

Аннотация к рабочей программе дисциплины «Управление рисками на международном рынке»

Дисциплина «Управление рисками на международном рынке» предназначена для магистрантов направления подготовки 38.04.01 Экономика, образовательная программа «Мировая экономика» (совместно с МГУ).

Дисциплина «Управление рисками на международном рынке» предназначена для магистрантов направления подготовки 38.04.01 Экономика, магистерская программа «Мировая экономика (совместно с МГУ)».

Дисциплина «Риск-менеджмент» включена в состав вариативной части блока «Дисциплины (модули)».

Общая трудоёмкость освоения дисциплины составляет 3 зачётных единицы, 108 часов. Учебным планом предусмотрены лекционные занятия (9 часов), практические занятия (27 часов, в том числе МАО 18 часов), самостоятельная работа студентов (72 часа, в том числе 36 часов на подготовку к экзамену). Дисциплина реализуется на 2 курсе, 3 семестре.

Изучение дисциплины «Управление рисками на международном рынке» базируется на знаниях и навыках, полученных при освоении дисциплин, «Макроэкономика», «Микроэкономика», «Эконометрика», «Международная статистика», «Международные валютно-финансовые отношения» и позволяет подготовить студентов к освоению ряда таких дисциплин, как «Мировой опыт анализа и оценки инвестиционных проектов», «Международный бизнес», «Национальное регулирование предпринимательской деятельности». Содержание дисциплины охватывает следующий круг вопросов:

1. Идентификация и оценка рисков: стратегических, инвестиционных, финансовых, предпринимательских, страновых рисков, рыночных и специфических рисков организаций; рисков субъектов финансового рынка, финансовых рисков государства, модели и методы оценки параметров риска; выявление причин возникновения рисков.

2. Общие принципы управления рисками по международным стандартам, методы управления; оценка эффективности управления рисками. Методы оценки и покрытия рисков в рамках современных международных концепций.

3. Методы количественной оценки рисков: статистические методы; методы оценки вероятности исполнения; методы анализа вероятностных распределений потоков платежей; имитационное моделирование.

4. Инвестиционный климат и страновой риск. Понятие странового риска и его структура. Модели и методы оценки странового риска. Оценка странового риска по методике Мирового банка.

5. Финансовые риски: процентные риски, кредитные риски, риск ликвидности, валютные риски, биржевые риски, операционные риски, инфляционные риски, риски банкротства.

6. Финансовый риск-менеджмент в компаниях финансового сектора: нормативное регулирование системы риск-менеджмента; международные стандарты управления рисками финансово-кредитных организаций – Базель III, Solvency II; системы внутреннего контроля финансово-кредитных организаций.

7. Практические аспекты управления финансовыми рисками государства: системный подход к управлению финансовыми рисками государства при осуществлении деятельности на международном рынке; идентификация, классификация, инвентаризация и количественная оценка рисков; формирование резервных фондов; способы адаптации финансовой системы к рискам; профилактика, превенция рисков; мониторинг финансовых рисков.

Цель: расширить и углубить знания студентов в области риск-менеджмента, сформировать навыки оценки и управления рисками для разработки стратегии риск-менеджмента в компаниях и государственных корпорациях, работающих на международных рынках.

Задачами курса по дисциплине «Управление рисками на международном рынке» является формирование профессиональных компетенций в области:

1. Оценки рисков;

2. Национальных и международных стандартов риск-менеджмента;

3. Разработки стратегии финансового риск-менеджмента субъектов, осуществляющих деятельность на международном рынке.

Для успешного изучения дисциплины «Управление рисками на международном рынке» у обучающегося по программе должны быть сформированы следующие предварительные компетенции:

– способность использовать основы экономических знаний в различных сферах деятельности;

– способность осуществлять сбор, анализ и обработку данных, необходимых для решения профессиональных задач;

– способность выбрать инструментальные средства для обработки экономических данных в соответствии с поставленной задачей, проанализировать результаты расчетов и обосновать полученные выводы ;

– способность на основе типовых методик и действующей нормативно-правовой базы рассчитать экономические и социально-экономические показатели, характеризующие деятельность хозяйствующих субъектов ;

– способностью на основе описания экономических процессов и явлений строить стандартные теоретические и эконометрические модели, анализировать и содержательно интерпретировать полученные результаты;

– способность анализировать и интерпретировать данные отечественной и зарубежной статистики о социально-экономических процессах и явлениях, выявлять тенденции изменения социально-экономических показателей;

– способность, используя отечественные и зарубежные источники информации, собрать необходимые данные проанализировать их и подготовить информационный обзор и/или аналитический отчет;

– способность использовать для решения аналитических и исследовательских задач современные технические средства и информационные технологии.

В результате изучения дисциплины у обучающихся формируются следующие профессиональные компетенции.

Код и формулировка компетенции	Этапы формирования компетенции	
ПК-11 способность анализировать и использовать различные источники информации для проведения экономических расчетов <i>(формируется частично)</i>	Знает	Этапы процесса оценки риска, качественный подход к оценке риска хозяйствующих субъектов, государства при осуществлении деятельности на международном рынке. Методы количественной оценки риска и неопределенности при осуществлении деятельности на международном рынке.
	Умеет	Применять качественный подход и методы количественной оценки рисков для оценки рисков хозяйствующих субъектов, государства при осуществлении деятельности на международном рынке в соответствии с международными стандартами риск-менеджмента
	Владеет	Навыками количественной оценки рисков хозяйствующих субъектов, государства, осуществляющих деятельность на международном рынке. Навыками качественной оценки рисков на основании выделения факторов, влияющих на вероятность реализации рисков, и тяжести ущерба от реализации рисков при осуществлении деятельности на международном рынке.
ПК-13 способность использовать современные методы и инструменты исследования социально-экономических процессов, сравнительного анализа национальных моделей экономики <i>(формируется частично)</i>	Знает	Методы идентификации финансово-экономических рисков хозяйствующих субъектов, осуществляющих деятельность на международном рынке, оценки уровня рисков компаний и корпораций на основании анализа факторов внешней и внутренней среды, статистической информации
	Умеет	Использовать методы идентификации стратегических, инвестиционных, финансовых, предпринимательских, страновых рисков, рыночных и специфических рисков хозяйствующих субъектов, осуществляющих деятельность на международном рынке; инструментарий оценки уровня рисков на основании анализа факторов внешней и внутренней среды, статистической информации

	Владеет	Методами идентификации, инструментами оценки уровня рисков на основании анализа факторов внешней и внутренней среды, статистической информации.
ПК-14 способность к применению теоретических знаний для решения практических проблем рационального и эффективного использования экономических ресурсов при осуществлении экономического выбора <i>(формируется частично)</i>	Знает	Методы, способы, приемы управления рисками хозяйствующих субъектов, государства при осуществлении деятельности на международном рынке с целью минимизации уровня потерь от риска возникновения убытков .
	Умеет	Использовать методы, способы, приемы управления рисками для минимизации убытков хозяйствующих субъектов, государства при осуществлении деятельности на международных рынках
	Владеет	Навыками принятия управленческих решений по управлению стратегическими, инвестиционными, финансовыми, предпринимательскими, страновыми рисками, рыночными и специфическими рисками хозяйствующих субъектов, государства с целью минимизации убытков от реализации рисков

Для формирования указанных компетенций в рамках дисциплины «Управление рисками по международным стандартам» применяются следующие методы интерактивного обучения:

- технология кейс-стади;
- создание временного проектного коллектива для работы над выполнением творческого задания;
- круглого стола с приглашением представителей бизнес-сообщества, представителей регулятора финансового рынка;
- учебная групповая дискуссия.