

МИНОБРНАУКИ РОССИИ  
Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение  
высшего образования  
«Тверской государственный технический университет»

УТВЕРЖДАЮ  
Заведующий кафедрой ЭУП  
\_\_\_\_\_ И.В. Вякина  
« 28 » \_\_\_\_\_ 12 \_\_\_\_\_ 2021 г.

**ОЦЕНОЧНЫЕ СРЕДСТВА**  
**промежуточной аттестации в форме зачета**  
**по дисциплине**  
**«Управление рисками»**

Направление подготовки – **27.04.02 Управление качеством**

Направленность (профиль) подготовки – Управление качеством в организации

Типы задач профессиональной деятельности - научно-исследовательский; организационно-управленческий

Разработаны в соответствии с

Рабочими программами «Управление рисками»,  
утвержденными проректором по УР.

Разработчик: Вякина И.В.

Тверь 2021

Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение  
высшего образования  
«Тверской государственный технический университет»

Направление подготовки специалистов **27.04.02 Управление качеством**  
Профиль подготовки **Управление качеством в организации**

Кафедра Экономики и управления производством  
Дисциплина «Управление рисками»  
Семестр 2

**ЗАДАНИЕ ДЛЯ ДОПОЛНИТЕЛЬНОГО ИТОГОВОГО КОНТРОЛЬНОГО  
ИСПЫТАНИЯ № 1**

1. Задание для проверки уровня «ЗНАТЬ» – 0 или 1 балл:

**Раскройте понятие риска, его основные функции**

2. Задание для проверки уровня «УМЕТЬ» - 0 или 1 балл:

**На основании приведенных данных определите критические значения цены и затрат и выполните оценку уровня риска при запланированном объеме выпуска продукции 75 000 шт. (аналитическим и графическим способами).**

<i>Показатель</i>	<i>При минимальной загрузке производственной мощности</i>	<i>При максимальной загрузке производственной мощности</i>
Объем реализации продукции, шт.	60000	80000
Совокупные затраты, тыс. руб.	12600	14400
Цена, руб.	300	

3. Задание для проверки уровня «УМЕТЬ» - 0 или 1 балл:

**Выполните количественную оценку риска и доходности указанных проектов.**

ПРОЕКТ А						ПРОЕКТ В					
1	2	3	4	5	6	1	2	3	4	5	6
2	4	3	10	8	6	2	8	4	4	8	7

**Критерии итоговой оценки за зачет:**

«зачтено» - при сумме баллов 2 или 3;

«не зачтено» - при сумме баллов 0 или 1.

Составители: Заведующий кафедрой ЭУП

И.В. Вякина

Заведующий кафедрой ЭУП

И.В. Вякина

Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение  
высшего образования  
«Тверской государственный технический университет»

Направление подготовки специалистов **27.04.02 Управление качеством**  
Профиль подготовки **Управление качеством в организации**

Кафедра Экономики и управления производством

Дисциплина «Управление рисками»

Семестр 2

**ЗАДАНИЕ ДЛЯ ДОПОЛНИТЕЛЬНОГО ИТОГОВОГО КОНТРОЛЬНОГО  
ИСПЫТАНИЯ № 2**

1. Задание для проверки уровня «знать» – или 0, или 1, или 2 балла:  
**Совокупный общественный продукт и его структура. Исключение повторного счета.**

2. Задание для проверки уровня «уметь» – или 0, или 2 балл:

**Оценка критического уровня затрат и цены.**

4. Задача для проверки уровня «уметь» – или 0, или 2 балла:

**На основании приведенных данных малого предприятия, которое специализируется на производстве мягких игрушек, определите алгебраическим и графическим методами:**

- а) сумму переменных издержек, приходящихся на единицу продукции;
- б) величину постоянных расходов в данном релевантном диапазоне объема реализации продукции;
- в) величину общих издержек на запланированный объем производства продукции, равный 45 000 игрушек;
- г) минимальную цену единицы реализуемой продукции, при которой будет обеспечена полная окупаемость всех затрат при объеме выпуска 45 000 игрушек;
- д) цену, которая позволит обеспечить уровень рентабельности продаж 24%;
- е) критическую сумму постоянных затрат;
- ж) безубыточный объем продаж в натуральном и стоимостном выражении и зону безопасности предприятия при запланированном объеме выпуска продукции 45 000 шт. (аналитическим и графическим способами).

*При минимальной загрузке  
производственной  
мощности*

*При максимальной  
загрузке  
производственной  
мощности*

Объем реализации продукции, шт.	40000	50000
Общие затраты (постоянные и переменные), тыс. руб.	8800	10000
Цена, руб.	250	

**Критерии итоговой оценки за зачет:**

«зачтено» - при сумме баллов 2 или 3;

«не зачтено» - при сумме баллов 0 или 1.

Составители: Заведующий кафедрой ЭУП

И.В. Вякина

Заведующий кафедрой ЭУП

И.В. Вякина

Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение  
высшего образования  
«Тверской государственный технический университет»

Направление подготовки специалистов **27.04.02 Управление качеством**  
Профиль подготовки **Управление качеством в организации**

Кафедра Экономики и управления производством

Дисциплина «Управление рисками»

Семестр 2

**ЗАДАНИЕ ДЛЯ ДОПОЛНИТЕЛЬНОГО ИТОГОВОГО КОНТРОЛЬНОГО  
ИСПЫТАНИЯ № 3**

1. Задание для проверки уровня «ЗНАТЬ» – 0 или 1 балл:

**Нормальное распределение рисков.**

2. Задание для проверки уровня «уметь» – или 0, или 1 балл:

**Охарактеризуйте инвестиционные риски.**

4. Задача для проверки уровня «владеть» – или 0, или 1 балл:

**В таблице представлены данные о доходности альтернативных проектов по периодам. Выполните количественную оценку риска и доходности указанных проектов. Выберите наиболее оптимальный проект с точки зрения риска и доходности, обоснуйте свой выбор.**

ПРОЕКТ А						ПРОЕКТ В					
1	2	3	4	5	6	1	2	3	4	5	6
5	12	10	7	2	6	-10	-12	24	20	12	10

**Критерии итоговой оценки за зачет:**

«зачтено» - при сумме баллов 2 или 3;

«не зачтено» - при сумме баллов 0 или 1.

Составители: Заведующий кафедрой ЭУП

И.В. Вякина

Заведующий кафедрой ЭУП

И.В. Вякина

Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение  
высшего образования  
«Тверской государственный технический университет»

Направление подготовки специалистов **27.04.02 Управление качеством**  
Профиль подготовки **Управление качеством в организации**

Кафедра Экономики и управления производством

Дисциплина «Управление рисками»

Семестр 2

**ЗАДАНИЕ ДЛЯ ДОПОЛНИТЕЛЬНОГО ИТОГОВОГО КОНТРОЛЬНОГО  
ИСПЫТАНИЯ № 4**

1. Задание для проверки уровня «знать» – 0 или 1 балл: **Нормальное распределение рисков.**

2. Задание для проверки уровня «уметь» – или 0, или 1 балл:  
**Охарактеризуйте инвестиционные риски.**

4. Задача для проверки уровня «уметь» – или 0, или 1 балла:

**В таблице представлены данные о доходности альтернативных проектов по периодам. Выполните количественную оценку риска и доходности указанных проектов. Выберите наиболее оптимальный проект с точки зрения риска и доходности, обоснуйте свой выбор.**

ПРОЕКТ А						ПРОЕКТ В					
1	2	3	4	5	6	1	2	3	4	5	6
5	12	10	7	2	6	-10	-12	24	20	12	10

**Критерии итоговой оценки за зачет:**

«зачтено» - при сумме баллов 2 или 3;

«не зачтено» - при сумме баллов 0 или 1.

Составители: Заведующий кафедрой ЭУП

И.В. Вякина

Заведующий кафедрой ЭУП

И.В. Вякина

Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение  
высшего образования  
«Тверской государственный технический университет»

Направление подготовки специалистов **27.04.02 Управление качеством**  
Профиль подготовки **Управление качеством в организации**

Кафедра Экономики и управления производством

Дисциплина «Управление рисками»

Семестр 2

**ЗАДАНИЕ ДЛЯ ДОПОЛНИТЕЛЬНОГО ИТОГОВОГО КОНТРОЛЬНОГО  
ИСПЫТАНИЯ № 5**

1. Задание для проверки уровня «знать» – 0 или 1, балл:

**Классификация рисков.**

2. Задание для проверки уровня «уметь» – или 0, или 1 балл:

**Охарактеризуйте дисконтирование во времени.**

3. Задание для проверки уровня «уметь» - 0 или 1 балла:

**Выполните количественную оценку риска и доходности указанных проектов.**

Период	ПРОЕКТ А						ПРОЕКТ В					
	1	2	3	4	5	6	1	2	3	4	5	6
Доходность, %	2	4	3	10	8	6	2	8	4	4	8	7

**Критерии итоговой оценки за зачет:**

«зачтено» - при сумме баллов 2 или 3;

«не зачтено» - при сумме баллов 0 или 1.

Составители: Заведующий кафедрой ЭУП

И.В. Вякина

Заведующий кафедрой ЭУП

И.В. Вякина

Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение  
высшего образования  
**«Тверской государственный технический университет»**

Направление подготовки специалистов **27.04.02 Управление качеством**  
Профиль подготовки **Управление качеством в организации**

Кафедра Экономики и управления производством

Дисциплина «Управление рисками»

Семестр 2

**ЗАДАНИЕ ДЛЯ ДОПОЛНИТЕЛЬНОГО ИТОГОВОГО КОНТРОЛЬНОГО  
ИСПЫТАНИЯ № 6**

1. Задание для проверки уровня «знать» – 0 или 1 балла:

**Выбор оптимального варианта решения с помощью статистических оценок.**

2. Задание для проверки уровня «уметь» – или 0, или 1 балл:

**Охарактеризуйте ставки доходности рискованных активов.**

4. Задача для проверки уровня «уметь» – или 0, или 1 балла:

**В таблице представлены данные о доходности альтернативных проектов по периодам. Выполните количественную оценку риска и доходности указанных проектов. Выберите наиболее оптимальный проект с точки зрения риска и доходности, обоснуйте свой выбор. (В1.2)**

ПРОЕКТ А						ПРОЕКТ В					
1	2	3	4	5	6	1	2	3	4	5	6
12	15	14	10	8	4	2	4	16	18	14	10

**Критерии итоговой оценки за зачет:**

«зачтено» - при сумме баллов 2 или 3;

«не зачтено» - при сумме баллов 0 или 1.

Составители: Заведующий кафедрой ЭУП

И.В. Вякина

Заведующий кафедрой ЭУП

И.В. Вякина

Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение  
высшего образования  
«Тверской государственный технический университет»

Направление подготовки специалистов **27.04.02 Управление качеством**  
Профиль подготовки **Управление качеством в организации**

Кафедра Экономики и управления производством

Дисциплина «Управление рисками»

Семестр 2

**ЗАДАНИЕ ДЛЯ ДОПОЛНИТЕЛЬНОГО ИТОГОВОГО КОНТРОЛЬНОГО  
ИСПЫТАНИЯ № 7**

1. Задание для проверки уровня «ЗНАТЬ» – 0 или 1 балла:

**Оценка критического уровня затрат и цены.**

2. Задание для проверки уровня «уметь» – или 0, или 1 балл:

**Охарактеризуйте ставки доходности рискованных активов.**

3. Задача для проверки уровня «уметь» – или 0, или 1 балла:

**На основании приведенных данных малого предприятия, которое специализируется на производстве мягких игрушек, определите алгебраическим и графическим методами:**

- а) сумму переменных издержек, приходящихся на единицу продукции;
- б) величину постоянных расходов в данном релевантном диапазоне объема реализации продукции;
- в) величину общих издержек на запланированный объем производства продукции, равный 25 000 игрушек;
- г) минимальную цену единицы реализуемой продукции, при которой будет обеспечена полная окупаемость всех затрат при объеме выпуска 25 000 игрушек;
- д) цену, которая позволит обеспечить уровень рентабельности продаж 25%;
- е) критическую сумму постоянных затрат;
- ж) безубыточный объем продаж в натуральном и стоимостном выражении и зону безопасности предприятия при запланированном объеме выпуска продукции 25 000 шт. (аналитическим и графическим способами). (В1.2)

<i>Показатель</i>	<i>При минимальной загрузке производственной мощности</i>	<i>При максимальной загрузке производственной мощности</i>
Объем реализации продукции, шт.	20000	30000
Общие затраты (постоянные и переменные), тыс. руб.	10000	12500
Цена, руб.	600	600

**Критерии итоговой оценки за зачет:**

«зачтено» - при сумме баллов 2 или 3;

«не зачтено» - при сумме баллов 0 или 1.

Составители: Заведующий кафедрой ЭУП

И.В. Вякина

Заведующий кафедрой ЭУП

И.В. Вякина



Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение  
высшего образования  
«Тверской государственный технический университет»

Направление подготовки специалистов **27.04.02 Управление качеством**  
Профиль подготовки **Управление качеством в организации**

Кафедра Экономики и управления производством

Дисциплина «Управление рисками»

Семестр 2

**ЗАДАНИЕ ДЛЯ ДОПОЛНИТЕЛЬНОГО ИТОГОВОГО  
КОНТРОЛЬНОГО ИСПЫТАНИЯ № 8**

1. Задание для проверки уровня «знать» – 0 или 1 балл:

**Ставки доходности рискованных активов**

2. Задание для проверки уровня «уметь» – или 0, или 1 балл:

**Охарактеризуйте понятия доходность и риск.**

3. Задача для проверки уровня «уметь» – или 0, или 1 балл:

**В таблице представлены данные о доходности альтернативных проектов по периодам. Выполните количественную оценку риска и доходности указанных проектов. Выберите наиболее оптимальный проект с точки зрения риска и доходности, обоснуйте свой выбор. (В1.2)**

ПРОЕКТ А						ПРОЕКТ В					
1	2	3	4	5	6	1	2	3	4	5	6
2	17	8	18	15	15	24	4	2	7	20	18

**Критерии итоговой оценки за зачет:**

«зачтено» - при сумме баллов 2 или 3;

«не зачтено» - при сумме баллов 0 или 1.

Составители: Заведующий кафедрой ЭУП

И.В. Вякина

Заведующий кафедрой ЭУП

И.В. Вякина

Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение  
высшего образования  
«Тверской государственный технический университет»

Направление подготовки специалистов **27.04.02 Управление качеством**  
Профиль подготовки **Управление качеством в организации**

Кафедра Экономики и управления производством  
Дисциплина «Управление рисками»  
Семестр 2

**ЗАДАНИЕ ДЛЯ ДОПОЛНИТЕЛЬНОГО ИТОГОВОГО КОНТРОЛЬНОГО  
ИСПЫТАНИЯ № 9**

1. Задание для проверки уровня «знать» – 0 или 1 балл:

**Портфель Марковица.(31.2)**

2. Задание для проверки уровня «уметь» – или 0, или 1 балл:

**Охарактеризуйте понятия доходность и риск.**

4. Задача для проверки уровня «владеть» – или 0, или 1 балл:

**На основании приведенных данных малого предприятия, которое специализируется на производстве мягких игрушек, определите алгебраическим и графическим методами:**

- а) сумму переменных издержек, приходящихся на единицу продукции;
- б) величину постоянных расходов в данном релевантном диапазоне объема реализации продукции;
- в) величину общих издержек на запланированный объем производства продукции, равный 45 000 игрушек;
- г) минимальную цену единицы реализуемой продукции, при которой будет обеспечена полная окупаемость всех затрат при объеме выпуска 45 000 игрушек;
- д) цену, которая позволит обеспечить уровень рентабельности продаж 24%;
- е) критическую сумму постоянных затрат;
- ж) безубыточный объем продаж в натуральном и стоимостном выражении и зону безопасности предприятия при запланированном объеме выпуска продукции 45 000 шт. (аналитическим и графическим способами).

<i>Показатель</i>	<i>При минимальной загрузке производственной мощности</i>	<i>При максимальной загрузке производственной мощности</i>
Объем реализации продукции, шт.	30000	50000
Общие затраты (постоянные и переменные), тыс. руб.	8000	9000
Цена, руб.	200	200

**Критерии итоговой оценки за зачет:**

«зачтено» - при сумме баллов 2 или 3;

«не зачтено» - при сумме баллов 0 или 1.

Составители: Заведующий кафедрой ЭУП

И.В. Вякина

Заведующий кафедрой ЭУП

И.В. Вякина

Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение  
высшего образования  
«Тверской государственный технический университет»

Направление подготовки специалистов **27.04.02 Управление качеством**  
Профиль подготовки **Управление качеством в организации**

Кафедра Экономики и управления производством

Дисциплина «Управление рисками»

Семестр 2

**ЗАДАНИЕ ДЛЯ ДОПОЛНИТЕЛЬНОГО ИТОГОВОГО КОНТРОЛЬНОГО  
ИСПЫТАНИЯ № 10**

1. Задание для проверки уровня «знать» – 0 или 1 балл:

**Оценка инфляционных рисков.**

2. Задание для проверки уровня «уметь» – или 0, или 1 балл:

**Охарактеризуйте понятие банковские риски.**

3. Задача для проверки уровня «уметь» – или 0, или 1 балла:

**В таблице представлены данные о доходности альтернативных проектов по периодам. Выполните количественную оценку риска и доходности указанных проектов. Выберите наиболее оптимальный проект с точки зрения риска и доходности, обоснуйте свой выбор.**

ПРОЕКТ А					ПРОЕКТ В						
1	2	3	4	5	6	1	2	3	4	5	6
4	5	8	10	5	1	12	15	2	12	-8	2

**Критерии итоговой оценки за зачет:**

«зачтено» - при сумме баллов 2 или 3;

«не зачтено» - при сумме баллов 0 или 1.

Составители: Заведующий кафедрой ЭУП

И.В. Вякина

Заведующий кафедрой ЭУП

И.В. Вякина

Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение  
высшего образования  
«Тверской государственный технический университет»

Направление подготовки специалистов **27.04.02 Управление качеством**  
Профиль подготовки **Управление качеством в организации**

Кафедра Экономики и управления производством

Дисциплина «Управление рисками»

Семестр 2

**ЗАДАНИЕ ДЛЯ ДОПОЛНИТЕЛЬНОГО ИТОГОВОГО КОНТРОЛЬНОГО  
ИСПЫТАНИЯ № 11**

1. Задание для проверки уровня «знать» – 0 или 1 балл:

**Коэффициент бета. Премия за риск.**

2. Задание для проверки уровня «уметь» – или 0, или 1 балл:

**Охарактеризуйте понятие риска.**

3. Задача для проверки уровня «уметь» – или 0, или 1 балл:

**На основании приведенных данных малого предприятия, которое специализируется на производстве мягких игрушек, определите алгебраическим и графическим методами:**

- а) сумму переменных издержек, приходящихся на единицу продукции;**
- б) величину постоянных расходов в данном релевантном диапазоне объема реализации продукции;**
- в) величину общих издержек на запланированный объем производства продукции, равный 50 000 игрушек;**
- г) минимальную цену единицы реализуемой продукции, при которой будет обеспечена полная окупаемость всех затрат при объеме выпуска 50 000 игрушек;**
- д) цену, которая позволит обеспечить уровень рентабельности продаж 20%;**
- е) критическую сумму постоянных затрат;**
- ж) безубыточный объем продаж в натуральном и стоимостном выражении и зону безопасности предприятия при запланированном объеме выпуска продукции 50 000 шт. (аналитическим и графическим способами).**

<i>Показатель</i>	<i>При минимальной загрузке производственной мощности</i>	<i>При максимальной загрузке производственной мощности</i>
Объем реализации продукции, шт.	40000	60000
Общие затраты (постоянные и переменные), тыс. руб.	8400	9800
Цена, руб.	200	200

**Критерии итоговой оценки за зачет:**

«зачтено» - при сумме баллов 2 или 3;

«не зачтено» - при сумме баллов 0 или 1.

Составители: Заведующий кафедрой ЭУП

И.В. Вякина

Заведующий кафедрой ЭУП

И.В. Вякина

Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение  
высшего образования  
«Тверской государственный технический университет»

Направление подготовки специалистов **27.04.02 Управление качеством**  
Профиль подготовки **Управление качеством в организации**

Кафедра Экономики и управления производством

Дисциплина «Управление рисками»

Семестр 2

**ЗАДАНИЕ ДЛЯ ДОПОЛНИТЕЛЬНОГО ИТОГОВОГО КОНТРОЛЬНОГО  
ИСПЫТАНИЯ № 12**

1. Задание для проверки уровня «знать» – 0 или 1 балл:

**Оценка инвестиционных рисков.**

2. Задание для проверки уровня «уметь» – или 0, или 1 балл:

**Охарактеризуйте денежные потоки.**

4. Задача для проверки уровня «уметь» – или 0, или 1 балл:

**В таблице представлены данные о доходности альтернативных проектов по периодам. Выполните количественную оценку риска и доходности указанных проектов. Выберите наиболее оптимальный проект с точки зрения риска и доходности, обоснуйте свой выбор.**

ПРОЕКТ А						ПРОЕКТ В					
1	2	3	4	5	6	1	2	3	4	5	6
-5	4	16	12	7	13	8	7	8	8	10	6

**Критерии итоговой оценки за зачет:**

«зачтено» - при сумме баллов 2 или 3;

«не зачтено» - при сумме баллов 0 или 1.

Составители: Заведующий кафедрой ЭУП

И.В. Вякина

Заведующий кафедрой ЭУП

И.В. Вякина

Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение  
высшего образования  
«Тверской государственный технический университет»

Направление подготовки специалистов **27.04.02 Управление качеством**  
Профиль подготовки **Управление качеством в организации**

Кафедра Экономики и управления производством  
Дисциплина «Управление рисками»  
Семестр 2

**ЗАДАНИЕ ДЛЯ ДОПОЛНИТЕЛЬНОГО ИТОГОВОГО КОНТРОЛЬНОГО  
ИСПЫТАНИЯ № 13**

1. Задание для проверки уровня «ЗНАТЬ» – 0 или 1 балл:  
**Связь финансового и операционного рычага с совокупным риском.**
2. Задание для проверки уровня «уметь» – или 0, или 1 балл:

**Охарактеризуйте портфель Марковица.**

3. Задача для проверки уровня «уметь» – или 0, или 1 балл:

**На основании приведенных данных малого предприятия, которое специализируется на производстве мягких игрушек, определите алгебраическим и графическим методами:**

- а) сумму переменных издержек, приходящихся на единицу продукции;
- б) величину постоянных расходов в данном релевантном диапазоне объема реализации продукции;
- в) величину общих издержек на запланированный объем производства продукции, равный 60 000 игрушек;
- г) минимальную цену единицы реализуемой продукции, при которой будет обеспечена полная окупаемость всех затрат при объеме выпуска 60 000 игрушек;
- д) цену, которая позволит обеспечить уровень рентабельности продаж 24%;
- е) критическую сумму постоянных затрат;
- ж) безубыточный объем продаж в натуральном и стоимостном выражении и зону безопасности предприятия при запланированном объеме выпуска продукции 60 000 шт. (аналитическим и графическим способами).

<i>Показатель</i>	<i>При минимальной загрузке производственной мощности</i>	<i>При максимальной загрузке производственной мощности</i>
Объем реализации продукции, шт.	50000	70000
Общие затраты (постоянные и переменные), тыс. руб.	11800	14200
Цена, руб.	240	240

**Критерии итоговой оценки за зачет:**

- «зачтено» - при сумме баллов 2 или 3;  
«не зачтено» - при сумме баллов 0 или 1.

Составители: Заведующий кафедрой ЭУП

И.В. Вякина

Заведующий кафедрой ЭУП

И.В. Вякина

Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение  
высшего образования  
«Тверской государственный технический университет»

Направление подготовки специалистов **27.04.02 Управление качеством**  
Профиль подготовки **Управление качеством в организации**

Кафедра Экономики и управления производством

Дисциплина «Управление рисками»

Семестр 2

**ЗАДАНИЕ ДЛЯ ДОПОЛНИТЕЛЬНОГО ИТОГОВОГО КОНТРОЛЬНОГО  
ИСПЫТАНИЯ № 14**

1. Задание для проверки уровня «знать» – 0 или 1 балл:

**Проблема выбора инвестиционного портфеля.**

2. Задание для проверки уровня «уметь» – или 0, или 1 балл:

**Охарактеризуйте портфель Марковица.**

3. Задача для проверки уровня «уметь» – или 0, или 1 балла:

**В таблице представлены данные о доходности альтернативных проектов по периодам. Выполните количественную оценку риска и доходности указанных проектов. Выберите наиболее оптимальный проект с точки зрения риска и доходности, обоснуйте свой выбор.**

ПРОЕКТ А						ПРОЕКТ В					
1	2	3	4	5	6	1	2	3	4	5	6
12	16	20	22	15	8	-2	-4	10	40	25	24

**Критерии итоговой оценки за зачет:**

«зачтено» - при сумме баллов 2 или 3;

«не зачтено» - при сумме баллов 0 или 1.

Составители: Заведующий кафедрой ЭУП

И.В. Вякина

Заведующий кафедрой ЭУП

И.В. Вякина

Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение  
высшего образования  
«Тверской государственный технический университет»

Направление подготовки специалистов **27.04.02 Управление качеством**  
Профиль подготовки **Управление качеством в организации**

Кафедра Экономики и управления производством

Дисциплина «Управление рисками»

Семестр 2

**ЗАДАНИЕ ДЛЯ ДОПОЛНИТЕЛЬНОГО ИТОГОВОГО КОНТРОЛЬНОГО  
ИСПЫТАНИЯ № 15**

1. Задание для проверки уровня «ЗНАТЬ» – 0 или 1 балл:

**Формирование инвестиционного портфеля.**

2. Задание для проверки уровня «уметь» – или 0, или 1 балл:

**Охарактеризуйте портфель Марковица.**

3. Задача для проверки уровня «уметь» – или 0, или 1 балла:

**На основании приведенных данных малого предприятия, которое специализируется на производстве мягких игрушек, определите алгебраическим и графическим методами:**

- а) сумму переменных издержек, приходящихся на единицу продукции;
- б) величину постоянных расходов в данном релевантном диапазоне объема реализации продукции;
- в) величину общих издержек на запланированный объем производства продукции, равный 70 000 игрушек;
- г) минимальную цену единицы реализуемой продукции, при которой будет обеспечена полная окупаемость всех затрат при объеме выпуска 70 000 игрушек;
- д) цену, которая позволит обеспечить уровень рентабельности продаж 28%;
- е) критическую сумму постоянных затрат;
- ж) безубыточный объем продаж в натуральном и стоимостном выражении и зону безопасности предприятия при запланированном объеме выпуска продукции 70 000 шт. (аналитическим и графическим способами).

<i>Показатель</i>	<i>При минимальной загрузке производственной мощности</i>	<i>При максимальной загрузке производственной мощности</i>
Объем реализации продукции, шт.	60000	80000
Общие затраты (постоянные и переменные), тыс. руб.	9400	11500
Цена, руб.	150	150

**Критерии итоговой оценки за зачет:**

«зачтено» - при сумме баллов 2 или 3;

«не зачтено» - при сумме баллов 0 или 1.

Составители: Заведующий кафедрой ЭУП

И.В. Вякина

Заведующий кафедрой ЭУП

И.В. Вякина



Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение  
высшего образования  
«Тверской государственный технический университет»

Направление подготовки специалистов **27.04.02 Управление качеством**  
Профиль подготовки **Управление качеством в организации**

Кафедра Экономики и управления производством

Дисциплина «Управление рисками»

Семестр 2

**ЗАДАНИЕ ДЛЯ ДОПОЛНИТЕЛЬНОГО ИТОГОВОГО КОНТРОЛЬНОГО  
ИСПЫТАНИЯ № 16**

1. Задание для проверки уровня «ЗНАТЬ» – 0 или 1 балл:

**Денежные потоки. Дисконтирование во времени.**

2. Задание для проверки уровня «уметь» – или 0, или 1 балл:

**Охарактеризуйте методы оценки экономических рисков.**

2. Задача для проверки уровня «уметь» – или 0, или 1 балла:

**В таблице представлены данные о доходности альтернативных проектов по периодам. Выполните количественную оценку риска и доходности указанных проектов. Выберите наиболее оптимальный проект с точки зрения риска и доходности, обоснуйте свой выбор.**

ПРОЕКТ А						ПРОЕКТ В					
1	2	3	4	5	6	1	2	3	4	5	6
-8	10	6	12	14	2	6	6	8	8	4	4

**Критерии итоговой оценки за зачет:**

«зачтено» - при сумме баллов 2 или 3;

«не зачтено» - при сумме баллов 0 или 1.

Составители: Заведующий кафедрой ЭУП

И.В. Вякина

Заведующий кафедрой ЭУП

И.В. Вякина

Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение  
высшего образования  
«Тверской государственный технический университет»

Направление подготовки специалистов **27.04.02 Управление качеством**  
Профиль подготовки **Управление качеством в организации**

Кафедра Экономики и управления производством  
Дисциплина «Управление рисками»  
Семестр 2

**ЗАДАНИЕ ДЛЯ ДОПОЛНИТЕЛЬНОГО ИТОВОГО КОНТРОЛЬНОГО  
ИСПЫТАНИЯ № 17**

1. Задание для проверки уровня «ЗНАТЬ» – 0 или 1 балл:

**Методы оценки экономических рисков.**

2. Задание для проверки уровня «уметь» – или 0, или 1 балл:

**Охарактеризуйте риск ликвидности.**

3. Задача для проверки уровня «уметь» – или 0, или 1 балла:

**На основании приведенных данных малого предприятия, которое специализируется на производстве мягких игрушек, определите алгебраическим и графическим методами:**

- а) сумму переменных издержек, приходящихся на единицу продукции;
- б) величину постоянных расходов в данном релевантном диапазоне объема реализации продукции;
- в) величину общих издержек на запланированный объем производства продукции, равный 80 000 игрушек;
- г) минимальную цену единицы реализуемой продукции, при которой будет обеспечена полная окупаемость всех затрат при объеме выпуска 80 000 игрушек;
- д) цену, которая позволит обеспечить уровень рентабельности продаж 30%;
- е) критическую сумму постоянных затрат;
- ж) безубыточный объем продаж в натуральном и стоимостном выражении и зону безопасности предприятия при запланированном объеме выпуска продукции 80 000 шт. (аналитическим и графическим способами).

<i>Показатель</i>	<i>При минимальной загрузке производственной мощности</i>	<i>При максимальной загрузке производственной мощности</i>
Объем реализации продукции, шт.	70000	90000
Общие затраты (постоянные и переменные), тыс. руб.	9000	10500
Цена, руб.	160	160

**Критерии итоговой оценки за зачет:**

«зачтено» - при сумме баллов 2 или 3;

«не зачтено» - при сумме баллов 0 или 1.

Составители: Заведующий кафедрой ЭУП

И.В. Вякина

Заведующий кафедрой ЭУП

И.В. Вякина

Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение  
высшего образования  
«Тверской государственный технический университет»

Направление подготовки специалистов **27.04.02 Управление качеством**  
Профиль подготовки **Управление качеством в организации**

Кафедра Экономики и управления производством

Дисциплина «Управление рисками»

Семестр 2

**ЗАДАНИЕ ДЛЯ ДОПОЛНИТЕЛЬНОГО ИТОГОВОГО КОНТРОЛЬНОГО  
ИСПЫТАНИЯ № 18**

1. Задание для проверки уровня «ЗНАТЬ» – 0 или 1 балл:

**Вероятностная постановка принятия предпочтительных решений.**

2. Задание для проверки уровня «уметь» – или 0, или 1 балл:

**Охарактеризуйте банковские риски.**

4. Задача для проверки уровня «уметь» – или 0, или 1 балла:

**В таблице представлены данные о доходности альтернативных проектов по периодам. Выполните количественную оценку риска и доходности указанных проектов. Выберите наиболее оптимальный проект с точки зрения риска и доходности, обоснуйте свой выбор.**

ПРОЕКТ А						ПРОЕКТ В					
1	2	3	4	5	6	1	2	3	4	5	6
12	12	15	8	3	14	5	11	7	12	15	14

**Критерии итоговой оценки за зачет:**

«зачтено» - при сумме баллов 2 или 3;

«не зачтено» - при сумме баллов 0 или 1.

Составители: Заведующий кафедрой ЭУП

И.В. Вякина

Заведующий кафедрой ЭУП

И.В. Вякина

Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение  
высшего образования  
«Тверской государственный технический университет»

Направление подготовки специалистов **27.04.02 Управление качеством**  
Профиль подготовки **Управление качеством в организации**

Кафедра Экономики и управления производством  
Дисциплина «Управление рисками»  
Семестр 2

**ЗАДАНИЕ ДЛЯ ДОПОЛНИТЕЛЬНОГО ИТОГОВОГО КОНТРОЛЬНОГО  
ИСПЫТАНИЯ № 19**

1. Задание для проверки уровня «ЗНАТЬ» – 0 или 1 балл:

**Определение безубыточного объема продаж и зоны безопасности предприятия.**

2. Задание для проверки уровня «уметь» – или 0, или 1 балл:

**Охарактеризуйте банковские риски.**

3. Задача для проверки уровня «владеть» – или 0, или 1 балла:

**На основании приведенных данных малого предприятия, которое специализируется на производстве мягких игрушек, определите алгебраическим и графическим методами:**

- а) сумму переменных издержек, приходящихся на единицу продукции;
- б) величину постоянных расходов в данном релевантном диапазоне объема реализации продукции;
- в) величину общих издержек на запланированный объем производства продукции, равный 75 000 игрушек;
- г) минимальную цену единицы реализуемой продукции, при которой будет обеспечена полная окупаемость всех затрат при объеме выпуска 75 000 игрушек;
- д) цену, которая позволит обеспечить уровень рентабельности продаж 30%;
- е) критическую сумму постоянных затрат;
- ж) безубыточный объем продаж в натуральном и стоимостном выражении и зону безопасности предприятия при запланированном объеме выпуска продукции 75 000 шт. (аналитическим и графическим способами).

<i>Показатель</i>	<i>При минимальной загрузке производственной мощности</i>	<i>При максимальной загрузке производственной мощности</i>
Объем реализации продукции, шт.	60000	80000
Общие затраты (постоянные и переменные), тыс. руб.	12600	14400
Цена, руб.	300	300

**Критерии итоговой оценки за зачет:**

«зачтено» - при сумме баллов 2 или 3;

«не зачтено» - при сумме баллов 0 или 1.

Составители: Заведующий кафедрой ЭУП  
Заведующий кафедрой ЭУП

И.В. Вякина  
И.В. Вякина

Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение  
высшего образования  
«Тверской государственный технический университет»

Направление подготовки специалистов **27.04.02 Управление качеством**  
Профиль подготовки **Управление качеством в организации**

Кафедра Экономики и управления производством

Дисциплина «Управление рисками»

Семестр 2

**ЗАДАНИЕ ДЛЯ ДОПОЛНИТЕЛЬНОГО ИТОГОВОГО КОНТРОЛЬНОГО  
ИСПЫТАНИЯ № 20**

1. Задание для проверки уровня «знать» – 0 или 1 балл:

**Диверсифицированный портфель.**

2. Задание для проверки уровня «уметь» – или 0, или 1 балл:

**Охарактеризуйте банковские риски.**

3. Задача для проверки уровня «уметь» – или 0, или 1 балла:

**В таблице представлены данные о доходности альтернативных проектов по периодам. Выполните количественную оценку риска и доходности указанных проектов. Выберите наиболее оптимальный проект с точки зрения риска и доходности, обоснуйте свой выбор.**

ПРОЕКТ А						ПРОЕКТ В					
1	2	3	4	5	6	1	2	3	4	5	6
14	15	16	10	7	6	12	-5	5	16	24	16

**Критерии итоговой оценки за зачет:**

«зачтено» - при сумме баллов 2 или 3;

«не зачтено» - при сумме баллов 0 или 1.

Составители: Заведующий кафедрой ЭУП

И.В. Вякина

Заведующий кафедрой ЭУП

И.В. Вякина