

Компонент ОПОП 38.04.02 Менеджмент направленность (профиль) Управление проектами

наименование ОПОП

Б1.В.12

шифр дисциплины

### ФОНД ОЦЕНОЧНЫХ СРЕДСТВ

Дисциплины (модуля)

Управление проектными рисками

Разработчик (и):

Распопова А.Ю.

ФИО

доцент

должность

к.э.н.

ученая степень,

звание

Утверждено на заседании кафедры

Экономики и управления

наименование кафедры

протокол № 6 от 20.02.2025

Заведующий кафедрой ЭиУ



подпись

Щебарова Н.Н.

ФИО

## 1. Критерии и средства оценивания компетенций и индикаторов их достижения, формируемых дисциплиной (модулем)

Код и наименование компетенции	Код и наименование индикатора(ов) достижения компетенции	Результаты обучения по дисциплине (модулю)			Оценочные средства текущего контроля	Оценочные средства промежуточной аттестации
		<i>Знать</i>	<i>Уметь</i>	<i>Владеть</i>		
ПК-2 Способен контролировать деятельность подразделений, команд (групп) работников, обеспечивать процесс отбора партнеров и направлений развития предприятий (организаций)	ИД-1 <sub>ПК-2</sub> : Умеет анализировать данные из различных источников, оценивать качество и достоверность полученной информации по проекту ИД-2 <sub>ПК-2</sub> : Применяет технологии проектного управления, нормы планирования и распределения работ по проекту ИД-3 <sub>ПК-2</sub> : Владет навыками системного анализа, мотивации участников команды проекта и методами управления персоналом	<ul style="list-style-type: none"> <li>— подходы и методы качественной и количественной оценки рисков;</li> <li>— содержание, сущность основные этапы, приемы и принципы управления рисками;</li> <li>— базовые понятия страхования и формы страхования;</li> <li>— базовые понятия кредитных и валютных рисков, риска банкротства;</li> </ul>	<ul style="list-style-type: none"> <li>— раскрывать содержание основных угроз финансовой безопасности;</li> <li>— составлять реестр выявленных рисков и проводить их ранжирование;</li> <li>— определять содержание страхового случая;</li> <li>— проводить сравнительную характеристику между фьючерсами, опционами и форвардными сделками;</li> </ul>	<ul style="list-style-type: none"> <li>— навыками анализа выявленных рисков;</li> <li>— навыками анализа страхового договора;</li> <li>— навыками анализа информации по кредитным и валютным рискам, рискам банкротства.</li> </ul>	Решение кейс-заданий, контрольное тестирование, выступлением с докладом	Экзаменационные билеты

## 2. Оценка уровня сформированности компетенций (индикаторов их достижения)

Показатели оценивания компетенций (индикаторов их достижения)	Шкала и критерии оценки уровня сформированности компетенций (индикаторов их достижения)			
	Ниже порогового («неудовлетворительно»)	Пороговый («удовлетворительно»)	Продвинутый («хорошо»)	Высокий («отлично»)
<b>Полнота знаний</b>	Уровень знаний ниже минимальных требований. Имели место грубые ошибки.	Минимально допустимый уровень знаний. Допущены не грубые ошибки.	Уровень знаний в объёме, соответствующем программе подготовки. Допущены некоторые погрешности.	Уровень знаний в объёме, соответствующем программе подготовки.
<b>Наличие умений</b>	При выполнении стандартных заданий не продемонстрированы основные умения. Имели место грубые ошибки.	Продемонстрированы основные умения. Выполнены типовые задания с не грубыми ошибками. Выполнены все задания, но не в полном объеме (отсутствуют пояснения, неполные выводы)	Продемонстрированы все основные умения. Выполнены все основные задания с некоторыми погрешностями. Выполнены все задания в полном объёме, но некоторые с недочетами.	Продемонстрированы все основные умения. Выполнены все основные и дополнительные задания без ошибок и погрешностей. Задания выполнены в полном объеме без недочетов.
<b>Наличие навыков (владение опытом)</b>	При выполнении стандартных заданий не продемонстрированы базовые навыки. Имели место грубые ошибки.	Имеется минимальный набор навыков для выполнения стандартных заданий с некоторыми недочетами.	Продемонстрированы базовые навыки при выполнении стандартных заданий с некоторыми недочетами.	Продемонстрированы все основные умения. Выполнены все основные и дополнительные задания без ошибок и погрешностей. Продемонстрирован творческий подход к решению нестандартных задач.
<b>Характеристика сформированности компетенции</b>	Компетенции фактически не сформированы. Имеющихся знаний, умений, навыков недостаточно для решения практических (профессиональных) задач.  ИЛИ Зачетное количество баллов не набрано согласно установленному диапазону	Сформированность компетенций соответствует минимальным требованиям. Имеющихся знаний, умений, навыков в целом достаточно для решения практических (профессиональных) задач.  ИЛИ Набрано зачетное количество баллов согласно установленному диапазону	Сформированность компетенций в целом соответствует требованиям. Имеющихся знаний, умений, навыков достаточно для решения стандартных профессиональных задач.  ИЛИ Набрано зачетное количество баллов согласно установленному диапазону	Сформированность компетенций полностью соответствует требованиям. Имеющихся знаний, умений, навыков в полной мере достаточно для решения сложных, в том числе нестандартных, профессиональных задач.  ИЛИ Набрано зачетное количество баллов согласно установленному диапазону

### 3. Критерии и шкала оценивания заданий текущего контроля

#### 3.1. Критерии и шкала оценивания доклада

Тематика докладов, информационных сообщений по дисциплине (модулю), требования к структуре, содержанию и оформлению изложены в методических материалах по освоению дисциплины (модуля), представлены в электронном курсе в ЭИОС МАУ.

В ФОС включены примерные темы докладов/информационных сообщений:

1. Понятие рисков и их связь с фондовым рынком.
2. Оценка эффективности управления рисками инвестиционного проекта.
3. Методы управления рисками их практическое приложение к различным видам деятельности.
4. Моделирование рискованных ситуаций.
5. Оценка риска портфеля из независимых ценных бумаг. Диверсификация портфеля.
6. Использование неравенства Чебышева для оценки рискованности финансовой операции.
7. Построение оптимального портфеля ценных бумаг при рискованных вложениях. Задача Г.Марковица.
8. Построение оптимального портфеля ценных бумаг при рискованных и безрисковых вложениях. Задача Д.Тобина.
9. Роль риска в менеджменте организации.
10. Управление рисками и страхование.
11. Диагностика кризисного состояния предприятия.
12. Методы снижения рисков.

Оценка/баллы	Критерии оценки
<i>Отлично/18-20</i>	Ориентированность в материале, полные и аргументированные ответы на дополнительные вопросы. Материал изложен логически последовательно, присутствуют самостоятельные выводы, используется материал из дополнительных источников, интернет ресурсов. Сообщение носит исследовательский характер. Используется наглядный материал (презентация).
<i>Хорошо/15-17</i>	Ориентированность в материале, но присутствуют некоторые затруднения в ответах на дополнительные вопросы. Отсутствует исследовательский компонент в сообщении. Отсутствует наглядный материал (презентация).
<i>Удовлетворительно/10-14</i>	Трудности в подборе материала, его структурировании. Использована, в основном, учебная литература, не использованы дополнительные источники информации. Трудности в ответе на дополнительные вопросы по теме сообщения, формулировке выводов. Материал изложен не последовательно, не установлены логические связи.
<i>Неудовлетворительно/9 и менее</i>	Доклад, информационное сообщение подготовлено по одному источнику информации либо не соответствует теме. ИЛИ Доклад, информационное сообщение не подготовлено.

#### 3.2. Критерии и шкала оценивания тестирования

Перечень тестовых вопросов и заданий, описание процедуры тестирования представлены в методических материалах по освоению дисциплины (модуля) и в электронном курсе в ЭИОС МАУ.

В ФОС включен типовой вариант тестового задания:

*1. Риск – это...*

- А) разновидность ситуации, объективно содержащая высокую вероятность невозможности осуществления цели
- Б) наличие факторов, при которых результаты действий не являются детерминированными, а степень возможного влияния этих факторов на результаты неизвестна
- В) следствие действия либо бездействия, в результате которого существует реальная возможность получения неопределенных результатов различного характера

*2. Отметьте потери, которые можно отнести к финансовым:*

- А) потери ценных бумаг
- Б) потери сырья
- В) невыполнение сроков сдачи объекта
- Г) выплата штрафа
- Д) уплата дополнительных налогов
- Е) ущерб репутации
- Ж) уменьшение выручки вследствие снижения цен на реализуемую продукцию

*3. Анализ риска – это...*

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

*4. Идентификация риска – это...*

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

*5. Риски, которые могут нести в себе как потери, так и дополнительную прибыль, называются*

- А) чистыми
- Б) критическими
- В) спекулятивными

*6. Какой из перечисленных методов оценки риска основан на расчетах и анализе статистических показателей?*

- А) вероятностный метод
- Б) построение дерева решений
- В) метод сценариев
- Г) анализ чувствительности
- Д) учет рисков при расчете чистой приведенной стоимости
- Е) имитационное моделирование

*7. К группе финансовых рисков, связанных с покупательной способностью, относятся*

- А) авансовый риск
- Б) риск снижения финансовой устойчивости
- В) риск ликвидности
- Г) инфляционный риск

8. Величиной кредитного риска является

- А) сумма кредита с учетом процентов
- Б) сумма процентов по кредиту
- В) сумма кредита по договору

9. Периодом подверженности кредитному риску называется:

- А) период с момента выдачи кредита до погашения суммы основного долга и процентов по кредиту
- Б) период деятельности кредитной организации до подписания кредитного договора
- В) период с момента выдачи кредита до погашения суммы основного долга

10. Вставьте пропущенное слово.

Страхование финансовых рисков – это процедура, при помощи которой страховая компания защищает имущественные и ... интересы страхователя от убытков при наступлении определенных случаев.

*Ответы на тестовые задания*

№ вопроса	ответ
1.	В
2.	А, Г, Д, Ж
3.	Б
4.	Б
5.	В
6.	А
7.	Г
8.	А
9.	А
10.	финансовые

Оценка/баллы	Критерии оценки
<b>Отлично/19-20</b>	90-100 % правильных ответов
<b>Хорошо/17-18</b>	70-89 % правильных ответов
<b>Удовлетворительно/15-16</b>	50-69 % правильных ответов
<b>Неудовлетворительно/14 и менее</b>	49 % и меньше правильных ответов

### 3.3. Критерии и шкала оценивания кейс-задания

Рекомендации по выполнению кейс-заданий по дисциплине (модулю) изложены в методических материалах по освоению дисциплины (модуля), представлены в электронном курсе в ЭИОС МАУ.

В ФОС включено типовое кейс-задание:

Для реализации инновационного проекта необходимо обеспечение нового производственного процесса сырьем, электроэнергией и комплектующими. Надежность

поставщика сырья (вероятность своевременной поставки качественного сырья) оценивается в 95%, поставщика комплектующих - 90%, надежность работы электростанции - 97%. Оценить степень риск проявляющегося в области материально-технического снабжения инновационного проекта.

**Решение:**

Его проявление выражается в остановке производственного процесса, т.е. мера риска является общей. Однако работа электростанции не связана с производственными процессами поставщиков. Поэтому степень риска оценивается по максимальной степени риска:

- Рсырья =  $100 - 95 = 5\%$
- Рэнергии =  $100 - 97 = 3\%$
- Ркомплектующих =  $100 - 90 = 10\%$

Максимальная степень риска составляет 10%.

**Ответ:** вероятность остановки внедряемого производственного процесса в связи с недостатками материально-технического снабжения составляет 0,1.

Оценка/баллы	Критерии оценки
<b>Отлично/39-40</b>	Выполнены соответствующие требования в полном объеме. Используются системный и ситуативный подходы, представлено аргументированное рассуждение по проблеме, определены цели, задачи, причины возникновения ситуации, определены риски, трудности при разрешении проблемы, подготовлена программа действий.
<b>Хорошо/37-38</b>	Правильно определены цели, задачи, причины возникновения ситуации. Определены риски, трудности при разрешении проблемы. Подготовлена программа действий, но недостаточно четко и последовательно аргументировано решение ситуации.
<b>Удовлетворительно/35-36</b>	Представлены рассуждения по проблеме, определены цели, задачи, причины возникновения ситуации. Определены возможные связи проблемы с другими проблемами, частично представлена программа действий.
<b>Неудовлетворительно/34 и менее</b>	Представлены разрозненные аргументы по проблеме или аргументы отсутствуют. Отсутствуют цели, задач, результаты предстоящей деятельности. Программа действий содержит серьезные ошибки или отсутствует. ИЛИ Задание не выполнено.

#### **4. Критерии и шкала оценивания результатов обучения по дисциплине (модулю) при проведении промежуточной аттестации**

##### Критерии и шкала оценивания результатов освоения дисциплины (модуля) с экзаменом

Для дисциплин (модулей), заканчивающихся экзаменом, результат промежуточной аттестации складывается из баллов, набранных в ходе текущего контроля и при проведении экзамена:

В ФОС включен список вопросов и заданий к экзамену и типовой вариант экзаменационного билета:

1. Риск как объект управления.
2. Классификация рисков.
3. Финансовая устойчивость и безопасность.
4. Теория риска и ее развитие.
5. Этапы процесса оценки риска.

6. Подходы к оценке рисков.
7. Качественный подход к оценке рисков.
8. Методы количественной оценки рисков.
9. Процесс управления рисками.
10. Диагностика рисков.
11. Карта рисков как инструмент управления.
12. Методы управления рисками.
13. Понятие и формы страхования.
14. Классификация видов страхования финансовых рисков.
15. Страховой договор.
16. Понятие кредитных рисков и факторы их возникновения.
17. Понятие валютных рисков и факторы их возникновения.
18. Способы регулирования кредитных и валютных рисков.
19. Понятие банкротства и методика диагностики.
20. Риски банкротства.

Оценка	Критерии оценки ответа на экзамене
<i>Отлично</i>	Обучающийся глубоко и прочно усвоил программный материал, исчерпывающе, последовательно, четко и логически стройно его излагает, умеет тесно увязывать теорию с практикой, не затрудняется с ответом при видоизменении вопроса. Владеет специальной терминологией, демонстрирует общую эрудицию в предметной области, использует при ответе ссылки на материал специализированных источников, в том числе на Интернет-ресурсы.
<i>Хорошо</i>	Обучающийся твердо знает материал, грамотно и по существу излагает его, не допуская существенных неточностей в ответе на вопрос, владеет специальной терминологией на достаточном уровне; могут возникнуть затруднения при ответе на уточняющие вопросы по рассматриваемой теме; в целом демонстрирует общую эрудицию в предметной области.
<i>Удовлетворительно</i>	Обучающийся имеет знания только основного материала, но не усвоил его деталей, допускает неточности, недостаточно правильные формулировки, плохо владеет специальной терминологией, допускает существенные ошибки при ответе, недостаточно ориентируется в источниках специализированных знаний.
<i>Неудовлетворительно</i>	Обучающийся не знает значительной части программного материала, допускает существенные ошибки, нарушения логической последовательности в изложении программного материала, не владеет специальной терминологией, не ориентируется в источниках специализированных знаний. Нет ответа на поставленный вопрос.

Оценка, полученная на экзамене, переводится в баллы («5» - 20 баллов, «4» - 15 баллов, «3» - 10 баллов) и суммируется с баллами, набранными в ходе текущего контроля.

Итоговая оценка по дисциплине (модулю)	Суммарные баллы по дисциплине (модулю), в том числе	Критерии оценивания
<i>Отлично</i>	91 - 100	Выполнены все контрольные точки текущего контроля на высоком уровне. Экзамен сдан
<i>Хорошо</i>	81-90	Выполнены все контрольные точки текущего контроля. Экзамен сдан
<i>Удовлетворительно</i>	70- 80	Контрольные точки выполнены в неполном объеме. Экзамен сдан
<i>Неудовлетворительно</i>	69 и менее	Контрольные точки не выполнены или не сдан экзамен

**5. Задания диагностической работы для оценки результатов обучения по дисциплине (модулю) в рамках внутренней независимой оценки качества образования**

ФОС содержит задания для оценивания знаний, умений и навыков, демонстрирующих уровень сформированности компетенций и индикаторов их достижения в процессе освоения дисциплины (модуля).

Комплект заданий разработан таким образом, чтобы осуществить процедуру оценки каждой компетенции, формируемых дисциплиной (модулем), у обучающегося в письменной форме.

Содержание комплекта заданий включает: тестовые задания.

**Комплект заданий диагностической работы**

***ПК–2 Способен контролировать деятельность подразделений, команд (групп) работников, обеспечивать процесс отбора партнеров и направлений развития предприятий (организаций)***

Вопрос 1. Вставьте пропущенное слово.

Риск - ... потери предприятием части своих ресурсов, недополучения доходов или появления дополнительных расходов в результате осуществления определенной производственной и финансовой деятельности.

Вопрос 2. Выберите правильные ответы.

Основными чертами риска являются:

1. Противоречивость.
2. Альтернативность.
3. Неопределенность.
4. Уверенность.
5. Желаемый результат.

Вопрос 3. Вставьте пропущенное слово.

Фактор риска – обстоятельство, влияющее на вероятность или последствия реализации риска, но не являющееся его непосредственной... .

Вопрос 4. Вставьте пропущенное слово.

Последствия финансовых рисков могут иметь как положительные, так и отрицательные ... от целевого результата.

Вопрос 5. Выберите правильные ответы.

Основные угрозы финансовой безопасности предприятия:

1. Угроза достижения высокой конкурентоспособности.
2. Угроза потери ликвидности предприятия.
3. Угроза утраты финансовой самостоятельности предприятия.
4. Угроза снижения эффективности деятельности предприятия.
5. Угроза старения объектов основных средств.

Вопрос 6. Метод, показывающий, насколько изменится чистая текущая стоимость проекта в ответ на изменение одной входной переменной, при том что все остальные условия не меняются, - это:

1. анализ сценариев;

2. анализ чувствительности;
3. анализ «дерева решений».

Вопрос 7. На стадии качественного анализа рисков проводится:

1. изучение внешней среды организации
2. классификация знаний и умений персонала
3. классификация выявленных рисков
4. изучение внутренней среды организации.

Вопрос 8. Разновидностью экспертного метода является:

1. метод Дельфи
2. метод Гаусса
3. метод Иванова
4. метод Монте-Карло.

Вопрос 9. Метод моделирования задачи выбора с помощью «дерева решений» предполагает:

1. математическое построение вариантов решений
2. программное графическое построение вариантов решений
3. графическое построение вариантов решений.

Вопрос 10. Укажите методы экспертных оценок риска:

1. построение «дерева решений»
2. SWOT-анализ
3. построение «розы рисков»
4. метод аналогий
5. математическое моделирование.