МИНОБРНАУКИ РОССИИ
федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение
высшего образования
«Самарский государственный технический университет»
(ФГБОУ ВО «СамГТУ»)

УТВЕРЖДАЮ:
Проректор по учебной работе
_____ / О.В. Юсупова
"_____" _____ 20___ г.

РАБОЧАЯ ПРОГРАММА ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛЯ)

Б1.В.01.09 «Проектные риски и оценка проектов»

Код и направление подготовки (специальность)	38.03.04 Государственное и муниципальное управление
Направленность (профиль)	Государственное управление устойчивым развитием
Квалификация	Бакалавр
Форма обучения	Очная
Год начала подготовки	2024
Институт / факультет	Институт инженерно-экономического и гуманитарного образования
Выпускающая кафедра	кафедра "Национальная и мировая экономика"
Кафедра-разработчик	кафедра "Национальная и мировая экономика"
Объем дисциплины, ч. / з.е.	144 / 4
Форма контроля (промежуточная аттестация)	Экзамен

Самара 2024

Б1.В.01.09 «Проектные риски и оценка проектов»

Рабочая программа дисциплины разработана в соответствии с требованиями ФГОС ВО по направлению подготовки (специальности) **38.03.04 Государственное и муниципальное управление**, утвержденного приказом Министерства образования и науки РФ от № 1016 от 13.08.2020 и соответствующего учебного плана.

Разработчик РПД:

Доцент, кандидат экономических наук, доцент	И.Г Кузнецова
(должность, степень, ученое звание)	(ФИО)

Заведующий кафедрой	А.С. Зотова, кандидат экономических наук, доцент
	(ФИО, степень, ученое звание)

СОГЛАСОВАНО:

Председатель методического совета факультета / института (или учебно-методической комиссии)	П.Г Лабзина, кандидат педагогических наук, доцент
	(ФИО, степень, ученое звание)
Руководитель образовательной программы	Е.А. Харитонова, кандидат экономических наук
	(ФИО, степень, ученое звание)

Содержание

1. Перечень планируемых результатов обучения по дисциплине (модулю), соотнесенных с планируемыми результатами освоения образовательной программы 4
2. Место дисциплины (модуля) в структуре образовательной программы 4
3. Объем дисциплины (модуля) в зачетных единицах с указанием количества академических часов, выделенных на контактную работу обучающихся с преподавателем (по видам учебных занятий) и на самостоятельную работу обучающихся 5
4. Содержание дисциплины (модуля), структурированное по темам (разделам), с указанием отведенного на них количества академических часов и видов учебных занятий 5
4.1 Содержание лекционных занятий 5
4.2 Содержание лабораторных занятий 7
4.3 Содержание практических занятий 9
4.4. Содержание самостоятельной работы 9
5. Перечень учебной литературы и учебно-методического обеспечения по дисциплине (модулю) 10
6. Перечень информационных технологий, используемых при осуществлении образовательного процесса по дисциплине (модулю), включая перечень программного обеспечения 10
7. Перечень ресурсов информационно-телекоммуникационной сети «Интернет», профессиональных баз данных, информационно-справочных систем 11
8. Описание материально-технической базы, необходимой для осуществления образовательного процесса по дисциплине (модулю) 12
9. Методические материалы 12
10. Фонд оценочных средств по дисциплине (модулю) 14

1. Перечень планируемых результатов обучения по дисциплине (модулю), соотнесенных с планируемыми результатами освоения образовательной программы

Наименование категории (группы) компетенций	Код и наименование компетенции	Код и наименование индикатора достижения компетенции	Результаты обучения (знать, уметь, владеть, соотнесенные с индикаторами достижения компетенции)
Профессиональные компетенции			
Не предусмотрено	ПК-3 Осуществляет нормативное правовое регулирование и участвует в формировании государственной политики в области устойчивого развития	ПК-3.1 Разрабатывает, рассматривает и согласовывает проекты нормативных правовых актов и других документов, организует и проводит мониторинг применения законодательства	Уметь разрабатывать, согласовывать проекты нормативных правовых актов и других документов, организовывать и проводить мониторинг применения законодательства
		ПК-3.3 Готовит официальные отзывы о проектах нормативных правовых актов, методические рекомендации и разъяснения, аналитические, информационные и другие материалы	Уметь писать официальные отзывы о проектах нормативных правовых актах, методические рекомендации и разъяснения, аналитические, информационные и другие материалы

2. Место дисциплины (модуля) в структуре образовательной программы

Место дисциплины (модуля) в структуре образовательной программы: **часть, формируемая участниками образовательных отношений**

Код компетенции	Предшествующие дисциплины	Параллельно осваиваемые дисциплины	Последующие дисциплины
ПК-3	Производственная практика: проектно-технологическая практика; Управление проектами	Производственная практика: проектно-технологическая практика; Устойчивая энергетика и природопользование	Подготовка к процедуре защиты и защита выпускной квалификационной работы; Производственная практика: преддипломная практика; Социальная политика государства; Устойчивая энергетика и природопользование

3. Объем дисциплины (модуля) в зачетных единицах с указанием количества

академических часов, выделенных на контактную работу обучающихся с преподавателем (по видам учебных занятий) и на самостоятельную работу обучающихся

Вид учебной работы	Всего часов / часов в электронной форме	7 семестр часов / часов в электронной форме
Аудиторная контактная работа (всего), в том числе:	64	64
Лабораторные работы	32	32
Лекции	32	32
Внеаудиторная контактная работа, КСР	4	4
Самостоятельная работа (всего), в том числе:	40	40
выполнение курсовых проектов	20	20
составление конспектов	20	20
Контроль	36	36
Итого: час	144	144
Итого: з.е.	4	4

4. Содержание дисциплины (модуля), структурированное по темам (разделам), с указанием отведенного на них количества академических часов и видов учебных занятий

№ раздела	Наименование раздела дисциплины	Виды учебной нагрузки и их трудоемкость, часы				
		ЛЗ	ЛР	ПЗ	СРС	Всего часов
1	Введение в дисциплину. Понятие проекта.	16	16	0	20	52
2	Методология оценки эффективности инвестиционных проектов	16	16	0	20	52
	КСР	0	0	0	0	4
	Контроль	0	0	0	0	36
	Итого	32	32	0	40	144

4.1 Содержание лекционных занятий

№ занятия	Наименование раздела	Тема лекции	Содержание лекции (перечень дидактических единиц: рассматриваемых подтем, вопросов)	Количество часов / часов в электронной форме

7 семестр				
1	Введение в дисциплину. Понятие проекта.	Тема 1. Введение в дисциплину.	1.1. Актуальность изучения дисциплины. 1.2. Цели и задачи дисциплины.	2
2	Введение в дисциплину. Понятие проекта.	Тема 2. Понятие проекта.	2.1. Общие положения. 2.2. Классификация проектов. 2.3. Структура проекта	2
3	Введение в дисциплину. Понятие проекта.	Тема 2. Понятие проекта (продолжение)	2.4. Участники проекта. 2.5. Идея проекта. 2.6. Жизненный цикл проекта.	2
4	Введение в дисциплину. Понятие проекта.	Тема 3. Понятия риска и неопределенности. Функции риска в экономике	3.1. Риск и неопределенность — взаимосвязь и различие понятий. 3.2.Виды рисков в работе предприятия. 3.3.Риски инвестиционного проекта.	2
5	Введение в дисциплину. Понятие проекта.	Тема 3. Понятия риска и неопределенности. Функции риска в экономике (продолжение)	3.4.Классификация рисков. 3.5.Функции риска в экономике	2
6	Введение в дисциплину. Понятие проекта.	Тема 4. Основы управления рисками. Динамический и предметный аспекты управления рисками	4.1.Управление рисками в системе менеджмента предприятия. 4.2.Управление рисками как часть управления инвестиционным проектом.	2
7	Введение в дисциплину. Понятие проекта.	Тема 4. Основы управления рисками. Динамический и предметный аспекты управления рисками (продолжение)	4.3.Управление рисками на разных стадиях жизненного цикла проекта (динамический аспект). 4.4.Управление отдельными факторами и областями риска (предметный аспект).	2
8	Введение в дисциплину. Понятие проекта.	Тема 5. Сущность и методы оценки риска	5.1.Качественный анализ рисков. Методы количественной оценки риска. 5.3.Анализ чувствительности показателей эффективности инвестиционного проекта.	2
9	Методология оценки эффективности инвестиционных проектов	Тема 5. Сущность и методы оценки риска (продолжение)	5.4.Анализ чувствительности показателей эффективности инвестиционного проекта	2
10	Методология оценки эффективности инвестиционных проектов	Тема 6. Вероятностные методы оценки риска	6.1.Имитационная модель. 6.2. Вероятностные критерии риска.	2

11	Методология оценки эффективности инвестиционных проектов	Тема 7. Экспертные методы в оценки рисков	7.1. Механизм экспертной оценки инвестиционных рисков. 7.2. Обобщающая оценка рисков.	2
12	Методология оценки эффективности инвестиционных проектов	Тема 8. Построение имитационной модели	8.1.Разработка сценариев. 8.2.Расчет статистических показателей (математическое ожидание, дисперсия, среднеквадратическое отклонение, коэффициент вариации). 8.3.Принятие оптимального инвестиционного решения на основе рассчитанных показателей	2
13	Методология оценки эффективности инвестиционных проектов	Тема 9. Принятие оптимального инвестиционного решения в условия риска и неопределенности	9.1.Склонность инвестора к риску, ее влияние на выбор варианта инвестирования. 9.2. Структура матрицы доходности и матрицы рисков.	2
14	Методология оценки эффективности инвестиционных проектов	Тема 10. Выбор наименее рискованного инвестиционного проекта на основе вероятностных критериев (продолжение)	10.1. Критерии Гурвица, Байеса, Лапласа -сущность, методика расчета. 10.2. Выбор наименее рискованного инвестиционного проекта исходя из рассчитанных вероятностных критериев.	2
15	Методология оценки эффективности инвестиционных проектов	Тема 11. Методология оценки эффективности инвестиционных проектов	11. 1. Определение и виды эффективности инвестиционных проектов. Основные принципы оценки эффективности. 11.2. Общая схема оценки эффективности инвестиционных проектов. Денежные потоки инвестиционного проекта.	2
16	Методология оценки эффективности инвестиционных проектов	Тема 12. Основные показатели эффективности инвестиционных проектов и методы их оценки	12.1. Классификация показателей эффективности ИП. 12.2. Показатели, не предполагающие использования концепции дисконтирования.	2
			Итого за семестр:	**32**
			Итого:	**32**

4.2 Содержание лабораторных занятий

№ занятия	**Наименование раздела**	**Тема лабораторного занятия**	**Содержание лабораторного занятия** (перечень дидактических единиц: рассматриваемых подтем, вопросов)	**Количество часов / часов в электронной форме**
7 семестр				

1	Введение в дисциплину. Понятие проекта.	Изучение программного продукта Project Expert.	Окружение проекта. Описание и прогнозирование финансово-экономической среды реализации планируемого проекта. Исследование динамики изменения валюты проекта (рубль, доллар, евро).	2
2	Введение в дисциплину. Понятие проекта.	Изучение программного продукта Project Expert.	Прогноз ставки рефинансирования на период реализации проекта. Исследование динамики объектов инфляции проекта	2
3	Введение в дисциплину. Понятие проекта.	Изучение программного продукта Project Expert.	Описание налогового окружения проекта. Подготовка и оформление отчета по проведенным исследованиям	2
4	Введение в дисциплину. Понятие проекта.	Изучение программного продукта Project Expert.	Стартовый баланс проекта. Финансовый анализ предприятия на момент начала проекта. Создание вариантов анализа. Ввод исходных данных (Баланс, отчет о прибылях и убытках, сведения об акциях.).	2
5	Введение в дисциплину. Понятие проекта.	Изучение программного продукта Project Expert	Расчет результатов деятельности предприятия (Рентабельность капитала, рентабельность деятельности; активы и пассивы аналитического баланса). Подготовка финансового заключения и отчета по лабораторной работе.	2
6	Введение в дисциплину. Понятие проекта.	Изучение программного продукта Project Expert	Инвестиционный план проекта. Составление календарного графика начальных капитальных вложений и подготовительных работ. Определение этапов работ проекта, определение ресурсов и их стоимости, формирование активов проекта, описание способов амортизации активов.	2
7	Введение в дисциплину. Понятие проекта.	Изучение программного продукта Project Expert	Календарный план. Описание иерархической структуры работ проекта. Составление и редактирование этапов проекта, определение связи между этапами.	2
8	Введение в дисциплину. Понятие проекта.	Изучение программного продукта Project Expert.	Формирование календарного плана проекта. Ресурсу и стоимость этапов. Описание характеристик активов, сформированных в календарном плане. Инфляция ресурсов, налоги на ресурсы.	2
9	Методология оценки эффективности инвестиционных проектов	Изучение программного продукта Project Expert.	Иерархическая организация этапов. Активы. Создание и редактирование активов. Типы амортизации активов.	2

10	Методология оценки эффективности инвестиционных проектов	Изучение программного продукта Project Expert.	Операционный план проекта. Описание основной деятельности предусмотренной проектом, прогноз объема сбыта продукции или услуги, описание потребности в материалах, стоимости ресурсов потребляемых на производстве.	2
11	Методология оценки эффективности инвестиционных проектов	Изучение программного продукта Project Expert.	План сбыта. Сырье, материалы и комплектующие	2
12	Методология оценки эффективности инвестиционных проектов	Изучение программного продукта Project Expert.	План производства. План персонала	2
13	Методология оценки эффективности инвестиционных проектов	Изучение программного продукта Project Expert.	Анализ безубыточности. Статистический анализ (метод Монте-Карло). Формирование отчета по лабораторной работе. Анализ эффективности инвестиций.	2
14	Методология оценки эффективности инвестиционных проектов	Изучение программного продукта Project Expert	Выбор и обоснование схемы финансирования проекта. Акционерный капитал. Займы. Лизинг	2
15	Методология оценки эффективности инвестиционных проектов	Изучение программного продукта Project Expert	Общие издержки. Анализ рисков проекта. Анализ чувствительности проекта	2
16	Методология оценки эффективности инвестиционных проектов	Изучение программного продукта Project Expert	Основные показатели эффективности инвестиционных проектов и методы их оценки.	2
			Итого за семестр:	**32**
			Итого:	**32**

4.3 Содержание практических занятий

Учебные занятия не реализуются.

4.4. Содержание самостоятельной работы

Наименование раздела	**Вид самостоятельной работы**	**Содержание самостоятельной работы** (перечень дидактических единиц: рассматриваемых подтем, вопросов)	**Количество часов**
7 семестр			

Введение в дисциплину. Понятие проекта.	Доработка конспекта лекций.	Вероятностные методы оценки риска	20
Методология оценки эффективности инвестиционных проектов	Написание курсового проекта	Написание курсового проекта	20
		Итого за семестр:	**40**
		Итого:	**40**

5. Перечень учебной литературы и учебно-методического обеспечения по дисциплине (модулю)

№ п/п	**Библиографическое описание**	**Ресурс НТБ СамГТУ** (ЭБС СамГТУ, IPRbooks и т.д.)
Основная литература		
1	Воронцовский, А.В. Оценка рисков : учеб.и практикум для бакалавриата и магистратуры / А. В. Воронцовский.- М., Юрайт, 2017.- 179 с.	Электронный ресурс
Дополнительная литература		
2	Анализ инвестиционной привлекательности организации / ред. Д. А. Ендовицкий.- М., Кнорус, 2017.- 374 с.	Электронный ресурс
3	Инвестиционный анализ; ЮНИТИ-ДАНА, 2017.- Режим доступа: https://elib.samgtu.ru/getinfo?uid=els_samgtu||iprbooks||81627	Электронный ресурс
Учебно-методическое обеспечение		
4	Базилевич, С.В. Количественные методы в управлении : учеб. пособие / С. В. Базилевич, Е. Ю. Легчилина; Федерал.ин-т развития образования.- М., Кнорус, 2016.- 153 с.	Электронный ресурс
5	Колмыкова, Т.С. Инвестиционный анализ : учеб. пособие / Т. С. Колмыкова.- М., Инфра-М, 2011.- 203 с.	Электронный ресурс
6	Минько, Э.В. Оценка эффективности коммерческих проектов : для бакалавров и специалистов : учеб. пособие / Э. В. Минько, О. А. Завьялов, А. Э. Минько ;под ред. Э. В. Минько.- М., Питер , 2014.- 368 с.	Электронный ресурс
7	Управление проектами : учеб. пособие / И. И. Мазур [и др.] ; ред.: И. И. Мазур, В. Д. Шапиро .- 10-е изд., стер..- М., Омега-Л, 2014.- 959 с.	Электронный ресурс

Доступ обучающихся к ЭР НТБ СамГТУ (elib.samgtu.ru) осуществляется посредством электронной информационной образовательной среды университета и сайта НТБ СамГТУ по логину и паролю.

6. Перечень информационных технологий, используемых при осуществлении образовательного процесса по дисциплине (модулю), включая перечень программного обеспечения

При проведении лекционных занятий используется мультимедийное оборудование.

Организовано взаимодействие обучающегося и преподавателя с использованием электронной ин-формационной образовательной среды университета.

№ п/п	Наименование	Производитель	Способ распространения
1	Microsoft Windows XP Professional	Microsoft (Зарубежный)	Лицензионное
2	Project Expert 7 Tutoiral	ООО "ПРО-ИНВЕСТ-ИТ", Москва (Отечественный)	Лицензионное
3	Linux	Linux (Зарубежный)	Свободно распространяемое
4	Альфа ОС (Alfa OS)	ALFA Vision (Отечественный)	Свободно распространяемое

7. Перечень ресурсов информационно-телекоммуникационной сети «Интернет», профессиональных баз данных, информационно-справочных систем

№ п/п	Наименование	Краткое описание	Режим доступа
1	POLPRED.COM - лучшие статьи информагентств и деловой прессы	http://polpred.com/news/	Ресурсы открытого доступа
2	Библиотека Гумер	http://www.gumer.info/	Ресурсы открытого доступа
3	Библиотека учебно-методической литературы системы "Единое окно"	http://window.edu.ru/	Ресурсы открытого доступа
4	Научная сеть	http://nature.web.ru/	Ресурсы открытого доступа
5	Правительство Самарской области	http://www.samregion.ru/	Ресурсы открытого доступа
6	Сервер органов государственной власти "Официальная Россия"	http://www.gov.ru/	Ресурсы открытого доступа
7	AUP.Ru - Электронная библиотека по вопросам экономики, финансов, менеджмента и маркетинга	http://www.aup.ru/	Ресурсы открытого доступа
8	Экономика. Социология. Менеджмент	http://ecsocman.hse.ru/	Ресурсы открытого доступа
9	Электронная библиотека РФФИ	http://www.rfbr.ru/rffi/ru/	Ресурсы открытого доступа

10	MS Project 2010 – Система управления проектами № 1 [Электронный ресурс]. - Видеозапись курса по MS Project 2010	www.microsoftproject.ru/articles.phtml	Ресурсы открытого доступа
11	Электронная библиотека изданий СамГТУ	http://irbis.samgtu.local/cgi-bin/irbis64r_01/cgiirbis_64.exe	Российские базы данных ограниченного доступа

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

Лекционные занятия

- аудитория, оснащенная презентационной техникой (проектор, экран, компьютер/ноутбук), программное обеспечение: MS Excel, MS Word);

- аудитория, оснащенная учебной мебелью: столы, стулья для обучающихся; стол, стул для преподавателя.

Лабораторные занятия

- лабораторные работы № 1-18 проводятся в аудитории №218 корпус №8, оснащённой необходимым оборудованием: персональными компьютерами на 15 посадочных мест, аудитория оснащенная презентационной техникой (проектор, экран), программное обеспечение: MS Excel, MS Word, Project Expert 7;

- аудитория, оснащенная учебной мебелью: столы, стулья для обучающихся; стол, стул для преподавателя

Самостоятельная работа

- компьютерный класс, оснащенный компьютерами с доступом и Интернет и обеспечивающие доступ в электронно-информационную образовательную среду СамГТУ;

- презентационная техника (проектор, экран, компьютер/ноутбук), учебно-наглядные пособия (презентационные материалы);

- пакеты ПО общего назначения (MS Excel, MS Word)

- материально-техническое обеспечение НТБ СамГТУ;

- ресурсы ИВЦ СамГТУ.

9. Методические материалы

Методические рекомендации при работе на лекции

До лекции студент должен просмотреть учебно-методическую и научную литературу по теме лекции с тем, чтобы иметь представление о проблемах, которые будут разбираться в лекции.

Перед началом лекции обучающимся сообщается тема лекции, план, вопросы, подлежащие рассмотрению, доводятся основные литературные источники. Весь учебный материал, сообщаемый преподавателем, должен не просто прослушиваться. Он должен быть активно воспринят, т.е. услышан, осмыслен, понят, зафиксирован на бумаге и закреплен в памяти. Приступая к слушанию нового учебного материала, полезно мысленно установить его связь с ранее изученным. Следя за техникой чтения лекции (акцент на существенном, повышение тона, изменение ритма, пауза и т.п.), необходимо вслед за преподавателем уметь выделять основные категории, законы и определять их содержание, проблемы, предполагать их возможные решения, доказательства и выводы. Осуществляя такую работу, можно

значительно облегчить себе понимание учебного материала, его конспектирование и дальнейшее изучение.

Конспектирование лекции позволяет обработать, систематизировать и лучше сохранить полученную информацию с тем, чтобы в будущем можно было восстановить в памяти основные, содержательные моменты. Типичная ошибка, совершаемая обучающимся, дословное конспектирование речи преподавателя. Как правило, при записи «слово в слово» не остается времени на обдумывание, анализ и синтез информации. Отбирая нужную информацию, главные мысли, проблемы, решения и выводы, необходимо сокращать текст, строить его таким образом, чтобы потом можно было легко в нем разобраться. Желательно оставить в рабочих конспектах поля, на которых можно будет делать пометки из рекомендованной литературы, дополняющие материал прослушанной лекции, а также подчеркивающие особую важность тех или иных теоретических положений. С окончанием лекции работа над конспектом не может считаться завершенной. Нужно еще восстановить отдельные места, проверить, все ли понятно, уточнить что-то на консультации и т.п. с тем, чтобы конспект мог быть использован в процессе подготовки к практическим занятиям, зачету, экзамену. Конспект лекции – незаменимый учебный документ, необходимый для самостоятельной работы.

Методические рекомендации при работе на лабораторном занятии

Проведение лабораторной работы делится на две условные части: теоретическую и практическую.

Необходимыми структурными элементами занятия являются проведение лабораторной работы, проверка усвоенного материала, включающая обсуждение теоретических основ выполняемой работы.

Перед лабораторной работой, как правило, проводится технико-теоретический инструктаж по использованию необходимого оборудования. Преподаватель корректирует деятельность обучающегося в процессе выполнения работы (при необходимости). После завершения лабораторной работы подводятся итоги, обсуждаются результаты деятельности.

Возможны следующие формы организации лабораторных работ: фронтальная, групповая и индивидуальная. При фронтальной форме выполняется одна и та же работа (при этом возможны различные варианты заданий). При групповой форме работа выполняется группой (командой). При индивидуальной форме обучающимися выполняются индивидуальные работы.

По каждой лабораторной работе имеются методические указания по их выполнению, включающие необходимый теоретический и практический материал, содержащие элементы и последовательную инструкцию по проведению выбранной работы, индивидуальные варианты заданий, требования и форму отчётности по данной работе.

Методические рекомендации по выполнению самостоятельной работы

Организация самостоятельной работы обучающихся ориентируется на активные методы овладения знаниями, развитие творческих способностей, переход от поточного к индивидуализированному обучению с учетом потребностей и возможностей обучающегося.

Самостоятельная работа с учебниками, учебными пособиями, научной, справочной литературой, материалами периодических изданий и Интернета является наиболее эффективным методом получения дополнительных знаний, позволяет значительно активизировать процесс овладения информацией, способствует более глубокому усвоению изучаемого материала. Все новые понятия по изучаемой теме необходимо выучить наизусть и внести в глоссарий, который целесообразно вести с самого начала изучения курса.

Самостоятельная работа реализуется:

- непосредственно в процессе аудиторных занятий;
- на лекциях, практических занятиях;
- в контакте с преподавателем вне рамок расписания;
- на консультациях по учебным вопросам, в ходе творческих контактов, при ликвидации задолженностей, при выполнении индивидуальных заданий и т.д.;
- в библиотеке, дома, на кафедре при выполнении обучающимся учебных и практических задач.

Эффективным средством осуществления обучающимся самостоятельной работы является электронная информационно-образовательная среда университета, которая обеспечивает доступ к

учебным планам, рабочим программам дисциплин (модулей), практик, к изданиям электронных библиотечных систем.

10. Фонд оценочных средств по дисциплине (модулю)

Фонд оценочных средств представлен в приложении № 1.

Приложение 1 к рабочей программе дисциплины
Б1.В.01.09 «Проектные риски и оценка проектов»

Фонд оценочных средств
по дисциплине
Б1.В.01.09 «Проектные риски и оценка проектов»

Код и направление подготовки (специальность)	38.03.04 Государственное и муниципальное управление
Направленность (профиль)	Государственное управление устойчивым развитием
Квалификация	Бакалавр
Форма обучения	Очная
Год начала подготовки	2024
Институт / факультет	Институт инженерно-экономического и гуманитарного образования
Выпускающая кафедра	кафедра "Национальная и мировая экономика"
Кафедра-разработчик	кафедра "Национальная и мировая экономика"
Объем дисциплины, ч. / з.е.	144 / 4
Форма контроля (промежуточная аттестация)	Экзамен

Перечень планируемых результатов обучения по дисциплине (модулю), соотнесенных с планируемыми результатами освоения образовательной программы

Наименование категории (группы) компетенций	Код и наименование компетенции	Код и наименование индикатора достижения компетенции	Результаты обучения (знать, уметь, владеть, соотнесенные с индикаторами достижения компетенции)
Профессиональные компетенции			
Не предусмотрено	ПК-3 Осуществляет нормативное правовое регулирование и участвует в формировании государственной политики в области устойчивого развития	ПК-3.1 Разрабатывает, рассматривает и согласовывает проекты нормативных правовых актов и других документов, организует и проводит мониторинг применения законодательства	Уметь разрабатывать, согласовывать проекты нормативных правовых актов и других документов, организовывать и проводить мониторинг применения законодательства
		ПК-3.3 Готовит официальные отзывы о проектах нормативных правовых актов, методические рекомендации и разъяснения, аналитические, информационные и другие материалы	Уметь писать официальные отзывы о проектах нормативных правовых актах, методические рекомендации и разъяснения, аналитические, информационные и другие материалы

Матрица соответствия оценочных средств запланированным результатам обучения

Код индикатора достижения компетенции	Результаты обучения	Оценочные средства	Текущий контроль успеваемости	Промежуточная аттестация
Введение в дисциплину. Понятие проекта.				
ПК-3.1 Разрабатывает, рассматривает и согласовывает проекты нормативных правовых актов и других документов, организует и проводит мониторинг применения законодательства	**Уметь** разрабатывать, согласовывать проекты нормативных правовых актов и других документов, организовывать и проводить мониторинг применения законодательства	Вопросы к экзамену	Нет	Да
		конспект	Да	Нет
		Курсовой проект	Да	Нет

ПК-3.3 Готовит официальные отзывы о проектах нормативных правовых актов, методические рекомендации и разъяснения, аналитические, информационные и другие материалы	**Уметь** писать официальные отзывы о проектах нормативных правовых актах, методические рекомендации и разъяснения, аналитические, информационные и другие материалы	конспект	Да	Нет
		Курсовой проект	Да	Нет
		Вопросы к экзамену	Нет	Да
Методология оценки эффективности инвестиционных проектов				
ПК-3.1 Разрабатывает, рассматривает и согласовывает проекты нормативных правовых актов и других документов, организует и проводит мониторинг применения законодательства	**Уметь** разрабатывать, согласовывать проекты нормативных правовых актов и других документов, организовывать и проводить мониторинг применения законодательства	конспект	Да	Нет
		Курсовой проект	Да	Нет
ПК-3.3 Готовит официальные отзывы о проектах нормативных правовых актов, методические рекомендации и разъяснения, аналитические, информационные и другие материалы	**Уметь** писать официальные отзывы о проектах нормативных правовых актах, методические рекомендации и разъяснения, аналитические, информационные и другие материалы	конспект	Да	Нет
		Курсовой проект	Да	Нет
		Вопросы к экзамену	Нет	Да

Перечень вопросов для подготовки к промежуточной аттестации (экзамену)

1. Актуальность изучения дисциплины.
2. Цели и задачи дисциплины.
3. Понятие проекта.
4. Общие положения.
5. Классификация проектов.
6. Структура проекта.
7. Участники проекта.
8. Идея проекта.
9. Жизненный цикл проекта.
10. Понятия риска и неопределенности.
11. Функции риска в экономике.
12. Риск и неопределенность — взаимосвязь и различие понятий.
13. Виды рисков в работе предприятия.
14. Риски инвестиционного проекта.
15. Классификация рисков.
16. Основы управления рисками.
17. Динамический аспекты управления рисками.
18. Предметный аспекты управления рисками.
19. Управление рисками в системе менеджмента предприятия.
20. Управление рисками как часть управления инвестиционным проектом.
21. Управление рисками на разных стадиях жизненного цикла проекта (динамический аспект).
22. Управление отдельными факторами и областями риска (предметный аспект).
23. Сущность оценки риска
24. Качественный анализ рисков.
25. Методы количественной оценки риска.
26. Анализ чувствительности показателей эффективности инвестиционного проекта.
27. Вероятностные методы оценки риска.
28. Имитационная модель.
29. Вероятностные критерии риска.
30. Экспертные методы в оценки рисков.
31. Механизм экспертной оценки инвестиционных рисков.
32. Обобщающая оценка рисков.
33. Построение имитационной модели.
34. Разработка сценариев.
35. Расчет статистических показателей (математическое ожидание, дисперсия, среднеквадратическое отклонение, коэффициент вариации).
36. Принятие оптимального инвестиционного решения на основе рассчитанных показателей.
37. Принятие оптимального инвестиционного решения в условия риска и неопределенности.
38. Склонность инвестора к риску, ее влияние на выбор варианта инвестирования.
39. Структура матрицы доходности и матрицы рисков.
40. Выбор наименее рискованного инвестиционного проекта на основе вероятностных критериев.
41. Критерии крайнего пессимизма (критерий Вальда, критерий Сэвиджа) — сущность, методика расчета.
42. Критерии Гурвица, Байеса, Лапласа -сущность, методика расчета.
43. Методология оценки эффективности инвестиционных проектов.
44. Определение и виды эффективности инвестиционных проектов.
45. Основные принципы оценки эффективности.
46. Общая схема оценки эффективности инвестиционных проектов.
47. Денежные потоки инвестиционного проекта.

48. Основные показатели эффективности инвестиционных проектов и методы их оценки.
49. Классификация показателей эффективности ИП.
50. Показатели, не предполагающие использования концепции дисконтирования.
51. Показатели эффективности инвестиционных проектов, определяемые на основании использования концепции дисконтирования.

Кейс

Управление проектами развития и разработка финансово-инвестиционной стратегии компании

Максим Владимирович Кукушкин назначен директором по развитию компании «Хорпрод». Компания производит пищевые продукты широкого ассортимента: фруктовые соки, молочные продукты, мясные и хлебобулочные изделия, пиво. Предприятие расположено в Центрально-Черноземном экономическом районе России. Реализует свою продукцию в данном регионе и соседних областях.

М.В. Кукушкин закончил магистерскую программу и сразу попал в поле зрения нескольких рекрутинговых агентств. Одно из них, получив заказ «Хорпрод» на подбор кандидата на должность директора по развитию, рекомендовало, среди прочих кандидатов, Максима Кукушкина, и он одержал верх над другими претендентами на должность.

Генеральный директор «Хорпрод», он же основной владелец компании (владеет 85% акций) Григорий Алексеевич Капитанов, бывший начальник управления пищевой промышленности облисполкома. По образованию он является технологом пищевых производств, имеет обширные связи в области, лично знаком с губернатором. В период приватизации ему удалось объединить под своим началом в открытое акционерное общество несколько пищевых предприятий области и сформировать на их основе ОАО «Хорпрод». Основное внимание он уделяет производственным вопросам.

Продукция ОАО пользуется спросом, предприятие стремится обновлять ассортиментный ряд, имеет планы технического перевооружения и нового строительства, покупки предприятий в своей и соседних областях.

Несмотря на очевидные успехи, в последнее время в деятельности компании стали отмечаться негативные явления. Они проявились, прежде всего, в дефиците денежных средств для возврата ранее полученных кредитов, в задержках платежей поставщикам и выплат заработной платы. Отсутствуют бренды компании и отдельных продуктов.

В настоящее время предприятие закупает сырье у сельхозпроизводителей и у оптовых посредников. Наметилась тенденция заметного роста цен на эту продукцию.

В составе ОАО отсутствуют торговые предприятия. Продукция реализуется через оптовые торговые предприятия и предпринимателей без образования юридического лица. Часть продукции продается розничным торговым сетям.

Перед новым директором по развитию была поставлена задача определить направления развития предприятия в среднесрочной и долгосрочной перспективе и пути изыскания требуемых для этого ресурсов. Кроме того, советом директоров принято решение выйти на зарубежные рынки, увеличить рентабельность собственного капитала и операционную рентабельность. Поставлена цель через 5 лет существенно увеличить долю «Хорпрод» на рынке по всем бизнес-направлениям. И, главное, что к концу пятилетнего периода планируется увеличить стоимость компании в несколько раз.

Краткая характеристика бизнес-направлений:

Хлебобулочное производство. Производятся традиционные сорта хлеба, сухари, баранки. Хлебозавод построен в 80-е годы, имеет высококвалифицированный персонал. Цены на хлеб жестко контролируются местными властями. Имеет лабораторию анализа качества изделий, в которой работают квалифицированные сотрудники.

Молочные изделия. Производство молочных изделий сосредоточено на молочном комбинате, введенном в эксплуатацию 5 лет назад. Комбинат производит молочную продукцию широкого ассортимента (молоко, йогурты, глазурованные сырки, несколько сортов сыра).

Мясные изделия. Производятся вареная колбаса одного сорта, сосиски, сардельки. Мясокомбинат довоенной постройки. Последняя реконструкция произведена в 1964 году. Имеет сильный коллектив производственного персонала и технологов.

Соки. Новое производство. Натуральные соки и соки из концентратов.

Пиво. Новый пивной завод. Введен в эксплуатацию год назад. Производственные мощности освоены на 50%.

Вполне логично, что для решения этих задач Кукушкин решил провести комплексный анализ деятельности, в общем-то, незнакомого для него предприятия. Анализ предполагается проводить по следующим направлениям:

• SWOT- анализ

• Анализ на основе финансовых коэффициентов

• Анализ по схеме фирмы Дюпон

• Маржинальный анализ (анализ «объем - затраты - прибыль», расчет точки безубыточности)

На основе данных анализа предполагается выбрать направления инвестирования, схему финансирования инвестиционных проектов, осуществление которых необходимо для решения поставленных стратегических задач. Могут быть использованы различные источники привлечения финансовых ресурсов.

Помогите директору по развитию провести диагностику бизнеса, определите направления инвестирования, стратегию и конкретные объекты слияний и поглощений, стратегии финансирования. Сделайте расчет денежных потоков на пятилетний период и определите стоимость бизнеса на начало и конец периода в результате реализации проектов развития.

Сформируйте WBS. постройте укрупненную диаграмму проведения работ, определите взаимосвязи работ и их временные параметры.

Отчет о прибылях и убытках, тыс. руб.

Показатели	Отчетный год	Прошлый год
Выручка от продаж	7800000	6500000
Себестоимость продаж	5200000	4000000
в том числе амортизация	300000	250000
Коммерческие и управленческие и проч.расходы	2200000	1500000
Прибыль от продаж	400000	1000000
Проценты уплаченные	100000	25000
Доходы от участия в других организациях	50000	30000
Налогооблагаемая прибыль	350000	1005000
Налог на прибыль	84000	241200
Чистая прибыль	266000	763800

Баланс

Актив	Отчетный год		Прошл.год
Основные средства	Начало года	Конец года	Начало Года
Незавершенное капитальное строительство	5500000	5700000	5400000
Долгосрочные финансовые вложения	500000	1000000	200000
Запасы	400000	800000	200000
Дебиторская задолженность всего	1400000	2200000	100000
В том числе с уплатой в период до 12 мес	2000000	3000000	1500000
С уплатой в период после 12 мес.	0	1000000	0
Денежные средства	2000000	2000000	1500000
Итого актив	80000	5000	300000
Пассив	9880000	12705000	7700000
Уставный капитал	1500000	1500000	1500000
Нераспределенная прибыль	2363800	2629800	1600000
Добавочный капитал	500000	600000	500000
Долгосрочные обязательства	0	0	0
Краткосрочный банковский кредит	100000	500000	50000
Кредиторская задолженность	5416200	7475200	4050000
Итого пассив	9880000	12705000	7700000

Характеристика бизнес-направлений

	Хлебобулочное производство	Молочные изделия	Мясные изделия	Соки	Пиво
Выручка от продаж	1950000	3120000	1170000	1170000	390000
Доля переменных затрат	60%	40%	50%	30%	30%
Постоянные затраты	1000000	1740000	600000	400000	400000
Основные средства	1375000	2200000	825000	825000	275000
Коэффициент загрузки производственной мощности	0,75	0,9	0,8	0,95	0,5

Тестовые задания

Тест 1

1. В чем заключается смысл понятия «риск» при принятии управленческих решений?
1. Опасность принятия неудачного решения.
2. Отсутствие необходимой информации для анализа ситуации.
3. Вероятность потери ресурсов или неполучения дохода.
4. Невозможность прогнозировать результаты решения.

2. Спекулятивный риск - это:
1. риск потерь от проведения биржевых спекуляций;

2. риск, возникающий при торговых операциях;
3. вероятность получения как прибыли, так и убытков;
4. правильно 1) и 2).

3. Должен ли менеджер избегать риска, принимая решение?
1. Да, должен.
2. Нет, не должен.
3. Менеджер должен не избегать риска, а управлять им.
4. Все зависит от ситуации.

4. Какие из перечисленных способов управления риском применяются для компенсирования причиненного ущерба?
1. Диверсификация риска.
2. Страхование риска.
3. Создание резервных фондов.
4. Лимитирование риска.

5. Какие из перечисленных методов позволяют снизить уровень риска?
1. Страхование риска.
2. Диверсификация риска.
3. Создание резервных фондов.
4. Лимитирование риска.

6. Способ управления риском, заключающийся в передаче риска страховщику (заключение договора страхования).
1. Лимитирование риска.
2. Страхование риска.
3. Распределение риска.
4. Диверсификация риска.

7. Критерием минимального сожаления называют:
1. Критерий Севиджа.
2. Критерий Вальда.
3. Критерий Гурвица.
4. Критерий абсолютного оптимизма.
5. Критерий относительного пессимизма.

8. Наиболее эффективными методами для принятия решений в условиях неопределенности считаются:
1. Метод экспертных оценок.
2. Теория игр.
3. Проведение анализа риска.

9. Какой критерий основан на принципе максимальной осторожности:
1. Критерий Вайда.
2. Критерий Лаплас.
3. Критерий Сэжвиджа.

10. Объективные факторы риска:
1. Независящие непосредственно от самой фирмы.
2. Зависящие от самой фирмы.

Ключ к тесту

1.	3	6.	2
2.	4	7.	1
3.	3	8.	1,2
4.	2,3	9.	1
5.	2,4	10	1

Тест 2

1. Отчет о движении денежных средств:
1. Кэш-Флоу.
2. Счет-фактура.
3. Фикция.

2. Процесс приведения будущих денежных потоков к текущему моменту времени:
1. Дисконтирование.
2. Кредитование.
3. Дебитирование.

3. Текущее положение предприятия на рынке и тенденции его изменения
1. Конкурентоспособность
-2. Рентабельность

4. Внутренние ресурсы финансирования проекта
1. Акционерный капитал
2. Накопленная прибыль предприятия
3. Кредиты коммерческих банков
4. Средства от потребителей

5. Внешние ресурсы финансирования проекта
1. Средства от инвестиционных фондов
2. Средства от поставщиков сырья и материалов
3. Накопленные амортизационные отчисления

6. Издержки, зависящие от объема производства
1. Постоянные
2. Переменные

7. Какие документы являются обязательными при оценки финансовой эффективности проекта
1. Отчет о прибылях и убытках
2. Кэш-Флоу
3. Балансовый отчет
4. Все ответы верны

8. Данный отчет демонстрирует финансовое положение организации на определенную дату
1. Кэш-Флоу
2. Балансовый отчет
3. Отчет о прибылях и убытках

9. Главное назначение данного отчета – регулирование материальных средств, чтобы не возникало дефицита, а излишки работали на увеличение прибыли

1. Кэш-Флоу
2. Балансовый отчет
3. Отчет о прибылях и убытках

10. Данный отчет фиксирует затраты и ожидаемые доходы

1. Отчет о прибылях и убытках
2. Кэш-Флоу
3. Балансовый отчет

Ключ к тесту

1.	1	6.	2
2.	1	7.	4
3.	1	8.	2
4.	1,2	9.	1
5.	1,2	10.	1

Курсовой проект

Целью курсового проекта является разработка технико-экономического обоснования инвестиций в реконструкцию (строительство) предприятия и обоснование выбора одного из вариантов развития.

Расчет технико-экономических показателей проводится с использованием специализированного ПО Project Expert.

Для написания курсового проекта используют методические указания по выполнению курсового проекта.

1. Методические материалы, определяющие процедуры оценивания знаний, умений, навыков, характеризующих этапы формирования компетенций.

Описание шкал оценивания

Учебная дисциплина формирует компетенции в соответствии с таблицей 2, процедура оценивания представлена в таблице 3 и реализуется поэтапно:

1-й этап процедуры оценивания: оценивание уровня достижения каждого из запланированных результатов обучения – дескрипторов (знаний, умений, владений) в соответствии со шкалами и критериями, установленными картами компетенций ОПОП (Приложение 1 ОПОП). Экспертной оценке преподавателя подлежит сформированность отдельных дескрипторов, для оценивания которых предназначена данная оценочная процедура текущего контроля и промежуточной аттестации согласно матрице соответствия оценочных средств результатам обучения (таблица 2).

2-й этап процедуры оценивания: интегральная оценка достижения обучающимся запланированных результатов обучения по итогам отдельных видов текущего контроля и промежуточной аттестации.

Таблица 3

Характеристика процедуры промежуточной аттестации по дисциплине

№	Наименование оценочного средства	Периодичность и способ проведения процедуры оценивания	Методы оценивания	Виды выставляемых оценок	Способ учета индивидуальных достижений, обучающихся
1	Опрос	Систематически на практических занятиях (устно)	Экспертный	По пятибалльной шкале	Рабочая книжка преподавателя
2	Конспект	По окончании изучения разделов 1,2 (письменно)	Экспертный	Зачет/незачет	Рабочая книжка преподавателя
3	Промежуточная аттестация-экзамен	На этапе промежуточной аттестации	Экспертный	По пятибалльной шкале	Экзаменационная ведомость, зачетная книжка и учебная карточка, индивидуальный план

Шкала и процедура оценивания сформированности компетенций

На этапе промежуточной аттестации используется система оценки успеваемости обучающихся, которая позволяет преподавателю оценить уровень освоения материала обучающимися. Критерии оценивания сформированности планируемых результатов обучения (дескрипторов) представлены в карте компетенции ОПОП.

Форма оценки знаний: оценка - 5 «отлично»; 4 «хорошо»; 3 «удовлетворительно»; 2 «неудовлетворительно».

Шкала оценивания:

«Зачет» – выставляется, если сформированность заявленных дескрипторов компетенций на *50%* и более оценивается не ниже «удовлетворительно» при условии отсутствия критерия

«неудовлетворительно». Выставляется, когда обучающийся показывает хорошие знания изученного учебного материала; самостоятельно, логично и последовательно излагает и интерпретирует материалы учебного курса; полностью раскрывает смысл предлагаемого вопроса; владеет основными терминами и понятиями изученного курса; показывает умение переложить теоретические знания на предполагаемый практический опыт.

«Отлично» – выставляется, если сформированность заявленных дескрипторов компетенций 88% более (в соответствии с картами компетенций ОПОП) оценивается критериями «хорошо» и «отлично», при условии отсутствия оценки «неудовлетворительно»: студент показал прочные знания основных положений фактического материала, умение самостоятельно решать конкретные практические задачи повышенной сложности, свободно использовать справочную литературу, делать обоснованные выводы из результатов анализа конкретных ситуаций;

«Хорошо» – выставляется, если сформированность заявленных дескрипторов компетенций на *62%* и более (в соответствии с картами компетенций ОПОП) оценивается критериями «хорошо» и «отлично», при условии отсутствия оценки «неудовлетворительно», допускается оценка «удовлетворительно»: обучающийся показал прочные знания основных положений фактического материала, умение самостоятельно решать конкретные практические задачи, предусмотренные рабочей программой, ориентироваться в рекомендованной справочной литературе, умеет правильно оценить полученные результаты анализа конкретных ситуаций;

«Удовлетворительно» – выставляется, если сформированность заявленных дескрипторов компетенций *35%* и более (в соответствии с картами компетенций ОПОП) оценивается критериями «удовлетворительно», «хорошо» и «отлично»: обучающийся показал знание основных положений фактического материала, умение получить с помощью преподавателя правильное решение конкретной практической задачи из числа предусмотренных рабочей программой, знакомство с рекомендованной справочной литературой;

«Неудовлетворительно» «Незачет» – выставляется, если сформированность заявленных дескрипторов компетенций менее чем *35%* (в соответствии с картами компетенций ОПОП) оценивается критериями «удовлетворительно», «хорошо» и «отлично»: при ответе обучающегося выявились существенные пробелы в знаниях основных положений фактического материала, неумение с помощью преподавателя получить правильное решение конкретной практической задачи из числа предусмотренных рабочей программой учебной дисциплины.

Соответствие критериев оценивания сформированности планируемых результатов обучения (дескрипторов) системам оценок представлено в табл. 4.

Таблица 4

Интегральная оценка

Критерии	**Традиционная оценка**	**Балльно-рейтинговая оценка**
5	5	86 - 100
4	4	70 - 85
3	3	50 - 69
2	2, незачет	0 - 49
5, 4, 3	зачет	50 - 100

Обучающиеся обязаны сдавать все задания в сроки, установленные преподавателем. Обучающиеся, выполнившие все практические задания в течении семестра, допускаются к экзамену (промежуточная аттестация).Обучающиеся не выполнившие все практические задания в течении семестра не допускаются к экзамену.