

Документ подписан простой электронной подписью
Информация о владельце:
ФИО: Шебзухова Татьяна Александровна
Должность: Директор Пятигорского института (филиал) Северо-Кавказского
федерального университета
Дата подписания: 24.08.2023 16:19:05
Уникальный программный ключ:
d74ce93cd40e39275c3ba2f58486412a1c8ef96f

МИНИСТЕРСТВО НАУКИ И ВЫСШЕГО ОБРАЗОВАНИЯ РОССИЙСКОЙ
ФЕДЕРАЦИИ
ФЕДЕРАЛЬНОЕ ГОСУДАРСТВЕННОЕ АВТОНОМНОЕ ОБРАЗОВАТЕЛЬНОЕ
УЧРЕЖДЕНИЕ ВЫСШЕГО ОБРАЗОВАНИЯ
«СЕВЕРО-КАВКАЗСКИЙ ФЕДЕРАЛЬНЫЙ УНИВЕРСИТЕТ»
Пятигорский институт (филиал) СКФУ

УТВЕРЖДАЮ
Зам. Директора по УР
Пятигорского института (филиала) СКФУ
_____ М.В. Мартыненко
«28» марта 2022 г.

ФОНД ОЦЕНОЧНЫХ СРЕДСТВ
для проведения текущего контроля успеваемости и промежуточной аттестации
по дисциплине
УПРАВЛЕНИЕ КОРПОРАТИВНЫМИ РИСКАМИ

Направленность (профиль)/специализация	Корпоративная экономика и финансы
Форма обучения	Очно-заочная
Год начала обучения	2022
Изучается в 6 семестре	

**ДОКУМЕНТ ПОДПИСАН
ЭЛЕКТРОННОЙ ПОДПИСЬЮ**
Сертификат: 12000002A633E3D113AD425FB50002000002A6
Владелец: Шебзухова Татьяна Александровна
Действителен: с 20.08.2021 по 20.08.2022

Введение

Назначение фонда оценочных средств - обеспечение научно-методической основы для организации и проведения текущего и промежуточного контроля по дисциплине Управление корпоративными рисками. Текущий и промежуточный контроль по дисциплине Управление корпоративными рисками – вид систематической проверки знаний, умений, навыков студентов. Задача текущего контроля – получить первичную оперативную информацию о ходе и качестве усвоения учебного материала, а также стимулировать регулярную целенаправленную работу студентов. Задача промежуточного контроля – получить достоверную информацию о степени освоения дисциплины.

Фонд оценочных средств текущего контроля и промежуточной аттестации на основе рабочей программы дисциплины Управление корпоративными рисками, составлен в соответствии с образовательной программой по направлению подготовки 38.03.01 Экономика

2. ФОС является приложением к программе дисциплины (модуля) Управление корпоративными рисками, составлен в соответствии с образовательной программой по направлению подготовки 38.03.01 Экономика

3. Разработчик М.В. Флоринская, Доцент кафедры финансов и бухгалтерского учета

Проведена экспертиза ФОС.

Члены экспертной группы:

Председатель: Новоселова Н.Н., заведующая кафедрой финансов и бухгалтерского учета

Члены комиссии:

Новоселов С.Н., профессор кафедры финансов и бухгалтерского учета
Маркова Л.А., доцент кафедры финансов и бухгалтерского учета

Представитель организации-работодателя Носолева В.А., директор ООО «ФИНЭКС»

Экспертное заключение: данные оценочные средства соответствует требованиям федерального государственного образовательного стандарта высшего образования, рекомендуются для использования в учебном процессе.

Срок действия ФОС определяется сроком реализации образовательной программы.

**ДОКУМЕНТ ПОДПИСАН
ЭЛЕКТРОННОЙ ПОДПИСЬЮ**

Сертификат: 12000002A633E3D113AD425FB50002000002A6

Владелец: Шебзухова Татьяна Александровна

Действителен: с 20.08.2021 по 20.08.2022

Перечень компетенций с указанием этапов их формирования в процессе освоения образовательной программы

Код оцениваемой компетенции, индикатора (ов)	Этап формирования компетенции (№ темы) (в соответствии с рабочей программой дисциплины)	Средства и технологии оценки	Вид контроля, аттестация (текущий/промежуточный)	Тип контроля (устный, письменный или с использованием технических средств)	Наименование оценочного средства
ИД-4 ПК – 5 ИД-2 ПК - 6	Темы 3, 15	Собеседование	Текущий	Устный	Вопросы для собеседования
ИД-4 ПК – 5 ИД-2 ПК - 6	Темы 14, 16	Круглый стол	Текущий	Устный	Перечень дискуссионных тем для круглого стола

Описание показателей и критериев оценивания на различных этапах их формирования, описание шкал оценивания

Уровни сформированности компетенци(ий), индикатора (ов)	Дескрипторы			
	Минимальный уровень не достигнут (Неудовлетворительно) 2 балла	Минимальный уровень (удовлетворительно) 3 балла	Средний уровень (хорошо) 4 балла	Высокий уровень (отлично) 5 баллов
Компетенция: ПК-5 Способность составлять финансовые планы, бюджеты, разрабатывать инвестиционные проекты				
Результаты обучения по дисциплине (модулю): Индикатор: ИД-4 ПК - 5 способность проводить оценку устойчивости инвестиционного проекта изменяющимся параметрам внешней и внутренней среды и разрабатывать меры по снижению	Недостаточно навыков чтобы -выполнять необходимые расчеты по планированию и бюджетированию в организации, обосновывать их и представлять результаты и обзоры	Испытывает затруднения при -выполнять необходимые расчеты по планированию и бюджетированию в организации, обосновывать их и представлять результаты и обзоры	Воспроизводит и корректно использует по -выполнять необходимые расчеты по планированию и бюджетированию в организации, обосновывать их и представлять результаты и обзоры	Выполняет необходимые расчеты по планированию и бюджетированию в организации, обосновывать их и представлять результаты и обзоры
	Недостаточно навыков - осуществлять подготовку предложений по инвестиционным проектам в соответствии с критериями их рыночной привлекательности, целями и критериями отбора	С затруднением - осуществлять подготовку предложений по инвестиционным проектам в соответствии с критериями их рыночной привлекательности, целями и критериями отбора	Испытывает затруднение - осуществлять подготовку предложений по инвестиционным проектам в соответствии с критериями их рыночной привлекательности, целями и критериями отбора	Использует экономическую и юридическую природу финансово-хозяйственной жизни государственных и муниципальных учреждений
воздействию факторов результаты проекта ДОКУМЕНТ ПОДПИСАН ЭЛЕКТРОННОЙ ПОДПИСЬЮ Идентификатор: 12000002A633E3D113AD425FB50002000002A6 Подпись: Шебзухова Татьяна Александровна				
Компетенция: ПК-6 Способность идентифицировать и анализировать риски в финансовой				

сфере				
Результаты обучения по дисциплине (модулю): <i>Индикатор:</i> ИД-2 ПК - 6 способность предлагать меры воздействия на финансовые риски, используя стандартные теоретические и эконометрические модели	Недостаточно навыков по оценке и проводить оценку устойчивости инвестиционного проекта к изменяющимся параметрам внешней и внутренней среды и разрабатывать меры по снижению воздействия факторов риска на результаты проекта	С затруднением оценивает и проводить оценку устойчивости инвестиционного проекта к изменяющимся параметрам внешней и внутренней среды и разрабатывать меры по снижению воздействия факторов риска на результаты проекта	Испытывает проводить оценку устойчивости инвестиционного проекта к изменяющимся параметрам внешней и внутренней среды и разрабатывать меры по снижению воздействия факторов риска на результаты проекта	Оценивает и проводить оценку устойчивости инвестиционного проекта к изменяющимся параметрам внешней и внутренней среды и разрабатывать меры по снижению воздействия факторов риска на результаты проекта

Рейтинговая оценка знаний студента (в случаях, предусмотренных нормативными актами СКФУ).

Не предусмотрена учебным планом.

Типовые контрольные задания и иные материалы, характеризующие этапы формирования компетенций

Критерии оценивания компетенций*

Оценка «отлично» выставляется студенту, если он в ходе собеседования правильно ответил на вопрос по теме собеседования, сопровождая наглядными примерами.

Оценка «хорошо» выставляется студенту, если он в ходе собеседования ответил на вопрос по теме собеседования, при этом есть неуверенность с практическими примерами.

Оценка «удовлетворительно» выставляется студенту, если он в ходе собеседования ответил неуверенно на вопросы по теме собеседования, не смог привести практические примеры.

Оценка «неудовлетворительно» выставляется студенту, если он не ответил на вопрос по теме собеседования.

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

Текущая аттестация студентов проводится преподавателем, ведущим лекционные и практические занятия по дисциплине. К практическому занятию студент должен подготовить ответы на вопросы, выполнить задания по теме занятия. Максимальное количество баллов студент получает, если он активно участвует в работе, владеет материалом, умеет логично и четко излагать мысли, творчески подходит к решению основных вопросов темы, показывает самостоятельность мышления.

Основанием для снижения оценки являются:

- слабое знание темы и основной терминологии;
- пассивность участия в групповой работе;
- отсутствие умения применить теоретические знания для решения практических задач;
- несвоевременность предоставления выполненных работ.

ДОКУМЕНТ ПОДПИСАН ЭЛЕКТРОННОЙ ПОДПИСЬЮ	
Сертификат:	12000002A633E3D113AD425FB50002000002A6
Владелец:	Шебзухова Татьяна Александровна
Тема 1. Теоретические основы риск – менеджмента	
Действителен: с 20.08.2021 по 20.08.2022	

1. Содержание риск - менеджмента и его место в системе управления организацией.
2. Понятие риска, его основные элементы и черты.
3. Общие принципы классификации рисков.

Тема 2. Анализ рисков основных видов экономической деятельности

1. Характеристика предпринимательской экономической деятельности.
2. Риски производственной деятельности.
3. Коммерческие и посреднические риски.

Тема 3. Концепции и методический инструментальный риск - менеджмента

1. Базовые концепции управления рисками.
2. Финансовые и коммерческие вычисления в исторической ретроспективе.
3. Понятие риска и доходности финансовой операции и их взаимосвязь.
4. Безрисковая норма доходности.

Тема 4. Методы оценки предпринимательских рисков

1. Оценка вероятности неблагоприятных событий.
2. Общеметодические подходы к количественной оценке риска.
3. Количественные оценки риска и методы их определения.
4. Шкалы риска и характеристика их градаций.
5. Показатели, применяемые для количественной оценки риска.

Тема 5. Интегральная оценка риска

1. Интегральные характеристики риска.
2. Статистические распределения ущерба.
3. Статистическое представление средних и предельных характеристик риска.

Тема 6. Категории риска и леве́риджа и их взаимосвязь

1. Сущность, виды и классификация предпринимательских рисков.
2. Основные методы управления предпринимательскими рисками.
3. Леве́ридж и его роль в финансовом менеджменте.
4. Производственный и финансовый леве́ридж.
5. Метод расчета критического объема продаж.

Тема 7. Учет риска при принятии управленческих решений

1. Современные тенденции в управлении рисками.
2. Принятие решений в условиях риска.
3. Принятие решений в условиях неопределенности.
4. Общая схема управления рисками на предприятии.
5. Программа управления рисками.
6. Разработка ситуационных планов.

Тема 8. Финансирование риска

1. Затраты на риск.
2. Источники финансирования рисков.
3. Текущее, дособытийное и послесобытийное финансирование предпринимательских рисков.

Тема 9. Пути снижения предпринимательских рисков

1. Стратегические направления снижения предпринимательских рисков.
2. Методы снижения предпринимательских рисков и их характеристика.
3. Выбор оптимального метода снижения рисков.
4. Страхование и самострахование предпринимательских рисков.
5. Формирование фонда риска.

Тема 10. Разработка программы управления финансовыми рисками организации

1. Общие подходы к формированию программы управления рисками на предприятии.
2. Этапы разработки программы управления рисками.

Тема 11. Формирование программы управления риском

1. Шебзухова Татьяна Александровна
2. Источники финансирования программы.

Сертификат: 12000002A633E3D113AD425FB50002000002A6

Владелец: 1. Шебзухова Татьяна Александровна

Действителен: с 20.08.2021 по 20.08.2022

3. Текущее, дособытийное и послесобытийное финансирование программы управления рисками.

Тема 12. Валютный риск

1. Экономический валютный риск.
2. Скрытые риски.
3. Общая характеристика странового валютного риска и способы определения его величины.

Тема 13. Кредитный риск

1. Сущность и классификация кредитных рисков.
2. Идентификация кредитных рисков.
3. Методы оценки кредитных рисков.

Тема 14. Депозитный риск

1. Теоретические основы депозита и риска.
2. Виды депозитов.
3. Теоретические аспекты депозитного риска.

Тема 15. Инвестиционный риск

1. Понятие инвестиционного риска.
2. Виды инвестиционных рисков.
3. Классификация инвестиционных рисков по сферам проявления; по формам инвестирования; по формам инвестирования.

Тема 16. Инновационный риск

1. Инновационная деятельность.
2. Риски инновационной деятельности.
3. Виды инновационных рисков.

Тема 17. Инфляционный риск

1. Понятие и виды инфляции.
2. Темп инфляции.
3. Индекс инфляции.

Тема 18. Налоговый риск

1. Понятие и виды налоговых рисков.
2. Методы оценки налогового риска.
3. Методы налогового риск-менеджмента.
4. Диверсификация риска.
5. Лимитирование сумм сделок.

Критерии оценивания компетенций

Оценка **«отлично»** выставляется студенту, если он свободно справляется с задачами, вопросами и другими видами применения знаний; использует в ответе дополнительный материал все предусмотренные программой задания выполнены, качество их выполнения оценено числом баллов, близким к максимальному; анализирует полученные результаты; проявляет самостоятельность при выполнении заданий.

Оценка **«хорошо»** выставляется студенту, если необходимые практические компетенции в основном сформированы, все предусмотренные программой обучения учебные задания выполнены, качество их выполнения достаточно высокое. Студент твердо знает материал, грамотно и по существу излагает его, не допуская существенных неточностей.

Оценка **«удовлетворительно»** выставляется студенту, большинство предусмотренных программой заданий выполнено, но в них имеются ошибки, при ответе

на поставленные вопросы студент допускает неточности, недостаточно правильные формулировки, недостаточно логичная последовательность в изложении

**ДОКУМЕНТ ПОДПИСАН
ЭЛЕКТРОННОЙ ПОДПИСЬЮ**

Сертификат: 12000002A633E3D113AD425FB50002000002A6

Владелец: Шебзухова Татьяна Александровна

Действителен: с 20.08.2021 по 20.08.2022

Оценка **«неудовлетворительно»** выставляется студенту, если он не проявляет значительной активности в собеседовании, допускает существенные ошибки, неуверенно, с большими затруднениями участвует в собеседовании, необходимые практические компетенции не сформированы, большинство предусмотренных программой обучения учебных заданий не выполнено, качество их выполнения оценено числом баллов, близким к минимальному.

Описание шкалы оценивания

Рейтинговая оценка успеваемости студентов не предусмотрена учебным планом.

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

Процедура проведения данного оценочного мероприятия включает в себя оценку текущей работы студента и его активности в течение всего курса.

Предлагаемые студенту задания позволяют проверить ИД-4 ПК - 5 компетенции.

Для подготовки к данному оценочному мероприятию необходимо подготовить ответы на приведенные вопросы, владеть нормативной базой по указанным направлениям.

При подготовке к ответу студенту предоставляется право пользования нормативно-справочной литературой.

При проверке задания, оцениваются содержательность ответов и активность студента при проведении лекции-дискуссии.

4. Оценочные листы

№ п/п	ФИО студента	Полнота раскрытия вопроса	Логичность и последовательность изложения материала	Аргументированность ответа студента	Способность анализировать и сравнивать различные подходы к решению поставленной проблемы	Готовность студента отвечать на дополнительные вопросы по существу темы	Итоговый балл

Перечень дискуссионных тем для круглого стола

Тема 9. Пути снижения предпринимательских рисков

Стратегические направления снижения предпринимательских рисков.

Выбор оптимального метода снижения рисков.

Критерии оценивания компетенций

Оценка **«отлично»** выставляется студенту, если в процессе проведения круглого стола он показывает исчерпывающе знания, последовательно, четко и логически стройно излагает материал; использует в ответе дополнительный материал; анализирует полученные результаты; проявляет самостоятельность при выполнении заданий.

Оценка **«хорошо»** выставляется студенту, если он твердо знает материал, грамотно и по существу излагает его, не допуская существенных неточностей в ответе на вопрос.

Оценка **«удовлетворительно»** выставляется студенту, если при ответе на поставленный вопрос студент допускает неточности, недостаточно правильные

ДОКУМЕНТ ПОДПИСАН
ЭЛЕКТРОННОЙ ПОДПИСЬЮ
Сертификат: 12000002A633E3D113AD425FB50002000002A6
Владелец: Шебзухова Татьяна Александровна
Действителен: с 20.08.2021 по 20.08.2022

формулировки, наблюдаются нарушения логической последовательности в изложении программного материала.

Оценка **«неудовлетворительно»** выставляется студенту, если он допускает существенные ошибки, необходимые практические компетенции не сформированы.

Описание шкалы оценивания

Рейтинговая оценка успеваемости студентов не предусмотрена учебным планом

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

Структура круглого стола позволяет проверить:

Для подготовки к данному оценочному мероприятию необходимо в течении практического занятия четко, логически верно отвечать на поставленные вопросы и приводить примеры.

При подготовке к круглому столу студенту предоставляется право пользования справочными материалами и литературными источниками по данной проблематике.

При проведении круглого стола оцениваются: последовательность и рациональность изложения материала.

4. Оценочные листы

№ п/п	ФИО студента	Соответств ие содержанию раскрытия вопроса	Четкость и последовате льность изложения материала	Аргумент ированно сть ответа студента	Умение анализиров ать полученные результаты	Способност ь студента отвечать на дополнител ьные вопросы	Итоговы й балл