

ФГБОУ ВО Новосибирский ГАУ

Кафедра Менеджмента

Рег. № ИИ-77.04-14ф
«30» мая 20 17 г.

УТВЕРЖДЕН

на заседании кафедры

Протокол от «03» мая 20 17 г. № 9
Заведующий кафедрой

А.Т. Стадник

(подпись)

**ФОНД
ОЦЕНОЧНЫХ СРЕДСТВ**

***Б1.В.ОД.8 Менеджмент инноваций и
риск-менеджмент***

по направлению подготовки

**23.04.03 Эксплуатация транспортно-технологических
машин и комплексов**

профиль: Автомобили и автомобильное хозяйство

Новосибирск 2017

Паспорт фонда оценочных средств

| № п/п | Контролируемые разделы (темы) дисциплины* | Код контролируемой компетенции (или ее части) | Наименование оценочного средства |
|---|---|---|--|
| I. Теоретические основы инновационного менеджмента | | | |
| 1.1 | Основы теории инноватики. Нововведения (инновации) как объект инновационного менеджмента | ОК-1, ОК-2 | Лекция визуализация, |
| 1.2 | Инновационная деятельность: сущность, цели, задачи | ОК-1, ОК-2 | Коллоквиум |
| II. Организация и управление инновационной деятельностью | | | |
| 2.1 | Инновационный процесс. Приемы инновационного менеджмента | ОК-1, ОК-2 | Доклад, вопросы для собеседования. |
| 2.2 | Инновационный менеджмент и стратегическое управление | ОК-1, ОК-2 | Доклад, вопросы для собеседования. Деловая игра |
| III. Теоретические основы риск-менеджмента | | | |
| 3.1 | Основные понятия и природа возникновения риска | ОК-1, ОК-2 | Коллоквиум |
| 3.2 | Методологические основы принятия риск-решений; методология адаптивного динамического управления рисками | ОК-1, ОК-2 | Тестирование. |
| Раздел IV. Управление рисками | | | |
| 4.1 | Основные приемы и этапы управления риском | ОК-1, ОК-2 | Творческое задание Тестирование. |
| 4.2 | Основные стратегические направления снижения риска | ОК-1, ОК-2 | Творческое задание Деловая игра |

*Наименование темы (раздела) или тем (разделов) берется из рабочей программы дисциплины.

МАТРИЦА СООТВЕТСТВИЯ КРИТЕРИЕВ ОЦЕНКИ УРОВНЮ СФОРМИРОВАННОСТИ КОМПЕТЕНЦИЙ

| Критерии оценки | Уровень сформированности компетенций |
|--|--------------------------------------|
| Оценка по пятибалльной системе | |
| «Отлично» | «Высокий уровень» |
| «Хорошо» | «Повышенный уровень» |
| «Удовлетворительно» | «Пороговый уровень» |
| «Неудовлетворительно» | «Не достаточный» |
| Оценка по системе «зачет – незачет» | |
| | |
| «Зачтено» | «Достаточный» |
| «Не зачтено» | «Не достаточный» |

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

1. Положение «О балльно-рейтинговой системе аттестации студентов»: СМК ПНД 08-01-2015, введено приказом от 28.09.2011 №371-О, утверждено ректором 12.10.2015 г. (<http://nsau.edu.ru/file/403>: режим доступа свободный);

2. Положение «О практике обучающихся, осваивающих основные профессиональные образовательные программы высшего образования в ФГБОУ ВО Новосибирский ГАУ»: СМК ПНД 95-01-2015, введено в действие приказом от 26.12.2015 №477-О; <http://nsau.edu.ru/file/126971>: режим доступа свободный).

**Темы докладов по дисциплине
«Менеджмент инноваций и риск-менеджмент»**

Тема 2.1. Инновационный процесс. Приемы инновационного менеджмента

1. Инновационный процесс: понятие и сущность.
2. Основные цели процесса инноваций.
3. Структура инновационного процесса (по содержанию работ).
4. Этапы инновационного процесса и их особенности от вида нововведений (инновация - продукт (услуга) или инновация – процесс).
5. Инновационные циклы и организация инновационной деятельности.
6. Функции инновационного процесса, их сущность и классификация: общие, специфические и вспомогательные.
7. Приемы инновационного менеджмента, воздействующие на производство инноваций: бенчмаркинг.
8. Приемы инновационного менеджмента, воздействующие на производство, реализацию, продвижение инноваций: инжиниринг.
9. Приемы инновационного менеджмента, воздействующие на производство, реализацию, продвижение инноваций: реинжиниринг.
10. Приемы инновационного менеджмента, воздействующие на производство, реализацию, продвижение инноваций: брэнд-стратегия.
11. Приемы инновационного менеджмента, воздействующие на реализацию и продвижение инноваций: мэрджер.
12. Инновационный прием, способствующий созданию высокоэффективных и конкурентоспособных организаций: аутсорсинг.

Темы докладов по дисциплине

Тема 2.2. Инновационный менеджмент и стратегическое управление

1. Особенности инновационного стратегического поведения организаций.
2. Стратегическая значимость нововведений.
3. Классификация ролевых стратегических функций организаций: виоленты, пациенты, эксплеренты, коммутанты.
4. Подходы к классификации инновационного стратегического поведения организаций. Понятие и сущность инновационной стратегии. Типы и виды инновационных стратегий.
5. Сущность стратегий НИОКР и стратегий внедрения и адаптации.
6. Варианты наступательных инновационных стратегий: стратегия активных НИОКР, ориентация на маркетинг, слияний и поглощений и др.

7. Варианты оборонительных инновационных стратегий: защитная, имитационная, выжидательная, непосредственного реагирования на запросы потребителей и др.
8. Общие принципы разработки инновационной стратегии.

Критерии оценки:

Преподаватель имеет право установить иную шкалу оценки для данного вида КИМ.

- оценка «отлично» выставляется студенту, при выполнении поставленной задачи с предоставлением доклада и ответом на дополнительные вопросы;
- оценка «хорошо» при выполнении поставленной задачи с докладом без ответов на дополнительные вопросы;
- оценка «удовлетворительно» при выполнении поставленной задачи без доклада;
- оценка «неудовлетворительно» при отсутствии выполненного задания.

Составитель _____ О.Г. Кабакова
«03» _____ 2017 г.

**Вопросы для коллоквиума по дисциплине
«Менеджмент инноваций и риск-менеджмент»**

Тема 1.2. Инновационная деятельность: сущность, цели, задачи

1. Понятие инновационной деятельности, ее направления и цели.
2. Содержание инновационной деятельности.
3. Инновационная сфера как система условий осуществления инновационной деятельности, ее назначение и основные элементы.
4. Рынок новаций (новшеств) его сущность и специфика.
5. Научно-исследовательская и научно-техническая деятельность, проектные и опытно-конструкторские разработки.
6. Интеллектуальный продукт и его виды. Правовая защита интеллектуальной собственности: авторское право, патентное право, товарный знак.
7. Участники рынка новаций.

3.1. Основные понятия и природа возникновения риска

1. Неопределенность и риск.
2. Классификация рисков. Понятие неопределенности. Причины неопределенности.
3. Роль науки в устранении неопределенности.
4. Субъективная оценка возможных исходов.
5. Оценочный подход к определению понятия "риск".
6. Субъективное и объективное в понимании риска.
7. Структура риска: причины, событие, последствия, факторы. Мера риска.
8. Информационный подход к определению понятия "риск".
9. Цели и принципы классификации рисков.
10. Классификации по характеристикам неопределенности, лежащей в основе риска.
11. Классификация по сфере возникновения неопределенности: природные риски, "человеческий фактор", технические риски, риски социума.

Критерии оценки:

Преподаватель имеет право установить иную шкалу оценивания для данного вида КИМ.

– оценка «отлично» выставляется студенту, при выполнении всех поставленных задач на 85-100%;

- оценка «хорошо» при выполнении всех поставленных задач на 68-84%;
- оценка «удовлетворительно» при выполнении всех поставленных задач на 50-67%;
- оценка «неудовлетворительно» при невыполнении поставленных задач менее чем на 50%.

Составитель _____ О.Г. Кабакова
« 03 » _____ 20 17 г.

**Темы групповых творческих заданий по дисциплине
«Менеджмент инноваций и риск-менеджмент»**

4.1 Основные приемы и этапы управления риском

4.2. Основные стратегические направления снижения риска

Раскрыть любой вопрос из предложенных тем. Составить граф (таблицу, схему, рисунок, график) к рассматриваемому вопросу.

1. Основные стратегические направления снижения риска; методы минимизации хозяйственных рисков.
2. Методы и модели управления рисками.
3. Методы и модели управления инвестиционными рисками.
4. Методы анализа и снижения «природных» рисков рынок альтернативных методов перевода риска; современные тенденции в управлении рисками; контроль процесса управления рисками
5. Методы оценки рисков.
6. Качественный; количественный; статистический; аналитический; экспертный; картографирование рисков.
7. Методы обработки рисков: измерение и оценивание рисков.
8. Системы риск-менеджмента.
9. Регулирование риска.
10. Организация управления рисками и планы финансирования рисков предприятий
11. Основные приемы и этапы управления риском; алгоритм управления; классификация методов управления рисками; критерий отбора и основное правило метода управления риском.

Критерии оценки:

Преподаватель имеет право установить иную шкалу оценивания для данного вида КИМ.

- оценка «отлично» выставляется студенту, при выполнении всех поставленных задач на 85-100%;
- оценка «хорошо» при выполнении всех поставленных задач на 68-84%;
- оценка «удовлетворительно» при выполнении всех поставленных задач на 50-67%;
- оценка «неудовлетворительно» при невыполнении поставленных задач менее чем на 50%.

Составитель _____ О.Г. Кабакова
«03» _____ 2014 г.

Фонд тестовых заданий

1. Инновация – это:

- а) введение в употребление товара, являющегося новым или значительно улучшенным по части его свойств или способов использования.
- б) секрет производства, сведение любого характера (изобретение, оригинальная технология, знание, умение и т. п.), которое охраняется режимом коммерческой тайны и может быть предметом купли-продажи.
- в) введение в употребление какого либо нового или значительно улучшенного продукта (товара или услуги) или процесса, нового метода маркетинга или нового организационного метода в деловой практике, организации рабочих мест и т.д.

2. В изобретательской практике результат научно-исследовательских работ может быть представлен в виде:

- а) макета.
- б) модели.
- в) экспериментального (опытного) образца.

3. Рекламное мероприятие, включающее в себя демонстрацию товара, сопровождаемое кино-, видеофильмами, слайдами, а также раздачей информационно-рекламных материалов – это:

- а) выставка.
- б) ярмарка.
- в) презентация.

4. Технологический форсайт – это:

- а) экспертный метод оценки долгосрочных перспектив развития технологий, выраженный в построении дорожной карты.
- б) метод прогнозирования будущего, в том числе путем экстраполяции существующих технологических, экономических или социальных тенденций.
- в) метод обнаружения перспектив научного поиска в точках междисциплинарных исследований, выраженный через карту научных знаний.

5. Назовите этапы развития технологической платформы:

- а) Зарождение → Рост → Специализация → Равновесие.
- б) Начало → Развитие → Специализация → Спад.
- в) Начало → Рост → Специализация → Равновесие.

6. Внедрение нового организационного метода (процесса) в деловой практике предприятия, в организации рабочих мест или внешних связей – это:

- а) процессная инновация.
- б) организационная инновация.
- в) маркетинговая инновация.

7. Инновационный менеджмент – это:

- а) управление процессом превращения новых идей в коммерчески результативные продукты и процессы.
- б) процесс последовательного превращения идеи в товар.
- в) процесс контроля за инновационными разработками.

8. Производственный этап инновационного процесса – это:

- а) процесс выработки новых решений в отношении существующих проблем или сложностей существования человека, социума или организации.
- б) комплекс работ по исследованию и превращению идеи в изобретение, оформленное в конструкционных чертежах.
- в) процесс освоения инвестиций, направленных на формирование основных производственных фондов реализации технологии или тиражирования продукции.

9. Какой потребительский сегмент составляет большую долю (с точки зрения predisposition к принятию инноваций) на рынке инноваций:

- а) Раннее большинство и Позднее большинство.
- б) Раннее большинство.
- в) Позднее большинство.

10. Организация, созданная инноватором для реализации единичного инновационного проекта с целью капитализации объектов интеллектуальной собственности – это:

- а) малое инновационное предприятие.
- б) единичное инновационное предприятие.
- в) научно-исследовательская организация.

11. Организация, деятельность которой направлена на поддержку малого инновационного предпринимательства за счет предоставления централизованного ресурса для реализации хозяйственной деятельности (аренда помещений, консультации в области инновационного предпринимательства, бухгалтерский учет и т.д.) – это:

- а) бизнес-инкубатор.
- б) технопарк.
- в) инновационный кластер.

12. Какова инновационная активность (доля организаций, осуществляющих инновации) национальной инновационной сферы в РФ?

- а) 10%.
- б) 90%.
- в) 100%.

Критерии оценки:

Преподаватель имеет право установить иную шкалу оценивания для данного вида КИМ.

- оценка «отлично» выставляется студенту, при выполнении всех поставленных задач на 85-100%;
- оценка «хорошо» при выполнении всех поставленных задач на 68-84%;
- оценка «удовлетворительно» при выполнении всех поставленных задач на 50-67%;
- оценка «неудовлетворительно» при невыполнении поставленных задач менее чем на 50%.

Составитель _____ О.Г. Кабакова
«03» _____ 2014 г.

**Деловая (ролевая) игра
по дисциплине «Менеджмент инноваций и риск-менеджмент»**

**2.2. Инновационный менеджмент и стратегическое управление
«Оценка жизненного цикла инновационного продукта»**

Концепция игры: интеграция теоретических знаний, полученных студентами, в системные практические знания; вовлечение студентов в инновационную деятельность, обобщающую их представления о профессии и прививающую интерес к решению сложных задач коллективом единомышленников. В результате формируются навыки междисциплинарного подхода к управленческим задачам, создается мощный мотивационный и интеллектуальный импульс к ускоренному профессиональному становлению.

Деловая игра является методом активного обучения и включает дискуссию, мозговой штурм, анализ конкретных ситуаций.

3 Роли:

- коммерческий директор гипермаркета;
- покупатель в возрасте до 30 лет;
- покупатель в возрасте от 30 до 60 лет;
- покупатель в возрасте старше 60 лет;
- индивидуальный предприниматель – владелец магазина формата «Магазин у дома».

4 Ожидаемый результат Ожидаемый результат: формирование грамотного управленческого подхода к организации инновационного процесса в торговом предприятии, позволяющей повысить конкурентоспособность и эффективность коммерческой деятельности.

Критерии оценки:

Преподаватель имеет право установить иную шкалу оценивания для данного вида КИМ.

- оценка «отлично» выставляется студенту, при выполнении всех поставленных задач на 85-100%;;
- оценка «хорошо» при выполнении всех поставленных задач на 68-84%;
- оценка «удовлетворительно» выполнении всех поставленных задач на 50-67%;
- оценка «неудовлетворительно» при невыполнении поставленных задач менее чем на 50%.

Составитель _____ О.Г. Кабакова
« 03 » _____ 20 17 г.

Деловая (ролевая) игра
по дисциплине «Менеджмент инноваций и риск-менеджмент»

4.2. Основные стратегические направления снижения риска

Концепция игры – преподаватель предлагает принять решение в конкретных ситуациях: Определить какой риск в каждой из ситуаций: качественный; количественный; статистический; аналитический; экспертный.

Ситуация 1

Неэффективная система управления предприятием привела к тому, что оно оказалось на грани банкротства. На складе скопилось значительное количество нераспроданной продукции. Изделия, производимые предприятием, уступают по качеству аналогичным изделиям конкурентов и теряют рынки сбыта, часть работников предприятия увольняется. С чего Вы начнете, если Вас назначат директором этого предприятия?

3. Роли:

- директор предприятия;
- эксперты: (3 студента и преподаватель);

4. Ожидаемый (е) результат (ы): предложения по решению проблемы

Ситуация 2

Крупной европейской фармацевтической компании необходимо принять решение о выборе дальнейшей стратегии развития. Возможно принятие трех принципиально разных альтернативных вариантов решения этой важной управленческой проблемы.

Первый вариант. Цель компании – получение максимально возможной прибыли в возможно более короткие сроки. Для этого на четверть урезается программа по созданию новых качественных видов продукции и на 30% сокращаются расходы на маркетинговое обеспечение торговых операций.

Второй вариант. Компания ставит перед собой цель обеспечить устойчивое положение в будущем. Для этого основные усилия сосредотачиваются на проведении НИОКР по повышению качества новых конкурентоспособных видов продукции.

Третий вариант. Целью компании является сочетание обеспеченности рентабельности производства в настоящее время со значительными расходами на повышение качества для создания продукции, конкурентоспособной на рынках сбыта. Проанализируйте возможные стратегические направления развития фармацевтической компании.

Какой из трех альтернативных вариантов Вы считаете наиболее приемлемым?

3 Роли:

- директор предприятия;
- эксперты: (3 студента и преподаватель);

4 Ожидаемый (е) результат (ы): предложения по решению проблемы

Критерии оценки:

Преподаватель имеет право установить иную шкалу оценивания для данного вида КИМ.

Критерии оценки:

- оценка «отлично» выставляется студенту, при выполнении всех поставленных задач на 85-100%;
- оценка «хорошо» при выполнении всех поставленных задач на 68-84%;
- оценка «удовлетворительно» при выполнении всех поставленных задач на 50-67%;
- оценка «неудовлетворительно» при невыполнении поставленных задач менее чем на 50%.

Составитель _____ О.Г. Кабакова
« 03 » _____ 20 17 г.

**Вопросы для подготовки к зачету
по дисциплине «Менеджмент инноваций и риск-менеджмент»**

1. Дать определение инновации новшества и нововведения.
2. Инновация – продукт, инновация – процесс, инновация – сервис.
3. Дать определение инновационного лага.
4. Инновационный менеджмент: определение, цели, особенности.
5. Классификация инноваций.
6. Объект инновационного менеджмента.
7. Стадии создания и коммерциализации новшеств.
8. Инновационный процесс и его особенности.
9. Факторы инновационного процесса (инновационный потенциал, направление инновационной деятельности, скорость внедрения инноваций, маркетинговая стратегия).
10. Формы инновационного процесса: внутриорганизационный, межорганизационный, расширенный.
11. Управление проектами (дать определение).
12. Жизненный цикл инновации (новшества) и его этапы.
13. Субъекты инновационной деятельности: новатор, инноватор, инвестор.
14. Инновационный проект и его классификация.
15. Инновационный маркетинг и его основные направления.
16. Типовые группы потребителей и их характеристика.
17. Основные типы инновационных систем.
18. Лицензия и лицензионное соглашение: суть и виды.
19. Авторские и смежные права (отличия и совпадения).
20. Товарный знак и его предназначение.
21. Интеллектуальная собственность и интеллектуальный продукт.
22. Патент и объекты патентного права.
23. Смежные права и его субъекты.
24. Виды цен на инновационную продукцию (перечислить и охарактеризовать).
25. Факторы, влияющие на цену инновационного продукта.
26. Виды договорных цен на инновационную продукцию.
27. Понятие инновационного риска.
28. Виды рисков в инновационной деятельности.
29. Виды источников финансирования инновационных процессов.
30. Госбюджетное финансирование инновационной деятельности.
31. Внебюджетное финансирование инновационной деятельности.
32. Финансирование за счет собственных средств.
33. Бизнес – инкубатор, технопарк: функции, классификация.
34. Научно – технические кадры (персонал) и их характеристика.
35. Охарактеризуйте взаимосвязь понятий неопределенности и риска.
36. Назовите основные причины, порождающие неопределенность.

37. Понятийный аппарат управления рисками
38. Цели и задачи управления рисками
39. Обоснуйте связь риск-менеджмента с функциональными службами.
40. Раскройте особенности работы с персоналом фирмы с целью недопущения кадрового риска.
41. Охарактеризуйте основные внутрифирменные источники снижения риска
42. Характеристика рисков в различных сферах предпринимательской деятельности
43. Основные принципы управления риском.
44. Количественная оценка риска и анализ риска.
45. Управление рисками в производственном комплексе
46. Методы управления финансовыми рисками
47. Управление риском в банковской системе
48. Инвестиционный менеджмент и риск
49. Методы оценки регионального инвестиционного риска
50. Охарактеризуйте метод поэтапной оценки риска.
51. Покажите особенности формирования вопросов и составления анкет при экспертном методе анализа риска.
52. Теоретические аспекты риск-менеджмента.
53. Принятие решений в условиях риска
54. Риск-менеджмент в страховании
55. Управление рисками и антикризисное управление.
56. Методы снижения степени риска
57. Управление риском методом «причины-факторы-противорисковые мероприятия»
58. Экономическая эффективность управления рисками

Составитель _____ О.Г. Кабакова
«03» _____ 20 14 г.

Варианты выполнения реферата по дисциплине «Менеджмент инноваций и риск-менеджмент»

Номер варианта работы определяется в зависимости от начальной буквы фамилии студента (см. табл. 1).

Т а б л и ц а 1 – Варианты реферата

| Начальная буква фамилии | Вариант | Начальная буква фамилии | Вариант |
|----------------------------|---------|----------------------------|---------|
| А | 1 | З, Х | 9 |
| Б, Р | 2 | И, Ц | 10 |
| В, С | 3 | К, Ч | 11 |
| Г, Т | 4 | Ш, Щ | 12 |
| Д, У | 5 | М, Э | 13 |
| Е, Ё | 6 | Н, Ю | 14 |
| Ж, Ф | 7 | О, Я | 15 |
| П | 8 | Л | 16 |

Вариант 1

Введение.

1. Основная часть.

1.1. Основные понятия теории инноватики и ее современные концепции.

1.3. Длинные волны Н.Д. Кондратьева. Технологические уклады

1.2. Число наступивших в рассматриваемом интервале времени негативных событий (рисков) составило 22, число негативных событий, наступление которых было предсказано, составило 18. Величина предсказанных негативных событий из числа наступивших составляет 16. Определить оправдываемость и предсказуемость прогноза рисков, а также ошибки 1-го и 2-го рода (представить графически).

Заключение.

Список литературы.

Вариант 2

Введение.

1. Основная часть.

1.1. Модели инновационного процесса. Стадии жизненного цикла нововведений

1.2. Консалтинговые услуги в инновационной деятельности

1.3. Число наступивших в рассматриваемом интервале времени негативных событий (рисков) составило 85, число негативных событий, наступление которых было предсказано, составило 63. Величина предсказанных негативных событий из числа наступивших составляет 25. Определить оправдываемость и предсказуемость прогноза рисков, а также ошибки 1-го и 2-го рода (представить графически).

Заключение.

Список литературы.

Вариант 3

Введение.

1. Основная часть.

1.1. Классификации инноваций и ее значение

1.2. Структура и использование классификатора в управлении инновациями

1.3. Число наступивших в рассматриваемом интервале времени негативных событий (рисков) составило 64, число негативных событий, наступление которых было предсказано, составило 90. Величина предсказанных негативных событий из числа наступивших составляет 90. Величина предсказанных негативных событий из числа наступивших составляет 90.

ших составляет 37. Определить оправдываемость и предсказуемость прогноза рисков, а также ошибки 1-го и 2-го рода (представить графически).

Заключение.

Список литературы.

. Вариант 4

Введение.

1. Основная часть.

1.1. Инновационный менеджмент и стратегическое управление

1.2. Понятия, виды и особенности инновационных стратегий

1.3. Число наступивших в рассматриваемом интервале времени негативных событий (рисков) составило 34, число негативных событий, наступление которых было предсказано, составило 24. Величина предсказанных негативных событий из числа наступивших составляет 20. Определить оправдываемость и предсказуемость прогноза рисков, а также ошибки 1-го и 2-го рода (представить графически).

Заключение.

Список литературы.

Вариант 5

Введение.

1. Основная часть.

1.1. Концепция проектирования инновационных преобразований

1.2. Реинжиниринг и инновационные бизнес-процессы.

1.3. Число наступивших в рассматриваемом интервале времени негативных событий (рисков) составило 68, число негативных событий, наступление которых было предсказано, составило 40. Величина предсказанных негативных событий из числа наступивших составляет 33. Определить оправдываемость и предсказуемость прогноза рисков, а также ошибки 1-го и 2-го рода (представить графически).

Заключение.

Список литературы.

Вариант 6

Введение.

1. Основная часть.

1.1. Формирование инновационных подразделений

1.2. Формы малого инновационного бизнеса.

1.3 Число наступивших в рассматриваемом интервале времени негативных событий (рисков) составило 64, число негативных событий, наступление которых было предсказано, составило 90. Величина предсказанных негативных событий из числа наступивших составляет 37. Определить оправдываемость и предсказуемость прогноза рисков, а также ошибки 1-го и 2-го рода (представить графически)

Заключение.

Список литературы.

Вариант 7

Введение.

1. Основная часть.

1.1. Инвестиционная привлекательность проектов и программ в инновационной деятельности.

1.2. Обоснование экономической эффективности проекта

1.3. Число наступивших в рассматриваемом интервале времени негативных событий (рисков) составило 64, число негативных событий, наступление которых было предсказано, составило 90. Величина предсказанных негативных событий из числа наступивших составляет 37. Определить оправдываемость и предсказуемость прогноза рисков, а также ошибки 1-го и 2-го рода (представить графически).

Заключение.

Список литературы.

Вариант 8

Введение.

1. Основная часть.

1.1. Классификация рыночных рисков.

1.2 Классический анализ кредитоспособности заемщика.

1.3 Число наступивших в рассматриваемом интервале времени негативных событий (рисков) составило 85, число негативных событий, наступление которых было предсказано, составило 63. Величина предсказанных негативных событий из числа наступивших составляет 25. Определить оправдываемость и предсказуемость прогноза рисков, а также ошибки 1-го и 2-го рода (представить графически).

Заключение.

Список литературы.

Вариант 9

Введение.

1. Основная часть.

1.1. Развитие теории рисков в историческом аспекте.

1.2. Управление налоговыми рисками.

1.3. Число наступивших в рассматриваемом интервале времени негативных событий (рисков) составило 64, число негативных событий, наступление которых было предсказано, составило 90. Величина предсказанных негативных событий из числа наступивших составляет 37. Определить оправдываемость и предсказуемость прогноза рисков, а также ошибки 1-го и 2-го рода (представить графически).

Заключение.

Список литературы.

Вариант 10

Введение.

1. Основная часть.

1.1. Идентификация, оценка и прогноз риска.

1.2. Модель оценки капитальных активов (CAPM).

1.3. Число наступивших в рассматриваемом интервале времени негативных событий (рисков) составило 28, число негативных событий, наступление которых было предсказано, составило 20. Величина предсказанных негативных событий из числа наступивших составляет 17. Определить оправдываемость и предсказуемость прогноза рисков, а также ошибки 1-го и 2-го рода (представить графически).

Заключение.

Список литературы.

Вариант 11

Введение.

1. Основная часть.

1.1. Показатели кредитного риска. Кредитное событие.

1.2. Концепция экономической добавленной стоимости (EVA).

1.3. Число наступивших в рассматриваемом интервале времени негативных событий (рисков) составило 45, число негативных событий, наступление которых было предсказано, составило 67. Величина предсказанных негативных событий из числа наступивших составляет 40. Определить оправдываемость и предсказуемость прогноза рисков, а также ошибки 1-го и 2-го рода (представить графически).

Заключение.

Список литературы.

Вариант 12

Введение.

1. Основная часть.

1.1. Понятие операционного риска. Классификация операционных рисков.

1.2. Понятие и виды стресс-тестирования. Требования регулирующих органов к проведению стресс-тестирования.

1.3. Число наступивших в рассматриваемом интервале времени негативных событий (рисков) составило 68, число негативных событий, наступление которых было предсказано, составило 40. Величина предсказанных негативных событий из числа наступивших составляет 33. Определить оправдываемость и предсказуемость прогноза рисков, а также ошибки 1-го и 2-го рода (представить графически).

Заключение.

Список литературы.

Вариант 13

Введение.

1. Основная часть.

1.1. Понятие макропруденциальных индикаторов. Основные макропруденциальные индикаторы.

1.2. Скорректированная на риск рентабельность капитала (RAROC).

1.3. Число наступивших в рассматриваемом интервале времени негативных событий (рисков) составило 101, число негативных событий, наступление которых было предсказано, составило 65. Величина предсказанных негативных событий из числа наступивших составляет 61. Определить оправдываемость и предсказуемость прогноза рисков, а также ошибки 1-го и 2-го рода (представить графически).

Заключение.

Список литературы.

Вариант 14

Введение.

1. Основная часть.

1.1. Факторы, обуславливающие повышение роли теории рисков в современном мире.

1.2. Концепция стоимостной меры риска (VaR).

1.3. Число наступивших в рассматриваемом интервале времени негативных событий (рисков) составило 57, число негативных событий, наступление которых было предсказано, составило 34. Величина предсказанных негативных событий из числа наступивших составляет 20. Определить оправдываемость и предсказуемость прогноза рисков, а также ошибки 1-го и 2-го рода (представить графически).

Заключение.

Список литературы.

Вариант 15

Введение.

1. Основная часть.

1.1. Методы прогноза риска. Показатели достоверности прогноза.

1.2. Портфельный подход к системе управления рисками. Тактический и стратегический риск-менеджмент.

1.3. Число наступивших в рассматриваемом интервале времени негативных событий (рисков) составило 15, число негативных событий, наступление которых было предсказано, составило 27. Величина предсказанных негативных событий из числа наступивших составляет 13. Определить оправдываемость и предсказуемость прогноза рисков, а также ошибки 1-го и 2-го рода (представить графически).

Заключение.
Список литературы.

Вариант 16

Введение.

1. Основная часть.

1.1. Методы оценки и управления операционным риском.

1.2. Понятие юридического риска. Управление юридическими рисками.

1.3. Число наступивших в рассматриваемом интервале времени негативных событий (рисков) составило 99, число негативных событий, наступление которых было предсказано, составило 103. Величина предсказанных негативных событий из числа наступивших составляет 88. Определить оправдываемость и предсказуемость прогноза рисков, а также ошибки 1-го и 2-го рода (представить графически).

Заключение.

Список литературы.

Составитель _____ О.Г. Кабакова
« 03 » _____ 20 17 г.