

АВТОНОМНАЯ НЕКОММЕРЧЕСКАЯ ОБРАЗОВАТЕЛЬНАЯ
ОРГАНИЗАЦИЯ ВЫСШЕГО ОБРАЗОВАНИЯ
ЦЕНТРОСОЮЗА РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ
«РОССИЙСКИЙ УНИВЕРСИТЕТ КООПЕРАЦИИ»
КАЗАНСКИЙ КООПЕРАТИВНЫЙ ИНСТИТУТ (ФИЛИАЛ)

РАБОЧАЯ ПРОГРАММА ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛЯ)

УПРАВЛЕНИЕ ПРОЕКТНЫМИ РИСКАМИ

Направление подготовки: 38.03.02 Менеджмент

Направленность (профиль): «Управление проектами»

Форма обучения: очная, заочная

Квалификация (степень) выпускника: бакалавр

Срок обучения: очная форма – 4 года, заочная форма – 4 года 6 мес.

Вид учебной работы	Трудоемкость, часы (з.е.)	
	Очная форма	Заочная форма
1. Контактная работа обучающихся с преподавателем:	60 (1,67)	14 (0,39)
Аудиторные занятия, часов всего, в том числе:	60 (1,67)	12 (0,33)
• лекции	26 (0,72)	6 (0,167)
• практические	34 (0,94)	6 (0,167)
Промежуточная аттестация (контактная работа)	-	2 (0,06)
2. Самостоятельная работа студентов, всего	48 (1,33)	92 (2,56)
• др. формы самостоятельной работы	48 (1,33)	92 (2,56)
3. Промежуточная аттестация: зачет с оценкой	-	2 (0,06)
Итого	108 (3)	108 (3)

Сергиенко О.А. Управление проектными рисками: Рабочая программа дисциплины (модуля). – Казань: Казанский кооперативный институт (филиал) Российского университета кооперации, 2019. – 111 с.

Рабочая программа по дисциплине (модулю) «Управление проектными рисками» по направлению подготовки 38.03.02 Менеджмент составлена Сергиенко О.А., доцентом кафедры «Экономика и инноватика» Казанского кооперативного института (филиала) Российского университета кооперации в соответствии с требованиями Федерального государственного образовательного стандарта высшего образования по направлению подготовки «Менеджмент», утвержденного приказом Министерства образования и науки Российской Федерации от «12» января 2016 г. № 7, и учебными планами для направления подготовки 38.03.02 Менеджмент (год начала подготовки - 2019).

Рабочая программа:

обсуждена и рекомендована к утверждению решением кафедры экономики и инноватики Казанского кооперативного института (филиала) Российского университета кооперации 23.03.2019 г., протокол № 12.

одобрена Научно-методическим советом Казанского кооперативного института (филиала) от 03.04.2019, протокол № 5.

утверждена Ученым советом Российского университета кооперации от 18.04.2019, протокол № 4.

© АНОО ВО ЦС РФ
«Российский университет
кооперации» Казанский
кооперативный институт
(филиал), 2019
© Сергиенко О.А., 2019

СОДЕРЖАНИЕ

1. Цели и задачи освоения дисциплины (модуля)	5
2. Место дисциплины (модуля) в структуре образовательной программы	5
3. Перечень планируемых результатов обучения по дисциплине (модулю)	5
4. Объем дисциплины (модуля) и виды учебной работы	7
5. Содержание дисциплины (модуля)	7
5.1. Содержание разделов, тем дисциплины (модуля)	7
5.2. Междисциплинарные связи с обеспечиваемыми (последующими) дисциплинами (модулями)	9
5.3. Разделы, темы дисциплины (модуля) и виды занятий	9
6. Лабораторный практикум	10
7. Практические занятия (семинары)	10
8. Примерная тематика курсовых проектов (работ)	11
9. Самостоятельная работа студента	12
10. Перечень учебно-методического обеспечения для самостоятельной работы обучающихся по дисциплине (модулю)	49
11. Перечень основной и дополнительной учебной литературы, необходимой для освоения дисциплины (модуля)	50
12. Перечень ресурсов информационно-телекоммуникационной сети «Интернет», необходимых для освоения дисциплины (модуля)	51
13. Перечень информационных технологий, используемых при осуществлении образовательного процесса по дисциплине (модулю), включая перечень программного обеспечения и информационно-справочных систем (при необходимости)	52
14. Описание материально-технической базы, необходимой для осуществления образовательного процесса по дисциплине (модулю)	52
15. Методические указания для обучающихся по освоению дисциплины (модуля)	52
16. Методические рекомендации по организации изучения дисциплины для преподавателей, образовательные технологии	53
ФОНД ОЦЕНОЧНЫХ СРЕДСТВ ДЛЯ ПРОВЕДЕНИЯ ПРОМЕЖУТОЧНОЙ АТТЕСТАЦИИ ОБУЧАЮЩИХСЯ ПО ДИСЦИПЛИНЕ (МОДУЛЮ)	55
1. Паспорт фонда оценочных средств	56
1.1. Компетенции, формируемые в процессе изучения дисциплины	56
1.2. Сведения об иных дисциплинах (преподаваемых, в том числе, на других кафедрах) участвующих в формировании данных компетенций	56
1.3. Этапы формирования и программа оценивания контролируемой компетенции	56
1.4. Показатели и критерии оценивания компетенций, шкала оценивания	58
2. Типовые контрольные задания для оценки результатов обучения по дисциплине и иные материалы для подготовки к промежуточной аттестации	61
2.1. Материалы для подготовки к промежуточной аттестации	61
2.2. Комплект билетов для проведения промежуточной аттестации	67
Комплект тестовых заданий для проведения зачета с оценкой по дисциплине	69
2.3. Критерии оценки для проведения зачета с оценкой по дисциплине	73
2.4. Методические материалы, определяющие процедуру оценивания по дисциплине	73
ФОНД ОЦЕНОЧНЫХ СРЕДСТВ ДЛЯ ПРОВЕДЕНИЯ ТЕКУЩЕГО КОНТРОЛЯ И ТЕКУЩЕЙ АТТЕСТАЦИИ ПО ДИСЦИПЛИНЕ (МОДУЛЮ)	75
Деловые игры	76
Кейс - Эффективность инвестиционных проектов с учетом неопределенности и риска	80
Вопросы для коллоквиума, собеседования	84
Комплект заданий для контрольной работы	87
Перечень дискуссионных тем для круглого стола	94
Комплект разноуровневых задач (заданий)	97

Темы рефератов	104
Комплект заданий для проведения текущей аттестации	108

1. Цели и задачи освоения дисциплины (модуля)

Цель дисциплины «Управление проектными рисками» — сформировать у студентов компетенции:

– ПК-9 – способность оценивать воздействие макроэкономической среды на функционирование организаций и органов государственного и муниципального управления, выявлять и анализировать рыночные и специфические риски; а также анализировать поведение потребителей экономических благ и формирование спроса на основе знания экономических основ поведения организаций, структур рынков и конкурентной среды отрасли;

– ПК-15 – умение проводить анализ рыночных и специфических рисков для принятия управленческих решений, в том числе, при принятии решений об инвестировании и финансировании.

Задачи дисциплины:

– анализ и оценка степени неопределенности при проектировании, идентификации и классификации проектных, рыночных и специфических рисков;

– анализ инвестиционных и финансовых рисков в процессе проектирования деятельности коммерческого предприятия;

– подготовка студентов к работе в реальных условиях неопределенности при проектировании деятельности коммерческого предприятия.

2. Место дисциплины (модуля) в структуре образовательной программы

Дисциплина относится к вариативной части блока Б1.

Для изучения учебной дисциплины необходимо обладать знаниями, полученными основной образовательной программы среднего (полного) общего образования (Экономика).

3. Перечень планируемых результатов обучения по дисциплине (модулю)

Изучение дисциплины направлено на формирование у обучающихся следующих профессиональных компетенций:

ПК-9 - способностью оценивать воздействие макроэкономической среды на функционирование организаций и органов государственного и муниципального управления, выявлять и анализировать рыночные и специфические риски; а также анализировать поведение потребителей экономических благ и формирование спроса на основе знания экономических основ поведения организаций, структур рынков и конкурентной среды

отрасли;

ПК-15 - умением проводить анализ рыночных и специфических рисков для принятия управленческих решений, в том числе, при принятии решений об инвестировании и финансировании.

В результате изучения дисциплины обучающийся должен:

Формируемые компетенции (код компетенции)	Планируемые результаты обучения по дисциплине (модулю), характеризующие этапы формирования компетенций	Наименование оценочного средства
ПК-9 ПК-15	Знать: понятие проектных рисков и их классификацию; методы качественного и количественного анализа проектных рисков.	<i>Опросы, Тесты, Задачи, Рефераты</i>
	Знать: методы снижения проектных рисков; особенности управления проектными рисками на промышленных предприятиях.	<i>Тесты, Задачи, Собеседование</i>
	Уметь: различать понятия неопределенность и риск, классифицировать риски; проводить выявление, анализ и оценку рисков проекта	<i>Опросы, Тесты, Задачи, Кейс-задача.</i>
	Уметь: проводить планирование антирисковых мероприятий; осуществлять мониторинг и контроль рисков проекта	<i>Опросы, Тесты, Задачи</i>
	Владеть: понятийным аппаратом управления рисками; методами качественного и количественного анализа проектных рисков; процедурами реагирования на риски.	<i>Опросы, Тесты, Задачи, Коллоквиум</i>
	Знать: методы оценки финансово-экономической эффективности проектов с учетом неопределенности.	<i>Тесты, Задачи, Собеседование</i>
	Знать: методы планирования проекта, в том числе с учетом неопределенности.	<i>Опросы, Тесты, Задачи, Реферат</i>
	Уметь: выявлять, анализировать и оценивать проектные риски; проводить планирование антирисковых мероприятий.	<i>Задачи, Круглый стол, Деловая игра</i>
	Уметь: принимать решения в условиях неопределенности и риска, прогнозируя их последствия для проекта и организации.	<i>Тесты, Задачи, Кейс-задача</i>
	Владеть: навыками планирования антирисковых мероприятий при реализации инвестиционных проектов; процедурами реагирования на риски	<i>Задачи, Деловая игра</i>

4. Объем дисциплины (модуля) и виды учебной работы

очная форма обучения

Вид учебной деятельности	Часов	
	Всего	По семестрам
		3
1. Контактная работа обучающихся с преподавателем:	60	60
Аудиторные занятия всего, в том числе:	60	60
Лекции	26	26
Практические занятия	34	34
2. Самостоятельная работа студента всего, в том числе:	48	48
Другие виды самостоятельной работы:	48	48
Вид промежуточной аттестации – зачет с оценкой	-	-
ИТОГО:	часов	108
Общая трудоемкость	зач. ед.	3

заочная форма обучения

Вид учебной деятельности	Часов	
	Всего	По курсам
		2
1. Контактная работа обучающихся с преподавателем:	14	14
Аудиторные занятия всего, в том числе:	12	12
Лекции	6	6
Практические занятия	6	6
Промежуточная аттестация (контактная работа)	2	2
2. Самостоятельная работа студента всего, в том числе:	92	92
Другие виды самостоятельной работы:	92	92
Вид промежуточной аттестации – зачет с оценкой	2	2
ИТОГО:	часов	108
Общая трудоемкость	зач. ед.	3

5. Содержание дисциплины (модуля)

5.1. Содержание разделов, тем дисциплины (модуля)

Тема 1. Риск-менеджмент как управленческая технология

Сущность, цели, задачи управления рисками в различных сферах деятельности предприятия (организации). Проблемы внедрения управления рисками в практику.

Тема 2. Риск и неопределенность в проектировании

Сущность неопределенности и риска в проектировании. Взаимосвязь данных категорий. Характеристики и типы рисков с точки зрения неопределенности.

Тема 3. Классификация проектных рисков

Классификация основных факторов рисков. Классификация рисков по различным признакам. Классификация потерь от рисков.

Тема 4. Анализ и расстановка приоритетов рисков

Сущность и цели анализа рисков. Выявление причин рисков. Воздействие на риск. Этапы процесса управления риском.

Тема 5. Планирование управления рисками

Составление плана управления рисками. Последовательность шагов по принятию решений в области управления рисками. Обеспечение процедур управления рисками.

Тема 6. Система управления рисками

Влияние рисков на достижение стратегической цели предприятия. Основные этапы управления рисками. Взаимодействие участников управления рисками.

Тема 7. Идентификация рисков

Определение весомости рисков. Документирование характеристик рисков.

Тема 8. Качественный анализ рисков

Цели и задачи качественного анализа рисков. Алгоритм такого анализа. Методы качественного анализа рисков. Последовательность и результаты качественного анализа. Карта рисков.

Тема 9. Количественный анализ рисков

Подходы к учету факторов неопределенности и риска в расчетах эффективности проектов. Методы оценки эффективности инвестиционных проектов с учетом неопределенности и риска

Тема 10. Методы реагирования на риски

Основные группы методов реагирования на риски. Выбор метода реагирования на риски.

Тема 11. Мониторинг и контроль рисков

Цели мониторинга и контроля рисков. Этапы жизненного цикла проекта. Динамика задач управления рисками в зависимости от этапа жизненного цикла проекта.

Тема 12. Методы снижения проектных рисков

Группы методов снижения проектных рисков. Подходы и способы управленческого воздействия на риск.

Тема 13. Определение стратегии управления рисками

Виды стратегий управления рисками. Диаграмма выбора стратегий управления рисками. Внедрение стратегии управления рисками.

Тема 14. Особенности управления проектными рисками коммерческих предприятий

Специфика идентификации рисков, применения методов снижения рисков, формирования программы мероприятий по снижению проектных рисков.

5.2 Междисциплинарные связи с обеспечиваемыми (последующими) дисциплинами (модулями)

Дисциплина «Управление проектными рисками» формирует компетенции ПК-9, ПК-15, в дальнейшем необходимые для формирования компетенций ПК-10, ПК-11, ПК-15, ПК-16.

5.3. Разделы, темы дисциплины (модуля) и виды занятий

очная форма обучения

№ п/п	Наименование раздела, темы дисциплины (модуля)	Виды занятий, включая самостоятельную работу студентов (в часах)			
		Лекции	Практические занятия	Самостоятельная работа	Всего
1	Риск-менеджмент как управленческая технология	1	2	2	5
2	Риск и неопределенность в проектировании.	1	2	2	5
3	Классификация проектных рисков	2	2	2	6
4	Анализ и расстановка приоритетов рисков	2	2	2	6
5	Планирование управления рисками.	2	2	4	8
6	Система управления рисками	2	2	4	8
7	Идентификация рисков	2	2	4	8
8	Качественный анализ рисков	2	2	4	8
9	Количественный анализ рисков	2	2	4	8
10	Методы реагирования на риски.	2	2	4	8
11	Мониторинг и контроль рисков	2	2	4	8
12	Методы снижения проектных рисков.	2	4	4	10
13	Определение стратегии управления рисками	2	4	4	10
14	Особенности управления проектными рисками коммерческих предприятий	2	4	4	10
	Итого	26	34	48	108

заочная форма обучения

№ п/п	Наименование раздела, темы дисциплины (модуля)	Виды занятий, включая самостоятельную работу студентов (в часах)			
		Лекции	Практические занятия	Самостоятельная работа	Всего
1	Риск-менеджмент как управленческая технология			6	6
2	Риск и неопределенность в проектировании.	2		6	8
3	Классификация проектных рисков			6	6
4	Анализ и расстановка приоритетов рисков			6	6
5	Планирование управления рисками.		2	6	8
6	Система управления рисками			6	6
7	Идентификация рисков			6	6

№ п/п	Наименование раздела, темы дисциплины (модуля)	Виды занятий, включая самостоятельную работу студентов (в часах)			
		Лекции	Практические занятия	Самостоятельная работа	Всего
8	Качественный анализ рисков	2		6	8
9	Количественный анализ рисков			6	6
10	Методы реагирования на риски.			6	6
11	Мониторинг и контроль рисков		2	6	8
12	Методы снижения проектных рисков.	2		8	10
13	Определение стратегии управления рисками		2	8	10
14	Особенности управления проектными рисками коммерческих предприятий			10	10
	Итого	6	6	92	104

6. Лабораторный практикум

Лабораторные занятия не предусмотрены учебными планами.

7. Практические занятия (семинары)

Практические занятия проводятся с целью формирования компетенций обучающихся, закрепления полученных теоретических знаний на лекциях и в процессе самостоятельного изучения обучающимися специальной литературы.

очная форма обучения

№ п/п	Наименование раздела, темы учебной дисциплины (модуля)	Тематика практических занятий (семинаров)	Трудоемкость (час.)
1	Риск-менеджмент как управленческая технология	Сущность, цели, задачи управления рисками в различных сферах деятельности предприятия (организации). Проблемы внедрения управления рисками в практику.	2
2	Риск и неопределенность в проектировании	Сущность неопределенности и риска в проектировании. Взаимосвязь данных категорий. Характеристики и типы рисков с точки зрения неопределенности.	2
3	Классификация проектных рисков	Классификация основных факторов рисков. Классификация рисков по различным признакам. Классификация потерь от рисков.	2
4	Анализ и расстановка приоритетов рисков	Сущность и цели анализа рисков. Выявление причин рисков. Воздействие на риск. Этапы процесса управления риском	2
5	Планирование управления рисками	Составление плана управления рисками. Последовательность шагов по принятию решений в области управления рисками. Обеспечение процедур управления рисками.	2
6	Система управления рисками	Влияние рисков на достижение стратегической цели предприятия. Основные этапы управления рисками. Взаимодействие участников управления рисками.	2
7	Идентификация рисков	Определение весомости рисков. Документирование характеристик рисков.	2
8	Качественный анализ	Цели и задачи качественного анализа рисков.	2

№ п/п	Наименование раздела, темы учебной дисциплины (модуля)	Тематика практических занятий (семинаров)	Трудоемкость (час.)
	рисков	Алгоритм такого анализа. Методы качественного анализа рисков. Последовательность и результаты качественного анализа. Карта рисков.	
9	Количественный анализ рисков	Подходы к учету факторов неопределенности и риска в расчетах эффективности проектов. Методы оценки эффективности инвестиционных проектов с учетом неопределенности и риска.	2
10	Методы реагирования на риски	Основные группы методов реагирования на риски. Выбор метода реагирования на риски.	2
11	Мониторинг и контроль рисков	Цели мониторинга и контроля рисков. Этапы жизненного цикла проекта. Динамика задач управления рисками в зависимости от этапа жизненного цикла проекта.	2
12	Методы снижения проектных рисков.	Группы методов снижения проектных рисков. Подходы и способы управленческого воздействия на риск.	4
13	Определение стратегии управления рисками	Виды стратегий управления рисками. Диаграмма выбора стратегий управления рисками. Внедрение стратегии управления рисками.	4
14	Особенности управления проектными рисками коммерческих предприятий	Специфика идентификации рисков, применения методов снижения рисков, формирования программы мероприятий по снижению проектных рисков.	4
Всего:			34

заочная форма обучения

№ п/п	Наименование раздела, темы учебной дисциплины (модуля)	Тематика практических занятий (семинаров)	Трудоемкость (час.)
1	Планирование управления рисками	Составление плана управления рисками. Последовательность шагов по принятию решений в области управления рисками. Обеспечение процедур управления рисками.	2
2	Мониторинг и контроль рисков	Цели мониторинга и контроля рисков. Этапы жизненного цикла проекта. Динамика задач управления рисками в зависимости от этапа жизненного цикла проекта.	2
3	Определение стратегии управления рисками	Виды стратегий управления рисками. Диаграмма выбора стратегий управления рисками. Внедрение стратегии управления рисками.	2
Всего:			6

8. Примерная тематика курсовых проектов (работ)

Курсовые проекты (работы) не предусмотрены учебными планами.

9. Самостоятельная работа студента

Тема 1 Риск-менеджмент как управленческая технология

Вопросы для самостоятельного изучения:

1. Что такое риск и можно ли им управлять?
2. Почему необходимы количественные и качественные оценки вероятности достижения предполагаемого результата, неудачи и отклонения от цели?
3. Почему в ситуации риска ответственное лицо оказывается перед необходимостью разработки альтернативных вариантов решения и последующего выбора наиболее приемлемого из них?
4. Какие действия включает управление риском?
5. Почему одни и те же факторы могут оказывать в различных условиях неодинаковое влияние на рынок?
6. Почему определение факторов риска предполагает учет прошлого в динамике, экономические знания?
7. Что является ключевым этапом в управлении рисками?
8. Какими способами оптимизируются и снижаются риски?

Контрольные вопросы:

1. Риск – это:
 - a) неблагоприятное событие, влекущее за собой убыток
 - b) все предпосылки, могущие негативно повлиять на достижение стратегических целей в течение строго определенного временного промежутка
 - c) вероятность наступления стихийных бедствий либо технических аварий
 - d) вероятность провала программы продаж
2. Управление риском – это:
 - a) отказ от рискованного проекта
 - b) комплекс мер, направленных на снижение вероятности реализации риска
 - c) комплекс мер, направленных на компенсацию, снижение, перенесение, принятие риска или уход от него
 - d) комплекс мероприятий, направленных на подготовку к реализации риска
3. Реализация риск-менеджмента на современных предприятиях включает в себя:
 - a) выявление последствий деятельности экономических субъектов в ситуации риска
 - b) прогнозирование этой деятельности для снижения уровня риска
 - c) умение реагировать на возможные отрицательные последствия этой деятельности

d) разработка и осуществление мер, при помощи которых могут быть нейтрализованы или компенсированы вероятные негативные результаты предпринимаемых действий

4. Содержательная сторона риск-менеджмента включает в себя:

- a) планирование деятельности по реализации рискованного проекта
- b) сравнение вероятностей и характеристик риска, полученных в результате оценки и анализа риска
- c) выбор мер по минимизации или устранению последствий риска
- d) организация службы управления рисками на предприятии

5. Что из перечисленного не является элементом системы риск-менеджмента:

- a) выявление расхождений в альтернативах риска
- b) разработка планов, позволяющих действовать оптимальным образом в ситуации риска
- c) разработка конкретных мероприятий, направленных на минимизацию или устранение негативных последствий
- d) учет психологического восприятия рискованных проектов

6. К основным категориям риск-менеджмента относят:

- a) применение методов риск-менеджмента
- b) управление рисками по их типам
- c) точность оценок рисков
- d) точность прогнозов рисков

7. VAR – это:

- a) парадигма стоимости риска (Value-at-Risk)
- b) показатель объемов потерь прибыли (Volume at Reduce)
- c) степень сопротивления персонала рискованным проектам (Volume at Resistance)
- d) объем риска (Volume of Accepted Risk)

8. Главной функцией риск-менеджмента является:

- a) создание чуткой системы управления рисками
- b) оценка риска по каждому проекту в компании
- c) оценка риска для компании в целом
- d) предотвращение банкротства компании в результате наступления случайных событий

9. Подходы, выделяемые при расчете VAR:

- a) логический
- b) оценочный
- c) ранжирование
- d) параметрический

10. Что, из перечисленного ниже, не является элементом расчета VAR для одного актива:

- a) текущая стоимость актива
- b) чувствительность стоимости к неблагоприятному изменению фактора риска
- c) изменение стоимости в перспективе

d) возможное изменение фактора риска при данном доверительном уровне

11. Волатильность – это:

- a) изменчивость рыночного спроса
- b) постоянство рыночного спроса
- c) изменчивость курсовых разниц и процентных ставок
- d) постоянство курсовых разниц и процентных ставок

12. Суть риск-менеджмента состоит в:

- a) устранении риска
- b) управлении риском
- c) снижении риска
- d) выборе риска

13. Функции объекта управления в риск-менеджменте:

- a) организация разрешения риска
- b) организация работы по снижению величины риска
- c) организация процесса страхования рисков
- d) организация экономических отношений и связей между субъектами

хозяйственного процесса

14. Что, из перечисленного ниже, не является функциями субъекта управления в риск-менеджменте:

- a) регулирование
- b) координация
- c) распределение
- d) контроль

Темы докладов:

1. Эволюция управления рисками: концепции, подходы и их условия.
2. Классификация рисков: виды, принципы разработки, использование.
3. Программа управления рисками: разработка и использование.
4. Комплексное использование методов управления рисками.
5. Управление рисками в малом предпринимательстве.

Форма контроля: проверка выполнения самостоятельной работы студентов на практическом занятии:

- a. Презентации докладов
- b. Анализ ответов на контрольные вопросы

Тема 2 Риск и неопределенность в проектировании

Вопросы для самостоятельного изучения:

1. Какими факторами обуславливается неопределённость проектирования?
2. В чём состоят различия между неопределённостью и детерминированностью?
3. Что понимается под инвестиционной деятельностью?
4. Какие риски относятся к внешним (не диверсифицируемым) рискам?

5. Почему степень вероятности наступления внутреннего риска можно определить с большой точностью, а вероятность внешнего риска предсказать практически невозможно?

6. Какие риски можно выделить по степени их влияния на проект и предприятие, а также, по степени обратимости последствий возникновения того или иного события?

7. Какие методы в мировой практике инвестиционного менеджмента используются для оценки эффективности инвестиционных проектов в условиях риска и неопределенности?

8. Раскройте сущность организационно - экономического механизма реализации проектов в условиях риска.

Контрольные вопросы:

1) Группа, не влияющая на возникновение неопределенности и вызванного ею риска:

a) многокритериальность и конфликтность в оценке решений

b) зависимость от поставщиков

c) асимметрия информации

d) индетерминированность процессов и явлений, которые влияют на экономику

2) К трудовым потерям можно отнести:

a. потери рабочего времени

b. уменьшение выручки вследствие снижения цен на реализуемую продукцию

c. невыполнение сроков сдачи объекта

d. потери материалов

e. ущерб здоровью

3) Отметьте потери, которые можно отнести к финансовым

a) потери ценных бумаг

b) выплата штрафа

c) уплата дополнительных налогов

d) уменьшение выручки вследствие снижения цен на реализуемую продукцию

e) всё перечисленное

4) Отметьте потери, которые можно отнести к потерям времени:

a) невыполнение сроков сдачи объекта

b) потери ценных бумаг

c) потери рабочего времени

d) ущерб репутации

e) потери сырья

5) Отметьте потери, которые можно отнести к специальным потерям:

a) выплата штрафа

b) ущерб здоровью

c) уплата дополнительных налогов

d) ущерб репутации

- е) невыполнение сроков сдачи объекта
- б) Анализ риска – это:
- 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
 - с) начальный этап системы мероприятий по управлению рисками, состоящий в систематическом выявлении рисков, характерных для определенного вида деятельности, и определении их характеристик
 - д) всё перечисленное верно
- 7) Идентификация риска – это:
- 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
 - с) систематическое научное исследование степени риска, которому подвержены конкретные объекты, виды деятельности и проекты
 - д) всё перечисленное верно
- 8) Риски, которые могут нести в себе как потери, так и дополнительную прибыль, называются:
- а) чистыми
 - б) критическими
 - с) спекулятивными
 - д) всё перечисленное верно
- 9) Риски, которые практически всегда несут в себе потери, называются:
- а) критическими
 - б) спекулятивными
 - с) чистыми
 - д) всё перечисленное верно
- 10) Риски, обусловленные деятельностью самого предприятия и его контактной аудиторией, называются:
- а. внешними
 - б. внутренними
 - с. чистыми
 - д. всё перечисленное верно
- 11) Риски, реализация которых грозит потерей прибыли, называются:
- а) катастрофическими
 - б) критическими
 - с) допустимыми
 - д) всё перечисленное верно
- 12) Риски, реализация которых грозит потерей выручки (т.е. потери превышают ожидаемую прибыль) предприятием, называются:

- a) катастрофическими
- b) критическими
- c) допустимыми
- d) всё перечисленное верно

13) Подразделение рисков на спекулятивные и чистые основано на:

- a) классификации субъектов риска
- b) классификации объектов риска
- c) характере оценки риска
- d) характере последствий риска

14) По сфере возникновения выделяют следующие типы рисков:

- a) производственный риск
- b) кадровый риск
- c) информационный риск;
- d) финансовый риск;
- e) коммерческий риск

15) Финансовые риски подразделяются на:

- a) валютные
- b) денежные
- c) инвестиционные
- d) проектные
- e) риски распределения доходности

Темы докладов:

1. Понятие риска и неопределенности
2. Мегаэкономические риски – риски, связанные с функционированием мировой экономики в целом
3. Макроэкономические риски – риски экономической системы государства
4. Мезоэкономические риски – риски, формируемые на уровне отдельных отраслей народного хозяйства и специфических сфер бизнеса
5. Микроэкономические риски – риски отдельных предпринимательских единиц (внутренние риски)

Форма контроля: проверка выполнения самостоятельной работы студентов на практическом занятии:

- a. Презентации докладов
- b. Анализ ответов на контрольные вопросы

Тема 3 Классификация проектных рисков

Вопросы для самостоятельного изучения:

1. Риски на преинвестиционной фазе проекта
2. Риски на инвестиционной фазе проекта
3. Эксплуатационные риски
4. Виды рисков
5. Динамические и статические риски

6. Смешанные риски
7. Систематические и несистематические риски
8. Страхуемые и нестрахуемые риски
9. Управляемые, частично управляемые и не управляемые риски

Контрольные вопросы:

- 1) Ситуацией риска на предприятии называют:
 - a) альтернативные варианты принятия решений для получения оптимальной величины прибыли
 - b) возможность качественно и количественно определить степень вероятности потери прибыли
 - c) возможность определить вероятность получения дополнительной прибыли
 - d) всё перечисленное верно
- 2) В явлении «риск» можно выделить следующие основные элементы, взаимосвязь которых составляет его сущность:
 - a) противоречивость и неопределенность
 - b) вероятность получения дополнительной прибыли и неопределенность ее недополучения
 - c) субъективность и объективность проявления
 - d) возможность материальных, нравственных и других потерь, связанных с осуществлением выбранной в условиях неопределенности альтернативы
- 3) Ситуация неопределенности характеризуется тем, что:
 - a) вероятность наступления результатов событий может быть установлена только опытным путем
 - b) вероятность наступления события в принципе не устанавливается
 - c) вероятность наступления события можно определить графическим способом на основе графика нормального распределения случайной величины
 - d) всё перечисленное верно
- 4) Основными причинами риска являются:
 - a) спонтанность природных процессов, случайность, наличие противоборствующих тенденций, вероятностный характер НТП
 - b) ограниченность финансовых ресурсов, случайность, развитие научно-технического прогресса, природные катаклизмы
 - c) спонтанность природных явлений, развитие научно-технического прогресса, недостаточность сведений об объекте
 - d) всё перечисленное верно
- 5) Источником риска в организации можно назвать:
 - a) бизнес-планирование проектов по освоению новых видов изделий на долгосрочный период
 - b) наличие противоборствующих тенденций, столкновение противоречивых интересов
 - c) смена административной команды управления организацией

- d) всё перечисленное верно
- 6) Наиболее важными элементами, положенными в основу классификации рисков, являются:
- a) гражданско-правовая форма образования организации
 - b) время возникновения и характер последствий
 - c) объективная и субъективная природа возникновения
 - d) всё перечисленное верно
- 7) К факторам прямого действия, определяющим уровень риска, относятся:
- a) непредвиденные изменения экономической обстановки в стране
 - b) малокомпетентная работа управленческих и иных служб
 - c) непредвиденные действия конкурентов
 - d) способ организации труда
- 8) К факторам косвенного действия, определяющим уровень риска, относятся:
- a) нестабильность, противоречивость законодательства
 - b) недостаток бизнес-информации в фирме
 - c) ошибки при принятии решений
 - d) непредвиденные изменения в отрасли предпринимательской деятельности
- 9) К объективным факторам, определяющим уровень риска, относятся:
- a) коррупция и рэкет
 - b) ошибки при реализации рискованных ситуаций
 - c) финансовые проблемы внутри фирмы
 - d) непредвиденные изменения экономической обстановки в регионе
- 10) К субъективным факторам, определяющим уровень риска, относятся:
- a) разработка, внедрение новых технологий, способ организации труда
 - b) отсутствие у персонала способности к риску
 - c) стихийные силы природы и климат
 - d) революционные скачки в научно-техническом прогрессе
- 11) В зависимости от рискованного события, к чистой группе рисков относят:
- a) валютный риск
 - b) политический риск
 - c) инновационный риск
 - d) страновой риск
- 12) В зависимости от рискованного события, к спекулятивной группе рисков относят:
- a) организационный риск
 - b) финансовый риск
 - c) налоговый риск
 - d) риск развития НТП
- 13) К принципам, прямо воздействующим на уровень политического риска, относят:

- a) политическую обстановку
- b) налоговую систему
- c) экономическую обстановку в стране для осуществления деятельности

d) всё перечисленное верно

14) К принципам, косвенно воздействующим на уровень политического риска, относят:

a) непредвиденные действия органов государственного и местного самоуправления

b) законодательство

c) международные события

d) всё перечисленное верно

Темы докладов:

1. Техничко-технологические и строительные риски
2. Управленческо-организационные и маркетинговые риски
3. Финансовые и валютные риски
4. Риски участников проекта, включая инвестиционные риски и форсмажор
5. Социальные и военно-политические риски
6. Юридическо-правовые риски
7. Экологические риски
8. Специфические риски

Форма контроля: проверка выполнения самостоятельной работы студентов на практическом занятии:

a. Презентации докладов

b. Анализ ответов на контрольные вопросы

Тема 4 Анализ и расстановка приоритетов рисков

Вопросы для самостоятельного изучения:

1. Относительное ранжирование или список приоритетов рисков проекта

2. План управления рисками

3. Идентификация рисков

4. Факторы, снижающие риск и повышающие ожидаемую прибыль

5. Факторы, повышающие риск и снижающие ожидаемую прибыль

Контрольные вопросы:

1) Установите последовательность алгоритма управления риском:

a) выбор метода воздействия на риск в целях снижения его уровня,

b) определение корректирующих целей для снижения рассогласования между фактическим уровнем риска и приемлемым,

c) выбор управляющих воздействий на риск,

d) постановка целей управления риском,

е) анализ эффективности принятых решений на основе сравнения полученного уровня риска с приемлемым уровнем,

ф) анализ риска на основе, собранной информации (качественный и количественный анализ)

2) К основным подходам к группировке методов анализа и оценки рисков относятся:

- а) экономический
- б) статистический
- с) вероятностный
- д) математический

3) Возможность обращения имеющихся активов в денежные средства определяется:

- а) ликвидностью
- б) платежеспособностью
- с) кредитоспособностью
- д) всё перечисленное верно

4) К факторам (коэффициентам) модели Э. Альтмана анализа возможности банкротства не относятся:

- а) соотношение собственных оборотных средств к общей сумме активов
- б) соотношение прибыли до вычета налогов и уплаты процентов к сумме активов
- с) соотношение заемных средств к сумме активов
- д) соотношение нераспределенной прибыли к общей величине затрат

5) Элемент системы управления, который формирует управляющие воздействия с учетом информации, осуществляет управленческую и организационную работу, принимает решения и обеспечивает достижение поставленных целей:

- а) объект управления
- б) субъект управления
- с) внутренняя среда
- д) всё перечисленное верно

6) К основным свойствам процесса управления не относятся:

- а) неопределенность
- б) непрерывность
- с) относительность
- д) вероятностный характер

7) Область риска, в которой потери по своей величине превосходят критический уровень потерь:

- а) зона допустимого риска
- б) зона критического риска
- с) зона катастрофического риска
- д) безрисковая зона

8) Найдите соответствие между подходами к группировке методов анализа и оценки рисков и их характеристикой:

- a) описательный
- b) статистический
- c) вероятностный
- d) нормативный

А. выявление и оценка рисков происходит на основе сопоставления параметров функционирования предприятия с нормативными значениями

В. заключается в определении факторов риска, этапов и работ, при выполнении которых риск возникает, то есть установить потенциальные области риска, после чего идентифицировать все возможные риски

С. заключается в определении факторов риска, этапов и работ, при выполнении которых риск возникает, то есть установить потенциальные области риска, после чего идентифицировать все возможные риски

Д. в данном подходе различают два типа вероятности: математическую (или априорную) и статистическую

9) Найдите соответствие между основными математическими моделями по оценке последствий риска и их характеристикой:

- a) детерминированные
- b) стохастические
- c) лингвистические

А. применяются, когда известны причины и факторы риска, а также исход по каждому предпринимаемому действию

В. используют аппарат нечеткой логики и применяются при нечетко выраженной природе риска

С. строятся на основе статистически значимой информации о прошлых реализациях, когда причины и факторы риска случайны и риск может описываться распределением вероятностей на заданном множестве

10) Найдите соответствие между методами анализа рисков и их характеристикой:

- a) вероятностный анализ
- b) экспертный анализ
- c) имитационные методы
- d) анализ чувствительности проекта

А. проводятся многократные опыты с моделью, в которой реализуются пошаговые алгоритмы поиска значения показателя риска

В. применяется при отсутствии или недостаточном объеме исходной информации и состоит в привлечении экспертов для оценки рисков

С. проводится на основе статистических данных предшествовавшего периода с установлением области риска, достаточности инвестиций, коэффициента риска

Д. оценивается влияние различных исходных переменных, необходимых для расчета, на изменение результирующих показателей проекта

11) Найдите соответствие между показателями риска и их характеристикой:

- a) относительные

- b) абсолютные
- c) средние

А.используются в качестве обобщающих показателей, в них отражаются действующие причины, факторы риска и закономерности

В.выражаются в стоимостной или материально-вещественной форме, могут быть представлены в составе балансовых отношений, описывающих финансовое состояние организации

С.отражают результат сравнения возможных потерь с некоторой базой

12) Если запасы и затраты предприятия покрываются общими источниками их формирования, то риск потери финансовой устойчивости:

- a) максимален
- b) минимален
- c) средний риск
- d) всё перечисленное верно

13) Какие виды рисков не относятся к чистому риску:

- a) торговые
- b) политические
- c) инфляционные
- d) транспортные

14) К основным источникам неопределенности не относятся:

- a) спонтанность процессов и явлений
- b) случайность процессов
- c) достаточность информации
- d) ограниченность ресурсов

15) Какая природа риска обусловлена вероятностной сущностью природных, технологических, и социально-экономических отношений:

- a) субъективная природа риска
- b) объективная природа риска
- c) всё перечисленное верно

Темы докладов:

1. Комплексное использование методов управления рисками.
2. Управление рисками в малом предпринимательстве.
3. Организация управления рисками на промышленном предприятии.
4. Организация управления рисками в финансово-кредитном учреждении.
5. Особенности управления рисками финансово-промышленной группы.
6. Особенности управления рисками транснациональной корпорации.
7. Управление рисками инвестиционного проекта

Форма контроля: проверка выполнения самостоятельной работы студентов на практическом занятии:

- a. Презентации докладов
- b. Анализ ответов на контрольные вопросы

Тема 5 Планирование управления рисками

Вопросы для самостоятельного изучения:

1. Какое влияние на план управления проектом оказывает толерантность к риску организаций и лиц, участвующих в проекте
2. Стандарты распределения ролей и ответственности; уровни полномочий для принятия решений
3. Определение подходов, инструментов и источников данных, которые могут использоваться для управления рисками в коммерческом проекте
4. Распределение ролей и ответственности
5. Выделение ресурсов и оценка стоимости мероприятий, необходимых для управления рисками
6. Определение сроков и частоты выполнения процесса управления рисками на протяжении всего жизненного цикла проекта
7. Иерархическая структура рисков
8. Идентификация рисков

Контрольные вопросы:

- 1) _____ - метод оценки риска, основанный на расчетах и анализе статистических показателей. Заполните пропуск:
 - a) вероятностный метод
 - b) построение дерева решений
 - c) метод сценариев
 - d) имитационное моделирование
- 2) Какой из ниже перечисленных методов оценки риска дает представление о наиболее критических факторах инвестиционного проекта:
 - a) построение дерева решений
 - b) учет рисков при расчете чистой приведенной стоимости
 - c) анализ чувствительности
 - d) имитационное моделирование
- 3) Какой из ниже перечисленных методов оценки риска реализуется путем введения поправки на риск или путем учета вероятности возникновения денежных потоков:
 - a) построение дерева решений
 - b) метод сценариев
 - c) учет рисков при расчете чистой приведенной стоимости
 - d) имитационное моделирование
- 4) Какой из перечисленных ниже методов оценки риска используется в ситуациях, когда принимаемые решения сильно зависят от принятых ранее и определяют сценарии дальнейшего развития событий:
 - a) имитационное моделирование
 - b) вероятностный метод
 - c) построение дерева решений
 - d) метод сценариев

5) Какой из перечисленных ниже методов оценки риска представляет собой серию численных экспериментов, призванных получить эмпирические оценки степени влияния различных факторов на некоторые зависящие от них результаты:

- a) вероятностный метод
- b) метод сценариев
- c) имитационное моделирование
- d) учет рисков при расчете чистой приведенной стоимости

б) При расчете чистой приведенной стоимости риск можно учитывать:

a) в знаменателе формулы NPV посредством корректировки ставки дисконта

b) комбинация формул NPV посредством корректировки чистых денежных потоков

c) в числителе формулы NPV посредством корректировки чистых денежных потоков

d) всё перечисленное верно

7) Субъектом управления в риск-менеджменте является:

a) специальная группа людей, которая посредством различных приемов и способов управленческого воздействия осуществляет управление рисками

b) риск, рисковые вложения капитала и экономические отношения между хозяйствующими субъектами

c) всё перечисленное верно

8) Объектом управления в риск-менеджменте является:

a) риск, рисковые вложения капитала и экономические отношения между хозяйствующими субъектами

b) специальная группа людей, которая посредством различных приемов и способов управленческого воздействия осуществляет управление рисками

c) всё перечисленное верно

9) Утверждение о том, что «деятельность любой организации всегда сопровождается рисками, присутствующими в ее внешней или внутренней среде» отражает смысл:

a) закона неизбежности риска

b) закона сочетания потенциальных потерь и выгод

c) закона прямой зависимости между степенью риска и уровнем планируемых доходов

d) всё перечисленное верно

10) Утверждение о том, что «практически в любых ситуациях риска потенциальная возможность потерь или убытков сочетается с потенциальной возможностью получения дополнительных доходов» отражает смысл:

a) закона прямой зависимости между степенью риска и уровнем планируемых доходов

b) закона неизбежности риска

c) закона сочетания потенциальных потерь и выгод

d) всё перечисленное верно

11) Утверждение о том, что «чем выше степень риска при осуществлении хозяйственной операции, тем выше уровень планируемых от этой операции доходов» отражает смысл:

а) закона прямой зависимости между степенью риска и уровнем планируемых доходов

б) закона неизбежности риска

в) закона сочетания потенциальных потерь и выгод

г) всё перечисленное верно

12) Прогнозирование внешней обстановки относится к методам:

а) компенсации рисков

б) уклонения от рисков

в) методы локализации рисков

г) методы диверсификации рисков

13) Страхование относится к методам:

а) уклонения от рисков

б) диверсификации рисков

в) локализации рисков

г) компенсации рисков

14) Распределение риска по этапам работы относится к группе методов:

а) локализации рисков

б) компенсации рисков

в) уклонения от рисков

г) диверсификации рисков

15) Заключение договоров о совместной деятельности для реализации рискованных проектов относится к группе методов:

а) диверсификации рисков

б) уклонения от рисков

в) методы компенсации рисков

г) методы локализации рисков

16) Обучение и инструктирование персонала относится к группе методов:

а) уклонения от рисков

б) компенсации рисков

в) диверсификации рисков

г) локализации рисков

17) Распределение ответственности между участниками проекта относится к группе методов:

а) диверсификации рисков

б) компенсации рисков

в) локализации рисков

г) уклонения от рисков

18) Увольнение некомпетентных сотрудников относится к группе методов:

а) локализации рисков

б) диверсификации рисков

с) уклонения от рисков

d) компенсации рисков

19) Создание системы резервов относится к группе методов:

a) уклонения от рисков

b) диверсификации рисков

с) компенсации рисков

d) локализации рисков

20) Создание специальных инновационных подразделений относится к группе методов:

a) локализации рисков

b) диверсификации рисков

с) компенсации рисков

d) уклонения от рисков

21) Распределение инвестиций в разных отраслях и сферах деятельности относится к группе методов:

a) диверсификации рисков

b) локализации рисков

с) компенсации рисков

d) уклонения от рисков

Темы докладов:

1. Планирование управления рисками

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

3. Программа управления рисками: разработка и использование.

4. Система управление проектами

5. Комплексное использование методов управления рисками

6. Информационное обеспечение управления рисками: принципы создания и использования информационной системы организации

Форма контроля: проверка выполнения самостоятельной работы студентов на практическом занятии:

a. Презентации докладов

b. Анализ ответов на контрольные вопросы

Тема 6 Система управления рисками

Вопросы для самостоятельного изучения:

1. Понятие о системе управления риском

2. Основные методы нейтрализации рисков

3. Выбор наиболее эффективных методов управления рисками при существующих ограничениях

4. Определение оптимальной совокупности методов управления рисками с точки зрения минимизации возможных потерь

5. Внешние и внутренние ограничения риск-менеджмента

6. Особенности риск-менеджмента в туристическом бизнесе

7. Особенности риск-менеджмента в гостиничном бизнесе

8. Особенности риск-менеджмента в ресторанном бизнесе

Контрольные вопросы:

- 1) Предприятия каких отраслей сталкиваются с коммерческими рисками:
 - a) промышленности
 - b) торговли
 - c) строительства
 - d) всех отраслей.
- 2) Как соотносятся понятия коммерческого и финансового риска:
 - a) финансовые риски включают в себя коммерческие
 - b) коммерческие риски включают в себя финансовые
 - c) эти понятия не соотносимы, т. к. относятся к разным классификациям
 - d) это синонимы
- 3) Что значит управлять риском?
 - a) следить за тенденцией его развития
 - b) использовать различные меры, позволяющие прогнозировать наступление рискованного события
 - c) принимать меры к снижению риска
 - d) управлять риском невозможно, т. к. данное понятие изучается теорией вероятности
- 4) При классификации рисков выделяют следующие основные группы:
 - a) входящие
 - b) чистые
 - c) текущие
 - d) спекулятивные
- 5) Спекулятивные риски включают:
 - a) имущественный риск
 - b) торговый риск
 - c) валютный риск
 - d) инфляционный риск
- 6) Неопределенность хозяйственной ситуации обуславливается:
 - a) вероятностью
 - b) случайностью
 - c) противодействием
 - d) закономерностью
- 7) Для определения вероятности наступления события используют:
 - a) субъективный метод
 - b) метод ABC
 - c) объективный метод
 - d) всё перечисленное верно
- 8) Уменьшение степени вероятного риска достигается следующими методами:
 - a) хеджированием
 - b) передачей риска

- c) страхованием
 - d) отказом от сделки
 - e) методом красной линии
 - f) франчайзингом
- 9) Риск, выражающийся в вероятности получить как положительный, так и отрицательный результат:
- a) финансовый
 - b) экологический
 - c) спекулятивный
 - d) чистый
- 10) В состав инвестиционных рисков входят:
- a) риск упущенной выгоды
 - b) валютный риск
 - c) кредитный риск
 - d) риск снижения доходности
- 11) Факторы, обуславливающие неопределенность хозяйственной ситуации:
- a) цикличность
 - b) отсутствие полной информации
 - c) противодействие
 - d) динамичность
 - e) случайность
- 12) Коммерческие риски образуют следующие чистые риски:
- a) экологические
 - b) финансовые
 - c) имущественные
 - d) торговые
 - e) производственные
- 13) Виды рисков, выделяемых на государственном уровне:
- a) чистые
 - b) на макроэкономическом уровне
 - c) на микроэкономическом уровне
 - d) спекулятивные
- 14) Функции предпринимательского риска:
- a) защитная
 - b) стоимостная
 - c) регулирующая
 - d) социальная
- 15) К спекулятивным рискам относятся:
- a) связанные с покупательной способностью денег
 - b) экономические
 - c) инвестиционные
 - d) производственные
- 16) Биржевой риск относится к _____ видам риска.
- Заполните пропуск:

- a) инфляционным
- b) финансовым
- c) кредитным
- d) инвестиционным

17) К методам, используемым при количественном анализе рисков, относятся:

- a) минимизация потерь
- b) дерево решений
- c) оценки вероятности ожидаемого ущерба
- d) экспертных оценок

Темы докладов:

1. Избежание риска
2. Лимитирование концентрации риска
3. Диверсификация риска
4. Хеджирование риска
5. Распределение рисков
6. Самострахование (внутреннее страхование рисков)
7. Страхование риска

Форма контроля: проверка выполнения самостоятельной работы студентов на практическом занятии:

- a. Презентации докладов
- b. Анализ ответов на контрольные вопросы

Тема 7 Идентификация рисков

Вопросы для самостоятельного изучения:

1. Идентификация потенциальных рисков
2. Группировка и сортировка рисков, в соответствии с целями компании в области риск-менеджмента
3. Идентификация методов по работе с рисками
4. Идентификация стратегий локализации риска
5. Идентификация стратегий предотвращения рисков
6. Идентификация стратегий уменьшения риска
7. Методики идентификации рисков

Контрольные вопросы:

- 1) К основным способам уменьшения риска относят:
 - a) резервирование средств на покрытие непредвиденных расходов
 - b) привлечение к разработке проекта компетентных партнеров
 - c) всё перечисленное верно
- 2) К какому виду риска относится разрыв контракта из-за действий властей страны, в которой находится компания-контрагент:
 - a) экономический
 - b) предпринимательский

- с) политический
- d) всё перечисленное верно

3) К какому, из перечисленных ниже, подвиду экологического риска можно отнести вероятность потерь, вызванных спецификой климатических условий, а также наличием природных ресурсов:

- a) природно-климатические
- b) антропогенные
- с) социально-бытовые
- d) всё перечисленное верно

4) К какому подвиду экологического риска можно отнести вероятность потерь, вызванных заболеваемостью животных и людей инфекционными заболеваниями:

- a) природно-климатические
- b) социально-бытовые
- с) антропогенные
- d) всё перечисленное верно

5) К какой группе методов управления экологическими рисками относится введение нормативных стандартов и ограничений для производителей:

- a) распределение прав на загрязнение
- b) административное регулирование
- с) система платежей и налогов за экологические загрязнения
- d) создание экономических стимулов

6) К какой группе методов управления экологическими рисками относится установление платы за выбросы и сбросы, а также за использование ресурсов:

- a) создание экономических стимулов
- b) административное регулирование
- с) система платежей и налогов за экологические загрязнения
- d) распределение прав на загрязнение

7) К какой группе методов управления экологическими рисками относится предоставление налоговых кредитов и обеспечение ускоренной амортизации природоохранного оборудования:

- a) создание экономических стимулов
- b) распределение прав на загрязнение
- с) система платежей и налогов за экологические загрязнения
- d) административное регулирование

8) Определите группу методов управления экологическими рисками, к которой относится введение компенсационных платежей, обеспечивающих уровень загрязнения среды в рамках общих нормативов региона:

- a) система платежей и налогов за экологические загрязнения
- b) распределение прав на загрязнение
- с) административное регулирование
- d) создание экономических стимулов

9) Определите группу методов управления экологическими рисками, к

которой относится предоставление займов с уменьшенной ставкой процента, а также предоставление гарантий по займам:

- a) распределение прав на загрязнение
- b) создание экономических стимулов
- c) административное регулирование
- d) система платежей и налогов за экологические загрязнения

10) Отметьте вид риска, не входящий в приведенную классификацию политических рисков:

- a. международный
- b. региональный
- c. междугородный
- d. страновой

11) Какой из видов производственного риска приводит к увеличению числа непредвиденных аварийных ситуаций:

- a) использование устаревшего оборудования
- b) нестабильность качества товаров и услуг
- c) ненадежность составляющих
- d) выявление новых технологий в отрасли
- e) отсутствие резервных возможностей

12) Какой из перечисленных видов производственного риска приводит к низкой эффективности производства по сравнению с конкурентами:

- a) ненадежность составляющих
- b) нестабильность качества товаров и услуг
- c) отсутствие резервных возможностей
- d) выявление новых технологий в отрасли
- e) использование устаревшего оборудования

13) Какой из перечисленных видов производственного риска приводит к увеличению затрат на ремонт и модернизацию оборудования:

- a) выявление новых технологий в отрасли
- b) использование устаревшего оборудования
- c) отсутствие резервных возможностей
- d) нестабильность качества товаров и услуг
- e) ненадежность составляющих

14) Какой из перечисленных видов производственного риска приводит к невозможности покрытия пикового спроса:

- a. использование устаревшего оборудования
- b. ненадежность составляющих
- c. отсутствие резервных возможностей
- d. выявление новых технологий в отрасли
- e. нестабильность качества товаров и услуг

15) Какой из перечисленных видов производственного риска приводит к оттоку клиентов и проблемам со спросом:

- a) ненадежность составляющих
- b) выявление новых технологий в отрасли
- c) нестабильность качества товаров и услуг

- d) отсутствие резервных возможностей
- e) использование устаревшего оборудования
- 16) Какие из перечисленных рисков относятся к коммерческим рискам:
 - a) риск, связанный с финансированием инвестиционного проекта
 - b) риск, связанный с невозможностью покрытия пикового спроса на товар
 - c) риск, связанный с реализацией товара (услуг) на рынке
 - d) риск, связанный с транспортировкой товара
 - e) риск, связанный с приемкой товара покупателем
 - f) риск, связанный с колебаниями процентных ставок
 - g) риск, связанный с платежеспособностью покупателя

Темы докладов:

1. Предпринимательские риски
2. Природно-естественные риски
3. Транспортные риски
4. Коммерческие риски
5. Финансовые риски

Форма контроля: проверка выполнения самостоятельной работы студентов на практическом занятии:

- a. Презентации докладов
- b. Анализ ответов на контрольные вопросы

Тема 8 Качественный анализ рисков

Вопросы для самостоятельного изучения:

1. Методика определения явных и потенциальных рисков проекта
2. Определение условий минимизации рисков
3. Анализ условий, повышающих риск
4. Определение вероятности реализации рисков
5. Определение тяжести последствий реализации рисков
6. Определения ранга риска по матрице «вероятность — последствия»
7. Определение близости наступления риска
8. Оценка качества использованной информации
9. Рейтинг-метод анализа риска
10. Метод экспертных оценок риска

Задания:

Задача №1. В состав портфеля включены два вида ценных бумаг: акции (x_1) с ожидаемой доходностью $m_1 = 15\%$ и облигации (x_2) с доходностью $m_2 = 6\%$. Стандартное отклонение акций $\sigma_1 = 23\%$, облигаций $\sigma_2 = 9\%$. Варьируя портфельными весами активов, выбрать оптимальную его структуру с точки зрения применяемого типа активов. Расчеты выполнить для пяти значений коэффициентов парной корреляции $\rho_{ij} = -1.0; -0,6; 0; 0,2;$

1,0.

Задача №2. Провести оценку риска двух инвестиционных проектов. Первый с вероятностью 0,7 обеспечивает прибыль 150 тыс. руб., однако с вероятностью 0,3 можно потерять 16,7 тыс. руб. Для второго проекта с вероятностью 0,6 можно получить прибыль 180 тыс. руб. и с вероятностью 0,4 потерять 20,0 тыс. руб. Какой проект выбрать?

Задача №3. Рассматриваются два инвестиционных проекта. Первый с вероятностью 0,65 обеспечивает доход в 10 млн руб., однако с вероятностью 0,35 убытки могут составить 6 млн. руб. Для второго проекта с вероятностью 0,7 можно получить доход 8 млн. руб., с вероятностью 0,3 убытки 4 млн. руб. Какой из проектов следует реализовать? Ответ аргументировать.

Задача №4. Рассматриваются два инвестиционных проекта. Срок реализации каждого – 3 года. Вероятности поступления наличности проекта **А** по периодам реализации составляют 0,2; 0,6; 0,2. Объем наличных поступлений по проекту **А** соответственно – 40, 50, 60 млн. руб. Вероятности проекта **Б** – 0,4; 0,2; 0,4. Наличные поступления по проекту **Б** соответственно 0, 50, 100 млн. руб. Фирма имеет обязательства в 80 млн. руб. Какой из проектов следует реализовать?

Задача №5. Известно, что при вложении капитала в мероприятие **А** из 120 случаев:

- прибыль 25 тыс. руб. была получена в 48 случаях,
- прибыль 20 тыс. руб. была получена в 36 случаях, 3
- прибыль 30 тыс. руб. была получена в 36 случаях.

При вложении капитала в мероприятие **Б**:

- прибыль 40 тыс. руб. была получена в 36 случаях,
- прибыль 30 тыс. руб. была получена в 60 случаях,
- прибыль 15 тыс. руб. была получена в 24 случаях.

Определить степень риска при вложении капитала в мероприятия **А** и **Б**.

Темы докладов:

1. Управление рисками в антикризисном менеджменте
2. Информационное обеспечение управления рисками
3. Принципы создания и использования информационной системы организации
4. Методы оценки эффективности управления рисками
5. Использование качественных методов анализа и оценки рисков
6. Использование превентивных мероприятий по управлению рисками

Форма контроля: проверка выполнения самостоятельной работы студентов на практическом занятии:

- а. Презентации докладов
- б. Анализ решения задач

Тема 9. Количественный анализ управления рисками

Вопросы для самостоятельного изучения:

1. Организация процедур количественного анализа рисков
2. Параметры рисков
3. Распределение вероятностей рисков и их оценка
4. Матрица «Вероятность и Последствия»
5. Метод сценариев
6. Имитационное моделирование
7. Центральнo-предельная теорема

Задания:

Задача №1. Компания «Palmira» рассматривает возможности осуществить производство продукции по трем проектам. Управление считает, что необходимо оценивать три альтернативы: A1, A2 или A3. увеличения объема производства в гривнах. Успех этих мероприятий зависит в основном от сочетания решений местного законодательства и деятельности конкурентов в этой отрасли. Следует рассматривать четыре возможных вариантов обстановки: позитивная законодательная база и достаточно слабая конкуренция (S1), позитивная законодательная база и достаточно сильная конкуренция (S2), негативная законодательная база и достаточно слабая конкуренция (S3), негативная законодательная база и достаточно сильная конкуренция (S4). В результате этих альтернатив при возможных состояниях внешней среды предполагаются ожидаемые значения прибыли (убытков), представленные в таблице 1.

Таблица 1 - Ожидаемая эффективность постройки дополнительного корпуса

Объем производства, грн.	Варианты обстановки			
	S1	S2	S3	S4
A1 = 80000	24930	197200	197200	197200
A2 = 500000	-80	148900	137800	137800
A3 = 980000	-1140	98400	196800	395600

Задача №2. Цены на металлопродукцию за последние 11 месяцев по статистическим данным составили:

Месяц	1	2	3	4	5	6
Цена, долл./т	300	310	312	309	302	305
Месяц	7	8	9	10	11	
Цена, долл./т	304	300	298	305	304	

Какова вероятность того, что в следующем месяце цена уменьшится по сравнению с ее последним значением?

Задача №3. Имеются два инвестиционных проекта: ИП1 и ИП2 с одинаковой прогнозной суммой требуемых капитальных вложений. Величина планируемого дохода (тыс. руб.) неопределенна и приведена в виде

распределения вероятностей (табл.). Оценить рискованность каждого проекта, используя критерий отбора – «максимизация математического ожидания дохода».

Характеристика проектов по доходам и вероятностям его получения:

Инвестиционный проект ИП1

Доход, тыс. руб.	Вероятность (В)
2500	0,15
3000	0,20
3500	0,35
5000	0,20
6000	0,10

Инвестиционный проект ИП2

Доход, тыс. руб.	Вероятность (В)
1500	0,10
2500	0,15
4000	0,30
5000	0,30
7000	0,15

Задача №4. Рассматриваются два инвестиционных проекта. Первый с вероятностью 0,65 обеспечивает доход в 10 млн руб., однако с вероятностью 0,35 убытки могут составить 6 млн. руб. Для второго проекта с вероятностью 0,7 можно получить доход 8 млн. руб., с вероятностью 0,3 убытки 4 млн. руб. Какой из проектов следует реализовать? Ответ аргументировать.

Задача №5. Компания «XXX» – производитель нефтепродуктов. Один из продуктов поставляется в страны ближнего зарубежья. Необходимо принять решение, какой объем продукции следует производить в течение следующего месяца. Вероятность того, что спрос этот продукт в течение месяца будет 6, 7, 8 или 9 тыс. тонн равны соответственно 0,1; 0,3; 0,5; 0,1 единиц. Затраты на производство одной тонны продукта равны 45 долл. при цене реализации 95 долл. Если партия не реализуется в течение месяца, то товар теряет кондицию, и компания терпит убытки. Какой объём производства продукции следует установить на ближайший месяц с учётом приведённых данных?

Темы докладов:

1. Методы оценки эффективности управления рисками
2. Использование количественных методов анализа и оценки рисков
3. Прогнозирование потерь от реализации рисков: принципы, подходы, методы.
4. Инновационные технологии в управлении рисками
5. Роль субъективных факторов в управлении рисками
6. Правовое обеспечение деятельности по управлению рисками в РФ

Форма контроля: проверка выполнения самостоятельной работы студентов на практическом занятии:

- c. Презентации докладов
- d. Анализ решения задач

Тема 10 Методы реагирования на риски

Вопросы для самостоятельного изучения:

1. Стратегия уклонения от риска
2. Передача и разделение риска
3. Страхование
4. Гарантии выполнения контракта
5. Поручительства и гарантийные обязательства
6. Стратегия снижения риска
7. Стратегия использования риска
8. Стратегия принятия риска
9. Выбор стратегии риска в зависимости от параметров риска

Контрольные вопросы:

- 1) Назовите методы управления проектными рисками и раскройте особенности их применения.
- 2) Назовите методы уклонения от риска.
- 3) Назовите методы локализации и диссипации (рассеивания) риска.
- 4) Назовите методы компенсации риска.
- 5) Дайте характеристику методам финансирования рисков и назовите их.
- 6) Охарактеризуйте стратегии реагирования на негативные риски
- 7) Стратегии реагирования на позитивные риски
- 8) В чем сущность задачи управления рисками проекта?

Темы докладов:

1. Методы реагирования на риск
2. Экологические риски и основные подходы к управлению ими
3. Страхование как инструмент управления рисками
4. Статистические методы оценки рисков: достоинства и недостатки
5. Методы имитационного моделирования в оценке рисков ситуации
6. Риски развития. Лидерство в снижении издержек и дифференциация.
7. Поиск наиболее эффективного пути развития.
8. Стратегические риски. Стратегическая безопасность. Проблемы и
9. перспективы глобализации
10. Картографирование рисков и построение рискового профиля предприятия

Форма контроля: проверка выполнения самостоятельной работы студентов на практическом занятии:

- a. Презентации докладов
- b. Анализ ответов на контрольные вопросы

Тема 11 Мониторинг и контроль рисков

Вопросы для самостоятельного изучения:

1. Методические приемы учета риска при принятии управленческих решений.
2. Выбор управленческих решений с учетом риска.
3. Направления снижения рисков.
4. Финансовый аспект управления рисками.
5. Страхование (хеджирование).
6. Современные тенденции в управлении рисками.

Контрольные вопросы:

- 1) Что необходимо для того, чтобы система мониторинга управления рисками была эффективной?
- 2) Какова структура отчетности при реализации системы управления рисками?
- 3) Какое место отводится контролю в системе управления рисками?
- 4) Что представляет собой страхование?
- 5) В чем фундаментальное отличие между страхованием и хеджированием?
- 6) Назовите ключевые особенности страховых контрактов.
- 7) Назовите преимущества и недостатки страхования рисков.
- 8) Приведите примеры хеджирования финансовых рисков.
- 9) Как осуществляется хеджирование с использованием опционов?
- 10) Как осуществляется хеджирование с использованием фьючерсных контрактов?
- 11) Как осуществляется хеджирование с использованием операции своп?
- 12) Какие ошибки в риск-менеджменте являются типичными?
- 13) К чему приводят ошибки при оценке рисков?
- 14) Назовите основные пути совершенствования системы управления рисками.

Темы докладов:

1. Мониторинг производственных рисков
2. Мониторинг коммерческих рисков
3. Мониторинг кредитных рисков
4. Мониторинг информационных рисков в инновационной деятельности.
5. Мониторинг инвестиционных рисков в инновационной деятельности.

Форма контроля: проверка выполнения самостоятельной работы студентов на практическом занятии:

- a. Презентации докладов
- b. Анализ ответов на контрольные вопросы

Тема 12 Методы снижения проектных рисков

Вопросы для самостоятельного изучения:

1. Диверсификация как метод снижения риска
2. Банковский риск и методы его снижения
3. Передача финансовых и кредитных рисков
4. Передача имущественных и транспортных рисков
5. Передача рисков снабжения и сбыта
6. Страхование как инструмент управления рисками
7. Понятие диссипации риска. Преимущества и недостатки диссипации
8. Инвестиционный риск и методы его снижения
9. Резервирование как метод компенсации риска
10. Картографирование рисков и построение рискового профиля предприятия
11. Источники финансирования риска
12. Разработка программы страхования предприятия
13. Формирование фонда риска в самостраховании. Преимущества и недостатки самострахования.

Контрольные вопросы:

- 1) Возможность воздействия на проект и его элементы неблагоприятных событий, которые могут нанести ущерб или препятствовать достижению целей проекта, представляет:
 - a) риск проекта
 - b) управленческий риск
 - c) кредитный риск
 - d) инновационный риск
- 2) Риск сознательного или вынужденного невыполнения участником своих обязательств в рамках проектной деятельности представляет:
 - a) риск проекта
 - b) риск участников проекта
 - c) управленческий риск
 - d) всё перечисленное верно
- 3) Риски участников проекта могут быть обусловлены рядом причин:
 - a) недобросовестностью участников, их непрофессионализмом
 - b) неустойчивым финансовым положением
 - c) сменой руководства фирмы
 - d) всё перечисленное верно
- 4) Ошибки при проектировании, неспособность подрядчика обеспечить эффективное использование ресурсов, изменение условий реализации проекта являются причиной риска:
 - a) превышения сметной стоимости проекта
 - b) участников проекта

- c) финансирования проекта
 - d) всё перечисленное верно
- 5) Задержки в завершении строительных работ влекут риск (2 ответа верны):
- a) участников проекта
 - b) превышения сметной стоимости проекта
 - c) проекта
 - d) несвоевременного завершения этапов проекта
- 6) Нарушение обязательств подрядчиком (и/или поставщиком), ошибки при проектировании влекут риск:
- a) низкого качества работ и объекта
 - b) участников проекта
 - c) превышения сметной стоимости проекта
 - d) всё перечисленное верно
- 7) Просчеты и ошибки разработчиков проектной (технической) документации, недостаточность или неточность исходной информации, необходимой для разработки этой документации, неапробированность строительных технологий влекут:
- a) конструкционный риск
 - b) риск низкого качества работ и объекта
 - c) риск участников проекта
 - d) риск превышения сметной стоимости проекта
- 8) Риск отклонения в режиме эксплуатации объекта от заданных технико-экономических параметров в результате использования не апробированных технологий считается:
- a) конструкционным
 - b) технологическим
 - c) производственным
 - d) всё перечисленное верно
- 9) Одной из разновидностей производственного риска является:
- a) экологический риск
 - b) конструкционный риск
 - c) риск низкого качества работ и объекта
 - d) риск участников проекта
- 10) Риск возникновения сбоев в производственном процессе считается:
- a) конструкционным
 - b) технологическим
 - c) производственным
 - d) всё перечисленное верно
- 11) Недостаточный уровень квалификации и опыта управленческого персонала порождает:
- a) риск участников проекта
 - b) управленческий риск
 - c) административные риски

- d) всё перечисленное верно
- 12) Риск снижения объемов реализации проектного продукта (товара, услуги) и цен на этот продукт считается:
- a) производственным
 - b) сбытовым
 - c) административным
 - d) управленческим
- 13) К финансовым рискам относятся:
- a) кредитный риск
 - b) риск изменения процентной ставки
 - c) валютный риск
 - d) всё перечисленное верно
- 14) Экономические и политические действия центральных и местных властей, войны, забастовки, социальные волнения, революции, террористические акты являются факторами:
- a) юридического риска
 - b) административного риска
 - c) странового риска
 - d) всё перечисленное верно
- 15) Процесс получения проектной компанией и другими участниками проектной деятельности различных лицензий и иной разрешительной документации от государственных регулирующих и надзорных ведомств порождает:
- a) юридические риски
 - b) административные риски
 - c) страновой риск
 - d) управленческий риск
- 16) Любые риски, затрудняющие реализацию проекта вследствие несовершенства законодательства, частой сменяемости законов, низкого качества юридических документов и недостатков судебно-арбитражных механизмов относятся к:
- a) управленческим рискам
 - b) административным рискам
 - c) юридическим рискам
 - d) всё перечисленное верно
- 17) Риск непреодолимой силы, включая стихийные бедствия, забастовки, восстания и революции считается риском:
- a) форс-мажорных обстоятельств
 - b) страновым
 - c) административным
 - d) экологическим

Темы докладов:

1. Диверсификация или распределение рисков
2. Резервирование средств на покрытие непредвиденных расходов

3. Страхование рисков
4. Диссипация риска: преимущества и недостатки
5. Передача риска: преимущества и недостатки

Форма контроля: проверка выполнения самостоятельной работы студентов на практическом занятии:

- a. Презентации докладов
- b. Анализ ответов на контрольные вопросы

Тема 13 Определение стратегии управления рисками

Вопросы для самостоятельного изучения:

1. Управление внутренним кредитным риском в российских банках.
2. Управление рисками инновационной деятельности.
3. Валютный риск и его разновидности.
4. Управление риском средствами внутреннего аудита.
5. Экономическая безопасность компании.
6. Правовой и психологический элементы управления предпринимательскими рисками.
7. Факторы, влияющие на восприятие риска людьми.
8. Ответственность и риск.
9. Проблемы формирования рисковозного сознания.
10. Предпринимательские риски в условиях современного этапа развития рыночных отношений.
11. Взаимосвязь финансового риска банкротства и другими видами риска.
12. Международные риски.
13. Оценка риска инвестирования с учетом специфики предприятия и региональных особенностей.
14. Национальные риски.
15. Локальные риски.
16. Управление инвестиционной деятельностью в условиях неопределенности и рисков.
17. Взаимосвязь риска и неопределенности.
18. Механизмы и способы преодоления неопределенности.
19. Неопределенность и социальный прогресс.
20. Социальные аспекты неопределенности и прибыли.
21. Коммерческая тайна в защите внутренней среды предпринимательства.

Контрольные вопросы:

- 1) Способы управления процентным риском, используемые при ожидании снижения достаточно высоких процентных ставок:
 - a) сокращение доли кредитов с фиксированной ставкой
 - b) сокращение сроков погашения заемных средств
 - c) увеличение доли кредитов с фиксированной ставкой

- d) увеличение сроков погашения заемных средств
- 2) Способы управления процентным риском, используемые при росте процентных ставок и ожидании достижения ими максимума:
- a) начать сокращение сроков заемных средств
 - b) начать удлинение сроков инвестиций
 - c) начать сокращение сроков инвестиций
 - d) начать удлинение сроков заемных средств
- 3) Способы управления процентным риском, используемые при снижении процентных ставок и ожидании достижения ими минимума:
- a) начать удлинение сроков инвестиций
 - b) начать удлинение сроков заемных средств
 - c) начать сокращение сроков инвестиций
 - d) начать сокращение сроков заемных средств
- 4) Способы управления процентным риском, используемые при росте процентных ставок и ожидании достижения ими максимума:
- a) начать подготовку к увеличению доли кредитов с фиксированной ставкой
 - b) рассмотреть возможность получения долгосрочных займов с фиксированной ставкой
 - c) начать подготовку к снижению доли кредитов с фиксированной ставкой
 - d) рассмотреть возможность досрочного погашения займов с фиксированной ставкой
- 5) Способы управления процентным риском, используемые при ожидании роста достаточно низких процентных ставок:
- a) увеличить долю кредитов с фиксированной ставкой
 - b) сократить долю кредитов с фиксированной ставкой
 - c) увеличить сроки заемных средств
 - d) сократить сроки заемных средств
- 6) Величиной кредитного риска является:
- a) сумма кредита с учетом процентов
 - b) сумма процентов по кредиту
 - c) сумма кредита по договору
 - d) всё перечисленное верно
- 7) Периодом подверженности кредитному риску называется:
- a) период с момента выдачи кредита до погашения суммы основного долга и процентов по кредиту
 - b) период деятельности кредитной организации до подписания кредитного договора
 - c) период с момента выдачи кредита до погашения суммы основного долга
 - d) всё перечисленное верно
- 8) Коэффициент автономности показывает
- a) отношение оборотных средств к собственному капиталу компании
 - b) отношение постоянных затрат к валовым затратам

- c) отношение заемных средств к собственному капиталу компании
 - d) всё перечисленное верно
- 9) К методам управления кредитным риском на уровне кредитного портфеля относятся:
- a) структуризация ссуды
 - b) лимитирование
 - c) диверсификация
 - d) контроль за состоянием залога
 - e) анализ кредитоспособности заемщика
 - f) создание системы резервов
- 10) К методам управления кредитным риском на уровне отдельной ссуды относятся:
- a) создание системы резервов
 - b) контроль за состоянием залога
 - c) структуризация ссуды
 - d) диверсификация
 - e) анализ кредитоспособности заемщика
- 11) Основными признаками инвестиционной деятельности являются:
- a) практическое освоение новшеств
 - b) неопределенность результатов
 - c) необратимость
 - d) ожидание увеличения исходного уровня благосостояния
- 12) К рискам, присущим эксплуатационному этапу инвестиционной деятельности, относятся:
- a) финансовые риски
 - b) экологические риски
 - c) риск неверного прогнозирования
 - d) производственные риски
- 13) К рискам, присущим завершающему этапу инвестиционной деятельности, относятся:
- a) риск финансирования ликвидационных работ
 - b) риск неверного прогнозирования
 - c) риски возникновения гражданской ответственности
 - d) производственные риски
- 14) К рискам прединвестиционного этапа инвестиционной деятельности можно отнести:
- a) экологические риски
 - b) риски ошибочной оценки эффективности
 - c) риск неверного прогнозирования будущих изменений
 - d) финансовые риски
- 15) К рискам, присущим собственно инвестиционному этапу инвестиционной деятельности, относят:
- a) производственные риски
 - b) риск превышения сметной стоимости проекта
 - c) риск неверного прогнозирования будущих изменений

d) риск задержки сдачи объекта

16) Стратегическое поведение характерное для крупных компаний, осуществляющих массовое производство, выходящих на массовый рынок со своей или приобретенной новой продукцией, опережающих конкурентов за счет серийности производства и эффекта масштаба, называется:

- a) коммутантным
- b) виолентным
- c) пациентным
- d) эксплерентным

17) Стратегическое поведение, заключающееся в приспособлении к узким сегментам широкого рынка путем специализированного выпуска новой или модернизированной продукции с уникальными характеристикам, называется:

- a) виолентным
- b) пациентным
- c) коммутантным
- d) эксплерентным

18) Стратегическое поведение, означающее выход на рынок с новым (радикально инновационным) продуктом и захватом части рынка, называется:

- a) эксплерентным
- b) коммутантным
- c) виолентным
- d) пациентным

19) Стратегическое поведение, состоящее в приспособлении к условиям спроса местного рынка, освоении новых видов услуг после появления новых продуктов и новых технологий, имитации новинок и продвижении их к самым широким слоям потребителей, называется:

- a) пациентным
- b) виолентным
- c) коммутантным
- d) эксплерентным

Темы докладов:

1. Картографирование рисков и построение рискового профиля
2. предприятия
3. Оценка эффективности управления предпринимательским риском
4. риском
5. Диагностика финансового кризиса предприятия. Анализ рисков при
6. угрозе банкротства
7. Организация системы риск-менеджмента на предприятии
8. Методы управления финансовыми рисками. Исследование факторов, влияющих на уровень финансовых рисков организации. Выбор механизмов нейтрализации финансовых рисков.

9. Методы управления финансовыми рисками. Исследование факторов, влияющих на уровень финансовых рисков организации. Выбор механизмов нейтрализации финансовых рисков.

Форма контроля: проверка выполнения самостоятельной работы студентов на практическом занятии:

- a. Презентации докладов
- b. Анализ ответов на контрольные вопросы

Тема 14 Особенности управления проектными рисками коммерческих предприятий

Вопросы для самостоятельного изучения:

1. Понятие и задачи регламента управления рисками
2. Рисксовая политика предприятия
3. Принципы построения системы управления рисками
4. Понятие и оценка потенциала эффективности предприятия
5. Оценка ценового риска предприятия
6. Предпосылки возникновения кредитного риска предприятия
7. Основные методы минимизации кредитного риска предприятия
8. Понятие и значение операционного риска предприятия. Виды и особенности операционных рисков предприятия
9. Методы оценки и управления операционными рисками предприятия
10. Применение сетевых моделей при оценке и управлении операционным риском. График сетевой модели.
11. Налоговые риски предприятия: внутренний и внешний налоговый риск
12. Методы оценки и управления налоговыми рисками предприятия

Задания:

Задача №1. Известны рентабельность продаж, оборачиваемость запасов и выручка четырех предприятий. Необходимо ранжировать эти предприятия методом суммы мест.

Таблица 14.1 - Исходные данные

Показатели	Предприятия			
	А	В	С	Д
Рентабельность продаж, %	28	31	32	29
Оборачиваемость запасов, дней	9	7	8	10
Выручка, млн. руб.	150	170	160	140

Задача №2. На основании данных таблицы 14.2

1. Определить показатель чистой текущей стоимости проектных денежных потоков.
2. Рассчитайте NPV, если за счет приобретения более прогрессивного оборудования (по сравнению с первоначальным вариантом инвестирования

инвестиционные затраты в части расходов по приобретению основных фондов увеличатся на 390 тыс. руб.) удастся снизить переменные издержки до 0,38 тыс. рублей за единицу продукции.

3. Графически и расчетным путем найдите точку безубыточности по двум альтернативным вариантам инвестирования (на основе NPV - критерия).

4. В аналитическом заключении охарактеризуйте уровень проектного риска каждого варианта капиталовложений.

Для определения величины денежного потока используйте следующую последовательность расчета искомого показателя:

величина чистой прибыли + объем амортизации + посленалоговый денежный поток от реализации имущества и погашения обязательств в конце срока реализации проекта - единовременные инвестиционные затраты.

Таблица 14.2 - Исходные данные

Показатели	Значение показателя
Объем продаж за год (шт.)	4000
Цена единицы продукции (тыс. руб.)	0,55
Переменные издержки на производство единицы продукции (тыс. руб.)	0,4
Годовые постоянные затраты без учета амортизации основных фондов (тыс. руб.)	120,8
Годовая ставка амортизации основных фондов с использованием прямолинейного метода ее начисления (%)	7
Начальные инвестиционные затраты, (тыс. руб.); в том числе в основные фонды	1560,0; 1120,0
Срок реализации проекта (лет)	10
Проектная дисконтная ставка (%)	10
Ставка налога на прибыль (%)	20
Посленалоговый денежный поток от реализации имущества и погашения обязательств в конце срока реализации проекта (тыс. руб.)	+ 205,0

Задача №3. Организация планирует приобрести технологическое оборудование, необходимое для производства новой продукции. На основании материалов, представленных производственными, техническими и экономическими службами компании (таблица 14.3) собраны данные, характеризующие уровень производства и реализации продукции по двум альтернативным вариантам инвестирования. С использованием данных таблицы 14.3:

1. Найдите точку безубыточности для каждого альтернативного варианта инвестирования и объем продаж, при котором рассматриваемые варианты инвестирования будут одинаково прибыльными (убыточными).

2. Постройте график безубыточности одновременно для двух вариантов приобретения оборудования.

3. Определите рентабельность инвестиции как отношение прибыли к инвестиционным затратам, исходя из следующих возможных параметров изменения спроса на выпускаемую продукцию: по оптимистическим оценкам объем продаж составит 150 % от точки безубыточности (вероятность - 0,25); ожидаемый объем продаж планируется на 20 % больше точки

безубыточности (вероятность - 0,5); по пессимистическим оценкам объем продаж будет на 10 % ниже точки безубыточности (вероятность - 0,25). 19

4. Рассчитайте стандартное отклонение и коэффициент вариации показателя рентабельности инвестиций по каждому варианту инвестирования.

5. В аналитическом заключении обоснуйте выбор наиболее безопасного варианта долгосрочных инвестиций.

Таблица 14.3 - Исходные данные

Показатель	Значения показателя	
	Вариант 1	Вариант 2
Годовые постоянные затраты (руб.)	200000	10000
Переменные затраты на единицу продукции (руб.)	10	6
Цена единицы продукции (руб.)	16	16
Капитальные затраты - инвестиции (руб.)	1200000	1400000

Задача №4. На основании данных таблицы 14.4:

1. Рассчитать показатель чистой текущей стоимости проектных денежных потоков.

2. Определите для полученного значения NPV и при неизменной величине денежного потока отрегулированную по уровню проектного риска дисконтную ставку.

Таблица 14.4 - Исходные данные

Показатели	Значение показателя в t-м году		
	0	1	2
Начальные инвестиционные затраты (тыс. руб.)	- 145000	-	-
Денежный поток (тыс. руб.)	X	108500	126000
Коэффициенты определенности (значение коэффициента)	1,0	0,9	0,8
Проектная дисконтная ставка (%)	X	10	10

Задача №5. На основании данных таблицы 14.5:

1. Рассчитайте коэффициенты вариации по каждому году реализации инвестиционного проекта.

2. Определите для каждого года коэффициент определенности (**at**), если известно, что на каждые 10 % коэффициента вариации **at** будет снижаться на 0,1.

3. Рассчитайте с использованием метода коэффициентов определенности показатель NPV при условии, если безрисковая дисконтная ставка равна 6 %.

4. По результатам анализа составьте письменное заключение.

Таблица 14.5 - Исходные данные

Величина денежного потока	Года и вероятности получения денежного потока			
	I=0	I=1	I=2	I=3
Пессимистическое значение	-90500	+ 42 000 (0,005)	+ 42 000 (0,3)	+ 48 200 (0,4)
Запланированное значение	-90500	+ 60 000 (0,9)	+ 75 000 (0,6)	+ 124 000 (0,5)
Оптимистическое значение	-90500	+ 75 000 (0,005)	+ 90 000 (0,1)	+ 137 500 (0,1)

Темы докладов:

1. Операционные риски: идентификация и оценка. Выбор критерия управления операционными рисками
2. Рыночные риски. Методы оценки и инструменты регулирования
3. Риски ликвидности. Анализ денежных потоков организации как метод управления рисками ликвидности. Пути повышения ликвидности и платежеспособности организации
4. Риски развития. Лидерство в снижении издержек и дифференциация. Поиск наиболее эффективного пути развития
5. Инвестиционные риски: оценка и управление рисками инвестиционного проекта
6. Инвестиционные риски: формирование инвестиционного портфеля с учетом риска
7. Стратегические риски. Стратегическая безопасность. Проблемы и перспективы глобализации
8. Методы управления риском: общая схема процесса управления риском. Выбор методов управления риском на основе оценки их сравнительной эффективности
9. Методы управления риском: диверсификация. Анализ существующих подходов к размещению капитала по направлениям деятельности
10. Методы нейтрализации рисков. Рынок форвардов в России. Хеджирование на основе инструментов FORTS.

Форма контроля: проверка выполнения самостоятельной работы студентов на практическом занятии:

- а. Презентации докладов
- б. Анализ решения задач

10. Перечень учебно–методического обеспечения для самостоятельной работы обучающихся по дисциплине (модулю)

Самостоятельная работа студентов предполагает тщательное освоение учебной и научной литературы по изучаемой дисциплине.

При изучении основной рекомендуемой литературы студентам необходимо обратить внимание на выделение основных понятий, их определения, научно-технические основы, узловые положения, представленные в изучаемом тексте.

При самостоятельной работе студентов с дополнительной литературой необходимо выделить аспект изучаемой темы (что в данном материале относится непосредственно к изучаемой теме и основным вопросам).

Дополнительную литературу целесообразно прорабатывать после основной, которая формирует базис для последующего более глубокого изучения темы. Дополнительную литературу следует изучать комплексно, рассматривая разные стороны изучаемого вопроса. Обязательным элементом

самостоятельной работы студентов с литературой является ведение необходимых записей: конспекта, выписки, тезисов, планов.

Для самостоятельной работы обучающихся по дисциплине используются следующее учебно-методическое обеспечение:

а) основная литература:

1. Управление рисками предприятия : учебное пособие / В.Н. Уродовских. — М. : Вузовский учебник, ИНФРА-М, 2017. — 168 с. - Режим доступа: <http://znanium.com/catalog/product/615086>

б) дополнительная литература:

1. Управление рисками организации: Учебное пособие / Г.Д. Антонов, О.П. Иванова, В.М. Тумин. - М.: НИЦ ИНФРА-М, 2015. - 153 с. - Режим доступа: <http://znanium.com/catalog/product/475625>

2. Управление рисками в инновационно-инвестиционной деятельности предприятия / Балдин К.В., Передеряев И.И., Голов Р.С., - 3-е изд. - М.: Дашков и К, 2017. - 418 с. - Режим доступа: <http://znanium.com/catalog/product/415224>

11. Перечень основной и дополнительной учебной литературы, необходимой для освоения дисциплины (модуля)

а) нормативные документы:

1. Национальный стандарт Российской Федерации. Менеджмент рисков: Руководство по надлежащей практике менеджмента рисков проектов: <http://docs.cntd.ru/document/1200118641>

2. Об уполномоченном органе Российской Федерации по осуществлению государственного контроля (надзора) за соблюдением требований технического регламента Таможенного союза "О безопасности мебельной продукции". Постановление Правительства РФ от 15 августа 2014 года №812

3. Об уполномоченных органах Российской Федерации по осуществлению государственного контроля (надзора) за соблюдением требований технического регламента Таможенного союза "О безопасности пищевой продукции". Постановление Правительства РФ от 28 августа 2013 года №745

4. Об утверждении Положения о регистрации деклараций о соответствии продукции требованиям технических регламентов Таможенного союза Решение Коллегии ЕЭК от 09 апреля 2013 года №76

5. Об утверждении единой формы сертификата на тип продукции, отвечающей требованиям технического регламента Таможенного союза "О безопасности машин и оборудования" (ТР ТС 010/2011), и правил его оформления (с изменениями на 15 ноября 2016 года). Решение Коллегии ЕЭК от 09 апреля 2013 года №75

6. О единых формах сертификата соответствия и декларации о соответствии требованиям технических регламентов Евразийского экономического союза и правилах их оформления (с изменениями на 15

ноября 2016 года). Решение Коллегии ЕЭК от 25 декабря 2012 года №293

7. Гражданский кодекс Российской Федерации (часть первая) от 30.11.1994 N 51-ФЗ (ред. от 06.04.2015). – [Электронный ресурс]. - Режим доступа: Консультант Плюс.

8. Гражданский кодекс Российской Федерации (часть вторая) от 26.01.1996 N 14-ФЗ (ред. от 06.04.2015, с изм. От 07.04.2015. – [Электронный ресурс]. - Режим доступа: Консультант Плюс.

9. ISO 21500-2012. Руководство по менеджменту проектов Международной организации по стандартизации (Guidance on project management). – Режим доступа: СПС Консультант Плюс.

10. ГОСТ Р ИСО 10006-2005. Системы менеджмента качества. Руководящие указания по менеджменту качества при проектировании. – – Режим доступа: СПС Консультант Плюс.

11. ГОСТ Р 54869-2011. Проектный менеджмент. Требования к управлению проектом. – Режим доступа: СПС Консультант Плюс.

12. ГОСТ Р 54870-2011. Проектный менеджмент. Требования к управлению портфелем проектов. – Режим доступа: СПС Консультант Плюс.

13. ГОСТ Р 54871-2011. Проектный менеджмент. Требования к управлению программой. – Режим доступа: СПС Консультант Плюс.

б) основная литература:

1. Управление рисками предприятия : учебное пособие / В.Н. Уродовских. — М. : Вузовский учебник, ИНФРА-М, 2017. — 168 с. - Режим доступа: <http://znanium.com/catalog/product/615086>

в) дополнительная литература:

1. Управление рисками организации: Учебное пособие / Г.Д. Антонов, О.П. Иванова, В.М. Тумин. - М.: НИЦ ИНФРА-М, 2015. - 153 с. - Режим доступа: <http://znanium.com/catalog/product/475625>

2. Управление рисками в инновационно-инвестиционной деятельности предприятия / Балдин К.В., Передеряев И.И., Голов Р.С., - 3-е изд. - М.: Дашков и К, 2017. - 418 с. - Режим доступа: <http://znanium.com/catalog/product/415224>

12. Перечень ресурсов информационно-телекоммуникационной сети «Интернет», необходимых для освоения дисциплины (модуля)

- <https://www.book.ru/> - ЭБС Book.ru
- <http://www.iprbookshop.ru> - ЭБС IPRbooks
- <https://ibooks.ru/> -ЭБС Айбукс.ru/ibooks.ru
- <https://rucont.ru/> - ЭБС «Национальный цифровой ресурс «Руконт»
- <http://znanium.com/> - ЭБС Znanium.com
- <https://dlib.eastview.com/>- База данных East View

13. Перечень информационных технологий, используемых при осуществлении образовательного процесса по дисциплине (модулю), включая перечень программного обеспечения и информационно-справочных систем (при необходимости)

1. Desktop School ALNG LicSAPk MVL.
 - a. Office ProPlus All Lng Lic/SA Pack MVL Partners in Learning (лицензия на пакет Office Professional Plus)
 - b. Windows 8
2. Консультант + версия проф.- справочная правовая система
3. Система тестирования INDIGO.
4. Adobe Acrobat – свободно-распространяемое ПО
5. Интернет-браузеры Google Chrome, Firefox – свободно-распространяемое ПО

Каждый обучающийся в течение всего обучения обеспечивается индивидуальным неограниченным доступом электронно-библиотечной системе и электронной информационно-образовательной среде.

14. Описание материально–технической базы, необходимой для осуществления образовательного процесса по дисциплине (модулю)

Образовательный процесс обеспечивается специальными помещениями, которые представляют собой аудитории для проведения занятий лекционного типа, занятий семинарского типа, групповых и индивидуальных консультаций, текущего контроля и промежуточной аттестации, помещения для самостоятельной работы студентов и помещения для хранения и профилактического обслуживания учебного оборудования.

Специальные помещения соответствуют действующим противопожарным правилам и нормам, укомплектованы специализированной мебелью.

Аудитории лекционного типа, оснащенные проекционным оборудованием и техническими средствами обучения, обеспечивающими представление учебной информации большой аудитории, демонстрационным оборудованием.

Помещения для самостоятельной работы обучающихся оснащены компьютерной техникой, обеспечивающей доступ к сети Интернет и электронной информационно-образовательной среде университета.

15. Методические указания для обучающихся по освоению дисциплины (модуля)

Дисциплина «Управление проектными рисками» состоит из 14 тем и изучается на лекциях, практических занятиях и при самостоятельной работе обучающихся. Обучающийся для полного освоения материала должен не

пропускать занятия и активно участвовать в учебном процессе. Кроме того, обучающиеся должны ознакомиться с программой дисциплины и списком основной и дополнительной рекомендуемой литературы.

Основной теоретический материал дается на лекционных занятиях. Лекции включают все темы и основные вопросы дисциплины. Для максимальной эффективности изучения необходимо постоянно вести конспект лекций, знать рекомендуемую преподавателем основную и дополнительную учебную литературу, позволяющую дополнить знания и лучше подготовиться к практическим занятиям.

Для закрепления теоретического материала, формирования профессиональных компетенций и практических навыков со студентами проводятся практические занятия. В ходе практических занятий разбираются основные и дополнительные теоретические вопросы Отечественной и мировой истории.

На изучение каждой темы выделено в соответствии с рабочей программой дисциплины количество часов практических занятий, которые проводятся в соответствии с вопросами, рекомендованными к изучению по определенным темам. Обучающиеся должны регулярно готовиться к практическим занятиям. При подготовке к занятиям следует руководствоваться конспектом лекций и рекомендованной литературой.

Для эффективного освоения материала дисциплины учебным планом предусмотрена самостоятельная работа, которая должна выполняться в обязательном порядке. Выполнение самостоятельной работы по темам дисциплины, позволяет регулярно проводить самооценку качества усвоения материалов дисциплины и выявлять аспекты, требующие более детального изучения. Задания для самостоятельной работы предложены по каждой из изучаемых тем и должны готовиться индивидуально и к указанному сроку. По необходимости студент-специалист может обращаться за консультацией к преподавателю. Выполнение заданий контролируется и оценивается преподавателем.

В случае посещения обучающегося лекций и практических занятий, изучения рекомендованной основной и дополнительной учебной литературы, а также своевременного и самостоятельного выполнения заданий, подготовка к зачету с оценкой по дисциплине сводится к дальнейшей систематизации полученных знаний, умений и навыков.

16. Методические рекомендации по организации изучения дисциплины для преподавателей, образовательные технологии

Оценочные средства для контроля успеваемости и результатов освоения дисциплины (модуля):

- а) для текущей успеваемости: опрос, реферат;
- б) для самоконтроля обучающихся: тесты;
- в) для промежуточной аттестации: вопросы для зачета с оценкой, практические задания (задачи).

При реализации различных видов учебной работы по дисциплине «Управление проектными рисками» используются следующие образовательные технологии:

- 1) лекции с использованием методов проблемного изложения материала;
- 2) анализ деловых ситуаций на основе кейс-метода;
- 3) решение ситуационных задач
- 4) обсуждение подготовленных студентами презентаций (дискуссия, круглый стол);
- 5) деловые и ролевые игры.

№	Занятие в интерактивной форме	Количество часов по очной форме		Количество часов по заочной форме	
		Лекция	Практич.	Лекция	Практич.
1	Риск и неопределенность в проектировании Виды: Лекция с демонстрацией видеоматериалов (слайды)	1			
2	Планирование управления рисками Виды: Лекция с демонстрацией видеоматериалов (слайды) Практические занятия с применением следующих технологий: - обсуждение в группе (обсуждение подготовленных студентами вопросов для самостоятельного изучения)		2	2	
3	Мониторинг и контроль рисков Виды: Практические занятия с применением следующих технологий: - обсуждение в группе (обсуждение подготовленных студентами вопросов для самостоятельного изучения)		2		
4	Методы снижения проектных рисков Виды: Лекция с демонстрацией видеоматериалов (слайды) Практические занятия с применением следующих технологий: - обсуждение в группе (обсуждение подготовленных студентами вопросов для самостоятельного изучения)	2			2
5	Определение стратегии управления риска Виды: Практические занятия с применением следующих технологий: - обсуждение в группе (обсуждение подготовленных студентами вопросов для самостоятельного изучения)		2		
6	Особенности управления проектными рисками коммерческих предприятий Виды: Лекция с демонстрацией видеоматериалов (слайды)	2			
	Итого:	6	6	2	2

**АВТОНОМНАЯ НЕКОММЕРЧЕСКАЯ ОБРАЗОВАТЕЛЬНАЯ
ОРГАНИЗАЦИЯ ВЫСШЕГО ОБРАЗОВАНИЯ
ЦЕНТРОСОЮЗА РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ
«РОССИЙСКИЙ УНИВЕРСИТЕТ КООПЕРАЦИИ»
КАЗАНСКИЙ КООПЕРАТИВНЫЙ ИНСТИТУТ (ФИЛИАЛ)**

**ФОНД ОЦЕНОЧНЫХ СРЕДСТВ ДЛЯ ПРОВЕДЕНИЯ
ПРОМЕЖУТОЧНОЙ АТТЕСТАЦИИ ОБУЧАЮЩИХСЯ ПО
ДИСЦИПЛИНЕ (МОДУЛЮ)**

УПРАВЛЕНИЕ ПРОЕКТНЫМИ РИСКАМИ

Направление подготовки: 38.03.02 Менеджмент
Направленность: «Управление проектами»

1. Паспорт фонда оценочных средств

1. 1. Компетенции, формируемые в процессе изучения дисциплины

Индекс	Формулировка компетенции
ПК-9	способностью оценивать воздействие макроэкономической среды на функционирование организаций и органов государственного и муниципального управления, выявлять и анализировать рыночные и специфические риски; а также анализировать поведение потребителей экономических благ и формирование спроса на основе знания экономических основ поведения организаций, структур рынков и конкурентной среды отрасли
ПК-15	умением проводить анализ рыночных и специфических рисков для принятия управленческих решений, в том числе, при принятии решений об инвестировании и финансировании

1.2. Сведения об иных дисциплинах (преподаваемых, в том числе, на других кафедрах) участвующих в формировании данных компетенций

1.2.1. Компетенция ПК-9 формируется в процессе изучения дисциплин (прохождения практик):

Методы управления рисками
Идентификация и анализ рисков проектов в области ИТ
Производственная практика. Практика по получению профессиональных умений и опыта профессиональной деятельности

1.2.2. Компетенция ПК-15 формируется в процессе изучения дисциплин (прохождения практик):

Технико-экономическое обоснование проекта
Производственная практика. Практика по получению профессиональных умений и опыта профессиональной деятельности
Производственная практика. Преддипломная практика

1.3. Этапы формирования и программа оценивания контролируемой компетенции

№ п/п	Код контролируемой компетенции (или ее части)	Контролируемые модули, разделы (темы) дисциплины	Наименование оценочного средства
1 2	ПК-9 ПК-15	1. Риск-менеджмент как управленческая технология 2. Риск и неопределенность в проектировании 3. Классификация проектных рисков 4. Анализ и расстановка приоритетов рисков 5. Планирование управления рисками 6. Система управления рисками 7. Идентификация рисков 8. Качественный анализ рисков 9. Количественный анализ рисков 10. Методы реагирования на риски	Деловая игра Кейс-задания Коллоквиум Контрольная работа Круглый стол Задачи Рефераты Тесты

№ п/п	Код контролируемой компетенции (или ее части)	Контролируемые модули, разделы (темы) дисциплины	Наименование оценочного средства
		11. Мониторинг и контроль рисков 12. Методы снижения проектных рисков 13. Определение стратегии управления рисками 14. Особенности управления проектными рисками коммерческих предприятий	

Процедура оценивания

1. Процедура оценивания результатов освоения программы учебной дисциплины включает в себя оценку уровня сформированности компетенций студента при осуществлении текущего контроля и проведении промежуточной аттестации.

2. Уровень сформированности компетенции определяется по качеству выполненной студентом работы и отражается в следующих формулировках: высокий, хороший, достаточный, недостаточный.

3. При выполнении студентами заданий текущего контроля и промежуточной аттестации оценивается уровень обученности «знать», «уметь», «владеть» в соответствии с запланированными результатами обучения и содержанием рабочей программы дисциплины:

– профессиональные знания студента могут проверяться при ответе на теоретические вопросы, выполнении тестовых заданий, практических работ,

– степень владения профессиональными умениями – при решении ситуационных задач, выполнении практических работ и других заданий.

4. Результаты выполнения заданий фиксируются в баллах в соответствии с показателями и критериями оценивания компетенций. Общее количество баллов складывается из:

– суммы баллов за выполнение практических заданий на выявление уровня обученности «уметь»;

– суммы баллов за выполнение практических заданий на выявление уровня обученности «владеть»;

– суммы баллов за ответы на теоретические и дополнительные вопросы.

5. По итогам текущего контроля и промежуточной аттестации в соответствии с показателями и критериями оценивания компетенций определяется уровень сформированности компетенций студента и выставляется оценка по шкале оценивания.

1.4. Показатели и критерии оценивания компетенций, шкала оценивания

Компетенции	Показатели оценивания	Критерии оценивания компетенций				Итого:
		Высокий (верно и в полном объеме) - 5 б.	Средний (с незначительными замечаниями) - 4 б.	Низкий (на базовом уровне, с ошибками) - 3 б.	Недостаточный (содержит большое количество ошибок, ответ не дан) – 0,5 б.	
<i>Теоретические показатели</i>						
ПК-9 ПК-15	Знает понятие проектных рисков и их классификацию; методы качественного и количественного анализа проектных рисков. (задачи)	Верно и в полном объеме знает понятие проектных рисков и их классификацию; методы качественного и количественного анализа проектных рисков.	С незначительными замечаниями знает понятие проектных рисков и их классификацию; методы качественного и количественного анализа проектных рисков.	На базовом уровне, с ошибками знает понятие проектных рисков и их классификацию; методы качественного и количественного анализа проектных рисков.	Не знает понятие проектных рисков и их классификацию; методы качественного и количественного анализа проектных рисков.	20
	Знает методы снижения проектных рисков; особенности управления проектными рисками на промышленных предприятиях. (рефераты)	Верно и в полном объеме знает методы снижения проектных рисков; особенности управления проектными рисками на промышленных предприятиях	С незначительными замечаниями знает методы снижения проектных рисков; особенности управления проектными рисками на промышленных предприятиях	На базовом уровне, с ошибками знает методы снижения проектных рисков; особенности управления проектными рисками на промышленных предприятиях	Не знает методы снижения проектных рисков; особенности управления проектными рисками на промышленных предприятиях	
	Знает методы оценки финансово-экономической эффективности проектов с учетом неопределенности. (тесты)	Верно и в полном объеме знает методы оценки финансово-экономической эффективности проектов с учетом неопределенности.	С незначительными замечаниями знает методы оценки финансово-экономической эффективности проектов с учетом неопределенности.	На базовом уровне, с ошибками знает методы оценки финансово-экономической эффективности проектов с учетом неопределенности.	Не знает методы оценки финансово-экономической эффективности проектов с учетом неопределенности.	
	Знает методы планирования проекта, в том числе с учетом неопределенности. (тесты)	Верно и в полном объеме знает методы планирования проекта, в том числе с учетом неопределенности.	С незначительными замечаниями знает методы планирования проекта, в том числе с учетом неопределенности.	На базовом уровне, с ошибками знает методы планирования проекта, в том числе с учетом неопределенности.	Не знает методы планирования проекта, в том числе с учетом неопределенности.	
<i>Практические показатели</i>						
ПК-9 ПК-15	Умеет различать понятия неопределенность и риск, классифицировать риски; проводить выявление, анализ и оценку рисков проекта (деловая игра)	Верно и в полном объеме может различать понятия неопределенность и риск, классифицировать риски; проводить выявление, анализ и оценку рисков проекта	С незначительными замечаниями может различать понятия неопределенность и риск, классифицировать риски; проводить выявление, анализ и оценку рисков проекта	На базовом уровне, с ошибками может различать понятия неопределенность и риск, классифицировать риски; проводить выявление, анализ и оценку рисков проекта	Не может различать понятия неопределенность и риск, классифицировать риски; проводить выявление, анализ и оценку рисков проекта	20

Компетенции	Показатели оценивания	Критерии оценивания компетенций				Итого:
		Высокий (верно и в полном объеме) - 5 б.	Средний (с незначительными замечаниями) - 4 б.	Низкий (на базовом уровне, с ошибками) - 3 б.	Недостаточный (содержит большое количество ошибок, ответ не дан) – 0,5 б.	
	Умеет проводить планирование антирисковых мероприятий; осуществлять мониторинг и контроль рисков проекта (кейс)	Верно и в полном объеме может проводить планирование антирисковых мероприятий; осуществлять мониторинг и контроль рисков проекта	С незначительными замечаниями может проводить планирование антирисковых мероприятий; осуществлять мониторинг и контроль рисков проекта	На базовом уровне, с ошибками может проводить планирование антирисковых мероприятий; осуществлять мониторинг и контроль рисков проекта	Не может проводить планирование антирисковых мероприятий; осуществлять мониторинг и контроль рисков проекта	
	Умеет выявлять, анализировать и оценивать проектные риски; проводить планирование антирисковых мероприятий. (круглый стол)	Верно и в полном объеме может выявлять, анализировать и оценивать проектные риски; проводить планирование антирисковых мероприятий.	С незначительными замечаниями может выявлять, анализировать и оценивать проектные риски; проводить планирование антирисковых мероприятий.	На базовом уровне, с ошибками может выявлять, анализировать и оценивать проектные риски; проводить планирование антирисковых мероприятий.	Не может выявлять, анализировать и оценивать проектные риски; проводить планирование антирисковых мероприятий.	
	Умеет принимать решения в условиях неопределенности и риска, прогнозируя их последствия для проекта и организации. (задачи, тесты)	Верно и в полном объеме может принимать решения в условиях неопределенности и риска, прогнозируя их последствия для проекта и организации.	С незначительными замечаниями может принимать решения в условиях неопределенности и риска, прогнозируя их последствия для проекта и организации.	На базовом уровне, с ошибками может принимать решения в условиях неопределенности и риска, прогнозируя их последствия для проекта и организации.	Не может принимать решения в условиях неопределенности и риска, прогнозируя их последствия для проекта и организации.	
<i>Владеет</i>						
ПК-9 ПК-15	Владеет понятийным аппаратом управления рисками; методами качественного и количественного анализа проектных рисков; процедурами реагирования на риски. (деловая игра, коллоквиум, тесты)	Верно и в полном объеме владеет понятийным аппаратом управления рисками; методами качественного и количественного анализа проектных рисков; процедурами реагирования на риски.	С незначительными замечаниями владеет понятийным аппаратом управления рисками; методами качественного и количественного анализа проектных рисков; процедурами реагирования на риски.	На базовом уровне, с ошибками владеет понятийным аппаратом управления рисками; методами качественного и количественного анализа проектных рисков; процедурами реагирования на риски.	Не владеет понятийным аппаратом управления рисками; методами качественного и количественного анализа проектных рисков; процедурами реагирования на риски.	10
	Владеет навыками планирования антирисковых мероприятий при реализации инвестиционных проектов;	Верно и в полном объеме владеет навыками планирования антирисковых мероприятий при реализации инвестиционных проектов;	С незначительными замечаниями владеет навыками планирования антирисковых мероприятий при реализации инвестиционных проектов;	На базовом уровне, с ошибками владеет навыками планирования антирисковых мероприятий при реализации инвестиционных проектов;	Не владеет навыками планирования антирисковых мероприятий при реализации инвестиционных проектов;	

Компетенции	Показатели оценивания	Критерии оценивания компетенций				Итого:
		Высокий (верно и в полном объеме) - 5 б.	Средний (с незначительными замечаниями) - 4 б.	Низкий (на базовом уровне, с ошибками) - 3 б.	Недостаточный (содержит большое количество ошибок, ответ не дан) – 0,5 б.	
	процедурами реагирования на риски (коллоквиум, задачи)	процедурами реагирования на риски	процедурами реагирования на риски	процедурами реагирования на риски	на риски	
<i>ВСЕГО:</i>						50

Шкала оценивания:

Оценка	Баллы	Уровень сформированности компетенции
отлично	43-50	высокий
хорошо	36-42	хороший
удовлетворительно	26-35	достаточный
неудовлетворительно	25 и менее	недостаточный

2. Типовые контрольные задания для оценки результатов обучения по дисциплине и иные материалы для подготовки к промежуточной аттестации

2.1. Материалы для подготовки к промежуточной аттестации

1. Неопределенность и проектный риск.
2. Общая характеристика проектных рисков.
3. Функции проектного риска.
4. Объекты, субъекты и характерные черты проектного риска.
5. Риск как источник прибыли.
6. Риск и доходность.
7. Факторы риска.
8. Источники возникновения рисков в предпринимательской деятельности.
9. Классификация проектных рисков: основные признаки классификации.
10. Факторы риска. Учет влияния фактора времени при оценке рисков предпринимательской деятельности.
11. Основные принципы и правила управления риском.
12. Система рисков в хозяйственной деятельности.
13. Классификация хозяйственных рисков.
14. Производственные риски, их классификация и характеристика.
15. Финансовые риски, их классификация и характеристика.
16. Коммерческие риски, их классификация и характеристика.
17. Инвестиционные риски, их классификация и характеристика.
18. Валютные риски, их классификация и характеристика.
19. Кредитные риски, их классификация и характеристика.
20. Банковские риски, их классификация и характеристика.
21. Классификация транспортных рисков.
22. Факторы внешней среды в управлении хозяйственным риском.
23. Факторы внутренней среды в рискованной деятельности организации.
24. Среда прямого воздействия на организацию.
25. Среда косвенного воздействия на организацию.
26. Идентификация и анализ хозяйственного риска.
27. Методы выявления хозяйственных рисков: сущность и характеристика.
28. Качественный анализ хозяйственных рисков.
29. Количественный анализ хозяйственных рисков.
30. Зоны хозяйственного риска.
31. Построение кривой риска организации.
32. Пороговые значения риска.
33. Показатели степени риска.
34. Экономико-статистические методы оценки риска.

35. Метод экспертных оценок анализа хозяйственного риска.
36. Критерии определения оптимальности в условиях неопределенности (критерий Лапласа, критерий Вальда, критерий математического ожидания).
37. Критерии определения оптимальности в условиях неопределенности (критерий Сэвиджа, критерий Гурвица, критерий математического ожидания).
38. Основные понятия и показатели оценки эффективности инвестиций.
39. Анализ степени риска реализации инвестиционных проектов.
40. Методы анализа риска инвестиционных проектов.
41. Риск инвестирования в отдельный актив.
42. Риск инвестиционного портфеля.
43. Модель увязки систематического риска и доходности ценных бумаг CAPM (Capital Asset Pricing Model).
44. Методы анализа риска инвестиционного портфеля.
45. Анализ корреляционной зависимости финансовых активов в портфеле ценных бумаг.
46. Сущность и содержание риск-менеджмента.
47. Понятие, цель и задачи риск-менеджмента.
48. Управление хозяйственным риском.
49. Этапы управления хозяйственным риском.
50. Методы управления рисками.
51. Основные правила менеджмента риска.
52. Методы уклонения от риска.
53. Методы локализации и диссипации риска.
54. Методы компенсации риска.
55. Методы финансирования рисков (покрытия убытков).
56. Принятие решения о выборе метода управления риском.
57. Покрытие убытков на основе страхования.
58. Содержание и виды страхования.
59. Имущественное страхование.
60. Основные показатели в страховании.
61. Определение экономического ущерба вследствие простоев производства.
62. Страхование финансовых рисков.
63. Хеджирование рисков.
64. Система управления хозяйственными рисками в организации.
65. Основные элементы эффективной системы управления рисками в организации.
66. Организационная структура системы управления рисками в организации.
67. Разработка программы управления рисками.
68. Реализация программы управления рисками.
69. Контроль и оценка эффективности мероприятий по управлению

рисками.

70. Оценка риска и выбор управленческих решений.

71. Экономические критерии оценки эффективности управления риском.

72. Основные подходы к выявлению риска на предприятии. Опросные листы и другие методы выявления рисков.

73. Прямая инспекция как метод выявления рисков. Анализ финансовой и управленческой отчетности.

74. Анализ доходности и риска финансовых операций на основе принципа оптимальности Парето.

75. Уклонение от риска. Методы оптимизации риска.

76. Диверсификация рисков.

77. Методы локализации риска. Распределение риска (диссипация).

Типовые контрольные задания:

1. Проанализируйте перечень возможных внутриотраслевых рисков, связанных с деятельностью предприятия по производству молочной продукции, оцените вероятность их наступления, основываясь на личном опыте на основе предлагаемой системы оценки рисков, сформулируйте рекомендации.

2. Компания «Крокус» занимается производством оборудования для химической промышленности. Руководством компании было принято решение расширить ассортимент своей продукции, добавив его техникой с новой технологией. Разработать карту рисков для этого проекта.

3. Провести оценку риска двух инвестиционных проектов. Первый с вероятностью 0,7 обеспечивает прибыль 150 тыс. руб., однако с вероятностью 0,3 можно потерять 16,7 тыс. руб. Для второго проекта с вероятностью 0,6 можно получить прибыль 180 тыс. руб. и с вероятностью 0,4 потерять 20,0 тыс. руб. Какой проект выбрать?

4. Рассматриваются два инвестиционных проекта. Первый с вероятностью 0,65 обеспечивает доход в 10 млн руб., однако с вероятностью 0,35 убытки могут составить 6 млн. руб. Для второго проекта с вероятностью 0,7 можно получить доход 8 млн. руб., с вероятностью 0,3 убытки 4 млн. руб. Какой из проектов следует реализовать? Ответ аргументировать.

5. Рассматриваются два инвестиционных проекта. Срок реализации каждого – 3 года. Вероятности поступления наличности проекта А по периодам реализации составляют 0,2; 0,6; 0,2. Объем наличных поступлений по проекту А соответственно – 40, 50, 60 млн. руб. Вероятности проекта Б – 0,4; 0,2; 0,4. Наличные поступления по проекту Б соответственно 0, 50, 100 млн. руб. Фирма имеет обязательства в 80 млн. руб. Какой из проектов следует реализовать?

Образцы тестовых заданий для проведения текущего контроля и промежуточной аттестации по итогам освоения дисциплины, а также для контроля самостоятельной работы:

1. Риск – это:
 - a) неблагоприятное событие, влекущее за собой убыток
 - b) все предпосылки, могущие негативно повлиять на достижение стратегических целей в течение строго определенного временного промежутка
 - c) вероятность наступления стихийных бедствий либо технических аварий
 - d) вероятность провала программы продаж

2. Управление риском – это:
 - a) отказ от рискованного проекта
 - b) комплекс мер, направленных на снижение вероятности реализации риска
 - c) комплекс мер, направленных на компенсацию, снижение, перенесение, принятие риска или уход от него
 - d) комплекс мероприятий, направленных на подготовку к реализации риска

3. Реализация риск-менеджмента на современных предприятиях включает в себя:
 - a) выявление последствий деятельности экономических субъектов в ситуации риска
 - b) прогнозирование этой деятельности для снижения уровня риска
 - c) умение реагировать на возможные отрицательные последствия этой деятельности
 - d) разработку и осуществление мер, при помощи которых могут быть нейтрализованы или компенсированы вероятные негативные результаты предпринимаемых действий

4. Содержательная сторона риск-менеджмента включает в себя:
 - a) планирование деятельности по реализации рискованного проекта
 - b) сравнение вероятностей и характеристик риска, полученных в результате оценки и анализа риска
 - c) выбор мер по минимизации или устранению последствий риска
 - d) организация службы управления рисками на предприятии

5. Что из перечисленного не является элементом системы риск-менеджмента:
 - a) выявление расхождений в альтернативах риска
 - b) разработка планов, позволяющих действовать оптимальным образом в ситуации риска

- с) разработка конкретных мероприятий, направленных на минимизацию или устранение негативных последствий
- d) учет психологического восприятия рискованных проектов

6. К основным категориям риск-менеджмента относят:

- a) применение методов риск-менеджмента
- b) управление рисками по их типам
- с) точность оценок рисков
- d) точность прогнозов рисков

7. VAR – это:

- a) парадигма стоимости риска (Value-at-Risk)
- b) показатель объемов потерь прибыли (Volume at Reduce)
- с) степень сопротивления персонала рискованным проектам (Volume at Resistance)
- d) объем риска (Volume of Accepted Risk)

Литература для подготовки к зачету с оценкой:

а) нормативные документы:

1. Национальный стандарт Российской Федерации. Менеджмент рисков: Руководство по надлежащей практике менеджмента рисков проектов: <http://docs.cntd.ru/document/1200118641>

2. Об уполномоченном органе Российской Федерации по осуществлению государственного контроля (надзора) за соблюдением требований технического регламента Таможенного союза "О безопасности мебельной продукции". Постановление Правительства РФ от 15 августа 2014 года №812

3. Об уполномоченных органах Российской Федерации по осуществлению государственного контроля (надзора) за соблюдением требований технического регламента Таможенного союза "О безопасности пищевой продукции". Постановление Правительства РФ от 28 августа 2013 года №745

4. Об утверждении Положения о регистрации деклараций о соответствии продукции требованиям технических регламентов Таможенного союза Решение Коллегии ЕЭК от 09 апреля 2013 года №76

5. Об утверждении единой формы сертификата на тип продукции, отвечающей требованиям технического регламента Таможенного союза "О безопасности машин и оборудования" (ТР ТС 010/2011), и правил его оформления (с изменениями на 15 ноября 2016 года). Решение Коллегии ЕЭК от 09 апреля 2013 года №75

6. О единых формах сертификата соответствия и декларации о соответствии требованиям технических регламентов Евразийского экономического союза и правилах их оформления (с изменениями на 15 ноября 2016 года). Решение Коллегии ЕЭК от 25 декабря 2012 года №293

7. Гражданский кодекс Российской Федерации (часть первая) от 30.11.1994 N 51-ФЗ (ред. от 06.04.2015). – [Электронный ресурс]. - Режим доступа: Консультант Плюс.

8. Гражданский кодекс Российской Федерации (часть вторая) от 26.01.1996 N 14-ФЗ (ред. от 06.04.2015, с изм. От 07.04.2015. – [Электронный ресурс]. - Режим доступа: Консультант Плюс.

9. ISO 21500-2012. Руководство по менеджменту проектов Международной организации по стандартизации (Guidance on project management). – Режим доступа: СПС Консультант Плюс.

10. ГОСТ Р ИСО 10006-2005. Системы менеджмента качества. Руководящие указания по менеджменту качества при проектировании. – – Режим доступа: СПС Консультант Плюс.

11. ГОСТ Р 54869-2011. Проектный менеджмент. Требования к управлению проектом. – Режим доступа: СПС Консультант Плюс.

12. ГОСТ Р 54870-2011. Проектный менеджмент. Требования к управлению портфелем проектов. – Режим доступа: СПС Консультант Плюс.

13. ГОСТ Р 54871-2011. Проектный менеджмент. Требования к управлению программой. – Режим доступа: СПС Консультант Плюс.

б) основная литература:

1. Управление рисками организации: Учебное пособие / Г.Д. Антонов, О.П. Иванова, В.М. Тумин. - М.: НИЦ ИНФРА-М, 2015. - 153 с. - Режим доступа: <http://znanium.com/catalog/product/475625>

2. Управление рисками предприятия : учебное пособие / В.Н. Уродовских. — М. : Вузовский учебник, ИНФРА-М, 2017. — 168 с. - Режим доступа: <http://znanium.com/catalog/product/615086>

3. Управление рисками в инновационно-инвестиционной деятельности предприятия / Балдин К.В., Передеряев И.И., Голов Р.С., - 3-е изд. - М.: Дашков и К, 2017. - 418 с. - Режим доступа: <http://znanium.com/catalog/product/415224>

Промежуточная аттестация

2.2 Комплект билетов для проведения промежуточной аттестации

АВТОНОМНАЯ НЕКОММЕРЧЕСКАЯ ОБРАЗОВАТЕЛЬНАЯ
ОРГАНИЗАЦИЯ ВЫСШЕГО ОБРАЗОВАНИЯ
ЦЕНТРОСОЮЗА РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ
«РОССИЙСКИЙ УНИВЕРСИТЕТ КООПЕРАЦИИ»
КАЗАНСКИЙ КООПЕРАТИВНЫЙ ИНСТИТУТ (ФИЛИАЛ)

Направление подготовки: 38.03.02 Менеджмент

Направленность: «Управление проектами»

Дисциплина: Управление проектными рисками

БИЛЕТ №1

1. Неопределенность и проектный риск
2. Основные понятия и показатели оценки эффективности инвестиций
3. Проанализируйте перечень возможных внутриотраслевых рисков, связанных с деятельностью предприятия по производству молочной продукции, оцените вероятность их наступления, основываясь на личном опыте на основе предлагаемой системы оценки рисков, сформулируйте рекомендации.

БИЛЕТ №2

1. Общая характеристика проектных рисков
2. Анализ степени риска реализации инвестиционных проектов
3. Компания «Крокус» занимается производством оборудования для химической промышленности. Руководством компании было принято решение расширить ассортимент своей продукции, добавив его техникой с новой технологией. Разработать карту рисков для этого проекта.

БИЛЕТ №3

1. Функции проектного риска
2. Методы анализа риска инвестиционных проектов
3. Провести оценку риска двух инвестиционных проектов. Первый с вероятностью 0,7 обеспечивает прибыль 150 тыс. руб., однако с вероятностью 0,3 можно потерять 16,7 тыс. руб. Для второго проекта с вероятностью 0,6 можно получить прибыль 180 тыс. руб. и с вероятностью 0,4 потерять 20,0 тыс. руб. Какой проект выбрать?

БИЛЕТ №4

1. Объекты, субъекты и характерные черты проектного риска
2. Риск инвестирования в отдельный актив
3. Акционерному обществу предлагаются два рискованных проекта (таблица 1). Учитывая, что фирма имеет долг в 90 млн. руб., какой проект должны выбрать акционеры и почему?

Таблица 1 - Исходные данные проектов

Заданные параметры	Проекты					
	Проект - 1			Проект - 2		
Вероятность события	0,2	0,5	0,3	0,3	0,3	0,4
Наличные поступления, млн. руб.	40	60	70	0	60	100

БИЛЕТ №5

1. Риск как источник прибыли
2. Риск инвестиционного портфеля
3. Рассматриваются два инвестиционных проекта. Первый с вероятностью 0,65 обеспечивает доход в 10 млн руб., однако с вероятностью 0,35 убытки могут составить 6 млн. руб. Для второго проекта с вероятностью 0,7 можно получить доход 8 млн. руб., с вероятностью 0,3 убытки 4 млн. руб. Какой из проектов следует реализовать? Ответ аргументировать.

БИЛЕТ №6

1. Риск и доходность
2. Модель увязки систематического риска и доходности ценных бумаг CAPM (Capital Asset Pricing Model)
3. Рассматриваются два инвестиционных проекта. Срок реализации каждого – 3 года. Вероятности поступления наличности проекта А по периодам реализации составляют 0,2; 0,6; 0,2. Объем наличных поступлений по проекту А соответственно – 40, 50, 60 млн. руб. Вероятности проекта Б – 0,4; 0,2; 0,4. Наличные поступления по проекту Б соответственно 0, 50, 100 млн. руб. Фирма имеет обязательства в 80 млн. руб. Какой из проектов следует реализовать?

Промежуточная аттестация
Комплект тестовых заданий для проведения зачета с оценкой по дисциплине

АВТОНОМНАЯ НЕКОММЕРЧЕСКАЯ ОБРАЗОВАТЕЛЬНАЯ
ОРГАНИЗАЦИЯ ВЫСШЕГО ОБРАЗОВАНИЯ
ЦЕНТРОСОЮЗА РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ
«РОССИЙСКИЙ УНИВЕРСИТЕТ КООПЕРАЦИИ»
КАЗАНСКИЙ КООПЕРАТИВНЫЙ ИНСТИТУТ (ФИЛИАЛ)

Направление подготовки: 38.03.02 Менеджмент

Направленность: «Управление проектами»

Дисциплина: Управление проектными рисками

Тестовые задания для проверки уровня обученности ЗНАТЬ:

Задание 1. Группа, не влияющая на возникновение неопределенности и вызванного ею риска:

- a) многокритериальность и конфликтность в оценке решений
- b) зависимость от поставщиков
- c) асимметрия информации
- d) индетерминированность процессов и явлений, которые влияют на экономику

Задание 2. К трудовым потерям можно отнести:

- a) потери рабочего времени
- b) уменьшение выручки вследствие снижения цен на реализуемую продукцию
- c) невыполнение сроков сдачи объекта
- d) ущерб здоровью

Задание 3. Отметьте потери, которые можно отнести к финансовым

- a) потери ценных бумаг
- b) выплата штрафа
- c) уплата дополнительных налогов
- d) уменьшение выручки вследствие снижения цен на реализуемую продукцию

Задание 4. Отметьте потери, которые можно отнести к потерям времени:

- a) невыполнение сроков сдачи объекта
- b) потери ценных бумаг
- c) потери рабочего времени
- d) ущерб репутации
- e) потери сырья

Задание 5. Отметьте потери, которые можно отнести к специальным потерям:

- a) выплата штрафа
- b) ущерб здоровью
- c) уплата дополнительных налогов
- d) ущерб репутации
- e) невыполнение сроков сдачи объекта

Задание 6. Анализ риска – это:

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

Задание 7. Идентификация риска – это:

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

Задание 8. Риски, которые могут нести в себе как потери, так и дополнительную прибыль, называются:

- a) чистыми
- b) критическими
- c) спекулятивными
- d) всё перечисленное верно

Задание 9. Риски, которые практически всегда несут в себе потери, называются:

- a) критическими
- b) спекулятивными
- c) чистыми
- d) всё перечисленное верно

Задание 10. Риски, обусловленные деятельностью самого предприятия и его контактной аудиторией, называются:

- a) внешними
- b) внутренними
- c) чистыми
- d) всё перечисленное верно

Тестовые задания для проверки уровня обученности: УМЕТЬ, ВЛАДЕТЬ:

Задание 1. Риски, реализация которых грозит потерей прибыли, называются:

- a) катастрофическими
- b) критическими
- c) допустимыми
- d) всё перечисленное верно

Задание 2. Риски, реализация которых грозит потерей выручки (т.е. потери превышают ожидаемую прибыль) предприятием, называются:

- a) катастрофическими
- b) критическими
- c) допустимыми
- d) всё перечисленное верно

Задание 3. Подразделение рисков на спекулятивные и чистые основано на:

- a) классификации субъектов риска
- b) классификации объектов риска
- c) характере оценки риска
- d) характере последствий риска

Задание 4. По сфере возникновения выделяют следующие типы рисков:

- a) производственный риск
- b) кадровый риск
- c) информационный риск
- d) финансовый риск
- e) коммерческий риск

Задание 5. Финансовые риски подразделяются на:

- a) валютные
- b) денежные
- c) инвестиционные
- d) проектные
- e) риски распределения доходности

Задание 6. Ситуацией риска на предприятии называют:

- a) альтернативные варианты принятия решений для получения оптимальной величины прибыли
- b) возможность качественно и количественно определить степень вероятности потери прибыли
- c) возможность определить вероятность получения дополнительной прибыли
- d) всё перечисленное верно

Задание 7. В явлении «риск» можно выделить следующие основные элементы, взаимосвязь которых составляет его сущность:

- a) противоречивость и неопределенность
- b) вероятность получения дополнительной прибыли и неопределенность ее недополучения
- c) субъективность и объективность проявления
- d) возможность материальных, нравственных и других потерь, связанных с осуществлением выбранной в условиях неопределенности альтернативы

Задание 8. Ситуация неопределенности характеризуется тем, что:

- a) вероятность наступления результатов событий может быть установлена только опытным путем
- b) вероятность наступления события в принципе не устанавливается
- c) вероятность наступления события можно определить графическим способом на основе графика нормального распределения случайной величины
- d) всё перечисленное верно

Задание 9. Основными причинами риска являются:

- a) спонтанность природных процессов, случайность, наличие противоборствующих тенденций, вероятностный характер НТП
- b) ограниченность финансовых ресурсов, случайность, развитие научно-технического прогресса, природные катаклизмы
- c) спонтанность природных явлений, развитие научно-технического прогресса, недостаточность сведений об объекте
- d) всё перечисленное верно

Задание 10. Источником риска в организации можно назвать:

- a) бизнес-планирование проектов по освоению новых видов изделий на долгосрочный период
- b) наличие противоборствующих тенденций, столкновение противоречивых интересов
- c) смена административной команды управления организацией
- d) всё перечисленное верно

2.3. Критерии оценки для проведения зачета с оценкой по дисциплине

После завершения тестирования на зачете с оценкой на мониторе компьютера высвечивается результат – процент правильных ответов. Результат переводится в баллы и суммируется с текущими семестровыми баллами.

Максимальная сумма (100 баллов), набираемая студентом по дисциплине, предусматривающей в качестве формы промежуточной аттестации зачет с оценкой, включают две составляющие.

Первая составляющая – оценка регулярности и своевременности качества выполнения студентом учебной работы по изучению дисциплины в течение семестра (сумма не более 60 баллов).

Вторая составляющая – оценка знаний студента на зачете с оценкой (не более 40 баллов).

Перевод полученных итоговых баллов в оценки осуществляется по следующей шкале:

- с 86 до 100 баллов – «отлично»;
- с 71 до 85 баллов – «хорошо»;
- с 50 до 70 баллов – «удовлетворительно».

Если студент при тестировании отвечает правильно менее, чем на 50 %, то автоматически выставляется оценка «неудовлетворительно» (без суммирования текущих рейтинговых баллов), а студенту назначается переэкзаменовка в дополнительную сессию.

2.4. Методические материалы, определяющие процедуру оценивания по дисциплине

Общая процедура оценивания определена Положением о фондах оценочных средств.

1. Процедура оценивания результатов освоения программы дисциплины включает в себя оценку уровня сформированности общекультурных и профессиональных компетенций студента, уровней обученности: «знать», «уметь», «владеть».

2. При сдаче экзамена/зачета:

– профессиональные знания студента могут проверяться при ответе на теоретические вопросы, при выполнении тестовых заданий, практических работ;

– степень владения профессиональными умениями, уровень сформированности компетенций (элементов компетенций) – при решении ситуационных задач, выполнении практических работ и других заданий.

3. Результаты промежуточной аттестации фиксируются в баллах. Общее количество баллов складывается из следующего:

- до 60% от общей оценки за выполнение практических заданий,

- до 30% оценки за ответы на теоретические вопросы,
- до 10% оценки за ответы на дополнительные вопросы.

**АВТОНОМНАЯ НЕКОММЕРЧЕСКАЯ ОБРАЗОВАТЕЛЬНАЯ
ОРГАНИЗАЦИЯ ВЫСШЕГО ОБРАЗОВАНИЯ
ЦЕНТРОСОЮЗА РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ
«РОССИЙСКИЙ УНИВЕРСИТЕТ КООПЕРАЦИИ»
КАЗАНСКИЙ КООПЕРАТИВНЫЙ ИНСТИТУТ (ФИЛИАЛ)**

**ФОНД ОЦЕНОЧНЫХ СРЕДСТВ ДЛЯ ПРОВЕДЕНИЯ ТЕКУЩЕГО
КОНТРОЛЯ И ТЕКУЩЕЙ АТТЕСТАЦИИ ПО ДИСЦИПЛИНЕ
(МОДУЛЮ)**

УПРАВЛЕНИЕ ПРОЕКТНЫМИ РИСКАМИ

Направление подготовки: 38.03.02 Менеджмент
Направленность: «Управление проектами»

Материалы для текущего контроля

АВТНОМНАЯ НЕКОММЕРЧЕСКАЯ ОБРАЗОВАТЕЛЬНАЯ
ОРГАНИЗАЦИЯ ВЫСШЕГО ОБРАЗОВАНИЯ
ЦЕНТРОСОЮЗА РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ
«РОССИЙСКИЙ УНИВЕРСИТЕТ КООПЕРАЦИИ»
КАЗАНСКИЙ КООПЕРАТИВНЫЙ ИНСТИТУТ (ФИЛИАЛ)

Деловые игры

по дисциплине «Управление проектными рисками»

1. Тема: «Система управления рисками»

Деловая игра: «Управление финансовыми рисками организации»

Целью игры является разработка системы управления финансовыми рисками коммерческой организации, обеспечивающей ей устойчивое положение на рынке и минимизацию финансовых рисков.

Задача деловой игры: произвести расчет показателей, определяющих степень финансового риска предприятия при разных вариантах вложения капитала и, соответственно, определить его наиболее эффективное направление

Вопросы для контроля знаний:

1. Что представляет собой риск?
2. Каков состав финансовых рисков организации?
3. Охарактеризуйте классификация финансовых рисков организации?
4. Какие основные методы оценки финансового риска вам известны?
5. Какие показатели рассчитываются при статистическом методе оценки степени финансовых рисков организации?
6. Перечислите средства разрешения финансовых рисков.
7. Назовите принципы, из которых следует исходить инвестору при выборе конкретного средства разрешения финансового риска.
8. Охарактеризуйте способы снижения степени финансовых рисков.

Состав участников деловой игры:

Учебная группа разбивается на подгруппы по 3-5 человек, в каждой из подгрупп выбирается лидер, в обязанности которого входит организация работы подгруппы в ходе проведения деловой игры (ситуации), формирование коллективного мнения, представление мнения, подгруппы во время обсуждения вопросов по рассматриваемой проблеме. Также выбирается группа экспертов (3-4 человека), которая, внимательно наблюдая за ходом игры, выносит решение о получении зачета каждым ее участником.

Методические указания к подготовке проведения деловой игры

Подготовительная работа

Коммерческая организация в процессе осуществления своей деятельности подвержена различным рискам, в том числе и финансовым. В

любой хозяйственной деятельности всегда существует опасность денежных потерь, вытекающая из специфики тех или иных хозяйственных операций. При рыночной экономике производители, продавцы, покупатели действуют в условиях конкуренции самостоятельно, то есть на свой страх и риск. Поэтому их финансовое будущее является непредсказуемым и мало прогнозируемым. Риск-менеджмент представляет систему оценки риска, управления риском и финансовыми отношениями, возникающими в процессе бизнеса. Риском, можно управлять, используя разнообразные меры, позволяющие в определенной степени прогнозировать наступление рискованного события и вовремя принимать меры к снижению степени риска.

Проблемам управления финансовыми рисками организации в РФ посвящена данная деловая игра (ситуация), продолжительность её проведения 2 часа.

Организационная работа

На основании приведённых данных игровым группам предлагается произвести расчёт показателей, определяющих степень финансового риска предприятия при разных вариантах вложения капитала и, соответственно, определить его наиболее эффективное направление.

Задание 1. Используя статистический метод оценки степени финансового риска выбрать наиболее эффективное вложение капитала, если известно, что при вложении капитала: в мероприятие А прибыль 200 тыс. руб. была получена в 4 случаях, прибыль 160 тыс. руб. – в 6 случаях, прибыль 80 тыс. руб. – в 8 случаях наблюдения. в мероприятие Б прибыль 180 тыс. руб. была получена в 5 случаях, прибыль 60 тыс. руб. – в 10 случаях, прибыль 220 тыс. руб. – в 3 случаях наблюдения. в мероприятие В прибыль 160 тыс. руб. была получена в 8 случаях, прибыль 180 тыс. руб. – в 5 случаях, прибыль 100 тыс. руб. – в 7 случаях наблюдения.

Задание 2. Выбрать оптимальное вложение капитала по коэффициенту риска. Известно, что при первом варианте вложения капитала объём собственных финансовых ресурсов составляет 10 000 тыс. рублей, максимально возможная сумма убытка – 7 000 тыс. рублей. При втором варианте вложения капитала объём собственных финансовых ресурсов составляет 60 000 тыс. рублей, максимально возможная сумма убытка – 34 000 тыс. рублей, при третьем варианте вложения капитала объём собственных финансовых ресурсов составляет 20 000 тыс. рублей, максимально возможная сумма убытка – 12 000 тыс. рублей, при четвертом варианте вложения капитала объём собственных финансовых ресурсов составляет 40 000 тыс. рублей, максимально возможная сумма убытка – 20 000 тыс. рублей.

Проведённые расчёты позволяют группам определить основные направления по формированию системы управления финансовыми рисками коммерческой организации. Каждая игровая группа может представить для обсуждения свой проект данной системы. Для иллюстративности и наглядности обсуждения представленных проектов подгруппы могут подготовить графики, схемы или другой наглядный иллюстративный

материал. После обсуждения предложенных подгруппами проектов по формированию системы управления финансовыми рисками коммерческой организации преподаватель вместе с экспертной группой производит их оценку с учетом содержательности, конкретности, реальности. Учитывается также быстрота выполненных заданий, а также активность участников подгрупп в обсуждении представляемых проектов.

В заключении деловой игры преподаватель обобщает её итоги, даёт оценку общих результатов работ игровых подгрупп.

Критерии оценки:

- оценка «отлично» выставляется студенту, если он решил задачу верно, в полном объеме и уровень сформированности компетенции высокий;
- оценка «хорошо» выставляется студенту, если он решил задачу верно с незначительными замечаниями и уровень сформированности компетенции хороший;
- оценка «удовлетворительно» выставляется студенту, если он решил задачу с ошибками и уровень сформированности компетенции достаточный;
- оценка «неудовлетворительно» выставляется студенту, если он не решил задачу и уровень сформированности компетенции недостаточный.

2. Тема: «Анализ и расстановка приоритетов рисков»

Деловая игра «Выявление и оценка финансовых рисков»

Целью проведения деловой игры является закрепление полученных студентами теоретических знаний и практических навыков по курсу «Управления проектными рисками». Работа выполняется в группах и включает в себя следующие этапы:

1 ЭТАП: Студенты исследуют краткую характеристику реально действующего предприятия и его продукции, выявляют наиболее значимые для него финансовые риски. Описание предприятия должно включать в себя следующие данные:

- 1) название организации;
- 2) виды деятельности;
- 3) масштаб деятельности (размер бизнеса);
- 4) регион, в котором работает предприятие;
- 5) объемы производства и реализации продукции (оказания услуг);
- 6) численность персонала;
- 7) финансовая отчетность предприятия;
- 8) другие данные, которые студенты посчитают необходимыми.

2 ЭТАП: Далее на основе данных финансовой отчетности за последние годы студентам необходимо дать оценку выявленным финансовым рискам. Для этого проводится анализ основных финансовых показателей, делаются соответствующие выводы, строятся прогнозы. На данном этапе участники

группы должны продемонстрировать навыки владения методами оценки и анализа рисков.

3 ЭТАП: В заключение студентам необходимо представить перечень возможных методов управления выявленными рисками. Результаты работы группы презентуются ее представителем в виде короткого доклада, а затем подвергаются обсуждению. Работа группы оценивается не только по качеству представленных результатов, но и по степени ее участия в обсуждении.

Критерии оценки:

- оценка «зачтено» выставляется студенту, если условие деловой игры выполнено и уровень сформированности компетенции достаточный;
- оценка «не зачтено», если задание не выполнено полностью и уровень сформированности компетенции недостаточный.

АВТНОМНАЯ НЕКОММЕРЧЕСКАЯ ОБРАЗОВАТЕЛЬНАЯ
ОРГАНИЗАЦИЯ ВЫСШЕГО ОБРАЗОВАНИЯ
ЦЕНТРОСОЮЗА РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ
«РОССИЙСКИЙ УНИВЕРСИТЕТ КООПЕРАЦИИ»
КАЗАНСКИЙ КООПЕРАТИВНЫЙ ИНСТИТУТ (ФИЛИАЛ)

**Кейс - Эффективность инвестиционных проектов с учетом
неопределенности и риска**

по дисциплине «Управления проектными рисками»

Источник: И.С. Богомолова, С.В. Гриненко, Е.С. Едалова, Е.К. Задорожная, Ю.В. Развадовская, Т.В. Седова, А.Ю. Федотова, А.В. Ханина, И.К. Шевченко. Инновационный и проектный менеджмент: http://www.aup.ru/books/m1518/4_1.htm

1,3 млрд. руб. выделил в декабре 2012 года фонд «Сколково» Российскому квантовому центру для развития квантовых технологий в России. В первом квартале 2013 г. настоящая квантовая магия наконец пришла на рынок. Квантовые парадоксы начали зарабатывать сотни миллионов долларов сейчас, и обещают сотни миллиардов в ближайшем будущем.

Квантовая суперпозиция позволила компьютеру компании D-Wave работать в 3600 раз быстрее, чем конкурентам. Благодаря этому, решение было куплено Google за \$15 млн и подняло дополнительно \$30 млн венчурного капитала. Принцип неопределенности помог швейцарской компании ID Quantique заключить многомиллионную сделку с крупнейшим вендором шифровального программного обеспечения Cryptsoft. Скоро квантовая криптография будет обеспечивать безопасность путешествий по Всемирной сети. Квантовая сцепленность, позволяющая в рекордные десятки раз повысить чувствительность радаров, только этой весной принесла компании BBN \$2,1 млн от оборонного ведомства. В конце 2014 года был создан первый в мире специализированный фонд Qwave, полем деятельности которого стало инвестирование в квантовые технологии.

- Фотон-одиночка

Компания: «Фотонные нанометатехнологии».

Сфера: нанофотоника, оптические процессоры, квантовые коммуникации.

Принцип: дискретное испускание фотонов в наноалмазе.

Продукт: источник одиночных фотонов, в виде микрочипа.

Фаза: исследовательские работы.

Деньги: 40 млн руб. венчурного финансирования привлекла компания от фонда «Сколково» и венчурного фонда QWave.

Рынок: развитие систем оптических телекоммуникаций, использующих квантовые эффекты. Для таких систем потребовались источники одиночных

фотонов. Спрос на эти устройства уверенно растет, а технические требования постоянно ужесточаются. Их потребителями станут производители оптических процессоров, в которых обработка информации осуществляется посредством световых, а не электронных импульсов (об успехах этой технологии рапортует IBM), а также, возможно, квантовых компьютеров.

- Размер света

Компания: QD Vision.

Сфера: новые материалы.

Принцип: дискретное возбуждение электрона в наночастице.

Продукт: квантовые точки.

Фаза: промышленное производство.

Деньги: \$7,5 млрд – объем рынка квантовых точек к 2022 г., по оценке исследовательской компании MarketsandMarkets

Рынок: LCD-дисплеи на квантовых точках – крохотных полупроводниках, размером от нескольких десятков до нескольких сотен атомов. Одно из интересных свойств квантовой точки в том, что параметры ее излучения зависят от размера и формы точки. Ученые научились довольно точно управлять этими параметрами, а, следовательно, получили источники света с тонко настраиваемыми характеристиками. Одна из перспективных сфер применения квантовых точек – дисплеи, заметно превосходящие OLED по цветовой насыщенности, яркости и контрастности. Они потребляют меньше энергии, но главное – они дешевле и проще в производстве.

- Разрушители квантов

Компания: ID Quantique.

Сфера: принцип неопределенности Гейзенберга.

Принцип: случайная природа квантовых процессов.

Продукт: криптоплатформа Cerberis.

Фаза: промышленное производство, экспансия на рынок.

Деньги: \$845 млн – объем рынка квантовой криптографии в 2015 г., по прогнозу Global Industry Analysts.

Рынок: Квантовая криптография основывается на принципе неопределенности, сформулированном в 1927 г. Вернером Гейзенбергом. Принцип свидетельствует, что невозможно одновременно получить координаты и импульс частицы. Соответственно, невозможно измерить один параметр фотона, не исказив другой. Если квантовый сигнал несет информацию, то стремление получить ее означает попытку измерения. Это вносит искажения в квантовую систему и приводит к ее разрушению. В итоге, используя квантовые явления, можно создать систему связи, которая всегда будет в состоянии обнаруживать подслушивание.

Единственный сегодня поставщик коммерческих криптоквантовых решений для рынка телекоммуникаций, банковского и промышленного сектора – швейцарская компания ID Quantique, в которой работает 20 человек. Продемонстрировав первый коммерческий квантовый криптомодуль в 2003 г., в 2011-м она завершила тестирование своего флагманского продукта – квантово-криптографической платформы Cerberis,

благодаря которой собрала обширное бизнес-портфолио внедрений. Cerberis поддерживает квантовые криптоканалы протяженностью до 100 км из-за ограничения, накладываемого мощностью источников одиночных фотонов. Начинка Cerberis не главное «ноу-хау» швейцарцев, которые продают не столько «квантовый ящик с проводами», сколько конкретные решения по встраиванию криптомодулей в уже работающие системы телекоммуникаций. Никто из конкурентов похвастаться этим пока не может.

- В одной связке

Компания: BBN.

Сфера: системы дистанционного обнаружения.

Принцип: квантовая сцепленность.

Продукт: квантовый радар.

Фаза: исследовательские работы.

Деньги: \$2,1 млн – грант министерства обороны США.

Рынок: исследования в области квантовых радаров.

- Вероятные вычисления

Компания: D-Wave Systems

Сфера: квантовые вычисления.

Принцип: квантовая сцепленность, суперпозиция.

Продукт: квантовый компьютер.

Фаза: коммерческие образцы.

Деньги: \$26 млрд – совокупный рынок квантовых вычислений в 2015-2020 гг., по прогнозам Market Research Media.

Кубиты, или квантовые биты, строительные кирпичики квантового компьютера, собрав которые, можно объявлять о начале новой эры в компьютерной индустрии. В отличие от битов, принимающих два значения (0 и 1), кубиты принимают несколько значений одновременно. Набор кубитов, находящихся одновременно во всех возможных состояниях, становится эффективной моделью для вычислений, связанных с вероятностными процессами, многомерными системами. Вычислительная мощность квантового компьютера определяется количеством кубитов. До недавнего времени в лабораторных условиях формировались квантовые компьютеры в виде системы из трех-четырёх кубитов. Однако канадская компания D-Wave Systems регулярно заявляла о создании коммерческой версии такого компьютера из 16, 128 и, совсем недавно, из 512 кубитов.

ЗАДАНИЕ

1. Какие сильные и слабые стороны представленных компаний Вы можете назвать?

2. Создание каких конкурентных преимуществ возможно в рамках реализуемых инноваций (выберите один проект)?

3. Какой тип инновационной стратегии используют в проектах (виолентная, эксплерентная, пациентная, коммутантная)?

4. Какая стратегия внешнеэкономической деятельности может быть предложена для представленных проектов?

Критерии оценки:

- оценка «зачтено» выставляется студенту, если задача решена и уровень сформированности компетенции достаточный;
- оценка «не зачтено», если задача не решена и уровень сформированности компетенции недостаточный.

АВТОНОМНАЯ НЕКОММЕРЧЕСКАЯ ОБРАЗОВАТЕЛЬНАЯ
ОРГАНИЗАЦИЯ ВЫСШЕГО ОБРАЗОВАНИЯ
ЦЕНТРОСОЮЗА РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ
«РОССИЙСКИЙ УНИВЕРСИТЕТ КООПЕРАЦИИ»
КАЗАНСКИЙ КООПЕРАТИВНЫЙ ИНСТИТУТ (ФИЛИАЛ)

Вопросы для коллоквиума, собеседования

по дисциплине «Управление проектными рисками»

Тема: Риск-менеджмент как управленческая технология

Задания для подготовки к коллоквиуму:

1. Эволюция управления рисками: концепции, подходы и их условия.
2. Классификация рисков: виды, принципы разработки, использование.
3. Программа управления рисками: разработка и использование.
4. Комплексное использование методов управления рисками.
5. Управление рисками в малом предпринимательстве
6. Понятие риска и неопределенности
7. Мегаэкономические риски – риски, связанные с функционированием мировой экономики в целом
8. Макроэкономические риски – риски экономической системы государства
9. Мезоэкономические риски – риски, формируемые на уровне отдельных отраслей народного хозяйства и специфических сфер бизнеса
10. Микроэкономические риски – риски отдельных предпринимательских единиц (внутренние риски)

Тема: Анализ и расстановка приоритетов рисков

Задания для подготовки к коллоквиуму:

1. Техничко-технологические и строительные риски
2. Управленческо-организационные и маркетинговые риски
3. Финансовые и валютные риски
4. Риски участников проекта, включая инвестиционные риски и форсмажор
5. Социальные и военно-политические риски
6. Юридическо-правовые риски
7. Экологические риски
8. Специфические риски
9. Комплексное использование методов управления рисками.
10. Управление рисками в малом предпринимательстве.
11. Организация управления рисками на промышленном предприятии.

12. Организация управления рисками в финансово-кредитном учреждении.
13. Особенности управления рисками финансово-промышленной группы.
14. Особенности управления рисками транснациональной корпорации.
15. Управление рисками инвестиционного проекта

Тема: Методы реагирования на риски

Задания для подготовки к коллоквиуму:

1. Методы реагирования на риск
2. Экологические риски и основные подходы к управлению ими
3. Страхование как инструмент управления рисками
4. Статистические методы оценки рисков: достоинства и недостатки
5. Методы имитационного моделирования в оценке рисков ситуации
6. Риски развития. Лидерство в снижении издержек и дифференциация.
7. Поиск наиболее эффективного пути развития.
8. Стратегические риски. Стратегическая безопасность. Проблемы и перспективы глобализации
9. Картографирование рисков и построение рискового профиля предприятия
10. Диверсификация или распределение рисков
11. Резервирование средств на покрытие непредвиденных расходов
12. Страхование рисков
13. Диссипация риска: преимущества и недостатки
14. Передача риска: преимущества и недостатки

Коллоквиум (от лат. –colloquium – разговор, беседа) – одна из форм учебных занятий, главная цель которой – контроль за усвоением знаний студентов по крупным разделам курса.

Возможны следующие варианты проведения коллоквиума:

1. Письменная работа: анализ текста, затрагивающего вопросы и проблемы вынесенной в название коллоквиума темы.
2. Письменная работа, в которой студентам предлагаются проблемные ситуации.
3. Беседа преподавателя со студентом по предварительно определенной (по выбору) проблеме развития экономики;
4. Мини-конференция, на которой несколько человек выступают с докладами по определенной теме, а все остальные - принимают активное участие в их обсуждении.

Критерии оценки:

- оценка «отлично» выставляется студенту, если он выступил с докладом, активно и доказательно отстаивал свою точку зрения в ходе обсуждения, показал высокий уровень сформированности компетенции 5 б;

- оценка «хорошо» выставляется студенту, если он выступил с докладом, активно отстаивал свою точку зрения, показал средний уровень сформированности компетенции (с незначительными замечаниями) 4 б;

- оценка «удовлетворительно» выставляется студенту, если он выступил с докладом, но не мог аргументировано отстаивать свою точку зрения, показал низкий уровень сформированности компетенции (на базовом уровне, с ошибками) 3 б;

- оценка «неудовлетворительно» выставляется студенту, если он не выступил с докладом и в процессе дискуссии показал недостаточный уровень сформированности компетенции (содержит большое количество ошибок/ответ не дан) - 2 б.

АВТОНОМНАЯ НЕКОММЕРЧЕСКАЯ ОБРАЗОВАТЕЛЬНАЯ
ОРГАНИЗАЦИЯ ВЫСШЕГО ОБРАЗОВАНИЯ
ЦЕНТРОСОЮЗА РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ
«РОССИЙСКИЙ УНИВЕРСИТЕТ КООПЕРАЦИИ»
КАЗАНСКИЙ КООПЕРАТИВНЫЙ ИНСТИТУТ (ФИЛИАЛ)

Комплект заданий для контрольной работы

По дисциплине «Управление проектными рисками»

Тема: Классификация проектных рисков

Вариант 1

Задание 1. Ситуацией риска на предприятии называют:

- а) альтернативные варианты принятия решений для получения оптимальной величины прибыли
- б) возможность качественно и количественно определить степень вероятности потери прибыли
- с) возможность определить вероятность получения дополнительной прибыли
- д) всё перечисленное верно

Задание 2. В явлении «риск» можно выделить следующие основные элементы, взаимосвязь которых составляет его сущность:

- а) противоречивость и неопределенность
- б) вероятность получения дополнительной прибыли и неопределенность ее недополучения
- с) субъективность и объективность проявления
- д) возможность материальных, нравственных и других потерь, связанных с осуществлением выбранной в условиях неопределенности альтернативы

Задание 3. Ситуация неопределенности характеризуется тем, что:

- а) вероятность наступления результатов событий может быть установлена только опытным путем
- б) вероятность наступления события в принципе не устанавливается
- с) вероятность наступления события можно определить графическим способом на основе графика нормального распределения случайной величины
- д) всё перечисленное верно

Задание 4. Основными причинами риска являются:

- а) спонтанность природных процессов, случайность, наличие противоборствующих тенденций, вероятностный характер НТП

- b)ограниченность финансовых ресурсов, случайность, развитие научно-технического прогресса, природные катаклизмы
- с)спонтанность природных явлений, развитие научно-технического прогресса, недостаточность сведений об объекте
- d)всё перечисленное верно

Задание 5. Источником риска в организации можно назвать:

- a)бизнес-планирование проектов по освоению новых видов изделий на долгосрочный период
- b)наличие противоборствующих тенденций, столкновение противоречивых интересов
- с)смена административной команды управления организацией
- d)всё перечисленное верно

Вариант 2

Задание 1. Наиболее важными элементами, положенными в основу классификации рисков, являются:

- a)гражданско-правовая форма образования организации
- b)время возникновения и характер последствий
- с)объективная и субъективная природа возникновения
- d)всё перечисленное верно

Задание 2. К факторам прямого действия, определяющим уровень риска, относятся:

- a)непредвиденные изменения экономической обстановки в стране
- b)малокомпетентная работа управленческих и иных служб
- с)непредвиденные действия конкурентов
- d)способ организации труда

Задание 3. К факторам косвенного действия, определяющим уровень риска, относятся:

- a)нестабильность, противоречивость законодательства
- b)недостаток бизнес-информации в фирме
- с)ошибки при принятии решений
- d)непредвиденные изменения в отрасли предпринимательской деятельности

Задание 4. К объективным факторам, определяющим уровень риска, относятся:

- a)коррупция и рэкет
- b)ошибки при реализации рискованных ситуаций
- с)финансовые проблемы внутри фирмы
- d)непредвиденные изменения экономической обстановки в регионе

Задание 5. К субъективным факторам, определяющим уровень риска, относятся:

- а) разработка, внедрение новых технологий, способ организации труда
- б) отсутствие у персонала способности к риску
- с) стихийные силы природы и климат
- д) революционные скачки в научно-техническом прогрессе

Вариант 3

Задание 1. В зависимости от рискового события, к чистой группе рисков относят:

- а) валютный риск
- б) политический риск
- с) инновационный риск
- д) страновой риск

Задание 2. В зависимости от рискового события, к спекулятивной группе рисков относят:

- а) организационный риск
- б) финансовый риск
- с) налоговый риск
- д) риск развития НТП

Задание 3. К принципам, прямо воздействующим на уровень политического риска, относят:

- а) политическую обстановку
- б) налоговую систему
- с) экономическую обстановку в стране для осуществления деятельности
- д) всё перечисленное верно

Задание 4. К принципам, косвенно воздействующим на уровень политического риска, относят:

- а) непредвиденные действия органов государственного и местного самоуправления
- б) законодательство
- с) международные события
- д) всё перечисленное верно

Задание 5. Установите последовательность алгоритма управления риском:

- а) выбор метода воздействия на риск в целях снижения его уровня,
- б) определение корректирующих целей для снижения рассогласования между фактическим уровнем риска и приемлемым,
- с) выбор управляющих воздействий на риск,
- д) постановка целей управления риском,
- е) анализ эффективности принятых решений на основе сравнения

полученного уровня риска с приемлемым уровнем,

f) анализ риска на основе, собранной информации (качественный и количественный анализ)

Вариант 4

Задание 1. К основным подходам группировки методов анализа и оценки рисков относятся:

- a) экономический
- b) статистический
- c) вероятностный
- d) математический

Задание 2. Возможность обращения имеющихся активов в денежные средства определяется:

- a) ликвидностью
- b) платежеспособностью
- c) кредитоспособностью
- d) всё перечисленное верно

Задание 3. Элемент системы управления, который формирует управляющие воздействия с учетом информации, осуществляет управленческую и организационную работу, принимает решения и обеспечивает достижение поставленных целей:

- a) объект управления
- b) субъект управления
- c) внутренняя среда
- d) всё перечисленное верно

Задание 4. К основным свойствам процесса управления не относятся:

- a) неопределенность
- b) непрерывность
- c) относительность
- d) вероятностный характер

Задание 5. Область риска, в которой потери по своей величине превосходят критический уровень потерь:

- a) зона допустимого риска
- b) зона критического риска
- c) зона катастрофического риска
- d) безрисковая зона

Тема: Планирование управления рисками

Вариант 1

Задание 1. _____ - метод оценки риска, основанный на расчетах и анализе статистических показателей. Заполните пропуск:

- a) вероятностный метод
- b) построение дерева решений
- c) метод сценариев
- d) имитационное моделирование

Задание 2. Какой из ниже перечисленных методов оценки риска дает представление о наиболее критических факторах инвестиционного проекта:

- a) построение дерева решений
- b) учет рисков при расчете чистой приведенной стоимости
- c) анализ чувствительности
- d) имитационное моделирование

Задание 3. Какой из ниже перечисленных методов оценки риска реализуется путем введения поправки на риск или путем учета вероятности возникновения денежных потоков:

- a) построение дерева решений
- b) метод сценариев
- c) учет рисков при расчете чистой приведенной стоимости
- d) имитационное моделирование

Задание 4. Какой из перечисленных ниже методов оценки риска используется в ситуациях, когда принимаемые решения сильно зависят от принятых ранее и определяют сценарии дальнейшего развития событий:

- a) имитационное моделирование
- b) вероятностный метод
- c) построение дерева решений
- d) метод сценариев

Задание 5. Какой из перечисленных ниже методов оценки риска представляет собой серию численных экспериментов, призванных получить эмпирические оценки степени влияния различных факторов на некоторые зависящие от них результаты:

- a) вероятностный метод
- b) метод сценариев
- c) имитационное моделирование
- d) учет рисков при расчете чистой приведенной стоимости

Вариант 2

Задание 1. При расчете чистой приведенной стоимости риск можно учитывать:

- a) в знаменателе формулы NPV посредством корректировки ставки дисконта
- b) комбинация формул NPV посредством корректировки чистых денежных потоков
- c) в числителе формулы NPV посредством корректировки чистых денежных потоков
- d) всё перечисленное верно

Задание 2. Субъектом управления в риск-менеджменте является:

- a) специальная группа людей, которая посредством различных приемов и способов управленческого воздействия осуществляет управление рисками
- b) риск, рисковые вложения капитала и экономические отношения между хозяйствующими субъектами
- c) всё перечисленное верно

Задание 3. Утверждение о том, что «деятельность любой организации всегда сопровождается рисками, присутствующими в ее внешней или внутренней среде» отражает смысл:

- a) закона неизбежности риска
- b) закона сочетания потенциальных потерь и выгод
- c) закона прямой зависимости между степенью риска и уровнем планируемых доходов
- d) всё перечисленное верно

Задание 4. Утверждение о том, что «практически в любых ситуациях риска потенциальная возможность потерь или убытков сочетается с потенциальной возможностью получения дополнительных доходов» отражает смысл:

- a) закона прямой зависимости между степенью риска и уровнем планируемых доходов
- b) закона неизбежности риска
- c) закона сочетания потенциальных потерь и выгод
- d) всё перечисленное верно

Задание 5. Утверждение о том, что «чем выше степень риска при осуществлении хозяйственной операции, тем выше уровень планируемых от этой операции доходов» отражает смысл:

- a) закона прямой зависимости между степенью риска и уровнем планируемых доходов
- b) закона неизбежности риска
- c) закона сочетания потенциальных потерь и выгод
- d) всё перечисленное верно

Критерии оценки:

- оценка «отлично» выставляется студенту, если задание он выполнил задания верно и в полном объеме, показал высокий уровень сформированности компетенции 5 б;

- оценка «хорошо» выставляется студенту, если задания он выполнил с незначительными замечаниями, показал средний уровень сформированности компетенции (с незначительными замечаниями) 4 б;

- оценка «удовлетворительно» выставляется, если задание выполнено на базовом уровне, но с ошибками;

- оценка «неудовлетворительно» выставляется, если содержится большое количество ошибок, задание не выполнено.

АВТНОМНАЯ НЕКОММЕРЧЕСКАЯ ОБРАЗОВАТЕЛЬНАЯ
ОРГАНИЗАЦИЯ ВЫСШЕГО ОБРАЗОВАНИЯ
ЦЕНТРОСОЮЗА РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ
«РОССИЙСКИЙ УНИВЕРСИТЕТ КООПЕРАЦИИ»
КАЗАНСКИЙ КООПЕРАТИВНЫЙ ИНСТИТУТ (ФИЛИАЛ)

**Перечень дискуссионных тем для круглого стола
(дискуссии, полемики, диспута, дебатов)**

по дисциплине «Управление проектными рисками»

Тема круглого стола: «Оценка рисков»

Вопросы для обсуждения:

1. Что представляет собой процедура оценки риска? Какое место она занимает в общей схеме управления рисками?
2. Перечислите источники необходимой для проведения оценки риска информации.
3. В чем основные отличия двух этапов оценки риска: качественного и количественного?
4. Каковы основные задачи качественной оценки риска?
5. Какой из этапов оценки риска можно формализовать: качественный или количественный? Какие методы для этого используют?
6. Какие существуют основные (укрупненные) группы методов количественной оценки риска? Дайте их краткую характеристику.
7. Сформулируйте общий принцип выбора методов оценки риска.
8. Назовите «плюсы» и «минусы» статистических методов оценки риска.
9. В чем схожесть вероятностно-статистических и статистических методов оценки риска, а в чем отличие?
10. Поясните сущность имитационного моделирования. В какой группе методов оценки риска оно применяется?
11. В чем сущность экспертных методов оценки риска и в каких ситуациях они применяются?
12. Применение какой группы методов требует наибольших финансовых затрат?
13. Назовите области применения каждой из четырех обобщенных групп методов оценки риска.

Круглый стол — семинарское занятие, в основу которого преднамеренно заложены несколько точек зрения на один и тот же вопрос. Обсуждение которых подводит к приемлемым для всех участников позициям и решениям.

Цель — обеспечить свободное, не регламентированное обсуждение поставленных вопросов.

Составляющие круглого стола:

- неразрешенный вопрос: Какая тенденция является определяющей в формировании регулирования торговли в АТР: мультилатерализм или регионализм?

- равноправное участие всех заинтересованных сторон
- выработка приемлемых решений

Формы:

1. Пассивная — когда несколько преподавателей или специалистов обсуждают тему, а группа слушает. Применяется из-за отсутствия предварительной подготовки или при желании продемонстрировать обучающимся профессиональный уровень обсуждения темы.

2. «Мужской разговор» - когда каждый из взявших слово говорит о своем, общий разговор и обсуждение не завязываются, а ведущий только предоставляет слово и слушает вместе со всеми.

3. Когда тему обсуждает как бы сам с собой ведущий, но подключает к осуждению учащихся, задавая им конкретные вопросы.

4. Активная — когда идет именно обсуждение, а ведущий сумев завязать разговор с «обратной связью», направляет его.

Этапы занятия:

1. Подготовительный

1.1. Выбор темы для обсуждения. Тема должна быть противоречивой, неоднозначной.

1.2. Выработка целей занятия.

1.3. Приглашение специалистов.

1.4. Консультирование учащихся.

1.5. Подготовка помещения. Всем участникам рекомендуется сесть по кругу.

1.6. Разработка плана занятия:

- структура занятия
- порядок ведения
- возможные варианты обсуждения темы
- вопросы и задачи для создания проблемной ситуации
- приемы выявления позиция у отдельных лиц или микрогрупп
- порядок завершения занятия

1. Обсуждение проблемы. Главные «нельзя»:

- нарушать принцип равноправия
- допускать разжигания межличностных конфликтов
- допускать уговаривания кем-либо кого-либо
- позволять бездоказательно, не аргументированно отрицать ту или иную точку зрения

- стремиться примирить спорящих
- проявлять ведущему свою точку зрения

1. Подведение итогов:

- 3.1. Напоминание целей и задач круглого стола
- 3.2. Показ итоговой расстановки участников встречи по точкам зрения на проблему
- 3.3. Формирование общей позиции к которой пришли или близки все участники встречи
- 3.4. Ориентирование учащихся на изучение вопросов, которые не нашли должного освещения на занятии
- 3.5. Слова благодарности всем участникам.

Критерии оценки:

- оценка «отлично» выставляется студенту, если он выступил с докладом, активно и доказательно отстаивал свою точку зрения в ходе обсуждения вопросов круглого стола, показал высокий уровень сформированности компетенции 5 б;

- оценка «хорошо» выставляется студенту, если он выступил с докладом, активно отстаивал свою точку зрения в ходе обсуждения вопросов круглого стола, показал средний уровень сформированности компетенции (с незначительными замечаниями) 4 б;

- оценка «удовлетворительно» выставляется студенту, если он выступил с докладом, но не мог аргументировано отстаивать свою точку зрения в ходе обсуждения вопросов круглого стола, показал низкий уровень сформированности компетенции (на базовом уровне, с ошибками) 3 б;

- оценка «неудовлетворительно» выставляется студенту, если он не выступил с докладом и в процессе дискуссии показал недостаточный уровень сформированности компетенции (содержит большое количество ошибок/ответ не дан) - 2 б.

АВТОНОМНАЯ НЕКОММЕРЧЕСКАЯ ОБРАЗОВАТЕЛЬНАЯ
ОРГАНИЗАЦИЯ ВЫСШЕГО ОБРАЗОВАНИЯ
ЦЕНТРОСОЮЗА РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ
«РОССИЙСКИЙ УНИВЕРСИТЕТ КООПЕРАЦИИ»
КАЗАНСКИЙ КООПЕРАТИВНЫЙ ИНСТИТУТ (ФИЛИАЛ)

Комплект разноуровневых задач (заданий)

по дисциплине «Управление проектными рисками»

1. Задачи репродуктивного уровня

Задача 1. В состав портфеля включены два вида ценных бумаг: акции (x_1) с ожидаемой доходностью $m_1 = 15\%$ и облигации (x_2) с доходностью $m_2 = 6\%$. Стандартное отклонение акций $\sigma_1 = 23\%$, облигаций $\sigma_2 = 9\%$. Варьируя портфельными весами активов, выбрать оптимальную его структуру с точки зрения применяемого типа активов. Расчеты выполнить для пяти значений коэффициентов парной корреляции $\rho_{ij} = -1,0; -0,6; 0; 0,2; 1,0$.

Задача 2. Провести оценку риска двух инвестиционных проектов. Первый с вероятностью 0,7 обеспечивает прибыль 150 тыс. руб., однако с вероятностью 0,3 можно потерять 16,7 тыс. руб. Для второго проекта с вероятностью 0,6 можно получить прибыль 180 тыс. руб. и с вероятностью 0,4 потерять 20,0 тыс. руб. Какой проект выбрать?

Задача 3. Рассматриваются два инвестиционных проекта. Первый с вероятностью 0,65 обеспечивает доход в 10 млн руб., однако с вероятностью 0,35 убытки могут составить 6 млн. руб. Для второго проекта с вероятностью 0,7 можно получить доход 8 млн. руб., с вероятностью 0,3 убытки 4 млн. руб. Какой из проектов следует реализовать? Ответ аргументировать.

Задача 4. Рассматриваются два инвестиционных проекта. Срок реализации каждого – 3 года. Вероятности поступления наличности проекта А по периодам реализации составляют 0,2; 0,6; 0,2. Объем наличных поступлений по проекту А соответственно – 40, 50, 60 млн. руб. Вероятности проекта Б – 0,4; 0,2; 0,4. Наличные поступления по проекту Б соответственно 0, 50, 100 млн. руб. Фирма имеет обязательства в 80 млн. руб. Какой из проектов следует реализовать?

Задача 5. Известно, что при вложении капитала в мероприятие А из 120 случаев:

- прибыль 25 тыс. руб. была получена в 48 случаях,
- прибыль 20 тыс. руб. была получена в 36 случаях, 3
- прибыль 30 тыс. руб. была получена в 36 случаях.

При вложении капитала в мероприятие Б:

- прибыль 40 тыс. руб. была получена в 36 случаях,
- прибыль 30 тыс. руб. была получена в 60 случаях,

– прибыль 15 тыс. руб. была получена в 24 случаях.

Определить степень риска при вложении капитала в мероприятия А и Б.

Задача 6. Компания «Palmira» рассматривает возможности осуществить производство продукции по трем проектам. Управление считает, что необходимо оценивать три альтернативы: А1, А2 или А3. увеличения объема производства в гривнах. Успех этих мероприятий зависит в основном от сочетания решений местного законодательства и деятельности конкурентов в этой отрасли. Следует рассматривать четыре возможных варианта обстановки: позитивная законодательная база и достаточно слабая конкуренция (S1), позитивная законодательная база и достаточно сильная конкуренция (S2), негативная законодательная база и достаточно слабая конкуренция (S3), негативная законодательная база и достаточно сильная конкуренция (S4). В результате этих альтернатив при возможных состояниях внешней среды предполагаются ожидаемые значения прибыли (убытков), представленные в таблице 1.

Таблица 1 - Ожидаемая эффективность постройки дополнительного корпуса

Объем производства, грн.	Варианты обстановки			
	S1	S2	S3	S4
A1 = 80000	24930	197200	197200	197200
A2 = 500000	-80	148900	137800	137800
A3 = 980000	-1140	98400	196800	395600

Задача 7. Цены на металлопродукцию за последние 11 месяцев по статистическим данным составили:

Месяц	1	2	3	4	5	6
Цена, долл./т	300	310	312	309	302	305
Месяц	7	8	9	10	11	
Цена, долл./т	304	300	298	305	304	

Какова вероятность того, что в следующем месяце цена уменьшится по сравнению с ее последним значением?

Задача 8. Имеются два инвестиционных проекта: ИП1 и ИП2 с одинаковой прогнозной суммой требуемых капитальных вложений. Величина планируемого дохода (тыс. руб.) неопределенна и приведена в виде распределения вероятностей (табл.). Оценить рискованность каждого проекта, используя критерий отбора – «максимизация математического ожидания дохода».

Характеристика проектов по доходам и вероятностям его получения:
Инвестиционный проект ИП1

Доход, тыс. руб.	Вероятность (В)
2500	0,15
3000	0,20
3500	0,35
5000	0,20
6000	0,10

Инвестиционный проект ИП2

Доход, тыс. руб.	Вероятность (В)
1500	0,10
2500	0,15
4000	0,30
5000	0,30
7000	0,15

Задача 9. Рассматриваются два инвестиционных проекта. Первый с вероятностью 0,65 обеспечивает доход в 10 млн руб., однако с вероятностью 0,35 убытки могут составить 6 млн. руб. Для второго проекта с вероятностью 0,7 можно получить доход 8 млн. руб., с вероятностью 0,3 убытки 4 млн. руб. Какой из проектов следует реализовать? Ответ аргументировать.

Задача 10. Ущерб страхователя, причиненный уничтожением объекта, равен 12420 тыс. руб., страховая сумма – 19840 тыс. руб., что составляет 60% оценки объекта. Исчислить сумму страхового возмещения по системе пропорциональной ответственности.

2. Задачи реконструктивного уровня:

Задача 1. Компания «XXX» – производитель нефтепродуктов. Один из продуктов поставляется в страны ближнего зарубежья. Необходимо принять решение, какой объем продукции следует производить в течение следующего месяца. Вероятность того, что спрос этот продукт в течение месяца будет 6, 7, 8 или 9 тыс. тонн равны соответственно 0,1; 0,3; 0,5; 0,1 единиц. Затраты на производство одной тонны продукта равны 45 долл. при цене реализации 95 долл. Если партия не реализуется в течение месяца, то товар теряет кондицию, и компания терпит убытки. Какой объём производства продукции следует установить на ближайший месяц с учётом приведённых данных?

Задача 2. Известны рентабельность продаж, оборачиваемость запасов и выручка четырех предприятий. Необходимо ранжировать эти предприятия методом суммы мест.

Таблица 14.1 - Исходные данные

Показатели	Предприятия			
	А	В	С	Д
Рентабельность продаж, %	28	31	32	29
Оборачиваемость запасов, дней	9	7	8	10
Выручка, млн. руб.	150	170	160	140

Задача 2. На основании данных таблицы 14.2

1. Определить показатель чистой текущей стоимости проектных денежных потоков.

2. Рассчитайте NPV, если за счет приобретения более прогрессивного оборудования (по сравнению с первоначальным вариантом инвестирования инвестиционные затраты в части расходов по приобретению основных фондов увеличатся на 390 тыс. руб.) удастся снизить переменные издержки до 0,38 тыс. рублей за единицу продукции.

3. Графически и расчетным путем найдите точку безубыточности по двум альтернативным вариантам инвестирования (на основе NPV - критерия).

4. В аналитическом заключении охарактеризуйте уровень проектного риска каждого варианта капиталовложений.

Для определения величины денежного потока используйте следующую последовательность расчета искомого показателя:

величина чистой прибыли + объем амортизации + посленалоговый денежный поток от реализации имущества и погашения обязательств в конце срока реализации проекта - единовременные инвестиционные затраты.

Таблица 14.2 - Исходные данные

Показатели	Значение показателя
Объем продаж за год (шт.)	4000
Цена единицы продукции (тыс. руб.)	0,55
Переменные издержки на производство единицы продукции (тыс. руб.)	0,4
Годовые постоянные затраты без учета амортизации основных фондов (тыс. руб.)	120,8
Годовая ставка амортизации основных фондов с использованием прямолинейного метода ее начисления (%)	7
Начальные инвестиционные затраты, (тыс. руб.); в том числе в основные фонды	1560,0; 1120,0
Срок реализации проекта (лет)	10
Проектная дисконтная ставка (%)	10
Ставка налога на прибыль (%)	20
Посленалоговый денежный поток от реализации имущества и погашения обязательств в конце срока реализации проекта (тыс. руб.)	+ 205,0

Задача 3. Организация планирует приобрести технологическое оборудование, необходимое для производства новой продукции. На основании материалов, представленных производственными, техническими и экономическими службами компании (таблица 14.3) собраны данные, характеризующие уровень производства и реализации продукции по двум альтернативным вариантам инвестирования. С использованием данных

таблицы 14.3:

1. Найдите точку безубыточности для каждого альтернативного варианта инвестирования и объем продаж, при котором рассматриваемые варианты инвестирования будут одинаково прибыльными (убыточными).

2. Постройте график безубыточности одновременно для двух вариантов приобретения оборудования.

3. Определите рентабельность инвестиции как отношение прибыли к инвестиционным затратам, исходя из следующих возможных параметров изменения спроса на выпускаемую продукцию: по оптимистическим оценкам объем продаж составит 150 % от точки безубыточности (вероятность - 0,25); ожидаемый объем продаж планируется на 20 % больше точки безубыточности (вероятность - 0,5); по пессимистическим оценкам объем продаж будет на 10 % ниже точки безубыточности (вероятность - 0,25). 19

4. Рассчитайте стандартное отклонение и коэффициент вариации показателя рентабельности инвестиций по каждому варианту инвестирования.

5. В аналитическом заключении обоснуйте выбор наиболее безопасного варианта долгосрочных инвестиций.

Таблица 14.3 - Исходные данные

Показатель	Значения показателя	
	Вариант 1	Вариант 2
Годовые постоянные затраты (руб.)	200000	10000
Переменные затраты на единицу продукции (руб.)	10	6
Цена единицы продукции (руб.)	16	16
Капитальные затраты - инвестиции (руб.)	1200000	1400000

Задача 4. На основании данных таблицы 14.4:

1. Рассчитать показатель чистой текущей стоимости проектных денежных потоков.

2. Определите для полученного значения NPV и при неизменной величине денежного потока отрегулированную по уровню проектного риска дисконтную ставку.

Таблица 14.4 - Исходные данные

Показатели	Значение показателя в t-м году		
	0	1	2
Начальные инвестиционные затраты (тыс. руб.)	- 145000	-	-
Денежный поток (тыс. руб.)	X	108500	126000
Коэффициенты определенности (значение коэффициента)	1,0	0,9	0,8
Проектная дисконтная ставка (%)	X	10	10

Задача 5. На основании данных таблицы 14.5:

1. Рассчитайте коэффициенты вариации по каждому году реализации инвестиционного проекта.

2. Определите для каждого года коэффициент определенности (**at**), если известно, что на каждые 10 % коэффициента вариации **at** будет

снижаться на 0,1.

3. Рассчитайте с использованием метода коэффициентов определенности показатель NPV при условии, если безрисковая дисконтная ставка равна 6 %.

4. По результатам анализа составьте письменное заключение

Таблица 14.5 - Исходные данные

Величина денежного потока	Года и вероятности получения денежного потока			
	I=0	I=1	I=2	I=3
Пессимистическое значение	-90500	+ 42 000 (0,005)	+ 42 000 (0,3)	+ 48 200 (0,4)
Запланированное значение	-90500	+ 60 000 (0,9)	+ 75 000 (0,6)	+ 124 000 (0,5)
Оптимистическое значение	-90500	+ 75 000 (0,005)	+ 90 000 (0,1)	+ 137 500 (0,1)

Задача 6. Проанализируйте перечень возможных внутриотраслевых рисков, связанных с деятельностью предприятия по производству молочной продукции, оцените вероятность их наступления, основываясь на личном опыте на основе предлагаемой системы оценки рисков, сформулируйте рекомендации.

Задача 7. Компания «Крокус» занимается производством оборудования для химической промышленности. Руководством компании было принято решение расширить ассортимент своей продукции, добавив его техникой с новой технологией. Разработать карту рисков для этого проекта.

Задача 8. Провести оценку риска двух инвестиционных проектов. Первый с вероятностью 0,7 обеспечивает прибыль 150 тыс. руб., однако с вероятностью 0,3 можно потерять 16,7 тыс. руб. Для второго проекта с вероятностью 0,6 можно получить прибыль 180 тыс. руб. и с вероятностью 0,4 потерять 20,0 тыс. руб. Какой проект выбрать?

Задача 9. Акционерному обществу предлагаются два рискованных проекта (таблица 14.6). Учитывая, что фирма имеет долг в 90 млн. руб., какой проект должны выбрать акционеры и почему?

Таблица 14.6 - Исходные данные проектов

Заданные параметры	Проекты					
	Проект - 1			Проект - 2		
Вероятность события	0,2	0,5	0,3	0,3	0,3	0,4
Наличные поступления, млн. руб.	40	60	70	0	60	100

Задача 10. Рассматриваются два инвестиционных проекта. Первый с вероятностью 0,65 обеспечивает доход в 10 млн руб., однако с вероятностью 0,35 убытки могут составить 6 млн. руб. Для второго проекта с вероятностью 0,7 можно получить доход 8 млн. руб., с вероятностью 0,3 убытки 4 млн. руб. Какой из проектов следует реализовать? Ответ аргументировать.

Критерии оценки:

- оценка «отлично» выставляется студенту, если задание он выполнил верно и в полном объеме, показал высокий уровень сформированности компетенции 5 б;
- оценка «хорошо» выставляется студенту, если задание он выполнил с незначительными замечаниями, показал средний уровень сформированности компетенции (с незначительными замечаниями) 4 б;
- оценка «удовлетворительно» выставляется, если задание выполнено на базовом уровне, но с ошибками;
- оценка «неудовлетворительно» выставляется, если содержится большое количество ошибок, задание не выполнено.

АВТНОМНАЯ НЕКОММЕРЧЕСКАЯ ОБРАЗОВАТЕЛЬНАЯ
ОРГАНИЗАЦИЯ ВЫСШЕГО ОБРАЗОВАНИЯ
ЦЕНТРОСОЮЗА РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ
«РОССИЙСКИЙ УНИВЕРСИТЕТ КООПЕРАЦИИ»
КАЗАНСКИЙ КООПЕРАТИВНЫЙ ИНСТИТУТ (ФИЛИАЛ)

Темы рефератов

по дисциплине «Управление проектными рисками»

1. Эволюция управления рисками: концепции, подходы и их условия.
2. Классификация рисков: виды, принципы разработки, использование.
3. Программа управления рисками: разработка и использование.
4. Комплексное использование методов управления рисками.
5. Управление рисками в малом предпринимательстве
6. Понятие риска и неопределенности
7. Мегаэкономические риски – риски, связанные с функционированием мировой экономики в целом
8. Макроэкономические риски – риски экономической системы государства
9. Мезоэкономические риски – риски, формируемые на уровне отдельных отраслей народного хозяйства и специфических сфер бизнеса
10. Микроэкономические риски – риски отдельных предпринимательских единиц (внутренние риски)
11. Техничко-технологические и строительные риски
12. Управленческо-организационные и маркетинговые риски
13. Финансовые и валютные риски
14. Риски участников проекта, включая инвестиционные риски и форсмажор
15. Социальные и военно-политические риски
16. Юридическо-правовые риски
17. Экологические риски
18. Специфические риски
19. Комплексное использование методов управления рисками.
20. Управление рисками в малом предпринимательстве.
21. Организация управления рисками на промышленном предприятии.
22. Организация управления рисками в финансово-кредитном учреждении.
23. Особенности управления рисками финансово-промышленной группы.
24. Особенности управления рисками транснациональной корпорации.
25. Управление рисками инвестиционного проекта
26. Планирование управления рисками

27. Эволюция управления рисками: концепции, подходы и их условия
28. Программа управления рисками: разработка и использование.
29. Система управление проектами
30. Комплексное использование методов управления рисками
31. Информационное обеспечение управления рисками: принципы создания и использования информационной системы организации
32. Избежание риска
33. Лимитирование концентрации риска
34. Диверсификация риска
35. Хеджирование риска
36. Распределение рисков
37. Самострахование (внутреннее страхование рисков)
38. Страхование риска
39. Предпринимательские риски
40. Природно-естественные риски
41. Транспортные риски
42. Коммерческие риски
43. Финансовые риски
44. Управление рисками в антикризисном менеджменте
45. Информационное обеспечение управления рисками
46. Принципы создания и использования информационной системы организации
47. Методы оценки эффективности управления рисками
48. Использование качественных методов анализа и оценки рисков
49. Использование превентивных мероприятий по управлению рисками
50. Методы оценки эффективности управления рисками
51. Использование количественных методов анализа и оценки рисков
52. Прогнозирование потерь от реализации рисков: принципы, подходы, методы.
53. Инновационные технологии в управлении рисками
54. Роль субъективных факторов в управлении рисками
55. Правовое обеспечение деятельности по управлению рисками в РФ
56. Методы реагирования на риск
57. Экологические риски и основные подходы к управлению ими
58. Страхование как инструмент управления рисками
59. Статистические методы оценки рисков: достоинства и недостатки
60. Методы имитационного моделирования в оценке рисковой ситуации
61. Риски развития. Лидерство в снижении издержек и дифференциация.
62. Поиск наиболее эффективного пути развития.
63. Стратегические риски. Стратегическая безопасность. Проблемы и
64. перспективы глобализации
65. Картографирование рисков и построение рискового профиля предприятия

- 66. Мониторинг производственных рисков
- 67. Мониторинг коммерческих рисков
- 68. Мониторинг кредитных рисков
- 69. Мониторинг информационных рисков в инновационной деятельности.
- 70. Мониторинг инвестиционных рисков в инновационной деятельности.
- 71. Диверсификация или распределение рисков
- 72. Резервирование средств на покрытие непредвиденных расходов
- 73. Диссипация риска: преимущества и недостатки
- 74. Передача риска: преимущества и недостатки
- 75. Картографирование рисков и построение рискового профиля
- 76. предприятия
- 77. Оценка эффективности управления предпринимательским риском
- 78. риском
- 79. Диагностика финансового кризиса предприятия. Анализ рисков при
- 80. угрозе банкротства
- 81. Организация системы риск-менеджмента на предприятии
- 82. Методы управления финансовыми рисками. Исследование факторов, влияющих на уровень финансовых рисков организации. Выбор механизмов нейтрализации финансовых рисков.
- 83. Методы управления финансовыми рисками. Исследование факторов, влияющих на уровень финансовых рисков организации. Выбор механизмов нейтрализации финансовых рисков.
- 84. Операционные риски: идентификация и оценка. Выбор критерия управления операционными рисками
- 85. Рыночные риски. Методы оценки и инструменты регулирования
- 86. Риски ликвидности. Анализ денежных потоков организации как метод управления рисками ликвидности. Пути повышения ликвидности и платежеспособности организации
- 87. Риски развития. Лидерство в снижении издержек и дифференциация. Поиск наиболее эффективного пути развития
- 88. Инвестиционные риски: оценка и управление рисками инвестиционного проекта
- 89. Инвестиционные риски: формирование инвестиционного портфеля с учетом риска
- 90. Стратегические риски. Стратегическая безопасность. Проблемы и перспективы глобализации
- 91. Методы управления риском: общая схема процесса управления риском. Выбор методов управления риском на основе оценки их сравнительной эффективности
- 92. Методы управления риском: диверсификация. Анализ существующих подходов к размещению капитала по направлениям деятельности

93. Методы нейтрализации рисков. Рынок форвардов в России.
Хеджирование на основе инструментов FORTS.

Критерии оценки:

- оценка «отлично» выставляется студенту, если он раскрыл выбранную им тему реферата, представил реферат, выступил с презентацией и докладом, показал высокий уровень сформированности компетенции 5 б;

- оценка «хорошо» выставляется студенту, если он раскрыл выбранную им тему реферата, представил реферат, выступил с докладом, показал средний уровень сформированности компетенции (с незначительными замечаниями) 4 б;

- оценка «удовлетворительно» выставляется студенту, если он представил реферат, выступил с докладом, но показал низкий уровень сформированности компетенции (на базовом уровне, с ошибками) 3 б;

- оценка «неудовлетворительно» выставляется студенту, если он не представил реферат, показав недостаточный уровень сформированности компетенции (ответ не дан) - 2 б.

2. Материалы для проведения текущей аттестации
Текущая аттестация 1

АВТНОМНАЯ НЕКОММЕРЧЕСКАЯ ОБРАЗОВАТЕЛЬНАЯ
ОРГАНИЗАЦИЯ ВЫСШЕГО ОБРАЗОВАНИЯ
ЦЕНТРОСОЮЗА РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ
«РОССИЙСКИЙ УНИВЕРСИТЕТ КООПЕРАЦИИ»
КАЗАНСКИЙ КООПЕРАТИВНЫЙ ИНСТИТУТ (ФИЛИАЛ)

Комплект заданий для проведения текущей аттестации
(в форме контрольной работы)

Тема: Система управления рисками

Вариант 1

Задание 1. Предприятия каких отраслей сталкиваются с коммерческими рисками:

- a) промышленности
- b) торговли
- c) строительства
- d) всех отраслей

Задание 2. Как соотносятся понятия коммерческого и финансового риска:

- a) финансовые риски включают в себя коммерческие
- b) коммерческие риски включают в себя финансовые
- c) эти понятия не соотносимы, т. к. относятся к разным классификациям
- d) это синонимы

Задание 3. Что значит управлять риском?

- a) следить за тенденцией его развития
- b) использовать различные меры, позволяющие прогнозировать наступление рискованного события
- c) принимать меры к снижению риска
- d) управлять риском невозможно, т. к. данное понятие изучается теорией вероятности

Задание 4. При классификации рисков выделяют следующие основные группы:

- a) входящие
- b) чистые
- c) текущие
- d) спекулятивные

Задание 5. Спекулятивные риски включают:

- a) имущественный риск
- b) торговый риск
- c) валютный риск

d) инфляционный риск

Вариант 2

Задание 1. Для определения вероятности наступления события используют:

- a) субъективный метод
- b) метод ABC
- c) объективный метод
- d) всё перечисленное верно

Задание 2. Уменьшение степени вероятного риска достигается следующими методами:

- a) хеджированием
- b) передачей риска
- c) страхованием
- d) отказом от сделки
- e) методом красной линии
- f) франчайзингом

Задание 3. Риск, выражающийся в вероятности получить как положительный, так и отрицательный результат:

- a) финансовый
- b) экологический
- c) спекулятивный
- d) чистый

Задание 4. В состав инвестиционных рисков входят:

- a) риск упущенной выгоды
- b) валютный риск
- c) кредитный риск
- d) риск снижения доходности

Задание 5. Факторы, обуславливающие неопределенность хозяйственной ситуации:

- a) цикличность
- b) отсутствие полной информации
- c) противодействие
- d) динамичность
- e) случайность

Тема: Идентификация рисков

Вариант 1

Задание 1. К какому виду риска относится разрыв контракта из-за действий властей страны, в которой находится компания-контрагент:

- a) экономический
- b) предпринимательский
- c) политический
- d) всё перечисленное верно

Задание 2. К какому, из перечисленных ниже, подвиду экологического риска можно отнести вероятность потерь, вызванных спецификой климатических условий, а также наличием природных ресурсов:

- a) природно-климатические
- b) антропогенные
- c) социально-бытовые
- d) всё перечисленное верно

Задание 3. К какому подвиду экологического риска можно отнести вероятность потерь, вызванных заболеваемостью животных и людей инфекционными заболеваниями:

- a) природно-климатические
- b) социально-бытовые
- c) антропогенные
- d) всё перечисленное верно

Задание 4. К какой группе методов управления экологическими рисками относится введение нормативных стандартов и ограничений для производителей:

- a) распределение прав на загрязнение
- b) административное регулирование
- c) система платежей и налогов за экологические загрязнения
- d) создание экономических стимулов

Задание 5. К какой группе методов управления экологическими рисками относится установление платы за выбросы и сбросы, а также за использование ресурсов:

- a) создание экономических стимулов
- b) административное регулирование
- c) система платежей и налогов за экологические загрязнения
- d) распределение прав на загрязнение

Вариант 2

Задание 1. К какой группе методов управления экологическими рисками относится предоставление налоговых кредитов и обеспечение ускоренной амортизации природоохранного оборудования:

- a) создание экономических стимулов
- b) распределение прав на загрязнение
- c) система платежей и налогов за экологические загрязнения
- d) административное регулирование

Задание 2. Определите группу методов управления экологическими рисками, к которой относится введение компенсационных платежей, обеспечивающих уровень загрязнения среды в рамках общих нормативов региона:

- a) система платежей и налогов за экологические загрязнения
- b) распределение прав на загрязнение
- c) административное регулирование
- d) создание экономических стимулов

Задание 3. Определите группу методов управления экологическими рисками, к которой относится предоставление займов с уменьшенной ставкой процента, а также предоставление гарантий по займам:

- a) распределение прав на загрязнение
- b) создание экономических стимулов
- c) административное регулирование
- d) система платежей и налогов за экологические загрязнения

Задание 4. Какой из видов производственного риска приводит к увеличению числа непредвиденных аварийных ситуаций:

- a) использование устаревшего оборудования
- b) нестабильность качества товаров и услуг
- c) выявление новых технологий в отрасли
- d) отсутствие резервных возможностей

Задание 5. Какой из перечисленных видов производственного риска приводит к низкой эффективности производства по сравнению с конкурентами:

- a) ненадёжность составляющих
- b) нестабильность качества товаров и услуг
- c) отсутствие резервных возможностей
- d) выявление новых технологий в отрасли
- e) использование устаревшего оборудования

Критерии оценки:

- оценка «отлично» выставляется студенту, если задание он выполнил задания верно и в полном объеме, показал высокий уровень сформированности компетенции 5 б;

- оценка «хорошо» выставляется студенту, если задания он выполнил с незначительными замечаниями, показал средний уровень сформированности компетенции (с незначительными замечаниями) 4 б;

- оценка «удовлетворительно» выставляется, если задание выполнено на базовом уровне, но с ошибками;

- оценка «неудовлетворительно» выставляется, если содержится большое количество ошибок, задание не выполнено.