

Документ подписан простой электронной подписью  
Информация о владельце:  
ФИО: Андрей Драгомирович Хлутков  
Должность: директор  
Дата подписания: 16.06.2026 22:02:15  
Уникальный программный ключ:  
880f7c07c583b07b775f6604a630281b13ca9fd2

Приложение 4  
к образовательной программе

## **РАБОЧАЯ ПРОГРАММА ДИСЦИПЛИНЫ**

Б1.В.ДЭ.01.01 Риск-менеджмент в сфере внешнеэкономической деятельности  
(индекс, наименование дисциплины в соответствии с учебным планом)

38.05.02 Таможенное дело  
(код, наименование направления подготовки)

Таможенные операции и таможенный контроль  
(наименование образовательной программы)

очная/заочная  
(формы обучения)

Год набора – 2026

Санкт-Петербург

**Автор(ы)-составитель(и) РПД:**

Степанов Радик Геннадьевич, канд. юрид. наук, доцент кафедры таможенного администрирования

**Заведующий кафедрой:**

Гетман Анастасия Геннадьевна, д-р экон. наук, доц., заведующий кафедрой таможенного администрирования

Рабочая программа дисциплины Б1.В.ДЭ.01.01 Риск-менеджмент в сфере внешнеэкономической деятельности одобрена на заседании кафедры таможенного администрирования факультета безопасности и таможни РАНХиГС Санкт-Петербург

Протокол № 9 от 30 апреля 2026 года

## **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. Типы оценочных материалов, показатели и критерии их оценивания
5. Формы аттестации, типовые оценочные материалы для текущего контроля успеваемости обучающихся, критерии и шкалы оценивания по контрольным точкам
6. Формы промежуточной аттестации, критерии и шкала оценивания, типовые оценочные материалы по дисциплине
7. Методические материалы по освоению дисциплины
8. Учебная литература и ресурсы информационно-телекоммуникационной сети «Интернет»
9. Материально-техническая база, информационные технологии, программное обеспечение и информационные справочные системы

# 1. Перечень планируемых результатов обучения по дисциплине, соотнесенных с планируемыми результатами освоения программы

Дисциплина Б1.В.ДЭ.01.01 Риск-менеджмент в сфере внешнеэкономической деятельности обеспечивает формирование у обучающихся следующих универсальных, общепрофессиональных и профессиональных компетенций\*:

<b>ОТФ/ТФ и реквизиты ПС</b>  <i>(при наличии)</i> <b>**</b>	<b>Код компетенции **</b>	<b>Наименование</b>  <b>Компетенции **</b>	<b>Код индикатора достижения компетенций **</b>	<b>Наименование индикатора достижения компетенций **</b>	<b>Образовательный результат **</b>
	УК ОС-1	Способен применять критический анализ информации и системный подход для решения задач обоснования собственной гражданской и мировоззренческой позиции	УК ОС-1.2	Вырабатывает стратегию действий, направленную на устранение рисков возникновения проблемных ситуаций	УК ОС-1.2 3-5  Знает общую терминологию в области управления рисками и антикризисного управления по ВЭД, современные принципы и методы формирования систем управления рисками по ВЭД.  УК ОС-1.2 У-5  Умеет разрабатывать систему управления рисками по ВЭД  УК ОС-1.2 Н-5  Обладает навыками практическое решение актуальных задач в области управления рисками по ВЭД; прогнозирование последствий принятия управленческих решений в кризисных ситуациях
	ПКо ОС-4	Способен осуществлять таможенный контроль за соблюдением таможенного законодательства	ПКо ОС-4.1	Осуществляет выбор, проведение анализа и формулирование основных требований действующего таможенного законодательства ЕАЭС, законодательства Российской Федерации, регламентирующего порядок осуществления таможенного контроля	ПКо ОС-4.1. 3-6 Знает: содержание процесса управления рисками по ВЭД на его основных этапах методологию процесса управления рисками по ВЭД  ПКо ОС-4.1. У-6  Умеет анализировать варианты антикризисного управления с целью поиска оптимального

					управленческого решения; пользоваться инструментами риск менеджмента на уровне навыков: использование математических и статистических методов расчета уровня рисков по ВЭД; выявления, оценки и анализа уровня рисков по ВЭД
--	--	--	--	--	--

\* Дисциплина может формировать компетенцию полностью или частично.

\*\* Должно соответствовать Приложению 1 к образовательной программе

## 2. Объем и место дисциплины в структуре образовательной программы

### Объем дисциплины

Общая трудоемкость дисциплины по учебному плану составляет 2 зачетные единицы или 72 академических часов/54 астрономических часов.

Дисциплина реализуется частично с применением дистанционных образовательных технологий (далее – ДОТ).

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.

Для очной формы обучения трудоемкость контактной работы с преподавателем составляет 34 ч. (из них: лекции – 12 ч., практические занятия – 18 ч. контроль-4 часа), самостоятельная работа – 38 ч.

Для заочной формы обучения трудоемкость контактной работы с преподавателем составляет 10 ч. (из них: лекции – 4 ч., практические занятия – 6 ч.), контроль – 4 ч., самостоятельная работа – 58 ч.

### Место дисциплины в структуре ОП ВО

Дисциплина Б1.В.ДЭ.01.01 Риск-менеджмент в сфере внешнеэкономической деятельности осваивается в 9 семестре для очной формы обучения и в 11 семестре для заочной формы обучения.

Учебная дисциплина базируется на знаниях, полученных на дисциплине Основы таможенного дела, Экономика организаций, Высшая математика, Математические методы и модели в таможенном деле.

Знания, умения и навыки, полученные при изучении дисциплины, используются студентами при подготовке и сдаче государственного экзамена.

Формой промежуточной аттестации в соответствии с учебным планом является зачет.

### 3. Содержание и структура дисциплины

#### 3.1. Структура дисциплины

Очная форма обучения

№ п/п	Наименование тем и (или) разделов	ВСЕГО	Объем дисциплины, ак.час										Форма текущего контроля успеваемости, промежуточной аттестации		
			Контактная работа обучающихся с преподавателем по видам учебных занятий							Самостоятельная работа					
			Период теоретического обучения				Период промежуточной аттестации (сессия)			СРкр	СРэк	СР			
			Занятия лекционного типа		Занятия семинарского типа		ИК	КСР	КЭ					Катгэк	Контроль
Л	ВЛ	ЛР	ПЗ												
Тема 1	Природа риска и его содержание. Место и роль рисков в предпринимательской деятельности. Классификация рисков.	12	2	0	0	3	0	0	0	0	0	0	0	7	Т, ПКЗ
Тема 2	Идентификация и анализ риска во внешнеэкономической деятельности	12	2	0	0	3	0	0	0	0	0	0	0	7	ПИЗ
Тема 3	Риск-менеджмент -	11	2	0	0	3	0	0	0	0	0	0	0	6	ПИЗ

	система управления. Стратегия риск-менеджмента.													
Тема 4	Риски внешнеэкономической деятельности	11	2	0	0	3	0	0	0	0	0	0	6	ПИЗ
Тема 5	Страхование в управлении рисками	11	2	0	0	3	0	0	0	0	0	0	6	ПИЗ
Тема 6	Методы управления финансовыми рисками	11	2	0	0	3	0	0	0	0	0	0	6	ПКЗ
Промежуточная аттестация														<b>Зачет</b>
<b>Итого</b>		72	12	0	0	18	0	0	0	4	0	0	38	

*Используемые сокращения:*

Л – лекции - занятия, предусматривающие преимущественную передачу учебной информации обучающимся педагогическими работниками организации и (или) лицами, привлекаемыми организацией к реализации образовательных программ на иных условиях,).

ВЛ – видео лекции.

ЛР – лабораторные работы.

ПЗ – практические занятия (за исключением лабораторных работ).

ИК – индивидуальные консультации.

КСР – контроль самостоятельной работы

КЭ – консультации перед экзаменом

Каттэк – контактная работа на аттестацию в период экзаменационных сессий

Контроль - контактная работа на аттестацию в период экзаменационных сессий для заочной формы обучения

СРкр – самостоятельная работа на подготовку курсовой работы/ курсового проекта.

СРэк – самостоятельная работа на подготовку к экзамену.

СР – самостоятельная работа в семестре на подготовку к учебным занятиям.

Т – тестирование.

ПКЗ – практические контрольные задания.

ПИЗ – профессионально-исследовательские задания.

### 3.1. Структура дисциплины Заочная форма обучения

№ п/п	Наименование тем и (или) разделов	ВСЕГО	Объем дисциплины, ак.час											Форма текущего контроля успеваемости, промежуточной аттестации							
			Контактная работа обучающихся с преподавателем по видам учебных занятий							Самостоятельная работа											
			Период теоретического обучения				ИК			КСП			КЭ			Кат тэк	К о н т р о л ь	СРкр	СРэк	СР	
			Занятия лекционного типа		Занятия семинарского типа		Л	ВЛ	ЛР	ПЗ											
Л	ВЛ	ЛР	ПЗ																		
Тема 1	Природа риска и его содержание. Место и роль рисков в предпринимательской деятельности. Классификация рисков.	12	1	0	0	1	0	0	0	0	0	0	0	0	0	10	Т, ПКЗ				
Тема 2	Идентификация и анализ риска во внешнеэкономической деятельности	12	1	0	0	1	0	0	0	0	0	0	0	0	0	10	ПИЗ				
Тема 3	Риск-менеджмент - система управления. Стратегия риск-менеджмента.	12	1	0	0	1	0	0	0	0	0	0	0	0	0	10	ПИЗ				
Тема 4	Риски	12	1	0	0	1	0	0	0	0	0	0	0	0	0	10	ПИЗ				

	внешнеэкономической деятельности													
Тема 5	Страхование в управлении рисками	10	0	0	0	1	0	0	0	0	0	0	9	ПИЗ
Тема 6	Методы управления финансовыми рисками	10	0	0	0	1	0	0	0	0	0	0	9	ПКЗ
Промежуточная аттестация										4				<b>Зачет</b>
<b>Итого</b>		72	4	0	0	6	0	0	0	4	0	0	58	

*Используемые сокращения:*

Л – лекции - занятия, предусматривающие преимущественную передачу учебной информации обучающимся педагогическими работниками организации и (или) лицами, привлекаемыми организацией к реализации образовательных программ на иных условиях,).

ВЛ – видео лекции.

ЛР – лабораторные работы.

ПЗ – практические занятия (за исключением лабораторных работ).

ИК – индивидуальные консультации.

КСР – контроль самостоятельной работы

КЭ – консультации перед экзаменом

Каттэк – контактная работа на аттестацию в период экзаменационных сессий

Контроль - контактная работа на аттестацию в период экзаменационных сессий для заочной формы обучения

СРкр – самостоятельная работа на подготовку курсовой работы/ курсового проекта.

СРэк – самостоятельная работа на подготовку к экзамену.

СР – самостоятельная работа в семестре на подготовку к учебным занятиям.

Т – тестирование.

ПКЗ – практические контрольные задания.

ПИЗ – профессионально-исследовательские задания.

В процессе обучения применяются следующие интерактивные формы: лекция-диалог, работа в малых группах, спарринг-партнерство. Темы 1-5 могут быть освоены с применением ЭО и ДОТ с контролем в системе электронного обучения Академии.

### 3.2. Содержание дисциплины

#### **Тема 1. Природа риска и его содержание. Место и роль рисков в предпринимательской деятельности. Классификация рисков. УК ОС-1.2.**

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. УК ОС-1.2.**

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. УК ОС-1.2, ПКo ОС-4.1.**

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. Планирование 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. ПКo OC-4.1.**

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. ПКo OC-4.1.**

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. ПКo OC-4.1.**

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. Типы оценочных материалов, показатели и критерии оценивания**

4.1. Оценочные материалы по дисциплине Б1.В.ДЭ.01.01 Риск-менеджмент в сфере внешнеэкономической деятельности анализ входят в состав оценочных материалов по образовательной программе. Совокупность оценочных материалов по всем дисциплинам образовательной программы составляет фонд оценочных средств (далее – ФОС). ФОС используется при проведении текущего контроля успеваемости и промежуточной аттестации обучающихся с целью оценивания достижения обучающимися планируемых результатов обучения.

4.2. ФОС разработан как комплекс проверочных заданий различного типа и уровня сложности, включает критерии и шкалы оценивания, а также «ключи» правильных ответов. ФОС формируется как отдельный документ и хранится в электронном виде, доступ к ФОС предоставлен ограниченному кругу лиц.

4.3. Для самостоятельной работы обучающихся при подготовке к текущему контролю успеваемости и промежуточной аттестации в рабочих программах дисциплин размещены типовые проверочные задания, которые можно условно разделить на задания закрытого, комбинированного и открытого типов.

Задания закрытого типа — это тестовые задания, в которых каждый вопрос сопровождается готовыми вариантами ответов, из которых необходимо выбрать один или несколько правильных.

Задания комбинированного типа – это тестовые задания, в которых каждый вопрос сопровождается готовыми вариантами ответов, из которых необходимо выбрать один или несколько правильных и обосновать свой выбор.

Задания открытого типа — это задания, в которых на каждый вопрос должен быть предложен развернутый обоснованный ответ.

В зависимости от типа задания рекомендованы определенная последовательность выполнения и система оценивания выполнения заданий.

#### 4.4. Типы заданий, сценарии выполнения, критерии оценивания

ТИП ЗАДАНИЯ	ИНСТРУКЦИЯ	СЦЕНАРИИ ВЫПОЛНЕНИЯ	КРИТЕРИИ ОЦЕНИВАНИЯ
Задание закрытого типа с выбором одного правильного ответа из нескольких вариантов предложенных	Прочитайте текст, выберите правильный ответ	<ol style="list-style-type: none"> <li>1. Внимательно прочитать текст задания и понять, что в качестве ответа ожидается только один из предложенных вариантов.</li> <li>2. Внимательно прочитать предложенные варианты ответа.</li> <li>3. Выбрать один верный ответ.</li> <li>4. Записать только номер (или букву) выбранного варианта ответа (например, 3 или В).</li> </ol>	Ответ считается верным, если правильно указана цифра или буква
Задание закрытого типа на установление соответствия	Прочитайте текст и установите соответствие	<ol style="list-style-type: none"> <li>1. Внимательно прочитать текст задания и понять, что в качестве ответа ожидаются пары элементов.</li> <li>2. Внимательно прочитать оба списка: список 1 – вопросы, утверждения, факты, понятия и т.д.; список 2 – утверждения, свойства объектов и т.д.</li> <li>3. Сопоставить элементы списка 1 с элементами списка 2, сформировать пары элементов.</li> <li>4. Записать попарно буквы и цифры (в зависимости от задания) вариантов ответа (например, А1 или Б4).</li> </ol>	Ответ считается верным, если правильно указаны цифры или буквы
Задание закрытого типа с выбором нескольких правильных ответов из нескольких вариантов предложенных	Прочитайте текст, выберите правильные ответы	<ol style="list-style-type: none"> <li>1. Внимательно прочитать текст задания и понять, что в качестве ответа ожидается несколько правильных ответов из предложенных вариантов.</li> <li>2. Внимательно прочитать предложенные варианты ответа.</li> <li>3. Выбрать несколько правильных ответов.</li> <li>4. Записать только номера (или буквы) выбранного варианта ответа (например, 1 4 или А Г).</li> </ol>	Ответ считается верным, если правильно установлены все соответствия (позиции из одного столбца верно сопоставлены с позициями другого)
Задание закрытого типа на установление последовательности	Прочитайте текст и установите последовательность	<ol style="list-style-type: none"> <li>1. Внимательно прочитать текст задания и понять, что в качестве ответа ожидается последовательность элементов.</li> <li>2. Внимательно прочитать предложенные варианты</li> </ol>	Ответ считается верным, если правильно указана вся последовательность цифр

		<p>ответа.</p> <p>3. Построить верную последовательность из предложенных элементов.</p> <p>4. Записать буквы/цифры (в зависимости от задания) вариантов ответа в нужной последовательности (например, БВА или 135).</p>	
<p>Задание комбинированного типа с выбором одного правильного ответа из предложенных и обоснованием выбора</p>	<p>Прочитайте текст, выберите правильный ответ и запишите аргументы, обосновывающие выбор ответа</p>	<p>1. Внимательно прочитать текст задания и понять, что в качестве ответа ожидается только один из предложенных вариантов.</p> <p>2. Внимательно прочитать предложенные варианты ответа.</p> <p>3. Выбрать один верный ответ.</p> <p>4. Записать только номер (или букву) выбранного варианта ответа.</p> <p>5. Записать аргументы, обосновывающие выбор ответа (например, 4 текст обоснования).</p>	<p>Ответ считается верным, если правильно указана цифра или буква и приведены корректные аргументы, используемые при выборе ответа</p>
<p>Задание открытого типа с развернутым ответом</p>	<p>Прочитайте текст и запишите развернутый обоснованный ответ</p>	<p>1. Внимательно прочитать текст задания и понять суть вопроса.</p> <p>2. Продумать логику и полноту ответа.</p> <p>3. Записать ответ, используя четкие компактные формулировки.</p> <p>4. В случае расчетной задачи, записать решение и ответ</p>	<p>Ответ считается верным:</p> <p>1. Отсутствие фактических ошибок.</p> <p>2. Раскрытие объема используемых понятий (полнота ответа).</p> <p>3. Обоснованность ответа (наличие аргументов).</p> <p>4. Логическая последовательность излагаемого материала.</p>

4.5. Общая шкала оценивания результатов текущего контроля успеваемости и промежуточной аттестации обучающихся с применением БРС

Итоговая балльная оценка	Традиционная система	Бинарная система	ECTS	
			Для традиционной системы	Для бинарной системы
95-100	Отлично	Зачтено	A	P/ Passed
85-94			B	P/ Passed
75-84	Хорошо		C	P/ Passed
65-74			D	P/ Passed
55-64	Удовлетворительно		E	P/ Passed
0-54	Неудовлетворительно	Не зачтено	F	F/Failed

Соотношение баллов за текущий контроль успеваемости и промежуточную аттестацию, а также повторную промежуточную аттестацию:

Максимальная сумма баллов за текущий контроль успеваемости	Максимальная сумма баллов за промежуточную аттестацию	Максимальная итоговая балльная оценка	Максимальная сумма баллов за повторную промежуточную аттестацию
60 баллов	40 баллов	100 баллов	100 баллов

## 5. Формы аттестации, типовые оценочные материалы для текущего контроля успеваемости обучающихся, критерии и шкалы оценивания по контрольным точкам

5.1. В ходе реализации дисциплины используются следующие формы текущего контроля успеваемости обучающихся (в том числе, задания к контрольным точкам):

Т – тестирование, ПКЗ – практические контрольные задания, ПИЗ – профессионально-исследовательские задания.

**Тема 1. Природа риска и его содержание. Место и роль рисков в предпринимательской деятельности. Классификация рисков. УК ОС-1.2.**

Тестовые задания:

Тест 1.

Внимательно прочитать текст задания и понять, что в качестве ответа ожидается только один из предложенных вариантов.

Внимательно прочитать предложенные варианты ответа.

Выбрать один верный ответ.

Записать только букву выбранного варианта ответа.

Какое из перечисленных определений наиболее полно отражает сущность риска в контексте внешнеэкономической деятельности?

А) Уверенность в получении ожидаемого результата;

В) Вероятность отклонения фактических результатов от ожидаемых;

С) Гарантированное возникновение убытков;

Д) Неизменность внешней среды.

Тест 2.

Внимательно прочитать текст задания и понять, что в качестве ответа ожидается только один из предложенных вариантов.

Внимательно прочитать предложенные варианты ответа.

Выбрать один верный ответ.

Записать только букву выбранного варианта ответа.

К какой группе рисков относится риск изменения таможенного законодательства страны-партнёра?

А) Операционный риск;

В) Финансовый риск;

С) Правовой (юридический) риск;

Д) Кредитный риск.

Тест 3.

Внимательно прочитать текст задания и понять, что в качестве ответа ожидается только один из предложенных вариантов.

Внимательно прочитать предложенные варианты ответа.

Выбрать один верный ответ.

Записать только букву выбранного варианта ответа.

Какой из перечисленных рисков не относится к внешним рискам внешнеэкономической деятельности?

А) Политическая нестабильность в стране-импортёре;

В) Неплатёжеспособность зарубежного контрагента;

С) Ошибки в логистическом планировании компании;

Д) Колебания валютных курсов.

ПИЗ по теме 1:

Задание 1.

ООО «БалтикТрейд» (Санкт-Петербург) планирует поставку оборудования в Турцию. Оплата предусмотрена в турецких лирах через 90 дней после отгрузки. За последний год курс турецкой лиры к рублю снизился более чем на 30%.

Определите, с какими видами рисков сталкивается компания в описанной ситуации.

Классифицируйте выявленные риски по следующим основаниям:

- по источнику (внутренний/внешний);
- по сфере проявления;
- по степени управляемости.

Предложите одну предварительную меру по снижению наиболее значимого риска.

### Задание 2.

Российская компания заключает контракт с поставщиком из Китая на условиях EXW («с завода поставщика»). Однако в момент доставки товара выясняется, что китайская сторона не оформила необходимые экспортные разрешения, и груз задержан на таможне КНР.

Охарактеризуйте природу риска, возникшего в данной ситуации.

Определите, к какому типу рисков (по общепринятой классификации в ВЭД) он относится.

Обоснуйте, почему данный риск можно считать внешним, но частично управляемым со стороны российской компании.

### Задание 3.

Международная компания планирует выйти на рынок стран Латинской Америки. В ходе предварительного анализа выявлены следующие факторы:

- частая смена валютного регулирования;
- высокий уровень коррупции в таможенных органах;
- отсутствие двустороннего соглашения о защите инвестиций с РФ;
- слабая развитость логистической инфраструктуры.

Сгруппируйте перечисленные факторы по видам рисков, актуальным для внешнеэкономической деятельности.

Для каждого вида риска укажите:

- его потенциальное последствие для бизнеса;
- относится ли он к допустимому, критическому или катастрофическому уровню (обоснуйте).

Сформулируйте вывод о целесообразности входа на рынок без разработки системы риск-менеджмента.

**Тема 2. Идентификация и анализ риска во внешнеэкономической деятельности. УК ОС-1.2.**

## ПИЗ по теме 2:

### Задание 1.

Проведите сравнительный анализ указанных методов идентификации рисков применительно к внешнеэкономической деятельности российской промышленной компании, планирующей экспорт продукции в Европейский Союз.

в исследовании необходимо:

Охарактеризовать суть каждого метода и условия его эффективного применения.

Оценить их применимость к выявлению страновых, валютных, правовых и логистических рисков.

Обосновать, какой из методов (или их комбинация) наиболее целесообразен в условиях высокой неопределённости и санкционного давления.

Предложить рекомендации по адаптации выбранного метода под специфику российского экспорта.

### Задание 2.

Исследуйте инструменты и источники, используемые для due diligence зарубежных контрагентов в условиях ограничений на доступ к международным базам данных (например, в связи с санкциями).

В работе следует:

Провести обзор доступных российских и международных источников (например, СПАРК, Contour, OpenSanctions, национальные торговые реестры).

Проанализировать, какие риски (неплатёжеспособность, аффилированность с санкционными лицами, подделка документов) могут быть выявлены на этапе предконтрактного анализа.

Разработать минималистичный чек-лист проверки контрагента для малого экспортёра без доступа к платным базам.

Обосновать, как своевременная идентификация этих рисков снижает вероятность наступления убытков.

### Задание 3.

Проведите исследование применимости качественных (например, экспертные оценки, матрица вероятность/воздействие) и количественных (например, VaR, анализ чувствительности, имитационное моделирование) методов анализа рисков для российских компаний, осуществляющих экспортно-импортные операции.

В исследовании необходимо:

Описать суть каждого подхода и условия его использования.

На примере конкретного типа риска (например, валютного или странового) показать, как может быть реализован его анализ обоими методами.

Выявить основные барьеры внедрения количественных методов в практику российских экспортёров (особенно МСП).

Сформулировать вывод о целесообразности гибридного подхода «качество + количественная оценка» в современных условиях ВЭД.

### **Тема 3. Риск-менеджмент - система управления. Стратегия риск-менеджмента. УК ОС-1.2, ПКo ОС-4.1.**

#### ПИЗ по теме 3:

##### Задание 1.

Проведите сравнительный анализ двух международных стандартов управления рисками — COSO ERM (2017) и ISO 31000:2018 — в контексте их применимости к внешнеэкономической деятельности российских компаний.

В исследовании необходимо:

Охарактеризовать ключевые элементы каждой модели (принципы, структура, этапы).

Выявить сходства и различия в подходах к формулировке стратегии риск-менеджмента.

Оценить, какая из моделей лучше учитывает специфику внешних рисков (страновых, валютных, санкционных, правовых).

Обосновать возможность или необходимость адаптации одной из моделей (или их гибридной версии) для использования российской экспортно-ориентированной компанией в условиях геополитической нестабильности.

##### Задание 2.

Исследуйте, как стратегия риск-менеджмента должна эволюционировать по мере расширения международной деятельности компании — от случайных экспортных поставок до создания зарубежных дочерних предприятий.

Кратко описать этапы международной экспансии по Uppsala Model.

Для каждого этапа определить:

- доминирующие категории рисков в ВЭД;
- соответствующую стратегию риск-менеджмента (избегание, снижение, передача, принятие);
- необходимый уровень формализации системы управления рисками.

На основе анализа предложить модель «стратегии риск-менеджмента по стадиям интернационализации», применимую к российским компаниям.

Обосновать, почему «одинаковая стратегия для всех» неприменима в ВЭД.

### Задание 3.

Проведите исследование по проблеме отрыва системы риск-менеджмента от общей бизнес-стратегии компаний, работающих на экспорт.

В работе необходимо:

Выявить основные причины, по которым риск-менеджмент в российских экспортёрах часто воспринимается как формальность или отдельная функция, а не стратегический инструмент.

На основе анализа лучших практик (в т.ч. зарубежных) определить ключевые условия для успешной интеграции риск-менеджмента в стратегическое планирование ВЭД.

Разработать алгоритм встраивания целей риск-менеджмента в стратегические КРІ внешнеэкономического блока компании (например, «долгосрочная рентабельность экспортных контрактов с учётом рисков»).

Сделать вывод о том, как такая интеграция повышает устойчивость бизнеса в условиях волатильности глобальных рынков.

## **Тема 4. Риски внешнеэкономической деятельности. ПКo OC-4.1.**

### ПИЗ по теме 4:

#### Задание 1.

Проведите исследование трансформации профиля рисков внешнеэкономической деятельности российских экспортёров и импортёров за период 2022–2025 гг.

В работе необходимо:

Выделить ключевые категории рисков ВЭД до 2022 года (традиционные: валютные, коммерческие, логистические и др.).

Охарактеризовать новые или усиленные риски, возникшие в условиях санкций:

- ограничения на использование SWIFT и международных платёжных систем;
- проблемы легитимизации контрагентов;
- риски вторичных санкций;
- нестабильность новых логистических коридоров.

На основе открытых источников (отчёты ЭКСАР, Деловой России, АЭБ, РЭЦ и др.) определить, какие риски стали доминирующими в 2024–2025 гг.

Сформулируйте вывод о том, как изменились приоритеты риск-менеджмента в стратегиях российских компаний.

### Задание 2.

Исследуйте и сравните страновые риски при организации внешнеэкономической деятельности с упором на четыре ключевых направления экспортной диверсификации России.

В работе следует:

Для каждой из стран (КНР, Индия, ОАЭ, Иран) проанализировать:

- политическую и экономическую стабильность;
- особенности валютного и таможенного регулирования;
- правовые барьеры и практику разрешения споров;
- уровень коррупции и прозрачность госзакупок.

Использовать метод сравнительной матрицы рисков с весовыми коэффициентами по значимости для российского экспорта.

Определить, какая из стран представляет наиболее сбалансированный профиль рисков для среднего промышленного экспортёра.

Обосновать, какие риски в этих юрисдикциях можно эффективно минимизировать.

### Задание 3.

Исследуйте влияние цифровых технологий (электронный документооборот, блокчейн в логистике, ИИ в таможенном оформлении, цифровые платформы ВЭД) на профиль рисков внешнеэкономической деятельности.

В работе необходимо:

Определить, какие новые категории рисков возникают в условиях цифровизации ВЭД:

- кибератаки на платформы электронного документооборота;
- ошибки в работе ИИ при классификации товаров;
- юридическая неопределённость электронных контрактов;
- зависимости от иностранных или непроверенных IT-решений.

Проанализировать, как традиционные риски (например, задержки в поставках) трансформируются в цифровой среде.

На основе анализа инцидентов 2023–2025 гг. (по данным ФСБ, Росфинмониторинга, отраслевых ассоциаций) оценить частоту и последствия таких рисков.

Предложить меры по включению цифровых и киберрисков в корпоративную систему риск-менеджмента ВЭД.

## **Тема 5. Страхование в управлении рисками. ПКo OC-4.1.**

### ПИЗ по теме 2:

#### Задание 1.

Проведите сравнительный анализ механизмов экспортного кредитного страхования в России и за рубежом в контексте поддержки ВЭД.

В исследовании необходимо:

Охарактеризовать продукты, предлагаемые ЭКСАР (Агентство по страхованию экспортных кредитов и инвестиций), с акцентом на покрытие неплатежа контрагента и политических рисков.

Сравнить условия страхования (тарифы, лимиты, исключения) с аналогичными программами от EKF (Дания), SACE (Италия) или Euler Hermes (Германия).

На основе открытых кейсов (например, из отчётов ЭКСАР за 2023–2025 гг.) проанализировать, какие риски чаще всего страхуются российскими компаниями и насколько эффективно это снижает убытки.

Сформулируйте рекомендации по расширению использования экспортного страхования малыми и средними предприятиями в условиях диверсификации географии экспорта.

## Задание 2.

Исследуйте особенности страхования грузов при международных перевозках и оцените, насколько российские страховые продукты соответствуют международным стандартам.

В работе следует:

Описать содержание и различия между ICC (A), (B), (C) — основными условиями страхования грузов по британским правилам.

Проанализировать типовые страховые полисы, предлагаемые ведущими российскими страховщиками (например, «Ингосстрах», «СОГАЗ», «АльфаСтрахование») при перевозке грузов в страны Азии, Ближнего Востока и Латинской Америки.

Выявить пробелы в покрытии рисков (например, при использовании мультимодальных перевозок, транзите через санкционные юрисдикции, задержках на таможне).

Предложить модель универсального страхового чек-листа для экспортера, позволяющего избежать «слепых зон» в защите от транспортных рисков.

## Задание 3.

Исследуйте возможности и ограничения страхового рынка в покрытии современных, нетрадиционных рисков, с которыми сталкиваются участники ВЭД.

В работе необходимо:

Определить, какие нетиповые риски сегодня актуальны для российских компаний:

- сбои в работе цифровых платформ ВЭД;
- санкционные ограничения, приводящие к невозможности

исполнения контракта;

– репутационный ущерб из-за аффилированности с «неблагонадёжными» контрагентами.

Проанализировать наличие (или отсутствие) соответствующих страховых продуктов на российском рынке (в т.ч. через международных брокеров).

Изучить международный опыт (например, страхование supply chain disruption или trade credit insurance с расширенным покрытием) и оценить его трансфер в российскую практику.

Сформулируйте вывод о том, может ли страхование оставаться универсальным инструментом управления рисками ВЭД или требует усиления за счёт гибридных моделей (страхование + хеджирование + юридические гарантии).

## **Тема 6. Методы управления финансовыми рисками. ПКo OC-4.**

### ПКЗ по теме 6:

#### Задание 1.

Условие: ООО «Невский Экспорт» (Санкт-Петербург) заключило контракт на поставку оборудования в Китай на сумму 1 млн евро. Оплата поступит через 3 месяца. На дату заключения контракта: Спот-курс EUR/RUB = 100 руб. Банк предлагает 3-месячный форвардный курс EUR/RUB = 102 руб. Через 3 месяца спот-курс составил 95 руб. за евро.

Задание:

Рассчитайте сумму в рублях, которую получит компания:

- а) без хеджирования;
- б) при заключении форвардного контракта.

Определите финансовый результат (выгода или убыток) от использования форварда.

Сделайте вывод об эффективности хеджирования в данной ситуации.

#### Задание 2.

Условие: Российская компания планирует поставку товаров в Индию на условиях отсрочки платежа 60 дней. Себестоимость поставки — 30 млн руб., выручка — 40 млн руб. Финансовый анализ показал, что вероятность неплатежа индийским контрагентом оценивается в 10%. Руководство компании придерживается правила: ожидаемый убыток не должен превышать 5% от выручки по сделке.

Рассчитайте ожидаемый убыток от сделки.

Определите, соответствует ли сделка внутреннему критерию управления кредитным риском.

Предложите одно из возможных решений, если риск признан чрезмерным:

- сократить сумму поставки;
  - потребовать аванс;
  - застраховать дебиторскую задолженность.
- Обоснуйте выбор.

### Задание 3.

Условие: Компания получает экспортную выручку в трёх валютах:  
 50% — в долларах США (USD),  
 30% — в евро (EUR),  
 20% — в китайских юанях (CNY).

На основе исторических данных за год установлено среднеквадратичное отклонение (СКО) курсов к рублю:

USD/RUB:  $\sigma = 8$  руб.,

EUR/RUB:  $\sigma = 10$  руб.,

CNY/RUB:  $\sigma = 2$  руб.

Для упрощения считается, что корреляция между валютами равна нулю.

Рассчитайте средневзвешенное СКО валютного портфеля компании как меру совокупного валютного риска.

Предложите вариант перераспределения валютной структуры выручки (с сохранением трёх валют), который снизит общий риск (например, увеличить долю CNY).

Обоснуйте, почему диверсификация по валютам снижает общий риск даже при отсутствии хеджирования.

5.2. Типовые оценочные материалы для текущего контроля успеваемости обучающихся (вне контрольных точек):

приведены в п.6.2.

5.3. Один или несколько тематических блоков дисциплины завершаются контрольной точкой (далее – КТ). Текущий контроль успеваемости по дисциплине предусматривает не менее 2 (двух) и не более 10 (десяти) КТ в течение периода освоения дисциплины.

Максимальное количество баллов за любой тип работ в рамках КТ составляет 100 (сто) баллов.

Распределение весовых коэффициентов по КТ в рамках текущего контроля успеваемости по дисциплине и формулы расчета:

Наименование контрольной точки	Максимальное количество баллов за работу в рамках КТ, которое может набрать студент	Коэффициент веса контрольной точки	Результат контрольной точки, участвующий в формировании итоговой балльной

			оценки по дисциплине (отражается в журнале БРС в СДО)
КТ 1	100	0,1	10
КТ 2	100	0,1	10
КТ 3	100	0,1	10
КТ 4	100	0,1	10
КТ 5	100	0,1	10
КТ 6	100	0,1	10
Итого:	x	0,6	60

Формула расчета результата контрольной точки:

Результат контрольной точки = Количество баллов за работу в рамках КТ X Коэффициент веса контрольной точки.

5.4. Формы текущего контроля успеваемости обучающихся в рамках КТ и типовые оценочные материалы:

**КТ-1**

**Тема 1.**

Тестирование.

Практическое контрольное задание (ПКЗ).

**КТ-2**

**Тема 2.**

Профессионально-исследовательское задание (ПИЗ).

**КТ-3**

**Тема 3.**

Профессионально-исследовательское задание (ПИЗ).

**КТ-4**

**Тема 4.**

Профессионально-исследовательское задание (ПИЗ).

**КТ-5**

**Тема 5.**

Профессионально-исследовательское задание (ПИЗ).

**КТ-6**

**Тема 6.**

Практическое контрольное задание (ПКЗ).

Для каждой формы текущего контроля успеваемости обучающихся в рамках КТ определены критерии оценивания результатов выполнения задания.

1. Критерии оценивания тестирования:

Критерии оценки	Диапазон баллов	Описание критерия
<i>Количество правильных ответов</i>	0	<i>Количество правильных ответов менее 55%</i>
	25	<i>Количество правильных ответов от 55% до 64%</i>
	50	<i>Количество правильных ответов от 65% до 74%</i>
	75	<i>Количество правильных ответов от 75% до 84%</i>
	100	<i>Количество правильных ответов от 85% до 100%</i>
Итого максимально:	100	

2. Критерии оценивания ПКЗ:

Критерии оценки	Диапазон баллов	Описание критерия
<i>Содержание и раскрытие выбранных понятий</i>	41-70	<i>Детальное, последовательное описание всех понятий на примере выбранной системы</i>
	21-40	<i>Поверхностное описание без привязки к выбранной системе</i>
	0-20	<i>Понятия раскрыты минимально или не раскрыты вовсе</i>
<i>Количество выполненных заданий</i>	30	<i>Количество выполненных заданий от 85% до 100%</i>
	15	<i>Количество выполненных заданий от 55% до 84%</i>
	0	<i>Количество выполненных заданий менее 55%</i>
Итого максимально:	100	

3. Критерии оценивания ПИЗ:

Критерии оценки	Диапазон баллов	Описание критерия
-----------------	-----------------	-------------------

<i>Содержание и раскрытие выбранных понятий</i>	<i>31-50</i>	<i>Детальное, последовательное описание всех понятий на примере выбранной системы</i>
	<i>16-30</i>	<i>Поверхностное описание без привязки к выбранной системе</i>
	<i>0-15</i>	<i>Понятия раскрыты минимально или не раскрыты вовсе</i>
<i>Достоверность и актуальность информации</i>	<i>16-20</i>	<i>Представленная информация подтверждена ссылками на источники</i>
	<i>0-15</i>	<i>Представленная информация частично подтверждена ссылками на источники или не подтверждена</i>
<i>Количество выполненных заданий</i>	<i>30</i>	<i>Количество выполненных заданий от 85% до 100%</i>
	<i>15</i>	<i>Количество выполненных заданий от 55% до 84%</i>
	<i>0</i>	<i>Количество выполненных заданий менее 55%</i>
<b>Итого максимально:</b>	<b>100</b>	

5.5. Описание дополнительных материалов и оборудования, необходимых для выполнения проверочных заданий (*при необходимости*).

Для решения задач открытого типа (кейсов, ПКЗ, ПИЗ), тестовых заданий студенту разрешается использование калькулятора; программ для работы с электронными таблицами для обработки, анализа и визуализации данных. Для построения интеллект-карты и моделей в различных нотациях студенту можно использовать любой соответствующий онлайн-инструмент.

## **6. Формы промежуточной аттестации, критерии и шкала оценивания, типовые оценочные материалы по дисциплине**

6.1. Промежуточная аттестация проводится в форме зачета.

Экзамен может проводиться с применением следующих методов (средств):

- устный ответ на вопросы билета;
- письменный ответ на вопросы билета.

В каждом билете не менее 2 вопросов.

При реализации промежуточной аттестации с применением ДОТ:

- устно с прокторингом – в форме ответа на вопросы билета;
- письменно с прокторингом – в форме ответа на вопросы билета.

6.2. Типовые оценочные материалы промежуточной аттестации.

## **Вопросы для подготовки к зачету:**

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

23. Раскройте особенности управления рисками во внешнеторговой деятельности.

24. Приведите алгоритм анализа риско-профиля внешнеторговых сделок.

Типовые проверочные задания для самоподготовки обучающегося к промежуточной аттестации:

ТИП ЗАДАНИЯ	СЦЕНАРИИ ВЫПОЛНЕНИЯ	ТИПОВЫЕ ЗАДАНИЯ												
Задание закрытого типа с выбором одного правильного ответа из нескольких вариантов предложенных	1. Внимательно прочитать текст задания и понять, что в качестве ответа ожидается только один из предложенных вариантов. 2. Внимательно прочитать предложенные варианты ответа. 3. Выбрать один верный ответ. 4. Записать только номер (или букву) выбранного варианта ответа (например, 3 или В).	1. Какой из перечисленных методов наиболее эффективен для снижения валютного риска при экспортных поставках с отсрочкой платежа? А) Страхование ответственности директоров и должностных лиц (D&O) В) Заключение форвардного валютного контракта С) Повышение качества продукции D) Расширение ассортимента экспортируемых товаров 2. К какому типу рисков относится невозможность исполнения контракта из-за введения односторонних санкций против страны контрагента? А) Операционный риск В) Кредитный риск С) Страновой (политический) риск D) Логистический риск												
Задание закрытого типа на установление соответствия	1. Внимательно прочитать текст задания и понять, что в качестве ответа ожидаются пары элементов. 2. Внимательно прочитать оба списка: список 1 – вопросы, утверждения, факты, понятия и т.д.; список 2 – утверждения, свойства объектов и т.д. 3. Сопоставить элементы списка 1 с элементами списка 2, сформировать пары элементов. 4. Записать попарно буквы и цифры (в зависимости от задания) вариантов ответа (например, А1 или Б4).	1. Установите соответствие между видом риска во внешнеэкономической деятельности и его характеристикой: <table border="1" data-bbox="869 1142 1492 1792"> <tbody> <tr> <td data-bbox="869 1142 1181 1299">1) Валютный риск</td> <td data-bbox="1181 1142 1492 1299">А) Возникает при невозможности контрагента выполнить свои платёжные обязательства</td> </tr> <tr> <td data-bbox="869 1299 1181 1422">2) Кредитный риск</td> <td data-bbox="1181 1299 1492 1422">Б) Связан с изменением обменного курса иностранной валюты к рублю</td> </tr> <tr> <td data-bbox="869 1422 1181 1635">3) Страновой риск</td> <td data-bbox="1181 1422 1492 1635">В) Обусловлен изменениями в законодательстве, политической нестабильностью или санкциями в стране контрагента</td> </tr> <tr> <td data-bbox="869 1635 1181 1792">4) Транспортный риск</td> <td data-bbox="1181 1635 1492 1792">Г) Связан с повреждением, утратой или задержкой груза при международной перевозке</td> </tr> </tbody> </table> 2. Установите соответствие между методом управления риском и его сутью: <table border="1" data-bbox="869 1848 1492 2038"> <thead> <tr> <th data-bbox="869 1848 1181 1948">МЕТОД УПРАВЛЕНИЯ РИСКОМ</th> <th data-bbox="1181 1848 1492 1948">СУТЬ МЕТОДА</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td data-bbox="869 1948 1181 2038">1) Избежание риска</td> <td data-bbox="1181 1948 1492 2038">А) Передача финансовых последствий риска</td> </tr> </tbody> </table>	1) Валютный риск	А) Возникает при невозможности контрагента выполнить свои платёжные обязательства	2) Кредитный риск	Б) Связан с изменением обменного курса иностранной валюты к рублю	3) Страновой риск	В) Обусловлен изменениями в законодательстве, политической нестабильностью или санкциями в стране контрагента	4) Транспортный риск	Г) Связан с повреждением, утратой или задержкой груза при международной перевозке	МЕТОД УПРАВЛЕНИЯ РИСКОМ	СУТЬ МЕТОДА	1) Избежание риска	А) Передача финансовых последствий риска
1) Валютный риск	А) Возникает при невозможности контрагента выполнить свои платёжные обязательства													
2) Кредитный риск	Б) Связан с изменением обменного курса иностранной валюты к рублю													
3) Страновой риск	В) Обусловлен изменениями в законодательстве, политической нестабильностью или санкциями в стране контрагента													
4) Транспортный риск	Г) Связан с повреждением, утратой или задержкой груза при международной перевозке													
МЕТОД УПРАВЛЕНИЯ РИСКОМ	СУТЬ МЕТОДА													
1) Избежание риска	А) Передача финансовых последствий риска													

			третьей стороне (например, страховщику)
		2) Снижение (контроль) риска	Б) Полный отказ от деятельности, связанной с риском
		3) Передача риска	В) Принятие решения о сохранении риска при наличии достаточных резервов или низкой вероятности убытков
		4) Принятие риска	Г) Применение мер для уменьшения вероятности наступления или размера ущерба
Задание закрытого типа на установление последовательности	1. Внимательно прочитать текст задания и понять, что в качестве ответа ожидается последовательность элементов. 2. Внимательно прочитать предложенные варианты ответа. 3. Построить верную последовательность из предложенных элементов. 4. Записать буквы/цифры (в зависимости от задания) вариантов ответа в нужной последовательности (например, БВА или 135).	1. Установите правильную последовательность этапов процесса риск-менеджмента во внешнеэкономической деятельности: А) Выбор методов управления рисками В) Идентификация рисков С) Мониторинг и обратная связь D) Анализ и оценка рисков 2. Установите логическую последовательность действий экспортёра при управлении валютным риском в рамках одной внешнеторговой сделки: А) Определение суммы и валюты будущего поступления В) Оценка потенциальных потерь от колебаний курса С) Заключение форвардного контракта с банком D) Анализ условий контракта на предмет валютной оговорки	
Задание комбинированного типа с выбором одного правильного ответа из предложенных и обоснованием выбора	1. Внимательно прочитать текст задания и понять, что в качестве ответа ожидается только один из предложенных вариантов. 2. Внимательно прочитать предложенные варианты ответа. 3. Выбрать один верный ответ. 4. Записать только номер (или букву) выбранного варианта ответа. 5. Записать аргументы, обосновывающие выбор ответа (например, 4 текст обоснования).	1. Российская компания планирует поставку оборудования в Иран с оплатой в иранских риалах через 6 месяцев. На фоне высокой инфляции и валютных ограничений в Иране курс риала сильно волатилен. Какой метод управления риском наиболее целесообразен в данной ситуации? Варианты ответов: А) Страхование груза при транспортировке В) Заключение контракта в рублях или стабильной третьей валюте (например, юане) С) Увеличение объёма поставки для компенсации возможных потерь D) Отказ от страхования дебиторской задолженности Правильный ответ: В Обоснование: Валютный риск в данном случае связан с обесценением иранского риала, что может привести к значительным убыткам при конвертации выручки в рубли. Наиболее эффективная мера — избежать использования нестабильной валюты в контракте. Заключение сделки в рублях или в валюте страны с устойчивым курсом (например, китайский юань, если он приемлем для контрагента) напрямую устраняет или минимизирует валютный риск на этапе планирования сделки. Остальные варианты либо не относятся к валютному риску (А), либо не снижают риск, а увеличивают экспозицию (С, D). 2. При выходе на новый экспортный рынок (например, Вьетнам) компания сталкивается с неопределённостью в отношении надёжности	

		<p>местного партнёра. Какой из перечисленных инструментов наиболее эффективно снижает кредитный и правовой риски на предконтрактном этапе?</p> <p>Варианты ответов:</p> <p>А) Применение условия 100% предоплаты  В) Проведение due diligence (проверки контрагента)  С) Заключение договора без письменной фиксации условий  D) Передача всех логистических функций контрагенту</p> <p>Правильный ответ: В</p> <p>Обоснование:</p> <p>Проведение due diligence позволяет объективно оценить финансовую устойчивость, репутацию, юридический статус и историю контрагента, включая возможные связи с санкционными лицами или судебные споры. Это проактивный и профессиональный метод снижения кредитного (риск неплатежа) и правового (риск недобросовестности, подделки документов) рисков. Вариант А (100% предоплата) снижает риск для экспортёра, но часто неприемлем для покупателя и может сорвать сделку. Варианты С и D, напротив, усиливают риски.</p>
<p>Задание открытого типа с развернутым ответом</p>	<ol style="list-style-type: none"> <li>1. Внимательно прочитать текст задания и понять суть вопроса.</li> <li>2. Продумать логику и полноту ответа.</li> <li>3. Записать ответ, используя четкие компактные формулировки.</li> <li>4. В случае расчетной задачи, записать решение и ответ</li> </ol>	<p>1. В условиях геополитической нестабильности и санкционного давления традиционные инструменты управления рисками (например, страхование через международные агентства или хеджирование на западных биржах) становятся недоступными для многих российских компаний. Как, на ваш взгляд, должна трансформироваться система риск-менеджмента в сфере внешнеэкономической деятельности в этих условиях? Приведите не менее трёх стратегических направлений адаптации и обоснуйте каждое из них.</p> <p>Ожидаемые элементы развернутого ответа:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>— Переориентация на национальные и альтернативные финансовые инструменты (например, развитие внутреннего рынка производных финансовых инструментов, использование национальных платёжных систем, сотрудничество с ЭКСАР и РЭЦ).</li> <li>— Усиление предконтрактной аналитики: более тщательная проверка контрагентов в «дружественных» странах, использование альтернативных источников данных (национальные реестры, партнёрские сети, дипломатические каналы).</li> <li>— Диверсификация внешнеэкономических связей не только по странам, но и по валютам, логистическим маршрутам и платёжным схемам (например, бартер, расчёты в национальных валютах, использование цифровых платформ).</li> <li>— Возможное включение нестандартных мер: создание резервов под риски, разработка внутренних регламентов управления санкционными рисками, привлечение юридических консультантов по международному праву стран Азии и Ближнего Востока.</li> <li>— Обоснование: подчеркнуть, что в новых условиях ключевую роль играет гибкость, проактивность и системность, а не только формальное применение</li> </ul>

		<p>международных стандартов.</p> <p>2. Многие российские экспортёры, особенно малого и среднего бизнеса, воспринимают риск-менеджмент как излишнюю бюрократическую нагрузку, а не как инструмент повышения устойчивости и конкурентоспособности. Как можно повысить мотивацию таких компаний к внедрению системы управления рисками во внешнеэкономической деятельности? Предложите и обоснуйте комплекс мер на уровне государства, инфраструктурных организаций и самой компании.</p> <p>Ожидаемые элементы развернутого ответа:</p> <p>— На уровне государства:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• Субсидирование страховых премий по экспортным контрактам (как это делает РЭЦ);</li> <li>• Упрощение доступа к информации о страновых рисках через официальные порталы (например, «Экспортный навигатор»);</li> <li>• Включение базовых принципов риск-менеджмента в требования госпрограмм поддержки экспорта.</li> </ul> <p>— На уровне инфраструктурных организаций (ТПП, Ассоциации экспортеров, ЭКСАР):</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• Проведение бесплатных обучающих вебинаров и разработка шаблонов (чек-листов, матриц рисков) для МСП;</li> <li>• Создание «риск-ориентированных» экспортных маршрутов с готовыми решениями по логистике, платежам и страхованию.</li> </ul> <p>— На уровне компании:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• Демонстрация экономической выгоды: расчёт ожидаемых убытков без риск-менеджмента vs. затрат на его внедрение;</li> <li>• Интеграция риск-менеджмента в рутинные процессы (например, обязательная проверка контрагента перед подписанием договора).</li> </ul> <p>— Обоснование: акцент на том, что риск-менеджмент — это не затрата, а инвестиция в устойчивость, особенно критичная при выходе на новые, менее изученные рынки.</p>
--	--	---

### 6.3. Критерии и шкала оценивания на основе БРС.

*Критерии и балльная шкала определяются преподавателем*

КРИТЕРИИ ОЦЕНИВАНИЯ	РЕЗУЛЬТАТ В БАЛЛАХ
<i>Дан полный, в логической последовательности развернутый ответ на поставленный вопрос, где он продемонстрировал знания предмета в полном объеме учебной программы, достаточно глубоко осмысливает дисциплину, самостоятельно, и исчерпывающе отвечает на дополнительные вопросы, приводит собственные примеры по проблематике поставленного вопроса, решил предложенные практические задания без ошибок</i>	40
<i>Дан развернутый ответ на поставленный вопрос, где студент демонстрирует знания, приобретенные на лекционных и семинарских занятиях, а также полученные посредством изучения обязательных учебных материалов по курсу, дает</i>	30-39

<i>аргументированные ответы, приводит примеры, в ответе присутствует свободное владение монологической речью, логичность и последовательность ответа. Однако допускается неточность в ответе. Решил предложенные практические задания с небольшими неточностями.</i>	
<i>Дан ответ, свидетельствующий в основном о знании процессов изучаемой дисциплины, отличающийся недостаточной глубиной и полнотой раскрытия темы, знанием основных вопросов теории, слабо сформированными навыками анализа явлений, процессов, недостаточным умением давать аргументированные ответы и приводит примеры, недостаточно свободным владением монологической речью, логичностью и последовательностью ответа. Допускается несколько ошибок в содержании ответа и решении практических заданий.</i>	20-29
<i>Дан ответ, который содержит ряд серьезных неточностей, обнаруживающий незнание процессов изучаемой предметной области, отличающийся неглубоким раскрытием темы, незнанием основных вопросов теории, несформированными навыками анализа явлений, процессов, неумением давать аргументированные ответы, слабым владением монологической речью, отсутствием логичности и последовательности. Выводы поверхностны. Решение практических заданий не выполнено, т.е. студент не способен ответить на вопросы даже при дополнительных наводящих вопросах преподавателя.</i>	0-19

6.4. Описание дополнительных материалов и оборудования, необходимых для выполнения проверочных заданий (*при необходимости*).

Для решения задач открытого типа (кейсов, ПКЗ, ПИЗ), тестовых заданий студенту разрешается использование калькулятора; программ для работы с электронными таблицами для обработки, анализа и визуализации данных. Для построения интеллект-карты и моделей в различных нотациях студенту можно использовать любой соответствующий онлайн-инструмент.

## 7. Методические материалы по освоению дисциплины

Для изучения основных вопросов образовательной программы необходимо конспектировать материалы лекций, работать с рекомендованной преподавателем литературой, а также ресурсами информационно-телекоммуникационной сети «Интернет». Для приобретения навыков активного использования знаний полезно обсуждать плановые и возникающие вопросы, а также решаемые задачи на практических занятиях. Чтобы легче и прочнее усвоить материал следует постоянно использовать конкретные примеры, сравнения из уже полученных областей наук.

Для закрепления изученного материала даны вопросы по каждой теме дисциплины, на которые следует самостоятельно найти ответы.

Важной составной частью учебного процесса в вузе являются практические занятия. Практические занятия проводятся главным образом по дисциплинам, требующим закрепления навыков решения задач, и помогают студентам глубже усвоить учебный материал, приобрести умения применять принципы системного подхода к решению разнообразных задач, определять и оценивать ресурсы и существующие ограничения разного рода проектов.

При подготовке к практическим занятиям необходимо проанализировать конспект лекции, ознакомиться с рекомендованной литературой по соответствующей теме, осуществить подготовку по рекомендованным в рабочей программе вопросам для обсуждения темы, выполнить домашнее задание (при необходимости).

Необходимо помнить, что на лекции обычно рассматривается не весь материал, а только его часть. Остальная его часть восполняется в процессе самостоятельной работы. В связи с этим работа с рекомендованной литературой обязательна. Особое внимание при этом необходимо обратить на содержание основных положений и выводов, объяснение явлений и фактов, уяснение практического приложения рассматриваемых теоретических вопросов. В процессе этой работы студент должен стремиться понять и запомнить основные положения рассматриваемого материала, примеры, поясняющие его, а также разобраться в иллюстративном материале. В процессе подготовки к занятиям рекомендуется взаимное обсуждение материала, во время которого закрепляются знания, а также приобретается практика в изложении и разъяснении полученных знаний, развивается речь. При необходимости следует обращаться за консультацией к преподавателю (в том числе по электронной почте). Планируя консультацию, необходимо хорошо продумать вопросы, которые требуют разъяснения. Заканчивать подготовку следует составлением плана (конспекта) по изучаемому материалу (вопросу). Это позволяет составить концентрированное, сжатое представление по изучаемым вопросам. Записи имеют первостепенное значение для самостоятельной работы студентов. Они помогают понять построение изучаемого материала, выделить основные положения, проследить их логику. Кроме того, ведение записей способствует превращению чтения в активный процесс, мобилизует, наряду со зрительной, и моторную память. Следует помнить: у студента, систематически ведущего записи, создается свой индивидуальный фонд методических материалов для быстрого повторения изученных вопросов, для мобилизации накопленных знаний. Особенно важны и полезны записи тогда, когда в них находят отражение мысли, возникшие при самостоятельной работе.

После изучения базовых тем курса проводится текущий контроль знаний студентов в виде опроса или письменного тестирования. Типовые тесты и задания по темам дисциплины приведены в специальном разделе данной рабочей программы.

Подготовка к текущему и промежуточному контролю предполагает изучение представленных вопросов к зачету, работу над тестами, представленными в данной рабочей программе, выполнение семестровой проектной работы по применению системного подхода и методов системного анализа к выбранной системе.

Работа в малых группах – это одна из самых популярных форм проведения занятий, так как она дает всем обучающимся (в том числе и стеснительным) возможность участвовать в работе, практиковать навыки сотрудничества, межличностного общения (в частности, умение активно слушать, вырабатывать общее мнение, разрешать возникающие разногласия). Цель данной формы проведения занятий: продемонстрировать сходство или различия определенных явлений, выработать стратегию или разработать план, выяснить отношение различных групп участников к одному и тому же вопросу. В ходе этой работы дополнительно решаются следующие задачи: развитие навыков общения и взаимодействия в группе, формирование ценностно-ориентационного единства группы, поощрение к гибкой смене социальных ролей в зависимости от ситуации.

Группа студентов делится на несколько малых групп. Количество групп определяется числом творческих заданий, которые будут обсуждаться в процессе занятия. Малые группы формируются либо по желанию студентов, либо по родственной тематике для обсуждения. Каждая малая группа обсуждает творческое задание в течение отведенного времени. Основной этап – проведение обсуждения творческого задания. Заслушиваются суждения, предлагаемые каждой малой группой по творческому заданию. Преподаватель дает оценочное суждение и работе малых групп, по решению творческих заданий, и эффективности предложенных путей решения.

В качестве самостоятельной работы студентами выполняется семестровая работа по применению системного подхода и методов системного анализа к выбранной системе по всем темам. Рекомендуется выбрать организационно-техническую систему. Перед выполнением задания по теме 1 выбранную систему необходимо согласовать с преподавателем. При выполнении заданий по темам могут использоваться представленные студентом материалы по предыдущим темам. Выполненная семестровая работа представляется студентом на открытой защите на промежуточной аттестации.

## **8. Учебная литература и ресурсы информационно-телекоммуникационной сети Интернет**

## 8.1. Основная литература

1. Фомичев, А.Н. Риск-менеджмент: Учебник. [Электронный ресурс] — Электрон. дан. — М. : Дашков и К, 2022. — 372 с. — Режим доступа: <http://idp.nwira.ru:2747/book/77294>

2. Кудрявцев, А.А. Введение в количественный риск-менеджмент: учебник. [Электронный ресурс] / А.А. Кудрявцев, А.В. Радионов. — Электрон. дан. — СПб. : СПбГУ, 2021. — 192 с. — Режим доступа: <http://idp.nwira.ru:2747/book/78092>

## 8.2. Дополнительная литература

1. Экономический и таможенный риск-менеджмент: монография. [Электронный ресурс] — Электрон. дан. — М.: РТА, 2021. — 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, 2022. — 188 с. — Режим доступа: <http://idp.nwira.ru:2747/book/58572> — Загл. с экрана.

## 8.3. Нормативные правовые документы и иная правовая информация

1. Таможенный кодекс Евразийского экономического союза (приложение N 1 к Договору о Таможенном кодексе Евразийского экономического союза от 11 апреля 2017 г.).

2. Кодекс Российской Федерации об административных правонарушениях от 30 декабря 2001 г. N 195-ФЗ (с изменениями и дополнениями).

3. Федеральный закон Российской Федерации от 3 августа 2018 года № 289-ФЗ «О таможенном регулировании в Российской Федерации и о внесении изменений в отдельные законодательные акты Российской Федерации».

## 8.4 Интернет-ресурсы

СЗИУ располагает доступом через сайт научной библиотеки <https://sziu-lib.ranepa.ru/> к следующим подписным электронным ресурсам:

### ***Русскоязычные ресурсы***

- Электронные учебники электронно-библиотечной системы (ЭБС) «Айбукс»

- Электронные учебники электронно-библиотечной системы (ЭБС) «Юрайт»
- Электронные учебники электронно-библиотечной системы (ЭБС) «Лань»
- Электронные учебники электронно-библиотечной системы (ЭБС) «ZNANIUM.COM»
- Электронные учебники электронно-библиотечной системы (ЭБС) «BOOK.RU»
- Электронные учебники электронно-библиотечной системы (ЭБС) «IPR SMART»
- <http://www.government.ru> – интернет-портал Правительства Российской Федерации.
- <http://www.gks.ru> – сайт Федеральной статистической государственной службы РФ.
- <http://www.consultant.ru> – справочная правовая система Консультант Плюс.
- <http://www.customs.ru> – сайт Федеральной таможенной службы РФ.
- <http://www.customs.ru> – Итоговые отчеты ФТС России.
- <http://www.economy.ru> – сайт Минэкономразвития РФ.
- <http://www.cbr.ru> – официальный сайт Центрального Банка Российской Федерации.
- <http://www.worldcustomsjournal.org> – международный таможенный электронный журнал.
- <http://www.garant.ru> – справочная правовая система Гарант.
- <http://www.www.edu.ru> – Федеральный портал «Российское образование».
- <http://www.wcoomd.org/en/topics/facilitation/resources> – Компедиум ВТамО по управлению таможенными рисками.

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

№ п/п	Наименование
1.	Специализированные залы для проведения лекций, оснащенные персональным компьютером/ноутбуком и мультимедийным проектором
2.	Аудитории и компьютерные классы, оборудованные посадочными местами и персональными компьютерами с выходом в Интернет для проведения практических занятий

3.	«МТС Линк» — российская платформа для онлайн-коммуникаций и совместной работы команд; «Яндекс Телемост» — сервис для видеоконференций от Яндекса; Я-мессенджер
4.	Технические средства обучения: персональные компьютеры; программные средства, обеспечивающие просмотр видеофайлов в форматах AVI, MPEG-4, DivX, RMVB, WMV; программы для работы с электронными таблицами для обработки, анализа и визуализации данных; соответствующие онлайн-инструменты для построения интеллект-карты и моделей в различных нотациях
5.	Научная библиотека (в т.ч. электронные информационные ресурсы научной библиотеки)
6.	СДО Академии <a href="https://lms.ranepa.ru/">https://lms.ranepa.ru/</a>