

Учреждение образования “Белорусский государственный экономический университет”

УТВЕРЖДАЮ

Ректор учреждения образования
“Белорусский государственный
экономический университет”

_____ В.Ю.Шутилин
“_____” _____ 2019 г.

Регистрационный № УД _____/уч.

Управление рисками в международном бизнесе

Учебная программа учреждения высшего образования по учебной дисциплине
для специальности 1-25 80 02 «Мировая экономика»

СОСТАВИТЕЛИ:

Рымкевич Валерий Валентинович, доцент кафедры международного бизнеса, учреждения образования «Белорусский государственный экономический университет», кандидат экономических наук, доцент

РЕЦЕНЗЕНТЫ:

Якушенко К. В., заведующая кафедрой маркетинга факультета маркетинга, менеджмента, предпринимательства Белорусского национального технического университета, кандидат экономических наук, доцент

Корнеевец И.В., доцент кафедры экономической политики, учреждения образования «Белорусский государственный экономический университет», кандидат экономических наук, доцент

РЕКОМЕНДОВАНА К УТВЕРЖДЕНИЮ:

Кафедрой международного бизнеса учреждения образования «Белорусский государственный экономический университет»
(протокол № 10 от 17.05.2019);

Научно-методическим советом учреждения образования «Белорусский государственный экономический университет»
(протокол № от)

ПОЯСНИТЕЛЬНАЯ ЗАПИСКА

Цель учебной дисциплины – получить теоретические знания о сущности экономических рисках в международном бизнесе, выявлении механизма и инструментария управления рисками во внешнеэкономической деятельности.

Основными задачами учебной дисциплины являются:

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

Требования к профессиональным компетенциям магистра.

Магистр должен:

Владеть навыками выявления, оценки и анализа рисков в международном бизнесе, определять инструменты и разрабатывать механизм управления ими с учетом изменений в мировой экономике.

знать:

- основные виды рисков в международном бизнесе;
- методы выявления, оценки и анализа уровня рисков во ВЭД;
- методы управления рисками зарубежной деятельности.

Уметь:

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

владеть:

- проведения системных экономических расчётов;
- анализа ситуационных изменений;
- оказания консультационной помощи при оценки и анализа уровня рисков во ВЭД.

Межпредметные связи:

Учебная дисциплина «Управление рисками в международном бизнесе» выступает логическим продолжением и развивает, и дополняет содержание учебных дисциплин «Международные экономические отношения», «Экономика и управление внешнеэкономической деятельностью» и «Мировая экономика».

В соответствии с учебными планами по специальностям 1-25 80 02 «Бизнес администрирование» учебная программа рассчитана на 108 учебных часов, из них 48 – аудиторные, примерное распределение которых по видам занятий включает 36 лекционных и 12 семинарских часа.

Форма текущего контроля экзамен.

СОДЕРЖАНИЕ УЧЕБНОГО МАТЕРИАЛА

Тема 1. Понятие и сущность экономического риска во ВЭД

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

Тема 2. Методы оценки экономических рисков

Риск как опасность потерь. Разновидности возможных потерь. Случайные и систематически повторяющиеся потери. Зоны допустимого, критического и катастрофического риска. Кривая распределения вероятностей потерь или вероятностей получения прибыли. Кривая риска и анализ ее характерных точек. Возможность количественной оценки риска. Показатели математической статистики, используемые для оценки риска (математическое ожидание, дисперсия, коэффициент вариации). Порядок расчета ожидаемых потерь или прибыли. Порядок расчета степени риска. Шкала риска. Метод экспертных оценок. Метод аналогий. Метод целесообразности затрат. Z – модель.

Оценка эффективности методов управления рисками. Методы оценки и покрытия рисков в рамках современных международных концепций

Тема 3. Инструментарий управления экономическими рисками

Внешние и внутренние механизмы нейтрализации рисков. Избежание риска. Лимитирование концентрации риска. Диверсификация как способ снижения степени риска. Хеджирование на повышение и на понижение. Трансферт риска. Компенсация риска. Самострахование от рисков и страхование. Механизмы нейтрализации рисков. Средства разрешения риска. Локализация риска. Способы снижения степени риска. Методы компенсации риска. Обзор стандартов по управлению рисками. Концепция COSO управление рисками организации. Стандарт FERMA (Federation of European Risk Management Association).

Тема 4. Риски в международном бизнесе

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

Тема 5. Инструменты и механизм управления рисками во ВЭД

Управление политическими рисками. Методы и техника анализа страновых рисков. Управление страновыми рисками коммерческой деятельности на зарубежных рынках (коммерческие, валютные, политические риски, связанные с поставкой товара и переводом валюты из страны в страну). Деятельность национальных и международных агентств по страхованию рисков.

Управление валютными рисками валютные. Хеджирование форвардными контрактами, валютными фьючерсами, опционами и свопами. Основы организации риск-менеджмента по валютным рискам.

Управление ценовыми рисками в международных коммерческих организациях. Хеджирование и страхование рисков. Организация управления рисками в компаниях.

Контрактные риски во ВЭД и способы их уменьшения. Обеспечение коммерческой эффективности контрактов. Планирование ценовых компромиссов с контрагентами. Правовой риск – менеджмент во внешнеторговых контрактах. Репутационные риски во ВЭД.

Управление транспортными и логистическими рисками. Основные виды рисков в международной логистической деятельности. Управление рисками в международных цепях поставок.

Классификация и идентификация рисков при таможенном контроле. Система управления рисками при таможенном контроле. Особенности системы управления рисками при таможенном контроле в Республики Беларусь.

Глобальные риски и их виды. Глобальные дисбалансы. Индастри 4.0. Глобальная цифровая экономика и риски. Мировой опыт внедрения антикризисных стратегий в управлении социально -экономическими системами национального уровня.

**УЧЕБНО-МЕТОДИЧЕСКАЯ КАРТА УЧЕБНОЙ ДИСЦИПЛИНЫ «УПРАВЛЕНИЕ РИСКАМИ В
МЕЖДУНАРОДНОМ БИЗНЕСЕ»
ДЛЯ ДНЕВНОЙ ФОРМЫ ПОЛУЧЕНИЯ ОБРАЗОВАНИЯ**

№ раздела, темы занятия	Название раздела, темы	Количество аудиторных часов						Иное*	Формы контроля знаний
		Лекции	Практические занятия	Семинарские занятия	Лабораторные занятия	УСР			
						лекции	ПЗ		
1	2	3	4	5		7	8	9	10
1.	Понятие и сущность экономического риска во ВЭД	4				2		[1]	опрос
2	Методы оценки экономических рисков	6		2		2		[1,2]	тест
3	Инструментарий управления экономическими рисками	6		2				[2]	Контрольная работа
4	Риски в международном бизнесе	4		2		2	2	[1,4]	тест
5	Инструменты и механизм управления рисками во ВЭД	6		2		4	2	[1,5]	Контрольная
		26		8		10	4		Экзамен

ИНФОРМАЦИОННО-МЕТОДИЧЕСКАЯ ЧАСТЬ

Методические рекомендации по организации самостоятельной работы магистрантов по учебной дисциплине «Управление рисками в международном бизнесе»

В овладении занятиями учебной дисциплины важным этапом является самостоятельная работа магистрантов. Рекомендуется бюджет времени для самостоятельной работы в среднем 2-2,5 часа на 2-х часовое аудиторное занятие.

Основными направлениями самостоятельной работы магистранта являются:

- первоначально подробное ознакомление с программой учебной дисциплины;
- ознакомление со списком рекомендуемой литературы по дисциплине в целом и ее разделам, изучение необходимой литературы по теме, подбор дополнительной литературы;
- изучение и расширение лекционного материала за счет специальной литературы;
- подготовка к семинарским (практическим) занятиям по специально разработанным планам с изучением основной и дополнительной литературы;
- подготовка рефератов по определенным темам дисциплины;
- сбор и систематизация статистических и аналитических материалов по разделам учебной дисциплины;
- анализ практически ситуаций и решение задач;
- подготовка к выполнению диагностических форм контроля (тесты, контрольные работы и т.п.);
- подготовка к зачетам.

Перечень рекомендуемых средств диагностики компетенций:

1. Собеседования.
2. Доклады на семинарских занятиях.
3. Рефераты.
4. Тесты.
5. Экзамен.

ЛИТЕРАТУРА

Основная (А):

1. Анализ и оценка рисков в бизнесе: учебник и практикум для бакалавриата и магистратуры / Т. Г. Касьяненко, Г. А. Маховикова. — 2-е изд., перераб. и доп. — М. : Издательство Юрайт, 2016. — 381 с.
2. Абчук В.А. Риски в бизнесе, менеджменте и маркетинге / В. А. Абчук. – С.-Пб : Издательство Михайлова В.А., 2006. - 476 с.
3. Дегтярева О.И. Управление рисками в международном бизнесе: учебник / О.И. Дегтярева. – М.: Флинта: МПСИ, 2014. -344с.
4. Шапкин А.С. Теория риска и моделирование рискованных ситуаций : учебник для вузов по спец. "Матем. методы в экономике" / А. С. Шапкин, В. А. Шапкин. - М: Дашков и К, 2005. - 879 с.
5. Энциклопедия финансового риск-менеджмента / [В.Е. Барбаумов и др.]; под ред. А.А.Лобанова и А.В. Чугунова. - 3-е изд. - М: Альпина Бизнес Букс, 2007. - 877 с

Дополнительная (Б):

6. Гранатуров, В.М. Экономический риск: сущность, методы измерения, пути снижения : учебное пособие / В. М. Гранатуров. - 3-е изд., перераб. и доп. - М: Дело и Сервис, 2010. – 207 с.
7. Грачева, М.В. Управление рисками в инновационной деятельности : учебное пособие для студентов вузов, обучающихся по экономическим специальностям / М. В. Грачева, С. Ю. Ляпина. - М: ЮНИТИ-ДАНА, 2010. – 350 с.
8. Домашенко, Д.В. Управление рисками в условиях финансовой нестабильности / Д. В. Домашенко, Ю. Ю. Финогенова. - М: Магистр: Инфра-М, 2010. – 237 с.
9. Екатеринославский, Ю.Ю. Риски бизнеса. Диагностика, профилактика, управление / Ю. Ю. Екатеринославский, А. М. Медведева, С. А. Щенкова. - М: Анкил, 2010. – 278 с.
- 10.Ермасова, Н.Б. Риск-менеджмент организации : учебно-практическое пособие / Н. Б. Ермасова. - М: Дашков и К, 2011. - 379 с.
- 11.Качалов Р.М. Управление экономическим риском. Теоретические основы и приложения. / Р. М. Качалов. М; СПб. : НЕСТОР-ИСТОРИЯ, 2012. 248 с.
- 12.Круи, М. Основы риск-менеджмента : учебное пособие для подготовки к экзамену на получение сертификата Associate PRM : [пер. с англ.] / М. Круи, Д. Галай, Р. Марк ; науч. ред. В.Б. Минасян. - М: ЮРАЙТ, 2011. – 389 с.
- 13.Кудрявцев, А.А. Интегрированный риск-менеджмент : [учебник] / А. А. Кудрявцев ; [СПбГУ, Экон. фак.]. - М: Экономика, 2010. – 654 с.

14. Риски хозяйствующих субъектов: теоретические основы, методологии анализа, прогнозирования и упр.: Уч.пос. / В.И.Авдийский, В.М.Безденежных. -М.: Альфа-М: НИЦ ИНФРА-М,2013 - 368 с.
15. Рыхтикова, Н.А. Анализ и управление рисками организации: учебное пособие для студентов, обуч, по спец. "Финансы и кредит", "Бух. учет, анализ и аудит" / Н. А. Рыхтикова. - 2-е изд. - М: ФОРУМ, 2010. - 239 с.
16. Тихомиров, Н.П. Риск-анализ в экономике / Н. П. Тихомиров, Т. М. Тихомирова. - М: Экономика, 2010. – 317 с.
17. Шапкин, А.С. Экономические и финансовые риски. Оценка, управление, портфель инвестиций / А. С. Шапкин, В. А. Шапкин. - 8-е изд. - М: Дашков и К, 2011. - 543 с.

18. Протокол согласования учебной программы

Название учебной дисциплины, которой требуется согласование	Название кафедры	Предложения об изменениях в содержании учебной программы учреждения высшего образования по учебной дисциплине	Решение, принятое кафедрой, разработавшей учебную программу (с указанием даты и номера протокола)
1	2	3	4
Экономика организации (предприятия)	Кафедра экономики промышленных предприятий		Протокол №____ от _____2019г.
Хозяйственный риск	Кафедра экономики промышленных предприятий		Протокол №____ от _____2019г.

**Дополнения и изменения к учебной программе
на _____ учебный год**

№ п/п	Дополнения и изменения	Основание
----------	------------------------	-----------

Учебная программа пересмотрена и одобрена на заседании кафедры
_____ (протокол № _____ от _____)
(название кафедры)

Заведующий кафедрой _____
(подпись) _____
(инициалы, фамилия)

УТВЕРЖДАЮ:
Декан факультета _____
(подпись) _____
(инициалы, фамилия)