

Документ подписан простой электронной подписью
Информация о владельце:
ФИО: Степанов Павел Иванович
Должность: Руководитель НТИ НИЯУ МИФИ
Дата подписания: 23.02.2026 20:57:01
Уникальный программный ключ:
8c65c591e26b2d8e460927740c7326228a36275

Министерство науки и высшего образования Российской Федерации
Федеральное государственное автономное образовательное учреждение
высшего образования
«Национальный исследовательский ядерный университет «МИФИ»

Новоуральский технологический институт –
филиал федерального государственного автономного образовательного
учреждения высшего образования «Национальный исследовательский ядерный
университет «МИФИ»

УТВЕРЖДЕНА
Ученым советом НТИ НИЯУ МИФИ
Протокол № 3 от 24.04.2023 г.

Рабочая программа учебной дисциплины "Анализ и оценка риска проекта"

Направление подготовки (специальность)	38.03.02 Менеджмент
Профиль подготовки (специализация)	Управление инвестиционными проектами
Квалификация (степень) выпускника	бакалавр
Форма обучения	очно-заочная

г. Новоуральск, 2023

Семестр	8
Трудоемкость, ЗЕТ	5 ЗЭТ
Трудоемкость, ч.	180 ч.
Аудиторные занятия, в т.ч.:	54 ч.
- лекции	18 ч.
- практические занятия	36 ч.
Самостоятельная работа	90 ч.
Контроль	36
Форма итогового контроля	экзамен

СОДЕРЖАНИЕ

1. ЦЕЛИ ОСВОЕНИЯ УЧЕБНОЙ ДИСЦИПЛИНЫ	4
2. МЕСТО УЧЕБНОЙ ДИСЦИПЛИНЫ В СТРУКТУРЕ ООП ВО.....	4
3. ФОРМИРУЕМЫЕ КОМПЕТЕНЦИИ И ПЛАНИРУЕМЫЕ РЕЗУЛЬТАТЫ ОБУЧЕНИЯ	4
4 ВОСПИТАТЕЛЬНЫЙ ПОТЕНЦИАЛ ДИСЦИПЛИНЫ.....	5
5 СТРУКТУРА И СОДЕРЖАНИЕ УЧЕБНОЙ ДИСЦИПЛИНЫ.....	5
6 ОБРАЗОВАТЕЛЬНЫЕ ТЕХНОЛОГИИ	7
7 ФОНД ОЦЕНОЧНЫХ СРЕДСТВ.....	7
8 УЧЕБНО-МЕТОДИЧЕСКОЕ И ИНФОРМАЦИОННОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ УЧЕБНОЙ ДИСЦИПЛИНЫ	8
9 МАТЕРИАЛЬНО-ТЕХНИЧЕСКОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ УЧЕБНОЙ ДИСЦИПЛИНЫ.....	9
10 УЧЕБНО-МЕТОДИЧЕСКИЕ РЕКОМЕНДАЦИИ ДЛЯ СТУДЕНТОВ И ПРЕПОДАВАТЕЛЕЙ.....	9
ПРИЛОЖЕНИЕ А ОЦЕНОЧНЫЕ СРЕДСТВА	10

1. ЦЕЛИ ОСВОЕНИЯ УЧЕБНОЙ ДИСЦИПЛИНЫ

Дисциплина имеет важное значение для подготовки бакалавров по направлению «Менеджмент». Цель занятий по дисциплине - Формирование у студентов знаний о методах оценки, анализа и управления рисками, а также умений и навыков использования этих инструментов в проектной деятельности.

Задачи преподавания дисциплины вытекают из необходимости изложения как теоретических основ, так и практических методов в решении вопросов анализа и оценки рисков проектов.

2. МЕСТО УЧЕБНОЙ ДИСЦИПЛИНЫ В СТРУКТУРЕ ООП ВО

В соответствии с Образовательной программой подготовки бакалавров «Управление инвестиционными проектами» по направлению 38.03.02 «Менеджмент» данная учебная дисциплина входит в часть, формируемую участниками образовательных отношений профессионального модуля и является дисциплиной по выбору.

Изучение дисциплины базируется на сумме знаний и практических навыков, полученных студентами в ходе изучения таких дисциплин, как «Теория менеджмента: теория организации», «Стратегический менеджмент», «Методы принятия управленческих решений», «Управление проектами».

Изучение данной дисциплины является необходимым для выполнения выпускной квалификационной работы.

3. ФОРМИРУЕМЫЕ КОМПЕТЕНЦИИ И ПЛАНИРУЕМЫЕ РЕЗУЛЬТАТЫ ОБУЧЕНИЯ

Профессиональные компетенции (ПК) в соответствии с задачами и объектами (областями знаний) профессиональной деятельности:

Задача профессиональной деятельности (ЗПД)	Объект или область знания	Код и наименование профессиональной компетенции	Код и наименование индикатора достижения профессиональной компетенции
разработка проектов, направленных на развитие организации, а также оценка их эффективности	инвестиционные проекты	ПК-7.1 способен проводить анализ рыночных и специфических рисков для принятия управленческих решений, в том числе при принятии решений об инвестировании и финансировании проектов	З-ПК-7.1 Знать: принципы, способы и методы оценки рыночных и специфических рисков для принятия управленческих решений У-ПК-7.1 Уметь: оценивать риски, доходность и эффективность принимаемых финансовых и инвестиционных решений В-ПК-7.1 Владеть: методами анализа рисков, оценкой вероятности их наступления

4 ВОСПИТАТЕЛЬНЫЙ ПОТЕНЦИАЛ ДИСЦИПЛИНЫ

Цели и задачи воспитания, воспитательный потенциал дисциплин

Направления/цели воспитания	Задачи воспитания (код)	Воспитательный потенциал дисциплин
Профессиональное воспитание	формирование ответственности за профессиональный выбор, профессиональное развитие и профессиональные решения (B18)	формирование у студентов ответственности за свое профессиональное развитие посредством выбора студентами индивидуальных образовательных траекторий, организации системы общения между всеми участниками образовательного процесса, в том числе с использованием новых информационных технологий.

5 СТРУКТУРА И СОДЕРЖАНИЕ УЧЕБНОЙ ДИСЦИПЛИНЫ

5.1 Структура учебной дисциплины

Раздел учебной дисциплины	Неделя семестра	Виды учебной деятельности					Формы контроля	Код индикатора достижения компетенции	
		Лекции	Практические занятия	СРС					
				Подготовка к коллоквиуму	Написание реферата	Подготовка доклада			
Теоретико-методологические основы системы управления рисками проектов	1	1	4		34	6	Дкл	3-ПК-7.1 3-ПК-7.1 3-ПК-7.1	
	2,3	2	-	10					
	4,5	2	8	10			Дкл Кол1		
	6,7	2	-	10					
Модели и методы разработки решений по управлению рисками и организации системы риск-менеджмента	8,9	2	8						Дкл Кол2
	10,11	2	-						
	12,13	2	8	10			Дкл Кол3		
	14,15	2	-						
	16,17	2	-						
	18	1	8	10			Дкл Кол4 Кол5		
Итого		18	36	50	34	6			
Контроль (экзамен)	36								

Обозначения: Дкл - Доклад, Кол – Коллоквиум

5.2. Содержание учебной дисциплины

Темы и содержание лекционных занятий

1. Теоретико-методологические основы системы управления рисками проектов (7 часов)

Понятие и сущность риска. Определение, функции, организация и правила управления рисками. Информационное обеспечение управления рисками. Классификация рисков. Анализ и оценка степени риска.

Оценка риска проекта на основе анализа безубыточности. Выбор оптимального проекта развития предприятия в условиях неопределённости и риска минимаксными методами.

2. Модели и методы разработки решений по управлению рисками и организации системы риск-менеджмента (11 часов)

Управление рисками, возникающими при инвестировании. Риск-менеджмент. Анализ риска в инвестиционной программе. Анализ рисков современного предприятия. Основные понятия и принципы оценки эффективности инвестиций. Рациональный выбор инвестиционного портфеля. Оценка эффективности проекта в условиях риска (оценка риска) с использованием статистических методов. Страхование как метод снижения рисков. Хеджирование как метод снижения риска.

Практические занятия (18 часов) проводятся в следующих формах:

- 1) в форме занятий, на которых происходит обсуждение и защита рефератов;
- 2) в форме коллоквиумов, проводимых по темам лекций с целью закрепления пройденного теоретического материала.

Темы рефератов, а также вопросы для подготовки к коллоквиумам представлены в фонде оценочных средств дисциплины.

Самостоятельная работа обучающихся (63 часа)

Самостоятельная работа студента по учебной дисциплине регламентируется «Положением об организации самостоятельной работы студентов в НТИ НИЯУ МИФИ».

Структура времени самостоятельной работы студентов

- 1 Подготовка к выполнению тестовых заданий
- 2 Написание реферата
- 3 Подготовка доклада
- 4 Изучение дополнительного материала по теме лекций

Перечень учебно-методического обеспечения.

Учебно-методическое обеспечение учебной работы студентов включает:

- 1) слайды для проведения лекций;
- 2) фонд оценочных средств:
 - комплект тестовых заданий;
 - вопросы для подготовки к коллоквиумам;
 - контрольные вопросы для подготовки к сдаче экзамена;
 - методические рекомендации для преподавателя;
- 3) учебно-методическое обеспечение самостоятельной работы студентов включает:
 - методические рекомендации по организации самостоятельной работы обучающихся НТИ НИЯУ МИФИ.
 - стандарт организации СТО НТИ-2-2014. Требования к оформлению текстовой документации;

6 ОБРАЗОВАТЕЛЬНЫЕ ТЕХНОЛОГИИ

Рекомендации для преподавателя по использованию информационно-образовательных технологий содержатся в «Положении об организационных формах и технологиях образовательного процесса в НТИ НИЯУ МИФИ».

При реализации программы дисциплины используются различные образовательные технологии. Аудиторные занятия проводятся в форме лекций, практических занятий. Для контроля усвоения студентами разделов данной дисциплины применяются тестовые технологии.

Для повышения уровня знаний студентов в течение семестра организуются консультации, во время которых:

- проводится объяснение непонятных для студентов разделов теоретического курса;
- проводятся консультации по написанию реферата;
- принимаются задолженности по тестовым и практическим работам и т.д.

Реализация компетентного подхода предусматривает широкое использование в учебном процессе активных и интерактивных форм проведения занятий, предполагающих активную обратную связь между преподавателем и студентами.

В процессе изучения дисциплины используются интерактивные формы обучения при проведении практических занятий:

- выступление студентов с докладом;
- дискуссии;
- презентации

7 ФОНД ОЦЕНОЧНЫХ СРЕДСТВ

Фонд оценочных средств по дисциплине обеспечивает проверку освоения планируемых результатов обучения (компетенций и их индикаторов) посредством мероприятий рубежного и промежуточного контроля по дисциплине.

Связь между формируемыми компетенциями и формами контроля их освоения представлена в таблице

№ п/п	Наименование	Аттестация	Максимальный балл	Индикаторы освоения дисциплины
1	Теоретико-методологические основы системы управления рисками проектов	Коллоквиум	15	З-ПК-7.1 У-ПК-7.1 В-ПК-7.1
2	Модели и методы разработки решений по управлению рисками и организации системы риск-менеджмента	Коллоквиум	15	
3	Написание реферата	Реферат	20	
4	Защита реферата	Доклад	10	
5	Экзамен	Тестовое задание на экзамен	40	
ИТОГО			100	

Средства текущего контроля и промежуточной аттестации по дисциплине представлены в ФОС. Шкала каждого контрольного мероприятия лежит в пределах от 0 до установленного максимального балла включительно. Итоговая аттестация по

дисциплине оценивается по 100-балльной шкале и представляет собой сумму баллов, заработанных студентом при выполнении контрольных мероприятий. Полученные баллы переводятся в 5-балльную систему по следующей шкале:

переводятся в 5-балльную систему по следующей шкале:				
Оценка по 5 балльной шкале	Зачет	Сумма баллов по дисциплине	Оценка (ECTS)	Градация
5 (отлично)	Зачтено	90-100	A	Отлично
4 (хорошо)		85-89	B	Очень хорошо
		75-84	C	Хорошо
		70-74	D	Удовлетворительно
		65-69		
3 (удовлетворительно)		60-64	E	Посредственно
2 (неудовлетворительно)	Не зачтено	Ниже 60	F	Неудовлетворительно

8 УЧЕБНО-МЕТОДИЧЕСКОЕ И ИНФОРМАЦИОННОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ УЧЕБНОЙ ДИСЦИПЛИНЫ

8.1 Перечень литературы, необходимой для освоения дисциплины

1 Касьяненко, Т. Г. Анализ и оценка рисков в бизнесе : учебник и практикум для вузов / Т. Г. Касьяненко, Г. А. Маховикова. — 2-е изд., перераб. и доп. — Москва : Издательство Юрайт, 2022. — 381 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-00375-8. — Текст : электронный // Образовательная платформа Юрайт [сайт]. — URL: <https://urait.ru/bcode/489052>

2 Воронцовский, А. В. Управление рисками : учебник и практикум для вузов / А. В. Воронцовский. — 2-е изд. — Москва : Издательство Юрайт, 2022. — 485 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-12206-0. — Текст : электронный // Образовательная платформа Юрайт [сайт]. — URL: <https://urait.ru/bcode/489580>

8.2 Учебно-методическое обеспечение дисциплины

1 Фонд оценочных средств. - Новоуральск, НТИ НИЯУ МИФИ

8.3 Перечень ресурсов информационно-коммуникационной сети «Интернет», необходимых для освоения дисциплины

Наименование ресурса	Электронный адрес ресурса
1) Официальный сайт НТИ НИЯУ МИФИ	http://nti.mephi.ru
2) ЭБС <i>Юрайт</i>	http://urait.ru

9 МАТЕРИАЛЬНО-ТЕХНИЧЕСКОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ УЧЕБНОЙ ДИСЦИПЛИНЫ

Учебная дисциплина обеспечена учебно-методической документацией и материалами. Её содержание представлено в локальной сети учебного заведения и находится в режиме свободного доступа для студентов. Доступ студентов для самостоятельной подготовки осуществляется через компьютеры библиотеки и компьютерных классов НТИ НИЯУ МИФИ.

Материально-техническое обеспечение аудиторных занятий:

- 1) комплект электронных презентаций/слайдов,
- 2) аудитория, оснащенная презентационной техникой (проектор, экран, компьютер)

10 УЧЕБНО-МЕТОДИЧЕСКИЕ РЕКОМЕНДАЦИИ ДЛЯ СТУДЕНТОВ И ПРЕПОДАВАТЕЛЕЙ

Вводная часть

Цель данной дисциплины — дать учащимся ключевые представления об управлении рисками в современных организациях.

Основной упор на лекциях необходимо делать на понимание излагаемого материала и умения его использования при подготовке для сдачи экзамена, к практическим занятиям и при выполнении самостоятельных работ.

Для освоения учебной дисциплины специальных образовательных технологий не требуется. Лекционная часть курса обеспечивает получение необходимых знаний; практические занятия посвящены решению конкретных учебных задач.

Методические указания к лекциям, практическим занятиям.

Преподавателям на каждой лекции рекомендуется очень кратко повторять пройденный материал предыдущих лекций. При этом следует останавливаться на сложных для понимания студентами ключевых элементах дисциплины.

Студентам перед текущей лекцией (заранее) рекомендуется очень кратко повторять пройденный материал предыдущих лекций. При этом следует сосредоточить свое внимание на сложных для понимания ключевых элементах дисциплины.

Основной упор на изучаемых лекциях необходимо делать именно на понимание представленного материала и на умение его использовать при выполнении практических контрольных работ.

Изучение текущего материала рекомендуется проводить, опираясь на следующие пособия [1, 2].

В рамках дисциплины предусмотрено проведение практических занятий, на которых учащиеся должны, используя представленный на лекциях материал, закрепить знания по изучаемой дисциплине. Практика показала, что следует быть готовым заранее к различным приемам вовлечения студентов в творческий процесс освоения учебного материала.

ПРИЛОЖЕНИЕ А

ОЦЕНОЧНЫЕ СРЕДСТВА

1. Вопросы для подготовки к промежуточной аттестации

Понятие и сущность риска.
Определение, функции, организация и правила управления рисками.
Информационное обеспечение управления рисками.
Классификация рисков.
Анализ и оценка степени риска.
Оценка риска проекта на основе анализа безубыточности.
Выбор оптимального проекта развития предприятия в условиях неопределённости и риска минимаксными методами.
Модели и методы разработки решений по управлению рисками и организации системы риск-менеджмента.
Управление рисками, возникающими при инвестировании.
Риск-менеджмент.
Анализ риска в инвестиционной программе.
Анализ рисков современного предприятия.
Основные понятия и принципы оценки эффективности инвестиций.
Рациональный выбор инвестиционного портфеля.
Оценка эффективности проекта в условиях риска (оценка риска) с использованием статистических методов.
Страхование как метод снижения рисков.
Хеджирование как метод снижения риска.

2. Оценочные материалы для проведения текущего контроля

1. Для каких событий подходят статистические данные?
 - a) для частых и однородных событий
 - b) для редких и уникальных событий
 - c) нет правильного ответа
2. Дисперсия, представляет собой:
 - a) средневзвешенное из квадратов отклонений действительных результатов рискованных инвестиционных вложений от средних ожидаемых
 - b) отношение среднего квадратичного отклонения к средней арифметической и показывает степень отклонения полученных значений
 - c) оба варианта не верны
3. Правильное ли высказывание?
 - a) чем выше значение дисперсии, то есть чем выше разброс доходности актива или портфеля активов относительно его ожидаемой доходности, тем выше будет уровень риска
 - b) низкие значения дисперсии свидетельствуют о низком уровне риска, связанного с осуществлением инвестиций
 - c) оба варианта верны
 - d) оба варианта не верны
4. Как называется область выигрыша?
 - a) безрисковая зона

- b) зона допустимого риска
- c) зона критического риска
- d) зона катастрофического риска

5. Назовите область, в пределах которой величина вероятных потерь не превышает ожидаемой прибыли.

- a) безрисковая зона
- b) зона допустимого риска
- c) зона критического риска
- d) зона катастрофического риска

6. В какой зоне предприниматель рискует не только не получить никакого дохода, но и понести прямые убытки в размере всех произведенных затрат?

- a) безрисковая зона
- b) зона допустимого риска
- c) зона критического риска
- d) зона катастрофического риска

7. Анализ сценариев - это:

- a) финансовый инструмент, при помощи которого осуществляется защита от потенциальных рисков: валюта, ценные бумаги, депозиты, срочные контракты и т.д.
- b) метод оценки риска, который наряду с базовым набором исходных данных рассматривает ряд других наборов данных, которые могут иметь место в процессе реализации проекта
- c) метод оценки влияния основных параметров финансовой модели на результирующий показатель

8. Анализ сценариев:

- a) позволяет определять ранг риска отдельно для каждой цели
- b) позволяет создать модель прогнозирования потенциальных убытков
- c) позволяет учесть все виды рисков, используя вероятностный подход, рассчитать основные экономико-статистические показатели количественной оценки уровня риска

9. Какое правило НЕ относится к анализу сценариев риска:

- a) проект (инвестиционный) следует отклонить, даже если при оптимистическом сценарии развития предприятия NPV отрицательна
- b) проект (инвестиционный) следует отклонить, если при реалистическом сценарии развития предприятия NPV положительна
- c) пессимистический сценарий в случае получения положительного значения NPV позволяет эксперту судить о приемлемости данного проекта несмотря на наихудшие ожидания

10. Первым этапом сценарного анализа является:

- a) определение ключевых факторов при помощи анализа чувствительности
- b) расчет NPV
- c) выявление возможных ситуаций и колебаний ситуаций
- d) построение "дерева сценариев"

11. Показатель NPV в сценарном анализе рассчитывается:

- a) для определения ключевых факторов
- b) для определения рискованности проекта
- c) для определения доходности проекта

12. Показатель VaR - это:

- a) соотношение между рентабельностью убытков и прибыли, которое используется для выбора сферы торговли или в качестве сравнительного показателя
- b) выраженная в денежных единицах (либо в процентах от стоимости) оценка величины, которую не превысят ожидаемые в течение заданного периода времени потери с заданной вероятностью

с) метод оценки риска, который наряду с базовым набором исходных данных рассматривает ряд других наборов данных, которые могут иметь место в процессе реализации проекта

13. Выберите параметр, который НЕ характеризует показатель VaR:

- a) временной горизонт
- b) уровень доверия
- c) уровень инвестиционного риска
- d) метод расчета или базовая валюта

14. К какой группе относится метод исторического моделирования (по методике оценки риска с использованием показателя VaR):

- a) группе, основанной на так называемом локальном оценивании
- b) к группе полного оценивания, подразумевающей полный перерасчет стоимости финансового инструмента
- c) оба варианта ответа являются неправильными

15. В каких единицах измеряется показатель VaR:

- a) в денежных единицах
- b) в процентах
- c) может измеряться и в денежных единицах, и в процентах
- d) все варианты ответа являются неправильными

16. Какой метод НЕ является разновидностью метода оценки риска с использованием показателя VaR:

- a) метод исторического моделирования
- b) метод анализа вероятностных распределений потоков платежей
- c) метод Монте-Карло
- d) Дельта-нормальный метод (параметрический)

17. К экзогенным факторам неопределенности следует относить...

- a) отраслевую специфику;
- b) уровень потребительского спроса;
- c) издержки предприятия;
- d) платежеспособность населения;
- e) все вышеперечисленное;
- f) только a), b), d);
- g) только c), d).

18. К функциям риска относят...

- a) контрольную;
- b) защитную;
- c) компенсирующую;
- d) регулятивную (стимулирующую);
- e) социально-экономическую;
- f) все вышеперечисленные;
- g) только a), c), d), e).

19. В относительном выражении риск рассматривается...

- a) как величина возможных потерь, отнесенная к некоторой базе, в виде которой наиболее удобно принимать либо финансовое состояние коммерческой организации, либо общие затраты ресурсов на данный вид предпринимательской деятельности, либо ожидаемый доход (прибыль) от предпринимательства;
- b) как величина возможных потерь в материально-вещественном (физическом) или стоимостном (денежном) выражении, в случае если ущерб измеряется;
- c) как величина возможных потерь только в материально-вещественном (физическом) выражении.

20. К основным чертам риска относятся...

- a) противоречивость;

- b) альтернативность;
- c) неопределенность;
- d) комплексность;
- e) все вышеперечисленное;
- f) только a), b), c).

21. Вероятность, основанная на расчете частоты, с которой происходит определенный процесс или явление, – это...

- a) объективная вероятность;
- b) субъективная вероятность;
- c) не объективная вероятность.

22. В абсолютном выражении риск характеризуется...

- a) как величина возможных потерь, отнесенная к некоторой базе, в виде которой наиболее удобно принимать либо финансовое состояние коммерческой организации, либо общие затраты ресурсов на данный вид предпринимательской деятельности, либо ожидаемый доход (прибыль) от предпринимательства;
- b) как величина возможных потерь в материально-вещественном (физическом) или стоимостном (денежном) выражении, в случае если ущерб измеряется;
- c) как величина возможных потерь только в стоимостном выражении.

23. Изменение технологии производства на предприятии можно отнести...

- a) к эндогенным факторам неопределенности;
- b) экзогенным факторам неопределенности;
- c) внешним факторам неопределенности.

24. Наличие факторов, при которых результаты действий не являются детерминированными, а степень возможного влияния этих факторов на результаты неизвестна, характеризуется категорией...

- a) случайность;
- b) частота;
- c) неопределенность.

25. Вероятность, базирующаяся на предположении о возможности получения данного результата, – это...

- a) не объективная вероятность;
- b) субъективная вероятность;
- c) объективная вероятность.

26. Риски, предполагающие вероятность получения только убытка, называются...

- a) чистые риски;
- b) спекулятивные риски;
- c) смешанные риски;
- d) риски потерь.

27. Риски, представляющие собой опасность валютных потерь, возникающих в связи с изменением курса одной иностранной валюты по отношению к другой, называют...

- a) экономическими;
- b) процентными;
- c) валютными.

28. Риск наступления косвенного финансового ущерба (неполучение прибыли) вследствие нереализации определенного мероприятия называют...

- a) риском упущенной выгоды;
- b) кредитным риском;
- c) социальным риском.

29. Риски, появление которых не связано с деятельностью конкретного предприятия, и они возникают как итог развития всей экономической системы и природных изменений, относятся...

- a) к управляемым рискам;
- b) неуправляемым рискам;
- c) непредвиденным рискам.

30. Производственный риск...

- a) возникает в процессе реализации товаров и услуг, произведенных или закупленных предприятием;
- b) связан с производством продукции, товаров, услуг, с осуществлением любых видов производственной деятельности;
- c) возникает в сфере отношений предприятия с банками и другими финансовыми инструментами.

31. Недиверсифицируемый риск представляет собой...

- a) рыночный риск, который не может быть уменьшен посредством создания инвестором диверсификационного портфеля акций;
- b) риск, появление которого непосредственно связано с производственной и инвестиционной деятельностью конкретного предприятия;
- c) риск, появление которого не связано с деятельностью конкретного предприятия.

32. Риск, от которого зависит дееспособность предприятия (возникает по причине простоев в технологическом цикле, несвоевременного управленческого решения), называется...

- a) динамичный риск;
- b) статичный риск;
- c) недиверсифицируемый риск.

33. К причинам процентного риска можно отнести...

- a) изменение ставки рефинансирования;
- b) неточный выбор ставки при осуществлении конкретной операции;
- c) все вышеперечисленное.

34. К видам валютного риска можно отнести...

- a) операционный валютный риск;
- b) трансляционный риск;
- c) экономический риск;
- d) все вышеперечисленные;
- e) только a), b);
- f) только b), c).

35. Финансовый риск включает...

- a) валютный риск;
- b) операционный риск;
- c) кредитный риск;
- d) процентный риск;
- e) все вышеперечисленные;
- f) только a), b), c).

36. Метод парного сравнения, ранжирование, метод балльной оценки относятся...

- a) к экспертным методам;
- b) статистическим методам;
- c) аналоговым методам.

37. Основной принцип морфологического анализа заключается...

- a) в том, что он исключает из исследования объекты, процессы, источники риска без предварительного тщательного анализа;
- b) в том, что он не позволяет исключать из исследования объекты, процессы, источники риска без предварительного тщательного анализа;
- c) в том, что он дает возможность оценить только количественное влияние риска.

38. SWOT-анализ относится...

- a) к эвристическим методам;

- b) методам детерминированного факторного анализа;
- c) статистическим методам.

39. Метод «Дельфи» представляет собой...

- a) аналоговый метод;
- b) метод экспертных оценок;
- c) расчетно-аналитический метод.

40. С помощью каких методов можно определить уровень вероятности появления рисков по отдельным часто повторяющимся операциям в организации, используя как собственный, так и внешний опыт проведения подобных операций?

- a) расчетно-аналитические методы;
- b) методы финансовых вычислений;
- c) аналоговые методы.

41. Для получения наиболее достоверных результатов при оценке предпринимательского риска следует использовать...

- a) только расчетно-аналитические методы;
- b) только экспертные методы;
- c) совмещать различные аналитические методы.

42. Возможно ли использование ранжирования при оценке инвестиционного риска?

- a) да;
- b) нет;
- c) при оценке инвестиционного риска используется только ранжирование.

43. Метод балльной оценки риска относят...

- a) к экспертным методам;
- b) статистическим методам;
- c) аналоговым методам.

44. Количественной оценке вероятности появления финансовых рисков на базе применения внутренней информационной базы самой организации способствуют...

- a) статистические методы;
- b) аналоговые методы;
- c) расчетно-аналитические методы.

45. Диверсификацией называется...

- a) процесс распределения инвестируемых средств среди различных, не связанных между собой, объектов вложения капитала с целью минимизации степени риска и потерь доходов;
- b) процесс распределения инвестируемых средств среди взаимосвязанных между собой объектов вложения капитала;
- c) процесс самостоятельного страхования организации путем формирования резервных фондов без заключения договоров со страховой компанией и приобретения страховки.

46. Передача ответственности за риск другому лицу, например, страховой организации, называется...

- a) страхованием;
- b) лимитированием;
- c) хеджированием;
- d) самострахованием.

47. Установление предельных сумм рискованных расходов организации, на которое она может пойти без ощутимого ущерба, называется...

- a) хеджированием на повышение;
- b) хеджированием на понижение;
- c) лимитированием;
- d) диверсификацией.

48. Пути снижения финансовых рисков включают...

- a) приемы предотвращения рисков;
- b) приемы снижения рисков;
- c) все вышеперечисленное.

49. Лимитирование относится...

- a) к приемам предотвращения рисков;
- b) приемам снижения рисков;
- c) приемам избежания риска.

50. Для страхования от возможного в будущем снижения цен применяется...

- a) хеджирование на повышение;
- b) диверсификация;
- c) избежание;
- d) хеджирование на понижение;
- e) все вышеперечисленное.

Темы рефератов

1. Сущность предпринимательского риска.
2. Анализ факторов микроокружения и макроокружения, влияющих на предпринимательский риск.
3. Функции и основные виды предпринимательского риска.
4. Методы анализа рисков.
5. Особенности финансовых рисков.
6. Методы прогнозирования риска банкротства организации.
7. Способы анализа ликвидности организации при оценке риска банкротства организации.
8. Сущность инвестиционных рисков.
9. Методы оценки инвестиционных рисков.
10. Минимизация рисков: понятие и методы.
11. Риск-менеджмент в современных условиях.
12. Основные инструменты управления рисками.
13. Анализ производственного риска.
14. Оценка кредитного риска.
15. Роль бюджетирования в управлении финансовыми рисками.
16. Диверсификация как способ снижения предпринимательского риска.
17. Способы снижения рисков и особенности их применения для отдельных видов деятельности.
18. Комплексный подход к диагностике предпринимательского риска.
19. Стратегии решений в условиях риска
20. Сущность экспресс-диагностики финансового положения организации при определении риска ее банкротства.