Документ подписан простой электронной подписью
Информация о владельце:
ФИО: Крылова Людмила Вячеславовна
Должность: Проректор по учебно-методической работе
Дата подписания: 08.11.2026 18:09:30
Уникальный программный ключ:
b066544bae1e449cd8bfce392f7224a676a271b2

МИНИСТЕРСТВО НАУКИ И ВЫСШЕГО ОБРАЗОВАНИЯ
РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ

ФЕДЕРАЛЬНОЕ ГОСУДАРСТВЕННОЕ БЮДЖЕТНОЕ ОБРАЗОВАТЕЛЬНОЕ
УЧРЕЖДЕНИЕ ВЫСШЕГО ОБРАЗОВАНИЯ
«ДОНЕЦКИЙ НАЦИОНАЛЬНЫЙ УНИВЕРСИТЕТ ЭКОНОМИКИ И
ТОРГОВЛИ ИМЕНИ МИХАИЛА ТУГАН-БАРАНОВСКОГО»

Кафедра финансов и экономической безопасности

УТВЕРЖДАЮ

Заведующий кафедрой финансов и
экономической безопасности
_____ Л.А. Омельянович
«21» февраля 2024 г.

ОЦЕНОЧНЫЕ МАТЕРИАЛЫ

по учебной дисциплине
Б1.В.ДВ.03.02 Корпоративные финансовые риски
(шифр и наименование учебной дисциплины, практики)

38.05.01 Экономическая безопасность
(код и наименование специальности)

Разработчик:

Доцент _____ Верич Ю.Л.

Оценочные материалы рассмотрены и утверждены на заседании кафедры
от 21.02 2024 г., протокол № 21

Донецк 2024 г.

Паспорт
оценочных материалов по учебной дисциплине
«КОРПОРАТИВНЫЕ ФИНАНСОВЫЕ РИСКИ»

Перечень компетенций, формируемых в результате освоения учебной дисциплины (модуля)

№ п/п	Код и наименование контролируемой компетенции	Контролируемые разделы (темы) учебной дисциплины	Этапы формирования (семестр изучения)
1	ПК-1 Способен осуществлять эксплуатацию интегрированной системы управления рисками	Тема 1. Теоретические основы финансовых рисков корпорации	9
		Тема 2. Интегрированное управление рисками	9
		Тема 3. Поведенческие финансы и их влияние на принятие финансовых решений	9
		Тема 4. Основы оценки и измерения финансовых рисков	9
		Тема 5. Использование производных финансовых инструментов для управления рисками	9
		Тема 6. Управление рыночными рисками	9
		Тема 7. Управление кредитным риском	9
		Тема 8. Управление риском ликвидности	9
		Тема 9. Операционные финансовые риски	9

Показатели и критерии оценивания компетенций, описание шкал оценивания

Показатели оценивания компетенций

Код контролируемой компетенции	Код и наименование индикатора достижения компетенции	Контролируемые разделы (темы) учебной дисциплины	Наименование оценочного средства
ПК-1 Способен осуществлять эксплуатацию интегрированной системы управления рисками	ИД-1ПК-1Анализирует функционирование системы управления рисками	Тема 1. Теоретические основы финансовых рисков корпорации	Коллоквиум, тест
		Тема 2. Интегрированное управление рисками	Коллоквиум, тест
		Тема 3. Поведенческие финансы и их влияние на принятие финансовых решений	Коллоквиум, тест
		Тема 4. Основы оценки и измерения финансовых рисков	Коллоквиум, тест практические задания
		Тема 5. Использование производных финансовых инструментов для управления рисками	Коллоквиум, тест практические задания, контрольная работа (ТМК 1)

Код контролируемой компетенции	Код и наименование индикатора достижения компетенции	Контролируемые разделы (темы) учебной дисциплины	Наименование оценочного средства
	ИД-2ПК-1 Осуществляет выработку рекомендаций по дальнейшему развитию системы управления рисками	Тема 5. Использование производных финансовых инструментов для управления рисками	Коллоквиум, тест практические задания, контрольная работа (ТМК 1)
		Тема 4. Основы оценки и измерения финансовых рисков	Коллоквиум, тест практические задания
		Тема 5. Использование производных финансовых инструментов для управления рисками	Коллоквиум, тест практические задания
		Тема 6. Управление рыночными рисками	Коллоквиум, тест практические задания
		Тема 7. Управление кредитным риском	Коллоквиум, тест практические задания
		Тема 8. Управление риском ликвидности	Коллоквиум, тест практические задания
		Тема 5. Использование производных финансовых инструментов для управления рисками	Коллоквиум, тест практические задания, контрольная работа (ТМК 2)

Критерии и шкала оценивания по оценочному материалу «Коллоквиум»

Шкала оценивания (баллы)	Критерий оценивания
3	Студент демонстрирует глубокое знание материала, свободно оперирует понятиями, ответы полные и точные на 90-100% вопросов.
2	Студент демонстрирует хорошее знание материала, в основном правильно отвечает на вопросы (75-89%), но могут быть незначительные неточности.
1	Студент демонстрирует удовлетворительное знание материала, отвечает на 60-74% вопросов, допускает существенные неточности.
0	Студент демонстрирует неудовлетворительное знание материала, отвечает менее чем на 60% вопросов.

Критерии и шкала оценивания по оценочному материалу «Тест»

Шкала оценивания (баллы)	Критерий оценивания
2	Задание выполнено на высоком уровне (правильные ответы даны на 90-100% вопросов).
1	Задание выполнено на удовлетворительном уровне (правильные ответы даны на 60-89% вопросов).
0	Задание выполнено на неудовлетворительном уровне (правильные ответы даны менее чем на 60% вопросов).

Критерии и шкала оценивания по оценочному материалу «Практические задания»

Шкала оценивания (баллы)	Критерии оценивания
6	Задание выполнено на высоком уровне: расчеты верны, формулы, обозначения, размерности указаны правильно, выводы обоснованы и сформулированы корректно.

5	Задание выполнено на хорошем уровне: расчеты верны, формулы указаны верно, но могут быть незначительные недочеты в обозначениях или размерностях, выводы верны.
4	Задание выполнено на уровне выше среднего: расчеты в основном верны, но есть незначительные ошибки, выводы сделаны, но могут быть неполными.
3	Задание выполнено на удовлетворительном уровне: есть ошибки в расчетах, но основные формулы указаны правильно, выводы присутствуют.
2	Задание выполнено на низком уровне: есть значительные ошибки в расчетах, основные формулы указаны правильно, выводы отсутствуют или некорректны.
0	Задание не выполнено или выполнено с грубыми ошибками.

Критерии и шкала оценивания по оценочному материалу «Контрольная работа (ТМК 1)»

Шкала оценивания (баллы)	Критерий оценивания
10	Задание выполнено на высоком уровне: расчеты верны, формулы, обозначения, размерности указаны правильно, выводы обоснованы и сформулированы корректно.
8-9	Задание выполнено на хорошем уровне: расчеты верны, формулы указаны верно, но могут быть незначительные недочеты в обозначениях или размерностях, выводы верны.
6-7	Задание выполнено на уровне выше среднего: расчеты в основном верны, но есть незначительные ошибки, выводы сделаны, но могут быть неполными.
1-5	Задание выполнено на удовлетворительном уровне: есть ошибки в расчетах, но основные формулы указаны правильно, выводы присутствуют.
0	Задание выполнено на низком уровне: есть значительные ошибки в расчетах, основные формулы указаны правильно, выводы отсутствуют или некорректны.

Критерии и шкала оценивания по оценочному материалу «Контрольная работа (ТМК 2)»

Шкала оценивания (баллы)	Критерий оценивания
15	Задание выполнено на высоком уровне: расчеты верны, формулы, обозначения, размерности указаны правильно, выводы обоснованы и сформулированы корректно.
11-14	Задание выполнено на хорошем уровне: расчеты верны, формулы указаны верно, но могут быть незначительные недочеты в обозначениях или размерностях, выводы верны.
6-10	Задание выполнено на уровне выше среднего: расчеты в основном верны, но есть незначительные ошибки, выводы сделаны, но могут быть неполными.
1-5	Задание выполнено на удовлетворительном уровне: есть ошибки в расчетах, но основные формулы указаны правильно, выводы присутствуют.
0	Задание выполнено на низком уровне: есть значительные ошибки в расчетах, основные формулы указаны правильно, выводы отсутствуют или некорректны.

Перечень оценочных материалов

№ п/п	Наименование оценочного материала	Краткая характеристика оценочного материала	Представление оценочного материала в фонде
1	Коллоквиум	Средство контроля усвоения учебного материала темы, раздела или разделов учебной дисциплины, организованное как учебное занятие в виде собеседования преподавателя с обучающимися.	Вопросы

2	Тест	Система стандартизированных заданий, позволяющая автоматизировать процедуру измерения уровня знаний и умений обучающегося.	Фонд тестовых заданий
3	Практические задания	Средство проверки умений применять полученные знания для решения практических заданий определенного типа по теме, разделу.	Комплект практических заданий
4	Контрольная работа (ТМК 1)	Средство проверки умений применять полученные знания для решения задач определенного типа по темам Модуля 1.	Комплект контрольных заданий по вариантам
5	Контрольная работа (ТМК 2)	Средство проверки умений применять полученные знания для решения задач определенного типа по темам Модуля 2.	Комплект контрольных заданий по вариантам

Распределение баллов, которые получают обучающиеся

Максимальное количество баллов за текущий контроль и самостоятельную работу									**Максимальная сумма баллов**
Смысловой модуль № 1					**Смысловой модуль № 2**				
Т1	Т2	Т3	Т4	Т5	Т6	Т7	Т8	Т9	
6	6	6	6	24	9	9	9	25	100

Соответствие государственной шкалы оценивания академической успеваемости

Сумма баллов за все виды учебной деятельности	**По государственной шкале**	**Определение**
90-100	«Отлично» (5)	отлично – отличное выполнение с незначительным количеством неточностей
75-89	«Хорошо» (4)	хорошо – в целом правильно выполненная работа с незначительным количеством ошибок
60-74	«Удовлетворительно» (3)	удовлетворительно – выполнение удовлетворяет минимальные критерии
0-59	«Неудовлетворительно» (2)	неудовлетворительно

Примеры типовых контрольных заданий

1) по оценочному материалу «Коллоквиум»

1. Раскройте сущность корпоративных финансовых рисков и приведите примеры их классификации.
2. Опишите основные этапы процесса управления корпоративными финансовыми рисками.
3. Сравните и охарактеризуйте различные виды рыночных рисков.
4. Объясните понятие кредитного риска и методы его оценки.
5. Раскройте содержание риска ликвидности и способы его измерения.
6. Опишите основные виды операционных финансовых рисков и методы их управления.
7. Объясните концепцию интегрированного управления рисками (ERM) и ее преимущества.
8. Раскройте влияние поведенческих факторов на принятие решений в области финансовых рисков.
9. Опишите основные методы оценки финансовых рисков.

10. Объясните принципы использования производных финансовых инструментов для управления рисками.

2) по оценочному материалу «Тест»

1. Какой из перечисленных рисков относится к рыночным рискам?
   а) Риск дефолта контрагента
   б) Риск изменения процентных ставок
   в) Риск сбоев в IT-системах
2. Что из перечисленного является целью управления финансовыми рисками?
   а) Полное исключение всех рисков
   б) Минимизация убытков и оптимизация прибыльности
   в) Максимизация прибыли любой ценой
3. Какой метод оценки риска использует анализ разрывов активов и пассивов?
   а) Value-at-Risk (VaR)
   б) Gap Analysis
   в) Стресс-тестирование
4. Какой вид производных финансовых инструментов используется для фиксации будущей цены актива?
   а) Опцион
   б) Фьючерс
   в) Своп
5. Какой поведенческий фактор может привести к недооценке риска?
   а) Неприятие потерь
   б) Излишняя самоуверенность
   в) Эффект привязки

3) по оценочному материалу «Решение ситуационных задач»

Задание 1. Компания имеет валютный кредит в размере 1 000 000 долларов США. Прогноз изменения курса доллара неблагоприятен. Предложите и обоснуйте инструменты хеджирования валютного риска.

Задание 2.

Группой экспертов были представлены прогнозы чистой прибыли по двум проектам. Результаты представлены в таблице (в тыс. руб.)

Проекты	Эксперты								
	1	2	3	4	5	6	7	8	9
Проект 1	250	250	300	400	200	350	300	275	300
Проект 2	250	250	250	300	200	350	300	350	300

Задание: Рассчитайте ожидаемую прибыль по каждому проекту. Сравните рискованность проектов при помощи показателя стандартного отклонения. Сделайте выводы.

4) по оценочному материалу «Контрольная работа»

Задание 1 (теоретическое). Раскройте взаимосвязь между различными видами корпоративных финансовых рисков. Приведите примеры.

Задание 2 (практическое).

На основании анализа проектов были разработаны три сценария. Информация о чистой приведенной стоимости в соответствии с каждым сценарием приведена в таблице.

Показатель	1 сценарий	2 сценарий	3 сценарий	1 сценарий	2 сценарий	3 сценарий
NPV,тыс. руб.	550	600	200	550	720	300
Вероятность	0,35	0,45	0,2	0,25	0,3	0,45

Задание: Рассчитайте наиболее вероятное значение NPV для каждого проекта. Сделайте вывод о сравнительной рискованности проекта на основании расчета стандартного отклонения

Методические материалы, определяющие процедуры
оценивания знаний, умений, навыков

Оценивание знаний с использованием оценочных материалов «Тесты» проводится в письменной форме и предполагает, что обучающимся раздаются индивидуальные задания, содержащие вопросы в форме тестов закрытого типа. Выполнение предполагает выбор одного правильного ответа (или нескольких, если это предусмотрено заданием) из предлагаемых вариантов. Обучающийся выполняет задание самостоятельно. Использование в процессе ответа источников информации не допускается. Максимальное количество баллов, которое обучающийся может получить за выполнение тестов по каждой теме, предусматривающей оценивание в форме «тесты» – 2 балла. Таким образом, выполняя тесты, обучающийся максимально может набрать 18 баллов (за 9 тем).

Оценивание знаний с использованием оценочных материалов «Коллоквиум» проводится в устной форме и предполагает предоставление обучающимся устных ответов на вопросы, задаваемые преподавателем. Ответы должны быть даны самостоятельно. Использование в процессе ответа источников информации не допускается. Максимальное количество баллов, которое обучающийся может получить за ответы по каждой теме, предусматривающей оценивание в форме «коллоквиум» – 3 балла. Таким образом, отвечая на вопросы коллоквиума, обучающийся максимально может набрать 27 баллов (за 9 тем).

Оценивание знаний с использованием оценочных материалов «Практические задания» проводится в письменной форме. Выполнение предполагает выполнение практических заданий (расчетных задач). Обучающийся выполняет задание самостоятельно. Использование в процессе ответа источников информации не допускается. Максимальное количество баллов, которое обучающийся может получить за выполнение практических заданий по каждой теме, предусматривающей оценивание в форме «практические задания» – 6 баллов. Таким образом, выполняя практические задания, обучающийся максимально может набрать 30 баллов (за 5 тем).

В конце изучения каждого смыслового модуля обучающийся выполняет текущую модульную контрольную работу по закрепленному варианту. Максимально возможное количество полученных баллов по результатам решения контрольной работы составляет 10 баллов (ТМК 1) и 15 баллов (ТМК 2). Таким образом, за две контрольные работы (ТМК) можно получить максимум 25 баллов.

По дисциплине предусмотрена промежуточная аттестация в форме зачета. Зачет выставляется на основе баллов, набранных за текущий контроль в течение семестра. Для получения зачета необходимо набрать не менее 60 баллов.

Итоговая сумма баллов за все виды работ в течение семестра составляет 100 баллов

Распределение баллов, которые получают обучающиеся

Форма контроля	**Макс. количество баллов**	
	За одну работу	**Всего**
Текущий контроль:		
- коллоквиум (темы № 1-9)	3	27
- тесты (темы № 1-9)	3	27
- практические задания (темы № 5-9)	3	15
- контрольная работа (ТМК 1) (тема № 5)	15	15
- контрольная работа (ТМК 2) (тема № 9)	16	16
Промежуточная аттестация	Зачет	100/60
Итого за семестр	*100*	