

**МИНИСТЕРСТВО НАУКИ И ВЫСШЕГО ОБРАЗОВАНИЯ
РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ**

**Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение
высшего образования
«Луганский государственный университет имени Владимира Даля»**

**Экономический факультет
Кафедра «Мировая экономика»**



УТВЕРЖДАЮ:

Декан экономического факультета

д.э.н., доцент Тхор Е.С.

«15» декабря 2023 года

РАБОЧАЯ ПРОГРАММА УЧЕБНОЙ ДИСЦИПЛИНЫ

«УПРАВЛЕНИЕ РИСКАМИ В МЕЖДУНАРОДНОМ БИЗНЕСЕ»

По направлению подготовки 38.03.01 Экономика

Профиль: «Международный бизнес и экономика»

Луганск – 2023

Лист согласования РПУД

Рабочая программа учебной дисциплины «Управление рисками в международном бизнесе» по направлению подготовки 38.03.01 Экономика. – 32 с.

Рабочая программа учебной дисциплины «Управление рисками в международном бизнесе» составлена с учетом Федерального государственного образовательного стандарта высшего образования по направлению подготовки 38.03.01 Экономика утвержденного приказом Министерства науки и высшего образования Российской Федерации от 12 августа 2020 года № 954.

СОСТАВИТЕЛЬ:

ст. пред. Михайлова И.Г.

Рабочая программа дисциплины утверждена на заседании кафедры мировой экономики «18» апреля 2023 г., протокол № 26

Заведующий кафедрой мировой экономики  Инговатова В.А..

Переутверждена: « » 20 г., протокол №

Рекомендована на заседании учебно-методической комиссии экономического факультета «21» апреля 2023 г., протокол № 4.

Председатель учебно-методической комиссии экономического факультета  Шаповалова Е.Н

© Михайлова И.Г., 2023 год

© ФГБОУ ВО «ЛГУ им. В. Даля», 2023 год

Структура и содержание дисциплины

1. Цели и задачи дисциплины, ее место в учебном процессе

Цель изучения дисциплины – является обучение студентов навыкам анализа, оценки и управления рисками в международном бизнесе с возможностью практического использования полученных знаний, умений и навыков при разработке и принятии управленческих решений в условиях неопределенности.

Задачи:

- уяснение социально-экономической сущности экономических рисков в международном бизнесе;
- выявление особенностей рисков во внешнеэкономической деятельности;
- формирование навыков оценки и анализа рисков в международном бизнесе;
- изучение методов и инструментов управления рисками во ВЭД;
- разработка механизма управления рисками в международном бизнесе.

2. Место дисциплины в структуре ООП ВО

Дисциплина «Управление рисками в международном бизнесе» относится к части, формируемой участниками образовательных отношений. Необходимыми условиями для освоения дисциплины являются:

знания

- основных понятий управления рисками;
- основных видов рисков в международном бизнесе;
- специфики управления в международном бизнесе;
- методов выявления, оценки и анализа уровня риска во ВЭД;
- принципов и методов оценки эффективности предпринимательской деятельности с учетом фактора неопределенности;

умения

- применять теоритические знания для ответов на конкретные вопросы и разрешения проблемных ситуаций в управлении рисками во внешнеэкономической деятельности;
- классифицировать риски во ВЭД;
- анализировать и оценивать рискообразующие факторы;
- рассчитывать степень риска и возможные потери или ожидаемую прибыль в связи с риском;
- применять на практике приемы управления внешнеэкономическими рисками предприятия и выбирать наименее рискованные варианты решений;

навыки

- методов оценки эффективности проектов развития международного бизнеса с учетом фактора неопределенности и обосновывать предложения по их совершенствованию;
- проведения системных экономических расчётов;
- анализа ситуационных изменений;

- оказания консультационной помощи при оценке и анализе уровня рисков во ВЭД.

Содержание дисциплины является логическим продолжением содержания дисциплин «Международный бизнес», «Международные экономические отношения» и служит основой для освоения дисциплин «Методология исследования международного бизнеса», «Оценка бизнеса».

3. Требования к результатам освоения содержания дисциплины

Код и наименование компетенции	Индикаторы достижений компетенции (по реализуемой дисциплине)	Перечень планируемых результатов
ПК-3. Способен выявлять основные тенденции в развитии мировой экономики и анализировать последствия принимаемых управленческих решений в сфере международного бизнеса.	ПК-3.4 Анализирует последствия принимаемых управленческих решений на основе критериев социально-экономической эффективности международных компаний.	Знать: основные понятия управления рисками; основные виды рисков в международном бизнесе; специфику управления в международном бизнесе; методы выявления, оценки и анализа уровня риска во ВЭД; принципы и методы оценки эффективности предпринимательской деятельности с учетом фактора неопределенности;
		Уметь: применять теоритические знания для ответов на конкретные вопросы и разрешения проблемных ситуаций в управлении рисками во внешнеэкономической деятельности; классифицировать риски во ВЭД; анализировать и оценивать рискообразующие факторы; рассчитывать степень риска и возможные потери или ожидаемую прибыль в связи с риском; применять на практике приемы управления внешнеэкономическими рисками предприятия и выбирать наименее рискованные варианты решений;
		Владеть: методами оценки эффективности проектов развития международного бизнеса с учетом фактора

		неопределенности и обосновывать предложения по их совершенствованию; навыками проведения системных экономических расчётов; анализом ситуационных изменений; навыками оказания консультационной помощи при оценке и анализе уровня рисков во ВЭД.
--	--	--

4. Структура и содержание дисциплины

4.1. Объем учебной дисциплины и виды учебной работы

Вид учебной работы	Объем часов (зач. ед.)		
	Очная форма	Очно-заочная форма	Заочная форма
Общая учебная нагрузка (всего)	324 (9 зач. ед)	324 (9 зач. ед)	324 (9 зач. ед)
Обязательная контактная работа (всего) в том числе:	136	60	40
Лекции	68	30	16
Семинарские занятия	68	30	24
Практические занятия	-		-
Лабораторные работы	-		-
Другие формы и методы организации образовательного процесса (<i>расчетно-графические работы, индивидуальные задания и т.п.</i>)	-		-
Самостоятельная работа студента (всего)	188	264	284
Форма аттестации	Зачет, экзамен	Зачет, экзамен	Зачет, экзамен

4.2. Содержание разделов дисциплины

Тема 1. Понятие и сущность экономического риска во ВЭД

Неопределенность среды, в которой функционируют предприятия. Риск как следствие неопределенности, зависимость между уровнем неопределенности и степенью риска. Значение государственного регулирования производственно-хозяйственной деятельности предприятий в условиях риска. Влияние субъективного фактора на риск. Предпочтения лиц, принимающих рискованные решения. Факторы внешней и внутренней среды. Предвидимые и непредвидимые факторы. Среда прямого и косвенного воздействия. Политические и социально-экономические факторы риска. Техно-технологические факторы риска. Маркетинговые факторы риска.

Тема 2. Экономическая классификация рисков

Риск как финансовая и экономическая категория. Риск-менеджмент. Функции управления рисками. Специфика рисков в международном бизнесе. Факторы риска.

Тема 3. Виды рисков инновационно- инвестиционных проектов

Чистые и спекулятивные риски. Финансовые риски. Бизнес-риски. Операционные риски.

Тема 4. Методы оценки экономических рисков

Риск как опасность потерь. Разновидности возможных потерь. Случайные и систематически повторяющиеся потери. Зоны допустимого, критического и катастрофического риска. Кривая распределения вероятностей потерь или вероятностей получения прибыли. Кривая риска и анализ ее характерных точек. Возможность количественной оценки риска. Порядок расчета ожидаемых потерь или прибыли. Порядок расчета степени риска. Шкала риска. Метод экспертных оценок. Метод аналогий. Метод целесообразности затрат. Z – модель. Методы оценки и покрытия рисков в рамках современных международных концепций.

Тема 5. Инструментарий оценки рисков

Случайные события. Случайная величина. Вероятности случайной величины. Математическое ожидание случайной величины. Коэффициент вариации. Законы распределений.

Тема 6. Инструментарий управления экономическими рисками

Внешние и внутренние механизмы нейтрализации рисков. Избежание риска. Лимитирование концентрации риска. Диверсификация как способ снижения степени риска. Хеджирование на повышение и на понижение. Трансферт риска. Компенсация риска. Самострахование от рисков и страхование. Механизмы нейтрализации рисков. Средства разрешения риска. Локализация риска. Способы снижения степени риска. Методы компенсации риска. Обзор стандартов по управлению рисками.

Тема 7. Риски в международном бизнесе

Основные виды рисков в международном бизнесе. Страновые риски. Политические риски. Валютные риски. Риск выбора и надежности партнера. Маркетинговые риски. Транспортные риски. Логистические риски. Риски, связанные с основными положениями внешнеэкономического контракта. Риски, связанные с процессом таможенного оформления.

Тема 8. Методы управления рисками в международном бизнесе

Стратегии управления рисками. Методы уклонения от риска. Методы локализации риска. Методы диссипации риска. Методы компенсации риска. Оценка эффективности методов управления рисками.

Тема 9. Инструменты и механизм управления рисками во ВЭД

Управление политическими рисками. Методы и техника анализа страновых рисков. Управление страновыми рисками коммерческой деятельности на зарубежных рынках (коммерческие, валютные, политические риски, связанные с поставкой товара и переводом валюты из страны в страну). Деятельность национальных и международных агентств по страхованию рисков. Управление валютными рисками. Хеджирование форвардными контрактами, валютными фьючерсами, опционами и свопами. Основы организации риск менеджмента по валютным рискам. Управление ценовыми рисками в международных коммерческих организациях. Хеджирование и страхование рисков. Организация управления рисками в компаниях.

Контрактные риски во ВЭД и способы их уменьшения. Обеспечение коммерческой эффективности контрактов. Планирование ценовых компромиссов с контрагентами. Правовой риск менеджмент во внешнеторговых контрактах. Репутационные риски во ВЭД. Управление транспортными и логистическими рисками. Основные виды рисков в международной логистической деятельности. Управление рисками в международных цепях поставок. Классификация и идентификация рисков при таможенном контроле. Система управления рисками при таможенном контроле. Мировой опыт внедрения антикризисных стратегий в управлении социально-экономическими системами национального уровня.

Тема 10. Основные методы анализа рисков в международном бизнесе

Качественные методы оценки рисков. Анализ уместности затрат. Метод аналогий. Метод экспертных оценок. Метод дерева решений. Количественные методы анализа рисков.

Тема 11. Оценка рисков инновационно- инвестиционных проектов

Анализ чувствительности (метод вариации параметров). Метод сценариев (метод формализованного описания неопределенностей). Имитационное моделирование (метод статистических испытаний, метод Монте-Карло). Метод корректировки ставки дисконтирования. Метод достоверных эквивалентов (коэффициент достоверности). Анализ вероятностных распределений потоков платежей.

4.3. Лекции

№ п/п	Название темы	Объем часов		
		Очная форма	Очно- заочная форма	Заочная форма
1.	Понятие и сущность экономического риска во ВЭД	6	2	1
2.	Экономическая классификация рисков	4	1	1
3.	Виды рисков инновационно- инвестиционных проектов	2	1	1
4.	Методы оценки экономических рисков	6	2	1
5.	Инструментарий оценки рисков	4	1	1
6.	Инструментарий управления экономическими рисками	6	2	1
7.	Риски в международном бизнесе	6	1	1
8.	Методы управления рисками в международном бизнесе	8	4	1
9.	Инструменты и механизм управления рисками во ВЭД	10	8	4
10.	Основные методы анализа рисков в международном бизнесе	8	4	2
11.	Оценка рисков инновационно-инвестиционных проектов	8	4	2
Итого:		68	30	16

4.4. Практические (семинарские) занятия

№ п/п	Название темы	Объем часов		
		Очная форма	Очно- заочная форма	Заочная форма
1.	Понятие и сущность экономического риска во ВЭД	6	2	2
2.	Экономическая классификация рисков	4	1	1
3.	Виды рисков инновационно-инвестиционных проектов	2	1	1
4.	Методы оценки экономических рисков	6	2	2
5.	Инструментарий оценки рисков	4	1	2
6.	Инструментарий управления экономическими рисками	6	2	2
7.	Риски в международном бизнесе	6	1	2
8.	Методы управления рисками в международном бизнесе	8	4	2
9.	Инструменты и механизм управления рисками во ВЭД	10	8	6
10.	Основные методы анализа рисков в международном бизнесе	8	4	2
11.	Оценка рисков инновационно-инвестиционных проектов	8	4	2
Итого:		68	30	24

4.5. Лабораторные работы по дисциплине «Управление рисками в международном бизнесе» не предполагаются учебным планом.

4.6. Самостоятельная работа студентов

№ п/п	Название темы	Вид СРС	Объем часов		
			Очная форма	Очно- заочная форма	Заочная форма
1.	Понятие и сущность экономического риска во ВЭД	Подготовка к семинарским занятиям, к текущему и промежуточному контролю знаний и умений	6	14	28
2.	Экономическая классификация рисков	Подготовка к семинарским занятиям, к текущему и промежуточному контролю знаний и умений	6	12	24
3.	Виды рисков инновационно-инвестиционных проектов	Подготовка к семинарским занятиям, к текущему и	4	12	24

		промежуточному контролю знаний и умений			
4.	Методы оценки экономических рисков	Подготовка к семинарским занятиям, к текущему и промежуточному контролю знаний и умений	6	14	28
5.	Инструментарий оценки рисков	Подготовка к семинарским занятиям, к текущему и промежуточному контролю знаний и умений	6	12	24
6.	Инструментарий управления экономическими рисками	Подготовка к семинарским занятиям, к текущему и промежуточному контролю знаний и умений	6	12	24
7.	Риски в международном бизнесе	Подготовка к семинарским занятиям, к текущему и промежуточному контролю знаний и умений	6	12	24
8.	Методы управления рисками в международном бизнесе	Подготовка к семинарским занятиям, к текущему и промежуточному контролю знаний и умений	36	44	26
9.	Инструменты и механизм управления рисками во ВЭД	Подготовка к семинарским занятиям, к текущему и промежуточному контролю знаний и умений	40	44	28
10.	Основные методы анализа рисков в международном бизнесе	Подготовка к семинарским занятиям, к текущему и промежуточному контролю знаний и умений	36	44	28

11.	Оценка рисков инновационно-инвестиционных проектов	Подготовка к семинарским занятиям, к текущему и промежуточному контролю знаний и умений	36	44	26
Итого:			188	264	284

4.7. Курсовые работы/проекты по дисциплине Управление рисками в международном бизнесе» не предполагаются учебным планом.

5. Образовательные технологии

Преподавание дисциплины ведется с применением следующих видов образовательных технологий: объяснительно-иллюстративного обучения (технология поддерживающего обучения, технология проведения учебной дискуссии), информационных технологий (презентационные материалы), развивающих и инновационных образовательных технологий.

Практические занятия проводятся с использованием развивающих, проблемных, проектных, информационных (использование электронных образовательных ресурсов (электронный конспект) образовательных технологий.

6. Формы контроля освоения дисциплины

Текущая аттестация студентов производится в дискретные временные интервалы лектором и преподавателем(ями), ведущими практические занятия по дисциплине в следующих формах:

- вопросы для обсуждения (в виде докладов и сообщений);
- контрольные работы;
- тесты.

Промежуточная аттестации по результатам освоения дисциплины проходит в форме устного/письменного зачета и экзамена (включает в себя ответы на теоретические вопросы и ответы на тестовые задания). Студенты, выполнившие 75% текущих и контрольных мероприятий на «отлично», а остальные 25 % на «хорошо», имеют право на получение итоговой оценки.

В экзаменационную ведомость и зачетную книжку выставляются оценки по шкале, приведенной в таблице.

Шкала оценивания (экзамен)	Характеристика знания предмета и ответов	Зачеты
отлично (5)	Студент глубоко и в полном объеме владеет программным материалом. Грамотно, исчерпывающе и логично его излагает в устной или письменной форме. При этом знает рекомендованную литературу, проявляет творческий подход в ответах на вопросы и правильно обосновывает принятые решения, хорошо владеет умениями и навыками при выполнении	зачтено

	практических задач.	
хорошо (4)	Студент знает программный материал, грамотно и по сути излагает его в устной или письменной форме, допуская незначительные неточности в утверждениях, трактовках, определениях и категориях или незначительное количество ошибок. При этом владеет необходимыми умениями и навыками при выполнении практических задач.	
удовлетворительно (3)	Студент знает только основной программный материал, допускает неточности, недостаточно чёткие формулировки, непоследовательность в ответах, излагаемых в устной или письменной форме. При этом недостаточно владеет умениями и навыками при выполнении практических задач. Допускает до 30% ошибок в излагаемых ответах.	
неудовлетворительно (2)	Студент не знает значительной части программного материала. При этом допускает принципиальные ошибки в доказательствах, в трактовке понятий и категорий, проявляет низкую культуру знаний, не владеет основными умениями и навыками при выполнении практических задач. Студент отказывается от ответов на дополнительные вопросы.	не зачтено

7. Учебно-методическое и информационное обеспечение дисциплины:

а) основная литература:

1. Грачев, С. А. Оценка и управление рисками : учеб. пособие / С. А. Грачев, М. А. Гундорова ; Владим. гос. ун-т им. А. Г. и Н. Г. Столетовых. – Изд. 2-е., испр. и доп. – Владимир : Издво ВлГУ, 2020. – 287 с. – ISBN 978-5-9984-1261-5. – Текст: электронный // http://op.vlsu.ru/fileadmin/Programmy/Specialitet/38.05.01/Ekon-prav_obesp_ekon_bezopas/Metod_doc/Ocenka_i_upravlenie_riskami.pdf
2. Финансовые и банковские риски : учебник / Л. И. Юзвович, Ю. Э. Слепухина, Ю. А. Долгих, В. А. Татьянников, Е. В. Стрельников, Р. Ю. Луговцов, М. Н. Клименко ; под ред. Л. И. Юзвович, Ю. Э. Слепухиной ; Министерство науки и высшего образования Российской Федерации, Уральский государственный экономический университет. – Екатеринбург :

Изд-во Урал. ун-та, 2020. – 336 с. : ил. – Библиогр.: в конце глав. – 100 экз. – ISBN 978-5-7996-3105-5. – Текст: электронный // https://elar.urfu.ru/bitstream/10995/95285/1/978-5-7996-3105-5_2020.pdf

3. Анализ и оценка рисков в бизнесе : учебник и практикум для вузов / Т.Г.Касьяненко, Г.А. Маховикова. - 2-е изд., пер. и доп. - М : Юрайт, 2022. - 381

4. Анализ и управление рисками организации: Уч.пос. / Н.А.Рыхтикова - 3 изд.-М.:НИЦ ИНФРА-М,2021 -248с.(П)

б) дополнительная литература:

1. Управление рисками организации: Уч. / Г.Д.Антонов и др.-М.:НИЦ ИНФРА-М,2023.-153 с.(ВО)(П)

2. Рычихина, Н.С0 Риск-менеджмент в международном бизнесе< учебное пособие / Н.С0 Рычихина, И.Е.Зотова; Иван0 гос0 хим0/технол0 ун-т0 – Иваново, 22390 – 8; с0 – Текст: электронный // https://mkl.isuct.ru/e-lib/sites/default/files/uiemm_06042017-2.pdf

3. Управление рисками предприятия: Уч.пос. /В.Н.Уродовских-М.:Вуз.уч., НИЦИНФР А-М,2022.-168с.(П)

4. Управление финансовыми рисками . учебник и практикум для вузов / И.П.Хоминич - 2-е изд., испр. и доп. - М : Юрайт, 2022 - 569 с.;

в) методические рекомендации:

1. Методические рекомендации к изучению дисциплины «Управление рисками в международном бизнесе» (для студентов направления подготовки 38.03.01 Экономика / Сост.: Инговатова В.А., Михайлова И.Г. – Луганск: Изд-во Луганского государственного университета имени Владимира Даля, 2023. – 20 с.

2. Методические рекомендации для самостоятельной работы по дисциплине «Управление рисками в международном бизнесе» (для студентов направления подготовки 38.03.01 Экономика / Сост. Михайлова И.Г. – Луганск : изд-во ЛГУ им. В. Даля, 2023. – 25 с.

г) интернет-ресурсы:

Министерство науки и высшего образования Российской Федерации – <http://минобрнауки.рф/>

Федеральная служба по надзору в сфере образования и науки – <http://obrnadzor.gov.ru/>

Портал Федеральных государственных образовательных стандартов высшего образования – <http://fgosvo.ru>

Федеральный портал «Российское образование» – <http://www.edu.ru/>

Информационная система «Единое окно доступа к образовательным ресурсам» – <http://window.edu.ru/>

Федеральный центр информационно-образовательных ресурсов – <http://fcior.edu.ru/>

Электронные библиотечные системы и ресурсы
 Электронно-библиотечная система «StudMed.ru» —
<https://www.studmed.ru>

Информационный ресурс библиотеки образовательной организации

Научная библиотека имени А. Н. Коняева – <http://biblio.dahluniver.ru/>

8. Материально-техническое и программное обеспечение дисциплины

Освоение дисциплины «Управление рисками в международном бизнесе» предполагает использование академических аудиторий, соответствующих действующим санитарным и противопожарным правилам и нормам.

Прочее: рабочее место преподавателя, оснащенное компьютером с доступом в Интернет.

Программное обеспечение:

Функциональное назначение	Бесплатное программное обеспечение	Ссылки
Офисный пакет	Libre Office 6.3.1	https://www.libreoffice.org/ https://ru.wikipedia.org/wiki/LibreOffice
Операционная система	UBUNTU 19.04	https://ubuntu.com/ https://ru.wikipedia.org/wiki/Ubuntu
Браузер	Firefox Mozilla	http://www.mozilla.org/ru/firefox/fx
Браузер	Opera	http://www.opera.com
Почтовый клиент	Mozilla Thunderbird	http://www.mozilla.org/ru/thunderbird
Файл-менеджер	Far Manager	http://www.farmanager.com/download.php
Архиватор	7Zip	http://www.7-zip.org/
Графический редактор	GIMP (GNU Image Manipulation Program)	http://www.gimp.org/ http://gimp.ru/viewpage.php?page_id=8 http://ru.wikipedia.org/wiki/GIMP
Редактор PDF	PDFCreator	http://www.pdfforge.org/pdfcreator
Аудиоплеер	VLC	http://www.videolan.org/vlc/

9. Оценочные средства по дисциплине

Паспорт

оценочных средств по учебной дисциплине

«Управление рисками в международном бизнесе»

Перечень компетенций (элементов компетенций), формируемых в результате освоения учебной дисциплины (модуля) или практики

№ п/п	Код контролируемой компетенции	Формулировка контролируемой компетенции	Индикаторы достижений компетенции (по реализуемой дисциплине)	Контролируемые темы учебной дисциплины, практики	Этапы формирования (семестр изучения)
1	ПК-3	Способен выявлять основные тенденции в развитии мировой экономики и анализировать последствия принимаемых управленческих решений в сфере международного бизнеса.	ПК-3.4 Анализирует последствия принимаемых управленческих решений на основе критериев социально-экономической эффективности международных компаний.	Тема 1. Понятие и сущность экономического риска во ВЭД	ОФО-5,6 ОЗФО-6,7 ЗФО-7,8
				Тема 2. Экономическая классификация рисков	
				Тема 3. Виды рисков инновационно-инвестиционных проектов	
				Тема 4. Методы оценки экономических рисков	
				Тема 5. Инструментарий оценки рисков	
				Тема 6. Инструментарий управления экономическими рисками	
				Тема 7. Риски в международном бизнесе	
				Тема 8. Методы управления рисками в международном бизнесе	
				Тема 9. Инструменты и механизм управления рисками во ВЭД	
				Тема 10. Основные методы анализа	

				рисков в международном бизнесе	
				Тема 11. Оценка рисков инновационно-инвестиционных проектов	

Показатели и критерии оценивания компетенций, описание шкал оценивания

№ п/п	Код контролируемой компетенции	Индикаторы достижений компетенции (по реализуемой дисциплине)	Перечень планируемых результатов	Контролируемые темы учебной дисциплины	Наименование оценочного средства
3.	ПК-3	ПК-3.4 Анализирует последствия принимаемых управленческих решений на основе критериев социально-экономической эффективности международных компаний.	Знать: основные понятия управления рисками; основные виды рисков в международном бизнесе; специфику управления в международном бизнесе; методы выявления, оценки и анализа уровня риска во ВЭД; принципы и методы оценки эффективности предпринимательской деятельности с учетом фактора неопределенности; Уметь: применять теоретические знания для ответов на конкретные вопросы и разрешения проблемных ситуаций в управлении рисками во внешнеэкономической деятельности; классифицировать риски во ВЭД; анализировать и оценивать рискообразующие факторы; рассчитывать	Тема 1, Тема 2, Тема 3, Тема 4, Тема 5, Тема 6, Тема 7, Тема 8, Тема 9, Тема 10, Тема 11	Вопросы для обсуждения (в виде докладов и сообщений), тесты, контрольные работы

			степень риска и возможные потери или ожидаемую прибыль в связи с риском; применять на практике приемы управления внешнеэкономическими рисками предприятия и выбирать наименее рискованные варианты решений; Владеть: методами оценки эффективности проектов развития международного бизнеса с учетом фактора неопределенности и обосновывать предложения по их совершенствованию; навыками проведения системных экономических расчётов; анализом ситуационных изменений; навыками оказания консультационной помощи при оценке и анализе уровня рисков во ВЭД.		
--	--	--	--	--	--

Фонды оценочных средств по дисциплине «Управление рисками в международном бизнесе»

**Вопросы для обсуждения на практических и семинарских занятиях
(в виде докладов и сообщений)**

1. Риск в экономической и предпринимательской деятельности.
2. Анализ рисков международного бизнеса. Источники информации о рисках.
3. Методы идентификации рисков. Картографирование рисков организации.
4. Методы оценки рисков. Статистические методы оценки рисков: сравнительный анализ и условия применения.
5. Методы оценки рисков. Аналитические методы оценки рисков.
6. Экспертные методы оценки рисков. Получение индивидуальных и коллективных экспертных оценок: достоинства и недостатки применяемых методов.

7. Риски в международном бизнесе: сущность, понятие, методы оценки и управления.

8. Методы управления финансовыми рисками. Исследование факторов, влияющих на уровень финансовых рисков организации. Выбор механизмов нейтрализации финансовых рисков.

9. Кредитные риски. Роль доллара в современных международных валютных и кредитных отношениях.

10. Валютные риски. Мировой валютный рынок: современное состояние и перспективы развития.

11. Процентные риски. Влияние учетной ставки процента на экономическую активность. Процентные риски в системе банковских рисков.

12. Операционные риски: идентификация и оценка. Выбор критерия управления операционными рисками.

13. Рыночные риски. Методы оценки и инструменты регулирования.

14. Риски развития. Лидерство в снижении издержек и дифференциация. Поиск наиболее эффективного пути развития.

15. Инвестиционные риски. Оценка и управление рисками инвестиционного проекта.

16. Инвестиционные риски. Формирование инвестиционного портфеля с учетом риска.

17. Стратегические риски. Стратегическая безопасность. Проблемы и перспективы глобализации.

18. Страновые риски. Мировой экономический кризис и тенденции развития российской экономики.

19. Политические риски.

20. Принятие решений в условиях неопределенности и риска.

21. Риски в глобальной экономике: основные подходы к управлению.

Критерии и шкала оценивания по оценочному средству «доклад, сообщение»

Шкала оценивания (интервал баллов)	Критерий оценивания
5	Доклад (сообщение) представлен(о) на высоком уровне (студент в полном объеме осветил рассматриваемую проблематику, привел аргументы в пользу своих суждений, владеет профильным понятийным (категориальным) аппаратом и т.п.)
4	Доклад (сообщение) представлен(о) на среднем уровне (студент в целом осветил рассматриваемую проблематику, привел аргументы в пользу своих суждений, допустив некоторые неточности и т.п.)
3	Доклад (сообщение) представлен(о) на низком уровне (студент допустил существенные неточности, изложил материал с ошибками, не владеет в достаточной степени профильным категориальным аппаратом и т.п.)
2	Доклад (сообщение) представлен(о) на неудовлетворительном уровне или не представлен (студент не готов, не выполнил задание и т.п.)

Вопросы к контрольным работам

1. Объективные и субъективные причины неизбежности риска в международной деятельности фирмы.
2. Прогнозирование в бизнесе: метод прогнозирования по аналогии, метод логических построений, математические методы, экспертный метод, натуральное моделирование.
3. Причины усиления предпринимательского риска в российских условиях.
4. Влияние на уровень финансового риска внешних факторов регионального уровня, отраслевого уровня.
5. Подходы отечественных и зарубежных экономистов к оценке рисков в международном бизнесе.
6. Интегральная модель оценки финансовых рисков в международном бизнесе.
7. Оценка риска на основе анализа финансовых показателей деятельности организации в международном бизнесе.
8. Прогнозирование вероятности банкротства фирм.
9. Антикризисное управление финансами предприятия.
10. Диверсификация деятельности как внутренний метод минимизации возможных финансовых рисков.
11. Выбор метода минимизации с учетом вида финансового риска, влияющего на международную деятельность фирмы.
12. Роль фактора времени в принятии инвестиционных решений.
13. Анализ проектных рисков, критерии оценки и выбора ИП.
14. Принципы и методы оценки эффективности отдельных финансовых инструментов инвестирования в международном бизнесе.
15. Риски портфельного инвестирования и управление ими.
16. Финансовые риски в международной деятельности.

Критерии и шкала оценивания по оценочному средству «контрольная работа»

Шкала оценивания (интервал баллов)	Критерий оценивания
5	Контрольная работа выполнена на высоком уровне (правильные ответы даны на 90-100% вопросов/задач)
4	Контрольная работа выполнена на среднем уровне (правильные ответы даны на 75-89% вопросов/задач)
3	Контрольная работа выполнена на низком уровне (правильные ответы даны на 50-74% вопросов/задач)
2	Контрольная работа выполнена на неудовлетворительном уровне (правильные ответы даны менее чем на 50%)

Тесты

1. Что такое риск?

- а) разновидность ситуации, объективно содержащая высокую вероятность невозможности осуществления цели
- б) наличие факторов, при которых результаты действий не являются детерминированными, а степень возможного влияния этих факторов на результаты неизвестна
- в) следствие действия либо бездействия, в результате которого существует реальная возможность получения неопределенных результатов различного характера

2. Какие потери можно обозначить как трудовые?

- а) потери рабочего времени
- б) уменьшение выручки вследствие снижения цен на реализуемую продукцию
- в) уплата дополнительных налогов
- г) невыполнение сроков сдачи объекта
- д) потери материалов
- е) ущерб здоровью
- ж) потери сырья
- з) ущерб репутации
- и) выплата штрафа

3. Какие компании называют кэптивными?

- а) универсальные страховые
- б) специализированные страховые
- в) ведомственные страховые

4. Какие потери можно считать финансовыми?

- а) потери ценных бумаг
- б) потери сырья
- в) невыполнение сроков сдачи объекта
- г) выплата штрафа
- д) уплата дополнительных налогов+
- е) уменьшение выручки вследствие снижения цен на реализуемую продукцию

5. Факторы, которые влияют на уровень финансовых рисков подразделяются на:

- а) объектные и субъектные
- б) позитивные и негативные
- в) простые и сложные

6. Какие потери можно отнести к потерям времени

- а) невыполнение сроков сдачи объекта
- б) потери ценных бумаг
- в) выплата штрафа
- г) уменьшение выручки вследствие снижения цен на реализуемую продукцию

7. Как называется процесс использования механизмов уменьшения рисков?

- а) диверсификация
- б) лимитирование
- в) хеджирование

8. Что такое анализ риска?

- а) систематизация множества рисков на основании каких-либо признаков и критериев, позволяющих объединить подмножества рисков в более общие понятия
- б) систематическое научное исследование степени риска, которому подвержены конкретные объекты, виды деятельности и проекты
- в) начальный этап системы мероприятий по управлению рисками, состоящий в систематическом выявлении рисков, характерных для определенного вида деятельности, и определении их характеристик

9. Что является принципом действия механизма диверсификации?

- а) избежание рисков
- б) разделение рисков
- в) снижение рисков

10. Что такое идентификация риска?

- а) систематизация множества рисков на основании каких-либо признаков и критериев, позволяющих объединить подмножества рисков в более общие понятия
- б) начальный этап системы мероприятий по управлению рисками, состоящий в систематическом выявлении рисков, характерных для определенного вида деятельности, и определении их характеристик
- в) систематическое научное исследование степени риска, которому подвержены конкретные объекты, виды деятельности и проекты

11. Под максимальным объемом страховой защиты предприятия по конкретным видам страхуемых финансовых рисков понимается:

- а) страховой тариф
- б) страховая сумма
- в) страховая премия

12. Как называются риски, которые могут нести в себе как потери, так и дополнительную прибыль?

- а) чистыми
- б) критическими
- в) спекулятивными

13. На какие виды подразделяются риски по уровню финансовых потерь?

- а) допустимый, критический и катастрофический
- б) недопустимый, допустимый и критический
- в) критический, катастрофический и недопустимый

14. Как называются риски, которые практически всегда несут в себе потери?

- а) критическими
- б) спекулятивными
- в) чистыми

15. В основе какой из ниже предложенных операции лежит обмен финансовыми активами или обязательствами для улучшения их структуры и снижения возможных потерь:

- а) своп
- б) хеджирование
- в) репо

16. Как называются риски, которые обусловлены деятельностью самого предприятия и его контактной аудиторией?

- а) внешними
- б) внутренними
- в) чистыми

17. Как называются риски, в результате реализации которых предприятию грозит потеря прибыли?

- а) катастрофическими
- б) критическими
- в) допустимыми

18. Чем измеряется величина или степень риска?

- а) средним ожидаемым значение
- б) изменчивостью возможного результата
- в) оба варианта верны

19. В чем состоит социально-экономическая функция риска?

- а) в том, что в процессе рыночной деятельности риск и конкуренция позволяет выделить социальные группы эффективных собственников в общественных классах, а в экономике – отрасли деятельности, в которых риск приемлем
- б) в том, что реализация риска может обеспечить дополнительную по сравнению с плановой прибыль в случае благоприятного исхода
- в) оба варианта верны

II вариант.

1. Риск это:

- а) разновидность ситуации, объективно содержащая высокую вероятность невозможности осуществления цели
- б) наличие факторов, при которых результаты действий не являются детерминированными, а степень возможного влияния этих факторов на результаты неизвестна
- в) следствие действия либо бездействия, в результате которого существует реальная возможность получения неопределенных результатов различного характера

2. Выберите метод оценки риска, который реализуется путем введения поправки на риск или путем учета вероятности возникновения денежных потоков?

- а) построение дерева решений
- б) метод сценариев
- в) учет рисков при расчете чистой приведенной стоимости

- г) анализ чувствительности
- д) вероятностный метод

3. Выберите метод оценки риска, который используется в ситуациях, когда принимаемые решения сильно зависят от принятых ранее и определяют сценарии дальнейшего развития событий?

- а) имитационное моделирование
- б) вероятностный метод
- в) учет рисков при расчете чистой приведенной стоимости
- г) построение дерева решений
- д) анализ чувствительности
- е) метод сценариев

4. Выберите метод оценки риска, который представляет собой серию численных экспериментов, призванных получить эмпирические оценки степени влияния различных факторов на некоторые зависящие от них результаты?

- а) учет рисков при расчете чистой приведенной стоимости
- б) анализ чувствительности
- в) построение дерева решений
- г) вероятностный метод
- д) метод сценариев
- е) имитационное моделирование

5. Субъект управления в риск-менеджменте:

- а) специальная группа людей, которая посредством различных приемов и способов управленческого воздействия осуществляет управление рисками
- б) все варианты верны
- в) риск, рискованные вложения капитала и экономические отношения между хозяйствующими субъектами

6. Объект управления в риск-менеджменте:

- а) риск, рискованные вложения капитала и экономические отношения между хозяйствующими субъектами
- б) все варианты верны
- в) специальная группа людей, которая посредством различных приемов и способов управленческого воздействия осуществляет управление рисками

7. «Деятельность любой организации всегда сопровождается рисками, присутствующими в ее внешней или внутренней среде» включает в себя смысл:

- а) закона неизбежности риска
- б) закона сочетания потенциальных потерь и выгод
- в) закона прямой зависимости между степенью риска и уровнем планируемых доходов

8. «Практически в любых ситуациях риска потенциальная возможность потерь или убытков сочетается с потенциальной возможностью получения дополнительных доходов» включает в себя смысл:

- а) закона прямой зависимости между степенью риска и уровнем планируемых доходов
- б) закона неизбежности риска
- в) закона сочетания потенциальных потерь и выгод

9. «Чем выше степень риска при осуществлении хозяйственной операции, тем выше уровень планируемых от этой операции доходов» включает в себя смысл:

- а) закона прямой зависимости между степенью риска и уровнем планируемых доходов
- б) закона неизбежности риска
- в) закона сочетания потенциальных потерь и выгод

10. Прогнозирование внешней обстановки относится к:

- а) методам компенсации рисков
- б) методам уклонения от рисков
- в) методам локализации рисков
- г) методам диверсификации рисков

11. Страхование относится к:

- а) методам уклонения от рисков
- б) методам диверсификации рисков
- в) методам локализации рисков
- г) методам компенсации рисков

12. Распределение риска по этапам работы относится к:

- а) методам локализации рисков
- б) методам компенсации рисков
- в) методам уклонения от рисков
- г) методам диверсификации рисков

13. Заключение договоров о совместной деятельности для реализации рискованных проектов относится к:

- а) методам диверсификации рисков
- б) методам уклонения от рисков
- в) методам компенсации рисков
- г) методам локализации рисков

14. Обучение и инструктирование персонала относится к:

- а) методам уклонения от рисков
- б) методам компенсации рисков
- в) методам диверсификации рисков
- г) методам локализации рисков

15. Распределение ответственности между участниками проекта относится к:

- а) методам диверсификации рисков
- б) методам компенсации рисков
- в) методам локализации рисков
- г) методам уклонения от рисков

16. Увольнение некомпетентных сотрудников относится к:

- а) методам локализации рисков

- б) методам диверсификации рисков
- в) методам уклонения от рисков
- г) методам компенсации рисков

17. Создание системы резервов относится к:

- а) методам уклонения от рисков
- б) методам диверсификации рисков
- в) методам компенсации рисков
- г) методам локализации рисков

18. Создание специальных инновационных подразделений относится к:

- а) методам локализации рисков
- б) методам диверсификации рисков
- в) методам компенсации рисков
- г) методам уклонения от рисков

19. Распределение инвестиций в разных отраслях и сферах деятельности относится к:

- а) методы диверсификации рисков
- б) методы локализации рисков
- в) методы компенсации рисков
- г) методы уклонения от рисков

Критерии и шкала оценивания по оценочному средству «тесты»

Шкала оценивания (интервал баллов)	Критерий оценивания
5	Тесты выполнены на высоком уровне (правильные ответы даны на 90-100% тестов)
4	Тесты выполнены на среднем уровне (правильные ответы даны на 75-89% тестов)
3	Тесты выполнены на низком уровне (правильные ответы даны на 50-74% тестов)
2	Тесты выполнены на неудовлетворительном уровне (правильные ответы даны менее чем на 50% тестов)

**Оценочные средства для промежуточной аттестации (зачет, экзамен)
5 семестр (зачет)**

1. Понятие риска.
2. Неопределенность и риск.
3. Оценка полезности и меры риска.
4. Риск инвестиционной деятельности.
5. Источники неопределенности инвестиционной деятельности.
6. Сущность управления рисками.
7. Цикл управления рисками инвестиционной деятельности
8. Задачи управления рисками в инвестиционной деятельности.

9. Виды рисков. Чистые риски. Спекулятивные риски.
10. Инвестиционные риски.
11. Стохастические методы моделирования.
12. Случайные события. Вероятность события и ее свойства
13. Случайная величина. Дискретная величина.
14. Среднее (ожидаемое) значение случайной величины.
15. Математическое ожидание. Дисперсия (вариация). Стандартное (среднее квадратическое) отклонение. Коэффициент вариации.
16. Законы распределения вероятностей и их основные параметры.
17. Нормальный закон распределения вероятностей (распределение Гаусса). Свойства нормального распределения.
18. Зоны риска.
19. Графики Лоренца.
20. Правило поглощения рисков.
21. Правило математического сложения рисков.
22. Правило логического сложения рисков.
23. Теория управления рисками.
24. Принципы управления рисками.

6 семестр (экзамен)

25. Методы управления рисками.
26. Метод распределения рисков
27. Метод диверсификации.
28. Метод лимитирования.
29. Метод страхования и хеджирования.
30. Принципы анализа рисков
31. Прямые и косвенные показатели оценки риска.
32. Метод аналогии в управлении
33. Метод дерева решений в управлении риском.
34. Метод Монте–Карло (статистических испытаний).
35. Методы экспертных оценок риска.
36. Методы портфолио.
37. Моделирование риска.
38. Качественная оценка риска и возможности ее применения.
39. Количественная оценка риска и возможности ее применения.
40. Собственный риск проекта.
41. Корпоративный, или внутрифирменный, риск. Рыночный риск.
42. Метод корректировки нормы дисконта с учетом риска. Принципы оценки. Преимущества и недостатки метода.
43. Метод достоверных эквивалентов (коэффициентов определенности). Информационная база оценки риска.
44. Анализ чувствительности критериев эффективности. Алгоритм проведения анализа. Достоинства и недостатки метода.
45. Метод сценариев. Достоинства и недостатки метода.
46. Анализ вероятностных распределений потоков платежей. Принципы анализа. Независимые потоки платежей. Сильно зависимые

(идеально коррелированные) потоки платежей. Особенности использования анализа вероятностного распределения потоков платежей на практике.

47. Деревья решений. Принципы построения дерева решений. Достоинства и недостатки метода.

48. Имитационное моделирование рисков. Преимущества и недостатки метода имитационного моделирования.

49. Имитационное моделирование с применением функций ППП EXCEL.

50. Имитационное моделирование с помощью генератора случайных чисел.

51. Как изменяется риск для компании, использующей различные формы международного бизнеса.

52. В чем проявляется экономический страновой риск и какие факторы его определяют.

53. Что такое политический риск.

54. Какие виды политических рисков возникают в операциях компаний на зарубежных рынках.

55. Организация управления рисками в компаниях.

56. Контрактные риски во ВЭД и способы их уменьшения.

57. Обеспечение коммерческой эффективности контрактов.

58. Планирование ценовых компромиссов с контрагентами.

59. Правовой риск менеджмент во внешнеторговых контрактах.

60. Репутационные риски во ВЭД.

61. Управление транспортными и логистическими рисками.

62. Основные виды рисков в международной логистической деятельности.

63. Управление рисками в международных цепях поставок.

64. Классификация и идентификация рисков при таможенном контроле.

65. Система управления рисками при таможенном контроле.

66. Мировой опыт внедрения антикризисных стратегий в управлении социально-экономическими системами национального уровня.

Критерии и шкала оценивания по оценочному средству промежуточный контроль («зачет», «экзамен»)

Шкала оценивания (интервал баллов)	Критерий оценивания	Зачеты
отлично (5)	Глубокое и прочное усвоение программного материала – на основании полученных знаний полные, последовательные, грамотные и логически излагаемые ответы при видоизменении задания, - свободно справляющиеся с поставленными задачами, знания материала, - правильно обоснованные принятые решения, - владение разносторонними навыками и приемами выполнения практических работ.	зачтено
хорошо (4)	Знание программного материала - грамотное изложение, без существенных неточностей в ответе на вопрос, - правильное применение теоретических знаний - владение необходимыми навыками при выполнении практических задач.	

удовлетворительно (3)	Усвоение основного материала - при ответе допускаются неточности, недостаточно правильные формулировки, нарушение последовательности в изложении программного материала, затруднения в выполнении практических заданий.	
неудовлетворительно (2)	Эпизодическое знание программного материала, при выполнении задания студент допускает грубые ошибки, но логически мыслит и выстраивает подходящие версии.	не зачтено

Лист изменений и дополнений

№ п/п	Виды дополнений и изменений	Дата и номер протокола заседания кафедры (кафедр), на котором были рассмотрены и одобрены изменения и дополнения	Подпись (с расшифровкой) заведующего кафедрой (заведующих кафедрами)