

Документ подписан простой электронной подписью
Информация о владельце:
ФИО: Косенок Сергей Михайлович
Должность: ректор
Дата подписания: 18.06.2024 14:49:45
Уникальный программный ключ:
e3a68f3eaa1e62674b54f49980e171c6f1d1f876

Оценочные материалы для текущего контроля и промежуточной аттестации по дисциплине

Финансовое сопровождение современных методов управления

Код, направление подготовки	38.04.08 Финансы и кредит
Направленность (профиль)	Финансы и кредит
Форма обучения	Очная
Кафедра-разработчик	Финансов, денежного обращения и кредита
Выпускающая кафедра	Финансов, денежного обращения и кредита

Типовые задания для контрольной работы

Задача 1. Провести сопоставительный анализ методов управления финансами в подразделениях образовательных, медицинских учреждений ХМАО и в подразделениях крупных нефтегазодобывающих компаний. Заполнить таблицу 1.

Таблица 1

№	Методы управления финансами	Образовательные учреждения	Медицинские учреждения	Подразделениях крупных нефтегазодобывающих компаний
1	Административные методы управления			
2	Организационные методы управления			
3	Проектные методы управления			
4	Программно-целевые методы управления			
5	Финансовый риск-менеджмент			
6	Бюджетирование			

Задача 2. Обосновать особенности и различия применения методов.

Задача 3. Провести сопоставительный анализ методов управления финансами в подразделениях финансово-кредитных организаций и подразделениях органов государственной власти и органов местного самоуправления.

Задача 4. Обосновать особенности и различия применения методов.

Задача 5. В таблице 1 приведены распределение вероятностей будущего состояния экономики и нормы возможной доходности стратегий. Построить график распределение вероятностей и нормы возможной доходности для стратегии 1 и 2.

Таблица 1

Распределение вероятностей будущего состояния экономики и нормы возможной доходности стратегий

Состояние экономики	Вероятность данного состояния (p_i)	Стратегия 1 (PF_i)	Стратегия 2 (PF_i)
Экономический подъем	0,2	30%	115%
Стабильное состояние	0,6	20%	80%
Экономический спад	0,2	10%	45%

Задача 6. Рассчитать для двух стратегий ожидаемую норму доходности (PFR), среднее квадратическое отклонение (δ) и коэффициент вариации (CV).

Задача 7. Провести оценку полноты и достоверности информации, приведенной в описании проекта (проект выбирается из готовых проектов, предлагаемых в сети интернет).

Задача 8. Подготовить экспертное заключение о целесообразности реализации проекта. Заполнить таблицу.

Экспертное заключение

Критерии оценки	Тематика вопроса	Оценка в зависимости от ответа				Оценка проекта
		«отлично» (5 баллов)	«хорошо» (4 балла)	«удовлетворительно» (2 балла)	«плохо» (1 балл)	
1	2	3	4	5	6	7
1. Рынок						
2. Конкурентные преимущества продукта						
Итого баллов						

Задача 9. Провести финансовый анализ проекта, заполнить таблицу.

Показатели эффективности инвестиционных затрат

Наименование показателя	Величина
Коэффициент эффективности инвестиций ARR	
Срок окупаемости инвестиций PP	

Чистая текущая стоимость NPV	
Индекс рентабельности PI	
Внутренняя норма доходности (IRR)	
Средневзвешенная стоимость капитала (WACC)	

Задача 10. Провести исторический анализ применения программно-целевых методов территориального управления в СССР. 1920 г. – план ГОЭЛРО, 1930 г. – «Урало-Кузнецкий комбинат», 1932 г. – Большая Волга, 1939 г. – «Второе Баку».

Задача 11. Провести исторический анализ применения программно-целевых методов территориального управления в США. «Программа развития долины Теннесси», программа развития района Аппалачских гор, программа «Апполон».

Задача 12. Известно, что при вложении капитала в мероприятие А из 120 случаев:

- прибыль 25 тыс.руб. была получена в 48 случаях,
- прибыль 20 тыс.руб. была получена в 36 случаях,
- прибыль 30 тыс.руб. была получена в 36 случаях.

При вложении капитала в мероприятие Б:

- прибыль 40 тыс.руб. была получена в 36 случаях,
- прибыль 30 тыс.руб. была получена в 60 случаях,
- прибыль 15 тыс.руб. была получена в 24 случаях.

Определить степень риска при вложении капитала в мероприятия А и Б.

Задача 13. Пожаром 15 июня в универмаге повреждены товары. На последнюю отчетную дату 10 июня в магазине имелось товаров на сумму 508000 тыс. руб. С 10 по 15 июня поступило товаров на сумму 152000 тыс. руб. Сданная выручка за тот же период – 146000 тыс. руб. Сумма несданной выручки – 3000 тыс. руб. Естественная убыль товаров, исчисленная с их оборота за межинвентаризационный период – 1000 тыс. руб.

По бухгалтерскому балансу страхователя средний размер скидок на остаток товаров – 5 %, а издержек обращения – 2 %. После пожара спасенных товаров учтено: неповрежденных – 260000 тыс. руб., поврежденных с учетом их обесценивания и приведения в порядок – 45000 тыс. руб. и остатков от погибших товаров – 5000 тыс. руб.

Определить сумму ущерба.

Задача 14. Укажите основные параметры, определяющие валютную позицию (соотношение требований и обязательств по валюте у оператора валютного рынка) банка.

Задача 15.

1. Имеются два инвестиционных проекта. Первый с вероятностью 0,6 обеспечивает прибыль 15 млн руб., однако с вероятностью 0,4 можно потерять 5,5 млн руб. Для второго проекта с вероятностью 0,8 можно получить прибыль 10 млн руб. и с вероятностью 0,2 потерять 6 млн руб. Какой проект выбрать?

2. Фирма изготавливает железобетонные панели, используя в качестве основного сырья цемент. В связи с неопределенным спросом на изделия потребность в сырье в течение месяца также не определена. Цемент поставляется в мешках, причем известно, что потребность может составлять D_1, D_2, \dots, D_n мешков. Резервы сырья на складе могут составлять R_1, R_2, \dots, R_n мешков в месяц. Учитывая, что удельные затраты на хранение сырья равны c_1 а

удельные издержки дефицитности сырья (потери, связанные с отсутствием необходимого количества цемента на складе) равны c_2 , определить оптимальную стратегию финансирования закупок цемента.

Рассмотреть частный случай: $n = 5, c_1 = 5, c_2 = 3$;

$D = (1\ 500, 2\ 000, 2\ 500, 3\ 500, 4\ 000), R = (1\ 500, 2\ 000, 2\ 500, 3\ 500, 4\ 000)$.

Задача 16.

1. Необходимо закупить уголь для обогрева школы. Количество хранимого угля ограничено и в течение холодного периода должно быть полностью израсходовано. Предполагается, что неизрасходованный зимой уголь в лето пропадает. Покупать уголь можно в любое время, однако летом он дешевле, чем зимой. Неопределенность состоит в том, что не известно, какой будет зима: суровой, тогда придется докупать уголь, или мягкой, тогда часть угля может остаться неиспользованной. Данные о количестве угля, необходимого зимой для отопления школы: 4 т, 5 т и 6 т соответственно в мягкую, обычную и холодную зиму. Цены на уголь взять у поставщиков. Вероятности зим: мягкой - 0,35; обычной - 0,5; холодной - 0,15.

2. Мелкий бизнесмен сталкивается с ситуацией, когда с вероятностью 10 % пожар может уничтожить все его имущество, с вероятностью 10 % - уменьшить его недвижимость до 500 тыс. руб., с вероятностью 80 % огонь не принесет ему вреда и стоимость его имущества останется равной 1000 тыс. руб. Какую максимальную сумму он готов заплатить за страховку, если его функция полезности имеет логарифмический вид $U(W) = \ln(W)$, а страховые выплаты составляют 1000 тыс. руб. для первого случая и 500 тыс. руб. для второго случая?

Задача 17.

1. При крупном автомобильном магазине планируется открыть мастерскую по предпродажному обслуживанию и гарантийному ремонту автомобилей. Консультационная фирма готова предоставить дополнительную информацию о том, будет ли рынок благоприятным или нет. Эти сведения обойдутся магазину в 13 тыс. руб. Администрация магазина считает, что эта информация гарантирует благоприятный рынок с вероятностью 0,5. Если рынок будет благоприятным, то большая мастерская принесет прибыль в 60 тыс. руб., а маленькая - 30 тыс. руб. При неблагоприятном рынке магазин потеряет 65 тыс. руб., если будет открыта большая мастерская, и 30 тыс. руб. - если откроется маленькая. Не имея дополнительной информации, директор оценивает вероятность благоприятного рынка как 0,6. Положительный результат обследования гарантирует благоприятный рынок с вероятностью 0,8. При отрицательном результате рынок может оказаться благоприятным с вероятностью 0,3. Постройте дерево решений и определите:

- Следует ли заказать консультационной фирме дополнительную информацию, уточняющую конъюнктуру рынка?
- Какую мастерскую следует открыть при магазине: большую или маленькую?
- Какова ожидаемая денежная оценка наилучшего решения?
- Какова ожидаемая ценность дополнительной информации?

2. Разведка недр в регионе показала наличие месторождений нефти. Требуется решить, разрабатывать месторождение, т. е. инвестировать бурение скважин (a_1), или воздержаться (a_2). Таким образом, множество решений $A = \{a_1, a_2\}$. Проведенные геологические исследования позволили открыть месторождение, но не дали ответа, бурить или не бурить скважины. Какую дополнительную информацию необходимо получить для принятия решения?

1. Особенности организации финансов при реализации административно-организационных методов управления в учреждениях и организациях органов государственной власти.
2. Основные факторы неопределенности, влияющие на принятие финансовых решений в учреждениях и организациях органов местного самоуправления.
3. Особенности организации финансов при реализации экономических методов управления в учреждениях и организациях местного самоуправления.
4. Методы принятия финансовых решений в условиях конфликта интересов.
5. Приемы финансового обеспечения административно-организационных методов управления в подразделениях крупных нефтегазодобывающих компаний.
6. Отличие задачи принятия решения в условиях конфликта от задачи принятия решения в условиях неопределенности и риска.
7. Особенности организации финансов в подразделениях неправительственных и международных организаций.
8. Оценка социально-экономических последствий финансовых решений при реализации программно-целевых методов территориального управления.
9. Технологии финансового обеспечения проектных методов управления в образовании и здравоохранении.
10. Особенности организации финансов в подразделениях кредитных организаций.
11. Основные факторы возникновения кредитных рисков.
12. Методы минимизации влияния рисков на финансовую устойчивость кредитных организаций.
13. Модели оценки кредитного риска портфеля.
14. Административно-организационные методы в управлении финансовыми службами.
15. Особенности организации финансов при реализации проектных методов управления в учреждениях и организациях местного самоуправления.
16. Программно-целевой метод как инструмент формирования бюджета, ориентированного на результат в организациях местного самоуправления.
17. Финансовая составляющая эффективного контракта в организациях образования и здравоохранения.
18. Показатели риска финансовой деятельности малого предприятия.
19. Принципы организации временных творческих коллективов для разработки финансовых аспектов новых проектных решений.
20. Роль кредитного рейтинга в принятии решения о заимствовании.
21. Финансовое проектирование, регламентирование и нормирование в организациях и учреждениях органов государственной власти и местного самоуправления.
22. Критерии принятия решений в условиях риска, неопределенности и конфликтных ситуациях.
23. Экономические методы в управлении финансовыми службами.
24. Сочетание административных и экономических методов управления при разработке финансовых аспектов новых проектных решений.