача репродуктивного уровня

(оценка умений – max 7 баллов):

Рассчитайте темпы роста ВРП, сравните регионы, сделайте выводы. Изобразите результаты графически (7 баллов).

Типовая практико-ориентированная задача реконструктивного уровня

(оценка навыков – max 10 баллов):

Найдите средние значения показателей, обосновав выбор методики расчета в каждом случае (10 баллов).

Контрольная точка № 2 в 2 вариантах

Тестовые задания (оценка знаний: 3 балла)

1. Установите соответствие между ключевыми понятиями и их определениями:

- 1) планирование закупок
- 2) осуществление закупок
- 3) закрытие закупок
- 4) управление поставками
- 5) управление запасами
- 6) управление распределением
- а) процесс завершения закупок по каждому проекту;
- б) процесс документирования решений в отношении закупок для проекта, формирования подхода и определения потенциальных продавцов;
- в) процесс получения ответов от продавцов, выбора подходящего продавца и заключения контракта;
- г) процесс прогнозирования потребности в ресурсах при составлении первоначального варианта расписания проекта;
- д) процесс управления отношениями с поставщиками, контроля исполнения контрактов;
- е) процесс определения объем каждого ресурса, который необходимо иметь в виде определенного запаса.

2. Определите основные требования, предъявляемые к материально-техническому обеспечению проекта:

- а) обеспечение надежности;
- б) создание материальных условий для диверсификации номенклатуры;
- в) гарантия выпуска конкурентоспособных видов продукции;
- г) снижение материалоемкости производства;
- д) все ответы верны

3. Установите соответствие между факторами, оказывающими влияние на материальные ресурсы, и их характеристикой

- 1) социальные факторы а) социальная среда
- 2) инфраструктурные факторы б) культурная среда
- 3) экономические факторы в) отрасль промышленности
- 4) рыночные факторы г) система транспорта
- 5) технические факторы д) инженерные коммуникации
- е) производственная мощность
- ж) размер проекта
- з) квалификация персонала
- и) применяемые технологии
- к) производительность труда персонала
- л) предложение со стороны поставщиков
- м) оснащенность оборудованием
- н) требования потребителей проекта к качеству поставляемого

4. Соотнесите типы материальных ресурсов и их характеристики:

1. невозпроизводимые ресурсы;

2. воспроизводимые ресурсы;
3. преобразуемые ресурсы;
4. непреобразуемые ресурсы.
- а) не являются частью выходных ресурсов;
- б) в ходе работы сохраняют свою натурально–вещественную форму, не накапливаются;
- в) расходуются полностью, не допускается их повторное использование, могут накапливаться;
- г) входят в выходные продукты.

5. Входными элементами системы планирования закупок являются:

- А. базовый план по содержанию;
- Б. реестр рисков;
- В. расписание проекта;
- Г. план управления закупками;
- Д. закупочная документация;
- Е. критерии выбора поставщика.

6. Когда начали тщательно анализировать сущность и теоретические аспекты риска за рубежом?

- а) 1980-е годы;
- б) 1960-е годы;
- в) 1990-е годы;
- г) 1940-е годы.

7. Развитие математического аппарата анализа рисков стало основой для развития теории.....

- а) менеджмента;
- б) маркетинга;
- в) бизнес планирования;
- г) планирования эксперимента.

8. Процессы принятия решений в управлении проектами происходят всегда в условиях неопределенности, которые характеризуются следующими аспектами:

- а) невозможностью адекватного и точного учета имеющейся информации;
- б) отсутствием фактора случайности;
- в) присутствием фактора случайности;
- г) наличием вероятностных характеристик поведения среды;
- д) наличием оптимальных знаний всех имеющихся параметров рассматриваемых рисков;
- е) наличием факторов противодействия.

9. Выберите наиболее полное определение «риска»:

- а) риск – это вероятностные потери средств;
- б) риск – это определённого рода опасность;
- в) риск – это неопределённость;
- г) риск – это возможность потери, чаще всего выраженная в числовом эквиваленте.

10. Чем прежде всего характеризуется неопределённость?

- а) информацией;
- б) статистикой;
- в) последствиями.

Типовая практико-ориентированная задача репродуктивного уровня
(оценка умений – тах 7 баллов):

По данным учета затрат известно, что стоимость подачи одного заказа составляет 200 руб. Годовая потребность в комплектующем изделии - 1550 шт. Цена единицы комплектующего изделия приравнивается к 560 руб., а стоимость содержания комплектующего изделия на складе оценивается 20% его цены, число рабочих дней в году-226 дней, время поставки-10 дней, возможная задержка поставки - 2 дня.

Определите:

- а) параметры системы управления запасами с фиксированным размером заказа;
- б) параметры системы управления запасами с фиксированным интервалом времени между заказами;
- в) параметры системы управления запасами с установленной периодичностью пополнения запасов до постоянного уровня;
- г) параметры системы управления запасами «минимум-максимум».

Типовая практико-ориентированная задача реконструктивного уровня

(оценка навыков – max 10 баллов):

Проведите совещание экспертов, на котором постарайтесь определить вероятность реализации выявленных в первом задании рисков. Для этого используйте следующие оценки: а) событие не реализуется – 0%; б) событие скорее всего не наступит – 25%; в) о наступлении события нельзя сказать ничего определенного – 50%; г) событие возможно реализуется – 75%; д) событие скорее всего реализуется – 100%. Рассчитайте среднюю вероятность проявления каждого риска с учетом мнения экспертов.

Контрольная точка № 3 в 2 вариантах

Тестовые задания (оценка знаний: 3 балла)

1. Выберите факторы, от которых зависит управление стоимостью проекта:

- а) от стоимости и сроков;
- б) от предмета проекта;
- в) от самой стоимости проекта;
- г) от сторон соглашения.

2. Выберите процессы, которые являются частью управления стоимостью ☐ проекта:

- а) разработка бюджета;
- б) контроль затрат;
- в) планирование проекта;
- г) все выше перечисленные.

3. Выберите процессы, которые являются частью управления стоимостью ☐ проекта:

- а) оценка стоимости;
- б) разработка бюджета;
- в) контроль стоимости;
- г) все перечисленные.

4. Выберите факторы, определяющие стоимостную оценку плана:

- а) стоимость рабочей силы;
- б) стоимость ресурсов;
- в) срок выполнения плана;
- г) техническое обеспечение.

5. Выберите автора приведенной трактовки «бюджет проекта» - это план, выраженный в количественных показателях и отражающий затраты, необходимые для достижения поставленной цели:

- а) Балашов А.И.;
- б) Гущин А.Н.;
- в) Алешин В.М.;
- г) Хэлдман К.

6. ВНД является таким положительным числом E' , что:

- а) ЧДД при норме дисконта $E=E'$ равен -1;
- б) ЧДД при норме дисконта $E=E'$ обращается в 0;
- в) ЧДД при норме дисконта $E=E'$ равен 1;
- г) все вышеперечисленное.

7. Величина, которая отражает такой минимальный объем внешнего финансирования проекта, без которого становится невозможным получение его финансовой реализуемости – это:

- а) срок окупаемости с учетом дисконтирования;
- б) простой срок окупаемости;
- в) индекс доходности;
- г) капитал риска.

8. Что из перечисленного является индексом доходности затрат?

- а) отношение суммы денежных притоков (накопленных поступлений) к сумме денежных оттоков (накопленным затратам);
- б) увеличенное на 1 единицу отношение ЧД к накопленному объему инвестиций;
- в) отношение суммы дисконтированных денежных притоков к сумме дисконтированных денежных оттоков;
- г) увеличенное на 1 единицу отношение ЧДД к накопленному дисконтированному объему инвестиций.

9. По какой из перечисленных формул можно вычислить индекс доходности?

- а) ;
- б) ;
- в) ;
- г) .

10. Какое равенство должно выполняться для расчета срока окупаемости?

- а)
- б)
- в)
- г) .

Типовая практико-ориентированная задача репродуктивного уровня
(оценка умений – тах 7 баллов):

Известны денежные потоки двух альтернативных инвестиционных проектов, тыс. руб.

Проект	Год			
	1	2	3	4
A	-240	60	100	120
B	-240	20	50	220

Определите, какой проект является предпочтительней при ставке доходности 6%.

Типовая практико-ориентированная задача реконструктивного уровня
(оценка навыков – тах 10 баллов):

Предприятие располагает \$160,000 и предполагает вложить их в собственное производство, получая в течение четырех последующих лет ежегодно \$50,000. В то же время предприятие может купить на эту сумму акции одной солидной корпорации, приносящие 12% годовых. Какой вариант Вам представляется более приемлемым, если считать, что более выгодной возможностью вложения денег (чем под 12% годовых) предприятие не располагает?

Тематика рефератов

1. Использование проектного финансирования при осуществлении больших инвестиционных проектов.
2. Основные принципы проектного финансирования.
3. Проектное финансирование: достоинства и недостатки.
4. Этапы формирования механизмов проектного финансирования.
5. Эволюция управления рисками: концепции, подходы и их условия.

6. Принятие предпринимательских решений в условиях риска.
7. Факторы неопределенности в условиях рыночной экономики.
8. Методы оценки эффективности управления рисками.
9. Прогнозирование потерь от реализации рисков: принципы, подходы, методы.
10. Учет рисков в бизнес-планировании.
11. Материальные ресурсы и их классификация.
12. Особенности управления рисками финансово-промышленной группы.
13. Особенности управления рисками транснациональной корпорации.
14. Методы экспертных оценок.
15. Методы количественной оценки.
16. Страхование рисков.
17. Резервирование средств: достоинства и недостатки.
18. Методы управления стоимостью проектов.
19. Составление бюджета проекта.
20. Контроль стоимости проекта.
21. Метод параметрической оценки.
22. Метод поэтапного оценивания.
23. Метод оценки по аналогии.
24. Метод оценки «снизу-вверх».
25. Метод анализа предложений исполнителей.
26. Смета проекта и включаемые в нее виды затрат.
27. Управление рисками в малом предпринимательстве.
28. Методы измерения рисков.
29. Этапы процесса управления риском.
30. Учет рисков в бизнес-планировании.

В процессе освоения дисциплины «Стратегическое управление рисками» студентами, обучающимися по заочной форме, в качестве самостоятельной подготовки, предусмотрено выполнение контрольной работы. Контрольная работа разработана в 100 вариантах. Вариант назначается студенту по предпоследней и последней цифре зачетной книжки.

Целью контрольной работы является оценка самостоятельного освоения материала студентами -заочниками. Контрольная работа включает: два теоретических вопроса и три практико-ориентированных задачи.

Типовая контрольная точка (аудиторная) для студентов заочной формы обучения (60 баллов max)

Теоретический вопрос (оценка знаний) (10 баллов):

Основные принципы проектного финансирования.

Практико-ориентированные задачи:

Типовое задание реконструктивного уровня (оценка умений, навыков) (20 баллов):

Необходимо оценить инвестиционный проект без учета и с учетом инфляции, имеющий стартовые инвестиции 14 000 рублей. Период реализации проекта 3 года. Денежный поток по годам: 7000, 6000, 5000. Требуемая ставка доходности без учета инфляции 12%. Среднегодовой индекс инфляции 6%.

Типовое задание творческого уровня (оценка навыков) (30 баллов):

Предприятие рассматривает два альтернативных проекта капитальных вложений, приводящих к одинаковому суммарному результату в отношении будущих денежных доходов:

Год	Проект 1	Проект 2
1	\$3,000	\$6,000
2	\$4,000	\$4,000
3	\$5,000	\$5,000
4	\$6,000	\$3,000
Всего	\$	\$

Оба проекта имеют одинаковый объем инвестиций. Предприятие планирует инвестировать полученные денежные доходы под 18% годовых. Сравните современные значения полученных денежных доходов.

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

Вопросы к зачету

Теоретические вопросы

1. Из каких этапов состоит подготовка обоснования проекта?
2. Что такое жизнеспособность проекта?
3. С помощью чего производится оценка жизнеспособности проекта?
4. Какова цель подготовки Обоснования инвестиций?
5. В какой момент инвестор принимает предварительное инвестиционное решение?
6. Какие специалисты принимают участие в разработке проекта?
7. В чем заключается предназначение ТЭО?
8. Перечислите основные принципы составления ТЭО.
9. Назовите основные технико-экономические показатели, рассчитываемые в ходе составления ТЭО.
10. В чем состоит назначение бизнес-плана проекта?
11. Каковы основные принципы составления бизнес-плана проекта?
12. Охарактеризуйте структуру бизнес-плана проекта.
13. Охарактеризуйте особенности ТЭО социального проекта.
14. Разработайте краткое обоснование социально значимой идеи.
15. Охарактеризуйте сущность проектного финансирования и его роль в управлении проектами.
16. Раскройте сущность принципов проектного финансирования.
17. Какие элементы включает в себя проектное финансирование?
18. Охарактеризуйте функции участников проектного финансирования.
19. Охарактеризуйте содержание этапов развития проектного финансирования.
20. Какими законами регламентируется проектное финансирование в РФ?
21. Чем характеризуется риски инвестиционного проекта?
22. Каковы способы минимизации рисков проектного финансирования?
23. Определите сложности в применении проектного финансирования и пути их преодоления.
24. Какие перспективы использования метода проектного финансирования вы видите?
25. Дайте определение процессу управления материальными ресурсами.
26. Прокомментируйте значение управления ресурсами как одной из функциональных областей управления проектом.
27. Перечислите требования, предъявляемые к системе обеспечения проекта материальными ресурсами.
28. Какие факторы оказывают влияние на процесс управления ресурсами? Охарактеризуйте их.
29. Классифицируйте материальные ресурсы
30. Что такое невозпроизводимые материальные ресурсы?
31. Охарактеризуйте сущность воспроизводимых материальных ресурсов.
32. В чем заключаются различия между преобразуемыми и непреобразуемыми ресурсами?
33. Опишите структурную модель управления материальными ресурсами проекта.
34. В чем состоит сущность управления закупками ресурсов?
35. Какие элементы включают в себя процессы управления закупками проекта?
36. Назовите основные задачи процесса планирования закупок.
37. Какие факторы оказывают влияние на стратегию планирования закупок?
38. Назовите исходные моменты системы планирования закупок.
39. Какие инструменты применяются при планировании закупок?
40. Что является результатом в системе планирования закупок?
41. Назовите исходные моменты системы осуществления закупок.

42. Какие инструменты применяются при осуществлении закупок?
43. Что является результатом в системе осуществления закупок?
44. Назовите исходные моменты системы закрытия закупок.
45. Какие инструменты применяются при закрытии закупок?
46. Что является результатом в системе закрытия закупок?
47. В чем состоит сущность управления снабжением ресурсами?
48. Какие элементы включают в себя процессы управления снабжением проекта?
49. Перечислите основные формы снабжения ресурсами.
50. Назовите процедуры, выполняемые в рамках управления поставками.
51. Перечислите типы контрактов между продавцами и покупателями ресурсов.
52. Что понимает под управлением запасами?
53. Каким учёным принадлежит наибольшее число исследований риска?
54. Охарактеризуйте сущность неопределённости и риска в управлении проектами.
55. Какими аспектами характеризуются процессы принятия решений в управлении проектами?
56. В чём различие между «неопределённостью» и «риском»?
57. Как можно классифицировать виды рисков?
58. Можете ли Вы охарактеризовать факторы маркетингового риска?
59. Можете ли Вы объяснить предпосылки возникновения внешних рисков?
60. Будет ли лучше, если предприниматель будет рассматривать и уделять внимание только допустимому риску, оставляя остальные виды без анализа?
61. В чём сильные и слабые стороны страхового риска?
62. Что свидетельствует о возникновении политического риска?
63. Как можно объединить денежные, кредитные и инвестиционные риски?
64. С чем связан инвестиционный вид риска?
65. Что будет результатом, если «точка безубыточности» будет больше единицы?
66. Из каких компонентов состоит последовательность сбора информации для построения дерева решений?
67. Какова главная идея анализа рисков по методу Монте-Карло?
68. Охарактеризуйте основные методы снижения риска проекта.
69. В каких случаях резервирование средств становится очевидным?
70. В чём сильные и слабые стороны резервирования средств?
71. Обоснуйте значение управления стоимостью проектов в современном мире.
72. Опишите процесс разработки концепции управления стоимостью проекта.
73. Какие этапы включает в себя процесс управления стоимостью проекта?
74. Что включает в себя оценка стоимости проекта?
75. Охарактеризуйте смету проекта, включаемые в нее виды затрат.
76. Что представляет собой бюджет проекта?
77. Охарактеризуйте обязательные элементы бюджетирования проекта.
78. Опишите известные вам формы представления бюджета.
79. Опишите содержание, функции и методы контроля стоимости проекта.
80. Какие этапы включает планирование стоимости проекта?
81. Охарактеризуйте метод параметрической оценки.
82. Охарактеризуйте метод поэтапного оценивания.
83. Охарактеризуйте метод оценки по аналогии.
84. Охарактеризуйте метод оценки «снизу-вверх».
85. Охарактеризуйте метод оценки «сверху-вниз».
86. Охарактеризуйте метод анализа предложений исполнителей.
87. Какие принципы оценки эффективности ИП Вам известны?
88. Какие основные исходные данные об ИП необходимы для оценки его эффективности?
89. Какие частичные потоки от отдельных видов деятельности составляют денежный поток $f(t)$ ИП?
90. Перечислите известные Вам показатели эффективности ИП.
91. Охарактеризуйте показатели ЧД и ЧДД. По каким формулам они рассчитываются?
92. Каков алгоритм нахождения ВНД?
93. Дайте определения понятиям «простой срок окупаемости» и «срок окупаемости с

учетом дисконтирования».

94. Перечислите и охарактеризуйте индексы доходности, рассчитываемые при оценке эффективности проекта.

95. Назовите особенности оценки коммерческой эффективности инвестиционного проекта.

96. Какие потоки рассматриваются при расчете бюджетной эффективности проекта?

97. Коков основной показатель бюджетной эффективности проекта?

98. Охарактеризуйте особенности расчета эффективности ИП структурами более высокого уровня.

99. Дайте определение понятиям «дисконтирование» и «норма дисконта».

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

Тематика рефератов

1. Использование проектного финансирования при осуществлении больших инвестиционных проектов.

2. Основные принципы проектного финансирования.

3. Проектное финансирование: достоинства и недостатки.

4. Этапы формирования механизмов проектного финансирования.

5. Эволюция управления рисками: концепции, подходы и их условия.

6. Принятие предпринимательских решений в условиях риска.

7. Факторы неопределенности в условиях рыночной экономики.

8. Методы оценки эффективности управления рисками.

9. Прогнозирование потерь от реализации рисков: принципы, подходы, методы.

10. Учет рисков в бизнес-планировании.

11. Материальные ресурсы и их классификация.

12. Особенности управления рисками финансово-промышленной группы.

13. Особенности управления рисками транснациональной корпорации.

14. Методы экспертных оценок.

15. Методы количественной оценки.

16. Страхование рисков.

17. Резервирование средств: достоинства и недостатки.

18. Методы управления стоимостью проектов.

19. Составление бюджета проекта.

20. Контроль стоимости проекта.

21. Метод параметрической оценки.

22. Метод поэтапного оценивания.

23. Метод оценки по аналогии.

24. Метод оценки «снизу-вверх».

25. Метод анализа предложений исполнителей.

26. Смета проекта и включаемые в нее виды затрат.

27. Управление рисками в малом предпринимательстве.

28. Методы измерения рисков.

29. Этапы процесса управления риском.

30. Учет рисков в бизнес-планировании.