

Министерство образования и науки Российской Федерации
 Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение
 высшего профессионального образования
 «Владимирский государственный университет
 имени Александра Григорьевича и Николая Григорьевича Столетовых»
 (ВлГУ)



УТВЕРЖДАЮ
 Профектор по
 учебно-методической работе

А.А.Панфилов

« 23 » _____ 04 _____ 2016 г.

РАБОЧАЯ ПРОГРАММА ДИСЦИПЛИНЫ
 УПРАВЛЕНИЕ РИСКАМИ В ПРОЕКТАХ

Направление подготовки 38.04.02 «Менеджмент»
 Программа подготовки Управление проектами
 Уровень высшего образования магистратура
 Форма обучения очная

Семестр	Трудоемкость зач. ед./ час.	Лекции, час.	Практич. занятия, час.	Лаборат. работы, час.	СРС, час.	Форма промежуточного контроля (экз./зачет)
3	108/3		18		90	Зачет
Итого	108/3		18		90	Зачет

1. ЦЕЛИ ОСВОЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ

Целями освоения дисциплины (модуля) «Управление рисками в проектах» являются:

- дать студентам теоретические знания и практические умения в сфере управления проектными рисками;
- сформировать практические навыки оценки степени неопределенности при проектировании, идентификации и классификации проектных рисков, анализа рисков в процессе проектирования;
- развить у студентов кругозор, общую культуру экономических исследований, позволяющую успешно работать в быстро меняющейся обстановке.

Задачи дисциплины:

- подготовка студентов к работе в реальных условиях неопределенности при осуществлении проектов в организации;
- изучение видов риска, связанных с инвестированием;
- освоение методов количественной оценки риска;
- получение студентами практических навыков управления проектами.

2. МЕСТО ДИСЦИПЛИНЫ В СТРУКТУРЕ ОПОП ВО

Дисциплина Б1.В.ДВ.3 «Управление рисками в проектах» относится к дисциплинам по выбору (ДВ.3) вариативной части (В) блока (Б1) дисциплин. Глубокое усвоение материала обеспечивается сочетанием аудиторных занятий и самостоятельной работы студентов с литературой. Основным видом учебных занятий по данной дисциплине являются лекционные и практические занятия. Изучение дисциплины для студентов очной формы обучения осуществляется в течение одного семестра. По дисциплине осуществляется текущий контроль и промежуточная аттестация в форме зачета.

Содержание дисциплины логически взаимосвязано с изучением таких дисциплин, как «Линейная алгебра», «Теория вероятностей», «Стратегический менеджмент», «Бизнес-планирование», «Методы принятия управленческих решений», «Экономическая информатика». В процессе освоения дисциплины создаются предпосылки и теоретические основы для изучения дисциплин «Инновационный менеджмент», «Управление инвестиционными проектами».

3. КОМПЕТЕНЦИИ ОБУЧАЮЩЕГОСЯ, ФОРМИРУЕМЫЕ В РЕЗУЛЬТАТЕ ОСВОЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛЯ)

Процесс изучения дисциплины «Управление рисками в проектах» направлен на формирование следующих компетенций:

общекультурные компетенции:

ОК-2 готовность действовать в нестандартных ситуациях, нести социальную и этическую ответственность за принятые решения;

обще-профессиональные компетенции:

ОПК-1 готовность к коммуникации в устной и письменной формах на русском и иностранном языках для решения задач профессиональной деятельности.

**Планируемые результаты обучения по дисциплине
Общекультурные и общепрофессиональные компетенции**

Код компетенции	Содержание компетенции	Планируемые результаты обучения по дисциплине
ОК-2	Готовность действовать в нестандартных ситуациях, нести социальную и этическую ответственность за принятые решения	<p>Знать: З1 (ОК-2) – основные проблемы, угрозы и риски связанные с осуществлением проектной деятельности. З1 (ОК-2) – основные модели принятия управленческих решений в различных ситуациях связанных с управлением рисками в проектах.</p> <p>Уметь: У1 (ОК-2) – принимать на себя ответственность в ходе решения вопросов связанных с управлением рисками в проектах. У2 (ОК-2) – отстаивать свою точку зрения в ходе решения вопросов связанных с управлением рисками в проектах. У13(ОК-2) – анализировать ошибки, корректировать решения в области управления рисками в проектах с целью повышения их эффективности</p> <p>Владеть: В1 (ОК-2) – знаниями, умениями и навыками подготовки и принятия организационно-управленческих решений связанных с управлением рисками в проектах.</p>
ОПК-1	готовностью к коммуникации в устной и письменной формах на русском и иностранном языках для решения задач профессиональной деятельности	<p>Знать: З1 (ОПК-3) – основные методы устной и письменной коммуникации по вопросам связанным с управлением рисками в проектах З2 (ОПК-3) – особенности представления докладов, сообщений на производственных совещаниях, научных конференциях, семинарах, круглых столах по вопросам управления рисками в проектах. З3 (ОПК-3) – основы подготовки выступлений на совещаниях по проблемам управления рисками в проектах. З4 (ОПК-3) – основы ведения деловых переговоров и дискуссий по проблемам управления рисками в проектах.</p> <p>Уметь: У1 (ОПК-3) – выступать с докладами, сообщениями на производственных совещаниях, научных конференциях, семинарах, круглых столах по вопросам управления рисками в проектах. У2 (ОПК-3) – подготовить выступление на совещаниях по проблемам управления рисками в проектах. У3 (ОПК-3) – вести переговоры, участвовать в дискуссиях по проблемам управления рисками в проектах</p> <p>Владеть: В1 (ОПК-1) – навыками ведения дискуссии на производственные и научные темы по вопросам управления рисками в проектах. В2 (ОПК-1) – навыками работы с текстами по вопросам управления рисками в проектах из учебной, страноведческой, научно-популярной и научной литературы, инструкций, проспектов и справочной литературы.</p>

4. СТРУКТУРА И СОДЕРЖАНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛЯ)

Курс рассчитан на 18 часов практических занятий и 90 часов самостоятельной работы. Всего 3 зачетных единицы (108 часов). Промежуточная аттестация в форме зачета предусмотрена в 3 семестре.

Таблица 2

Вид учебных занятий и самостоятельная работа	Объем дисциплины, час.											
	Всего	Семестр										
		1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	11
<i>Очная форма обучения</i>												
Контактная работа обучающихся с преподавателем, в том числе:	18		18									
лекционного												
лабораторные работы												
практического занятия	18		18									
Самостоятельная работа студента (СРС)	36		36									
Промежуточная аттестация	3		3									
Общая трудоемкость (час. / з.е.)	108/3		108/3									

Таблица 3

№ п/п	Раздел (тема) дисциплины	Семестр	Неделя семестра	Виды учебной работы, включая самостоятельную работу студентов и трудоемкость (в часах)						Объем учебной работы, с применением интерактивных методов (в часах / %)	Формы текущего контроля успеваемости (по неделям семестра), форма промежуточной аттестации (по семестрам)
				Лекции	Практические занятия	Лабораторные работы	Контрольные работы	СРС	КП / КР		
1	Риск и неопределенность в управлении проектами.	3	1		2			10		2/100	О,Д
2	Классификация проектных рисков	3	3		2			10		2/100	О,Д
3	Система управления рисками проектов.	3	5		2			10		2/100	О,Д, Рейтинг-контроль №1
4	Планирование управления проектными рисками	3	7		2			10		2/100	О,Д
5	Идентификация проектных рисков	3	9		2			10		2/100	О,Д
6	Качественный анализ рисков	3	11		2			10		2/100	О,Д, Рейтинг-контроль №2
7	Количественный анализ рисков	3	13		2			10		2/100	О,Д
8	Планирование реагирования на проектные риски	3	15		2			10		2/100	О,Д
9	Мониторинг и методы обработки проектных рисков.	3	17		2			10		2/100	О,Д, Рейтинг-контроль №3
Всего		3			18			90		18/100	Зачет

О – опрос, Д – дискуссия

Содержание дисциплины

Таблица 4

№ п/п	Наименование тем	Содержание тем	Коды компетенций	Коды ЗУН (в соответствии с табл. 1)	
Тема 1	Риск и неопределенность в управлении проектами.	Понятие неопределенности и риска в проектах. Источники неопределенности и риска в проектах. Атрибуты проектного риска. Влияние риска на проект. Определение управления проектным риском. Задачи менеджеров и членов команды проекта в рамках управления риском проекта.	ОК-2 ОПК-1	31 (ОК-2), 32 (ОК-2), У1(ОК-2), У2(ОК-2), У3(ОК-2), В1(ОК-2), 31 (ОПК-1), 32 (ОПК-1),	33 (ОПК-1), 34 (ОПК-1) У1 (ОПК-1), У2(ОПК-1), У3(ОПК-1), В1(ОПК-1), В2(ОПК-1).
Тема 2	Классификация проектных рисков	Основные классификационные признаки риска в проектах. Основные виды проектного риска. Инвестиционный риск. Производственный риск. Инновационный риск. Финансовый риск: процентный, кредитный и валютный. Операционный риск. Риски, связанные с нестабильностью экономического законодательства и текущей экономической ситуации, условий инвестирования и использования прибыли.	ОК-2 ОПК-1	31 (ОК-2), 32 (ОК-2), У1(ОК-2), У2(ОК-2), У3(ОК-2), В1(ОК-2), 31 (ОПК-1), 32 (ОПК-1),	33 (ОПК-1), 34 (ОПК-1) У1 (ОПК-1), У2(ОПК-1), У3(ОПК-1), В1(ОПК-1), В2(ОПК-1).
Тема 3	Система управления рисками проектов.	Создание системы управления рисками. Задачи, решаемые с помощью системы управления проектными рисками. Нормативно-методическая база управления проектными рисками. Распределение ролей и ответственности. Основные стандарты управления проектными рисками. Методологические принципы управления проектными рисками. Методология управления рисками проекта согласно РМВОК.	ОК-2 ОПК-1	31 (ОК-2), 32 (ОК-2), У1(ОК-2), У2(ОК-2), У3(ОК-2), В1(ОК-2), 31 (ОПК-1), 32 (ОПК-1),	33 (ОПК-1), 34 (ОПК-1) У1 (ОПК-1), У2(ОПК-1), У3(ОПК-1), В1(ОПК-1), В2(ОПК-1).
Тема 4	Планирование управления проектными рисками	Совещания по планированию управления рисками и анализ рисков. План управления рисками проекта. Основные элементы плана управления рисками проекта: методология, роли и ответственность, разработка бюджета, определение сроков, категории рисков.	ОК-2 ОПК-1	31 (ОК-2), 32 (ОК-2), У1(ОК-2), У2(ОК-2), У3(ОК-2), В1(ОК-2), 31 (ОПК-1), 32 (ОПК-1),	33 (ОПК-1), 34 (ОПК-1) У1 (ОПК-1), У2(ОПК-1), У3(ОПК-1), В1(ОПК-1), В2(ОПК-1).
Тема 5	Идентификация проектных рисков	Источники для анализа проектного риска. Методы сбора информации по рискам проекта. Основные инструменты идентификации риска проекта. Мозговой штурм. Метод Дельфи. Методы диаграмм. Анализ допущений. SWOT-анализ. Составление реестра риска проекта.	ОК-2 ОПК-1	31 (ОК-2), 32 (ОК-2), У1(ОК-2), У2(ОК-2), У3(ОК-2), В1(ОК-2), 31 (ОПК-1), 32 (ОПК-1),	33 (ОПК-1), 34 (ОПК-1) У1 (ОПК-1), У2(ОПК-1), У3(ОПК-1), В1(ОПК-1), В2(ОПК-1).
Тема 6	Качественный анализ рисков	Ранжирование и рейтинг проектного риска. Методика составления матрицы вероятности и воздействия. Оценка качества данных по рискам. Категоризация рисков. Оценка срочности рисков.	ОК-2 ОПК-1	31 (ОК-2), 32 (ОК-2), У1(ОК-2), У2(ОК-2), У3(ОК-2), В1(ОК-2), 31 (ОПК-1), 32 (ОПК-1),	33 (ОПК-1), 34 (ОПК-1) У1 (ОПК-1), У2(ОПК-1), У3(ОПК-1), В1(ОПК-1), В2(ОПК-1).
Тема 7	Количественный анализ рисков	Анализ чувствительности. Анализ ожидаемого денежного значения. Математическое ожидание, дисперсия и коэффициент вариации ожидаемого денежного значения. Дерево решений. Моделирование и имитация. Метод Монте-Карло. Отчет о количественном	ОК-2 ОПК-1	31 (ОК-2), 32 (ОК-2), У1(ОК-2), У2(ОК-2), У3(ОК-2), В1(ОК-2),	33 (ОПК-1), 34 (ОПК-1) У1 (ОПК-1), У2(ОПК-1), У3(ОПК-1), В1(ОПК-1),

№ п/п	Наименование тем	Содержание тем	Коды компетенций	Коды ЗУН (в соответствии с табл. 1)	
		анализе риска.		31 (ОПК-1), 32 (ОПК-1),	В2(ОПК-1).
Тема 8	Планирование реагирования на проектные риски	Определения путей и действий по увеличению возможностей и снижению угроз целям проекта. Определение стратегии управления проектными рисками. Уклонение от проектного риска. Передача проектного риска. Снижение проектного риска. Принятие проектного риска.	ОК-2 ОПК-1	31 (ОК-2), 32 (ОК-2), У1(ОК-2), У2(ОК-2), У3(ОК-2), В1(ОК-2), 31 (ОПК-1), 32 (ОПК-1),	33 (ОПК-1), 34 (ОПК-1), У1 (ОПК-1), У2(ОПК-1), У3(ОПК-1), В1(ОПК-1), В2(ОПК-1).
Тема 9	Мониторинг и управление проектными рисками.	Реализация планов реагирования на риски. Отслеживание идентифицированных рисков. Мониторинг остаточных рисков, обнаружение новых рисков. Оценка результативности управления проектным риском. Пересмотр рисков. Аудит рисков. Обновление реестра проектных рисков.	ОК-2 ОПК-1	31 (ОК-2), 32 (ОК-2), У1(ОК-2), У2(ОК-2), У3(ОК-2), В1(ОК-2), 31 (ОПК-1), 32 (ОПК-1),	33 (ОПК-1), 34 (ОПК-1), У1 (ОПК-1), У2(ОПК-1), У3(ОПК-1), В1(ОПК-1), В2(ОПК-1).

5. ОБРАЗОВАТЕЛЬНЫЕ ТЕХНОЛОГИИ

1. Деловая игра – метод имитации принятия решения в различных производственных ситуациях, осуществляемых по заданным правилам группой людей в диалоговом режиме. Активное средство обучения.
2. Дискуссия – форма учебной работы, в рамках которой высказывают свое мнение по вопросу, поставленному преподавателем. Проведение дискуссий подразумевает самостоятельный подготовительный этап в виде написания эссе, тезисов, реферата по предложенному вопросу.
3. Метод кейс-стадии – обучение, при котором студенты и преподаватели участвуют в непосредственном обсуждении деловой ситуации или задачи, взятой из практики реального функционирующего предприятия. Основой для создания кейсов являются данные конкретных предприятий, а именно: ООО «ВСЗ «Техника», ОАО «ВПО «Точмаш», ООО «Амбитус», ОАО «Авангард», ОАО «Электрокабель», ОАО «Связной» и др., а также материалы периодической печати, а именно, статьи журналов «Инновации», «РИСК», «Проблемы теории и практики управления», «Экономический анализ», «ЭКО», «Менеджмент инноваций» и др.

6. ОЦЕНОЧНЫЕ СРЕДСТВА ДЛЯ ТЕКУЩЕГО КОНТРОЛЯ УСПЕВАЕМОСТИ, ПРОМЕЖУТОЧНОЙ АТТЕСТАЦИИ ПО ИТОГАМ ОСВОЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ И УЧЕБНО-МЕТОДИЧЕСКОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ САМОСТОЯТЕЛЬНОЙ РАБОТЫ СТУДЕНТОВ

6.1. Перечень учебно-методического обеспечения для самостоятельной работы обучающихся по дисциплине

1. Трудоемкость самостоятельной работы студентов по дисциплине «Управление рисками в проектах» составляет 90 часов.

Таблица 5

Вопросы для самостоятельного изучения

№ темы	Вопросы, выносимые на самостоятельное изучение	Кол-во часов
1	Основные виды проектного риска.	
2	Основные подходы к идентификации риска в проектах.	10
3	Основные стандарты управления рисками в проектах.	10

4	Создание плана управления рисками в проекте.	10
5	Проектные риски на различных этапах жизненного цикла проекта.	10
6	Качественные методы оценки риска в проектах	10
7	Количественные методы оценки риска в проектах	10
8	Мониторинг и контроль результатов риска проекта.	10
9	Автоматизация управления проектным риском.	10
	Итого:	90

Вопросы для самостоятельного изучения в рамках СРС:

1. Как рассчитывается коэффициент риска и определяются возникающие проблемы управления риском на предприятии?
2. Какие базовые финансовые документы необходимо использовать для получения информации с целью управления риском?
3. Назовите характерные отличия чистых рисков от спекулятивных.
4. Охарактеризуйте группы транспортного риска по степени ответственности.
5. Что подразумевают риски неисполнения хозяйственных договоров и селективные риски?
6. Как правильно осуществлять обнаружение рисков при помощи качественного анализа?
7. Какую информацию о рисках необходимо получать при помощи количественной оценки?
8. По каким критериям необходимо идентифицировать внешние и внутренние источники информации?
9. Какие требования необходимо предъявлять к информации о рисках?
10. Как осуществлять визуализацию рисков путем сравнения распределения ущерба до реализации какого-либо предупредительного мероприятия и соответствующего распределения после его осуществления?
11. Каким образом следует определять границу между приемлемым и неприемлемым рисками?
12. Охарактеризуйте экономическую (коммерческую) и политическую неопределенности.
13. Определите степень риска при помощи количественных и качественных методов оценки рисков.
14. Рассчитайте ожидаемую норму доходности ERR и IRR – внутреннюю норму доходности.
15. Какие экспертные методы применяются при определении возможности наступления рискованных ситуаций?
16. При помощи каких показателей определяется доверительный интервал и временной горизонт при оценке (VaR)?
17. Какие практические меры используются при управлении информационными рисками?
18. Как правильно разработать и довести до подчиненных план действий в случае критической ситуации возникновения информационных рисков?
19. По каким критериям осуществлять выбор методов управления риском?
20. Как проводится оценка рискованности объекта размещения ресурсов банка?
21. Охарактеризуйте превентивные и поддерживающие мероприятия риск-стратегий в рамках осуществления проектов.
22. При помощи каких методов следует осуществлять выбор оптимального инвестиционного проекта?
23. Для чего используются рейтинговые значения двухуровневых вероятностей окупаемости инвестиций?

Структура самостоятельных работ студентов
(эссе и рефератов):

Структура эссе:

Титульный лист (заполняется по единой форме);

Введение (30 % объема) – суть и обоснование выбора данной темы, состоит из ряда компонентов, связанных логически и стилистически.

Основная часть (60 % объема эссе) – теоретические и практические основы выбранной проблемы и изложение основного вопроса.

Заключение (10 % объема эссе) – обобщения и аргументированные выводы по теме с указанием области ее применения и т.д.

Структура реферата:

Оглавление (содержание);

Введение;

Несколько глав с выводами по каждой главе;

Заключение;

Список литературы (указывать только действительно изученные источники).

6.2. Фонд оценочных средств для проведения промежуточной аттестации обучающихся по дисциплине

Промежуточная аттестация студентов по дисциплине «Управление рисками в проектах» проводится в соответствии с Учебным планом в форме зачета в 3 семестре для студентов. Студенты допускаются к зачету по дисциплине в случае выполнения им учебного плана по дисциплине: выполнения всех заданий и мероприятий, предусмотренных программой дисциплины.

6.3. Перечень компетенций с указанием этапов их формирования в процессе освоения образовательной программы

В ходе промежуточной аттестации осуществляется контроль освоения компетенций в соответствии с этапами их формирования.

Этапы формирования компетенций в ходе изучения дисциплины «Управление рисками в проектах»

Таблица 6

№ п/п	Наименование тем	Содержание тем	Коды компетенций
Тема 1	Риск и неопределенность в управлении проектами.	Понятие неопределенности и риска в проектах. Источники неопределенности и риска в проектах. Атрибуты проектного риска. Влияние риска на проект. Определение управления проектным риском. Задачи менеджеров и членов команды проекта в рамках управления риском проекта.	ОК-2 ОПК-1
Тема 2	Классификация проектных рисков	Основные классификационные признаки риска в проектах. Основные виды проектного риска. Инвестиционный риск. Производственный риск. Инновационный риск. Финансовый риск: процентный, кредитный и валютный. Операционный риск. Риски, связанные с нестабильностью экономического законодательства и текущей экономической ситуации, условий инвестирования и использования прибыли.	ОК-2 ОПК-1
Тема 3	Система управления рисками проектов	Создание системы управления рисками. Задачи, решаемые с помощью системы управления проектными рисками. Нормативно-методическая база управления проектными рисками. Распределение ролей и ответственности. Основные стандарты управления проектными рисками. Методологические принципы управления проектными рисками. Методология управления рисками проекта согласно РМВОК.	ОК-2 ОПК-1
Тема 4	Планирование управления проектными рисками	Совещания по планированию управления рисками и анализ рисков. План управления рисками проекта. Основные элементы плана управления рисками проекта: методология, роли и ответственность, разработка бюджета, определение сроков, категории рисков.	ОК-2 ОПК-1
Тема 5	Идентификация проектных рисков	Источники для анализа проектного риска. Методы сбора информации по рискам проекта. Основные инструменты идентификации риска проекта. Мозговой штурм. Метод Дельфи. Методы диаграмм. Анализ допущений. SWOT-анализ. Составление реестра риска проекта.	ОК-2 ОПК-1
Тема 6	Качественный анализ рисков	Ранжирование и рейтинг проектного риска. Методика составления матрицы вероятности и воздействия. Оценка качества данных по рискам. Категоризация рисков. Оценка срочности рисков.	ОК-2 ОПК-1
Тема 7	Количественный	Анализ чувствительности. Анализ ожидаемого денежного значения.	ОК-2

№ п/п	Наименование тем	Содержание тем	Коды компетенций
	анализ рисков	Математическое ожидание, дисперсия и коэффициент вариации ожидаемого денежного значения. Дерево решений. Моделирование и имитация. Метод Монте-Карло. Отчет о количественном анализе риска.	ОПК-1
Тема 8	Планирование реагирования на проектные риски	Определения путей и действий по увеличению возможностей и снижению угроз целям проекта. Определение стратегии управления проектными рисками. Уклонение от проектного риска. Передача проектного риска. Снижение проектного риска. Принятие проектного риска.	ОК-2 ОПК-1
Тема 9	Мониторинг и управление проектными рисками	Реализация планов реагирования на риски. Отслеживание идентифицированных рисков. Мониторинг остаточных рисков, обнаружение новых рисков. Оценка результативности управления проектным риском. Пересмотр рисков. Аудит рисков. Обновление реестра проектных рисков.	ОК-2 ОПК-1

6.4. Описание показателей и критериев оценивания компетенций на различных этапах их формирования, описание шкал оценивания

Показатели и критерии оценивания компетенций по этапам их формирования

Таблица 7

Наименование тем	Коды компетенций	Коды ЗУВ		Показатели оценивания	Критерии оценивания	Оценка
Риск и неопределенность в управлении проектами	ОК-2 ОПК-1	31 (ОК-2), 32 (ОК-2), У1(ОК-2), У2(ОК-2), У3(ОК-2), В1(ОК-2), 31 (ОПК-1), 32 (ОПК-1),	33 (ОПК-1), 34 (ОПК-1) У1 (ОПК-1), У2(ОПК-1), У3(ОПК-1), В1(ОПК-1), В2(ОПК-1).	Вопросы на зачете 1-6	Оценка «зачтено» выставляется студенту, если он твердо знает материал, грамотно и по существу излагает его, не допуская существенных неточностей в ответе на вопрос, правильно применяет теоретические положения при решении практических вопросов и задач, владеет необходимыми навыками и приемами их выполнения.	Зачтено
Классификация проектных рисков	ОК-2 ОПК-1	31 (ОК-2), 32 (ОК-2), У1(ОК-2), У2(ОК-2), У3(ОК-2), В1(ОК-2), 31 (ОПК-1), 32 (ОПК-1),	33 (ОПК-1), 34 (ОПК-1) У1 (ОПК-1), У2(ОПК-1), У3(ОПК-1), В1(ОПК-1), В2(ОПК-1).	Вопросы на зачете 7-14		
Система управления рисками проектов	ОК-2 ОПК-1	31 (ОК-2), 32 (ОК-2), У1(ОК-2), У2(ОК-2), У3(ОК-2), В1(ОК-2), 31 (ОПК-1), 32 (ОПК-1),	33 (ОПК-1), 34 (ОПК-1) У1 (ОПК-1), У2(ОПК-1), У3(ОПК-1), В1(ОПК-1), В2(ОПК-1).	Вопросы на зачете 15-21		
Планирование управления проектными рисками	ОК-2 ОПК-1	31 (ОК-2), 32 (ОК-2), У1(ОК-2), У2(ОК-2), У3(ОК-2), В1(ОК-2), 31 (ОПК-1), 32 (ОПК-1),	33 (ОПК-1), 34 (ОПК-1) У1 (ОПК-1), У2(ОПК-1), У3(ОПК-1), В1(ОПК-1), В2(ОПК-1).	Вопросы на зачете 22-24		
Идентификация проектных рисков	ОК-2 ОПК-1	31 (ОК-2), 32 (ОК-2), У1(ОК-2), У2(ОК-2), У3(ОК-2), В1(ОК-2), 31 (ОПК-1),	33 (ОПК-1), 34 (ОПК-1) У1 (ОПК-1), У2(ОПК-1), У3(ОПК-1), В1(ОПК-1), В2(ОПК-1).	Вопросы на зачете 25-33		

Наименование тем	Коды компетенций	Коды ЗУВ		Показатели оценивания	Критерии оценивания	Оценка
Качественный анализ рисков	ОК-2 ОПК-1	32 (ОПК-1), 31 (ОК-2), 32 (ОК-2), У1(ОК-2), У2(ОК-2), У3(ОК-2), В1(ОК-2), 31 (ОПК-1), 32 (ОПК-1),	33 (ОПК-1), 34 (ОПК-1) У1 (ОПК-1), У2(ОПК-1), У3(ОПК-1), В1(ОПК-1), В2(ОПК-1).	Вопросы на зачете 34-38	Оценка «не зачтено» выставляется студенту, который не знает значительной части программного материала, допускает существенные ошибки, неуверенно, с большими затруднениями выполняет практические работы. Как правило, оценка «не зачтено» ставится студентам, которые не могут продолжить обучение без дополнительных занятий по соответствующей дисциплине.	Не зачтено
Количественный анализ рисков	ОК-2 ОПК-1	31 (ОК-2), 32 (ОК-2), У1(ОК-2), У2(ОК-2), У3(ОК-2), В1(ОК-2), 31 (ОПК-1), 32 (ОПК-1),	33 (ОПК-1), 34 (ОПК-1) У1 (ОПК-1), У2(ОПК-1), У3(ОПК-1), В1(ОПК-1), В2(ОПК-1).	Вопросы на зачете 39-43		
Планирование реагирования на проектные риски	ОК-2 ОПК-1	31 (ОК-2), 32 (ОК-2), У1(ОК-2), У2(ОК-2), У3(ОК-2), В1(ОК-2), 31 (ОПК-1), 32 (ОПК-1),	33 (ОПК-1), 34 (ОПК-1) У1 (ОПК-1), У2(ОПК-1), У3(ОПК-1), В1(ОПК-1), В2(ОПК-1).	Вопросы на зачете 44-50		
Мониторинг и управление проектными рисками.	ОК-2 ОПК-1	31 (ОК-2), 32 (ОК-2), У1(ОК-2), У2(ОК-2), У3(ОК-2), В1(ОК-2), 31 (ОПК-1), 32 (ОПК-1),	33 (ОПК-1), 34 (ОПК-1) У1 (ОПК-1), У2(ОПК-1), У3(ОПК-1), В1(ОПК-1), В2(ОПК-1).	Вопросы на зачете 51-57		

6.5. Типовые контрольные задания или иные материалы, необходимые для оценки знаний, умений, навыков и (или) опыта деятельности, характеризующих этапы формирования компетенций в процессе освоения образовательной программы

Вопросы для подготовки к опросу по дисциплине «Управление рисками в проектах»

Тема 1. Риск и неопределенность в управлении проектами

1. Понятие неопределенности и риска в проектах.
2. Источники неопределенности и риска в проектах.
3. Атрибуты проектного риска.
4. Влияние риска на проект.
5. Определение управления проектным риском.
6. Задачи менеджеров и членов команды проекта в рамках управления риском проекта.

Тема 2. Классификация проектных рисков

1. Основные классификационные признаки риска в проектах.
2. Основные виды проектного риска.
3. Инвестиционный риск.
4. Производственный риск.
5. Инновационный риск.
6. Финансовый риск: процентный, кредитный и валютный.

7. Операционный риск.
8. Риски, связанные с нестабильностью экономического законодательства и текущей экономической ситуации, условий инвестирования и использования прибыли.

Тема 3. Система управления рисками проектов

1. Создание системы управления рисками.
2. Задачи, решаемые с помощью системы управления проектными рисками.
3. Нормативно-методическая база управления проектными рисками.
4. Распределение ролей и ответственности.
5. Основные стандарты управления проектными рисками.
6. Методологические принципы управления проектными рисками.
7. Методология управления рисками проекта согласно РМВОК.

Тема 4. Планирование управления проектными рисками

1. Совещания по планированию управления рисками и анализ рисков.
2. План управления рисками проекта.
3. Основные элементы плана управления рисками проекта: методология, роли и ответственность, разработка бюджета, определение сроков, категории рисков.

Тема 5. Идентификация проектных рисков

1. Источники для анализа проектного риска.
2. Методы сбора информации по рискам проекта.
3. Основные инструменты идентификации риска проекта.
4. Мозговой штурм.
5. Метод Дельфи.
6. Методы диаграмм.
7. Анализ допущений.
8. SWOT-анализ.
9. Составление реестра риска проекта

Тема 6. Качественный анализ рисков

1. Ранжирование и рейтинг проектного риска.
2. Методика составления матрицы вероятности и воздействия.
3. Оценка качества данных по рискам.
4. Категоризация рисков.
5. Оценка срочности рисков

Тема 7. Количественный анализ рисков

1. Анализ чувствительности. Анализ ожидаемого денежного значения.
2. Математической ожидание, дисперсия и коэффициент вариации ожидаемого денежного значения.
3. Дерево решений.
4. Моделирование и имитация. Метод Монте-Карло.
5. Отчет о количественном анализе риска

Тема 8. Планирование реагирования на проектные риски

1. Определения путей и действий по увеличению возможностей и снижению угроз целям проекта.
2. Определение стратегии управления проектными рисками.
3. Уклонение от проектного риска.
4. Передача проектного риска.
5. Снижение проектного риска.
6. Принятие проектного риска.

Тема 9. Мониторинг и управление проектными рисками

1. Реализация планов реагирования на риски.
2. Отслеживание идентифицированных рисков.
3. Мониторинг остаточных рисков, обнаружение новых рисков.

4. Оценка результативности управления проектным риском.
5. Пересмотр рисков.
6. Аудит рисков.
7. Обновление реестра проектных рисков.

**Примеры тестовых заданий
по дисциплине «Управление рисками в проектах»,
используемых при промежуточной аттестации**

Тесты к рейтинг-контролю №1

1. 1. Риск в проектах – это:
 - а) вероятность технических аварий в рамках проекта;
 - б) все, что может негативно повлиять на достижение целей проекта в рамках строго определенного временного промежутка;
 - в) неблагоприятное событие, влекущее за собой убыток в проекте;
 - г) вероятность провала в реализации проекта;
 - д) неопределенное событие или условие, наступление которого отрицательно или положительно сказывается на целях проекта, таких как: содержание, расписание, стоимость и качество.
2. Управление риском в проектах– это:
 - а) отказ от рискованного проекта;
 - б) систематический процесс идентификации, анализа и реагирования на риски проекта;
 - в) комплекс мер, направленных на компенсацию, снижение, перенесение, принятие риска проекта или уход от него;
 - г) комплекс мероприятий, направленных на подготовку к реализации риска в проекте.
 - д) комплекс мер, направленных на снижение вероятности реализации риска проекта;
3. К задачам системы управления проектными рисками не относится:
 - а) распределение ответственности между подразделениями и проектами;
 - б) минимизация неблагоприятного воздействия на проект;
 - в) разработка нормативно-методической базы управления проектными рисками;
 - г) построение организационной модели управления проектными рисками;
 - д) обучение проектных риск-менеджеров методологии управления рисками.
4. В рамках количественного анализа рисков не применяются следующие методы:
 - а) статистический;
 - б) синтетический;
 - в) анализ чувствительности;
 - г) эмпирический;
 - д) моделирования и имитации.
5. Стратегия, позволяющая выполнить некоторые действия и не учитывать риск впоследствии, называется:
 - А. Уклонение от риска.
 - В. Принятие риска.
 - С. Передача риска.
6. Триггером риска – симптомом, сигнализатором риска не может быть:
 - А. Задержка выполнения нескольких операций.
 - В. Повторяющиеся однотипные дефекты.

- С. Предсказание члена команды.
7. Затраты на не идентифицированные риски учитываются в статье:
- А. Управленческий резерв.
 В. Бюджет на непредвиденные обстоятельства.
 С. Фонд управления рисками.
- 8) Управление риском – это:
- а) отказ от рискованного проекта;
 б) комплекс мер, направленных на снижение вероятности реализации риска;
 в) комплекс мер, направленных на компенсацию, снижение, перенесение, принятие риска или уход от него;
 г) комплекс мероприятий, направленных на подготовку к реализации риска.
- 9) Реализация управления рисками на современных предприятиях включает в себя:
- а) выявление последствий деятельности экономических субъектов в ситуации риска;
 б) прогнозирование этой деятельности для снижения уровня риска;
 в) умение реагировать на возможные отрицательные последствия этой деятельности;
 г) умение ликвидировать такие последствия;
 д) разработка и осуществление мер, при помощи которых могут быть нейтрализованы или компенсированы вероятные негативные результаты предпринимаемых действий.
- 10) Содержательная сторона управления рисками включает в себя:
- а) планирование деятельности по реализации рискованного проекта;
 б) сравнение вероятностей и характеристик риска, полученных в результате оценки и анализа риска;
 в) выбор мер по минимизации или устранению последствий риска;
 г) организация службы управления рисками на предприятии.
- 11) Что из перечисленного не является элементом системы управления рисками?
- а) выявление расхождений в альтернативах риска;
 б) разработка планов, позволяющих действовать оптимальным образом в ситуации риска;
 в) разработка конкретных мероприятий, направленных на минимизацию или устранение негативных последствий;
- 12) Основные аспекты и тенденции управления рисками:
- г) учет психологического восприятия рискованных проектов;
 д) ни один из вариантов не является элементом системы риск-менеджмента;
 е) все перечисленное является элементами системы риск-менеджмента.

Тесты к рейтинг-контролю №2

1. Вычисление ожидаемого значения риска и принятие решения в условиях влияния нескольких факторов, называется:
- А. Дерево решений.
 В. Ожидаемое значение.
 С. Графические методы.
- 2) Разновидностью экспертного метода является:
- а) метод Дельфи;
 б) метод Гаусса;

- в) метод Иванова.
- 3 При экспертной оценке предпринимательского риска большое внимание следует уделять:
 - а) типу предприятия;
 - б) подбору экспертов;
 - в) величине предприятия.
- 4) Метод моделирования задачи выбора с помощью «дерева решений» предполагает:
 - а) математическое построение вариантов решений;
 - б) программное графическое построение вариантов решений;
 - в) графическое построение вариантов решений.
- 5) При использовании метода аналогий применяются:
 - а) базы данных о риске аналогичных проектов или сделок;
 - б) действия, которые намерен совершить предприниматель;
 - в) анонимность и управляемая обратная связь.
- 6. Экспертный метод может быть реализован:
 - а) путем обработки мнений опытных предпринимателей и специалистов;
 - б) с помощью опроса респондентов;
 - в) путем несистемной выборки.
- 7) Каждому эксперту, работающему отдельно, представляется:
 - а) помощник;
 - б) устав компании;
 - в) перечень возможных рисков.
- 8. Объективный метод определения вероятности основан на:
 - а) экспертных оценках;
 - б) вычислении частоты, с которой происходят некоторые события;
 - в) комбинировании вычисления частоты, с которой происходят некоторые события, с экспертными оценками;
 - г) нет верного ответа.
- 9) Субъективный метод определения вероятности основан на:
 - а) экспертных оценках;
 - б) вычислении частоты, с которой происходят некоторые события;
 - в) комбинировании вычисления частоты, с которой происходят некоторые события, с экспертными оценками;
 - г) нет верного ответа.
- 10) Известный метод экспертных оценок для определения исходных данных предстоящего моделирования инвестиционной программы носит название:
 - а) «СФИНКС»;
 - б) «ЛИБЕРО»;
 - в) «ПАТТЕРН»;
 - г) «КОНЭКСПЕРТ».
- 11) Волатильность – это:
 - а) изменчивость рыночного спроса;
 - б) постоянство рыночного спроса;
 - в) изменчивость курсовых разниц и процентных ставок;
 - г) постоянство курсовых разниц и процентных ставок.
- 12) Суть управления рисками проекта состоит в:

- а) устранении риска проекта;
 - б) управлении проектным риском;
 - в) снижении уровня проектного риска;
 - г) выборе проектного риска.
- 13) Каковы функции объекта управления рисками?
- а) организация разрешения риска;
 - б) организация рискованных вложений капитала;
 - в) организация работы по снижению величины риска;
 - г) организация процесса страхования рисков;
 - д) организация экономических отношений и связей между субъектами хозяйственного процесса;
 - е) все перечисленное является функциями объекта управления;

Тесты к рейтинг-контролю №3

1. В течение каких фаз проекта будут определены риски:
 - А. Инициации и исполнения.
 - В. Исполнения.
 - С. Всех фаз.
2. Риски присутствуют в проектах из-за:
 - А. Неадекватной толерантности исполняющей организации к рискам.
 - В. Неопределенностей относительно желаемого результата.
 - С. Из-за невозможности защитить проект извне.
3. На выходе какого процесса получается список выявленных рисков:
 - А. Планирование управления рисками.
 - В. Идентификация рисков.
 - С. Качественный анализ рисков.
4. Способ обнаружения рисков, основанный на выявлении хороших и плохих внешних и внутренних факторов исполняющей организации, называется:
 - А. Метод Дельфи.
 - В. SWOT-анализ.
 - С. Анализ документации.
5. Показатель допустимого риска не должен:
 - а) превышать предельного значения;
 - б) быть меньше предельной величины;
 - в) быть равным нулю.
6. К стратегиям реагирования на риски относится:
 - а) диверсификация риска;
 - б) лидерство в издержках связанных с риском;
 - в) передача риска;
 - г) интеграция риска;
7. Матрица вероятности и последствий используется для:
 - А. Анализа чувствительности рисков.
 - В. Вычисления ожидаемых значений рисков.
 - С. Качественного ранжирования рисков по уровням.
- 8) Какие категории задач управления рисками проекта можно выделить?

- а) применение риск-менеджмента;
 - б) применение методов риск-менеджмента;
 - в) управление рисками по их типам;
 - г) точность оценок рисков;
 - д) точность прогнозов рисков.
- 9) VAR – это:
- а) парадигма стоимости риска (Value-at-Risk);
 - б) показатель объемов потерь прибыли (Volume at Reduce);
 - в) степень сопротивления персонала рискованным проектам (Volume at Resistance);
 - г) объем риска (Volume of Accepted Risk).
- 10) Главной функцией управления рисками является:
- а) создание чуткой системы управления рисками;
 - б) оценка риска по каждому проекту в компании;
 - в) оценка риска для компании в целом;
 - г) предотвращение банкротства компании в результате наступления случайных событий.
- 11) Какие подходы выделяют при расчете VAR?
- а) эмпирический;
 - б) логический;
 - в) оценочный;
 - г) ранжирование;
 - д) параметрический.
- 12) Что из перечисленного не является элементом расчета VAR для одного актива?
- а) текущая стоимость актива;
 - б) чувствительность стоимости к неблагоприятному изменению фактора риска;
 - в) изменение стоимости в перспективе;
 - г) возможное изменение фактора риска при данном доверительном уровне;
 - д) все вышеперечисленные ответы верны;
 - е) все вышеперечисленные ответы не верны.

Регламент проведения текущего контроля и оценивания

№	Вид работы	Продолжительность
1.	Предел длительности тестирования (12 вопросов)	35-40 мин.
2.	Внесение исправлений	до 5 мин.
	Итого (в расчете на тест)	до 45 мин.

Общее распределение баллов текущего контроля по видам учебных работ для студентов (в соответствии с Положением)

Рейтинг-контроль 1	Тест 12 вопросов в	До 15 баллов
Рейтинг-контроль 2	Тест 12 вопросов в	До 15 баллов
Рейтинг контроль 3	Тест 12 вопросов в	До 30 баллов
Посещение занятий студентом		5 баллов
Дополнительные баллы (бонусы)		5 баллов
Выполнение семестрового плана самостоятельной работы		30 баллов
	Итого	До 100 баллов

Задачи и практические задания

Практическое упражнение (1 часть семестрового задания):

1. Используя разработанный ранее бизнес-план проекта – определить риски проекта.
2. Составить реестр рисков проекта.
3. Составить план управления рисками проекта.

Контрольная работа (2 часть семестрового задания)

Задача 1. Решение задач на применение метода анализа ожидаемого денежного значения.

Цель работы – развитие навыков решения задач по выбору оптимальных с точки зрения финансовых результатов проектов на основе применения статистических методов.

Компании предлагается два рискованных проекта:

	Проект 1			Проект 2		
Вероятность события	0,3	0,3	0,4	0,5	0,3	0,2
Прибыль, млн. руб.	60	40	30	50	10	20

Рассчитать ожидаемое денежное значение по каждому проекту.

Ответ: проект 1 – 42 млн.руб., проект 2 - 32 млн.руб.

Задача 2. Решение задач с использованием дерева решений.

Цель работы: Совершенствование умений применения методов количественного анализа рисков в проектах.

Содержание работы:

Условия задачи: Руководство компании решает вопрос о выборе проекта по созданию нового продукта из 3 альтернатив. Уровень прибыли каждого проекта зависит от величины спроса. Вероятность высокого спроса равна 0,6, а низкого спроса равна 0,4.

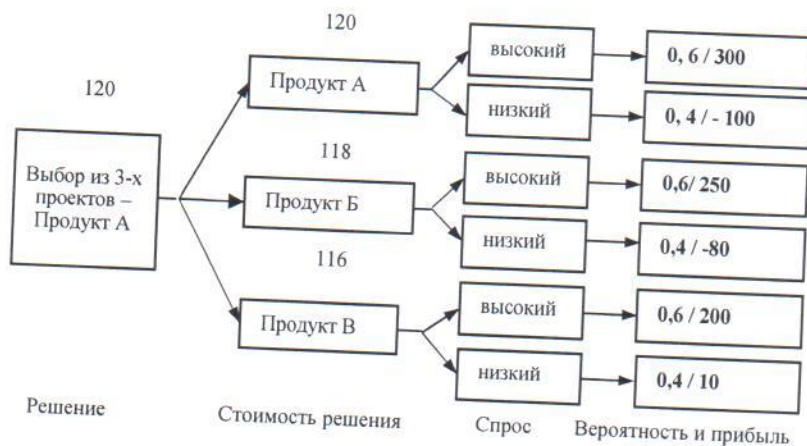
Этапы работы:

1. На основании данных таблицы 1 построить дерево решений;

Проект	Продукт	Средняя ожидаемая прибыль, тыс. руб.	
		Высокий спрос	Низкий спрос
1	А	300	- 100
2	Б	250	- 80
3	В	200	10

Таблица 1

2. Определить среднюю ожидаемую прибыль по каждому проекту.



Задача 3. Инвестиционная стратегия предприятия (селективные риски)

- а) Руководству фирмы требуется определить рискованность вложения, т.е. сколько

нужно вложить средств в инвестирование проекта в настоящее время, чтобы через 7 лет иметь 35 тыс. у.е. при 10%-ной норме доходности инвестиций.

б) От эксплуатации основного средства предприятие может получать в течение 8 лет доход в размере 14 тыс. у.е. в год. Остаточная стоимость данного основного средства через 8 лет будет равна 10 тыс. у.е. Какую минимальную сумму должно получить предприятие от продажи этого основного средства, чтобы в случае вложения вырученных денег в банк под 20 % годовых на 8 лет иметь доход не ниже, чем результат от эксплуатации основного средства?

Задача 4. Измерение риска на основе вероятностной оценки ожидаемых доходов. Требуется дать оценку двум взаимоисключающим проектам развития предприятия стоимостью 500 тыс. у.е.

Проект (М):

– замена оборудования на более производительное (модернизация).

Проект (И):

– приобретение нового оборудования для изготовления новой продукции (инновация).

Оценку необходимо осуществить в следующей последовательности:

1. Оценка денежных потоков и финансовых результатов для каждого варианта реализации проектов. Использовать статистический метод оценки на основе чистого ожидаемого годового дохода (NCF t)
2. Присвоение определенной вероятности получения дохода по каждому варианту реализации проекта:
 - оптимистический;
 - нормальный (наиболее вероятный);
 - пессимистический.
3. Построение графика ожидаемых чистых доходов (исходя из нормального закона распределения вероятностей). (По оси абсцисс «ожидаемый доход», по оси ординат «вероятность»)
4. Рассчитать параметры вероятности – стандартное отклонение, дисперсию, математическое ожидание.
5. Осуществить сравнительную оценку риска по стандартному отклонению (если проекты обладают одинаковым стандартным отклонением – то по коэффициенту вариации).

Задача 5. Риски доходности при выборе инвестиционного проекта
Даны два инвестиционных проекта А и В, для которых возможные нормы доходности (IRR) находятся в зависимости от будущего состояния экономики. Данную зависимость отражена в таблице 1.

Таблица 1

Данные для расчета ожидаемой нормы доходности вариантов вложения капитала в проекты 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%

Для каждого из проектов А и В необходимо рассчитать ожидаемую норму доходности ERR – средневзвешенное (где в качестве весов берутся вероятности) или вероятностное среднее возможных IRR.

Вопросы к зачету по дисциплине «Управление рисками в проектах»

1. Понятие неопределенности и риска в проектах.
2. Источники неопределенности и риска в проектах.
3. Атрибуты проектного риска.
4. Влияние риска на проект.
5. Определение управления проектным риском.
6. Задачи менеджеров и членов команды проекта в рамках управления риском проекта.
7. Основные классификационные признаки риска в проектах.
8. Основные виды проектного риска.
9. Инвестиционный риск.
10. Производственный риск.
11. Инновационный риск.
12. Финансовый риск: процентный, кредитный и валютный.
13. Операционный риск.
14. Риски, связанные с нестабильностью экономического законодательства и текущей экономической ситуации, условий инвестирования и использования прибыли.
15. Создание системы управления рисками.
16. Задачи, решаемые с помощью системы управления проектными рисками.
17. Нормативно-методическая база управления проектными рисками.
18. Распределение ролей и ответственности.
19. Основные стандарты управления проектными рисками.
20. Методологические принципы управления проектными рисками.
21. Методология управления рисками проекта согласно РМВОК.
22. Совещания по планированию управления рисками и анализ рисков.
23. План управления рисками проекта.
24. Основные элементы плана управления рисками проекта: методология, роли и ответственность, разработка бюджета, определение сроков, категории рисков.
25. Источники для анализа проектного риска.
26. Методы сбора информации по рискам проекта.
27. Основные инструменты идентификации риска проекта.
28. Мозговой штурм.
29. Метод Дельфи.
30. Методы диаграмм.
31. Анализ допущений.
32. SWOT-анализ.
33. Составление реестра риска проекта
34. Ранжирование и рейтинг проектного риска.
35. Методика составления матрицы вероятности и воздействия.
36. Оценка качества данных по рискам.
37. Категоризация рисков.
38. Оценка срочности рисков
39. Анализ чувствительности. Анализ ожидаемого денежного значения.
40. Математической ожидание, дисперсия и коэффициент вариации ожидаемого денежного значения.
41. Дерево решений.
42. Моделирование и имитация. Метод Монте-Карло.

43. Отчет о количественном анализе риска
44. Определения путей и действий по увеличению возможностей и снижению угроз целям проекта.
45. Определение стратегии управления проектными рисками.
46. Уклонение от проектного риска.
47. Передача проектного риска.
48. Снижение проектного риска.
49. Принятие проектного риска.
50. Реализация планов реагирования на риски.
51. Отслеживание идентифицированных рисков.
52. Мониторинг остаточных рисков, обнаружение новых рисков.
53. Оценка результативности управления проектным риском.
54. Пересмотр рисков.
55. Аудит рисков.
56. Обновление реестра проектных рисков.

6.6. Методические материалы, определяющие процедуры оценивания знаний, умений, навыков и (или) опыта деятельности, характеризующих этапы формирования компетенций

Опрос проводит преподаватель по всем темам дисциплины. Знания, умения, навыки студента при проведении опроса оцениваются «зачтено», «не зачтено». Основой для определения оценки служит уровень усвоения студентами материала, предусмотренного данной рабочей программой.

Оценивание студента на опросе по дисциплине «Управление рисками в проектах»

Оценка	Требования к знаниям
«Зачтено»	Оценка «зачтено» выставляется студенту, который усвоил предусмотренный программный материал; правильно, с приведением примеров, показал систематизированные знания по теме дисциплины, способен связать теорию с практикой, тему вопроса с другими темами данного курса, других изучаемых предметов.
«Не зачтено»	Оценка «не зачтено» выставляется в следующих случаях: 1. Студент не справился с заданием, не может ответить на вопросы, предложенные преподавателем, не обладает целостным представлением об изучаемой теме и ее взаимосвязях. 2. Ответ на вопрос полностью отсутствует. 3. Отказ от ответа.

Зачет принимает преподаватель. Оценка знаний студента на зачете носит комплексный характер и определяется его:

- ответом на зачете;
- учебными достижениями в семестровый период.

Знания, умения, навыки студента при проведении зачета по дисциплине оцениваются по системе: «зачтено» и «не зачтено». Основой для определения оценки служит уровень усвоения студентами материала, предусмотренного данной рабочей программой.

Оценивание студента на зачете по дисциплине «Управление рисками в проектах»

Оценка	Требования к знаниям
«Зачтено»	Оценка «зачтено» выставляется студенту, если он твердо знает материал, грамотно и по существу излагает его, не допуская существенных неточностей в ответе на вопрос, правильно применяет теоретические положения при решении практических вопросов и задач, владеет необходимыми навыками и приемами их выполнения.
«Не зачтено»	Оценка «не зачтено» выставляется студенту, который не знает значительной части программного материала, допускает существенные ошибки, неуверенно, с большими затруднениями выполняет практические работы. Как правило, оценка «не зачтено» ставится студентам, которые не могут продолжить обучение без дополнительных занятий по соответствующей дисциплине.

6.7. Методические указания для обучающихся по освоению дисциплины

Обучение по дисциплине «Управление рисками в проектах» предполагает изучение курса на аудиторных занятиях (практические занятия) и самостоятельной работы студентов. Практические занятия дисциплины «Управление рисками в проектах» предполагают их проведение в различных формах с целью выявления полученных знаний, умений, навыков и компетенций.

Подготовка к практическим занятиям:

- внимательно прочитайте материал лекций относящихся к данному практическому занятию, ознакомьтесь с учебным материалом по учебнику и учебным пособиям;
- выпишите основные термины;
- ответьте на контрольные вопросы по занятиям, готовьтесь дать развернутый ответ на каждый из вопросов;
- уясните, какие учебные элементы остались для вас неясными и постарайтесь получить на них ответ заранее во время текущих консультаций преподавателя;
- готовиться можно индивидуально, парами или в составе малой группы, последние являются эффективными формами работы.

Подготовка к зачету. Текущий контроль должны сопровождать рефлексия участия в интерактивных занятиях и ответы на ключевые вопросы по изученному материалу. Итоговый контроль по курсу осуществляется в форме ответа на вопросы к зачету. В самом начале учебного курса необходимо познакомиться со следующей учебно-методической документацией:

- программой дисциплины;
- перечнем знаний и умений, которыми студент должен владеть;
- тематическими планами занятий;
- контрольными мероприятиями;
- учебником, учебными пособиями по дисциплине, а также электронными ресурсами;
- перечнем вопросов к зачету.

После этого должно сформироваться четкое представление об объеме и характере знаний и умений, которыми надо будет овладеть по дисциплине. Систематическое выполнение учебной работы на занятиях позволит успешно освоить дисциплину и создать хорошую базу для сдачи зачета.

7. УЧЕБНО-МЕТОДИЧЕСКОЕ И ИНФОРМАЦИОННОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛЯ)

а) основная литература:

1. Павлов, А. Н. Управление проектами на основе стандарта PMI PMBOK. Изложение методологии и опыт применения [Электронный ресурс] / А. Н. Павлов. - 4-е изд., испр. и доп. (эл.). - М.: БИНОМ. Лаборатория знаний, 2014. - 271 с.: ил. - (Проекты, программы, портфели). - ISBN 978-5-9963-2355-5. Режим доступа: <http://www.iprbookshop.ru/6547.html>
2. Горбунов В. Л. Бизнес-планирование с оценкой рисков и эффективности проектов: Научно-практическое пособие / В.Л. Горбунов. - М.: ИЦ РИОР: НИЦ ИНФРА-М, 2013 - 248 с.: 60x88 1/16 + (Доп. мат. znanium.com). - (Наука и практика). (о) ISBN 978-5-369-01228-4 Режим доступа: <http://znanium.com/catalog.php?bookinfo=414488>
3. Романова М. В. Управление проектами: Учебное пособие / М.В. Романова. - М.: ИД ФОРУМ: НИЦ Инфра-М, 2013. - 256 с.: ил.; 60x90 1/16. - (Высшее образование). (переплет) ISBN 978-5-8199-0308-7 Режим доступа: <http://znanium.com/catalog.php?bookinfo=391146>

б) дополнительная литература:

1. Грачева М. В. Риск-менеджмент инвестиционного проекта [Электронный ресурс]: учебник для студентов вузов, обучающихся по экономическим специальностям / под ред. М. В. Грачевой, А. Б. Секерина. - М.: ЮНИТИДАНА, 2012. - 544 с. - ISBN 978-5-238-01506-4. Режим доступа: <http://znanium.com/catalog.php?bookinfo=391215>
2. Володин, В. В. Управление проектом [Электронный ресурс] : учеб. пособие / В. В. Володин, Ф. Б. Лобанов, Т. В. Алексеева и др. - М.: Московский финансово-промышленный университет «Синергия», 2013. - (Сдаем госэкзамен). - ISBN 978-5-4257-0144-2. Режим доступа: <http://znanium.com/catalog.php?bookinfo=451383>
3. Хелдман К. Профессиональное управление проектом [Электронный ресурс] / К. Хелдман ; пер. с англ. А.В. Шаврина. — 6-е изд. (эл.). — М. : БИНОМ. Лаборатория знаний, 2015. — 731 с. — (Проекты, программы, портфели). — ISBN 978-5-9963-2503-0 Режим доступа: <http://www.iprbookshop.ru/26135.html>
4. Павлов, А. Н. Управление программами проектов на основе стандарта PMI The Standard for Program Management. Изложение методологии и рекомендации по применению [Электронный ресурс] / А. Н. Павлов. - Эл. изд. - М.: БИНОМ. Лаборатория знаний, 2012. - 304 с.: ил. - (Проекты, программы, портфели). - ISBN 978-5-9963-1180-4. Режим доступа: <http://www.iprbookshop.ru/26140.html>
5. Павлов А. Н. Управление портфелями проектов на основе стандарта PMI The Standard for Portfolio Management. Изложение методологии и рекомендации по применению [Электронный ресурс] / А.Н. Павлов. - Эл. изд. - М.: БИНОМ. Лаборатория знаний, 2013. - 214 с.: ил. - (Проекты, программы, портфели). - ISBN 978-5-9963-2299-2. Режим доступа: <http://www.iprbookshop.ru/26138.html>

в) периодические издания:

1. Управление финансовыми рисками;
2. Управление риском;

3. Экономический анализ: теория и практика;
4. РИСК: Ресурсы, Информация, Снабжение, Конкуренция

в) интернет-ресурсы:

5. <http://www.riskmanager.ru>
6. <http://www.ecoline.ru>
7. <http://www.projectmanagement.ru>
8. <http://www.consultant.ru>

8. МАТЕРИАЛЬНО-ТЕХНИЧЕСКОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛЯ)

Для обеспечения образовательного процесса по дисциплине институт располагает следующей материально-технической базой, обеспечивающей проведение всех видов дисциплинарной и междисциплинарной подготовки, предусмотренных учебным планом и соответствующих действующим санитарным и противопожарным правилам и нормам:

- лекционные аудитории, оборудованные видеопроjectionным оборудованием для презентаций, средствами звуковоспроизведения, экраном и имеющие выход в сеть Интернет;
- помещения для проведения практических занятий, оборудованные учебной мебелью;
- библиотека, имеющая места для студентов, оснащенные компьютерами с доступом к базам данных и сети Интернет;
- компьютерные классы с комплектом лицензионного программного обеспечения Microsoft Office, «КонсультантПлюс».

Рабочая программа дисциплины составлена в соответствии с требованиями ФГОС ВО по направлению 38.04.02 «Менеджмент» программа «Управление проектами»


Рабочую программу составил доц. каф. МНиМР, к.э.н., доц. Омаров Т.Д. 

Рецензент:

Генеральный директор ООО «ПКФ Росток» Михеев А.П. 

Программа рассмотрена и одобрена на заседании кафедры «Менеджмент и маркетинг»


Протокол № 10 от «21» апреля 2016 года

Заведующий кафедрой д.э.н., проф. Филимонова Н.М. 

Рабочая программа рассмотрена и одобрена на заседании учебно-методической комиссии направления 38.04.02 «Менеджмент»

Протокол № 12 от «25» апреля 2016 года

Председатель комиссии:

директор Института экономики и менеджмента, д.э.н., проф. Захаров П.Н. 

**ЛИСТ ПЕРЕУТВЕРЖДЕНИЯ
РАБОЧЕЙ ПРОГРАММЫ ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛЯ)**

Рабочая программа одобрена на _____ учебный год

Протокол заседания кафедры № _____ от _____ года

Заведующий кафедрой _____

Рабочая программа одобрена на _____ учебный год

Протокол заседания кафедры № _____ от _____ года


Заведующий кафедрой _____

Рабочая программа одобрена на _____ учебный год

Протокол заседания кафедры № _____ от _____ года

Заведующий кафедрой _____

**ЛИСТ ПЕРЕУТВЕРЖДЕНИЯ
РАБОЧЕЙ ПРОГРАММЫ ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛЯ)**

Рабочая программа одобрена на 2016/17 учебный год
Протокол заседания кафедры № 1 от 31.08.16 года
Заведующий кафедрой 

Рабочая программа одобрена на _____ учебный год
Протокол заседания кафедры № _____ от _____ года
Заведующий кафедрой _____

Рабочая программа одобрена на _____ учебный год
Протокол заседания кафедры № _____ от _____ года
Заведующий кафедрой _____

Министерство образования и науки Российской Федерации
Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение
высшего профессионального образования
«Владимирский государственный университет
имени Александра Григорьевича и Николая Григорьевича Столетовых»

Институт экономики и менеджмента
Кафедра «Менеджмент и маркетинг»

УТВЕРЖДАЮ

Заведующий кафедрой «Менеджмента и
маркетинга»

 Филимонова Н.М.

« 24 » 04 20 15

Основание: решение кафедры от

« 24 » 04 20 15

**ФОНД ОЦЕНОЧНЫХ СРЕДСТВ
ДЛЯ ТЕКУЩЕГО КОНТРОЛЯ И ПРОМЕЖУТОЧНОЙ АТТЕСТАЦИИ
ПРИ ИЗУЧЕНИИ УЧЕБНОЙ ДИСЦИПЛИНЫ**

УПРАВЛЕНИЕ РИСКАМИ В ПРОЕКТАХ

38.04.02 «МЕНЕДЖМЕНТ»

ПРОГРАММА ПОДГОТОВКИ «Управление проектами»

МАГИСТРАТУРА

Владимир, 2015

ПАСПОРТ ФОНДА ОЦЕНОЧНЫХ СРЕДСТВ

Фонд оценочных средств (ФОС) для текущего контроля успеваемости и промежуточной аттестации по дисциплине «УПРАВЛЕНИЕ РИСКАМИ В ПРОЕКТАХ» разработан в соответствии с рабочей программой, входящей в ОПОП ВО направления подготовки 38.04.02 «Менеджмент» программа подготовки «Управление проектами».

Комплект оценочных средств по дисциплине «УПРАВЛЕНИЕ РИСКАМИ В ПРОЕКТАХ» предназначен для аттестации обучающихся на соответствие их персональных достижений поэтапным требованиям образовательной программы, в том числе рабочей программы дисциплины «УПРАВЛЕНИЕ РИСКАМИ В ПРОЕКТАХ», для оценивания результатов обучения: знаний, умений, владений и уровня приобретенных компетенций.

Фонд оценочных средств для проведения промежуточной аттестации обучающихся по дисциплине

Промежуточная аттестация студентов по дисциплине «Управление рисками в проектах» проводится в соответствии с Учебным планом в форме зачета в 3 семестре для студентов. Студенты допускаются к зачету по дисциплине в случае выполнения им учебного плана по дисциплине: выполнения всех заданий и мероприятий, предусмотренных программой дисциплины.

Перечень компетенций с указанием этапов их формирования в процессе освоения образовательной программы

В ходе промежуточной аттестации осуществляется контроль освоения компетенций в соответствии с этапами их формирования.

Этапы формирования компетенций в ходе изучения дисциплины «Управление рисками в проектах»

Таблица 6

№ п/п	Наименование тем	Содержание тем	Коды компетенций
Тема 1	Риск и неопределенность в управлении проектами.	Понятие неопределенности и риска в проектах. Источники неопределенности и риска в проектах. Атрибуты проектного риска. Влияние риска на проект. Определение управления проектным риском. Задачи менеджеров и членов команды проекта в рамках управления риском проекта.	ОК-2 ОПК-1
Тема 2	Классификация проектных рисков	Основные классификационные признаки риска в проектах. Основные виды проектного риска. Инвестиционный риск. Производственный риск. Инновационный риск. Финансовый риск: процентный, кредитный и валютный. Операционный риск. Риски, связанные с нестабильностью экономического законодательства и текущей экономической ситуации, условий инвестирования и использования прибыли.	ОК-2 ОПК-1
Тема 3	Система управления рисками проектов	Создание системы управления рисками. Задачи, решаемые с помощью системы управления проектными рисками. Нормативно-методическая база управления проектными рисками. Распределение ролей и ответственности. Основные стандарты управления проектными рисками. Методологические принципы управления проектными рисками. Методология управления рисками проекта согласно РМВОК.	ОК-2 ОПК-1
Тема 4	Планирование управления проектными рисками	Совещания по планированию управления рисками и анализ рисков. План управления рисками проекта. Основные элементы плана управления рисками проекта: методология, роли и ответственность, разработка бюджета, определение сроков, категории рисков.	ОК-2 ОПК-1
Тема 5	Идентификация проектных рисков	Источники для анализа проектного риска. Методы сбора информации по рискам проекта. Основные инструменты идентификации риска проекта. Мозговой штурм. Метод Дельфи. Методы диаграмм. Анализ допущений. SWOT-анализ. Составление реестра риска проекта.	ОК-2 ОПК-1

№ п/п	Наименование тем	Содержание тем	Коды компетенций
Тема 6	Качественный анализ рисков	Ранжирование и рейтинг проектного риска. Методика составления матрицы вероятности и воздействия. Оценка качества данных по рискам. Категоризация рисков. Оценка срочности рисков.	ОК-2 ОПК-1
Тема 7	Количественный анализ рисков	Анализ чувствительности. Анализ ожидаемого денежного значения. Математическое ожидание, дисперсия и коэффициент вариации ожидаемого денежного значения. Дерево решений. Моделирование и имитация. Метод Монте-Карло. Отчет о количественном анализе риска.	ОК-2 ОПК-1
Тема 8	Планирование реагирования на проектные риски	Определения путей и действий по увеличению возможностей и снижению угроз целям проекта. Определение стратегии управления проектными рисками. Уклонение от проектного риска. Передача проектного риска. Снижение проектного риска. Принятие проектного риска.	ОК-2 ОПК-1
Тема 9	Мониторинг и управление проектными рисками	Реализация планов реагирования на риски. Отслеживание идентифицированных рисков. Мониторинг остаточных рисков, обнаружение новых рисков. Оценка результативности управления проектным риском. Пересмотр рисков. Аудит рисков. Обновление реестра проектных рисков.	ОК-2 ОПК-1

Описание показателей и критериев оценивания компетенций на различных этапах их формирования, описание шкал оценивания

Таблица 7

Показатели и критерии оценивания компетенций по этапам их формирования

Наименование тем	Коды компетенций	Коды ЗУВ		Показатели оценивания	Критерии оценивания	Оценка
Риск и неопределенность в управлении проектами	ОК-2 ОПК-1	31 (ОК-2), 32 (ОК-2), У1(ОК-2), У2(ОК-2), У3(ОК-2), В1(ОК-2), 31 (ОПК-1), 32 (ОПК-1),	33 (ОПК-1), 34 (ОПК-1) У1 (ОПК-1), У2(ОПК-1), У3(ОПК-1), В1(ОПК-1), В2(ОПК-1).	Вопросы на зачете 1-6	Оценка «зачтено» выставляется студенту, если он твердо знает материал, грамотно и по существу излагает его, не допуская существенных неточностей в ответе на вопрос, правильно применяет теоретические положения при решении практических вопросов и задач, владеет необходимыми навыками и приемами их выполнения.	Зачтено
Классификация проектных рисков	ОК-2 ОПК-1	31 (ОК-2), 32 (ОК-2), У1(ОК-2), У2(ОК-2), У3(ОК-2), В1(ОК-2), 31 (ОПК-1), 32 (ОПК-1),	33 (ОПК-1), 34 (ОПК-1) У1 (ОПК-1), У2(ОПК-1), У3(ОПК-1), В1(ОПК-1), В2(ОПК-1).	Вопросы на зачете 7-14		
Система управления рисками проектов	ОК-2 ОПК-1	31 (ОК-2), 32 (ОК-2), У1(ОК-2), У2(ОК-2), У3(ОК-2), В1(ОК-2), 31 (ОПК-1), 32 (ОПК-1),	33 (ОПК-1), 34 (ОПК-1) У1 (ОПК-1), У2(ОПК-1), У3(ОПК-1), В1(ОПК-1), В2(ОПК-1).	Вопросы на зачете 15-21		
Планирование управления проектными рисками	ОК-2 ОПК-1	31 (ОК-2), 32 (ОК-2), У1(ОК-2), У2(ОК-2), У3(ОК-2), В1(ОК-2), 31 (ОПК-1), 32 (ОПК-1),	33 (ОПК-1), 34 (ОПК-1) У1 (ОПК-1), У2(ОПК-1), У3(ОПК-1), В1(ОПК-1), В2(ОПК-1).	Вопросы на зачете 22-24		
Идентификация	ОК-2	31 (ОК-2),	33 (ОПК-1),			

Наименование тем	Коды компетенций	Коды ЗУВ		Показатели оценивания	Критерии оценивания	Оценка
проектных рисков	ОПК-1	32 (ОК-2), У1(ОК-2), У2(ОК-2), У3(ОК-2), В1(ОК-2), 31 (ОПК-1), 32 (ОПК-1),	34 (ОПК-1) У1 (ОПК-1), У2(ОПК-1), У3(ОПК-1), В1(ОПК-1), В2(ОПК-1).	Вопросы на зачете 25-33	Оценка «не зачтено» выставляется студенту, который не знает значительной части программного материала, допускает существенные ошибки, неуверенно, с большими затруднениями выполняет практические работы. Как правило, оценка «не зачтено» ставится студентам, которые не могут продолжить обучение без дополнительных занятий по соответствующей дисциплине.	Не зачтено
Качественный анализ рисков	ОК-2 ОПК-1	31 (ОК-2), 32 (ОК-2), У1(ОК-2), У2(ОК-2), У3(ОК-2), В1(ОК-2), 31 (ОПК-1), 32 (ОПК-1),	33 (ОПК-1), 34 (ОПК-1) У1 (ОПК-1), У2(ОПК-1), У3(ОПК-1), В1(ОПК-1), В2(ОПК-1).	Вопросы на зачете 34-38		
Количественный анализ рисков	ОК-2 ОПК-1	31 (ОК-2), 32 (ОК-2), У1(ОК-2), У2(ОК-2), У3(ОК-2), В1(ОК-2), 31 (ОПК-1), 32 (ОПК-1),	33 (ОПК-1), 34 (ОПК-1) У1 (ОПК-1), У2(ОПК-1), У3(ОПК-1), В1(ОПК-1), В2(ОПК-1).	Вопросы на зачете 39-43		
Планирование реагирования на проектные риски	ОК-2 ОПК-1	31 (ОК-2), 32 (ОК-2), У1(ОК-2), У2(ОК-2), У3(ОК-2), В1(ОК-2), 31 (ОПК-1), 32 (ОПК-1),	33 (ОПК-1), 34 (ОПК-1) У1 (ОПК-1), У2(ОПК-1), У3(ОПК-1), В1(ОПК-1), В2(ОПК-1).	Вопросы на зачете 44-50		
Мониторинг и управление проектными рисками.	ОК-2 ОПК-1	31 (ОК-2), 32 (ОК-2), У1(ОК-2), У2(ОК-2), У3(ОК-2), В1(ОК-2), 31 (ОПК-1), 32 (ОПК-1),	33 (ОПК-1), 34 (ОПК-1) У1 (ОПК-1), У2(ОПК-1), У3(ОПК-1), В1(ОПК-1), В2(ОПК-1).	Вопросы на зачете 51-57		

Типовые контрольные задания или иные материалы, необходимые для оценки знаний, умений, навыков и (или) опыта деятельности, характеризующих этапы формирования компетенций в процессе освоения образовательной программы

**Вопросы для подготовки к опросу
по дисциплине «Управление рисками в проектах»**

Тема 1. Риск и неопределенность в управлении проектами

1. Понятие неопределенности и риска в проектах.
2. Источники неопределенности и риска в проектах.
3. Атрибуты проектного риска.
4. Влияние риска на проект.
5. Определение управления проектным риском.
6. Задачи менеджеров и членов команды проекта в рамках управления риском проекта.

Тема 2. Классификация проектных рисков

1. Основные классификационные признаки риска в проектах.
2. Основные виды проектного риска.
3. Инвестиционный риск.
4. Производственный риск.
5. Инновационный риск.
6. Финансовый риск: процентный, кредитный и валютный.
7. Операционный риск.
8. Риски, связанные с нестабильностью экономического законодательства и текущей экономической ситуации, условий инвестирования и использования прибыли.

Тема 3. Система управления рисками проектов

1. Создание системы управления рисками.
2. Задачи, решаемые с помощью системы управления проектными рисками.
3. Нормативно-методическая база управления проектными рисками.
4. Распределение ролей и ответственности.
5. Основные стандарты управления проектными рисками.
6. Методологические принципы управления проектными рисками.
7. Методология управления рисками проекта согласно РМВОК.

Тема 4. Планирование управления проектными рисками

1. Совещания по планированию управления рисками и анализ рисков.
2. План управления рисками проекта.
3. Основные элементы плана управления рисками проекта: методология, роли и ответственность, разработка бюджета, определение сроков, категории рисков.

Тема 5. Идентификация проектных рисков

1. Источники для анализа проектного риска.
2. Методы сбора информации по рискам проекта.
3. Основные инструменты идентификации риска проекта.
4. Мозговой штурм.
5. Метод Дельфи.
6. Методы диаграмм.
7. Анализ допущений.
8. SWOT-анализ.
9. Составление реестра риска проекта

Тема 6. Качественный анализ рисков

1. Ранжирование и рейтинг проектного риска.
2. Методика составления матрицы вероятности и воздействия.
3. Оценка качества данных по рискам.
4. Категоризация рисков.
5. Оценка срочности рисков

Тема 7. Количественный анализ рисков

1. Анализ чувствительности. Анализ ожидаемого денежного значения.
2. Математическое ожидание, дисперсия и коэффициент вариации ожидаемого денежного значения.
3. Дерево решений.
4. Моделирование и имитация. Метод Монте-Карло.
5. Отчет о количественном анализе риска

Тема 8. Планирование реагирования на проектные риски

1. Определения путей и действий по увеличению возможностей и снижению угроз целям проекта.
2. Определение стратегии управления проектными рисками.
3. Уклонение от проектного риска.

4. Передача проектного риска.
5. Снижение проектного риска.
6. Принятие проектного риска.

Тема 9. Мониторинг и управление проектными рисками

1. Реализация планов реагирования на риски.
2. Отслеживание идентифицированных рисков.
3. Мониторинг остаточных рисков, обнаружение новых рисков.
4. Оценка результативности управления проектным риском.
5. Пересмотр рисков.
6. Аудит рисков.
7. Обновление реестра проектных рисков.

Примеры тестовых заданий по дисциплине «Управление рисками в проектах», используемых при промежуточной аттестации

Тесты к рейтинг-контролю №1

1. 1. Риск в проектах – это:
 - а) вероятность технических аварий в рамках проекта;
 - б) все, что может негативно повлиять на достижение целей проекта в рамках строго определенного временного промежутка;
 - в) неблагоприятное событие, влекущее за собой убыток в проекте;
 - г) вероятность провала в реализации проекта;
 - д) неопределенное событие или условие, наступление которого отрицательно или положительно сказывается на целях проекта, таких как: содержание, расписание, стоимость и качество.
2. Управление риском в проектах– это:
 - а) отказ от рискованного проекта;
 - б) систематический процесс идентификации, анализа и реагирования на риски проекта;
 - в) комплекс мер, направленных на компенсацию, снижение, перенесение, принятие риска проекта или уход от него;
 - г) комплекс мероприятий, направленных на подготовку к реализации риска в проекте.
 - д) комплекс мер, направленных на снижение вероятности реализации риска проекта;
3. К задачам системы управления проектными рисками не относится:
 - а) распределение ответственности между подразделениями и проектами;
 - б) минимизация неблагоприятного воздействия на проект;
 - в) разработка нормативно-методической базы управления проектными рисками;
 - г) построение организационной модели управления проектными рисками;
 - д) обучение проектных риск-менеджеров методологии управления рисками.
4. В рамках количественного анализа рисков не применяются следующие методы:
 - а) статистический;
 - б) синтетический;
 - в) анализ чувствительности;
 - г) эмпирический;
 - д) моделирования и имитации.

5. Стратегия, позволяющая выполнить некоторые действия и не учитывать риск впоследствии, называется:
- А. Уклонение от риска.
 - В. Принятие риска.
 - С. Передача риска.
6. Триггером риска – симптомом, сигнализатором риска не может быть:
- А. Задержка выполнения нескольких операций.
 - В. Повторяющиеся однотипные дефекты.
 - С. Предсказание члена команды.
7. Затраты на не идентифицированные риски учитываются в статье:
- А. Управленческий резерв.
 - В. Бюджет на непредвиденные обстоятельства.
 - С. Фонд управления рисками.
- 8) Управление риском – это:
- а) отказ от рискованного проекта;
 - б) комплекс мер, направленных на снижение вероятности реализации риска;
 - в) комплекс мер, направленных на компенсацию, снижение, перенесение, принятие риска или уход от него;
 - г) комплекс мероприятий, направленных на подготовку к реализации риска.
- 9) Реализация управления рисками на современных предприятиях включает в себя:
- а) выявление последствий деятельности экономических субъектов в ситуации риска;
 - б) прогнозирование этой деятельности для снижения уровня риска;
 - в) умение реагировать на возможные отрицательные последствия этой деятельности;
 - г) умение ликвидировать такие последствия;
 - д) разработка и осуществление мер, при помощи которых могут быть нейтрализованы или компенсированы вероятные негативные результаты предпринимаемых действий.
- 10) Содержательная сторона управления рисками включает в себя:
- а) планирование деятельности по реализации рискованного проекта;
 - б) сравнение вероятностей и характеристик риска, полученных в результате оценки и анализа риска;
 - в) выбор мер по минимизации или устранению последствий риска;
 - г) организация службы управления рисками на предприятии.
- 11) Что из перечисленного не является элементом системы управления рисками?
- а) выявление расхождений в альтернативах риска;
 - б) разработка планов, позволяющих действовать оптимальным образом в ситуации риска;
 - в) разработка конкретных мероприятий, направленных на минимизацию или устранение негативных последствий;
- 12) Основные аспекты и тенденции управления рисками:
- г) учет психологического восприятия рискованных проектов;
 - д) ни один из вариантов не является элементом системы риск-менеджмента;
 - е) все перечисленное является элементами системы риск-менеджмента.

1. Вычисление ожидаемого значения риска и принятие решения в условиях влияния нескольких факторов, называется:
 - А. Дерево решений.
 - В. Ожидаемое значение.
 - С. Графические методы.
- 2) Разновидностью экспертного метода является:
 - а) метод Дельфи;
 - б) метод Гаусса;
 - в) метод Иванова.
- 3 При экспертной оценке предпринимательского риска большое внимание следует уделять:
 - а) типу предприятия;
 - б) подбору экспертов;
 - в) величине предприятия.
- 4) Метод моделирования задачи выбора с помощью «дерева решений» предполагает:
 - а) математическое построение вариантов решений;
 - б) программное графическое построение вариантов решений;
 - в) графическое построение вариантов решений.
- 5) При использовании метода аналогий применяются:
 - а) базы данных о риске аналогичных проектов или сделок;
 - б) действия, которые намерен совершить предприниматель;
 - в) анонимность и управляемая обратная связь.
6. Экспертный метод может быть реализован:
 - а) путем обработки мнений опытных предпринимателей и специалистов;
 - б) с помощью опроса респондентов;
 - в) путем несистемной выборки.
- 7) Каждому эксперту, работающему отдельно, представляется:
 - а) помощник;
 - б) устав компании;
 - в) перечень возможных рисков.
8. Объективный метод определения вероятности основан на:
 - а) экспертных оценках;
 - б) вычислении частоты, с которой происходят некоторые события;
 - в) комбинировании вычисления частоты, с которой происходят некоторые события, с экспертными оценками;
 - г) нет верного ответа.
- 9) Субъективный метод определения вероятности основан на:
 - а) экспертных оценках;
 - б) вычислении частоты, с которой происходят некоторые события;
 - в) комбинировании вычисления частоты, с которой происходят некоторые события, с экспертными оценками;
 - г) нет верного ответа.
- 10) Известный метод экспертных оценок для определения исходных данных предстоящего моделирования инвестиционной программы носит название:
 - а) «СФИНКС»;
 - б) «ЛИБЕРО»;

- в) «ПАТТЕРН»;
- г) «КОНЭКСПЕРТ».
- 11) Волатильность – это:
 - а) изменчивость рыночного спроса;
 - б) постоянство рыночного спроса;
 - в) изменчивость курсовых разниц и процентных ставок;
 - г) постоянство курсовых разниц и процентных ставок.
- 12) Суть управления рисками проекта состоит в:
 - а) устранении риска проекта;
 - б) управлении проектным риском;
 - в) снижении уровня проектного риска;
 - г) выборе проектного риска.
- 13) Каковы функции объекта управления рисками?
 - а) организация разрешения риска;
 - б) организация рискованных вложений капитала;
 - в) организация работы по снижению величины риска;
 - г) организация процесса страхования рисков;
 - д) организация экономических отношений и связей между субъектами хозяйственного процесса;
 - е) все перечисленное является функциями объекта управления;

Тесты к рейтинг-контролю №3

1. В течение каких фаз проекта будут определены риски:
 - А. Инициации и исполнения.
 - В. Исполнения.
 - С. Всех фаз.
2. Риски присутствуют в проектах из-за:
 - А. Неадекватной толерантности исполняющей организации к рискам.
 - В. Неопределенностей относительно желаемого результата.
 - С. Из-за невозможности защитить проект извне.
3. На выходе какого процесса получается список выявленных рисков:
 - А. Планирование управления рисками.
 - В. Идентификация рисков.
 - С. Качественный анализ рисков.
4. Способ обнаружения рисков, основанный на выявлении хороших и плохих внешних и внутренних факторов исполняющей организации, называется:
 - А. Метод Дельфи.
 - В. SWOT-анализ.
 - С. Анализ документации.
5. Показатель допустимого риска не должен:
 - а) превышать предельного значения;
 - б) быть меньше предельной величины;
 - в) быть равным нулю.
6. К стратегиям реагирования на риски относится:
 - а) диверсификация риска;

- б) лидерство в издержках связанных с риском;
 - в) передача риска;
 - г) интеграция риска;
7. Матрица вероятности и последствий используется для:
- А. Анализа чувствительности рисков.
 - В. Вычисления ожидаемых значений рисков.
 - С. Качественного ранжирования рисков по уровням.
- 8) Какие категории задач управления рисками проекта можно выделить?
- а) применение риск-менеджмента;
 - б) применение методов риск-менеджмента;
 - в) управление рисками по их типам;
 - г) точность оценок рисков;
 - д) точность прогнозов рисков.
- 9) VAR – это:
- а) парадигма стоимости риска (Value-at-Risk);
 - б) показатель объемов потерь прибыли (Volume at Reduce);
 - в) степень сопротивления персонала рискованным проектам (Volume at Resistance);
 - г) объем риска (Volume of Accepted Risk).
- 10) Главной функцией управления рисками является:
- а) создание чуткой системы управления рисками;
 - б) оценка риска по каждому проекту в компании;
 - в) оценка риска для компании в целом;
 - г) предотвращение банкротства компании в результате наступления случайных событий.
- 11) Какие подходы выделяют при расчете VAR?
- а) эмпирический;
 - б) логический;
 - в) оценочный;
 - г) ранжирование;
 - д) параметрический.
- 12) Что из перечисленного не является элементом расчета VAR для одного актива?
- а) текущая стоимость актива;
 - б) чувствительность стоимости к неблагоприятному изменению фактора риска;
 - в) изменение стоимости в перспективе;
 - г) возможное изменение фактора риска при данном доверительном уровне;
 - д) все вышеперечисленные ответы верны;
 - е) все вышеперечисленные ответы не верны.

Регламент проведения текущего контроля и оценивания

№	Вид работы	Продолжительность
1.	Предел длительности тестирования (12 вопросов)	35-40 мин.
2.	Внесение исправлений	до 5 мин.
	Итого (в расчете на тест)	до 45 мин.

Общее распределение баллов текущего контроля по видам учебных работ для студентов (в соответствии с Положением)

Рейтинг-контроль 1	Тест 12 вопросов в	До 15 баллов
Рейтинг-контроль 2	Тест 12 вопросов в	До 15 баллов
Рейтинг контроль 3	Тест 12 вопросов в	До 30 баллов
Посещение занятий студентом		5 баллов
Дополнительные баллы (бонусы)		5 баллов
Выполнение семестрового плана самостоятельной работы		30 баллов
Итого		До 100 баллов

Задачи и практические задания

Практическое упражнение (1 часть семестрового задания):

1. Используя разработанный ранее бизнес-план проекта – определить риски проекта.
2. Составить реестр рисков проекта.
3. Составить план управления рисками проекта.

Контрольная работа (2 часть семестрового задания)

Задача 1. Решение задач на применение метода анализа ожидаемого денежного значения.

Цель работы – развитие навыков решения задач по выбору оптимальных с точки зрения финансовых результатов проектов на основе применения статистических методов.

Компании предлагается два рискованных проекта:

	Проект 1			Проект 2		
	0,3	0,3	0,4	0,5	0,3	0,2
Вероятность события						
Прибыль, млн. руб.	60	40	30	50	10	20

Рассчитать ожидаемое денежное значение по каждому проекту.

Ответ: проект 1 – 42 млн.руб., проект 2 - 32 млн.руб.

Задача 2. Решение задач с использованием дерева решений.

Цель работы: Совершенствование умений применения методов количественного анализа рисков в проектах.

Содержание работы:

Условия задачи: Руководство компании решает вопрос о выборе проекта по созданию нового продукта из 3 альтернатив. Уровень прибыли каждого проекта зависит от величины спроса. Вероятность высокого спроса равна 0,6, а низкого спроса равна 0,4.

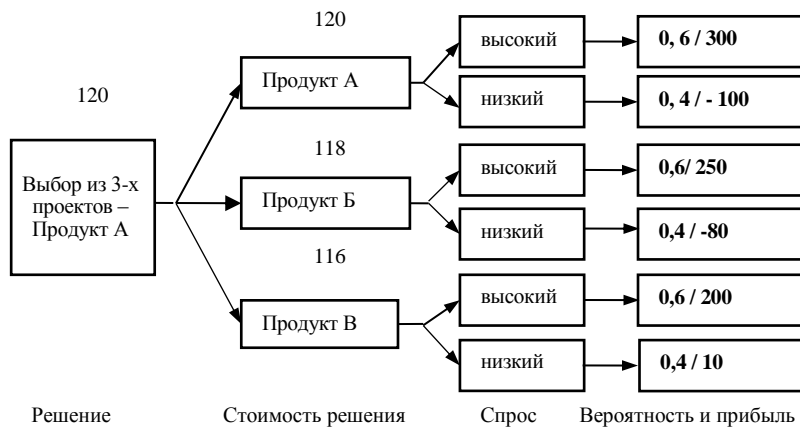
Этапы работы:

1. На основании данных таблицы 1 построить дерево решений;

Таблица 1

Проект	Продукт	Средняя ожидаемая прибыль, тыс. руб.	
		Высокий спрос	Низкий спрос
1	А	300	- 100
2	Б	250	- 80
3	В	200	10

2. Определить среднюю ожидаемую прибыль по каждому проекту.



Задача 3. Инвестиционная стратегия предприятия (селективные риски)

а) Руководству фирмы требуется определить рискованность вложения, т.е. сколько нужно вложить средств в инвестирование проекта в настоящее время, чтобы через 7 лет иметь 35 тыс. у.е. при 10%-ной норме доходности инвестиций.

б) От эксплуатации основного средства предприятие может получать в течение 8 лет доход в размере 14 тыс. у.е. в год. Остаточная стоимость данного основного средства через 8 лет будет равна 10 тыс. у.е. Какую минимальную сумму должно получить предприятие от продажи этого основного средства, чтобы в случае вложения вырученных денег в банк под 20 % годовых на 8 лет иметь доход не ниже, чем результат от эксплуатации основного средства?

Задача 4. Измерение риска на основе вероятностной оценки ожидаемых доходов
Требуется дать оценку двум взаимоисключающим проектам развития предприятия стоимостью 500 тыс. у.е.

Проект (М):

– замена оборудования на более производительное (модернизация).

Проект (И):

– приобретение нового оборудования для изготовления новой продукции (инновация).

Оценку необходимо осуществить в следующей последовательности:

1. Оценка денежных потоков и финансовых результатов для каждого варианта реализации проектов. Использовать статистический метод оценки на основе чистого ожидаемого годового дохода (NCF t)
2. Присвоение определенной вероятности получения дохода по каждому варианту реализации проекта:
 - оптимистический;
 - нормальный (наиболее вероятный);
 - пессимистический.
3. Построение графика ожидаемых чистых доходов (исходя из нормального закона распределения вероятностей). (По оси абсцисс «ожидаемый доход», по оси ординат «вероятность»)
4. Рассчитать параметры вероятности – стандартное отклонение, дисперсию, математическое ожидание.

5. Осуществить сравнительную оценку риска по стандартному отклонению (если проекты обладают одинаковым стандартным отклонением – то по коэффициенту вариации).

Задача 5. Риски доходности при выборе инвестиционного проекта

Даны два инвестиционных проекта А и В, для которых возможные нормы доходности (IRR) находятся в зависимости от будущего состояния экономики. Данную зависимость отражена в таблице 1.

Таблица 1

Данные для расчета ожидаемой нормы доходности вариантов вложения капитала в проекты 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%

Для каждого из проектов А и В необходимо рассчитать ожидаемую норму доходности ERR – средневзвешенное (где в качестве весов берутся вероятности) или вероятностное среднее возможных IRR.

Вопросы к зачету по дисциплине «Управление рисками в проектах»

1. Понятие неопределенности и риска в проектах.
2. Источники неопределенности и риска в проектах.
3. Атрибуты проектного риска.
4. Влияние риска на проект.
5. Определение управления проектным риском.
6. Задачи менеджеров и членов команды проекта в рамках управления риском проекта.
7. Основные классификационные признаки риска в проектах.
8. Основные виды проектного риска.
9. Инвестиционный риск.
10. Производственный риск.
11. Инновационный риск.
12. Финансовый риск: процентный, кредитный и валютный.
13. Операционный риск.
14. Риски, связанные с нестабильностью экономического законодательства и текущей экономической ситуации, условий инвестирования и использования прибыли.
15. Создание системы управления рисками.
16. Задачи, решаемые с помощью системы управления проектными рисками.
17. Нормативно-методическая база управления проектными рисками.
18. Распределение ролей и ответственности.
19. Основные стандарты управления проектными рисками.
20. Методологические принципы управления проектными рисками.
21. Методология управления рисками проекта согласно РМВОК.
22. Совещания по планированию управления рисками и анализ рисков.
23. План управления рисками проекта.

24. Основные элементы плана управления рисками проекта: методология, роли и ответственность, разработка бюджета, определение сроков, категории рисков.
25. Источники для анализа проектного риска.
26. Методы сбора информации по рискам проекта.
27. Основные инструменты идентификации риска проекта.
28. Мозговой штурм.
29. Метод Дельфи.
30. Методы диаграмм.
31. Анализ допущений.
32. SWOT-анализ.
33. Составление реестра риска проекта
34. Ранжирование и рейтинг проектного риска.
35. Методика составления матрицы вероятности и воздействия.
36. Оценка качества данных по рискам.
37. Категоризация рисков.
38. Оценка срочности рисков
39. Анализ чувствительности. Анализ ожидаемого денежного значения.
40. Математической ожидание, дисперсия и коэффициент вариации ожидаемого денежного значения.
41. Дерево решений.
42. Моделирование и имитация. Метод Монте-Карло.
43. Отчет о количественном анализе риска
44. Определения путей и действий по увеличению возможностей и снижению угроз целям проекта.
45. Определение стратегии управления проектными рисками.
46. Уклонение от проектного риска.
47. Передача проектного риска.
48. Снижение проектного риска.
49. Принятие проектного риска.
50. Реализация планов реагирования на риски.
51. Отслеживание идентифицированных рисков.
52. Мониторинг остаточных рисков, обнаружение новых рисков.
53. Оценка результативности управления проектным риском.
54. Пересмотр рисков.
55. Аудит рисков.
56. Обновление реестра проектных рисков.

Методические материалы, определяющие процедуры оценивания знаний, умений, навыков и (или) опыта деятельности, характеризующих этапы формирования компетенций

Опрос проводит преподаватель по всем темам дисциплины. Знания, умения, навыки студента при проведении опроса оцениваются «зачтено», «не зачтено». Основой для определения оценки служит уровень усвоения студентами материала, предусмотренного данной рабочей программой.

Оценивание студента на опросе по дисциплине «Управление рисками в проектах»

Оценка	Требования к знаниям
«Зачтено»	Оценка «зачтено» выставляется студенту, который усвоил предусмотренный программный материал; правильно, с приведением примеров, показал систематизированные знания по теме дисциплины, способен связать теорию с практикой, тему вопроса с другими темами данного курса, других изучаемых предметов.

«Не зачтено»	<p>Оценка «не зачтено» выставляется в следующих случаях:</p> <ol style="list-style-type: none"> 1. Студент не справился с заданием, не может ответить на вопросы, предложенные преподавателем, не обладает целостным представлением об изучаемой теме и ее взаимосвязях. 2. Ответ на вопрос полностью отсутствует. 3. Отказ от ответа.
--------------	---

Зачет принимает преподаватель. Оценка знаний студента на зачете носит комплексный характер и определяется его:

- ответом на зачете;
- учебными достижениями в семестровый период.

Знания, умения, навыки студента при проведении зачета по дисциплине оцениваются по системе: «зачтено» и «не зачтено». Основой для определения оценки служит уровень усвоения студентами материала, предусмотренного данной рабочей программой.

Оценивание студента на зачете по дисциплине «Управление рисками в проектах»

Оценка	Требования к знаниям
«Зачтено»	Оценка «зачтено» выставляется студенту, если он твердо знает материал, грамотно и по существу излагает его, не допуская существенных неточностей в ответе на вопрос, правильно применяет теоретические положения при решении практических вопросов и задач, владеет необходимыми навыками и приемами их выполнения.
«Не зачтено»	Оценка «не зачтено» выставляется студенту, который не знает значительной части программного материала, допускает существенные ошибки, неуверенно, с большими затруднениями выполняет практические работы. Как правило, оценка «не зачтено» ставится студентам, которые не могут продолжить обучение без дополнительных занятий по соответствующей дисциплине.

Методические указания для обучающихся по освоению дисциплины

Обучение по дисциплине «Управление рисками в проектах» предполагает изучение курса на аудиторных занятиях (практические занятия) и самостоятельной работы студентов. Практические занятия дисциплины «Управление рисками в проектах» предполагают их проведение в различных формах с целью выявления полученных знаний, умений, навыков и компетенций.

Подготовка к практическим занятиям:

- внимательно прочитайте материал лекций относящихся к данному практическому занятию, ознакомьтесь с учебным материалом по учебнику и учебным пособиям;
- выпишите основные термины;
- ответьте на контрольные вопросы по занятиям, готовьтесь дать развернутый ответ на каждый из вопросов;
- уясните, какие учебные элементы остались для вас неясными и постарайтесь получить на них ответ заранее во время текущих консультаций преподавателя;
- готовиться можно индивидуально, парами или в составе малой группы, последние являются эффективными формами работы.

Подготовка к зачету. Текущий контроль должны сопровождать рефлексия участия в интерактивных занятиях и ответы на ключевые вопросы по изученному материалу. Итоговый контроль по курсу осуществляется в форме ответа на вопросы к зачету. В самом начале учебного курса необходимо познакомиться со следующей учебно-методической документацией:

- программой дисциплины;
- перечнем знаний и умений, которыми студент должен владеть;
- тематическими планами занятий;

- тематическими планами занятий;
- контрольными мероприятиями;
- учебником, учебными пособиями по дисциплине, а также электронными ресурсами;
- перечнем вопросов к зачету.

После этого должно сформироваться четкое представление об объеме и характере знаний и умений, которыми надо будет овладеть по дисциплине. Систематическое выполнение учебной работы на занятиях позволит успешно освоить дисциплину и создать хорошую базу для сдачи зачета.

Составитель

доц. каф. МНиМР, к.э.н., доц. Омаров Т.Д. 