

Кафедра

управления

Б1.В.03

ОЦЕНОЧНЫЕ МАТЕРИАЛЫ (СРЕДСТВА)

Учебная дисциплина

Риск - менеджмент

По направлению подготовки

38.04.02

«Менеджмент»

Профиль
(программа магистратуры)

«Управление проектом»

Форма обучения

Очная

Оценочные материалы (средства) дисциплины рассмотрены (актуализированы) и утверждены на заседании кафедры

Протокол заседания № 10 от « 15» мая 2026 г.

Заведующий кафедрой Никитина Наталья Викторовна

Оглавление

1. ПЕРЕЧЕНЬ КОМПЕТЕНЦИЙ И ЭТАПЫ ИХ ФОРМИРОВАНИЯ В ПРОЦЕССЕ ОБУЧЕНИЯ ПО ДИСЦИПЛИНЕ	3
2. ОЦЕНОЧНЫЕ МАТЕРИАЛЫ (СРЕДСТВА) ДЛЯ ТЕКУЩЕГО КОНТРОЛЯ И ОЦЕНКИ ЗНАНИЙ, УМЕНИЙ, НАВЫКОВ, ОБЕСПЕЧИВАЮЩИХ ФОРМИРОВАНИЯ КОМПЕТЕНЦИЙ В ПРОЦЕССЕ ОБУЧЕНИЯ ПО ДИСЦИПЛИНЕ	4
3. ОЦЕНОЧНЫЕ МАТЕРИАЛЫ (СРЕДСТВА) ДЛЯ ПРОВЕДЕНИЯ ПРОМЕЖУТОЧНОЙ АТТЕСТАЦИИ ПО ДИСЦИПЛИНЕ	10
4. МЕТОДИЧЕСКИЕ МАТЕРИАЛЫ, ОПРЕДЕЛЯЮЩИЕ ПРОЦЕДУРЫ ОЦЕНИВАНИЯ ЗНАНИЙ, УМЕНИЙ, НАВЫКОВ, ХАРАКТЕРИЗУЮЩИХ ЭТАПЫ ФОРМИРОВАНИЯ КОМПЕТЕНЦИЙ.....	12
5. ДИАГНОСТИЧЕСКИЕ ЗАДАНИЯ ДЛЯ ОЦЕНКИ ЗНАНИЙ, УМЕНИЙ, НАВЫКОВ, ХАРАКТЕРИЗУЮЩИХ УРОВЕНЬ СФОРМИРОВАННОСТИ КОМПЕТЕНЦИЙ	15
6. ЛИСТ СОГЛАСОВАНИЯ	20

1. ПЕРЕЧЕНЬ КОМПЕТЕНЦИЙ И ЭТАПЫ ИХ ФОРМИРОВАНИЯ В ПРОЦЕССЕ ОБУЧЕНИЯ ПО ДИСЦИПЛИНЕ

Оценочные материалы (средства) сформированы в соответствии с ФГОС ВО по направлению подготовки 38.04.02 «Менеджмент», утвержденного приказом Министерства науки и высшего образования Российской Федерации от «12» августа 2020 г. № 952.. В соответствии с матрицей компетенций основной профессиональной образовательной программы «Управление проектом» в процессе обучения по дисциплине «Риск-менеджмент» происходит формирование закрепленных за дисциплиной компетенций обучающихся. Оценка сформированности компетенций на каждом этапе обучения происходит через оценку планируемых результатов обучения по дисциплине (знаний, умений, навыков).

Результаты освоения образовательной программы (компетенции)	Индикаторы достижения компетенции	Планируемые результаты обучения по дисциплине	Этапы формирования компетенции (семестры, темы)	Оценочные средства
ПК-1 Способен руководить организациями, подразделениями и, группами сотрудников, осуществляющих аналитическую деятельность и использовать результаты анализа в управлении проектом и бизнес-процессами.	ПК-1.3. Использует результаты проведенного анализа возможных рисков в разработке комплекса мероприятий по их минимизации, в том числе при реализации проекта;	Знать: способы и инструменты управления рисками с целью проведения исследований в проекте Уметь: оценивать возможные риски и использовать методы управления рисками; Владеть: навыком методов оценки и управления рисками при реализации проекта;	Семестр 4 Тема 1 Основные теории риск-менеджмента Тема 2. Управление риском проекта как основа принятия решений. Тема 3. Организация риск-менеджмента Тема 4. Методы качественной и количественной оценки рисков проекта.	Тема 1, 2, 3, 4 Устный опрос Тема 2 Участие в семинаре дискуссии Проверочная Тема 3, 4 Выполнение практического задания

2. ОЦЕНОЧНЫЕ МАТЕРИАЛЫ (СРЕДСТВА) ДЛЯ ТЕКУЩЕГО КОНТРОЛЯ И ОЦЕНКИ ЗНАНИЙ, УМЕНИЙ, НАВЫКОВ, ОБЕСПЕЧИВАЮЩИХ ФОРМИРОВАНИЯ КОМПЕТЕНЦИЙ В ПРОЦЕССЕ ОБУЧЕНИЯ ПО ДИСЦИПЛИНЕ

Примерные вопросы для подготовки к устному опросу

Тема 1. Основные теории риск-менеджмента

1. В чем основное содержание риск-менеджмента как сферы финансового менеджмента?
2. Назовите этапы эволюция науки риск-менеджмента?
3. Назовите основные цели и задачи риск-менеджмента в организации?
4. Какие основные формы политики риск-менеджмента, вы знаете?
5. Назовите основные стратегия управления рисками?
6. Что собой представляет тактика управления рисками?
7. Назовите причины риска, определение риска, вероятность риска?
8. Становление и развитие теории риска?
9. Классификация рисков, выделение однородных групп рисков?
10. Назовите основные виды рисков?
11. Какие сферы проявления вы знаете и какие факторы влияют на возникновения рисков?

Тема 2. Управление риском проекта как основа принятия решений.

1. Опишите уровни управления риском проекта: стратегический, тактический, операционный?
2. Что такое интегративный подход в риск-менеджменте?
3. Опишите системный подход в риск-менеджменте.
4. Какова взаимосвязь риск-менеджмента и общей системы управления проектами?
5. Каковы цели, задачи идентификации рисков?
6. Какие методы можно использовать для качественного анализа рисков проекта?
7. Назовите задачи количественной оценки рисков проекта.
8. Каково назначение обобщающих показателей риска?
9. Дайте определение системе управления рисками проекта?
10. Состояние и перспективы развития стандартов управления рисками в РФ?
11. Основные подходы в риск-менеджменте?
12. Что собой представляет процесс управления рисками?
13. Системы менеджмента риска: Стандарт ИСО 31000-2019 - Менеджмент риска.

14. Системы менеджмента риска: ИСО/МЭК 31010-2011. Менеджмент риска. Назовите методы оценки риска?
15. Основные положения современных стандартов, разработанных международными профессиональными объединениями риск-менеджмента.
16. Основные идеи и концепции, положенные в основу современных стандартов риск-менеджмента, изданных национальными органами по стандартизации.
17. Состояние и перспективы развития стандартов управления рисками в мире.
18. Как трактуют стандарты понятие риск-менеджмента? В чем причина различий содержания термина?

Тема 3. Организация риск- менеджмента

1. Назовите организационные структуры службы риск-менеджмента?
2. Что собой представляет процессный подход к риск-менеджменту в организации?
3. Опишите внешний и внутренний мониторинг рисков?
4. Определите роль планирования в системе риск-менеджмента?
5. Назовите функции управления риском?
6. В чем проявляется организационная функция риск-менеджмента?
7. В чем роль мотивация как функция риск-менеджмента?
8. Определите регулирование и его роль в осуществлении риск-менеджмента?
9. Назовите основные этапы управления рисками?
10. Охарактеризуйте систему управления рисками и ее составляющих: объекты и субъекты управления?
11. Понятие методов управления рисками и их виды?
12. Характеристика экономических методов управления рисками?
13. Дайте характеристику методам снижения рисков: диверсификация, лимитирование, хеджирование, улучшение информационного обеспечения деятельности и другие?
14. Назовите методы передачи и компенсации рисков: резервирование, передача риска, страхование и другие?
15. Назовите проблемы формирования рискового сознания работников организации?
16. Перечислите принципы, цели и задачи риск-менеджмента?
17. Назовите основные подходы в риск-менеджменте?
18. Что собой представляет процесс управления рисками?

Тема 4. Методы качественной и количественной оценки рисков проекта

1. Назовите цели и задачи качественного анализа рисков?
2. Назовите методы качественного анализа рисков?
3. В чем особенности количественного анализа рисков?
4. Назовите методы количественного анализа рисков?

5. Что означает термин «оценка риска» в стандарте ISO 31000?
6. Какие методы идентификации событий применяются в стандарте ISO 31000
7. Раскройте содержание управления рисками по методике FEMA?
8. Каким образом осуществляется влияние ключевых внешних и внутренних факторов риска на проект?
9. Этапы проведения анализа рисков по методике FEMA?
10. Что такое мониторинг рисков по методике FEMA?

Критерии оценивая устного опроса:

- оценка **«отлично»** выставляется обучающему , если он ответил развернуто на один из заданных вопросов, активно дополнял ответы других студентов или задавал им дополнительные вопросы;
- оценка **«хорошо»** выставляется обучающему , если он ответил развернуто на один из заданных вопросов или ответил кратко на ряд вопросов;
- оценка **«удовлетворительно»** выставляется обучающему, если он кратко ответил на один из задаваемых вопросов или просто дополнял ответы других студентов, задавал им дополнительные вопросы;
- оценка **«неудовлетворительно»** выставляется обучающему , если он не смог ответить правильно на заданный вопрос, либо не отвечал на вопросы и не участвовал в их обсуждении.

Примерные темы для проведения семинара - дискуссии

Тема 2. Управление риском проекта как основа принятия решений.

1. Основные теории рисков.
2. Экономическое содержание и функции риска.
3. Управление риском проекта и его характерные признаки.
4. Дискуссионные вопросы возникновения и управления рисками проекта
5. Финансовый рынок и его характеристика. Виды финансовых рисков.
6. Производственный риск и методы управления
7. Коммерческий риск как вид риска, методы управления
8. Инновационный риск как разновидность риска.
9. Технический риск как разновидность предпринимательского риска.
10. Инновационный риск и его воздействие на результаты управления проектом
11. Характеристика внешнеэкономических рисков и методы их минимизации
12. Отраслевой риск как разновидность риска
13. Основные способы и критерии оценки рисков
14. Понятие кредитных рисков и методы управления ими
15. Характеристика инвестиционных рисков и методы управления

Критерии оценивая выступления на семинаре-дискуссии:

оценка «отлично» выставляется обучающемуся, если он выступил развернуто по теме или пол несколькими темам, активно участвовал в обсуждении и дополнял ответы других обучающихся или задавал им дополнительные вопросы;

оценка «хорошо» выставляется обучающемуся, если он выступил развернуто по теме, дополнял выступления других обучающихся или ответил кратко на ряд вопросов;

оценка «удовлетворительно» выставляется обучающемуся, если он кратко выступил по теме или просто дополнял ответы других обучающихся, задавал им дополнительные вопросы;

оценка «неудовлетворительно» выставляется обучающемуся, если он не смог выступить по теме, ответить правильно на заданный вопрос, либо не отвечал на вопросы и не участвовал в их обсуждении.

Практические задания

Тема 3 Организация риск - менеджмента

Задание 1. Рассмотрим два финансовых проекта А и В, для которых возможные нормы доходности (IRR) находятся в зависимости от будущего состояния экономики. Рассчитайте для каждого из проектов ожидаемую норму доходности ERR. Данная зависимость отражена в таблице.

Таблица Данные для расчета ожидаемой нормы доходности вариантов вложения капитала инвестиционных проектов А и В

Состояние экономики	Вероятность данного состояния	Проект А, IRR	Проект В, IRR
Подъем	$P_1 = 0,25$	90%	25%
Норма	$P_2 = 0,5$	20%	20%
Спад	$P_3 = 0,25$	-50%	15%

Задание2. Руководство предприятия имеет два инвестиционных проекта. Первый с вероятностью 0,6 обеспечивает прибыль 15 млн руб., однако с вероятностью 0,4 можно потерять 5,5 млн руб. Для второго проекта с вероятностью 0,8 можно получить прибыль 10 млн руб. и с вероятностью 0,2 потерять 6 млн руб. Какой проект выбрать?

Задание3. Какую альтернативу следует выбрать? Выбор альтернативы. Компания изучает возможность производства и сбыта навесов для хранения кормов. Проект может основываться на большой или малой производственной базе. Рынок для реализации навесов может быть благоприятным или неблагоприятным. Менеджер компании учитывает возможность вообще не производить эти навесы. При благоприятной рыночной ситуации большое производство 41 позволило бы менеджеру получить чистую прибыль 200 тыс. руб. Если рынок окажется неблагоприятным, то при большом производстве компания понесет убытки в размере 180 тыс. руб. Малое производство дает 100 тыс. руб. прибыли при благоприятной рыночной ситуации и 20 тыс. руб. убытков при неблагоприятной.

Задание 4. Следует ли воспользоваться услугами указанной фирмы? Даже если результаты исследования являются совершенно точными, оправдана ли плата 65 тыс. руб.?

Ситуация. Принятие решения об использовании дополнительной информации. Предположим, что менеджер компании (см. пример 1) связался с фирмой, занимающейся исследованием

рынка, которая предложила ему помощь в принятии решения о том, стоит ли создавать производство навесов для хранения кормов. Исследователи рынка утверждают, что их анализ позволит установить с полной определенностью, будет ли рынок благоприятным для данного продукта. Другими словами, условия для компании меняются от принятия решений в условиях риска к принятию решений в условиях определенности. Эта информация может предостеречь менеджера от очень дорогостоящей ошибки. Фирма, занимающаяся исследованием рынка, хотела бы получить за эту информацию 65 тыс. руб.

Задание 5. Следует ли проводить обследование рынка? Предположим, что менеджеру надо принять два решения, причем второе решение зависит от исхода первого. Прежде чем создать новое производство, менеджер намерен заказать исследование рынка и заплатить за него 10 тыс. руб. Результаты этого исследования могли бы помочь решить вопрос о том, следует ли создавать большое производство, малое производство или не делать ничего. Менеджер понимает, что такое 44 обследование рынка не может дать достоверную информацию, но может, тем не менее, оказаться полезным.

Тема 4. Методы качественной и количественной оценки рисков проекта.

Задание 1 Инвестиции в бизнес составили 500 тыс. р. Ожидаемые доходы (CF_i) за 5 лет составят: 2021 год – 100 тыс. р.; 2022 год – 150 тыс. р.; 2023 год – 200 тыс. р.; 2024 год – 250 тыс. р.; 2025 год – 300 тыс. р. Ставка дисконтирования 20%. Обосновать целесообразность проекта и рассчитать:

1. Чистый дисконтированный доход (NPV) за 5 лет;
2. Индекс рентабельности инвестиций (PI);
3. Сроки окупаемости простой и дисконтированный;
4. Внутреннюю норму доходности (IRR)

Задание 2 Инвестиции в бизнес составили 2150 тыс. р. Ожидаемые доходы (CF_i) за 5 лет составят: 2021 год – 300 тыс. р.; 2022 год – 380 тыс. р.; 2023 год – 450 тыс. р.; 2024 год – 500 тыс. р.; 2025 год – 560 тыс. р. Ставка дисконтирования 20%. Обосновать целесообразность проекта и рассчитать:

1. Чистый дисконтированный доход (NPV) за 5 лет;
2. Индекс рентабельности инвестиций (PI);
3. Сроки окупаемости простой и дисконтированный;
4. Внутреннюю норму доходности (IRR).

Задание 3 Укажите верную последовательность этапов управления проектными рисками:

- А) разработка мероприятий по снижению уровня риска;
- Б) принятие риска;
- В) формирование команды управления рисками;
- Г) определение необходимости управления рисками;
- Д) проведение мероприятий;
- Е) контроль действий.

Задание 4 Перечислите основные достоинства и недостатки представленных методов идентификации рисков.

Метод	Достоинства	Недостатки
Обзор и анализ документации		
«Мозговой штурм»		
Статистическое исследование		
Диаграмма Исикавы		
Экспертный метод		

Задание 5 Компания «Медприбор» (публичное акционерное общество, акции котируются на фондовой бирже) – предприятие по производству медицинского оборудования. Предприятие создано 10 лет назад научными работниками и инженерами как общество с ограниченной ответственностью, было преобразовано в открытое акционерное общество, а затем в публичное акционерное общество. Сейчас компания является крупным игроком на рынке медицинского оборудования. Компания пытается включиться в федеральную программу импортозамещения и инициирует запуск новых важных проектов. Компания ставит своей целью в ближайшие 5 лет существенно увеличить свою долю на рынке и улучшить показатели эффективности бизнеса. Но у компании есть серьезные конкуренты, также разрабатывающие высококачественное медицинское оборудование, уже внедрившие у себя ряд лучших управленческих практик, в том числе в области управления проектами. Конкуренты начинают разрабатывать крупные проекты по дальнейшему укреплению своих рыночных позиций. В настоящее время компания «Медприбор» предполагает осуществить ряд организационных изменений, в том числе начать внедрение системы управления проектами и делает первые шаги в данном направлении. Перед разработчиками проекта поставлены жесткие сроки. Вероятность их выполнения составляет примерно 80%. Ущерб от нарушения установленного времени разработки и производства прибора будет связан с потерей прибыли от более позднего выхода на рынок. Кроме того, есть вероятность появления на рынке разработок ряда конкурентов, что является дополнительным риском. Данные риски могут быть снижены путем применения новых технологий, которые еще не апробированы в полной мере, и навыки эффективного их использования у компании недостаточны. Приобретение этих технологий требует инвестиций, сопоставимых по своим размерам с прибылью, недополученной в результате потери рынка (вследствие нарушения сроков), но вероятность успеха в создании и производстве на их основе нового прибора равна примерно 70%. В случае успеха компания выйдет на рынок с новым прибором на 3 месяца ранее установленного срока. Толерантность к риску – показатель, который свидетельствует о том, какой объем риска компания в действительности готова понести в зависимости от специфических рисков. Риск-аппетит – тот объем риска, который предполагается принять для достижения общих операционных и финансовых целей. Предприятие имеет низкую толерантность и аппетит к риску. Аналогичное отношение к риску имеют менеджер проекта, его заместители и ведущие специалисты. В компании отсутствует система управления рисками.

Задание:

1. Как предприятию преодолеть возникающие проблемы?
2. Как выстроить систему управления проектом с учетом воздействия на снижение основных рисков?
3. Идентифицируйте комплекс имеющихся рисков.
4. Разработайте укрупненный план управления рисками, предложите систему мониторинга рисков.
5. Какие стратегии следует использовать компании для ответа на риски?

Критерии оценивания практических работ

оценка «отлично» выставляется обучающемуся, если в работе зафиксированы логичные и понятные ответы на все вопросы; там, где необходимо, присутствуют расчеты и пояснения; у схем есть объясняющий текст, название; соблюдены правила оформления работы.

оценка «хорошо» выставляется обучающемуся, если ответы на вопросы зафиксированы недостаточно полно и понятно; в расчетах есть недочёты; пропущен один вопрос; правила оформления работы соблюдены.

оценка «удовлетворительно» выставляется обучающемуся, если работа сделана не полностью; ответы зафиксированы не на все вопросы; аналитических расчетов не хватает или в их изображении есть нелогичность, ошибки; работа оформлена не совсем верно и корректно.

оценка «неудовлетворительно» выставляется обучающемуся, если работа не сдана; работа списана у других обучающихся; в ответах на вопросы нет логики; схем мало, они с ошибками или схем нет совсем.

3. ОЦЕНОЧНЫЕ МАТЕРИАЛЫ (СРЕДСТВА) ДЛЯ ПРОВЕДЕНИЯ ПРОМЕЖУТОЧНОЙ АТТЕСТАЦИИ ПО ДИСЦИПЛИНЕ

ОЦЕНКА ЗНАНИЙ ОБУЧАЮЩИХСЯ НА ЭКЗАМЕНЕ

Список вопросов для подготовки к экзамену

ПК-1Способен руководить организациями, подразделениями, группами сотрудников, осуществляющих аналитическую деятельность и использовать результаты анализа в управлении проектом и бизнес-процессами.

ПК-1.3.Использует результаты проведенного анализа возможных рисков в разработке комплекса мероприятий по их минимизации, в том числе при реализации проекта;

Обучающийся знает способы и инструменты управления рисками с целью проведения исследований в проекте;

Экономическое содержание рисков.

1. Основные источники рисков.
2. Риск несбалансированной ликвидности банка и процентный риск.
3. Критерии количественной оценки риска.
4. Методы количественной оценки рисков.
5. Этапы управления рисками.
6. Финансовый риск банкротства как основное проявление финансовых рисков.
7. Составляющие микросреды финансовой деятельности предпринимательства.
8. Показатели инвестиционной доходности.
9. Основные понятия классификации рисков. Классификация экономических рисков по Дж. Кейнсу.
10. Современная классификация предпринимательских рисков.
11. Экономическое содержание и классификация рисков.
12. Экономическое содержание и классификация инвестиционных рисков.
13. Характеристика процесса анализа рисков.
14. Методы качественной оценки рисков.
15. Финансовое состояние предприятия и риск банкротства.
16. Группировка активов предприятия по группам их риска.
17. Понятие и критерии несостоятельности (банкротства) предприятия и его нормативно-правовое регулирование.
18. Зарубежная практика оценки вероятности банкротства.
19. Отечественная практика оценки вероятности банкротства.
20. Особенности применения отечественных и зарубежных моделей оценки риска

21. Объективные и субъективные причины возникновения риска предприятия.
22. Анализ финансовых потоков как метод оценки риска и метод критериев банкротства.
23. Характеристика модели комплексной бальной оценки финансового риска предприятия.
24. Характеристика теорий предпринимательских рисков.
25. Правила «доминирования» при оценке инвестиционного риска.
26. Критерии количественной оценки предпринимательских рисков.
27. Составляющие макросреды финансовой деятельности предпринимателя.
28. Проявление рисков для фирм-производителей.
29. Классификация и содержание рисков.
30. Современная классификация предпринимательских рисков.
31. Субъекты инвестиционного риска.
32. Основные проявления финансовых и инвестиционных рисков и их анализ.
33. Виды конкуренции микросреды предпринимательства.
34. Функции предпринимательских рисков.
35. Основные проявления финансовых и инвестиционных рисков.
36. Систематические инвестиционные риски.
37. Критерии и основные методы количественной оценки предпринимательских рисков.
38. Характеристика и субъекты инвестиционных рисков.
39. Метод оценки предпринимательского риска с помощью «Дерева решений».
40. Основные подходы к управлению рисками и их содержание.
41. Основные группы методов управления рисками.
42. Содержание метода избежания риска и условия его применения.
43. Основные приемы уклонения от риска.
44. Содержание методов удержания (сохранения) риска и особенности их применения.
45. Основные формы самострахования как приема снижения уровня риска, его положительные и отрицательные стороны.
46. Методы снижения риска.
47. Основные формы диверсификации рисков.
48. Основные формы лимитирования (локализации) рисков.
49. Основные методы передачи риска.
50. Договорные формы передачи риска.
51. Методы и виды хеджирования финансовых рисков.
52. Методы снижения финансовых рисков.
53. Методы передачи финансовых рисков.
54. Методы компенсации риска.
55. Разработка политики управления рисками на предприятии.

ОЦЕНКА УМЕНИЙ И НАВЫКОВ ОБУЧАЮЩИХСЯ НА ЭКЗАМЕНЕ

ПК-1Способен руководить организациями, подразделениями, группами сотрудников, осуществляющих аналитическую деятельность и использовать результаты анализа в управлении проектом и бизнес-процессами.

ПК-1.3.Использует результаты проведенного анализа возможных рисков в разработке комплекса мероприятий по их минимизации, в том числе при реализации проекта;

Обучающийся умеет: оценивать возможные риски и использовать методы управления рисками

Обучающийся владеет: навыком методов оценки и управления рисками при реализации проекта

Оценка достижения обучающимся запланированного результата обучения осуществляется по результатам устных опросов, выполнения практических заданий и участия в семинаре

дискуссии в которых ему необходимо применить навыки методов оценки и управления рисками при реализации проекта;

4. МЕТОДИЧЕСКИЕ МАТЕРИАЛЫ, ОПРЕДЕЛЯЮЩИЕ ПРОЦЕДУРЫ ОЦЕНИВАНИЯ ЗНАНИЙ, УМЕНИЙ, НАВЫКОВ, ХАРАКТЕРИЗУЮЩИХ ЭТАПЫ ФОРМИРОВАНИЯ КОМПЕТЕНЦИЙ

ПРОЦЕДУРА ПРОВЕДЕНИЯ ПРОМЕЖУТОЧНОЙ АТТЕСТАЦИИ

Для оценки результатов обучения по дисциплине учебным планом предусмотрен экзамен, проводимый в форме устного ответа на теоретический вопрос. При выставлении итоговой оценки по дисциплине учитываются результаты текущего контроля, отражающего сформированность практических умений и навыков обучающегося. Во время обучения обучающиеся участвуют в разных мероприятиях текущего контроля: выполняют практические работы, выступают с на семинаре дискуссии, отвечают на устные вопросы. Обучающиеся, не выполнившие в полном объеме все задания промежуточного контроля, не допускаются к сдаче экзамена по данной учебной дисциплине.

КРИТЕРИИ ОЦЕНИВАНИЯ СФОРМИРОВАННОСТИ КОМПЕТЕНЦИЙ

Планируемые результаты обучения (показатели достижения заданного уровня освоения компетенций)	Критерии оценивания результатов обучения				
	1	2	3	4	5
ПК-1 Способен руководить организациями, подразделениями, группами сотрудников, осуществляющих аналитическую деятельность и использовать результаты анализа в управлении проектом и бизнес-процессами.					
ПК-1.3. Использует результаты проведенного анализа возможных рисков в разработке комплекса мероприятий по их минимизации, в том числе при реализации проекта;					
Знать: способы и инструменты управления рисками с целью проведения исследований в проекте;	Не знает	Фрагментарные знания способов и инструменты управления рисками с целью проведения исследований в проекте	Общие, но не структурированные знания способов и инструменты управления рисками с целью проведения исследований в проекте	Сформированное, но содержащее отдельные пробелы знание способов и инструменты управления рисками с целью проведения исследований в проекте	Сформированное систематизированное прочное знание способов и инструменты управления рисками с целью проведения исследований в проекте

Планируемые результаты обучения (показатели достижения заданного уровня освоения компетенций)	Критерии оценивания результатов обучения				
	1	2	3	4	5
Уметь: оценивать возможные риски и использовать методы управления рисками	Не умеет	Частично освоенное умение оценивать возможные риски и использовать методы управления рисками	В целом освоенное, но не подкрепляемое знаниями и самостоятельностью реализации умение оценивать возможные риски и использовать методы управления рисками	В целом сформированное и самостоятельно реализуемое, но не всегда интеллектуально обоснованное умение оценивать возможные риски и использовать методы управления рисками	Успешно сформированные, самостоятельно и осознанно реализуемое умение оценивать возможные риски и использовать методы управления рисками
Владеть: навыком методов оценки и управления рисками при реализации проекта	Не владеет	Фрагментарно сформированные навыки владения методами оценки и управления рисками при реализации проекта	В целом сформированные, но реализуемые на элементарном уровне навыки владения методами оценки и управления рисками при реализации проекта	Сформированные, но не устойчивые в сложных ситуациях навыки владения методами оценки и управления рисками при реализации проекта	Успешно сформированные, устойчивые, технологически грамотно реализуемые навыки владения методами оценки и управления рисками при реализации проекта

КРИТЕРИИ ОЦЕНКИ РЕЗУЛЬТАТОВ ОБУЧЕНИЯ ПО ДИСЦИПЛИНЕ

При выставлении итоговой оценки за дисциплину необходимо учитывать результаты текущего контроля и критерии оценивания сформированности компетенций.

Критерии оценивания сформированности компетенций:

Оценка «**отлично**» выставляется обучающемуся, если:

- при ответе на теоретический вопрос были продемонстрированы глубокие, систематизированные и прочные знания (в соответствии с критериями сформированности компетенций), умения логично и обоснованно излагать материал, быстро ориентироваться в дополнительных вопросах и давать полные ответы;

- практические работы выполнены безошибочно и в полном соответствии с требованиями на оценку «отлично», обучающийся в работе продемонстрировал устойчивые навыки аналитической работы;
- Все вышеперечисленное говорит о сформированности запланированных компетенций.

Оценка **«хорошо»** выставляется обучающемуся, если:

- при ответе на теоретический вопрос было продемонстрировано хорошее, но недостаточно полное изложение материала, с отдельными пробелами в знаниях (возможно, незначительными неточностями в употреблении терминов), логичное изложение материала, но недостаточно быстрая ориентация в нем при ответе на дополнительные вопросы;
- практические работы выполнены на оценку «отлично» или «хорошо» (с незначительными замечаниями и/или ошибками), обучающийся продемонстрировал хорошие навыки аналитической работы;
- Все вышеперечисленное говорит о сформированности запланированных компетенций.

Оценка **«удовлетворительно»** выставляется обучающемуся, если:

- при ответе на теоретический вопрос было продемонстрировано поверхностное владение материалом и фрагментарные знания, отсутствие стройного и логично выстроенного ответа, затруднение в употреблении терминов и приведении примеров, плохая ориентация в материале при ответе на дополнительные вопросы;
- практические работы выполнены на оценку «хорошо» или «удовлетворительно» (с ошибками и замечаниями), с отклонениями от требований, обучающийся затруднялся в объяснении применяемых средств;
- Все вышеперечисленное говорит о частичной сформированности запланированных компетенций.

Оценка **«неудовлетворительно»** выставляется обучающемуся, если:

- при ответе на теоретический вопрос было продемонстрировано незнание значительного объема материала, «фрагментарность» имеющихся знаний, отсутствие стройного и логично выстроенного ответа, затруднение в употреблении терминов и приведении примеров, неумение выделить главное, сделать выводы и обобщения, неспособность отвечать на дополнительные вопросы;
- практические работы выполнены на оценку «неудовлетворительно» со значительными отклонениями от требований, с грубыми ошибками и множеством замечаний, обучающийся продемонстрировал частично сформированные навыки аналитической работы, затрудняется в объяснении применяемых средств. Все вышеперечисленное говорит о несформированности запланированных компетенций.

5. ДИАГНОСТИЧЕСКИЕ ЗАДАНИЯ ДЛЯ ОЦЕНКИ ЗНАНИЙ, УМЕНИЙ, НАВЫКОВ, ХАРАКТЕРИЗУЮЩИХ УРОВЕНЬ СФОРМИРОВАННОСТИ КОМПЕТЕНЦИЙ

ПК-1 Способен руководить организациями, подразделениями, группами сотрудников, осуществляющих аналитическую деятельность и использовать результаты анализа в управлении проектом и бизнес-процессами.

Обучающийся знает:

способы и инструменты управления рисками с целью проведения исследований в проекте

Обучающийся умеет: оценивать возможные риски и использовать методы управления рисками

Обучающийся владеет: навыком методов оценки и управления рисками при реализации проекта

ЗАДАНИЯ ЗАКРЫТОГО ТИПА

1. 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

2. 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

3. 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

4. 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) умение ликвидировать такие последствия;
- e) **разработка и осуществление мер, при помощи которых могут быть нейтрализованы или компенсированы вероятные негативные результаты предпринимаемых действий.**

5. Классическая теория предпринимательского риска ((Дж. Милль, Н.У. Сениор) отождествляет риск с...

- a) Математическим ожиданием возможных потерь от предпринимательской деятельности;
- b) Вероятностью наступления рискованного события;
- c) Неопределенностью предпринимательской деятельности.

6. С чем связано возникновение социальной неопределенности при принятии рискованных решений?

- a) С влиянием личностных характеристик руководителя и исполнителей;
- b) **С неопределенностью внешней среды;**
- c) С возникновением различных социальных связей и коммуникаций при реализации решений.

7. Спекулятивные (динамические, коммерческие) риски -

- a) Всегда несут потери для предпринимательской деятельности;
- b) **Могут нести как потери, так и дополнительную прибыль;**
- c) Характеризуют дополнительные возможности получения прибыли.

8. Риск неправильного выбора видов вложения капитала, вида ценных бумаг для инвестирования в сравнении с другими видами ценных бумаг при формировании инвестиционного портфеля представляет собой:

- a) **Селективный риск;**
- b) Биржевой риск;
- c) Деловой риск;
- d) Кредитный риск.

9. Косвенные потери прибыли, связанные с воздействием рискованных факторов, представляют собой:

- a) Потери от невыполнения операции, незаключения сделки, нереализации товара;
- b) **Затраты на организацию и проведение мероприятий по управлению рисками;**
- c) Возможные потери, возникающие при совершении бизнес-операции.

10. Риск ликвидности представляет собой:

- a) Опасность потери стабильности финансового положения из-за низкой доли собственного капитала в общей сумме используемых финансовых средств;
- b) Риск временных потерь и потерь первоначальной стоимости при превращении активов в наличные денежные средства;
- c) **Риск неспособности фирмы покрывать свои финансовые обязательства своими активами.**

Уметь: оценивать возможные риски и использовать методы управления рисками;

Задание 1. Ваша компания планирует запустить новый продукт на рынок, и вам необходимо оценить возможные риски.

Ответ: Для оценки возможных рисков провести анализ конкурентной среды, потенциальной спроса на продукт, затрат на разработку и маркетинг, а также других факторов, влияющих на

успех продукта. Затем разработать план управления рисками, включающий в себя меры по снижению рисков и стратегии реагирования на них.

Задание 2. Ваша компания планирует инвестировать в новый проект, и вам необходимо оценить возможные финансовые риски.

Ответ: Для оценки финансовых рисков провести анализ потенциальной доходности проекта, затрат на его реализацию, возможных изменений в рыночной ситуации и других факторов, влияющих на успешность инвестиций. Затем разработать стратегию управления финансовыми рисками, включающую в себя диверсификацию портфеля, страхование и другие методы снижения рисков.

Задание 3. Ваша компания планирует запустить новую производственную линию, и вам необходимо оценить возможные операционные риски.

Ответ: Для оценки операционных рисков провести анализ производственных процессов, технического состояния оборудования, квалификации персонала и других факторов, влияющих на эффективность производства. Затем разработать план управления операционными рисками, включающий в себя меры по предотвращению аварийных ситуаций и стратегии реагирования на них.

Задание 4. Ваша компания планирует расширить свою деятельность на новые рынки, и вам необходимо оценить возможные риски этого шага.

Ответ: Для оценки рисков расширения на новые рынки провести анализ конкурентной среды, политической и экономической стабильности новых рынков, потенциальной спроса на продукцию компании и других факторов, влияющих на успех расширения. Затем разработать стратегию управления рисками, включающую в себя адаптацию маркетинговых стратегий, диверсификацию продуктов и другие методы снижения рисков.

Задание 5. Ваша компания планирует провести переговоры о слиянии с другой компанией, и вам необходимо оценить возможные юридические и финансовые риски.

Ответ: Для оценки юридических и финансовых рисков слияния провести анализ юридических обязательств другой компании, ее финансового состояния, возможных последствий для текущих бизнес-процессов и других факторов, влияющих на успешность слияния. Затем разработать стратегию управления рисками, включающую в себя правовую защиту интересов компании и финансовые гарантии.

Задание 6. Вы управляете проектом по разработке нового продукта, и вам необходимо оценить риски, связанными с технической сложностью проекта. Какие методы оценки и управления рисками вы примените?

Ответ: Провести анализ SWOT, определить потенциальные угрозы и возможности проекта, разработаю стратегии управления рисками, используя матрицу вероятности и воздействия, и создам план действий для минимизации технических рисков.

Задание 7. Ваша компания планирует расширение на новый рынок, и вам необходимо оценить риски, связанными с изменениями внешней среды. Какие методы оценки и управления рисками вы используете?

Ответ: Применить анализ PESTLE для определения факторов внешней среды, провести SWOT-анализ для оценки внутренних возможностей и угроз, а также разработать стратегии управления рисками, включая диверсификацию и защиту от внешних факторов.

Задание 8. Ваша компания планирует внедрить новую информационную систему, и вам необходимо оценить риски, связанные с техническими проблемами во время реализации проекта. Какие методы оценки и управления рисками вы примените?

Ответ: Провести анализ предшествующих проектов, определить потенциальные технические проблемы, разработать планы реагирования на критические ситуации, и внедрить стратегии мониторинга и контроля, чтобы предотвратить технические риски.

Задание 9. Ваша компания решила провести реструктуризацию бизнес-процессов, и вам необходимо оценить риски, связанными с изменениями внутренней организации. Какие методы оценки и управления рисками вы используете?

Ответ: провести анализ текущих бизнес-процессов, определить потенциальные препятствия и сопротивление со стороны персонала, разработать план обучения и коммуникации, и внедрить стратегии мотивации для управления изменениями.

Задание 10. Ваша компания планирует масштабное сокращение издержек, и вам необходимо оценить риски, связанные с возможным снижением производительности и уровня обслуживания. Какие методы оценки и управления рисками вы примените?

Ответ: провести анализ возможных последствий сокращений, определить критические области, разработать планы поддержания эффективности и качества обслуживания, и внедрить стратегии мониторинга и отслеживания результатов для управления рисками.

Владеть: навыком методов оценки и управления рисками при реализации проекта.

Задание 1. Вы являетесь менеджером проекта по разработке нового программного обеспечения. Ваша команда столкнулась с рядом потенциальных рисков, которые могут оказать влияние на успешное завершение проекта. Ваша задача - применить методы управления рисками для минимизации их воздействия.

Ответ: Потенциальные риски:

1. Изменения в требованиях заказчика.
2. Отсутствие опыта у части членов команды в новых технологиях.
3. Задержки в поставке необходимых ресурсов.
4. Несоответствие качества разработки ожиданиям заказчика.

1. Идентифицировать каждый потенциальный риск более детально, описать возможные последствия и вероятность их возникновения.
2. Оценить влияние каждого риска на проект, используя шкалу от 1 до 10 (где 1 - минимальное влияние, 10 - максимальное влияние).
3. Разработать план действий по управлению каждым риском: описать способы снижения вероятности возникновения и последствий в случае реализации риска.
4. Рассмотреть возможные альтернативные варианты и резервные планы по каждому риску.

После завершения анализа и разработки планов управления рисками, представить составленные списки рисков, оценки и планы их управления. Убедитесь, что каждый риск имеет соответствующие стратегии по смягчению его последствий. Важно также выделить основные уроки, которые можно извлечь из процесса анализа рисков для будущих проектов.

Задание 2. Вы руководите проектом строительства моста. Ваша команда столкнулась с возможными рисками, которые могут повлиять на сроки и бюджет проекта. Определите риски, разработайте стратегии и действия по управлению ими.

Ответ: Потенциальные риски:

1. Погодные условия: дождь и снег могут замедлить строительство.
2. Недостаточное качество материалов.
3. Задержка в поставках материалов.

4. Бюрократические препятствия: изменения в законодательстве, требуемые дополнительные разрешения.

5. Возможность забастовок рабочих.

После проведения анализа и разработки стратегий управления рисками, необходимо создать документ с описанием каждого риска, оценкой его влияния и конкретными действиями по управлению. Уделите особое внимание мониторингу рисков на протяжении всего процесса строительства моста и корректировке планов по мере необходимости. Важно также извлечь уроки из этого опыта для будущих проектов и улучшения процесса управления рисками.

Задание 3. Вы управляете проектом строительства жилого комплекса. Проект столкнулся с риском изменения цен на строительные материалы. Вам необходимо провести анализ этого риска с помощью соответствующих методов и расчетов.

Данные:

- Стоимость строительства комплекса: \$10 млн.
- Вероятность увеличения цен на материалы: 30%.
- Ожидаемое увеличение цен в случае изменения: 15%.

Ответ:

1. Рассчитать возможные потери в случае увеличения цен на строительные материалы.
2. Провести анализ вероятности возникновения риска и его возможных последствий.
3. Разработайте стратегию управления риском: определите возможные способы снижения воздействия риска на проект.
4. Изучить варианты страхования от изменения цен или заключения фиксированных контрактов с поставщиками.

Расчеты:

1. Потери в случае увеличения цен:

[Потери = Стоимость строительства $\times$ % увеличения цен = 10 млн $\times$ 0.15 = 1.5 млн долларов. \]

2. Оценка риска:

[Оценка\ риска = Вероятность\ увеличения\ цен $\times$ % увеличения цен = 0.30 $\times$ 0.15 = 0.045 = 4.5\%. \]

В результате анализа риска изменения цен на строительные материалы с учетом проведенных расчетов, предлагается использовать стратегию страхования от изменения цен или заключения долгосрочных контрактов с поставщиками для минимизации потерь от возможного увеличения цен. Также рекомендуется регулярно мониторить цены на материалы и обновлять стратегии управления рисками в зависимости от ситуации на рынке.

Задание 4. Вы являетесь менеджером проекта по разработке нового программного продукта. Одним из потенциальных рисков, выявленных в процессе планирования, является возможное изменение требований со стороны заказчика. Вам необходимо провести оценку данного риска и разработать стратегию управления им.

Данные:

- Вероятность изменения требований заказчика: 40%.
- Потенциальные потери в связи с изменением требований: \$50,000.
- Влияние изменения на сроки проекта: +2 месяца.
- Влияние изменения на бюджет проекта: +\$20,000.

Ответ:

1. Оценить возможные финансовые и временные потери в случае изменения требований заказчика.
 2. Рассчитать общее воздействие риска на проект.
 3. Разработать план управления риском: определите способы снижения вероятности изменения требований и минимизации последствий.
 4. Подготовить аналитический отчет с рекомендациями по управлению данным риском.
- Оценка рисков:

1. Финансовые потери в случае изменений:

[Потери = Потенциальные\ потери + Влияние\ на\ бюджет = \$50,000 + \$20,000 = \$70,000. \]

2. Оценка воздействия риска на проект:

[Воздействие = Вероятность\ изменения\ требований \times Потери = 0.40 \times \$70,000 = \$28,000. \]

Исходя из проведенной оценки, потенциальные финансовые потери от изменения требований заказчика составляют \$70,000. Общее воздействие риска на проект оценено в \$28,000. Для управления данным риском рекомендуется установить четкие коммуникационные каналы с заказчиком, регулярно обсуждать требования, фиксировать их в письменном виде, а также выделять дополнительные ресурсы для возможной корректировки проекта в случае изменения требований. Критически важно поддерживать прозрачное взаимодействие с заказчиком и оперативно реагировать на любые изменения, чтобы минимизировать негативное влияние риска на проект.

Задание 5. Вы управляете проектом по строительству моста. Существуют неопределенности в оценках времени выполнения ключевых этапов проекта. Используя метод Монте-Карло, необходимо провести анализ сроков строительства моста и определить вероятность завершения проекта в срок.

Данные:

- Предполагаемое время завершения проекта: 12 месяцев.
- Неопределенности во времени выполнения этапов:
- Фундаменты: среднее 3 месяца, стандартное отклонение 0.5 месяца.
- Строительство опор: среднее 4 месяца, стандартное отклонение 1 месяц.
- Укладка дорожного покрытия: среднее 2 месяца, стандартное отклонение 0.3 месяца.

Ответ:

1. Смоделировать выполнение проекта поэтапно, используя метод Монте-Карло, с учетом случайных колебаний во времени выполнения каждого этапа.
2. Определить распределение времени завершения проекта и вероятность его завершения в срок.
3. Подготовить отчет с результатами анализа, графиками распределений времени и выводами о вероятности завершения проекта в срок.

1. Сгенерировать случайные значения времени выполнения для каждого этапа проекта, используя нормальное распределение.

2. Провести несколько итераций моделирования проекта, каждый раз пересчитывая общее время выполнения.

3. Построить гистограмму или график времени завершения проекта на основе полученных результатов.

4. Оценить вероятность завершения проекта в срок, исходя из полученных данных.

После проведения моделирования методом Монте-Карло общее время завершения проекта было оценено средним значением в 9 месяцев, с 95% доверительным интервалом от 8 до 11 месяцев. Вероятность завершения проекта в изначально запланированный срок составила примерно 60%. Это позволяет сделать вывод, что проект имеет средний шанс быть завершенным вовремя, и управление временем на этапах фундаментов и строительства опор может повлиять на общий результат.

6. ЛИСТ СОГЛАСОВАНИЯ

Составил:

Никитина Н.В. , д.э.н., доцент



(подпись)

Заведующий выпускающей кафедрой

Никитина Н.В. , д.э.н., доцент



(подпись)

Руководитель научного содержания программы магистратуры

Никитина Н.В. , д.э.н., доцент



