

Документ подписан простой электронной подписью

Информация о владельце:

ФИО: Кузнецова Эмилия Васильевна

Должность: Исполнительный директор

Дата подписания: 11.12.2025 00:40:05

Уникальный программный ключ:

01e176f1d70ae109e92d86b7d8f33ec82fbb87d6

**Частное образовательное учреждение высшего образования
«Региональный институт бизнеса и управления»**

Рассмотрено и одобрено на заседании
Ученого совета Протокол № 8 от 17
апреля 2023 года, с изменениями и
дополнениями, одобренными протоколами
Ученого совета №23/24-02 от 26 января
2024 года, №25/6 от 21 апреля 2025 года,
№25/11 от 28 ноября 2025 года

УТВЕРДЖЕНО

Проректор по учебно-воспитательной
работе и качеству образования

Ю.Н.Паничкин

«28» ноября 2025 года



ФОНД ОЦЕНОЧНЫХ СРЕДСТВ

*по дисциплине «Междисциплинарный проект «Международный бизнес и глобальная
стратегия развития»»*

Направление подготовки / специальность 38.03.02 Менеджмент

Квалификация выпускника Бакалавр

Направленность (профиль) / специализация «Международный менеджмент»

Для оценки сформированности компетенции:

ПК-2 «Способность анализировать и оценивать риски»

ИПК-2.1. Знает методы, техники, технологии управления различными видами риска. Классификация рисков организаций.

ИПК-2.2. Умеет осуществлять расчеты, прогнозировать, тестировать и верифицировать методики управления рисками с учетом отраслевой специфики.

ИПК-2.3. Владеет навыками отбирать подходящие методы воздействия на отдельные виды рисков и эффективно применять их с учетом их результативности и экономической эффективности.

Рязань 2025

Закрытые задания на установление соответствие

Инструкция для выполнения задания: прочитайте текст и установите соответствие

Профессиональная компетенция ПК-2

Индикатор: ИПК-2.1

Время на ответ: 2 мин.

Задание 1: Установите соответствие между **категорией риска** и её **описанием**:

Категория	Описание
A) Стратегический risk	1) Потери от неблагоприятных валютных курсов и ставок
Б) Финансовый risk	2) Упущеные возможности из-за неверного выбора направления
В) Операционный risk	3) Срыв поставок вследствие отказа процессов
Г) Репутационный risk	4) Утрата доверия к бренду после негативных новостей

Запишите выбранные буквы под соответствующими цифрами:

A	Б	В	Г

Индикатор: ИПК-2.1

Время на ответ: 4 мин.

Задание 2: Установите соответствие между **методами идентификации рисков** и их **характеристиками**:

Метод	Характеристика
A) SWOT-анализ	1) Структурированный список угроз из прошлых проектов
Б) Delphi-опрос	2) Анонимная групповая экспертиза в несколько раундов
В) Контрольный список	3) Анализ сильных/слабых сторон, возможностей и угроз
Г) Анализ допущений	4) Проверка корректности исходных предположений проекта

Запишите выбранные буквы под соответствующими цифрами:

A	Б	В	Г

Индикатор: ИПК-2.2

Время на ответ: 8 мин.

Задание 3: Установите соответствие между **методами расчёта VaR** и их **особенностями**.

Метод	Особенность
A) Историческое моделирование	1) Случайные итерации с любым распределением
Б) Variance-Covariance	2) Линейная нормальная зависимость, σ и μ
В) Монте-Карло	3) Использует фактические изменения рынка за период

Метод	Особенность
Г) Стресс-VaR	4) Экстремальные сценарии вне стандартного интервала

Запишите выбранные буквы под соответствующими цифрами:

A	Б	В	Г

Индикатор: ИПК-2.2

Время на ответ: 4 мин.

Задание 4: Установите соответствие между **типовом страхового покрытия** и **риска-ситуацией логистики**.

Страховка	Риск
A) Cargo insurance	1) Повреждение оборудования судна
Б) Hull & Machinery	2) Потеря дохода из-за задержки поставки
В) Delay-in-Start-Up (DSU)	3) Гибель/порча груза владельца

Запишите выбранные буквы под соответствующими цифрами:

A	Б	В

Индикатор: ИПК-2.3

Время на ответ: 8 мин.

Задание 5: Установите соответствие между **стратегией реакции на политический риск** и **конкретным примером**.

Стратегия	Пример
А) Избежание	1) Договор страхования MIGA
Б) Передача	2) Отказ от инвестиций в страну под санкциями
В) Снижение	3) JV с местным партнёром
Г) Принятие	4) Мониторинг и резервный фонд без активных действий

Запишите выбранные буквы под соответствующими цифрами:

A	Б	В	Г

Ключи к заданиям

Номер вопроса	Правильный вариант ответа
1	2134
2	3214
3	3214
4	312
5	2134

Закрытые задания на установление последовательности

Инструкция для выполнения задания: прочитайте текст и установите последовательность

Профессиональная компетенция ПК-2

Индикатор: ИПК-2.1

Время на ответ: 4 мин.

Задание 1: Установите правильную последовательность этапов *идентификации рисков* международного проекта:

- А) Определение целей проекта
- Б) Сбор информации о внешней среде
- В) Мозговой штурм команды
- Г) Формирование реестра рисков

Запишите соответствующую последовательность цифр слева направо:

--	--	--	--

Индикатор: ИПК-2.1

Время на ответ: 2 мин.

Задание 2: Расставьте действия *классификации рисков организации* в логическом порядке:

- А) Выделение категории риска
- Б) Определение типа риска внутри категории
- В) Присвоение приоритетности
- Г) Документирование в реестре

Запишите соответствующую последовательность цифр слева направо:

--	--	--	--

Индикатор: ИПК-2.2

Время на ответ: 8 мин.

Задание 3: Определите последовательность расчёта *Value-at-Risk (VaR)* для *валютного риска* экспортного контракта:

- А) Определение временного горизонта оценки
- Б) Сбор исторических данных курса
- В) Расчёт волатильности
- Г) Определение VaR на заданном доверительном уровне

Запишите соответствующую последовательность цифр слева направо:

--	--	--	--

Индикатор: ИПК-2.2

Время на ответ: 4 мин.

Задание 4: Установите порядок проведения анализа чувствительности проекта к изменению процентной ставки

- А) Определение базового NPV
- Б) Изменение ставки на +1 п.п.
- В) Пересчёт NPV
- Г) Сравнение нового NPV с базовым

Запишите соответствующую последовательность цифр слева направо:

--	--	--	--

Индикатор: ИПК-2.3

Время на ответ: 8 мин.

Задание 5: Определите оптимальную последовательность методов воздействия на политico-правовые риски при выходе на зарубежный рынок:

- А) Диверсификация географии продаж
- Б) Выбор совместного предприятия
- В) Полис политического страхования
- Г) План лоббистских мероприятий

Запишите соответствующую последовательность цифр слева направо:

--	--	--	--

Ключи к заданиям

Номер вопроса	Правильный вариант ответа
1	А → Б → В → Г
2	А → Б → В → Г
3	А → Б → В → Г
4	А → Б → В → Г
5	Б → В → Г → А

Открытые задания с развернутым ответом

Инструкция для выполнения задания: прочитайте текст и запишите развернутый обоснованный ответ

Профессиональная компетенция ПК-2

Индикатор: ИПК-2.1

Время на ответ: 2 мин.

Задание 1: (Определение)

Что такое **риск ликвидности** в международном проекте?

Поле для ответа:

Индикатор: ИПК-2.1

Время на ответ: 4 мин.

Задание 2: (Объяснение)

Как сценарный анализ помогает оценивать макроэкономические риски?

Поле для ответа:

Индикатор: ИПК-2.2

Время на ответ: 8 мин.

Задание 3: (Сравнение)

В чём разница между **forward-** и **futures-контрактами** при управлении валютным риском?

Поле для ответа:

Индикатор: ИПК-2.3

Время на ответ: 4 мин.

Задание 4: (Классификация)

Какие основные категории проектных рисков выделяет стандарт PMI?

Поле для ответа:

Индикатор: ИПК-2.3

Время на ответ: 4 мин.

Задание 5: (Причина-следствие)

Почему **девальвация местной валюты** может улучшить рентабельность экспортно-ориентированного проекта?

Поле для ответа:

Ключи к заданиям

Номер вопроса	Ответ (развернутое обоснование)
1	Риск ликвидности — финансовый риск, связанный с неспособностью краткосрочной реализации финансового актива, ценной бумаги или физического товара по цене.
2	Сценарный анализ помогает оценивать макроэкономические риски, моделируя различные варианты развития событий с учётом изменений макроэкономической среды. Он оценивает влияние данных рисков на показатели проекта.
3	Разница между forward и futures-контрактами при управлении валютным риском заключается в том, где заключаются сделки и стандартизированы ли условия. Оба инструмента позволяют зафиксировать цену на валюту в будущем, но имеют разные особенности. Forward-контракты внебиржевые и индивидуальные, futures-контракты биржевые и стандартизованные.
4	Основными категориями проектных рисков по стандарту PMI являются технические, финансовые, операционные, внешние риски.
5	Девальвация местной валюты может улучшить рентабельность экспортно ориентированного проекта по причине улучшения торгового баланса. Снижаются рублевые затраты при неизменной валютной выручке.

Закрытые задания с выбором одного правильного ответа.

Инструкция для выполнения задания: прочтайте текст, выберите правильный ответ.

Профессиональная компетенция ПК-2

Индикатор: ИПК-2.1

Время на ответ: 2 мин.

Задание 1: К какому классу рисков в международной компании относится **валютный риск**?

Выберите один правильный ответ:

- А) Стратегический
- Б) Финансовый
- В) Операционный
- Г) Репутационный

Ответ:

Индикатор: ИПК-2.1

Время на ответ: 4 мин.

Задание 2: Какой метод **идентификации рисков** основан на анонимных раундах опроса экспертов?

Выберите один правильный ответ:

- А) Мозговой штурм
- Б) Delphi-опрос
- В) SWOT-анализ
- Г) Анализ документации

Ответ:

Индикатор: ИПК-2.1

Время на ответ: 4 мин.

Задание 3: Как называется инструмент, в котором риски ранжируются по осям «вероятность» и «влияние»?

Выберите один правильный ответ:

- А) Диаграмма Ганта
- Б) Матрица риска
- В) Диаграмма Парето
- Г) Гистограмма распределения

Ответ:

Индикатор: ИПК-2.3

Время на ответ: 8 мин.

Задание 4: Какой из перечисленных инструментов **передаёт** валютный риск другой стороне, сохранив право на выгоду при благоприятном курсе?

Выберите один правильный ответ:

- А) Форвард

- Б) Валютный своп
- В) Валютный колл-опцион
- Г) Страхование кредитного риска

Ответ:

Индикатор: ИПК-2.3

Время на ответ: 4 мин.

Задание 5: Какой метод **прогнозирования спроса** предпочтителен, когда для нового рынка отсутствует собственная статистика продаж?

Выберите один правильный ответ:

- А) ARIMA-модель
- Б) Метод аналогов
- В) Линейная регрессия
- Г) Скользящая средняя

Ответ:

Ключи к заданиям

Номер вопроса	Ответ
1	Б
2	Б
3	Б
4	В
5	Б

Закрытые задания с выбором нескольких вариантов ответа.

Инструкция для выполнения задания: прочитайте текст, выберите все правильные ответы.

Профессиональная компетенция ПК-2

Индикатор: ИПК-2.1

Время на ответ: 2 мин.

Задание 1 Какие действия помогают **снизить репутационный риск** при выходе на новый рынок?

Выберите несколько правильных ответов:

1. Проведение регулярных ESG-аудитов
2. Сокрытие неблагоприятной информации в СМИ
3. Публичное подписание кодекса деловой этики
4. Игнорирование местных культурных норм
5. Создание горячей линии для стейкхолдеров

Ответ:

Индикатор: ИПК-2.1

Время на ответ: 4 мин.

Задание 2: Выберите методы, обеспечивающие **коллективную идентификацию рисков** на старте международного проекта.

Выберите несколько правильных ответов:

1. Мозговой штурм
2. Контрольный список прошлых проектов
3. Закрытое интервью со спонсором
4. Delphi-опрос
5. SWOT-анализ в одиночку руководителем проекта

Ответ:

Индикатор: ИПК-2.2

Время на ответ: 8 мин.

Задание 3: Какие допущения корректны для **исторического моделирования VaR?**

Выберите несколько правильных ответов:

1. Доходности имеют стационарное распределение
2. Будущее будет статистически похоже на прошлое
3. Доходности строго нормальны
4. Используются фактические изменения цен без перерасчёта
5. Корреляции активов постоянны во времени

Ответ:

Индикатор: ИПК-2.2

Время на ответ: 4 мин.

Задание 4: Какие шаги обязательны при **монте-карло-оценке сроков проекта?**

Выберите несколько правильных ответов:

1. Задать распределения длительностей задач
2. Сгенерировать тысячи сценариев
3. Взять максимальную длительность одной критической задачи как итог
4. Рассчитать критический путь в каждом сценарии
5. Построить кумулятивную Р-кривую

Ответ:

Индикатор: ИПК-2.3

Время на ответ: 8 мин.

Задание 5 Какие меры одновременно **снижают политico-правовые риски и повышают экономическую эффективность** при входе на рынок?

Выберите несколько правильных ответов:

1. Создание совместного предприятия с местным партнёром
2. Покупка высокопремиального политического страхования

3. Развитие отношений с отраслевыми ассоциациями для лоббизма
4. Диверсификация поставщиков в разных регионах
5. Полная передача операций франчайзи без контроля

Ответ:

Ключи к заданиям

Номер вопроса	Ответ
1	1,3,5
2	1,2,4
3	1,2,4
4	1,2,4
5	1,3,4