

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

УТВЕРЖДАЮ:
Заведующий кафедрой ЭУП

(подпись)

д.э.н., доцент И.В. Вякина

«___» _____ 2022 г.

ОЦЕНОЧНЫЕ СРЕДСТВА
промежуточной аттестации в форме экзамена
по дисциплине

«Управление рисками»

Специальность: **38.05.01 Экономическая безопасность**

Направленность (специализация): **Экономико-правовое обеспечение
экономической безопасности**

Типы задач профессиональной деятельности:
информационно-аналитический, организационно-управленческий,
научно-исследовательский

Разработаны в соответствии с

Рабочей программой «Управление рисками»,

утвержденной 05.07.2022 г.

Разработчик: Вякина И.В.

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

Специальность – 38.05.01 Экономическая безопасность
Специализация подготовки – Экономико-правовое обеспечение
экономической безопасности
Кафедра «Экономика и управление производством»
Дисциплина «Управление рисками»
Семестр 6

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.

	ПРОЕКТ А						ПРОЕКТ В					
Период	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 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»

Специальность – 38.05.01 Экономическая безопасность
Специализация подготовки – Экономико-правовое обеспечение экономической безопасности
Кафедра «Экономика и управление производством»
Дисциплина «Управление рисками»
Семестр 6

ЭКЗАМЕНАЦИОННЫЙ БИЛЕТ № 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).

<i>Показатель</i>	<i>При минимальной загрузке производственной мощности</i>	<i>При максимальной загрузке производственной мощности</i>
Объем реализации продукции, шт.	40000	50000
Общие затраты (постоянные и переменные), тыс. руб.	8800	10000
Цена, руб.	250	250

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»

Специальность – 38.05.01 Экономическая безопасность
Специализация подготовки – Экономико-правовое обеспечение
экономической безопасности
Кафедра «Экономика и управление производством»
Дисциплина «Управление рисками»
Семестр 6

ЭКЗАМЕНАЦИОННЫЙ БИЛЕТ № 3

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

Нормальное распределение рисков.

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

Охарактеризуйте инвестиционные риски.

4. Задача для проверки уровня «владеть» – или 0, или 2 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					
Период	1	2	3	4	5	6	1	2	3	4	5	6
Доходность, %	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»

Специальность – 38.05.01 Экономическая безопасность
Специализация подготовки – Экономико-правовое обеспечение
экономической безопасности
Кафедра «Экономика и управление производством»
Дисциплина «Управление рисками»
Семестр 6

ЭКЗАМЕНАЦИОННЫЙ БИЛЕТ № 3

1. Задание для проверки уровня «знать» – 0 или 1, или 2 балла:
Нормальное распределение рисков.

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

4. Задача для проверки уровня «уметь» – или 0, или 2 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					
Период	1	2	3	4	5	6	1	2	3	4	5	6
Доходность, %	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»

Специальность – 38.05.01 Экономическая безопасность
Специализация подготовки – Экономико-правовое обеспечение экономической безопасности
Кафедра «Экономика и управление производством»
Дисциплина «Управление рисками»
Семестр 6

ЭКЗАМЕНАЦИОННЫЙ БИЛЕТ № 4

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

Классификация рисков.

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

Охарактеризуйте дисконтирование во времени.

3. Задание для проверки уровня «уметь» - 0 или 2 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 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»

Специальность – 38.05.01 Экономическая безопасность
Специализация подготовки – Экономико-правовое обеспечение
экономической безопасности
Кафедра «Экономика и управление производством»
Дисциплина «Управление рисками»
Семестр 6

ЭКЗАМЕНАЦИОННЫЙ БИЛЕТ № 5

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

Выбор оптимального варианта решения с помощью статистических оценок.

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

Охарактеризуйте ставки доходности рискованных активов.

4. Задача для проверки уровня «уметь» – или 0, или 2 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					
Период	1	2	3	4	5	6	1	2	3	4	5	6
Доходность, %	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»

Специальность – 38.05.01 Экономическая безопасность
Специализация подготовки – Экономико-правовое обеспечение экономической безопасности
Кафедра «Экономика и управление производством»
Дисциплина «Управление рисками»
Семестр 6

ЭКЗАМЕНАЦИОННЫЙ БИЛЕТ № 6

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

Оценка критического уровня затрат и цены.

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

Охарактеризуйте ставки доходности рискованных активов.

3. 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 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 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»

Специальность – 38.05.01 Экономическая безопасность
Специализация подготовки – Экономико-правовое обеспечение экономической
безопасности
Кафедра «Экономика и управление производством»
Дисциплина «Управление рисками»
Семестр 6

ЭКЗАМЕНАЦИОННЫЙ БИЛЕТ № 7

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

Ставки доходности рискованных активов

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

Охарактеризуйте понятия доходность и риск.

3. Задача для проверки уровня «уметь» – или 0, или 2 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					
Период	1	2	3	4	5	6	1	2	3	4	5	6
Доходность, %	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»

Специальность – 38.05.01 Экономическая безопасность
Специализация подготовки – Экономико-правовое обеспечение экономической безопасности
Кафедра «Экономика и управление производством»
Дисциплина «Управление рисками»
Семестр 6

ЭКЗАМЕНАЦИОННЫЙ БИЛЕТ № 8

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

Портфель Марковица.(31.2)

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

Охарактеризуйте понятия доходность и риск.

4. Задача для проверки уровня «владеть» – 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).

<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 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»

Специальность – 38.05.01 Экономическая безопасность
Специализация подготовки – Экономико-правовое обеспечение экономической безопасности
Кафедра «Экономика и управление производством»
Дисциплина «Управление рисками»
Семестр 6

ЭКЗАМЕНАЦИОННЫЙ БИЛЕТ № 9

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

Оценка инфляционных рисков.

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

Охарактеризуйте понятие банковские риски.

3. Задача для проверки уровня «уметь» – или 0, или 2 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					
Период	1	2	3	4	5	6	1	2	3	4	5	6
Доходность, %	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»

Специальность – 38.05.01 Экономическая безопасность
Специализация подготовки – Экономико-правовое обеспечение экономической безопасности
Кафедра «Экономика и управление производством»
Дисциплина «Управление рисками»
Семестр 6

ЭКЗАМЕНАЦИОННЫЙ БИЛЕТ № 10

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

Коэффициент бета. Премия за риск.

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

Охарактеризуйте понятие риска.

3. 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 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 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»

Специальность – 38.05.01 Экономическая безопасность
Специализация подготовки – Экономико-правовое обеспечение экономической безопасности
Кафедра «Экономика и управление производством»
Дисциплина «Управление рисками»
Семестр 6

ЭКЗАМЕНАЦИОННЫЙ БИЛЕТ № 11

1. Задание для проверки уровня «знать» – 0 или 1, или 2 балла: **Оценка инвестиционных рисков.**

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

Охарактеризуйте денежные потоки.

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

Период	ПРОЕКТ А						ПРОЕКТ В					
	1	2	3	4	5	6	1	2	3	4	5	6
Доходность, %	-5	4	16	12	7	13	8	7	8	8	10	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»

Специальность – 38.05.01 Экономическая безопасность
Специализация подготовки – Экономико-правовое обеспечение экономической безопасности
Кафедра «Экономика и управление производством»
Дисциплина «Управление рисками»
Семестр 6

ЭКЗАМЕНАЦИОННЫЙ БИЛЕТ № 12

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

Охарактеризуйте портфель Марковица.

3. 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 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 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»

Специальность – 38.05.01 Экономическая безопасность
Специализация подготовки – Экономико-правовое обеспечение экономической безопасности
Кафедра «Экономика и управление производством»
Дисциплина «Управление рисками»
Семестр 6

ЭКЗАМЕНАЦИОННЫЙ БИЛЕТ № 13

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

Период	ПРОЕКТ А						ПРОЕКТ В					
	1	2	3	4	5	6	1	2	3	4	5	6
Доходность, %	12	16	20	22	15	86	-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»

Специальность – 38.05.01 Экономическая безопасность
Специализация подготовки – Экономико-правовое обеспечение экономической безопасности
Кафедра «Экономика и управление производством»
Дисциплина «Управление рисками»
Семестр 6

ЭКЗАМЕНАЦИОННЫЙ БИЛЕТ № 14

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

Формирование инвестиционного портфеля. (31.2)

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

Охарактеризуйте портфель Марковица.

3. 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 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).

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

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»

Специальность – 38.05.01 Экономическая безопасность
Специализация подготовки – Экономико-правовое обеспечение экономической
безопасности
Кафедра «Экономика и управление производством»
Дисциплина «Управление рисками»
Семестр 6

ЭКЗАМЕНАЦИОННЫЙ БИЛЕТ № 15

1. Задание для проверки уровня «ЗНАТЬ» – 0 или 1, или 2 балла: **Денежные потоки. Дисконтирование во времени.**

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

Охарактеризуйте методы оценки экономических рисков.

2. Задача для проверки уровня «уметь» – или 0, или 2 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					
Период	1	2	3	4	5	6	1	2	3	4	5	6
Доходность, %	-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»

Специальность – 38.05.01 Экономическая безопасность
Специализация подготовки – Экономико-правовое обеспечение экономической безопасности
Кафедра «Экономика и управление производством»
Дисциплина «Управление рисками»
Семестр 6

ЭКЗАМЕНАЦИОННЫЙ БИЛЕТ № 16

1. Задание для проверки уровня «ЗНАТЬ» – 0 или 1, или 2 балла: **Методы оценки экономических рисков.**

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

Охарактеризуйте риск ликвидности.

3. 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 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 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»

Специальность – 38.05.01 Экономическая безопасность
Специализация подготовки – Экономико-правовое обеспечение экономической
безопасности
Кафедра «Экономика и управление производством»
Дисциплина «Управление рисками»
Семестр 6

ЭКЗАМЕНАЦИОННЫЙ БИЛЕТ № 17

1. Задание для проверки уровня «ЗНАТЬ» – 0 или 1, или 2 балла: **Вероятностная постановка принятия предпочтительных решений.**

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

Охарактеризуйте банковские риски.

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

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

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

Специальность – 38.05.01 Экономическая безопасность
Специализация подготовки – Экономико-правовое обеспечение экономической безопасности
Кафедра «Экономика и управление производством»
Дисциплина «Управление рисками»
Семестр 6

ЭКЗАМЕНАЦИОННЫЙ БИЛЕТ № 18

1. Задание для проверки уровня «ЗНАТЬ» – 0 или 1, или 2 балла: **Определение безубыточного объема продаж и зоны безопасности предприятия.**

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

Охарактеризуйте банковские риски.

3. Задача для проверки уровня «владеть» – 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 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 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»

Специальность – 38.05.01 Экономическая безопасность
Специализация подготовки – Экономико-правовое обеспечение экономической
безопасности
Кафедра «Экономика и управление производством»
Дисциплина «Управление рисками»
Семестр 6

ЭКЗАМЕНАЦИОННЫЙ БИЛЕТ № 19

1. Задание для проверки уровня «знать» – 0 или 1, или 2 балла:
Диверсифицированный портфель.

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

3. Задача для проверки уровня «уметь» – или 0, или 2 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					
Период	1	2	3	4	5	6	1	2	3	4	5	6
Доходность, %	14	15	16	10	7	6	12	-5	5	16	24	16

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»

Специальность – 38.05.01 Экономическая безопасность
Специализация подготовки – Экономико-правовое обеспечение экономической безопасности
Кафедра «Экономика и управление производством»
Дисциплина «Управление рисками»
Семестр 6

ЭКЗАМЕНАЦИОННЫЙ БИЛЕТ № 20

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

Инвестиционные риски.

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

Охарактеризуйте банковские риски.

3. 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 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 18%;
- 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.	50000	90000
Общие затраты (постоянные и переменные), тыс. руб.	12000	15000
Цена, руб.	200	200

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

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

УТВЕРЖДАЮ:
Заведующий кафедрой ЭУП

(подпись)

д.э.н., доцент И.В. Вякина
«___» _____ 2022 г.

ОЦЕНОЧНЫЕ СРЕДСТВА
промежуточной аттестации в форме курсового проекта
по дисциплине

«Управление рисками»

Специальность: **38.05.01 Экономическая безопасность**

Направленность (специализация): **Экономико-правовое обеспечение
экономической безопасности**

Типы задач профессиональной деятельности:
информационно-аналитический, организационно-управленческий,
научно-исследовательский

Разработаны в соответствии с

Рабочей программой «Управление рисками»,

утвержденной 05.07.2022 г.

Разработчик: Вякина И.В.

Тверь 2022

Компетенция, закрепленная за дисциплиной в ОХОП:

ОПК-2. Способен осуществлять сбор, анализ и использование данных хозяйственного, налогового и бюджетного учетов, учетной документации, бухгалтерской (финансовой), налоговой и статистической отчетности в целях оценки эффективности и прогнозирования финансово-хозяйственной деятельности хозяйствующего субъекта, а также выявления, предупреждения, локализации и нейтрализации внутренних и внешних угроз и рисков.

Индикаторы компетенции, закреплённые за дисциплиной в ОХОП:

ИОПК-2.3. Выявляет внутренние и внешние угрозы и риски хозяйствующего субъекта, разрабатывает меры по их предупреждению, локализации и нейтрализации

Показатели оценивания индикаторов достижения компетенций

Знать:

З1.1. Содержание, принципы и методы прогнозирования угроз на основе обработки финансовой, бухгалтерской и иной экономической информации.

З1.2. Задачи, принципы и методы организации мониторинга рисков в социально-экономических системах.

Уметь:

У1.1. Выбирать инструментальные средства для обработки финансовой, бухгалтерской и иной экономической информации с целью прогнозирования возможных угроз.

У1.2. Идентифицировать риски в экономической и социальной сферах.

Разделы расчетно-пояснительной записки курсового проекта по дисциплине «Управление рисками»

№ критерия	Содержание критерия	Баллы по шкале уровня
1	Степень раскрытия темы: <ul style="list-style-type: none">– способность самостоятельно определить исследовательскую проблему;– способность самостоятельно осмыслить и проанализировать исследовательскую проблему;– умение применить при выполнении курсового проекта теоретические знания, полученные в рамках изучения дисциплины;– умение обосновать актуальность темы курсового проекта;– умение формулировать цель, задачи, объект и предмет исследования	Выше базового – 2 Базовый – 1 Ниже базового – 0
2	Полнота охвата научной литературы: <ul style="list-style-type: none">– способность к всестороннему рассмотрению данных различных научных исследований по изучаемой проблеме;– способность к объективной интерпретации данных различных научных исследований по изучаемой проблеме;- способность использовать теоретические знания и практические навыки бухгалтерского учета при анализе финансовой отчетности в рамках исследуемого объекта.	Выше базового – 2 Базовый – 1 Ниже базового – 0
3	Использование нормативных актов:	Наличие - 1

	<ul style="list-style-type: none"> – способность использования актуальных нормативных актов по теме исследования; – умение применять знания законодательства в рамках исследуемого объекта; - умение применять классификацию законодательных перечней в рамках темы исследования. 	Отсутствие - 0
4	<p style="text-align: center;">Индивидуальность подхода к написанию курсовой работы:</p> <ul style="list-style-type: none"> – умение выявлять проблемы бухгалтерского учета в организациях различных сфер деятельности и разработать рекомендации по их решению; – способность к разработке рекомендаций по предотвращению отрицательных результатов хозяйственной деятельности организации и выявлению внутривозможных резервов обеспечения ее финансовой устойчивости; – умение применять на практике нормативное регулирование бухгалтерского учета; – умение применять методики бухгалтерского финансового учета на субъектах хозяйственной деятельности; – разработка рекомендаций возможных действий по управлению предприятием, с учетом выявленных внутривозможных резервов, как действующим и развивающимся; – способность к анализу нормативной, плановой, отчетной и учетной документации предприятий, с целью определения параметров проектируемой стратегии организации; – умение применять понятийный аппарат при обосновании выводов по проделанной исследовательской работе; – способность использовать на практике передовой отечественный и зарубежный опыт бухгалтерской деятельности при составлении рабочего плана счетов в рамках исследуемого объекта. 	Выше базового – 2 Базовый – 1 Ниже базового – 0
5	<p style="text-align: center;">Последовательность и логика изложения материала:</p> <ul style="list-style-type: none"> – способность к подбору и анализу литературы по теме исследования, ее проработке и способности логически верно, аргументированно и последовательно формулировать полученные выводы по теме; – соблюдение правил структуризации и логики излагаемого материала; – способность логично и грамотно излагать собственные выводы; – способность формулировать аргументированные умозаключения в соответствии с поставленными во введении целью и задачами курсового проекта. 	Выше базового – 2 Базовый – 1 Ниже базового – 0
6	<p style="text-align: center;">Качество оформления, язык, стиль и грамматический уровень работы:</p> <ul style="list-style-type: none"> – способность выражать собственные умозаключения по проработанному материалу в рамках исследуемой 	Выше базового – 2 Базовый – 1 Ниже базового – 0

	<p>темы и воплощать идеи и умозаключения превращая материал в эксклюзивный с авторской уникальностью текста не менее 60%;</p> <ul style="list-style-type: none"> – соответствовать требованиям ГОСТ, предъявляемым к оформлению текстовых документов; – способность использования экономической терминологии при изложении материала в рамках выбранной темы исследования; – корректная интерпретация представляемых результатов в области бухгалтерской и финансовой отчетности; – умение применять полученные знания естественнонаучных дисциплин при расчетах финансовых показателей в рамках проводимого исследования; – умение оформить курсовой проект в соответствии с предъявляемыми требованиями. 	
7	<p>Использование иллюстрированного материала (рисунки, таблицы, графики, диаграммы и т.д.)</p> <ul style="list-style-type: none"> – достаточность иллюстрированного материала для пояснения излагаемого текста; – умение представить цифровые данные в сгруппированном и систематизированном виде; – умение представления иллюстрированного материала только по существу и отсутствие иллюстративного материала не имеющего прямого отношения к излагаемому вопросу; – умение использования графиков в исследовательской работе как для анализа, так и для повышения наглядности иллюстрируемого материала; – умение оформления материалов вспомогательного характера в приложении к курсовому проекту. 	<p>Выше базового – 2 Базовый – 1 Ниже базового – 0</p>

Критерии итоговой оценки за курсовой проект: «отлично» – при сумме баллов от 11 до 13; «хорошо» – при сумме баллов от 8 до 10; «удовлетворительно» – при сумме баллов от 6 до 7; «неудовлетворительно» – при сумме баллов менее 6, а также если в проекте выявлено недобросовестное заимствование (оригинальность текста менее 60%) или структура работы не соответствует представленным выше требованиям.