

Документ подписан простой электронной подписью  
Информация о владельце:  
ФИО: Андрей Драгомирович Хлутков  
Должность: директор  
Дата подписания: 27.08.2023 16:15:44  
Уникальный программный ключ:  
880f7c07c583b07b775f6604a630281b13ca9fd2

Федеральное государственное бюджетное образовательное  
учреждение высшего образования  
«РОССИЙСКАЯ АКАДЕМИЯ НАРОДНОГО ХОЗЯЙСТВА  
И ГОСУДАРСТВЕННОЙ СЛУЖБЫ  
ПРИ ПРЕЗИДЕНТЕ РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ»

---

СЕВЕРО-ЗАПАДНЫЙ ИНСТИТУТ УПРАВЛЕНИЯ – ФИЛИАЛ РАНХиГС

Факультет безопасности и таможи  
Кафедра таможенного администрирования

УТВЕРЖДЕНО

Директор

Северо-Западный института управ-  
ления

филиала РАНХиГС

Хлутков А.Д.

## РАБОЧАЯ ПРОГРАММА ДИСЦИПЛИНЫ

Б1.В.ДВ.02.01 «Риск-менеджмент при осуществлении внешнеэкономической  
деятельности»

*(индекс, наименование дисциплины (модуля), в соответствии с учебным планом)*

РМприОВЭД

*по направлению подготовки (специальности)*

38.05.02 «Таможенное дело»

*(код и наименование направления подготовки (специальности))*

«Таможенные операции и таможенный контроль»  
*направленность(и) (профиль (и)/специализация(ии))*

специалист таможенного дела  
*квалификация*

очная, заочная  
*форма(ы) обучения*

Год набора - 2022

**Автор(ы)–составитель(и):**

к.э.н., доцент кафедры таможенного администрирования В.В. Николаев

**Врио Заведующего кафедрой**

таможенного администрирования

д с/х.н.

Р.Х.Кочкаров

РПД одобрена на заседании кафедры таможенного администрирования. Протокол от (30.08.2022) № 1

## СОДЕРЖАНИЕ

1. Перечень планируемых результатов обучения по дисциплине, соотнесенных с планируемыми результатами освоения образовательной программы
2. Объем и место дисциплины в структуре образовательной программы
3. Содержание и структура дисциплины
4. Материалы текущего контроля успеваемости обучающихся и фонд оценочных средств промежуточной аттестации по дисциплине
5. Методические указания для обучающихся по освоению дисциплины (модуля)
6. Учебная литература и ресурсы информационно-телекоммуникационной сети "Интернет", учебно-методическое обеспечение самостоятельной работы обучающихся по дисциплине
  - 6.1. Основная литература
  - 6.2. Дополнительная литература
  - 6.3. Учебно-методическое обеспечение самостоятельной работы
  - 6.4. Нормативные правовые документы
  - 6.5. Интернет-ресурсы
  - 6.6. Иные источники
7. Материально-техническая база, информационные технологии, программное обеспечение и информационные справочные системы

**1. Перечень планируемых результатов обучения по дисциплине (модулю), соотнесенных с планируемыми результатами освоения образовательной программы**

1.1. Дисциплина «Риск-менеджмент при осуществлении внешнеэкономической деятельности» обеспечивает овладение следующей компетенцией:

Код компетенции	Наименование компетенции	Код этапа освоения компетенции	Наименование этапа освоения компетенции
ПК-16	Умение применять систему управления рисками в профессиональной деятельности	ПК-16.5.	Способность применять международные стандарты риск-менеджмента в таможенном деле

1.2. В результате освоения дисциплины у студентов должны быть сформированы:

Трудовая функция	Код этапа освоения компетенции	Результаты обучения
<ul style="list-style-type: none"> <li>• Определение контекста, идентификация, анализ рисков и выработка мероприятий по воздействию на риск;</li> <li>• Документирование процесса управления рисками в рамках отдельных направлений, процессов;</li> <li>• Эксплуатация системы управления рисками;</li> <li>• Поддержание устойчивого функционирования системы управления рисками;</li> <li>• Подготовка и ведение документации при осуществлении перевозки грузов в цепи поставок;</li> </ul>	ПК-16.5.	<p><b>На уровне знаний:</b>  Знать общую терминологию в области управления рисками и антикризисного управления по ВЭД;  Знать современные принципы и методы формирования систем управления рисками по ВЭД;  Знать содержание процесса управления рисками по ВЭД на его основных этапах методологию процесса управления рисками по ВЭД</p>
		<p><b>На уровне умений:</b>  разрабатывать систему управления рисками по ВЭД  анализировать варианты антикризисного управления с целью поиска оптимального управленческого решения;  пользоваться инструментами риск-менеджмента</p> <p><b>на уровне навыков:</b>  практического решения актуальных задач в области управления рисками по ВЭД;  прогнозирования последствий принятия управленческих решений в кризисных ситуациях;  использования математических и статистических методов расчета уровня рисков по ВЭД;  выявления, оценки и анализа уровня рисков по ВЭД</p>

**2. Объем и место дисциплины (модуля) в структуре ОП ВО**  
**Объем дисциплины**

Общая трудоемкость дисциплины составляет 2 зачетных единицы или 72 академических часа.

По очной форме обучения трудоемкость контактной работы с преподавателем составляет 36 академических часов (из них 12 часов – лекции, 24 часа – практические занятия), самостоятельной работы – 36 академических часов.

По заочной форме: 8 академических часов (из них 4 часа - лекции, 4 часа- практические занятия) самостоятельной работы – 60 академических часов, 4 академических часа-зачет.

### Место дисциплины в структуре ОП ВО

Дисциплина «Риск-менеджмент при осуществлении внешнеэкономической деятельности» включена в состав дисциплин вариативной части Учебного плана подготовки специалистов по специальности 38.05.02 «Таможенное дело».

Дисциплина реализуется в 8 семестре 4 курса по очной форме и в 10 семестре 5 курса по заочной форме обучения.

Дисциплина реализуется после изучения дисциплин: «Таможенно-тарифное регулирование внешнеторговой деятельности», «Информатика», «Экономическая теория», «Финансы», «Основы таможенного дела». Форма контроля – зачет.

Дисциплина реализуется с применением дистанционных образовательных технологий.

Доступ к системе дистанционных образовательных технологий осуществляется каждым обучающимся самостоятельно с любого устройства на портале: <https://lms.ranepa.ru>. Пароль и логин к личному кабинету / профилю предоставляется студенту в деканате.

### 3. Содержание и структура дисциплины (модуля)

#### Очная форма

№ п/п	Наименование тем (разделов),	Объем дисциплины (модуля), час.					СР	Форма текущего контроля успеваемости**, промежуточной аттестации
		Все-го	Контактная работа обучающихся с преподавателем по видам учебных занятий					
			Л/ЭО/ДОТ	ЛР/ЭО/ДОТ	ПЗ/ЭО/ДОТ	КСР		
Тема 1	Природа риска и его содержание. Место и роль рисков в предпринимательской деятельности. Классификация рисков	12	2/2	0	4	0	6	УО, КР, П

Тема 2	Идентификация и анализ риска во внешнеэкономической деятельности	12	2/2	0	4	0	6	УО, КР, П, РЗ
Тема 3	Риск-менеджмент - система управления. Стратегия риск-менеджмента	12	2/2	0	4	0	6	УО, КР, П
Тема 4	Риски внешнеэкономической деятельности	12	2/2	0	4	0	6	УО, КР, П, РЗ
Тема 5	Страхование в управлении рисками	12	2/2	0	4	0	6	УО, КР, П, РЗ
Тема 6	Методы управления финансовыми рисками	12	2/2	0	4	0	6	УО, КР, П, РЗ
<b>Контроль</b>		Зачет						
<b>Всего:</b>		<b>72</b>	<b>12</b>	<b>0</b>	<b>24</b>		<b>36</b>	

*Заочная форма*

№ п/п	Наименование тем (разделов),	Объем дисциплины (модуля), час.						Форма текущего контроля успеваемости**, промежуточной аттестации
		Всего	Контактная работа обучающихся с преподавателем по видам учебных занятий				СР	
			Л/ЭО/ДОТ	ЛР/ЭО/ДОТ	ПЗ/ЭО/ДОТ	КСР		
Тема 1	Природа риска и его содержание. Место и роль рисков в предпринимательской деятельности. Классификация рисков	12	1/1	0	1/1	0	10	УО, КР, П
Тема 2	Идентификация и анализ риска во внешнеэкономической деятельности	12	1/1	0	1/1	0	10	УО, КР, П, РЗ

Тема 3	Риск-менеджмент - система управления. Стратегия риск-менеджмента	10		0		0	10	УО, КР, П	
Тема 4	Риски внешне-экономической деятельности	12	1/1	0	1/1	0	10	УО, КР, П, РЗ	
Тема 5	Страхование в управлении рисками	12	1/1	0	1/1	0	10	УО, КР, П, РЗ	
Тема 6	Методы управления финансовыми рисками	10		0		0	10	УО, КР, П, РЗ	
<b>Контроль</b>		4						Зачет	
<b>Всего:</b>		<b>72</b>	<b>4</b>	<b>0</b>	<b>4</b>		<b>60</b>		

### 3.1. Учебно-тематический план

### 3.2. Содержание дисциплины (модуля)

#### **Тема 1. «Природа риска и его содержание. Место и роль рисков в предпринимательской деятельности. Классификация рисков»**

Сущность понятия риска. Взаимосвязь риска с неопределенностью. Отношение степени риска и неопределенности. Учет риска и неопределенности. Информационный и оценочный подход в разделении риска и неопределенности. Объективное и субъективное понимание риска. Структурные характеристики риска. Опасность. Подверженность риску. Уязвимость (чувствительность к риску). Степень взаимодействия рисков. Экономические риски. Сфера применения определения экономического риска. Понятие риска в предпринимательстве. Идея риска. Различия в определениях риска применительно к предпринимательству. Номинации источников рисков. Угрозы, опасности и риск. Баланс между риском и доходностью. Степень риска экономической деятельности. Группы факторов, влияющих на степень риска. Объективные факторы. Субъективные факторы. Критерии классификации. Опасность. Подверженность риску. Уязвимость. Взаимодействие с другими рисками. Информация о риске. Величина расходов (издержек). Специфические классификации рисков. Банковские риски. Страховые риски. Однородные риски.

#### **Тема 2. Идентификация и анализ риска во внешнеэкономической деятельности.**

Содержание и этапы идентификации и анализа рисков. Принципы информационного обеспечения системы управления рисками. Полезность информации. Эффективность управления риском. Доступность информации. Достоверность информации. Внешние и внутренние источники информации. Информационная система. Визуализация рисков. Концепция приемлемого риска. Пороговые значения риска. Рисковый капитал.

#### **Тема 3. Риск-менеджмент - система управления. Стратегия риск-менеджмента.**

Сущность и содержание риск-менеджмента. Разработка программы действий по снижению риска: последовательность стадий. Особенности принятия решений в области риск-менеджмента. Эвристические правила риск-менеджмента и их действие. Коэффициент риска. Организационные структуры службы риск-менеджмента. Процессный подход к риск-менеджменту в организации. Внешний и внутренний мониторинг рисков. Планиро-



вание в системе риск-менеджмента. Стратегия риск-менеджмента Понятие стратегии риск-менеджмента. Основные правила стратегии риск - менеджмента и их действие. Принципы управления риском. Приемы управления риском. Средства разрешения риска (избежание, удержание, передача, снижение степени риска). Способы снижения риска. Диверсификация. Поиск информации. Ассиметрия информации. Оценка эффективности приобретаемой информации. Лимитирование. Объединение риска. Самострахование. Страхование.

#### ***Тема 4. Риски внешнеэкономической деятельности.***

Структура рисков ВЭД. Понятие странового риска в области международного бизнеса. Разновидности странового риска и их особенности. Факторы, определяющие страновой экономический риск. Качественные методы анализа страновых рисков («oldhands», «grandtours»), проблемы оценки. Сравнительные методы в анализе страновых рисков. Рейтинговые системы в анализе рисков (индекс BERI, рейтинг «Euromoney»). Политические риски в зарубежной коммерческой деятельности, их специфика. Методы управления политическими рисками в международном инвестировании. Риски, связанные с основными положениями внешнеэкономического контракта.

#### ***Тема 5. Страхование в управлении рисками***

Страхование в управлении рисками Страхование и его место в системе риск-менеджмента. Страхование, как один из методов управления риском, базирующийся на передаче риска. Основные характеристики страхования, как метода управления риском. Классификация рисков. Имущественные риски, экологические риски, риски стихийных бедствий, риски гражданской ответственности, риски, смерти, трудоспособности граждан. Финансовые и предпринимательские риски. Страхование гражданской ответственности. Виды страхования на рынке РФ и мировом рынке. Особенности покрытия риска в рамках существующих систем страховой ответственности. Франшиза, ее виды, расчет, влияние на уровень покрытия риска

#### ***Тема 6. Методы управления финансовыми рисками***

Методы управления финансовыми рисками Особенности рынка срочных контрактов и его виды. Фьючерсные контракты. Специфика фьючерсных сделок. Форвардные контракты, их специфика. Форвардный курс. Особенности риска форвардных сделок. Опционы и их назначение: Опционы европейский и американский. Опцион на покупку и опцион на продажу. Особенности сделок с опционами, специфика риска. Опционные торги (стандарт публикаций). Свопы. Хеджирование и его роль в снижении риска. Специфика валютного риска. Методы снижения степени валютного риска. Методы страхования валютного риска. Валютные оговорки, их виды, особенности применения. Процентный арбитраж с форвардным покрытием. Роль срочных контрактов в управлении валютным риском

### **4. Фонд оценочных средств промежуточной аттестации по дисциплине (модулю)**

#### ***4.1. Формы и методы текущего контроля успеваемости и промежуточной аттестации***

Тестирование (Т): осуществляется с использованием опросника, содержащего варианты ответов;

Проект (П): осуществляется разработка проектных решений по управлению риском на основе виртуального предприятия

Решение задач (РЗ): задачи решаются в письменном виде.

Зачет (Зач): Устный опрос по зачетным билетам

**4.1.1. В ходе реализации дисциплины «Риск-менеджмент при осуществлении внешнеэкономической деятельности» используются следующие методы текущего контроля успеваемости обучающихся:**

Тема (раздел)	Формы (методы) текущего контроля успеваемости
1. Природа риска и его содержание. Место и роль рисков в предпринимательской деятельности. Классификация рисков	УО, КР, П
2. Идентификация и анализ риска во внешнеэкономической деятельности	УО, КР, П, РЗ
3. Риск-менеджмент - система управления. Стратегия риск-менеджмента	УО, КР, П
4. Риски внешнеэкономической деятельности	УО, КР, П, РЗ
5. Страхование в управлении рисками	УО, КР, П, РЗ
6. Методы управления финансовыми рисками	УО, КР, П, РЗ

**4.1.2. Зачет проводится с применением следующих методов:**

Зачет: устный опрос по зачетным билетам. В каждом билете не менее 2-х вопросов. Один вопрос теоретической направленности, второй – практической направленности. Может проводиться с использованием ДОТ.

**4.2. Материалы текущего контроля успеваемости обучающихся**

Полный перечень типовых оценочных материалов находится на кафедре таможенно-го администрирования и безопасности.

**Типовые оценочные материалы по теме 1**

*«Природа риска и его содержание. Место и роль рисков в предпринимательской деятельности. Классификация рисков»*

Устный опрос:

1. Пешеход принимает решение перейти улицу. Выделите здесь три признака ситуации принятия решения в условиях риска.
2. Приведите пример ситуации неопределенности, в которой известны вероятности разных исходов.
3. Охарактеризуйте основные задачи, решаемые в ходе подготовки принятия решения в условиях риска.
4. На основе какой из концепций управления риском целесообразно осуществлять управление риском потерь овощей при их хранении?

**Типовые оценочные материалы по теме 2. Идентификация и анализ риска во внешнеэкономической деятельности.**

Устный опрос:

- Как классифицируются проектные риски?
- Как Вы понимаете внешние риски проекта?
- Перечислите основные внутренние риски проекта.
- Сравните приведенные в тексте данной главы классификации проектных рисков. В чем их основные различия?
- Решение задач.
- Задача 1
- Вы арендовали участок за 50 000 долл. на 5 лет. Вы можете:

1) поставить на нем мойку для автомобилей; оборудование стоит 80 000 долл., ежегодный прогнозный приток наличных средств составит 35000 долл. или 2) сдать участок в субаренду за 15 000 долл. в год. Норма дисконта составляет 12%.

Какой проект выгоднее для вас (решение принимать на основании расчетов срока окупаемости (PBP) и чистого дисконтированного дохода (NPV) каждого проекта)?

Задача 2

Опытный завод «Инноватор» организует производство новых клапанов. Для этого ему необходим специальный двигатель.

На рынке в настоящее время есть только два типа таких двигателей — модель «1» и модель «2». Срок жизни проекта по производству новых клапанов — 5 лет. Были проведены предварительные расчеты потоков затрат и выгод по каждой из моделей.

Год	Затраты		Выгоды	
	«1»	«2»	«1»	«2»
1-	1700	2000	600	500
2-	200	300	600	900
3-	200	250	700	900
4-	200	220	800	900
5-	200	50	900	900

Вы приглашены в качестве эксперта, чтобы помочь заводу решить, какую модель двигателя ему лучше приобрести. Учетная банковская ставка 10%. Какую модель вы порекомендуете?

**Кейс-анализ.** В известной сказке Три поросенка герои Ниф-Ниф, Нуф-Нуф и Наф-Наф приняли решение построить теплый и прочный дом для защиты от злого Волка. Каждый из поросят, руководствуясь своими идеями, решил разрабатывать свой проект: ленивый Ниф-Ниф начал строить соломенный домик, более предусмотрительный Нуф-Нуф — деревянный, а мудрый Наф-Наф приступил к сооружению кирпичного дома, который в конце концов и спас поросят от волчьих зубов.

Ответьте на следующие вопросы.

Какова была внешняя среда каждого проекта?

Опишите воздействие факторов внешней среды, которое они оказали на проект в процессе его реализации. Переместите проект Наф-нафа в Среднюю Азию, Нуф-Нуфа в Африку, Ниф-Нифа – в Европе.

Перечислите объективные факторы проекта строительства каждого дома.

Назовите субъективные факторы каждого проекта.

В чем состоят риски проекта строительства соломенного домика?

Какие внешнеэкономические риски?

Каковы специфические риски проекта Нуф-Нуфа?

Классифицируйте основные риски проекта Наф-Нафа.

**Типовые оценочные материалы по теме 3. Риск-менеджмент - система управления. Стратегия риск-менеджмента.**

Опишите возможности использования SWOT-анализа в риск-менеджменте.

В чем состоит экспертный подход?

В чем заключаются основные особенности метода Дельфи?

Какие требования предъявляются эксперту?

Метод проектов-аналогов — что это?

В каких случаях применим метод проектов-аналогов? Приведите примеры.

В чем заключается метод ставки процента с поправкой на риск?

В чем состоит метод критических значений?

**Проектная работа.** Разработайте для вашего проекта:

Составьте опросный лист для проекта, описанного в ситуации.

С помощью этого листа проведите экспертную оценку проекта.

На основании имеющейся информации оцените в баллах рискованность каждого проекта.

Ваши результаты по п. 2 используйте для разработки «розы» рисков.

Постройте спираль рисков этого проекта.

Проведите SWOT-анализ этого проекта.

Получились ли результаты одинаковыми при использовании разных методов?

**Типовые оценочные материалы по теме 4. Риски внешнеэкономической деятельности.**

**Контрольная работа. Тест.**

1. На какие группы делятся методы управления рисками по признаку «вариант воздействия на риск»?
  - а) группа, отвечающая процедурам «уклонение от риска», «сокращение риска» и «передача риска»
  - б) группа методов трансформации рисков, связанная с непосредственным воздействием на риск, и группа методов финансирования рисков, направленная на возмещение возможного ущерба.
2. Каким способом может проводиться оценка эффективности разработки программы управления рисками?
  - а) сопоставление с финансовыми возможностями фирмы значений максимально возможного, наиболее вероятного и ожидаемого убытков до и после реализации программы управления рисками.
  - б) сравнительный анализ значений максимально возможного, наиболее вероятного и ожидаемого убытков до и после реализации программы управления рисками.
  - в) могут использоваться различные способы.
3. Какие действия предполагаются при выборе приоритетных процедур управления рисками?
  - а) уточнение принципов управления рисками и принципов разработки программы с учетом уточненных общей стратегии, и стратегии, целей и задач по управлению рисками
  - б) определение пороговых значений вероятности и/или размера возможного ущерба по отдельным направлениям и аспектам деятельности фирмы и в целом по фирме с учетом уточненных общей стратегии, стратегии, целей и задач управления риском, а также процедур управления рисками
  - в) комплекс вышеперечисленных действий
4. С точки зрения теории менеджмента наиболее корректным определением цели управления является
  - а) результат, на достижение которого направлено управление
  - б) желательное, необходимое и возможное состояние управляемой системы
  - в) видение будущего, которое желательно достичь
  - г) объективная тенденция развития организации
5. Укажите последовательность решения задач для достижения цели мониторинга программ управления рисками:
  - 1) провести анализ реализации программ риск-менеджмента;
  - 2) определить необходимый состав и объем информации о контролируемых параметрах программ;
  - 3) провести сбор статистической и экспертной информации о параметрах, определяющих эффективность функционирования системы риск-менеджмента;
  - 4) разработать методики контроля наблюдаемых параметров и стратегию мониторинга параметров;
  - 5) оценить и проанализировать текущее состояние системы риск-менеджмента;
  - 6) разработать мероприятия по обеспечению требуемого состояния системы риск-менеджмента;

7) уточнить модели развития событий, перечень контролируемых параметров, требования к функционированию системы риск-менеджмента.

а) 1, 2, 3, 4, 5, 6, 7

б) 1, 2, 4, 3, 5, 6, 7

в) 1, 2, 3, 4, 6, 5, 7

#### **Типовые оценочные материалы по теме 5. Страхование в управлении рисками**

##### **Контрольная работа. Тест.**

1) Какие подходы выделяют при расчете VAR?

а) эмпирический;

б) логический;

в) оценочный;

г) ранжирование;

д) параметрический.

2) Суть риск-менеджмента состоит в:

а) устранении риска;

б) управлении риском;

в) снижении риска;

г) выборе риска.

3) Каковы функции объекта управления в риск-менеджменте?

а) организация разрешения риска;

б) организация рискованных вложений капитала;

в) организация работы по снижению величины риска;

г) организация процесса страхования рисков;

д) организация экономических отношений и связей между субъектами хозяйственного процесса;

е) все перечисленное является функциями объекта управления;

ж) ничего из перечисленного не является функцией объекта управления.

4) Какие из перечисленных источников могут использоваться для информационного обеспечения риск-менеджмента?

а) контракты, договоры об имущественных сделках;

б) имидж руководства организации;

в) кредитные договоры;

г) тенденции развития рынков;

д) бухгалтерская отчетность;

е) статистическая отчетность.

5) Какие риски могут принести дополнительную прибыль фирме?

а) спекулятивные;

б) чистые;

в) ретроспективные;

г) любые;

д) реализация риска в принципе не может принести дополнительную прибыль компании.

#### **Типовые оценочные материалы по теме 6. Методы управления финансовыми рисками.**

##### **Контрольная работа. Тест.**

1) Подразделение рисков на спекулятивные и чистые основано на:

а) классификации субъектов риска;

б) классификации объектов риска;

в) характере оценки риска;

г) характере последствий риска.

2) По сфере возникновения выделяют следующие типы рисков:

а) производственный риск;

- б) кадровый риск;  
 в) информационный риск;  
 г) финансовый риск;  
 д) коммерческий риск.
- 3) Коммерческий риск – это риск, возникающий:  
 а) на коммерческих предприятиях;  
 б) при заключении коммерческих сделок;  
 в) в процессе реализации товаров или услуг;  
 г) в процессе производства товаров или услуг.
- 4) Относятся ли риски, связанные с транспортировкой товаров, к группе коммерческих рисков?  
 а) да;  
 б) нет;  
 в) это зависит от характера транспортировки.
- 5) На какие виды подразделяются финансовые риски?  
 а) валютные;  
 б) денежные;  
 в) инвестиционные;  
 г) проектные;  
 д) риски распределения доходности.
- 5) Инфляционный риск – это:  
 а) риск увеличения темпов инфляции;  
 б) риск опережения роста доходов темпом их обесценивания; в) риск инфляционных ожиданий;  
 г) риск возникновения разницы в темпах инфляции на разных рынках сбыта.
- б) Мера защиты и мера компенсации негативного воздействия неуправляемых факторов  
 а) адаптация  
 б) санация  
 в) инновационность  
 г) страхование

Результаты текущего контроля обучающихся используются в рамках балльной рейтинговой системы:

Недели	Виды учебных занятий (лекции/семинары)	Посещение учебных занятий	Письменные работы		Устные выступления			Работа на ПК Решение задач на ПК	Компенсирующие задания (сверх расчетных 100 баллов)	Промежуточная аттестация		Итого (максимально-расчетное количество баллов)
			Тестирование	Доклад (с презентацией/ без презентации)	Участие в дискуссии	Устный опрос	Зачет			Экзамен		
Кольво баллов за 1 вид мероприятия		0,5	2	1	2		3	3	15	25	28,5	
1 п		0,5										
2 п		0,5										
3 с		0,5			2		2					
4 с		0,5					2	3			11	
5 п		0,5										
6 п		0,5										
7 с		0,5			1	2		3				
8 с		0,5						3	6			
9 с		0,5	2					3			17	
	Текущий контроль 1*	4,5	2	1	4		4	12	6	15	48,5	
10 с		0,5			1		2					
11 с		0,5			1		2					
12 п		0,5									7,5	
13 п		0,5										
14 п		0,5										
15 п		0,5										
16 с		0,5				2		3	6		13	
17 с		0,5	2		1		2					
	Текущий ** контроль 2	4	2	3	2		6	3	6	0	25	
Всего за семестр (баллов)		8,5	4	4	6	10	15	12	40	51	99,5	

\*Количество баллов, достаточное для аттестации текущего контроля

\*\*Количество баллов, достаточное для возможного освобождения от промежуточной аттестации

#### 4.3. Оценочные средства для промежуточной аттестации.

Код компетенции	Наименование компетенции	Код этапа освоения компетенции	Наименование этапа освоения компетенции
ПК-16	Умение применять систему управления рисками в профессиональной деятельности	ПК-16.5.	Способность применять международные стандарты риск-менеджмента в таможенном деле

#### Вопросы для подготовки к зачету

Дайте определение понятиям «неопределенность» и «риск» и раскройте сущность риска

1. Перечислите и раскройте основные причины возникновения экономических рисков.
2. Идентифицируйте основные причины возникновения рисков во ВЭД.
3. Представьте подходы классификации рисков во ВЭД и дайте их характеристику.
4. Приведите классификацию рисков во ВЭД в соответствии с уровневым подходом.
5. Охарактеризуйте структуру глобальных рисков-2016 ВЭФ и их динамику.
6. Раскройте сущность и виды страновых рисков.
7. Раскройте сущность методик оценки страновых рисков различными международными институтами (BERI, Euromoney, OECD, Moody's, Standard&Poor's и др.).
8. Представьте виды страновых рисков 2016 года в интерпретации BERI и Euromoney.
9. Обоснуйте страновые риски РФ для иностранного бизнеса в современных условиях.
10. Раскройте понятие и идентифицируйте основные отраслевые и структурные риски
11. Обоснуйте типичные и специфические риски во ВЭД российских предприятий.
12. Обозначьте риски, возникающие на различных этапах внешнеэкономических сделок.
13. Обоснуйте алгоритм и методики идентификации и оценки рисков во ВЭД.
14. Раскройте содержание количественных методов идентификации и оценки рисков во ВЭД.
15. Охарактеризуйте содержание качественных методик идентификации и оценки рисков во ВЭД.
16. Обоснуйте сущность и алгоритм построения матрицы рисков во ВЭД предприятия.
17. Раскройте сущность политики риск-менеджмента и ее виды.
18. Охарактеризуйте стандарты риск-менеджмента и их особенности.
19. Обоснуйте технологию управления рисками.
20. Охарактеризуйте внешние предпринимательские риски и методы управления ими

21. Охарактеризуйте внутренние предпринимательские риски и методы управления ими
22. Раскройте особенности управления рисками во внешнеторговой деятельности
23. Приведите алгоритм анализа риско-профиля внешнеторговых сделок

#### Шкала оценивания

Оценка результатов производится на основе балльно-рейтинговой системы (БРС). Использование БРС осуществляется в соответствии с приказом от 06 сентября 2019 г. №306 «О применении балльно-рейтинговой системы оценки знаний обучающихся».

Схема расчетов сформирована в соответствии с учебным планом направления, согласована с руководителем научно-образовательного направления, утверждена деканом факультета.

Схема расчетов доводится до сведения студентов на первом занятии по данной дисциплине, является составной частью рабочей программы дисциплины и содержит информацию по изучению дисциплины, указанную в Положении о балльно-рейтинговой системе оценки знаний обучающихся в РАНХиГС.

В соответствии с балльно-рейтинговой системой максимально-расчетное количество баллов за семестр составляет 100, из них в рамках дисциплины отводится:

- 30 баллов - на промежуточную аттестацию
- 50 баллов - на работу на практических занятиях
- 20 баллов - на посещаемость занятий

В случае если студент в течение семестра не набирает минимальное число баллов, необходимое для сдачи промежуточной аттестации, то он может заработать дополнительные баллы, отработав соответствующие разделы дисциплины, получив от преподавателя компенсирующие задания.

**Критерии оценки ответа на вопросы на зачёте:**

«Зачтено» ставится в том случае, если студент продемонстрирует знание основных понятий, относящихся к изучаемой дисциплине, правильно ответить, по крайней мере, на один дополнительный вопрос, в состоянии выполнить практические действия. Ответ должен быть логичным и последовательным, либо студент способен уточнить содержание ответа

«Не зачтено» ставится в том случае, если студент не демонстрирует знание основных понятий, относящихся к изучаемой дисциплине, не отвечает ни на один дополнительный вопрос, и изложение ответа на вопрос не последовательное и не логичное. При этом, студент не в состоянии выполнить практические действия.

- 51-100 баллов - зачет
- 0-50 баллов - незачет

#### **4.4. Методические материалы**

**Критерии оценки ответа на вопросы на зачете:**

**Формой итоговой аттестации является зачет**

Итоговая оценка знаний студента базируется на двух составляющих:

- 1) Активность и текущая успеваемость в течение семестра – 40% итоговой оценки.
- 2) Результат итогового зачета – 60% итоговой оценки.

Итоговый экзамен проводится в письменной форме (при необходимости – в письменно-устной).

**Критерии оценки на зачете**

Положительная оценка «зачтено» ставится при условии, что студент, дает ответы на все вопросы и дополнительные вопросы, ответы демонстрируют понимание проблем



изучаемого предмета, сформированную систему знаний по всем темам дисциплины, навыки анализа предприятия, умения обосновать свою позицию, основываясь на системе полученных знаний.

Неудовлетворительная оценка «незачтено» ставится в случае, если студент не правильно решил задачи, не может ответить на часть вопросов, дает не верные или не глубокие ответы, не способен обосновать свою точку зрения.

**Критерии допуска к зачету:** преподаватель имеет право не допустить к сдаче зачета студентов при 50 и более процентов пропусков ими практических занятий.

## **5. Методические указания для обучающихся по освоению дисциплины**

Дисциплина «Риск-менеджмент при осуществлении внешнеэкономической деятельности», изучается студентами на 7 семестре очной формы обучения. При подготовке к лекционным занятиям студенту следует ознакомиться с учебно-тематическим планом изучаемой учебной дисциплины, а также с Календарным планом прохождения соответствующего курса - с тем, чтобы иметь возможность вспомнить уже пройденный материал данного курса и на этой основе подготовиться к восприятию новой информации, следуя логике изложения курса преподавателем-лектором.

В процессе лекционного занятия студент ведет свой конспект лекций, делая записи, касающиеся основных тезисов лектора. Это могут быть исходные проблемы и вопросы, ключевые понятия и их определения, важнейшие положения и выводы, существенные оценки и т.д.

В заключительной части лекции студент может задать вопросы преподавателю по содержанию лекции, уточняя и уясняя для себя теоретические моменты, которые остались ему непонятными.

Стоит отметить, что необходимо также систематическая самостоятельная работа студента. Самостоятельная работа студента, прежде всего, подразумевает изучение им учебной и научной литературы, рекомендуемой рабочей программой дисциплины и программой курса. Кроме того, студент должен уделять время детальному и вдумчивому изучению нормативно-правовых документов, регулирующих перемещение товаров через таможенную границу ЕАЭС.

## **6. Учебная литература и ресурсы информационно-телекоммуникационной сети "Интернет", включая перечень учебно-методического обеспечения для самостоятельной работы обучающихся по дисциплине**

### **6.1. Основная литература.**

1. Фомичев, А.Н. Риск-менеджмент: Учебник. [Электронный ресурс] — Электрон. дан. — М. : Дашков и К, 2016. — 372 с. — Режим доступа: <http://idp.nwira.ru:2747/book/77294> — Загл. с экрана.

2. Кудрявцев, А.А. Введение в количественный риск-менеджмент: учебник. [Электронный ресурс] / А.А. Кудрявцев, А.В. Радионов. — Электрон. дан. — СПб. : СПбГУ, 2016. — 192 с. — Режим доступа: <http://idp.nwira.ru:2747/book/78092> — Загл. с экрана.

### **6.2. Дополнительная литература.**

1. Экономический и таможенный риск-менеджмент: монография. [Электронный ресурс] — Электрон. дан. — М.: РТА, 2015. — 180 с. — Режим доступа: <http://idp.nwira.ru:2747/book/74231> — Загл. с экрана.

2. Селюков, В.К. Риск-менеджмент организации. [Электронный ресурс] — Электрон. дан. — М. : МГТУ им. Н.Э. Баумана, 2008. — 188 с. — Режим доступа: <http://idp.nwira.ru:2747/book/58572> — Загл. с экрана.

### **6.3. Учебно-методическое обеспечение самостоятельной работы.**

В ходе учебного процесса не используется.

#### **6.4. Нормативные правовые документы.**

В ходе учебного процесса не используется.

#### **6.5. Интернет-ресурсы.**

Для освоения дисциплины следует пользоваться доступом через сайт научной библиотеки <http://nwapa.spb.ru/> к следующим подписным электронным ресурсам:

##### ***Русскоязычные ресурсы:***

- официальный сайт Евразийского экономического союза <http://www.eaeunion.org/>;
- официальный сайт Евразийской экономической Комиссии

<http://www.eurasiancommission.org/>;

- электронные учебники электронно-библиотечной системы (ЭБС) «Айбукс»;

- электронные учебники электронно-библиотечной системы (ЭБС) «Лань»;

- статьи из периодических изданий по общественным и гуманитарным наукам «Ист-

**Вью»;**

- энциклопедии, словари, справочники «Рубрикон»;

- полные тексты диссертаций и авторефератов **Электронная Библиотека Диссер-**

**таций РГБ.**

##### ***Англоязычные ресурсы:***

- **EBSCO Publishing** - доступ к мультидисциплинарным полнотекстовым базам данных различных мировых издательств по бизнесу, экономике, финансам, бухгалтерскому учету, гуманитарным и естественным областям знаний, рефератам и полным текстам публикаций из научных и научно-популярных журналов.

Кроме вышеперечисленных ресурсов, используются следующие ресурсы сети Интернет:

[www.cfin.ru](http://www.cfin.ru),

[www.rbc.ru](http://www.rbc.ru)

[www.expert.ru](http://www.expert.ru)

[www.finansmag.ru](http://www.finansmag.ru)

[www.cbonds.ru](http://www.cbonds.ru)

[www.rts.ru](http://www.rts.ru)

[www.allinsurance.ru](http://www.allinsurance.ru)

<http://econ.me/forum/>

### **7. Материально-техническая база, информационные технологии, программное обеспечение и информационные справочные системы**

Курс включает использование программного обеспечения Microsoft Excel, Microsoft Word, Microsoft Power Point для подготовки текстового и табличного материала, графических иллюстраций; Ramus – для моделирования бизнес-процессов.

Методы обучения с использованием информационных технологий (компьютерное тестирование, демонстрация мультимедийных материалов)

Интернет-сервисы и электронные ресурсы (поисковые системы, электронная почта, профессиональные тематические чаты и форумы, системы аудио и видео конференций, онлайн энциклопедии, справочники, библиотеки, электронные учебные и учебно-методические материалы)

Системы дистанционного обучения.

### **Описание материально-технической базы,**

**необходимой для осуществления образовательного процесса по дисциплине**

№ п/п	Наименование
1.	Специализированные залы для проведения лекций:
2.	Специализированная мебель и оргсредства: аудитории и компьютерные классы, оборудованные посадочными местами
3.	Технические средства обучения: Персональные компьютеры; компьютерные проекторы; звуковые динамики; программные средства, обеспечивающие просмотр видеофайлов в форматах AVI, MPEG-4, DivX, RMVB, WMV.
4.	Прочее