

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

УТВЕРЖДАЮ:
Заведующий кафедрой ЭУП
_____ И.В. Вякина
(подпись)
«01» « 07 » 2022г.

ОЦЕНОЧНЫЕ СРЕДСТВА
промежуточной аттестации в форме экзамена по дисциплине
«Оценка рисков»

Направление подготовки бакалавров – **01.03.05 Статистика**

Направленность (профиль) – **Экономическая статистика и анализ данных**

Типы задач профессиональной деятельности:
организационно-управленческий; научно-аналитический

Разработаны в соответствии с рабочей программой по дисциплине
«Оценка рисков»

Разработчик: Вякина И.В.

Тверь 2022

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

Направление подготовки бакалавров – 01.03.05 Статистика
Направленность (профиль) – Экономическая статистика и анализ данных
Кафедра «Экономики и управления производством»
Дисциплина «Оценка рисков»
Семестр 7

ЭКЗАМЕНАЦИОННЫЙ БИЛЕТ № 1

1. Задание для проверки уровня «ЗНАТЬ» – 0 или 1, или 2 балла:

Раскройте понятие риска, его основные функции

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

На основании приведенных данных определите критические значения цены и затрат и выполните оценку уровня риска.

3. Задание для проверки уровня «УМЕТЬ» – 0 или 2 балла:

Выполните количественную оценку риска и доходности указанных проектов. Выберите наиболее оптимальный проект с точки зрения риска и доходности, обоснуйте свой выбор.

Критерии итоговой оценки за экзамен:

«отлично» - при сумме баллов 5 или 6;

«хорошо» - при сумме баллов 4;

«удовлетворительно» - при сумме баллов 3;

«неудовлетворительно» - при сумме баллов 0, 1 или 2.

Составитель:

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 бакалавров – 01.03.05 Статистика
Направленность (профиль) – Экономическая статистика и анализ данных
Кафедра «Экономики и управления производством»
Дисциплина «Оценка рисков»
Семестр 7

ЭКЗАМЕНАЦИОННЫЙ БИЛЕТ № 2

1. Задание для проверки уровня «ЗНАТЬ» – 0 или 1, или 2 балла:

Перечислите основные методы оценки экономических рисков

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

Рассчитайте изменение безубыточного объема продаж и зоны безопасности предприятия по нижеприведенным данным.

<i>Показатель</i>	<i>Уровень показателя</i>	
	<i>Прошлый период</i>	<i>Отчетный период</i>
Объем реализации продукции, шт.	5500	5000
Цена, руб.	210	230
Переменные затраты на изделие, руб.	95	100
Сумма постоянных затрат на весь выпуск, руб.	240 000	280 000

3. Задание для проверки уровня «УМЕТЬ» – 0 или 2 балла:

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
2	4	3	10	8	6	2	8	4	4	8	7

Критерии итоговой оценки за экзамен:

«отлично» - при сумме баллов 5 или 6;

«хорошо» - при сумме баллов 4;

«удовлетворительно» - при сумме баллов 3;

«неудовлетворительно» - при сумме баллов 0, 1 или 2.

Составитель:

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 бакалавров – 01.03.05 Статистика
Направленность (профиль) – Экономическая статистика и анализ данных
Кафедра «Экономики и управления производством»
Дисциплина «Оценка рисков»
Семестр 7

ЭКЗАМЕНАЦИОННЫЙ БИЛЕТ № 3

1. Задание для проверки уровня «ЗНАТЬ» – 0 или 1, или 2 балла:

Раскройте суть вероятностной постановки задачи принятия решений в условиях риска

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

Рассчитайте изменение безубыточного объема продаж и зоны безопасности предприятия по нижеприведенным данным.

<i>Показатель</i>	<i>Уровень показателя</i>	
	<i>Прошлый период</i>	<i>Отчетный период</i>
Объем реализации продукции, шт.	6000	5500
Цена, руб.	220	250
Переменные затраты на изделие, руб.	110	120
Сумма постоянных затрат на весь выпуск, руб.	280 000	400 000

3. Задание для проверки уровня «УМЕТЬ» – 0 или 2 балла:

Выполните количественную оценку риска и доходности указанных проектов. Выберите наиболее оптимальный проект с точки зрения риска и доходности, обоснуйте свой выбор.

Проект А					
Исход 1		Исход 2		Исход 3	
доход	вероятность	доход	вероятность	доход	вероятность
20	0,22	80	0,54	80	0,24
Проект В					
Исход 1		Исход 2		Исход 3	
доход	вероятность	доход	вероятность	доход	вероятность
-10	0,28	120	0,5	40	0,22

Критерии итоговой оценки за экзамен:

«отлично» - при сумме баллов 5 или 6;

«хорошо» - при сумме баллов 4;

«удовлетворительно» - при сумме баллов 3;

«неудовлетворительно» - при сумме баллов 0, 1 или 2.

Составитель:

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 бакалавров – 01.03.05 Статистика
Направленность (профиль) – Экономическая статистика и анализ данных
Кафедра «Экономики и управления производством»
Дисциплина «Оценка рисков»
Семестр 7

ЭКЗАМЕНАЦИОННЫЙ БИЛЕТ № 4

1. Задание для проверки уровня «ЗНАТЬ» – 0 или 1, или 2 балла:

Опишите статистические методы принятия решений в условиях риска

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

Рассчитайте изменение безубыточного объема продаж и зоны безопасности предприятия по нижеприведенным данным.

<i>Показатель</i>	<i>Уровень показателя</i>	
	<i>Прошлый период</i>	<i>Отчетный период</i>
Объем реализации продукции, шт.	6500	6000
Цена, руб.	230	260
Переменные затраты на изделие, руб.	125	105
Сумма постоянных затрат на весь выпуск, руб.	320 000	340 000

3. Задание для проверки уровня «УМЕТЬ» – 0 или 2 балла:

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	-10	12	24	5	8	12	10	3	5	6	15

Критерии итоговой оценки за экзамен:

«отлично» - при сумме баллов 5 или 6;

«хорошо» - при сумме баллов 4;

«удовлетворительно» - при сумме баллов 3;

«неудовлетворительно» - при сумме баллов 0, 1 или 2.

Составитель:

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 бакалавров – 01.03.05 Статистика
Направленность (профиль) – Экономическая статистика и анализ данных
Кафедра «Экономики и управления производством»
Дисциплина «Оценка рисков»
Семестр 7

ЭКЗАМЕНАЦИОННЫЙ БИЛЕТ № 5

1. Задание для проверки уровня «ЗНАТЬ» – 0 или 1, или 2 балла:

Дайте понятие нормального распределения и раскройте его роль в оценке риска.

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

Рассчитайте изменение безубыточного объема продаж и зоны безопасности предприятия по нижеприведенным данным.

Показатель	Уровень показателя	
	Прошлый период	Отчетный период
Объем реализации продукции, шт.	7000	6500
Цена, руб.	240	270
Переменные затраты на изделие, руб.	140	150
Сумма постоянных затрат на весь выпуск, руб.	410 000	400 000

3. Задание для проверки уровня «УМЕТЬ» – 0 или 2 балла:

Выполните количественную оценку риска и доходности указанных проектов. Выберите наиболее оптимальный проект с точки зрения риска и доходности, обоснуйте свой выбор.

Проект А					
Исход 1		Исход 2		Исход 3	
доход	вероятность	доход	вероятность	доход	вероятность
80	0,24	100	0,58	40	0,18
Проект В					
Исход 1		Исход 2		Исход 3	
доход	вероятность	доход	вероятность	доход	вероятность
20	0,26	170	0,4	30	0,34

Критерии итоговой оценки за экзамен:

«отлично» - при сумме баллов 5 или 6;

«хорошо» - при сумме баллов 4;

«удовлетворительно» - при сумме баллов 3;

«неудовлетворительно» - при сумме баллов 0, 1 или 2.

Составитель:

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 бакалавров – 01.03.05 Статистика
Направленность (профиль) – Экономическая статистика и анализ данных
Кафедра «Экономики и управления производством»
Дисциплина «Оценка рисков»
Семестр 7

ЭКЗАМЕНАЦИОННЫЙ БИЛЕТ № 6

1. Задание для проверки уровня «ЗНАТЬ» – 0 или 1, или 2 балла:

Опишите влияние факторов рыночного равновесия на изменение экономического риска

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

Рассчитайте изменение безубыточного объема продаж и зоны безопасности предприятия по нижеприведенным данным.

<i>Показатель</i>	<i>Уровень показателя</i>	
	<i>Прошлый период</i>	<i>Отчетный период</i>
Объем реализации продукции, шт.	6500	7000
Цена, руб.	250	240
Переменные затраты на изделие, руб.	150	155
Сумма постоянных затрат на весь выпуск, руб.	230 000	250 000

3. Задание для проверки уровня «УМЕТЬ» – 0 или 2 балла:

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 экзамен:

«отлично» - при сумме баллов 5 или 6;

«хорошо» - при сумме баллов 4;

«удовлетворительно» - при сумме баллов 3;

«неудовлетворительно» - при сумме баллов 0, 1 или 2.

Составитель:

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 бакалавров – 01.03.05 Статистика
Направленность (профиль) – Экономическая статистика и анализ данных
Кафедра «Экономики и управления производством»
Дисциплина «Оценка рисков»
Семестр 7

ЭКЗАМЕНАЦИОННЫЙ БИЛЕТ № 7

1. Задание для проверки уровня «ЗНАТЬ» – 0 или 1, или 2 балла:

Опишите влияние факторов времени, эластичности спроса и предложения и налогообложения на уровень коммерческого риска

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

Рассчитайте изменение безубыточного объема продаж и зоны безопасности предприятия по нижеприведенным данным.

<i>Показатель</i>	<i>Уровень показателя</i>	
	<i>Прошлый период</i>	<i>Отчетный период</i>
Объем реализации продукции, шт.	6000	7500
Цена, руб.	260	250
Переменные затраты на изделие, руб.	170	160
Сумма постоянных затрат на весь выпуск, руб.	190 000	300 000

3. Задание для проверки уровня «УМЕТЬ» – 0 или 2 балла:

Выполните количественную оценку риска и доходности указанных проектов. Выберите наиболее оптимальный проект с точки зрения риска и доходности, обоснуйте свой выбор.

Проект А					
Исход 1		Исход 2		Исход 3	
доход	вероятность	доход	вероятность	доход	вероятность
60	0,16	10	0,72	80	0,12
Проект В					
Исход 1		Исход 2		Исход 3	
доход	вероятность	доход	вероятность	доход	вероятность
20	0,24	25	0,4	30	0,36

Критерии итоговой оценки за экзамен:

«отлично» - при сумме баллов 5 или 6;

«хорошо» - при сумме баллов 4;

«удовлетворительно» - при сумме баллов 3;

«неудовлетворительно» - при сумме баллов 0, 1 или 2.

Составитель:

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 бакалавров – 01.03.05 Статистика
Направленность (профиль) – Экономическая статистика и анализ данных
Кафедра «Экономики и управления производством»
Дисциплина «Оценка рисков»
Семестр 7

ЭКЗАМЕНАЦИОННЫЙ БИЛЕТ № 8

1. Задание для проверки уровня «ЗНАТЬ» – 0 или 1, или 2 балла:

Раскройте суть функциональной зависимости между затратами и объемом производства

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

Рассчитайте изменение безубыточного объема продаж и зоны безопасности предприятия по нижеприведенным данным.

<i>Показатель</i>	<i>Уровень показателя</i>	
	<i>Прошлый период</i>	<i>Отчетный период</i>
Объем реализации продукции, шт.	5500	7000
Цена, руб.	270	250
Переменные затраты на изделие, руб.	170	155
Сумма постоянных затрат на весь выпуск, руб.	400 000	380 000

3. Задание для проверки уровня «УМЕТЬ» – 0 или 2 балла:

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	15	14	10	8	4	2	4	16	18	14	10

Критерии итоговой оценки за экзамен:

«отлично» - при сумме баллов 5 или 6;

«хорошо» - при сумме баллов 4;

«удовлетворительно» - при сумме баллов 3;

«неудовлетворительно» - при сумме баллов 0, 1 или 2.

Составитель:

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 бакалавров – 01.03.05 Статистика
Направленность (профиль) – Экономическая статистика и анализ данных
Кафедра «Экономики и управления производством»
Дисциплина «Оценка рисков»
Семестр 7

ЭКЗАМЕНАЦИОННЫЙ БИЛЕТ № 9

1. Задание для проверки уровня «ЗНАТЬ» – 0 или 1, или 2 балла:

Дайте определение безубыточного объема продаж и зоны безопасности предприятия и опишите методы их нахождения

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

Рассчитайте изменение безубыточного объема продаж и зоны безопасности предприятия по нижеприведенным данным.

Показатель	Уровень показателя	
	Прошлый период	Отчетный период
Объем реализации продукции, шт.	5000	5500
Цена, руб.	280	290
Переменные затраты на изделие, руб.	180	160
Сумма постоянных затрат на весь выпуск, руб.	320 000	375 000

3. Задание для проверки уровня «УМЕТЬ» – 0 или 2 балла:

Выполните количественную оценку риска и доходности указанных проектов. Выберите наиболее оптимальный проект с точки зрения риска и доходности, обоснуйте свой выбор.

Проект А					
Исход 1		Исход 2		Исход 3	
доход	вероятность	доход	вероятность	доход	вероятность
40	0,28	100	0,36	60	0,36
Проект В					
Исход 1		Исход 2		Исход 3	
доход	вероятность	доход	вероятность	доход	вероятность
-10	0,22	110	0,6	20	0,18

Критерии итоговой оценки за экзамен:

«отлично» - при сумме баллов 5 или 6;

«хорошо» - при сумме баллов 4;

«удовлетворительно» - при сумме баллов 3;

«неудовлетворительно» - при сумме баллов 0, 1 или 2.

Составитель:

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 бакалавров – 01.03.05 Статистика
Направленность (профиль) – Экономическая статистика и анализ данных
Кафедра «Экономики и управления производством»
Дисциплина «Оценка рисков»
Семестр 7

ЭКЗАМЕНАЦИОННЫЙ БИЛЕТ № 10

1. Задание для проверки уровня «ЗНАТЬ» – 0 или 1, или 2 балла:

Раскройте сущность дисконтирования денежных потоков во времени

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

Рассчитайте изменение безубыточного объема продаж и зоны безопасности предприятия по нижеприведенным данным.

<i>Показатель</i>	<i>Уровень показателя</i>	
	<i>Прошлый период</i>	<i>Отчетный период</i>
Объем реализации продукции, шт.	4500	6000
Цена, руб.	290	260
Переменные затраты на изделие, руб.	140	160
Сумма постоянных затрат на весь выпуск, руб.	270 000	300 000

3. Задание для проверки уровня «УМЕТЬ» – 0 или 2 балла:

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
2	17	8	18	15	15	24	4	2	7	20	18

Критерии итоговой оценки за экзамен:

«отлично» - при сумме баллов 5 или 6;

«хорошо» - при сумме баллов 4;

«удовлетворительно» - при сумме баллов 3;

«неудовлетворительно» - при сумме баллов 0, 1 или 2.

Составитель:

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 бакалавров – 01.03.05 Статистика
Направленность (профиль) – Экономическая статистика и анализ данных
Кафедра «Экономики и управления производством»
Дисциплина «Оценка рисков»
Семестр 7

ЭКЗАМЕНАЦИОННЫЙ БИЛЕТ № 11

1. Задание для проверки уровня «ЗНАТЬ» – 0 или 1, или 2 балла:
Раскройте суть проблемы выбора инвестиционного портфеля

2. Задание для проверки уровня «УМЕТЬ» - 0 или 2 балла:
Рассчитайте изменение безубыточного объема продаж и зоны безопасности предприятия по нижеприведенным данным.

<i>Показатель</i>	<i>Уровень показателя</i>	
	<i>Прошлый период</i>	<i>Отчетный период</i>
Объем реализации продукции, шт.	5000	4500
Цена, руб.	200	220
Переменные затраты на изделие, руб.	80	85
Сумма постоянных затрат на весь выпуск, руб.	350 000	360 000

3. Задание для проверки уровня «УМЕТЬ» – 0 или 2 балла:
Выполните количественную оценку риска и доходности указанных проектов. Выберите наиболее оптимальный проект с точки зрения риска и доходности, обоснуйте свой выбор.

Проект А					
Исход 1		Исход 2		Исход 3	
доход	вероятность	доход	вероятность	доход	вероятность
50	0,3	100	0,4	80	0,3
Проект В					
Исход 1		Исход 2		Исход 3	
доход	вероятность	доход	вероятность	доход	вероятность
70	0,2	80	0,58	90	0,22

Критерии итоговой оценки за экзамен:

- «отлично» - при сумме баллов 5 или 6;
- «хорошо» - при сумме баллов 4;
- «удовлетворительно» - при сумме баллов 3;
- «неудовлетворительно» - при сумме баллов 0, 1 или 2.

Составитель:

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 бакалавров – 01.03.05 Статистика
Направленность (профиль) – Экономическая статистика и анализ данных
Кафедра «Экономики и управления производством»
Дисциплина «Оценка рисков»
Семестр 7

ЭКЗАМЕНАЦИОННЫЙ БИЛЕТ № 12

1. Задание для проверки уровня «ЗНАТЬ» – 0 или 1, или 2 балла:

Раскройте понятие «Диверсифицированный портфель»

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

Рассчитайте изменение безубыточного объема продаж и зоны безопасности предприятия по нижеприведенным данным.

<i>Показатель</i>	<i>Уровень показателя</i>	
	<i>Прошлый период</i>	<i>Отчетный период</i>
Объем реализации продукции, шт.	5500	5000
Цена, руб.	210	230
Переменные затраты на изделие, руб.	95	100
Сумма постоянных затрат на весь выпуск, руб.	240 000	280 000

3. Задание для проверки уровня «УМЕТЬ» – 0 или 2 балла:

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 экзамен:

«отлично» - при сумме баллов 5 или 6;

«хорошо» - при сумме баллов 4;

«удовлетворительно» - при сумме баллов 3;

«неудовлетворительно» - при сумме баллов 0, 1 или 2.

Составитель:

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 бакалавров – 01.03.05 Статистика
Направленность (профиль) – Экономическая статистика и анализ данных
Кафедра «Экономики и управления производством»
Дисциплина «Оценка рисков»
Семестр 7

ЭКЗАМЕНАЦИОННЫЙ БИЛЕТ № 13

1. Задание для проверки уровня «ЗНАТЬ» – 0 или 1, или 2 балла:
Опишите ценовую модель оценки активов капитала

2. Задание для проверки уровня «УМЕТЬ» - 0 или 2 балла:
Рассчитайте изменение безубыточного объема продаж и зоны безопасности предприятия по нижеприведенным данным.

<i>Показатель</i>	<i>Уровень показателя</i>	
	<i>Прошлый период</i>	<i>Отчетный период</i>
Объем реализации продукции, шт.	6000	5500
Цена, руб.	220	250
Переменные затраты на изделие, руб.	110	120
Сумма постоянных затрат на весь выпуск, руб.	280 000	400 000

3. Задание для проверки уровня «УМЕТЬ» – 0 или 2 балла:
Выполните количественную оценку риска и доходности указанных проектов. Выберите наиболее оптимальный проект с точки зрения риска и доходности, обоснуйте свой выбор.

Проект А					
Исход 1		Исход 2		Исход 3	
доход	вероятность	доход	вероятность	доход	вероятность
70	0,32	120	0,6	100	0,08
Проект В					
Исход 1		Исход 2		Исход 3	
доход	вероятность	доход	вероятность	доход	вероятность
20	0,18	200	0,36	60	0,46

Критерии итоговой оценки за экзамен:

- «отлично» - при сумме баллов 5 или 6;
- «хорошо» - при сумме баллов 4;
- «удовлетворительно» - при сумме баллов 3;
- «неудовлетворительно» - при сумме баллов 0, 1 или 2.

Составитель:

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 бакалавров – 01.03.05 Статистика
Направленность (профиль) – Экономическая статистика и анализ данных
Кафедра «Экономики и управления производством»
Дисциплина «Оценка рисков»
Семестр 7

ЭКЗАМЕНАЦИОННЫЙ БИЛЕТ № 14

1. Задание для проверки уровня «ЗНАТЬ» – 0 или 1, или 2 балла:

Раскройте взаимосвязь доходности и риска

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

Рассчитайте изменение безубыточного объема продаж и зоны безопасности предприятия по нижеприведенным данным.

<i>Показатель</i>	<i>Уровень показателя</i>	
	<i>Прошлый период</i>	<i>Отчетный период</i>
Объем реализации продукции, шт.	6500	6000
Цена, руб.	230	260
Переменные затраты на изделие, руб.	125	105
Сумма постоянных затрат на весь выпуск, руб.	320 000	340 000

3. Задание для проверки уровня «УМЕТЬ» – 0 или 2 балла:

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 экзамен:

«отлично» - при сумме баллов 5 или 6;

«хорошо» - при сумме баллов 4;

«удовлетворительно» - при сумме баллов 3;

«неудовлетворительно» - при сумме баллов 0, 1 или 2.

Составитель:

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 бакалавров – 01.03.05 Статистика
Направленность (профиль) – Экономическая статистика и анализ данных
Кафедра «Экономики и управления производством»
Дисциплина «Оценка рисков»
Семестр 7

ЭКЗАМЕНАЦИОННЫЙ БИЛЕТ № 15

1. Задание для проверки уровня «ЗНАТЬ» – 0 или 1, или 2 балла:
Дайте понятия премии за риск и коэффициента бета.

2. Задание для проверки уровня «УМЕТЬ» - 0 или 2 балла:
Рассчитайте изменение безубыточного объема продаж и зоны безопасности предприятия по нижеприведенным данным.

Показатель	Уровень показателя	
	Прошлый период	Отчетный период
Объем реализации продукции, шт.	7000	6500
Цена, руб.	240	270
Переменные затраты на изделие, руб.	140	150
Сумма постоянных затрат на весь выпуск, руб.	410 000	400 000

3. Задание для проверки уровня «УМЕТЬ» – 0 или 2 балла:
Выполните количественную оценку риска и доходности указанных проектов.
Выберите наиболее оптимальный проект с точки зрения риска и доходности, обоснуйте свой выбор.

Проект А					
Исход 1		Исход 2		Исход 3	
доход	вероятность	доход	вероятность	доход	вероятность
-20	0,3	90	0,5	60	0,2
Проект В					
Исход 1		Исход 2		Исход 3	
доход	вероятность	доход	вероятность	доход	вероятность
50	0,2	60	0,6	30	0,2

Критерии итоговой оценки за экзамен:

- «отлично» - при сумме баллов 5 или 6;
- «хорошо» - при сумме баллов 4;
- «удовлетворительно» - при сумме баллов 3;
- «неудовлетворительно» - при сумме баллов 0, 1 или 2.

Составитель:

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 бакалавров – 01.03.05 Статистика
Направленность (профиль) – Экономическая статистика и анализ данных
Кафедра «Экономики и управления производством»
Дисциплина «Оценка рисков»
Семестр 7

ЭКЗАМЕНАЦИОННЫЙ БИЛЕТ № 16

1. Задание для проверки уровня «ЗНАТЬ» – 0 или 1, или 2 балла:

Опишите практику применения модели ценообразования активов капитала

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

Рассчитайте изменение безубыточного объема продаж и зоны безопасности предприятия по нижеприведенным данным.

<i>Показатель</i>	<i>Уровень показателя</i>	
	<i>Прошлый период</i>	<i>Отчетный период</i>
Объем реализации продукции, шт.	6500	7000
Цена, руб.	250	240
Переменные затраты на изделие, руб.	150	155
Сумма постоянных затрат на весь выпуск, руб.	230 000	250 000

3. Задание для проверки уровня «УМЕТЬ» – 0 или 2 балла:

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 экзамен:

«отлично» - при сумме баллов 5 или 6;

«хорошо» - при сумме баллов 4;

«удовлетворительно» - при сумме баллов 3;

«неудовлетворительно» - при сумме баллов 0, 1 или 2.

Составитель:

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 бакалавров – 01.03.05 Статистика
Направленность (профиль) – Экономическая статистика и анализ данных
Кафедра «Экономики и управления производством»
Дисциплина «Оценка рисков»
Семестр 7

ЭКЗАМЕНАЦИОННЫЙ БИЛЕТ № 17

1. Задание для проверки уровня «ЗНАТЬ» – 0 или 1, или 2 балла:

Раскройте суть финансовых рисков

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

Рассчитайте изменение безубыточного объема продаж и зоны безопасности предприятия по нижеприведенным данным.

<i>Показатель</i>	<i>Уровень показателя</i>	
	<i>Прошлый период</i>	<i>Отчетный период</i>
Объем реализации продукции, шт.	6000	7500
Цена, руб.	260	250
Переменные затраты на изделие, руб.	170	160
Сумма постоянных затрат на весь выпуск, руб.	190 000	300 000

3. Задание для проверки уровня «УМЕТЬ» – 0 или 2 балла:

Выполните количественную оценку риска и доходности указанных проектов. Выберите наиболее оптимальный проект с точки зрения риска и доходности, обоснуйте свой выбор.

Проект А					
Исход 1		Исход 2		Исход 3	
доход	вероятность	доход	вероятность	доход	вероятность
-40	0,28	100	0,5	60	0,22
Проект В					
Исход 1		Исход 2		Исход 3	
доход	вероятность	доход	вероятность	доход	вероятность
50	0,2	70	0,5	20	0,3

Критерии итоговой оценки за экзамен:

«отлично» - при сумме баллов 5 или 6;

«хорошо» - при сумме баллов 4;

«удовлетворительно» - при сумме баллов 3;

«неудовлетворительно» - при сумме баллов 0, 1 или 2.

Составитель:

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 бакалавров – 01.03.05 Статистика
Направленность (профиль) – Экономическая статистика и анализ данных
Кафедра «Экономики и управления производством»
Дисциплина «Оценка рисков»
Семестр 7

ЭКЗАМЕНАЦИОННЫЙ БИЛЕТ № 18

1. Задание для проверки уровня «ЗНАТЬ» – 0 или 1, или 2 балла:

Опишите связь финансового и операционного рычага с совокупным риском

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

Рассчитайте изменение безубыточного объема продаж и зоны безопасности предприятия по нижеприведенным данным.

<i>Показатель</i>	<i>Уровень показателя</i>	
	<i>Прошлый период</i>	<i>Отчетный период</i>
Объем реализации продукции, шт.	5500	7000
Цена, руб.	270	250
Переменные затраты на изделие, руб.	170	155
Сумма постоянных затрат на весь выпуск, руб.	400 000	380 000

3. Задание для проверки уровня «УМЕТЬ» – 0 или 2 балла:

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 экзамен:

«отлично» - при сумме баллов 5 или 6;

«хорошо» - при сумме баллов 4;

«удовлетворительно» - при сумме баллов 3;

«неудовлетворительно» - при сумме баллов 0, 1 или 2.

Составитель:

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 бакалавров – 01.03.05 Статистика
Направленность (профиль) – Экономическая статистика и анализ данных
Кафедра «Экономики и управления производством»
Дисциплина «Оценка рисков»
Семестр 7

ЭКЗАМЕНАЦИОННЫЙ БИЛЕТ № 19

1. Задание для проверки уровня «ЗНАТЬ» – 0 или 1, или 2 балла:

Раскройте понятие риска ликвидности

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

Рассчитайте изменение безубыточного объема продаж и зоны безопасности предприятия по нижеприведенным данным.

<i>Показатель</i>	<i>Уровень показателя</i>	
	<i>Прошлый период</i>	<i>Отчетный период</i>
Объем реализации продукции, шт.	5000	5500
Цена, руб.	280	290
Переменные затраты на изделие, руб.	180	160
Сумма постоянных затрат на весь выпуск, руб.	320 000	375 000

3. Задание для проверки уровня «УМЕТЬ» – 0 или 2 балла:

Выполните количественную оценку риска и доходности указанных проектов. Выберите наиболее оптимальный проект с точки зрения риска и доходности, обоснуйте свой выбор.

Проект А					
Исход 1		Исход 2		Исход 3	
доход	вероятность	доход	вероятность	доход	вероятность
100	0,26	30	0,36	80	0,38
Проект В					
Исход 1		Исход 2		Исход 3	
доход	вероятность	доход	вероятность	доход	вероятность
40	0,22	80	0,6	50	0,18

Критерии итоговой оценки за экзамен:

«отлично» - при сумме баллов 5 или 6;

«хорошо» - при сумме баллов 4;

«удовлетворительно» - при сумме баллов 3;

«неудовлетворительно» - при сумме баллов 0, 1 или 2.

Составитель:

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 бакалавров – 01.03.05 Статистика
Направленность (профиль) – Экономическая статистика и анализ данных
Кафедра «Экономики и управления производством»
Дисциплина «Оценка рисков»
Семестр 7

ЭКЗАМЕНАЦИОННЫЙ БИЛЕТ № 20

1. Задание для проверки уровня «ЗНАТЬ» – 0 или 1, или 2 балла:

Перечислите методы оценки инфляционных рисков

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

Рассчитайте изменение безубыточного объема продаж и зоны безопасности предприятия по нижеприведенным данным.

<i>Показатель</i>	<i>Уровень показателя</i>	
	<i>Прошлый период</i>	<i>Отчетный период</i>
Объем реализации продукции, шт.	4500	6000
Цена, руб.	290	260
Переменные затраты на изделие, руб.	140	160
Сумма постоянных затрат на весь выпуск, руб.	270 000	300 000

3. Задание для проверки уровня «УМЕТЬ» – 0 или 2 балла:

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 экзамен:

«отлично» - при сумме баллов 5 или 6;

«хорошо» - при сумме баллов 4;

«удовлетворительно» - при сумме баллов 3;

«неудовлетворительно» - при сумме баллов 0, 1 или 2.

Составитель:

Заведующий кафедрой ЭУП

_____ И.В. Вякина

Заведующий кафедрой ЭУП

_____ И.В. Вякина