

МИНИСТЕРСТВО НАУКИ И ВЫСШЕГО ОБРАЗОВАНИЯ РОССИЙСКОЙ
ФЕДЕРАЦИИ

Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение
высшего образования
«Забайкальский государственный университет»
(ФГБОУ ВО «ЗабГУ»)

Юридический факультет
Кафедра Международного права и международных связей

УТВЕРЖДАЮ:

Декан факультета

Юридический факультет

Макаров Андрей
Владимирович

«___» _____ 20___
г.

РАБОЧАЯ ПРОГРАММА ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛЯ)

Б1.В.ДВ.01.01 Риск-менеджмент
на 180 часа(ов), 5 зачетных(ые) единиц(ы)
для направления подготовки (специальности) 38.04.01 - Экономика

составлена в соответствии с ФГОС ВО, утвержденным приказом
Министерства образования и науки Российской Федерации от
«___» _____ 20___ г. №___

Профиль – Международная торговля (для набора 2023)
Форма обучения: Очная

1. Организационно-методический раздел

1.1 Цели и задачи дисциплины (модуля)

Цель изучения дисциплины:

формирование у студентов практических навыков выявления, классификации, диагностики, анализа, оценки рисков, имеющих место в международной торговле и выработке мер по управлению ими.

Задачи изучения дисциплины:

1. Изучение принципов построения системы управления риском в организации, занимающейся международной торговлей
2. Получение студентами навыков выбора методов управления рисками, оценки эффективности проводимых мероприятий по минимизации рисков;
3. Овладение навыками диагностирования, классификации, оценки, анализа рисков компании, использования инструментов риск-менеджмента

1.2. Место дисциплины (модуля) в структуре ОП

Дисциплина «Риск-менеджмент» относится к числу дисциплин по выбору части, формируемой участниками образовательных отношений (Б1.В.ДВ.01.01) и преподается в первом семестре первого курса.

1.3. Объем дисциплины (модуля) с указанием трудоемкости всех видов учебной работы

Общая трудоемкость дисциплины (модуля) составляет 5 зачетных(ые) единиц(ы), 180 часов.

Виды занятий	Семестр 1	Всего часов
Общая трудоемкость		180
Аудиторные занятия, в т.ч.	34	34
Лекционные (ЛК)	17	17
Практические (семинарские) (ПЗ, СЗ)	17	17
Лабораторные (ЛР)	0	0
Самостоятельная работа студентов (СРС)	110	110
Форма промежуточной аттестации в семестре	Экзамен	36
Курсовая работа (курсовой		

2. Перечень планируемых результатов обучения по дисциплине, соотнесенных с планируемыми результатами освоения образовательной программы

Планируемые результаты освоения образовательной программы		Планируемые результаты обучения по дисциплине
Код и наименование компетенции	Индикаторы достижения компетенции, формируемые в рамках дисциплины	Дескрипторы: знания, умения, навыки и (или) опыт деятельности
ОПК-3	ОПК-3.1.Находиторганизационно-управленческие решения (оперативного и стратегического уровней), анализирует, интерпретирует необходимую информацию в целях принятия управленческих решений;	<p>Знать: сущность, разновидности неопределенности и риска, методы выявления рисков, методы оценки рисков.</p> <p>Уметь: оперировать основными понятиями риск-менеджмента, анализировать, интерпретировать собранную информацию и использовать её для поиска организационно-управленческих решений.</p> <p>Владеть: терминологией риск-менеджмента, навыками выявления рисков, анализа, интерпретации собранной информации, применения современных информационных технологий и программных средств, используемых при оценке рисков.</p>
ОПК-3	ОПК-3.2. Принимает организационно-управленческие решения в профессиональной деятельности, применяет и несет за них ответственность.	<p>Знать: сущность, разновидности неопределенности и риска, алгоритм принятия управленческих решений в сфере управления рисками и методы управления рисками</p> <p>Уметь: оперировать основными понятиями риск-менеджмента, использовать алгоритм принятия управленческих решений в сфере управления рисками, обосновать управленческие</p>

		<p>решения в сфере управления рисками</p> <p>Владеть: терминологией риск-менеджмента, навыками использования алгоритма принятия решений в сфере управления рисками, разработки стратегического подхода к управлению рисками</p>
ПК-4	<p>ПК-4.1. Осуществляет планирование внешнеэкономической деятельности организации с учетом мировых тенденций развития международной торговли и национальных условий экспорта и импорта</p>	<p>Знать: роль, место и особенности понятия риска в международных операциях компаний, источники информации для анализа рисков, методы выявления, диагностики рисков, алгоритм разработки плана управления рисками с учетом тенденций развития международной торговли и национальных условий экспорта и импорта</p> <p>Уметь: собирать, анализировать, обобщать информацию по рискованной ситуации, а также формировать план действий по управлению рисками с учетом тенденций развития международной торговли и национальных условий экспорта и импорта</p> <p>Владеть: Методами сравнительного анализа и оценки различного рода рисков, навыками разработки плана действий в сфере управления рисками с учетом тенденций развития международной торговли и национальных условий экспорта и импорта</p>
ПК-4	<p>ПК-4.2. Разрабатывает прогноз конъюнктуры мирового и регионального рынков выбранного товара, прогнозирует (моделирует) перспективы продвижения товара на внешних рынках</p>	<p>Знать: основы теории риска в контексте продвижения товаров на внешних рынках.</p> <p>Уметь: применять основы теории рисков в контексте оценки</p>

		<p>перспектив продвижения товаров на внешних рынках.</p> <p>Владеть: навыками использования основ теории рисков в контексте оценки перспектив продвижения товаров на внешних рынках.</p>
ПК-4	<p>ПК-4.3. Выявляет, анализирует и учитывает риски при осуществлении внешнеэкономической деятельности организации</p>	<p>Знать: разновидности рисков, имеющих место при осуществлении внешнеэкономической</p> <p>Уметь: классифицировать, выявлять, анализировать, учитывать риски, имеющие место при осуществлении внешнеэкономической деятельности.</p> <p>Владеть: навыками классификации, выявления, анализа, учета рисков, имеющих место при осуществлении внешнеэкономической деятельности</p>
ПК-4	<p>ПК-4.4. Реализует мероприятия по получению юридически значимой информации и использует ее в интересах предупреждения и пресечения рисков при выборе торгового партнера, заключении внешнеторгового контракта и его транспортно-логистического обеспечения</p>	<p>Знать: источники поиска юридически значимой информации, методы её анализа, направления использования для предупреждения, пресечения рисков при выборе торгового партнера, заключении внешнеторгового контракта и его транспортно-логистического обеспечения</p> <p>Уметь: собирать, анализировать, обобщать, использовать информацию по рискованной ситуации, в том числе юридически значимую, для предупреждения, пресечения рисков при выборе торгового партнера, заключении внешнеторгового контракта и его транспортно-логистического обеспечения</p> <p>Владеть: навыками сбора,</p>

	обработки и использования юридически значимой информации для предупреждения и пресечения рисков при выборе торгового партнера, заключении внешнеторгового контракта и его транспортно-логистического обеспечения
--	--

3. Содержание дисциплины

3.1. Разделы дисциплины и виды занятий

3.1 Структура дисциплины для очной формы обучения

Модуль	Номер раздела	Наименование раздела	Темы раздела	Всего часов	Аудиторные занятия			С Р С
					Л К	П З (С З)	Л Р	
1	1.1	Основы риск-менеджмент в международной торговле	Введение в риск-менеджмент Ключевые риски в международной торговле	22	3	3	0	16
2	2.1	Методы выявления и анализа рисков	Выявление рисков Сравнительные методы анализа рисков	42	4	4	0	34
	2.2	Методы оценки и управления рисками	Оценка рисков Методы управления рисками	80	10	10	0	60
Итого				144	17	17	0	110

3.2. Содержание разделов дисциплины

3.2.1. Лекционные занятия, содержание и объем в часах

Модуль	Номер раздела	Тема	Содержание	Трудоемкость (в часах)
1	1.1	Введение в риск-менеджмент	Понятие риска, его основные элементы и черты. Виды неопределённости. Типология рисков	1

			по различным классификационным признакам. Структурные характеристики риска. Объект и субъект управления в риск-менеджменте. Основные цели, задачи, функции, реализуемые в риск-менеджменте. Принципы риск-менеджмента. Современные теории риска.	
	1.1	Ключевые риски в между народной торговле	Предпринимательский риск: структура, классификация по причинам, характеру деятельности, объектам, времени, факторам возникновения, характеру учета и последствий, сфере возникновения. Внутренние и внешние предпринимательские риски. Экономический, финансовый, валютный риск как виды рисков, связанные с внешнеэкономической деятельностью фирмы. Политический риск, его понятие и содержание. Инвестиционные риски. Кредитные и налоговые риски.	2
2	2.1	Выявление рисков	Состав и последовательность работ по идентификации и ранжированию рисков. Методы выявления рисков. Построение карты рисков компании. Различные варианты построения рискографии организации.	2
	2.1	Сравнительные методы анализа рисков	Виды сравнительных методов анализа страновых рисков, их достоинства и недостатки, возможность и особенности применения. Рейтинговые методы анализа, их сущность и методика. Виды рейтингов, методика их составления и публикации. Структура рейтингов "BERI" и "Credit Risk International". Интегральные и специальные рейтинги. Особенности методики "Delphi" в проведении экспертных оценок в рейтингах. Примеры страновых рейтингов, рекомендации по использованию. Проблемы составления рейтингов в международном бизнесе.	2

			<p>Мониторинг рейтинговых позиций. Примеры использования рейтингов при принятии решений Матричные методы сравнительного анализа, их достоинства и недостатки. Практика применения матричных методов. Примеры использования матричных методов.</p>	
	2.2	Оценка рисков	<p>Способы измерения рисков. Волатильность и чувствительность как меры риска. Методология VaR и направления его применения. Расчет VaR в некоторых специальных случаях: метод дельта-гамма-вега. Бэктестирование VaR моделей. Современные тенденции измерения рисков. Подходы к вычислению стоимостной метрики рисков: методология Corporate Metrics, методология NERA, методология, основанная на регрессионном анализе: алгоритм вычисления, область применения.</p>	6
	2.2	Методы управления рисками	<p>Алгоритм управления рисками. Методы управления рисками: избежание, лимитирование, передача (трансфер), хеджирование, диверсификация, страхование, самострахование, повышение уровня информационного обеспечения, принятие, объединение. Сущность хеджирования как процесса минимизации ценовых и валютных рисков инвестирования. Хеджирование на повышение и понижение. Инструменты хеджирования. Форвардные и фьючерсные контракты. Процентные и валютные свопы. Опционы. Коллопционы и путопционы. Стоимость хеджирования: явная и неявная. Управление рисками процентных ставок с использованием различных финансовых инструментов. Оценка эффективности проведения антирисковой программы.</p>	4

3.2.2. Практические занятия, содержание и объем в часах

Модуль	Номер раздела	Тема	Содержание	Трудоемкость (в часах)
1	1.1	Введение в риск-менеджмент	Тестирование и презентация докладов на темы: природные риски и их влияние на экономику, специфика управления демографическими рисками, инновационные риски, общая характеристика отраслевых и структурных рисков.	1
	1.1	Ключевые риски в международной торговле	Тестирование и презентация докладов на темы: современные формы международного бизнеса, принципы их выбора, концепция мирового портфеля как основа современных теорий страновых рисков, преимущества и недостатки различных форм организации зарубежных операций, управление зарубежной деятельностью компании, типы организационных структур управления, их преимущества и недостатки, источники поиска юридически-значимой информации в сфере внешнеторговой деятельности	2
2	2.1	Выявление рисков	Тестирование и презентация творческого задания по использованию методов выявления рисков.	2
	2.1	Сравнительные методы анализа рисков	Тестирование, презентация творческого задания по использованию матричного метода, презентация подготовленных докладов на темы: виды аналитических методов оценки, корпоративные методики оценки рисков	2
	2.2	Оценка рисков	Тестирование, решение практических задач	6
	2.2	Методы управления рисками	Тестирование, решение практических задач	4

3.2.3. Лабораторные занятия, содержание и объем в часах

Модуль	Номер раздела	Тема	Содержание	Трудоемкость (в часах)

3.3. Содержание материалов, выносимых на самостоятельное изучение

Модуль	Номер раздела	Содержание материалов, выносимого на самостоятельное изучение	Виды самостоятельной деятельности	Трудоемкость (в часах)
1	1.1	Преимущества и недостатки различных форм организации зарубежных операций, управление зарубежной деятельностью компании, типы организационных структур управления, их преимущества и недостатки, источники поиска юридически-значимой информации в сфере внешнеторговой деятельности	Работа с рекомендованной учебной и научной литературой; поиск информации в интернете по заданной теме, подготовка к тестированию.	6
	1.1	Природные риски и их влияние на экономику, специфика управления демографическими рисками, инновационные риски, общая характеристика отраслевых и структурных рисков, современные формы международного бизнеса, принципы их выбора, концепция мирового портфеля как основа современных теорий страновых рисков,	Работа с рекомендованной учебной и научной литературой; поиск информации в интернете по заданной теме, подготовка к тестированию.	10
2	2.1	Методы диагностики, выявления, анализа	Работа с рекомендованной учебной и научной	34

		рисков в аспекте международной торговли и внешнеэкономических отношений	литературой; поиск информации в Интернете по заданной теме, выполнение творческих заданий, подготовка к тестированию	
	2.2	Методы оценки рисков и управления ими в аспекте международной торговли и внешнеэкономических отношений	Работа с рекомендованной учебной и научной литературой; поиск информации в Интернете по заданной теме, подготовка к тестированию	60

4. Фонд оценочных средств для проведения текущей и промежуточной аттестации обучающихся по дисциплине

Фонд оценочных средств текущего контроля и промежуточной аттестации по итогам освоения дисциплины представлен в приложении.

[Фонд оценочных средств](#)

5. Учебно-методическое и информационное обеспечение дисциплины

5.1. Основная литература

5.1.1. Печатные издания

1.

5.1.2. Издания из ЭБС

1. 1. Управление рисками. Практикум [Электронный ресурс]: учебное пособие / Черняева С. Н., Коробова Л. А., Толстова И. С., Арапова Д. В. - Воронеж : ВГУИТ, 2022. - 90 с. — [Электронный ресурс] – Режим доступа: <https://e.lanbook.com/book/254525> 2. Управление рисками, системный анализ и моделирование в 3 ч. Часть 3 : учебник и практикум для спо / П. Г. Белов. - Москва : Юрайт, 2022. - 272 с. — [Электронный ресурс] – Режим доступа: <https://urait.ru/bcode/495881> 3. Управление рисками, системный анализ и моделирование в 3 ч. Часть 2 : учебник и практикум для вузов / П. Г. Белов. - Москва : Юрайт, 2022. - 250 с. — [Электронный ресурс] – Режим доступа: <https://urait.ru/bcode/490635> 4. Управление рисками, системный анализ и моделирование в 3 ч. Часть 1 : учебник и практикум для вузов / П. Г. Белов. - Москва : Юрайт, 2022. - 211 с. — [Электронный ресурс] – Режим доступа: <https://urait.ru/bcode/490634> 5. Управление рисками: учебник и практикум для вузов / А. В. Воронцовский. - 2-е изд. - Москва: Юрайт, 2022. - 485 с. — [Электронный ресурс] – Режим доступа: <https://urait.ru/bcode/489580>

5.2. Дополнительная литература

5.2.1. Печатные издания

1.

5.2.2. Издания из ЭБС

1. 1. Системный анализ и программно-целевой менеджмент рисков : учебник и практикум для вузов / П. Г. Белов. - Москва : Юрайт, 2022. - 289 с. — [Электронный ресурс] – Режим доступа: <https://urait.ru/bcode/493057> 2. Рискология в 2 ч. Часть 2 : учебник для вузов / Ю. И. Рягин. - Москва : Юрайт, 2022. - 275 с. — [Электронный ресурс] – Режим доступа: <https://urait.ru/bcode/492120> 3. Рискология в 2 ч. Часть 1 : учебник для вузов / Ю. И. Рягин. - Москва : Юрайт, 2022. - 255 с. — [Электронный ресурс] – Режим доступа: <https://urait.ru/bcode/492118> 4. Риск-менеджмент : учебник / В. Н. Вяткин, В. А. Гамза, Ф. В. Маевский. - 2-е изд. - Москва : Юрайт, 2022. - 365 с. — [Электронный ресурс] – Режим доступа: <https://urait.ru/bcode/489098> 5. Оценка рисков и многошаговые позиционные конфликты : учебное пособие для вузов / В. И. Жуковский, М. Е. Салуквадзе. - 2-е изд. - Москва : Юрайт, 2022. - 305 с. . — [Электронный ресурс] – Режим доступа: <https://urait.ru/bcode/493948>

5.3. Базы данных, информационно-справочные и поисковые системы

Название	Ссылка
Электронно-библиотечная система «Издательство «Лань».	https://e.lanbook.com
Электронно-библиотечная система «Юрайт»	https://urait.ru
Электронно-библиотечная система «Консультант студента»	http://www.studentlibrary.ru/
Электронно-библиотечная система «Троицкий мост»	http://www.trmost.com
Электронная библиотека диссертаций Российской государственной библиотеки.	http://diss.rsl.ru
Научная электронная библиотека eLIBRARY.RU	https://elibrary.ru

6. Перечень программного обеспечения

Программное обеспечение общего назначения: ОС Microsoft Windows, Microsoft Office, ABBYY FineReader, ESET NOD32 Smart Security Business Edition, Foxit Reader, АИБС "МегаПро".

Программное обеспечение специального назначения:

7. Материально-техническое обеспечение дисциплины

Наименование помещений для проведения учебных занятий и для самостоятельной работы обучающихся	Оснащенность специальных помещений и помещений для самостоятельной работы
Учебные аудитории для проведения занятий лекционного типа	Состав оборудования и технических средств обучения указан в паспорте аудитории, закреплённой расписанием по факультету
Учебные аудитории для проведения практических занятий	
Учебные аудитории для промежуточной аттестации	

8. Методические рекомендации по организации изучения дисциплины

Изучение учебной дисциплины студентами предусматривает два вида работ:

- работа с преподавателем;
- самостоятельная работа.

Работа с преподавателем охватывает два вида учебных занятий: лекционные занятия и практические. Практическое занятие требует подготовки студентов, предусматривающей изучение теоретического материала по теме занятия с использованием учебной литературы, перечень, которой приведен в данной рабочей программе.

В рамках практических занятий, предполагается представление докладов и обсуждение творческих заданий, участие в тестировании, решение практических задач.

Доклад – публичное сообщение, представляющее собой развёрнутое изложение определённой темы.

Этапы подготовки доклада:

- определение цели доклада.
- подбор необходимого материала, определяющего содержание доклада.
- составление плана доклада, распределение собранного материала в необходимой логической последовательности.
- общее знакомство с литературой и выделение среди источников главного.
- уточнение плана, отбор материала к каждому пункту плана.
- композиционное оформление доклада.
- заучивание, запоминание текста доклада, подготовки тезисов выступления.
- выступление с докладом.
- обсуждение доклада.
- оценивание доклада

Композиционное оформление доклада – это его реальная речевая внешняя структура, в ней отражаются соотношения частей выступления по их цели, стилистическим особенностям, по объёму, сочетанию рациональных и эмоциональных моментов, как правило, элементами композиции доклада являются: вступление, определение предмета выступления, изложение(опровержение), заключение.

Вступление помогает обеспечить успех выступления по любой тематике.

Вступление должно содержать:

- название доклада;
- сообщение основной идеи;

- современную оценку предмета изложения;
- краткое перечисление рассматриваемых вопросов;
- интересную для слушателей форму изложения;
- акцентирование оригинальности подхода.

Выступление состоит из следующих частей:

- основная часть, в которой выступающий должен раскрыть суть темы, обычно строится по принципу отчёта. Задача основной части: представить достаточно данных для того, чтобы слушатели заинтересовались темой и захотели ознакомиться с материалами.
- заключение- это чёткое обобщение и краткие выводы по излагаемой теме.

Важное значение в ходе обучения занимают также и творческие задания. В ходе подготовки данного задания необходимо обращаться к разнообразному массиву информации.

Тестирование проводится на каждом практическом занятии с целью проверки закрепления пройденного материала и включает в себя вопросы по ранее рассмотренным темам.

Следовательно, для подготовки к нему студенту следует периодически с целью повторения обращаться к уже изученному материалу в рамках лекционных и практических занятий.

Вторым видом работы студента, выполняемым им при изучении курса, является самостоятельная работа, которая помимо подготовки к практическим занятиям предусматривает изучение рекомендованной основной и дополнительной литературы.

Целью самостоятельной работы является закрепление полученных знаний в рамках отдельных тем по учебной дисциплине, формирование умений, навыков по решению вопросов, составляющих содержание курса.

Разработчик/группа разработчиков:
Кирилл Игоревич Галынис

Типовая программа утверждена

Согласована с выпускающей кафедрой
Заведующий кафедрой

_____ «___» _____ 20___ г.