

## АННОТАЦИЯ РАБОЧЕЙ ПРОГРАММЫ ДИСЦИПЛИНЫ

### Б1.В.ДВ.6.1 Страновые риски

**Авторы:** Харченко Сергей Григорьевич, академик РАЕН и АВН, доктор физико-математических наук, профессор

**Код и наименование направления подготовки, профиля:**

41.03.01 Зарубежное регионоведение, «Экономическое и политическое развитие стран Востока»

**Квалификация (степень) выпускника:** бакалавр

**Форма обучения:** очная

**Цель освоения дисциплины** Б1.В.ДВ.6.1 Страновые риски – формирование у обучающихся знаний об основных тенденциях развития ключевых интеграционных процессов современности и умения использовать эти знания для определения специфики интеграционных процессов в конкретных регионах мира.

#### План курса

№ п/п	Наименование тем (разделов)	Содержание тем (разделов)
1	Тема 1. Введение в анализ страновых рисков.	Основные понятия анализа страновых рисков. Сходства и различия между политическим и страновым риском. Восемь основных типов ущерба в результате политического риска. Три основных подхода к рассмотрению странового и политического риска. Типология политических рисков. Уровни рассмотрения политических факторов: макро-уровень, микро-уровень и уровень фирмы. Ретроспективный анализ страновых рисков. Первые методы оценки страновых рисков – экспертные заключения (old hands) и метод «больших туров» (grand tours). Метод оценки странового риска, представленный журналом <i>The Economist</i> . Модель оценки индекса глобальной стабильности LEGSI (Lehman Brothers–Eurasia Group Stability Index). Основные организации, выполняющие оценку политических и страновых рисков.
2	Тема 2. Анализ страновых рисков ICRG на примере методологии, разработанной компанией PRS Group, Inc.	Основные элементы методологии оценки странового риска, разработанной компанией PRS Group, Inc. Основные категории риска: политической, финансовой и экономической, и описывающие их 22 переменные (компоненты). Принципы оценки категорий и компонент. Соотнесение бальной оценки с определенной категорией риска (степень риска - от очень низкого до очень высокого риска). Характеристика каждого компонента риска в каждой из трех категорий (политический, финансовый и экономический риск). Метод вычисления странового, политического, финансового и экономического риска и каждого компонента риска. Основные типы политического управления, определяющие оценку политических рисков PRS Group, Inc. Инвестиционный климат: понятие, характеристика, факторы, влияющие на него, инвестиционные риски, оценка инвестиционного профиля.
3	Тема 3. Кредитный страновой риск.	История создания кредитных рейтингов и рейтинговых агентств. Кредитные рейтинговые агентства Moody's, Fitch и

	Анализ рисков по методологии компании Standard & Poor's	Standard & Poor's. Страновые кредитные рейтинги. Суверенные кредитные рейтинги. Составление рейтингов стран по уровню страновых и политических рисков по методу компании Standard & Poor's. Кредитные рейтинги S&P. Индикаторы состояния фондовых рынков S&P. Индекс S&P 500. Индекс S&P Global 1200. Рейтинги корпоративного управления S&P. Методология анализа корпоративного управления Standard & Poor's — GAMMA: в чем сущность, на интересы каких лиц нацелена. Четыре основных механизма управления рисками – четыре компонента анализа. Принципы бальной оценки. Процесс присвоения рейтинга, какая информация анализируется, как интерпретируется оценка.
4	Тема 4. Анализ страновых рисков по методологии компании BERI	Основные элементы методологии оценки странового риска, разработанной компанией BERI (Business Environment Risk Intelligence S.A.) – показатель <i>Profit Opportunity Recommendation</i> (POR) (рекомендации по возможностям получения прибыли), их характеристика и метод расчета. Какая информация анализируется и как интерпретируется оценка для целей инвестирования и торговли. Индекс политического риска (The Political Risk Index - PRI) компании BERI. Индекс операционного риска (The Operations Risk Index – ORI) компании BERI. Фактор перевода денег и репатриации ( <i>R-фактор</i> ) компании BERI.
5	Тема 5. Методология оценки коррупции компании TI (Трансперенси Интернэшнл)	Концепции, методология и критерии оценки коррупции компании Трансперенси Интернэшнл. Индекс восприятия коррупции Трансперенси Интернэшнл: концепция, методология и критерии оценки. Барометр мировой коррупции Трансперенси Интернэшнл: концепция, методология и критерии оценки. Индекс Взяткодателей Трансперенси Интернэшнл: концепция, методология и критерии оценки. Доклад о положении дел с коррупцией в мире Трансперенси Интернэшнл: концепция и методология.
6	Тема 6. Методология анализа рисков компании World Economic Forum	Мировой Экономический Форум - World Economic Forum (WEF) характеристика и основные информационные продукты, Доклад о глобальной конкурентоспособности ( <i>The Global Competitiveness Report</i> ): методология и основные характеристики. Концепция Индекса глобальной конкурентоспособности. Основные группы переменных конкурентоспособности. Концепция стадий развития. Ежегодный доклад о глобальных рисках ( <i>The Global Risks Report</i> ). Определение глобального риска. Показатели тяжести глобального риска. Классификация глобальных рисков. Почему взаимосвязанность глобальных рисков имеет значение для безопасности. Основные проблемы управления глобальными рисками. Пять путей уменьшения глобальных рисков.
7	Тема 7. Методология анализа рисков Института развития менеджмента	Институт развития менеджмента - the Institute for Management Development (IMD) и <i>Мировой Ежегодник Конкурентоспособности</i> ( <i>World Competitiveness Yearbook - WCY</i> ) . Определение конкурентоспособности, используемое в WCY. Методология и основные характеристики WCY. Обзор мнений руководителей компаний WCY. На каких данных и информации основано ранжирование WCY. Характеристика

		текущей конкурентоспособности в соответствии с последним WCY. Россия в глобальном рейтинге конкурентоспособности. Основные различия в подходах Доклада о глобальной конкурентоспособности и Мирового Ежегодника Конкурентоспособности.
8	Тема 8. Управление страновыми рисками	Законодательная защита инвесторов. Стратегия инвесторов в случае экспроприации или других потерь. Управление риском со стороны страны – хозяина. Два основных типа реакции правительства-хозяина на оценки странового и политического риска. Восемь основных типов управления риском со стороны инвестора. Страхование политического риска государственными и частными компаниями, привести примеры компаний. Страхование политического риска от MIGA (Мировой Банк).

### **Формы текущего контроля успеваемости и промежуточной аттестации**

В ходе реализации дисциплины Б1.В.ДВ.6.1 «Страновые риски» используются следующие методы текущего контроля успеваемости обучающихся:

- при проведении занятий лекционного типа: контрольные работы, написание рефератов, эссе, письменные и устные опросы
- при проведении занятий семинарского типа: оценка презентаций и участия в деловых играх, диспутах, зачет

Промежуточная аттестация проводится в форме экзамена

### **Основная литература**

1. Белов, П. Г. Управление рисками, системный анализ и моделирование : учебники и практикум для бакалавриата и магистратуры / П. Г. Белов. — М. : Издательство Юрайт, 2014. — 728 с. — Серия : Бакалавр и магистр. Академический курс. ISBN 978-5-9916-3807-4