

Государственное образовательное учреждение
«Приднестровский государственный университет им. Т.Г. Шевченко»
Филиал ПГУ им. Т.Г. Шевченко в г. Рыбнице

Кафедра менеджмента

Утверждаю: 
Заведующий кафедрой менеджмента
к.э.н., доцент Д.М. Трач
 « 06.08.2019 г.

ФОНД ОЦЕНОЧНЫХ СРЕДСТВ

ПО УЧЕБНОЙ ДИСЦИПЛИНЕ

«РИСК-МЕНЕДЖМЕНТ ИНВЕСТИЦИОННЫХ ПРОЕКТОВ»

Направление подготовки:

5.38. 03.02 «Менеджмент»

для 2017 года набора, очное отделение

квалификация (степень) выпускника
бакалавр

Разработал:
ст.преп. Козыма Е.С.


г. Рыбница – 2019 г.

Паспорт фонда оценочных средств по учебной дисциплине «РИСК-МЕНЕДЖМЕНТ ИНВЕСТИЦИОННЫХ ПРОЕКТОВ»

В результате изучения дисциплины обучающийся должен:

знать:

- основные понятия и классификационные аспекты теории риска;
- методические основы количественной оценки и анализа рисков инвестиционных проектов;
- теоретические основы принятия инвестиционных решений в условиях риска;

уметь:

- применять конкретные подходы, методы и модели для оценки и анализа рисков инвестиционных проектов;
- выбирать оптимальные инвестиционные решения, сопряженные с различными видами рисков.

владеть:

- методами количественного анализа и моделирования, теоретического и экспериментального исследования;
- анализировать поведение потребителей экономических благ и формировать спрос;
- оценивать риски, доходность и эффективность принимаемых финансовых и инвестиционных решений.

Программа оценивания контролируемой компетенции:

Текущая аттестация	Контролируемые модули, разделы (темы) дисциплины и их наименование *	Код контролируемой компетенции (или ее части)	Наименование оценочного средства**
1	Раздел 1. Основы управления рисками	ПК-3, ПК-5, ПК-15	Вопросы для самоподготовки
2	Раздел 2. Методы определения вероятности и последствий рисков	ПК-3, ПК-5, ПК-15	Вопросы для самоподготовки
3	Раздел 3. Планирование реагирования на риски	ПК-3, ПК-5, ПК-15	Вопросы для самоподготовки
4	Раздел 4. Обработка рисков	ПК-3, ПК-5, ПК-15	Вопросы для самоподготовки
5	Раздел 5. Методы теории игр	ПК-3, ПК-5, ПК-15	Вопросы для самоподготовки
6	Раздел 6. Анализ чувствительности проекта	ПК-3, ПК-5, ПК-15	Вопросы для самоподготовки
7	Раздел 7. Методы минимизации проектных рисков	ПК-3, ПК-5, ПК-15	Вопросы для самоподготовки
8	Раздел 8. Планирование реагирования на риски, мониторинг и контроль рисков	ПК-3, ПК-5, ПК-15	Вопросы для самоподготовки
9	Раздел 9. Оценка экономического эффекта от управления рисками	ПК-3, ПК-5, ПК-15	Вопросы для самоподготовки
Промежуточная аттестация		ПК-3, ПК-5, ПК-15	Вопросы к зачету с оценкой
Контрольная работа		ПК-3, ПК-5, ПК-15	Задание для контрольной работы

* Выбор контролируемых единиц (модули, разделы, темы рабочей программы дисциплины) для текущей аттестации (при наличии) преподаватель определяет самостоятельно, каждый сопровождается комплектом оценочных средств.

**В данной графе в обязательном порядке перечисляются оценочные средства промежуточной и текущей (при наличии) аттестаций. Перечень оценочных средств может быть дополнен и расширен.

Оформление комплекта заданий для контрольной работы

Комплект заданий для контрольной работы

1. Объективный и субъективный методы определения вероятности нежелательных событий.
2. Сущность статистических методов и моделей определения и оценки рисков предприятия.
3. Сущность аналитических методов и моделей определения и оценки рисков предприятия
4. Система управления рисками и отчетность
5. Общие принципы управления риском
6. Метод вариации параметров: инвестиционные затраты; объем производства; издержки производства; процент за кредит; индексы цен или индексы инфляции; задержки платежей; длительность расчетного периода.
7. Относительный и абсолютный анализ чувствительности проекта
8. Специальные методы управления риском.
9. Подходы к разработке методов управления риском на конкретном предприятии.
10. Организация программы управления риском.
11. Избежание и лимитирование рисков
12. Управление рыночными рисками

Критерии оценки:

- оценка «отлично» выставляется студенту, если теоретическое содержание дисциплины усвоено в полном объеме на высоком научно-теоретическом уровне, у студента сформированы необходимые практические навыки работы с теоретическим материалом, учебные задания выполнены полностью. Студент показал свободное владение материалом, способность обобщать и критически оценивать результаты исследований актуальных проблем управления, полученных отечественными и зарубежными исследователями.
- оценка «хорошо» выставляется студенту, если теоретическое содержание дисциплины усвоено в полном объеме на хорошем научно-теоретическом уровне, у студента не в полной мере сформированы необходимые практические навыки работы с теоретическим материалом, учебные задания выполнены полностью. Студент показал свободное владение материалом, способность обобщать и критически оценивать результаты исследований актуальных проблем управления, полученных отечественными и зарубежными исследователями.
- оценка «удовлетворительно» выставляется, если теоретическое содержание дисциплины усвоено частично, но пробелы не носят существенного характера, необходимые практические навыки работы с теоретическим материалом в основном сформированы, большинство учебных заданий выполнено. Студент не в полной мере показал свободное владение материалом, способность обобщать и критически оценивать результаты исследований актуальных проблем управления, полученных отечественными и зарубежными исследователями.
- оценка «неудовлетворительно» выставляется, если теоретическое содержание дисциплины усвоено частично, необходимые практические навыки работы с теоретическим материалом не сформированы, большая часть учебных заданий не выполнена. Студент не показал свободное владение материалом, способность обобщать и критически оценивать результаты исследований актуальных проблем управления, полученных отечественными и зарубежными исследователями.

Тестовые задания по дисциплине

1.Какую функцию риска характеризует выполнение им роли катализатора в принятии решений, связанных с реализацией инновационных проектов?

1. стимулирующую;
2. защитную;
3. регулирующую;
4. нормативную.

2.Возникновение интернальных эффектов в результате воздействия риска связано с:

1. возможностью получения незапланированных дополнительных издержек;
2. возможностью получения незапланированных дополнительных доходов;
3. возможностью получения незапланированных дополнительных издержек или доходов.

3.В каком случае вероятность негативного воздействия рисков максимальна?

1. «действие наудачу в надежде на счастливый исход»;
2. действия на основе четко разработанной стратегии оценки и управления рисками

4.Является ли альтернативность выбора решения обязательным условием рисковой ситуации?

1. да;
2. нет.

5.Какие виды потерь могут возникнуть в результате воздействия риска?

1. материальные;
2. трудовые;
3. финансовые;
4. времени;
5. специальные;
6. все перечисленные.

6.В целом риск как экономическая категория представляет собой:

1. возможность, вероятность отклонения от цели, несовпадения фактического результата с намеченным в условиях объективно существующей неопределенности;
2. вероятность потери части ресурсов, недополучения доходов или получения дополнительных расходов;
3. дополнительные расходы;
4. потери, убытки, получаемые в результате осуществления определенной финансовой и производственной политики.

7.При отрицательном отношении к риску предприниматель предпочтет:

1. среднюю прибыль;
2. определенный гарантированный доход;
3. рисковый результат с большим доходом.

8.При каком отношении предпринимателя к риску увеличение общей полезности превышает прирост связанного с риском дохода?

1. склонности к риску;
2. отрицательном отношении к риску;
3. нейтральном отношении к риску.

9.Какой термин обозначает следующее определение: «скоординированные действия по руководству и управлению организацией в отношении риска»?

1. система менеджмента риска;
2. менеджмент риска;
3. анализ риска.

10.Какая из указанных сфер деятельности связана с областью применения риск-менеджмента?

1. экономика;
2. медицина;
3. право;
4. теория катастроф;
5. все вышеперечисленные.

11.Принятие поставщиком решения об изменении условий договора (сроков, цен, объемов, требований к качеству поставляемой продукции) выступает в качестве причины или фактора воздействия риска недополучения исходных материалов из-за срыва заключенных договоров о поставке?

1. причина риска;
2. фактор риска.

12.К каким факторам риска относятся: законодательство, регулирующее предпринимательскую деятельность; действия органов государственного и местного управления; налоговая система; взаимоотношения с партнерами; конкуренция предпринимателей?

1. внешние факторы косвенного воздействия;
2. внешние факторы прямого воздействия;
3. внутренние факторы.

13.Факторы риска - это:

1. условия, способствующие проявлению причин риска;
2. источники возникновения риска;
3. возникновение специфического набора обстоятельств, при которых происходит данное явление.

14.Какие риски связаны с вероятностью потерь, возникающих при вложении предприятием средств в производство новых товаров и услуг, а также при разработке, освоении и внедрении технологических, организационных и других нововведений?

1. инновационные;
2. финансовые;
3. коммерческие.

Учебно-методическое обеспечение самостоятельной работы студентов по дисциплине

Вопросы для самоподготовки

1. Основы управления рисками
2. Методы определения вероятности и последствий рисков
3. Планирование реагирования на риски
4. Обработка рисков
5. Методы теории игр

6. Анализ чувствительности проекта
7. Методы минимизации проектных рисков
8. Планирование реагирования на риски, мониторинг и контроль рисков
9. Оценка экономического эффекта от управления рисками

Оформление вопросов к зачету и зачету с оценкой по дисциплине

Вопросы к зачету с оценкой по дисциплине

1. Сущность категории «риск»; эволюция представлений о риске.
2. Объективные и субъективные стороны риска; причины возникновения экономического риска.
3. Цели, задачи и функции риск-менеджмента. Функциональная структура риск-менеджмента.
4. Алгоритм управления риском в системе управления предприятием.
5. Организация процесса управления риском на предприятии.
6. Мониторинг программ риск-менеджмента. Принятие решений.
7. Общие принципы классификации рисков.
8. Виды рисков: промышленные риски.
9. Виды рисков: экологические риски.
10. Виды рисков: инвестиционные риски.
11. Виды рисков: кредитные риски.
12. Виды рисков: технические риски.
13. Виды рисков: предпринимательские риски.
14. Виды рисков: финансовые и коммерческие риски.
15. Виды рисков: страновые и политические риски.
16. Методы выявления риска: опросные листы.
17. Методы выявления риска: структурные диаграммы.
18. Методы выявления риска: карты потоков.
19. Методы выявления риска: прямая инспекция.
20. Методы выявления риска: анализ финансовой и управленческой отчетности.
21. Оценка вероятности неблагоприятных событий: метод построения деревьев событий.
22. Оценка вероятности неблагоприятных событий: метод «события – последствия».
23. Оценка вероятности неблагоприятных событий: метод деревьев отказов.
24. Концепция приемлемого риска.
25. Активное и пассивное управление рисками.
26. Методы управления рисками организации: сущность, возможности использования.
27. Системный подход к управлению рисками организации.
28. Контроль и оценка эффективности мероприятий по управлению рисками.
29. Затраты на риск.
30. Источники финансирования риска.

Критерии оценки ответа студента на зачете с оценкой

- оценка «отлично» выставляется студенту, если теоретическое содержание дисциплины усвоено в полном объеме на высоком научно-теоретическом уровне, у студента сформированы необходимые практические навыки работы с теоретическим материалом, учебные задания выполнены полностью. Студент показал свободное владение материалом, способность обобщать и критически оценивать результаты

исследований актуальных проблем управления, полученных отечественными и зарубежными исследователями.

- оценка «хорошо» выставляется студенту, если теоретическое содержание дисциплины усвоено в полном объеме на хорошем научно-теоретическом уровне, у студента не в полной мере сформированы необходимые практические навыки работы с теоретическим материалом, учебные задания выполнены полностью. Студент показал свободное владение материалом, способность обобщать и критически оценивать результаты исследований актуальных проблем управления, полученных отечественными и зарубежными исследователями.

- оценка «удовлетворительно» выставляется, если теоретическое содержание дисциплины усвоено частично, но пробелы не носят существенного характера, необходимые практические навыки работы с теоретическим материалом в основном сформированы, большинство учебных заданий выполнено. Студент не в полной мере показал свободное владение материалом, способность обобщать и критически оценивать результаты исследований актуальных проблем управления, полученных отечественными и зарубежными исследователями.

- оценка «неудовлетворительно» выставляется, если теоретическое содержание дисциплины усвоено частично, необходимые практические навыки работы с теоретическим материалом не сформированы, большая часть учебных заданий не выполнена. Студент не показал свободное владение материалом, способность обобщать и критически оценивать результаты исследований актуальных проблем управления, полученных отечественными и зарубежными исследователями.