

ФЕДЕРАЛЬНОЕ ГОСУДАРСТВЕННОЕ БЮДЖЕТНОЕ ОБРАЗОВАТЕЛЬНОЕ УЧРЕЖДЕНИЕ ВЫСШЕГО
ОБРАЗОВАНИЯ «ВСЕРОССИЙСКАЯ АКАДЕМИЯ ВНЕШНЕЙ ТОРГОВЛИ»
МИНИСТЕРСТВА ЭКОНОМИЧЕСКОГО РАЗВИТИЯ РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ»

КОНТРОЛЬНО-ОЦЕНОЧНЫЕ МАТЕРИАЛЫ

Б1.В.ДВ.01.01 «Риск-менеджмент»

Уровень высшего образования

Магистратура

Направление подготовки

09.04.02 «Информационные системы и технологии»

Направленность (профиль)

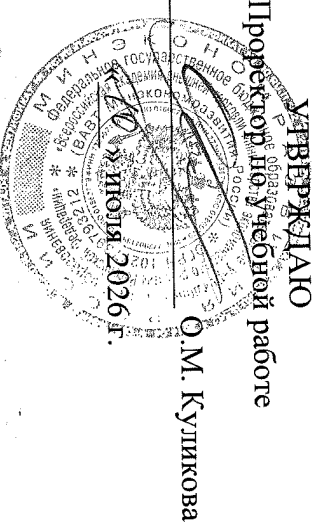
«Информационные системы в экономике и управлении»

Квалификация – Магистр

Форма обучения – очная

Москва, 2026

УТВЕРЖДАЮ
Проректор по учебной работе
О.М. Куликова
«10» июля 2026 г.



Учебный план

Курс	Семестр	Трудоемкость, зет.	Академ. часы				Форма промежуточной аттестации
			Всего	Лекции	Практ занятия	Сам. работа	
2	3	4	30	6	24	114	Диф. зачет

Проверяемые компетенции: УК-2, ПК-4

Максимальная итоговая сумма баллов, по которой может быть оценен уровень освоения изучаемой учебной дисциплины за семестр (далее – максимальная итоговая сумма баллов по дисциплине за семестр), не может превышать 100 баллов, которые включают оценку работы обучающегося в течение семестра и оценку, полученную на зачете / экзамене¹.

Оценка работы обучающегося в течение семестра составляет в сумме до 50 баллов. Структура оценки работы обучающегося в течение семестра включает отдельные баллы, начисляемые за:

- текущий контроль (выполнение тестов, контрольных работ, домашних заданий, подготовку презентаций, сдачу коллоквиумов, реферативный обзор дополнительного материала по теме и др.);
- работу на занятиях семинарского типа (выступления на занятиях, ответы на вопросы и др.);
- посещаемость занятий лекционного и семинарского типов.
- тестирование: количество баллов от количества правильных ответов.

Допускается проставление дополнительных «премиальных» баллов за отличную работу в семестре до 5 баллов. В таком случае, максимальное количество баллов за работу в семестре может быть увеличено до 55 баллов.

Критерии оценивания по мероприятиям текущего контроля и промежуточной аттестации прописываются подробно в рабочей программе учебной дисциплины.

Критерии оценки на зачете / экзамене/дифференцированном зачете:

Оценка знаний, выявленных в ходе зачета / экзамена, составляет до 60 баллов.

Для выявления знаний по пропущенному в семестре материалу обучающемуся может быть предоставлена возможность ответить на дополнительные вопросы (задания), что может повысить итоговую оценку. За ответы на дополнительные вопросы (задания) допускается проставление до 30 дополнительных баллов. В таком случае, максимальное количество баллов, которое обучающийся может получить в ходе зачета / экзамена, может быть увеличено до 90 баллов.

В случае, если итоговая сумма баллов по дисциплине (включающая оценку работы обучающегося, «премиальные» баллы за отличную работу в семестре, оценку за зачет / экзамен/дифференцированный зачет и баллы за дополнительные вопросы (задания)) превышает 100 баллов, обучающемуся проставляется в ведомость 100 баллов.

¹Положение о балльно-рейтинговой системе оценки успеваемости обучающихся в федеральном государственном бюджетном образовательном учреждении высшего образования «Всероссийская академия внешней торговли Министерства экономического развития Российской Федерации», утвержденное приказом ВАВТ Минэкономразвития России от 30.06.2023г. № 293.

Перевод итоговой суммы баллов по учебной дисциплине из 100-балльной в эквивалент пятибалльной системы / системы зачета осуществляется по приведенным ниже шкалам.

Шкала перевода для экзамена/дифференцированного зачета

Баллы по 100-балльной системе	Пятибалльная система оценки
85-100 баллов	Отлично
70-84 баллов	Хорошо
52-69 баллов	Удовлетворительно
51 балл и ниже	Неудовлетворительно

Примеры тестовых заданий

№ п/п	Код компетенции	Задание	Ответ	Критерии оценивания
1.	УК-2.1	Какая классификация рисков выделяет риски, связанные с изменением валютных курсов? А) Производственные риски; Б) Валютные риски В) Кредитные риски; Г) Операционные риски	Б) Валютные риски	1
2.	УК-2.1	Назовите основные этапы процесса управления рисками и раскройте содержание этапа идентификации рисков.	Этапы: идентификация рисков, оценка рисков, разработка стратегии реагирования, мониторинг и контроль. Идентификация – выявление возможных рисков, их описание и классификация.	2
3.	УК-2.1	Какой показатель используется для измерения систематического риска актива? А) Коэффициент вариации; Б) Бета-коэффициент В) Дисперсия; Г) Размах вариации	Б) Бета-коэффициент	11
4.	УК-2.1	Раскройте содержание модели ценообразования основных активов (САРМ) и укажите её назначение.	САРМ – модель, описывающая связь между ожидаемой доходностью актива и его систематическим риском (β). Назначение: оценка требуемой доходности актива, определение	2

		премии за риск, обоснование инвестиционных решений.	
5.	УК-2.1	Что такое эффект диверсификации в управлении рисками? А) Увеличение доходности портфеля Б) Снижение несистематического риска за счёт включения различных активов В) Увеличение систематического риска Г) Полное устранение всех рисков	Б) Снижение несистематического риска за счёт включения различных активов 1
6.	УК-2.1	Назовите показатели колеблемости, используемые для оценки риска, и раскройте их содержание.	Показатели: размах вариации (разница между max и min значениями), дисперсия (мера разброса), среднее квадратическое отклонение (стандартное отклонение), коэффициент вариации (отношение СКО к среднему значению). 2
7.	УК-2.2	Какой способ управления риском предполагает отказ от рискованной деятельности? А) Удержание; Б) Передача В) Избежание; Г) Снижение степени риска	В) Избежание 1
8.	УК-2.2	Раскройте понятие «хеджирование» и укажите основные инструменты хеджирования.	Хеджирование – способ снижения рисков неблагоприятного изменения цен/курсов путём заключения встречных сделок на срочном рынке. Инструменты: фьючерсы, опционы, форвардные контракты, свопы. 2
9.	УК-2.2	Какой метод управления рисками предполагает создание резервных фондов за счёт собственных средств? А) Страхование; Б) Самострахование В) Хеджирование; Г) Диверсификация	Б) Самострахование 1
10.	УК-2.2	Назовите средства разрешения риска и раскройте содержание каждого из них.	Средства: избежание (отказ от рискованной деятельности), удержание (принятие риска на себя), передача (передача риска третьей стороне, страхование), 2

			снижение степени риска (меры по уменьшению вероятности или последствий).	
11.	УК-2.2	В чём отличие форвардного контракта от фьючерсного?	Форвард – внебиржевой контракт с индивидуальными условиями, нестандартизированный. Фьючерс – биржевой стандартизированный контракт, с ежедневной переоценкой и маржинальными требованиями.	2
12.	ПК-4.1	Какой риск возникает при изменении требований заказчика в ходе ИТ-проекта? А) Технический риск; Б) Риск изменения требований В) Финансовый риск; Г) Организационный риск	Б) Риск изменения требований	1
13.	ПК-4.1	Назовите основные риски, возникающие при управлении изменениями в ИТ-проектах, и способы их минимизации.	Риски: изменение требований (минимизация – гибкие методологии, частые итерации), превышение бюджета (контроль затрат, резервирование), срыв сроков (детальное планирование, управление ресурсами), техническая сложность (прототипирование, экспертиза).	2
14.	ПК-4.1	Какой метод управления изменениями в ИТ-проектах позволяет гибко реагировать на изменения требований? А) Каскадная модель; Б) Agile-методологии В) V-модель; Г) Спиральная модель	Б) Agile-методологии	1
15.	ПК-4.1	Раскройте роль управления изменениями в минимизации рисков ИТ-проекта.	Управление изменениями позволяет: своевременно выявлять и оценивать риски изменений; контролировать влияние изменений на бюджет, сроки и качество; обеспечивать прозрачность процесса; предотвращать неконтролируемое разрастание требований и снижать неопределённость.	2

16.	ПК-4.1	Что такое «разрастание требований» (score creep) в ИТ-проекте? А) Увеличение бюджета проекта Б) Неконтролируемое добавление новых требований без пересмотра сроков и бюджета В) Сокращение сроков проекта Г) Уменьшение функциональности	Б) Неконтролируемое добавление новых требований без пересмотра сроков и бюджета	1
17.	ПК-4.2	Какой метод риск-менеджмента применяется для контроля изменений в ИТ-проектах? А) Регулярный мониторинг и пересмотр рисков; Б) Игнорирование рисков В) Отказ от изменений; Г) Увеличение бюджета	А) Регулярный мониторинг и пересмотр рисков	1
18.	ПК-4.2	Назовите методы контроля изменений в ИТ-проектах и раскройте их содержание.	Методы: управление конфигурацией (учёт и контроль версий), комитет по изменениям (принятие решений по изменениям), процедура запроса на изменение (формализованный процесс подачи и утверждения изменений), регрессионное тестирование (проверка после изменений).	2
19.	ПК-4.2	Какой документ фиксирует запрос на изменение в ИТ-проекте? А) Техническое задание; Б) Запрос на изменение (Change Request) В) Бизнес-план; Г) Отчёт о тестировании	Б) Запрос на изменение (Change Request)	1
20.	ПК-4.2	Раскройте понятие «мониторинг рисков» в контексте контроля изменений ИТ-проекта.	Мониторинг рисков – непрерывное отслеживание выявленных рисков, выявление новых рисков, оценка эффективности мер реагирования, корректировка планов управления рисками при изменении условий проекта.	2
21.	ПК-4.2	Какая техника используется для оценки влияния изменений на сроки и бюджет ИТ-проекта? А) Метод Монте-Карло; Б) Анализ «что-если» В) Метод Парето; Г) SWOT-анализ	Б) Анализ «что-если»	1
22.	УК-2.1	Что такое индекс Трейнора в оценке риска? А) Показатель, учитывающий систематический риск портфеля	А) Показатель, учитывающий систематический риск портфеля	1

		Б) Показатель доходности с учётом общего риска В) Показатель диверсификации Г) Показатель ликвидности		
23.	УК-2.2	В чём заключается метод «объединение риска» (pooling risk)? А) Разделение риска между несколькими участниками Б) Передача риска страховой компании В) Отказ от рискованной деятельности Г) Создание резервов	А) Разделение риска между несколькими участниками	1
24.	УК-2.2	Назовите способы снижения риска и раскройте содержание диверсификации.	Способы: диверсификация (распределение ресурсов между разными активами/проектами), поиск информации (снижение асимметрии информации), лимитирование (установление предельных значений), объединение риска (разделение риска между участниками).	2
25.	ПК-4.1	Что такое «ретрессионное тестирование» в контексте управления изменениями? А) Проверка работоспособности существующих функций после внесения изменений Б) Тестирование новых функций В) Тестирование производительности Г) Тестирование безопасности	А) Проверка работоспособности существующих функций после внесения изменений	1
26.	ПК-4.2	Назовите инструменты контроля изменений, используемые в системах управления проектами (на примере Jira).	Инструменты: workflows (рабочие процессы изменений), issue tracking (отслеживание запросов), boards (канбан-доски для визуализации), reports (отчёты по изменениям), интеграция с системами контроля версий (Bitbucket, GitHub).	2
27.	УК-2.2	Какой финансовый инструмент используется для хеджирования валютного риска? А) Валютный опцион; Б) Акция В) Облигация; Г) Депозит	А) Валютный опцион	1

28.	ПК-4.1	Раскройте связь между управлением изменениями и риск-менеджментом в ИТ-проектах.	Управление изменениями напрямую связано с риск-менеджментом: каждое изменение потенциально несёт новые риски; управление изменениями включает оценку рисков до принятия решения; риск-менеджмент обеспечивает контроль изменений через мониторинг и корректирующие действия.	2
29.	УК-2.2	Какая форма страхования используется для покрытия политических рисков в международном бизнесе? А) Страхование экспортных кредитов; Б) Страхование имущества В) Страхование ответственности; Г) Страхование жизни	А) Страхование экспортных кредитов	1
30.	УК-2.1	Назовите виды страновых рисков и раскройте содержание экономического странового риска.	Виды: экономический (ухудшение макроэкономических показателей), финансовый (валютный контроль, дефолт), политический (изменение режима, экспроприация). Экономический страновой риск – возможность ухудшения экономической ситуации, влияющей на бизнес-среду страны.	2

Примерные вопросы к дифференцированному зачету:

1. Понятие риска, классификация рисков.
2. Измерение риска на базе показателей колеблемости, характеристика показателей.
3. Систематический и несистематический риск. Измерение систематического риска. Бета-коэффициент. Эффект диверсификации.
4. Индекс Трейнора.
5. Модель ценообразования основных активов (САРМ). Премия риска индивидуального актива.
6. Экспертные методы оценки риска (первое и второе правила).
7. Понятие стратегии риск - менеджмента. Этапы процесса риск-менеджмента.
8. Приемы управления риском. Средства разрешения риска (избежание, удержание, передача, снижение степени риска).
9. Способы снижения риска.

10. Особенности покрытия риска в рамках существующих систем страховой ответственности.
11. Хеджирование как способ снижения конъюнктурных рисков. Фьючерсы, опционы, форварды.
12. Влияние внешнеэкономической деятельности на стратегию риск-менеджмента и выбор приемов управления рисками.
13. Специфика валютного риска. Правило экспортера-импортера.
14. Методы снижения степени валютного риска.
15. Методы страхования валютного риска.
16. Валютные оговорки, их виды, особенности применения.
17. Роль срочных контрактов в управлении валютным риском.
18. Базовые условия внешнеэкономического контракта.
19. Классификация и особенности рисков внешнеэкономического контракта.
20. Риски, связанные с основными положениями внешнеэкономического контракта.
21. Методы и принципы управления рисками внешнеторгового контракта.
22. Способы минимизации рисков внешней среды. Классификация и особенности рисков внешнеэкономического контракта.
23. Страновые риски: понятие, виды и особенности.
24. Методики, используемые для оценки страновых рисков.
25. Политические риски, их особенности и классификация.
26. Политические риски в зарубежной коммерческой деятельности, их специфика и факторы.
27. Методы внутреннего страхования политических рисков коммерческой деятельности.
28. Внешняя техника страхования политических рисков коммерческой деятельности.
29. Методы управления политическими рисками в международном инвестировании.
30. Особенности сделок «долг – собственность» и их возможности в снижении странового риска для инвестора.