

## **АННОТАЦИЯ РАБОЧЕЙ ПРОГРАММЫ ДИСЦИПЛИНЫ**

### **Б1.В.ДВ.07.02 Риски во внешнеторговой деятельности**

---

**Автор:** к.э.н., профессор Леонова О.В.

**Код и наименование направления подготовки, профиля:** 38.03.06 «Торговое дело»,  
профиль «Управление финансами во внешнеторговой деятельности»

**Квалификация (степень) выпускника:** бакалавр

**Форма обучения:** очная

**Цель освоения дисциплины:** сформировать компетенции для идентификации товаров для выявления и предупреждения их фальсификации; для участия в таможенной деятельности; для участия в подготовке и принятии решений по вопросам организации управления и совершенствования деятельности внешнеторговых организаций

#### **План курса:**

#### **Тема 1. Риски в международном бизнесе их особенности и классификация. Сущность и классификация финансовых рисков, и их оценка участниками ВЭД.**

Понятие финансового риска и его сущность. Смысл риска и его оценка. Классификация финансовых рисков в международном бизнесе. Риски, связанные с внешнеторговой деятельностью. Механизм регулирования рисков в соглашении Базель I,II,III.

#### **Тема 2. Современные стратегии в организации зарубежной деятельности компаний.**

Внутренние и внешние условия рыночной среды. Типы внедрения на международные рынки. Типы организационных структур управления, их преимущества и недостатки.

#### **Тема 3. Методы анализа финансового риска. Метод BERI**

Понятие управления риском и его сущность. Основные принципы управления финансовыми рисками. Риск – менеджмент компании и его процедуры. Способы организации зарубежных операций. Российская практика управлением рискованных ситуаций. Методы анализа риска в абсолютном и относительном выражении. Качественный и количественный анализ риска. Метод экспертных оценок, аналитический метод. Метод анализа чувствительности модели. Метод аналогий. Value-at-Risk - оценка рыночного риска. Метод BERI.

#### **Тема 4. Специфика и содержание странового и политического рисков в зарубежной деятельности**

Понятие и содержание странового риска. Эволюция понятия данного риска, его современная трактовка. Факторы, определяющие страновой экономический риск. Политический риск: понятие, способы определения. Проявление политического риска. Классификация политических рисков. Воздействие политического риска на зарубежные операции.

#### **Тема 5. Управление финансовыми рисками.**

Стратегии управления кредитными, валютными и ценовыми рисками. Продуманный выбор валюты сделок, выбор валюты платежа. Защитные оговорки. Виды ценовых рисков в международной производственно-торговой деятельности. Ценовые «подушки». Стадии управления рисками в компании.

#### **Тема 6. Пути нейтрализации финансовых рисков. Производные финансовые инструменты**

Методы нейтрализации финансовых рисков. Классические средства предохранения от валютного риска. Виды рисков банковских деривативов. Хеджирование валютных рисков через следующие финансовые инструменты: форвардный валютный контракт, валютные фьючерсы, валютные опционы. Основные стратегии риск-менеджмента в коммерческих внешнеторговых предприятиях.

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

Текущий контроль осуществляется посредством устного опроса, практических заданий, кейс-задачи.

Промежуточная аттестация осуществляется в форме устного зачета.

#### **Компетенции ДПК – 1, ДПК-3 формируют**

##### **на уровне знаний:**

- Показатели риска и методы его оценки.
- Финансовые риски внешнеторгового предприятия.
- Методы управления финансовыми рисками
- Методы экономического анализа поведения экономических агентов и международных рынков в глобальной среде
- Результаты, полученные отечественными и зарубежными исследователями в области финансовых рисков

##### **на уровне умений:**

- Использовать весь имеющийся спектр по нейтрализации финансовых рисков;
- Использовать различные методики расчета рыночного риска
- Готовить аналитические материалы для управления бизнес-процессами и оценки их эффективности за рубежом
- Выявлять и формулировать актуальные научные проблемы связанные с нейтрализацией финансовых рисков

##### **на уровне навыков:**

- Владеть методами управления рисками во внешнеторговой компании
- Актуальными проблемами в области международного бизнеса и риска

#### **Основная литература:**

1. Стоименов М. Финансирование международной торговли. / пер. с болг. - М.: МЫСЛЬ, 2006 496с-ISBN-5-244-01074-3.
2. Финансы: Учебник. / Под редакцией проф. В.Г. Князеваа, проф В.А. Слепова, 3-е издание. – М.: Магистр, 2008, гл. 13-16.