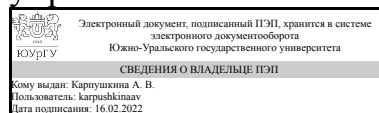


ЮЖНО-УРАЛЬСКИЙ ГОСУДАРСТВЕННЫЙ УНИВЕРСИТЕТ

УТВЕРЖДАЮ:
Директор института
Высшая школа экономики и
управления



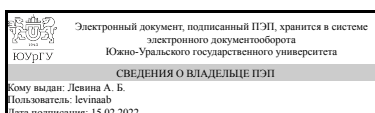
А. В. Карпушкина

РАБОЧАЯ ПРОГРАММА

дисциплины 1.Ф.М1.12 Оценка и предотвращение рисков во внешнеэкономической деятельности
для направления 38.04.01 Экономика
уровень Магистратура
магистерская программа Международный бизнес
форма обучения очная
кафедра-разработчик Менеджмент

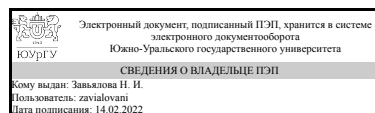
Рабочая программа составлена в соответствии с ФГОС ВО по направлению подготовки 38.04.01 Экономика, утверждённым приказом Минобрнауки от 11.08.2020 № 939

Зав.кафедрой разработчика,
к.экон.н., доц.



А. Б. Левина

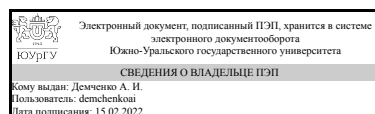
Разработчик программы,
старший преподаватель



Н. И. Завьялова

СОГЛАСОВАНО

Руководитель образовательной
программы
к.техн.н., доц.



А. И. Демченко

1. Цели и задачи дисциплины

Целью изучения дисциплины «Оценка и предотвращение рисков в сфере ВЭД» является изучение теоретических представлений о современной философии риск-ориентированного управления в сфере ВЭД и освоение новых методов оценки и управления рисками на интегральной основе, раскрывающих взаимосвязь регулирования рисков на макро- и микроуровнях. **знать:** теоретические, методологические и организационные подходы к построению системы риск-менеджмента в корпоративном и банковском секторе, методы риск-менеджмента и принятия управленческих решений; основные финансовые инструменты, применяемые при хеджировании рисков ВЭД; использование современных IT-технологий в риск-менеджменте; нормы законодательства, касающиеся внешнеэкономической деятельности, валютного контроля, налогообложения, таможенного регулирования и т.п. для избегания правовых рисков; **уметь:** оценивать кредитные, процентные, курсовые, страновые, региональные и иные риски, связанные с международной экономической деятельностью; оценивать потенциал эффективности предлагаемых инструментов снижения финансовых рисков; **владеть:** методиками расчета основных показателей, характеризующих ликвидность и финансовую устойчивость компании, осуществляющей ВЭД; способами поиска, подбора и обработки информации, необходимой для экономического анализа, в том числе с помощью информационных технологий.

Краткое содержание дисциплины

Тема 1. Понятие, сущность и классификация рисков. Особенности рисков в сфере ВЭД Риски как объективное проявление неопределенности экономической среды. Сущность экономического риска. Классификация рисков. Объект и субъекты управления риском. Две стороны риска: опасность и возможность. Основные черты риска: альтернативность, противоречивость и неопределенность. Объективная природа риска. Чистые риски. Коммерческие риски. Стимулирующая функция риска. Защитная функция риска. Компенсирующая функция риска. Социально-экономическая функция риска. Особенности рисков в сфере ВЭД. Тема 2. Современные системы риск-менеджмента в корпоративном и банковском секторе Характеристика фундаментальных концепций финансового менеджмента, отражающих воздействие риска. Концепция альтернативных затрат и оценка временной стоимости денежного потока с учетом риска: методы и модели определения ставки дисконтирования и ее связь с риском. Логика развития системы регулирования рисков ВЭД и современных подходов к их оценке. Тема 3. Нормативно-правовое регулирование рисков Финансовые, коммерческие, правовые, организационные и операционные риски при осуществлении внешнеэкономической деятельности. Внешние и внутренние факторы возникновения финансовых рисков при осуществлении международных торгово-экономических сделок. Виды финансовых рисков международного бизнеса (кредитные, процентные, валютные, налоговые, рыночные, страновые, риски упущенной выгоды и др.). Классификация финансовых рисков по возможным последствиям (допустимый риск, критический риск, катастрофический риск). Инструменты хеджирования финансовых рисков международного бизнеса. Профессиональные стандарты управления рисками. Международный опыт макропруденциального регулирования и перспективы ее внедрения в России. Тема 4. Методологические основы построения системы риск-

менеджмента и его инструментарий Принципы и «золотые правила» риск-менеджмента. Способы управления риском (избежание риска, принятие риска, передача риск или его части, снижение степени риска). Основные инструменты снижения степени риска: диверсификация; лимитирование; страхование (передача риска); самострахование (создание резервов); хеджирование финансовой нестабильности). Характеристика основных компонентов системы риск-менеджмента участников ВЭД. Тема 5. Методы оценки и управления финансовыми рисками ВЭД Международная практика оценки риска. Гэп-анализ. VaR (Value-at-Risk – «стоимость, подверженная риску»). Метод Монте-Карло. Shortfall. Аналитические методы оценки рыночного риска. Метод исторического моделирования. Stress Testing (стресс-тестирование). Однофакторные и многофакторные стресс-тесты. Стресс-тесты - исторические и гипотетические. От оценки риска - к его страхованию. Тема 6. Методы агрегации рисков ВЭД Понятие и методы агрегации распределения рисков ВЭД. Комплексный характер влияния рисков. Основные направления и порядок агрегации рисков: по экономической природе риска, по направлениям (секторам) ВЭД и др. Особенности агрегации рисков и риск-менеджмента на уровне подразделений, роль трансфертного ценообразования. Математические основы агрегации рисков. Методы и особенности валидации моделей. Тема 7. Интегрированный риск-менеджмент в системе управления корпоративного и банковского сектора Интегрированный риск менеджмент и внутренние процедуры оценки достаточности капитала финансового института. Построение системы управления в координатах риск-доходность. Концепция риск-ориентированного управления в системе стратегического менеджмента и необходимость формирования внутренних процедур оценки достаточности капитала. Сущность и основное содержание внутренних процедур оценки достаточности капитала и их связь с процессами стратегического планирования и управления.

2. Компетенции обучающегося, формируемые в результате освоения дисциплины

Планируемые результаты освоения ОП ВО (компетенции)	Планируемые результаты обучения по дисциплине
ПК-3 Способен разрабатывать маркетинговую стратегию организации на международных рынках, реализовывать программы развития международных рынков, оценивать экономические результаты реализации стратегии	Знает: подходы к оценке и учету рисков внешнеэкономической деятельности Умеет: оценивать экономические результаты реализации стратегии организации с учетом фактора неопределенности и риска Имеет практический опыт: использования методов организации мониторинга рисков в сфере внешнеэкономической деятельности
ПК-7 Способен разрабатывать и внедрять системы управления рисками на основе исследования финансово-экономических рисков в деятельности хозяйствующих субъектов, оценивать их результативность и социально-экономическую эффективность на региональном и отраслевом уровнях	Знает: современные принципы и методы формирования систем управления рисками, методологию и содержание процесса управления рисками внешнеэкономической деятельности Умеет: выявлять, оценивать и анализировать уровни рисков внешнеэкономической деятельности на основе финансово-экономических результатов деятельности организации Имеет практический опыт: использования

	методов оценки рисков при реализации стратегий развития организации, прогнозирования последствий принятия управленческих решений в кризисных ситуациях
--	--

3. Место дисциплины в структуре ОП ВО

Перечень предшествующих дисциплин, видов работ учебного плана	Перечень последующих дисциплин, видов работ
Международные коммерческие операции, Учебная практика, ознакомительная практика (2 семестр)	Не предусмотрены

Требования к «входным» знаниям, умениям, навыкам студента, необходимым при освоении данной дисциплины и приобретенным в результате освоения предшествующих дисциплин:

Дисциплина	Требования
Международные коммерческие операции	Знает: методы и инструменты управленческой аналитики, направленные на оценку финансово-экономических рисков, основные документы, регламентирующие международные коммерческие операции Умеет: осуществлять анализ финансово-экономических рисков на основе прогнозирования динамики ключевых показателей деятельности организации, разработать проект международной коммерческой операции в соответствии с выбранной стратегией Имеет практический опыт: разработки стратегии управления рисками организаций в области внешнеэкономической деятельности, разработки международных коммерческих контрактов
Учебная практика, ознакомительная практика (2 семестр)	Знает: способы использования информационно-коммуникационных технологий; правила перевода профессиональных и научных текстов, методы проведения исследований международных рынков и анализа полученных результатов Умеет: использовать системы сбора необходимой информации для расширения внешних связей и обмена опытом; аргументировано излагать свою позицию, использовать вспомогательные средства (графики, диаграммы, презентации и т.д.), применять методы экономического и стратегического анализа экономических агентов и рынков в глобальной среде, оценивать и обосновывать результаты исследований международных рынков Имеет практический опыт: чтения профессиональной и научной литературы в оригинале; осуществления деловой переписки и поддержки электронных коммуникаций, интерпретирования полученных результатов для принятия управленческих

решений, представления результатов проведенного исследования в виде научного отчета

4. Объём и виды учебной работы

Общая трудоемкость дисциплины составляет 3 з.е., 108 ч., 56,5 ч. контактной работы

Вид учебной работы	Всего часов	Распределение по семестрам в часах	
		Номер семестра	
		4	
Общая трудоёмкость дисциплины	108	108	
<i>Аудиторные занятия:</i>	48	48	
Лекции (Л)	36	36	
Практические занятия, семинары и (или) другие виды аудиторных занятий (ПЗ)	12	12	
Лабораторные работы (ЛР)	0	0	
<i>Самостоятельная работа (СРС)</i>	51,5	51,5	
с применением дистанционных образовательных технологий	0		
Подготовка к промежуточному контролю	23	23	
выполнение домашних заданий по текущему контролю	28,5	28,5	
Консультации и промежуточная аттестация	8,5	8,5	
Вид контроля (зачет, диф.зачет, экзамен)	-	экзамен	

5. Содержание дисциплины

№ раздела	Наименование разделов дисциплины	Объем аудиторных занятий по видам в часах			
		Всего	Л	ПЗ	ЛР
1	Понятие, сущность и классификация рисков. Особенности рисков в сфере ВЭД	6	4	2	0
2	Современные системы риск-менеджмента в корпоративном и банковском секторе	8	6	2	0
3	Нормативно-правовое регулирование рисков	8	6	2	0
4	Методологические основы построения системы риск-менеджмента и его инструментарий	8	6	2	0
5	Методы оценки и управления финансовыми рисками ВЭД	8	6	2	0
6	Методы агрегации рисков ВЭД	6	4	2	0
7	Интегрированный риск-менеджмент в системе управления корпоративного и банковского сектора	4	4	0	0

5.1. Лекции

№ лекции	№ раздела	Наименование или краткое содержание лекционного занятия	Кол-во часов
1,2	1	Понятие, сущность и классификация рисков. Особенности рисков в сфере	4

		ВЭД	
3,4,5	2	Современные системы риск-менеджмента в корпоративном и банковском секторе	6
6,7,8	3	Нормативно-правовое регулирование рисков	6
9,10,11	4	Методологические основы построения системы риск-менеджмента и его инструментарий	6
12,13,14	5	Методы оценки и управления финансовыми рисками ВЭД	6
15,16	6	Методы агрегации рисков ВЭД	4
17,18	7	Интегрированный риск-менеджмент в системе управления корпоративного и банковского сектора	4

5.2. Практические занятия, семинары

№ занятия	№ раздела	Наименование или краткое содержание практического занятия, семинара	Кол-во часов
1	1	Понятие, сущность и классификация рисков. Особенности рисков в сфере ВЭД	2
2	2	Современные системы риск-менеджмента в корпоративном и банковском секторе	2
3	3	Нормативно-правовое регулирование рисков	2
4	4	Методологические основы построения системы риск-менеджмента и его инструментарий	2
5	5	Методы оценки и управления финансовыми рисками ВЭД	2
6	6	Методы агрегации рисков ВЭД	2

5.3. Лабораторные работы

Не предусмотрены

5.4. Самостоятельная работа студента

Выполнение СРС			
Подвид СРС	Список литературы (с указанием разделов, глав, страниц) / ссылка на ресурс	Семестр	Кол-во часов
Подготовка к промежуточному контролю	ЭУМД осн. лит 1,2, мет.пос. для СРС , доп. лит, 1,2 Оценка и предотвращение рисков во внешнеэкономической деятельности: методические указания по дисциплине/ Составитель Завьялова Н.И., Челябинск, 2022	4	23
выполнение домашних заданий по текущему контролю	ЭУМД, Оценка и предотвращение рисков во внешнеэкономической деятельности: методические указания по дисциплине/ Составитель Завьялова Н.И., Челябинск, 2022	4	28,5

6. Текущий контроль успеваемости, промежуточная аттестация

Контроль качества освоения образовательной программы осуществляется в соответствии с Положением о балльно-рейтинговой системе оценивания результатов учебной деятельности обучающихся.

6.1. Контрольные мероприятия (КМ)

№ КМ	Се-местр	Вид контроля	Название контрольного мероприятия	Вес	Макс. балл	Порядок начисления баллов	Учитывается в ПА
1	4	Текущий контроль	КРМ 1 Тестирование	1	15	Проведение тестирования студентов после изучения разделов дисциплины включает компьютерное тестирование. При оценивании результатов мероприятия используется балльно-рейтинговая система оценивания результатов учебной деятельности обучающихся. Тест состоит из 15 вопросов, позволяющих оценить сформированность компетенций. На ответы отводится 30 минут. Правильный ответ на вопрос соответствует 1 баллу. Неправильный ответ на вопрос соответствует 0 баллов Максимальное количество баллов за тестирование – 15.	экзамен
2	4	Текущий контроль	КРМ 2 Тестирование	1	15	Проведение тестирования студентов после изучения разделов дисциплины включает компьютерное тестирование. При оценивании результатов мероприятия используется балльно-рейтинговая система оценивания результатов учебной деятельности обучающихся. Тест состоит из 15 вопросов, позволяющих оценить сформированность компетенций. На ответы отводится 30 минут. Правильный ответ на вопрос соответствует 1 баллу. Неправильный ответ на вопрос соответствует 0 баллов Максимальное количество баллов за тестирование – 15.	экзамен
3	4	Текущий контроль	КРМ 3 Устный опрос	1	6	В начале занятия студенты отвечают на вопросы по материалу предыдущего занятия. Студенту задаются 3 вопроса из списка контрольных вопросов. Время, отведенное на опрос -15 минут Правильный ответ на вопрос соответствует 2 баллам. Частично правильный ответ соответствует 1 баллу. Неправильный ответ на вопрос соответствует 0 баллов. Максимальное количество баллов – 6. Весовой коэффициент мероприятия (за каждый опрос) – 1	экзамен
4	4	Текущий контроль	КРМ 4 Письменный опрос.	1	6	Письменный опрос осуществляется на последнем занятии изучаемого раздела. Студенту задаются 3 вопроса из списка контрольных вопросов. Время, отведенное	экзамен

					на опрос -15 минут Правильный ответ на вопрос соответствует 2 баллам. Частично правильный ответ соответствует 1 баллу. Неправильный ответ на вопрос соответствует 0 баллов. Максимальное количество баллов – 6. Весовой коэффициент мероприятия (за каждый письменный опрос) – 1		
5	4	Промежуточная аттестация	Экзамен	-	40	На экзамена при оценивании результатов мероприятия используется балльно-рейтинговая система оценивания результатов учебной деятельности обучающихся/ По результатам экзамена выставляется оценка в ведомость и зачетную книжку студента. Экзамен проводится в форме итогового компьютерного тестирования, по результатам которого студент может получить максимально 40 баллов. Итоговое тестирование содержит 40 вопросов, затрагивающих все разделы курса и позволяющих оценить сформированность компетенций. На ответы отводится 1 час. Правильный ответ на вопрос соответствует 1 баллу. Неправильный ответ на вопрос соответствует 0 баллов. Максимальное количество баллов – 40. После прохождения итогового тестирования, его результаты суммируются с результатами, полученными в течение учебного семестра. В результате складывается совокупный рейтинг студента, который дифференцируется в оценку и проставляется в ведомость, зачетную книжку студента.	экзамен

6.2. Процедура проведения, критерии оценивания

Вид промежуточной аттестации	Процедура проведения	Критерии оценивания
экзамен	На экзамена при оценивании результатов мероприятия используется балльно-рейтинговая система оценивания результатов учебной деятельности обучающихся/ По результатам экзамена выставляется оценка в ведомость и зачетную книжку студента. Экзамен проводится в форме итогового компьютерного тестирования, по результатам которого студент может получить максимально 40 баллов. Итоговое тестирование содержит 40 вопросов, затрагивающих все разделы курса и позволяющих оценить сформированность компетенций. На ответы отводится 1 час. Правильный ответ на вопрос соответствует 1 баллу. Неправильный ответ на вопрос соответствует 0 баллов. Максимальное количество баллов – 40.	В соответствии с пп. 2.5, 2.6 Положения

	После прохождения итогового тестирования, его результаты суммируются с результатами, полученными в течение учебного семестра. В результате складывается совокупный рейтинг студента, который дифференцируется в оценку и проставляется в ведомость, зачетную книжку студента.	
--	---	--

6.3. Оценочные материалы

Компетенции	Результаты обучения	№ КМ				
		1	2	3	4	5
ПК-3	Знает: подходы к оценке и учету рисков внешнеэкономической деятельности	+		++	++	
ПК-3	Умеет: оценивать экономические результаты реализации стратегии организации с учетом фактора неопределенности и риска	+		++	++	
ПК-3	Имеет практический опыт: использования методов организации мониторинга рисков в сфере внешнеэкономической деятельности			++	++	
ПК-7	Знает: современные принципы и методы формирования систем управления рисками, методологию и содержание процесса управления рисками внешнеэкономической деятельности		+		++	
ПК-7	Умеет: выявлять, оценивать и анализировать уровни рисков внешнеэкономической деятельности на основе финансово-экономических результатов деятельности организации				++	
ПК-7	Имеет практический опыт: использования методов оценки рисков при реализации стратегий развития организации, прогнозирования последствий принятия управленческих решений в кризисных ситуациях				++	

Фонды оценочных средств по каждому контрольному мероприятию находятся в приложениях.

7. Учебно-методическое и информационное обеспечение дисциплины

Печатная учебно-методическая документация

а) основная литература:

1. Балдин, К. В. Риск-менеджмент [Текст] учеб. пособие для вузов по специальности "Менеджмент организаций" К. В. Балдин. - М.: ЭКСМО, 2006. - 364, [1] с. ил.
2. Лясковская, Е. А. Риск-менеджмент на российских предприятиях [Текст] учеб. пособие Е. А. Лясковская ; Юж.-Урал. гос. ун-т, Каф. Экономика, упр. и инвестиции ; ЮУрГУ. - Челябинск: Издательский Центр ЮУрГУ, 2011. - 74, [1] с. электрон. версия
3. Рогов, М. А. Риск-менеджмент [Текст] М. А. Рогов. - М.: Финансы и статистика, 2001. - 118,[1] с. ил.

б) дополнительная литература:

1. Лясковская, Е. А. Риск-менеджмент на российских предприятиях [Текст] учеб. пособие Е. А. Лясковская ; Юж.-Урал. гос. ун-т, Каф. Экономика, упр. и инвестиции ; ЮУрГУ. - Челябинск: Издательский Центр ЮУрГУ, 2011. - 74, [1] с. электрон. версия
2. Ступаков, В. С. Риск-менеджмент [Текст] учеб. пособие по специальности "Финансы и кредит" В. С. Ступаков, Г. С. Токаренко. - М.: Финансы и статистика, 2007. - 281, [1] с. ил.

в) отечественные и зарубежные журналы по дисциплине, имеющиеся в библиотеке:
Не предусмотрены

г) методические указания для студентов по освоению дисциплины:

1. Оценка и предотвращение рисков во внешнеэкономической деятельности: методические указания по дисциплине/ Составитель Завьялова Н.И., Челябинск: Издательский Центр ЮУрГУ, 2022

из них: учебно-методическое обеспечение самостоятельной работы студента:

1. Оценка и предотвращение рисков во внешнеэкономической деятельности: методические указания по дисциплине/ Составитель Завьялова Н.И., Челябинск: Издательский Центр ЮУрГУ, 2022

Электронная учебно-методическая документация

№	Вид литературы	Наименование ресурса в электронной форме	
1	Методические пособия для самостоятельной работы студента	Электронный каталог ЮУрГУ	Кабытова, Л. Б. Товарная номенклатура внешнеэкономической деятельности. URL: http://virtua.lib.susu.ru/cgi-bin/gw_2011_1_4/chameleon?sessionid=2020022701383809745&skin=
2	Основная литература	eLIBRARY.RU	Бушенева Ю.И. Внешнеэкономическая деятельность: учеб. пособие.
3	Дополнительная литература	eLIBRARY.RU	Сметанина, Т. П. Экономика и внешнеэкономическая деятельность.
4	Основная литература	Образовательная платформа Юрайт	Сенотрусова, С. В. Внешнеэкономическая деятельность организации.
5	Дополнительная литература	Образовательная платформа Юрайт	Лузина, Т. В. Запреты и ограничения внешнеэкономической деятельности. URL: https://urait.ru/bcode/494305

Перечень используемого программного обеспечения:

1. Microsoft-Office(бессрочно)
2. ФГАОУ ВО "ЮУрГУ (НИУ)"-Портал "Электронный ЮУрГУ" (<https://edu.susu.ru>)(бессрочно)

Перечень используемых профессиональных баз данных и информационных справочных систем:

1. ООО "ГарантУралСервис"-Гарант(бессрочно)

8. Материально-техническое обеспечение дисциплины

Вид занятий	№ ауд.	Основное оборудование, стенды, макеты, компьютерная техника, предустановленное программное обеспечение, используемое для различных видов занятий
Экзамен	450 (2)	Компьютерная техника с выходом в Интернет и доступом в электронную информационно-образовательную среду, наборы

		демонстрационного материала, проектор, маркерная доска
Практические занятия и семинары	450 (2)	Компьютерная техника с выходом в Интернет и доступом в электронную информационно-образовательную среду, наборы демонстрационного материала, проектор, маркерная доска
Лекции	450 (2)	Компьютерная техника с выходом в Интернет и доступом в электронную информационно-образовательную среду, наборы демонстрационного материала, проектор, маркерная доска
Самостоятельная работа студента	450 (2)	Компьютерная техника с выходом в Интернет и доступом в электронную информационно-образовательную среду, наборы демонстрационного материала, проектор, маркерная доска