

Документы
Информация о владельце: "Самарский государственный экономический университет"
ФИО: Кандрашина Елена Александровна
Должность: И.о. ректора ФГАОУ ВО «Самарский государственный экономический университет»
Дата подписания: 23.07.2026 13:20:59
Уникальный программный ключ:
2db64eb9605ce27edd3b8e8fdd32c70e0674ddd2

**РАБОЧАЯ ПРОГРАММА ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛЯ)
«ПРОГНОЗИРОВАНИЕ И МОДЕЛИРОВАНИЕ РИСКОВ ПРОЕКТА»**

Уровень высшего образования: магистратура

Направление подготовки: 38.04.01 Экономика

Направленность (профиль) подготовки: Экономика и управление проектами

Квалификация (степень) выпускника: магистр

Форма обучения: очная

Год набора (приема на обучение): 2026

Срок получения образования: 2 года

Объем: в зачетных единицах: 3 з.е.
в академических часах: 108 ак.ч.

г. Самара, 2026

Разработчики:

Кандидат экономических наук Чиркунова Е. К.

Рабочая программа дисциплины (модуля) составлена в соответствии с требованиями ФГОС ВО по направлению подготовки 38.04.01 Экономика, утвержденного приказом Минобрнауки от 11.08.2020 № 939, с учетом трудовых функций профессиональных стандартов: "Специалист по работе с инвестиционными проектами", утвержден приказом Минтруда России от 23.09.2024 № 497н; "Специалист в сфере управления проектами государственно-частного партнерства", утвержден приказом Минтруда России от 20.07.2020 № 431н.

Согласование и утверждение

№	Подразделение или коллегиальный орган	Ответственное лицо	ФИО	Виза	Дата, протокол (при наличии)
1	Кафедра региональной экономики и управления	Заведующий кафедрой, руководитель подразделения, реализующего ОП	Гусева М. С.	Рассмотрено	26.05.2026, № 10

1. Цель и задачи освоения дисциплины (модуля)

Цель освоения дисциплины - формирование результатов обучения, обеспечивающих достижение планируемых результатов освоения образовательной программы

Задачи изучения дисциплины:

- Формирование у обучающихся системное представление о ключевых понятиях, принципах и методологии дисциплины, а также об их роли и месте в структуре всей образовательной программы;
- Развитие у студентов способности применять полученные теоретические знания и практические навыки для решения типовых и нестандартных профессиональных задач, соответствующих профилю подготовки;
- Обеспечение интеграции результатов обучения по данной дисциплине с другими модулями образовательной программы для формирования целостных профессиональных компетенций.

2. Планируемые результаты обучения по дисциплине (модулю), соотнесенные с планируемыми результатами освоения образовательной программы

Компетенции, индикаторы и результаты обучения

УК-1 Способен осуществлять критический анализ проблемных ситуаций на основе системного подхода, вырабатывать стратегию действий

УК-1.1 Осуществляет критический анализ проблемных ситуаций на основе системного подхода

Знать:

УК-1.1/Зн1 Методологию системного и критического анализа, методы научного познания, необходимые для исследования проблемных ситуаций; принципы выявления структуры проблемной ситуации и связей между ее элементами; критерии оценки надежности источников информации для прогнозирования рисков проектов

Уметь:

УК-1.1/Ум1 Выявлять проблемные ситуации в рамках управления инвестиционными проектами, обосновывать потребность в их исследовании; проводить декомпозицию задач и определять пробелы в информации, необходимой для разрешения проблемной ситуации

Владеть:

УК-1.1/Нв1 Методическими инструментами выявления и установления структуры проблемных ситуаций; способами оценки качества и надежности получаемой информации для разрешения диагностированной проблемной ситуации; методами установления причинно-следственных связей

УК-1.2 Вырабатывает стратегию действий в проблемных ситуациях

Знать:

УК-1.2/Зн1 Место содержательного анализа проблем и проблемных ситуаций в общей методике исследования системы управления; принципы и подходы к формированию стратегии решения проблемных ситуаций на основе системного и междисциплинарных подходов

Уметь:

УК-1.2/Ум1 Разрабатывать и содержательно аргументировать стратегию решения проблемной ситуации на основе системного и междисциплинарных подходов; проектировать процессы по устранению пробелов в информации

Владеть:

УК-1.2/Нв1 Современной научной базой методов исследования; способами выявления научной и практической эффективности разработанных стратегий; конструированием показателей эффективности с учетом специфики решаемой управленческой проблемы; навыками определения последствий предложенного решения

ПК-2 Способен владеть методами аналитической работы в процессе управления рисками инвестиционных проектов

ПК-2.1 Идентифицирует, классифицирует и оценивает риски инвестиционного проекта на всех стадиях его жизненного цикла

Знать:

ПК-2.1/Зн1 Классификацию проектных рисков; методы идентификации и качественной оценки рисков инвестиционных проектов; методы количественного прогнозирования рисков (имитационное моделирование, анализ чувствительности, сценарный анализ)

Уметь:

ПК-2.1/Ум1 Применять методы системного анализа для идентификации рисков на всех стадиях жизненного цикла проекта; проводить качественную и количественную оценку вероятности наступления рисков событий и их влияния на проектные параметры; формировать реестр рисков инвестиционного проекта

Владеть:

ПК-2.1/Нв1 Навыками построения матриц рисков; методикой выбора рационального комплекса методов прогнозирования рисков; практическими приемами имитационного моделирования и анализа чувствительности для прогнозирования вероятных отклонений проектных параметров; методами сбора и анализа данных для принятия практических решений

ПК-2.2 Разрабатывает мероприятия по минимизации выявленных рисков

Знать:

ПК-2.2/Зн1 Технологии и методы управления рисками: уклонение, передача, снижение, принятие; критерии выбора оптимальных способов реагирования на риски; методики оценки экономической эффективности мероприятий по минимизации рисков

Уметь:

ПК-2.2/Ум1 Разрабатывать план реагирования на выявленные риски с обоснованием выбранных стратегий; формировать комплекс организационно-технических средств для реализации мероприятий по минимизации рисков; оценивать экономическую эффективность предлагаемых мер

Владеть:

ПК-2.2/Нв1 Навыками разработки синтезированных прогнозов риска; методикой разработки мероприятий по снижению негативных последствий рисков событий; опытом формирования стратегии оптимизации управления рисками инвестиционной деятельности

3. Место дисциплины в структуре ОП

Дисциплина (модуль) «Прогнозирование и моделирование рисков проекта» относится к формируемой участниками образовательных отношений части образовательной программы и изучается в семестре(ах): 3.

В процессе изучения дисциплины студент готовится к решению типов задач профессиональной деятельности, предусмотренных ФГОС ВО и образовательной программой.

Компетенция	Предшествующие дисциплины	Последующие дисциплины
ПК-2 - Способен владеть методами аналитической работы в процессе управления рисками инвестиционных проектов		
ПК-2.1 Идентифицирует, классифицирует и оценивает риски инвестиционного проекта на всех стадиях его жизненного цикла	Инвестиционный анализ и экспертиза проектов, Проектное управление инвестициями, Производственная практика: по профилю профессиональной деятельности	Подготовка к процедуре защиты и защита выпускной квалификационной работы, Производственная практика: по профилю профессиональной деятельности, Производственная практика: преддипломная
ПК-2.2 Разрабатывает мероприятия по минимизации выявленных рисков	Инвестиционный анализ и экспертиза проектов, Проектное управление инвестициями	Подготовка к процедуре защиты и защита выпускной квалификационной работы, Производственная практика: преддипломная
УК-1 - Способен осуществлять критический анализ проблемных ситуаций на основе системного подхода, вырабатывать стратегию действий		
УК-1.1 Осуществляет критический анализ проблемных ситуаций на основе системного подхода	Стратегическое мышление и стратегический анализ, Учебная практика: ознакомительная практика	Подготовка к процедуре защиты и защита выпускной квалификационной работы
УК-1.2 Вырабатывает стратегию действий в проблемных ситуациях	Производственная практика: научно-исследовательская работа, Стратегическое мышление и стратегический анализ, Учебная практика: ознакомительная практика	Подготовка к процедуре защиты и защита выпускной квалификационной работы

4. Объем дисциплины (модуля) и виды учебной работы

Период обучения	Общая трудоемкость (часы)	Общая трудоемкость (ЗЕТ)	Контактная работа (часы, всего)	Практические занятия (часы)	Индивидуальная контактная работа (часы)	Самостоятельная работа (часы)	Промежуточная аттестация
Третий семестр	108	3	12	12	0,15	77,85	Зачет
Всего	108	3	12	12	0,15	77,85	18

5. Содержание дисциплины (модуля)

5.1. Разделы, темы дисциплины и виды занятий (часы промежуточной аттестации не указываются)

Наименование раздела, темы	лекционные занятия	лабораторная работа
----------------------------	--------------------	---------------------

	Всего	Практичес	Самостоя
Раздел 1. Прогнозирование и моделирование рисков проекта	89,85	12	77,85
Тема 1.1. Неопределенность и риск. Введение в теорию рисков. Факторы риска	11	2	9
Тема 1.2. Измерение риска и критерии принятия рисковых решений. Методы оценки рисков	12	2	10
Тема 1.3. Стратегии рисковых решений и основные методы управления риском	12	2	10
Тема 1.4. Приемы и способы управления рисками. Количественные методы прогнозирования и моделирования рисков.	18	2	16
Тема 1.5. Применение имитационного моделирования, анализа чувствительности и сценарного подхода для прогнозирования вероятных отклонений проектных параметров	18	2	16
Тема 1.6. Портфельное инвестирование. Риск портфеля активов	18,85	2	16,85

5.2. Контрольные мероприятия по дисциплине

Вид контроля	Форма контроля/Оценочное средство
Текущий контроль	Тестирование
Промежуточная аттестация	Зачет

№ п/п	Наименование раздела	Вид контроля/ используемые оценочные материалы	
		Текущий	Промежут. аттестация
1	Прогнозирование и моделирование рисков проекта	Тестирование	Зачет

6. Оценочные материалы текущего контроля

1. Прогнозирование и моделирование рисков проекта Тестирование

№ п/п	Содержание вопроса		Компетенция
		Правильный ответ (ключ ответа)	

1	Прочитайте задание, выберите правильный ответ. Проблемная ситуация с точки зрения системного подхода представляет собой: 1. Логическое противоречие в научной теории 2. Несоответствие между новыми фактами и старыми методами их объяснения 3. Противоречие между желаемым и действительным состоянием системы, требующее разрешения 4. Отсутствие информации для принятия решения	УК-1
	Ответ: 3	
2	Прочитайте задание, выберите правильный ответ. Какой метод системного анализа предполагает построение иерархии от вершины (цели) через промежуточные уровни (критерии) к нижнему уровню альтернатив с последующим построением матриц попарных сравнений? 1. Метод «ДЕЛЬФИ» 2. Метод анализа иерархий 3. SWOT-анализ 4. Морфологический метод	УК-1
	Ответ: 2	
3	Прочитайте задание, выберите правильный ответ. Что из перечисленного является главной трудностью информационного обеспечения при критическом анализе проблемной ситуации? 1. Создание резервной информации 2. Наличие дезинформации 3. Отбор так называемой излишней информации 4. Сложности определения истинности информации	УК-1
	Ответ: 4	
4	Прочитайте задание, выберите правильный ответ. Результатом выхода из проблемной ситуации на основе системного подхода является: 1. Новое научное знание 2. Выявление путей к объяснению новых знаний 3. Конструирование новых, рационально осмысленных форм организации теоретического знания 4. Разработка стратегии действий, обеспечивающей достижение цели	УК-1
	Ответ: 4	
5	Прочитайте задание, выберите правильный ответ. Понятие рациональности применимо к таким параметрам всякой деятельности как: 1. Предположение и поиск истины 2. Создание гипотезы 3. Цель и действие 4. Определение проблемы	УК-1
	Ответ: 3	
6	Прочитайте задание, выберите правильный ответ. Критический анализ проблемной ситуации предполагает: 1. Выявление только негативных аспектов ситуации 2. Декомпозицию системы на составляющие, выявление связей между ними и оценку их влияния на достижение цели 3. Поиск виновных в возникновении проблемы 4. Сбор максимального объема информации без ее оценки	УК-1
	Ответ: 2	
7	Прочитайте задание и установите соответствие. Установите соответствие между методом системного анализа и его характеристикой: Метод / Характеристика 1. Метод «ДЕЛЬФИ» А. Построение дерева целей, определение весовых коэффициентов и выбор оптимальной стратегии 2. SWOT-анализ Б. Экспертный опрос в несколько туров с обратной связью для достижения консенсуса 3. Метод «ПАТТЕРН» В. Выявление сильных и слабых сторон, возможностей и угроз объекта исследования	УК-1
	Ответ: 1-Б, 2-В, 3-А	
8	Прочитайте задание и установите соответствие. Установите соответствие между этапом разработки стратегии решения проблемной ситуации и его содержанием: Этап / Содержание 1. Анализ проблемной ситуации А. Определение последовательности действий, предвидение результата каждого шага 2. Постановка проблемы Б. Выявление составляющих системы и связей между ними 3. Разработка стратегии В. Формулирование противоречия, требующего разрешения	УК-1
	Ответ: 1-Б, 2-В, 3-А	

9	Прочитайте задание и установите соответствие. Установите соответствие между способом устранения пробелов в информации и его применением: Способ / Применение 1. Поиск дополнительных источников А. Оценка достоверности имеющейся информации 2. Критический анализ имеющихся данных Б. Привлечение экспертов для получения недостающих знаний 3. Экспертная оценка В. Расширение информационной базы для решения проблемной ситуации	УК-1
	Ответ: 1-В, 2-А, 3-Б	
10	Прочитайте задание и установите правильную последовательность. Установите правильную последовательность этапов проведения SWOT-анализа проблемной ситуации: 1. Выявление сильных и слабых сторон объекта анализа 2. Описание потенциальных возможностей и внешних угроз 3. Уточнение содержания и формулировок основных целей исследования 4. Анализ использования сильных сторон для реализации возможностей и преодоления угроз	УК-1
	Ответ: 3-1-2-4	
11	Прочитайте задание и установите правильную последовательность. Установите правильную последовательность этапов метода анализа иерархий: 1. Построение множества матриц попарных сравнений 2. Определение глобальной цели и анализ проблемной ситуации 3. Иерархический синтез оценок для получения искомых весов 4. Построение иерархии от цели через критерии к альтернативам	УК-1
	Ответ: 2-4-1-3	
12	Впишите пропущенное слово: Осмысление проблемной ситуации трактуется как установление ее смысла, реконструкция смысла, содержащегося в _____, с последующим построением теоретических конструктов.	УК-1
	Ответ: описании	
13	Впишите пропущенное слово: При разработке стратегии решения проблемной ситуации на основе системного подхода необходимо определить _____ действий как последовательность шагов, предвидя результат каждого из них.	УК-1
	Ответ: стратегию (или последовательность)	
14	Впишите пропущенное слово или словосочетание: Процесс выявления пробелов в информации, необходимой для решения проблемной ситуации, и проектирование процессов по их устранению является этапом _____ анализа проблемной ситуации.	УК-1
	Ответ: критического	
15	Впишите пропущенное слово: SWOT-анализ включает выявление сильных и слабых сторон объекта исследования, а также описание потенциальных _____ и внешних угроз.	УК-1
	Ответ: возможностей	
16	Впишите пропущенное слово: Применение _____ подхода при анализе проблемной ситуации предполагает рассмотрение ее как целостной системы с выявлением составляющих элементов и связей между ними.	УК-1
	Ответ: системного	
17	Прочитайте задание, выберите правильный ответ. Инвестиционный риск характеризует: 1. Неполнота или неточность информации об условиях реализации проекта 2. Вероятность возникновения непредвиденных финансовых потерь вследствие неопределенности условий инвестиционной деятельности 3. Неопределенность, связанная с возможностью возникновения в ходе реализации проекта неблагоприятных ситуаций 4. Все перечисленные варианты	ПК-2
	Ответ: 4	
18	Прочитайте задание, выберите правильный ответ. В основе деления инвестиционных рисков на систематический и несистематический лежит критерий: 1. Источник возникновения 2. Период возникновения 3. Причина возникновения и возможность устранения 4. Степень влияния на финансовое положение предприятия	ПК-2
	Ответ: 3	
19	Прочитайте задание, выберите правильный ответ. Какой вид риска характеризуется степенью неопределенности, связанной с комбинацией заемных и собственных источников финансирования инвестиционного проекта? 1. Процентный риск 2. Рыночный риск 3. Валютный риск 4. Финансовый риск	ПК-2

	Ответ: 4	
20	Прочитайте задание, выберите правильный ответ. Систематический риск характеризуется следующими признаками: 1. Связан с внутренними факторами и зависит от деятельности предприятия 2. Может быть устранен в результате диверсификации 3. Связан с внешними факторами и не зависит от деятельности предприятия 4. Приводит только к потере прибыли, но не капитала Ответ: 3	ПК-2
21	Прочитайте задание, выберите правильный ответ. Относительным показателем инвестиционного риска является: 1. Вариация 2. Дисперсия 3. Среднеквадратическое отклонение 4. Коэффициент вариации Ответ: 4	ПК-2
22	Прочитайте задание, выберите правильный ответ. При сравнительной оценке инвестиционных проектов более рискованным является проект: 1. Менее чувствительный к изменению критических факторов 2. С большим размахом вариации показателя чистой текущей стоимости 3. С меньшим размахом вариации показателя чистой текущей стоимости 4. С более высокой внутренней нормой доходности Ответ: 2	ПК-2
23	Прочитайте задание и установите соответствие. Установите соответствие между процедурой управления рисками проекта и ее содержанием: Процедура / Содержание 1. Идентификация риска А. Качественный и количественный анализ причин и вероятности возникновения, а также влияния последствий рисков на проект 2. Оценка риска Б. Определение рисков, способных повлиять на проект, и документирование их характеристик 3. Планирование реагирования на риски В. Разработка мер, обеспечивающих минимизацию вероятности и ослабление отрицательных последствий рисков событий Ответ: 1-Б, 2-А, 3-В	ПК-2
24	Прочитайте задание и установите соответствие. Установите соответствие между видом риска и его характеристикой: Вид риска / Характеристика 1. Допустимый риск А. Угроза полной потери предприятием прибыли 2. Критический риск Б. Угроза потери имущества и банкротства предприятия 3. Катастрофический риск В. Связан с утратой предполагаемой выручки от реализации Ответ: 1-В, 2-А, 3-Б	ПК-2
25	Прочитайте задание и установите соответствие. Установите соответствие между методом количественной оценки риска и его содержанием: Метод / Содержание 1. Анализ чувствительности А. Определение влияния изменения одного фактора на результирующий показатель 2. Сценарный анализ Б. Оценка изменения результирующего показателя при различных комбинациях факторов 3. Имитационное моделирование В. Многократная генерация случайных значений факторов для построения распределения вероятностей Ответ: 1-А, 2-Б, 3-В	ПК-2
26	Прочитайте задание и установите правильную последовательность. Установите правильную последовательность этапов управления рисками инвестиционного проекта: 1. Планирование реагирования на риски 2. Идентификация рисков 3. Мониторинг и контроль рисков 4. Качественная и количественная оценка рисков Ответ: 2-4-1-3	ПК-2
27	Прочитайте задание и установите правильную последовательность. Установите правильную последовательность действий при разработке мероприятий по минимизации выявленных рисков: 1. Выбор стратегии реагирования на каждый идентифицированный риск 2. Оценка экономической эффективности предлагаемых мероприятий 3. Формирование реестра рисков с их характеристиками 4. Разработка плана реагирования с указанием ответственных и сроков Ответ: 3-1-2-4	ПК-2

28	Впишите пропущенное слово: Снижение степени риска может обеспечиваться распределением риска между участниками проекта, страхованием и _____ средств на случай непредвиденных обстоятельств.		ПК-2
	Ответ:	резервированием	
29	Впишите пропущенное слово: Метод, основанный на определении срока, который понадобится для возмещения суммы первоначальных инвестиций, называется методом расчета периода _____ инвестиций.		ПК-2
	Ответ:	окупаемости	
30	Впишите пропущенное слово: Если бета-коэффициент актива равен 0,7, то финансовый риск _____ среднего уровня риска финансового рынка на 30%.		ПК-2
	Ответ:	ниже	
31	Решите задачу: Справочные данные: Уровень финансового риска рассчитывается как произведение вероятности возникновения данного финансового риска и размера возможных финансовых потерь при реализации данного риска. Вероятность наступления рискованного события по инвестиционному проекту составляет 0,25. Размер возможных финансовых потерь при реализации риска — 4 000 000 руб. Рассчитайте уровень финансового риска. В ответе укажите числовое значение в рублях.		ПК-2
	Ответ:	1 000 000 Обоснование: $\text{Уровень риска} = 0,25 \times 4\,000\,000 = 1\,000\,000 \text{ руб.}$	
32	Решите задачу: Справочные данные: Уровень доходности финансового инструмента с учетом фактора риска рассчитывается как сумма безрисковой нормы доходности и уровня премии за риск. Безрисковая ставка доходности составляет 7%. Средняя норма доходности на финансовом рынке — 11%. Бета-коэффициент конкретного актива — 0,6. Рассчитайте уровень премии за риск и уровень доходности актива с учетом риска. В ответе укажите значение уровня доходности актива с учетом риска (в процентах).		ПК-2
	Ответ:	9,4 Обоснование: 1. Премия за риск $= 0,6 \times (11\% - 7\%) = 0,6 \times 4\% = 2,4\%$ 2. Уровень доходности с учетом риска $= 7\% + 2,4\% = 9,4\%$	

7. Оценочные материалы промежуточной аттестации

Зачет третий семестр

№ п/п	Содержание вопроса		Компетенция
		Правильный ответ (ключ ответа)	
1	Дайте развернутый ответ на вопрос. Раскройте сущность системного подхода как методологической основы критического анализа проблемных ситуаций в управлении проектами.		УК-1
	Ответ:	Системный подход рассматривает проблемную ситуацию как целостную систему, состоящую из взаимосвязанных элементов. Ключевые принципы: целостность (свойства системы не сводятся к сумме свойств частей), структурность (описание через связи элементов), иерархичность (каждый элемент может быть системой). Применительно к проектам это означает, что проблема не изолирована — она является следствием сложных взаимодействий факторов. Критический анализ требует декомпозиции системы, выявления причинно-следственных связей и оценки влияния каждого элемента на достижение цели.	
2	Дайте развернутый ответ на вопрос. Охарактеризуйте методы сбора и критического анализа информации, необходимой для идентификации проблемных ситуаций в инвестиционном проектировании.		УК-1
	Ответ:	Критический анализ информации включает оценку ее достоверности, полноты и релевантности. Методы сбора: анализ документации, интервью с экспертами, анкетирование, мониторинг внешней среды. Критический анализ предполагает выявление пробелов в информации, проверку источников на достоверность (сопоставление с альтернативными данными), оценку влияния неполноты данных на качество прогнозов. Результатом является систематизированное описание проблемной ситуации с указанием степени неопределенности по каждому значимому фактору.	

3	Решите ситуационную задачу. При реализации инвестиционного проекта по модернизации производства выявлено, что плановые сроки ввода оборудования срываются. Руководство видит причину только в задержке поставок. Примените системный подход для критического анализа ситуации: какие факторы могут быть неочевидны, и как проверить гипотезы?	УК-1
	Ответ: Системный подход требует рассмотрения комплекса взаимосвязанных факторов. Помимо очевидной задержки поставок, возможно: недостаточная готовность площадки (не завершен ремонт, отсутствует необходимое электроснабжение), кадровый дефицит (нет обученного персонала для монтажа), ошибки в проектной документации, несогласованность действий подрядчиков. Для проверки гипотез необходимо: проанализировать графики всех смежных работ, провести интервью с ответственными исполнителями на местах, проверить готовность сопутствующей инфраструктуры. Только выявление всех системных факторов позволит разработать эффективную стратегию выхода из ситуации, а не ограничиваться воздействием на один симптом.	
4	Дайте развернутый ответ на вопрос. Опишите этапы разработки стратегии действий при разрешении проблемной ситуации на основе системного подхода.	УК-1
	Ответ: Разработка стратегии включает: 1) определение целей разрешения проблемы (что должно быть достигнуто), 2) генерацию альтернативных сценариев действий, 3) оценку каждого варианта по критериям эффективности, ресурсоемкости и рискам, 4) выбор оптимальной стратегии, 5) планирование ресурсов и сроков. Системный подход требует учитывать взаимовлияние принимаемых решений на все элементы системы. Стратегия должна быть гибкой — предусматривать корректировку при изменении внешних условий. Критерием успешности является не только устранение текущего проявления проблемы, но и предотвращение ее возникновения в будущем.	
5	Дайте развернутый ответ на вопрос. Как оценить эффективность разработанной стратегии решения проблемной ситуации и какие критерии используются для такой оценки?	УК-1
	Ответ: Оценка эффективности стратегии базируется на нескольких критериях: достижение целевых показателей (степень устранения проблемы), ресурсная эффективность (соотношение затрат и полученных результатов), временная эффективность (сроки реализации), устойчивость решения к изменению внешних условий. Наиболее объективным методом является сравнение прогнозируемого состояния системы при реализации стратегии с альтернативными сценариями (без вмешательства или при других вариантах действий). Дополнительно оцениваются риски, связанные с реализацией стратегии, и разрабатываются меры по их минимизации.	
6	Решите ситуационную задачу. Вы — руководитель проектного офиса. По результатам полугодового мониторинга выявлено систематическое отставание от плана по срокам и превышение бюджета по всем проектам. Разработайте стратегию действий, включающую комплекс взаимосвязанных мер, а не точечные корректировки.	УК-1
	Ответ: Стратегия должна быть комплексной: 1) провести анализ первопричин (причины системного характера: возможно, изначально заниженные сроки при планировании, недостаточная квалификация проектных менеджеров, неэффективная система мониторинга); 2) пересмотреть методологию планирования (внедрение резервов времени и бюджета, применение более реалистичных оценок); 3) усилить систему мониторинга через внедрение ранних индикаторов отклонений; 4) провести обучение проектных команд методам управления сроками и бюджетом; 5) разработать систему мотивации, стимулирующую соблюдение планов. Стратегия должна быть внедрена пилотно на 1–2 проектах с последующей корректировкой и масштабированием.	
7	Дайте развернутый ответ на вопрос. Охарактеризуйте классификацию инвестиционных рисков по источникам возникновения и по возможности устранения (систематические и несистематические).	ПК-2
	Ответ: По источнику возникновения риски делятся на: макроэкономические (изменение законодательства, инфляция, курсы валют — внешние, неуправляемые), отраслевые (специфика рынка), микроэкономические (внутренние факторы проекта). По возможности устранения: систематические (рыночные) риски обусловлены внешними факторами, не зависят от деятельности инвестора, не могут быть устранены диверсификацией — это риск изменения ставок, инфляции, политической ситуации. Несистематические риски связаны с конкретным проектом (невыполнение плана, ошибки менеджмента, срыв поставок) и могут быть снижены или устранены грамотным управлением. Идентификация всех видов рисков на всех стадиях жизненного цикла позволяет формировать адекватную стратегию реагирования.	

8	Дайте развернутый ответ на вопрос. Охарактеризуйте метод анализа иерархий (МАИ) как инструмент системного анализа проблемных ситуаций и его применение при выработке стратегии действий.		УК-1
	Ответ:	Метод анализа иерархий (МАИ) — инструмент системного анализа, основанный на построении иерархической структуры проблемы: вершина (глобальная цель), промежуточные уровни (критерии, альтернативы) и нижний уровень (решения). Применение включает: декомпозицию проблемной ситуации на элементы, попарное сравнение элементов по шкале относительной важности (от 1 до 9), вычисление весовых коэффициентов, иерархический синтез для выбора оптимальной альтернативы. МАИ позволяет учитывать как количественные, так и качественные критерии, объединять экспертные оценки и обеспечивать обоснованность стратегии действий в условиях неопределенности.	
9	Решите ситуационную задачу. В компании при запуске нового продукта возникла проблемная ситуация: отдел маркетинга настаивает на агрессивной рекламной кампании, а финансовый отдел — на минимизации затрат. Примените системный подход для анализа данной ситуации и предложите стратегию действий, учитывающую интересы обеих сторон и долгосрочные цели компании.		УК-1
	Ответ:	Системный подход требует рассматривать ситуацию как целостность. Конфликт между отделами — это частное проявление системного противоречия между краткосрочной экономией и долгосрочным ростом рыночной доли. Стратегия действий: 1) провести декомпозицию целей (выручка, прибыль, узнаваемость бренда); 2) построить модель зависимости «затраты на маркетинг — выручка — прибыль» с учетом временного лага; 3) разработать поэтапный план: пилотный запуск с умеренным бюджетом, сбор данных о реакции рынка, корректировка стратегии на основе фактических результатов. Ключевой элемент — создание системы мониторинга ранних индикаторов (конверсия, охват, отзывы) для оперативной корректировки стратегии без риска потери бюджета.	
10	Дайте развернутый ответ на вопрос. Охарактеризуйте имитационное моделирование (метод Монте-Карло) как инструмент количественной оценки рисков инвестиционных проектов и раскройте последовательность его применения.		ПК-2
	Ответ:	Имитационное моделирование (Монте-Карло) — метод количественной оценки рисков, основанный на многократной генерации случайных значений факторов, влияющих на проект (например, цены, спроса, ставок), для построения распределения вероятностей результирующих показателей (NPV, IRR). Последовательность: 1) идентификация ключевых факторов неопределенности; 2) определение закона распределения вероятностей для каждого фактора; 3) многократный (тысячи раз) расчет проекта при случайных комбинациях факторов; 4) анализ полученного распределения — определение вероятности достижения целевых значений, квантилей, риска отклонений. Преимущество — учет корреляций между факторами и получение вероятностных оценок, а не точечных.	
11	Решите ситуационную задачу. В ходе реализации инвестиционного проекта выявлен риск срыва сроков поставки критического оборудования на 3 месяца, что приведет к переносу запуска производства и потере рыночной доли. Разработайте комплекс мероприятий по минимизации данного риска с использованием различных стратегий реагирования и экономическим обоснованием.		ПК-2
	Ответ:	Комплекс мероприятий: 1) уклонение — заключение контракта с неустойкой за просрочку с поставщиком-дублером (два поставщика с параллельной поставкой); 2) передача — страхование риска срыва сроков поставки оборудования с покрытием упущенной выгоды; 3) снижение — организация поэтапной приемки оборудования с промежуточным контролем качества на заводе-изготовителе, заблаговременная подготовка монтажной площадки; 4) принятие — создание резерва времени в календарном плане (3 месяца буфера) и финансового резерва. Экономическое обоснование: сопоставление затрат на мероприятия (оплата поставщику-дублеру 20% стоимости, страховка 5% стоимости) с прогнозируемыми потерями (снижение выручки на 30% за квартал). Приоритет — страхование и резервирование времени как наиболее экономически эффективные для данного риска.	

7.1. Уровни овладения

Компетенция: УК-1 Способен осуществлять критический анализ проблемных ситуаций на основе системного подхода, вырабатывать стратегию действий.

Индикатор достижения компетенции: УК-1.1 Осуществляет критический анализ проблемных ситуаций на основе системного подхода.

Уровень	Характеристика	Оценка в баллах
Повышенный	Достигнуто полное овладение знаниями, умениями и навыками. Студент свободно владеет терминологией, умеет применять теоретические знания в различных ситуациях для решения поставленных задач.	81-100
Базовый	Достигнуто достаточное овладение знаниями, умениями и навыками. Студент уверенно владеет терминологией, умеет применять теоретические знания в различных ситуациях для решения поставленных задач.	61-80
Пороговый	Достигнуто овладение минимально необходимыми знаниями, умениями и навыками. Студент владеет основной терминологией, умеет применять теоретические знания для решения поставленных задач в стандартных ситуациях.	41-60
Ниже порогового	Компетенция не освоена	0-40

Индикатор достижения компетенции: УК-1.2 Вырабатывает стратегию действий в проблемных ситуациях.

Уровень	Характеристика	Оценка в баллах
Повышенный	Достигнуто полное овладение знаниями, умениями и навыками. Студент свободно владеет терминологией, умеет применять теоретические знания в различных ситуациях для решения поставленных задач.	81-100
Базовый	Достигнуто достаточное овладение знаниями, умениями и навыками. Студент уверенно владеет терминологией, умеет применять теоретические знания в различных ситуациях для решения поставленных задач.	61-80
Пороговый	Достигнуто овладение минимально необходимыми знаниями, умениями и навыками. Студент владеет основной терминологией, умеет применять теоретические знания для решения поставленных задач в стандартных ситуациях.	41-60
Ниже порогового	Компетенция не освоена	0-40

Компетенция: ПК-2 Способен владеть методами аналитической работы в процессе управления рисками инвестиционных проектов.

Индикатор достижения компетенции: ПК-2.1 Идентифицирует, классифицирует и оценивает риски инвестиционного проекта на всех стадиях его жизненного цикла.

Уровень	Характеристика	Оценка в баллах
Повышенный	Достигнуто полное овладение знаниями, умениями и навыками. Студент свободно владеет терминологией, умеет применять теоретические знания в различных ситуациях для решения поставленных задач.	81-100

Базовый	Достигнуто достаточное овладение знаниями, умениями и навыками. Студент уверенно владеет терминологией, умеет применять теоретические знания в различных ситуациях для решения поставленных задач.	61-80
Пороговый	Достигнуто овладение минимально необходимыми знаниями, умениями и навыками. Студент владеет основной терминологией, умеет применять теоретические знания для решения поставленных задач в стандартных ситуациях.	41-60
Ниже порогового	Компетенция не освоена	0-40

Индикатор достижения компетенции: ПК-2.2 Разрабатывает мероприятия по минимизации выявленных рисков.

Уровень	Характеристика	Оценка в баллах
Повышенный	Достигнуто полное овладение знаниями, умениями и навыками. Студент свободно владеет терминологией, умеет применять теоретические знания в различных ситуациях для решения поставленных задач.	81-100
Базовый	Достигнуто достаточное овладение знаниями, умениями и навыками. Студент уверенно владеет терминологией, умеет применять теоретические знания в различных ситуациях для решения поставленных задач.	61-80
Пороговый	Достигнуто овладение минимально необходимыми знаниями, умениями и навыками. Студент владеет основной терминологией, умеет применять теоретические знания для решения поставленных задач в стандартных ситуациях.	41-60
Ниже порогового	Компетенция не освоена	0-40

8. Материально-техническое и учебно-методическое обеспечение дисциплины

8.1. Перечень основной и дополнительной учебной литературы

Основная литература

1. Трофимова, Л. А. Методы принятия управленческих решений: учебник и практикум для вузов / Л. А. Трофимова, В. В. Трофимов. - Москва: Юрайт, 2026. - 246 с - 978-5-534-21610-3. - Текст: электронный // ИКО Юрайт: [сайт]. - URL: <https://urait.ru/bcode/582593> (дата обращения: 21.05.2026). - Режим доступа: по подписке

Дополнительная литература

1. Воронов, М. В. Системы искусственного интеллекта: учебник и практикум для вузов / М. В. Воронов, В. И. Пименов, И. А. Небаев. - 2-е изд. - Москва: Юрайт, 2026. - 268 с - 978-5-534-17032-0. - Текст: электронный // ИКО Юрайт: [сайт]. - URL: <https://urait.ru/bcode/588642> (дата обращения: 21.05.2026). - Режим доступа: по подписке

2. Киселева, А. М. Публичные решения: учебник для вузов / А. М. Киселева. - 2-е изд. - Москва: Юрайт, 2026. - 170 с - 978-5-534-14349-2. - Текст: электронный // ИКО Юрайт: [сайт]. - URL: <https://urait.ru/bcode/588536> (дата обращения: 21.05.2026). - Режим доступа: по подписке

3. Прокофьев, С. Е. Теория и механизмы современного государственного и муниципального управления: учебник для вузов / С. Е. Прокофьев, С. Г. Еремин, А. И. Галкин. - 3-е изд. - Москва: Юрайт, 2026. - 692 с - 978-5-534-17620-9. - Текст: электронный // ИКО Юрайт: [сайт]. - URL: <https://urait.ru/bcode/588173> (дата обращения: 21.05.2026). - Режим доступа: по подписке

4. Васильев, В. П. Государственное регулирование экономики: учебник и практикум для вузов / В. П. Васильев. - 6-е изд. - Москва: Юрайт, 2026. - 178 с - 978-5-534-18711-3. - Текст: электронный // ИКО Юрайт: [сайт]. - URL: <https://urait.ru/bcode/584675> (дата обращения: 21.05.2026). - Режим доступа: по подписке

8.2. Профессиональные базы данных и ресурсы «Интернет», к которым обеспечивается доступ обучающихся

Профессиональные базы данных

1. <http://www.gov.ru/> - Профессиональная база данных «Информационные системы Министерства экономического развития Российской Федерации в сети Интернет» (Портал «Официальная Россия»)

2. <http://pravo.gov.ru/> - Государственная система правовой информации «Официальный интернет-портал правовой информации»

3. <https://minfin.gov.ru/> - Министерство финансов Российской Федерации (Минфин России)

4. <http://www.gks.ru/> - Профессиональная база данных «Официальная статистика» (Официальный сайт Федеральной службы государственной статистики)

Ресурсы «Интернет»

Не используются.

8.3. Программное обеспечение и информационно-справочные системы, используемые при осуществлении образовательного процесса по дисциплине

Перечень программного обеспечения

(обновление производится по мере появления новых версий программы)

1. Astra Linux Special Edition;

2. МойОфис Стандартный 2.;

Перечень информационно-справочных систем

(обновление выполняется еженедельно)

1. КонсультантПлюс;

2. Справочно-правовая система "Гарант-Максимум";

8.4. Специальные помещения, лаборатории и лабораторное оборудование

Учебные аудитории для проведения занятий лекционного типа	Комплекты ученической мебели Мультимедийный проектор Доска Экран
Учебные аудитории для проведения практических занятий (занятий семинарского типа)	Комплекты ученической мебели Мультимедийный проектор Доска Экран Компьютеры с выходом в сеть «Интернет» и ЭИОС СГ

Учебные аудитории для групповых и индивидуальных консультаций	Комплекты ученической мебели Мультимедийный проектор Доска Экран Компьютеры с выходом в сеть «Интернет» и ЭИОС СПб
Учебные аудитории для текущего контроля и промежуточной аттестации	Комплекты ученической мебели Мультимедийный проектор Доска Экран Компьютеры с выходом в сеть «Интернет» и ЭИОС СПб
Помещения для самостоятельной работы	Комплекты ученической мебели Мультимедийный проектор Доска Экран Компьютеры с выходом в сеть «Интернет» и ЭИОС СПб
Помещения для хранения и профилактического обслуживания оборудования	Комплекты специализированной мебели для хранения