

**ОЦЕНОЧНЫЕ МАТЕРИАЛЫ
ПО ДИСЦИПЛИНЕ**

Инструменты минимизации и анализа рисков ВЭД

Код модуля
1150606(1)

Модуль
Проблемы международной экономики и бизнеса

Екатеринбург

Оценочные материалы составлены автором(ами):

№ п/п	Фамилия, имя, отчество	Ученая степень, ученое звание	Должность	Подразделение
1	Непш Александр Николаевич	кандидат экономических наук, доцент	Доцент	международной экономики и менеджмента

Согласовано:

Управление образовательных программ

И.Ю. Русакова

Авторы:

1. СТРУКТУРА И ОБЪЕМ ДИСЦИПЛИНЫ **Инструменты минимизации и анализа рисков ВЭД**

1.	Объем дисциплины в зачетных единицах	3	
2.	Виды аудиторных занятий	Лекции Практические/семинарские занятия	
3.	Промежуточная аттестация	Зачет	
4.	Текущая аттестация	Контрольная работа	1
		Домашняя работа	1

2. ПЛАНИРУЕМЫЕ РЕЗУЛЬТАТЫ ОБУЧЕНИЯ (ИНДИКАТОРЫ) ПО ДИСЦИПЛИНЕ МОДУЛЯ **Инструменты минимизации и анализа рисков ВЭД**

Индикатор – это признак / сигнал/ маркер, который показывает, на каком уровне обучающийся должен освоить результаты обучения и их предъявление должно подтвердить факт освоения предметного содержания данной дисциплины, указанного в табл. 1.3 РПМ-РПД.

Таблица 1

Код и наименование компетенции	Планируемые результаты обучения (индикаторы)	Контрольно-оценочные средства для оценивания достижения результата обучения по дисциплине
1	2	3
ПК-14 -Способен рассчитывать финансовые показатели эффективности внешнеэкономической деятельности организации, выявлять и классифицировать риски, связанные с внешнеэкономической деятельностью, разрабатывать комплекс мероприятий по их минимизации	З-2 - Знать основы риск-менеджмента во внешнеэкономической деятельности З-3 - Знать современные программные продукты, необходимых для решения задач риск-менеджмента П-1 - Владеть навыками разработки комплекса мероприятий по минимизации рисков от внешнеэкономической деятельности У-2 - Уметь выявлять и классифицировать риски, связанные с внешнеэкономической деятельностью организации	Домашняя работа Зачет Контрольная работа Лекции Практические/семинарские занятия

	У-3 - Уметь применять инструменты минимизации основных рисков, участников внешнеэкономической деятельности и оценивать эффективность их использования	
ПК-15 -Способен разрабатывать стратегические планы для осуществления организацией внешнеэкономической деятельности	З-2 - Знать основные стратегии международного бизнеса на внешних рынках П-1 - Владеть навыками составления аналитических отчетов и разработки предложений по совершенствованию внешнеэкономической деятельности организации П-2 - Владеть методами решения практических задач по разработке стратегических планов организации, осуществляющей внешнеэкономическую деятельность	Домашняя работа Зачет Контрольная работа Лекции Практические/семинарские занятия
ПК-16 -Способен проводить анализ внешнеэкономической деятельности на основе применения современных прикладных программ	З-1 - Знать методы и основы сбора и системного анализа внешнеэкономической информации П-2 - Анализ и систематизации информации для выполнения проектов и проведения исследовательских разработок в области внешнеэкономической деятельности У-2 - Уметь работать с информационными системами и базами данных по внешнеэкономической деятельности У-3 - Уметь применять современный математический инструментальный и программное обеспечение для решения задач в сфере внешнеэкономической деятельности	Домашняя работа Зачет Контрольная работа Лекции Практические/семинарские занятия

3. ПРОЦЕДУРЫ КОНТРОЛЯ И ОЦЕНИВАНИЯ РЕЗУЛЬТАТОВ ОБУЧЕНИЯ В РАМКАХ ТЕКУЩЕЙ И ПРОМЕЖУТОЧНОЙ АТТЕСТАЦИИ ПО

**ДИСЦИПЛИНЕ МОДУЛЯ В БАЛЬНО-РЕЙТИНГОВОЙ СИСТЕМЕ
(ТЕХНОЛОГИЧЕСКАЯ КАРТА БРС)**

3.1. Процедуры текущей и промежуточной аттестации по дисциплине

1. Лекции: коэффициент значимости совокупных результатов лекционных занятий – 0.5		
Текущая аттестация на лекциях	Сроки – семестр, учебная неделя	Максимальная оценка в баллах
<i>домашняя работа</i>	6	100
Весовой коэффициент значимости результатов текущей аттестации по лекциям – 1		
Промежуточная аттестация по лекциям – нет		
Весовой коэффициент значимости результатов промежуточной аттестации по лекциям – не предусмотрено		
2. Практические/семинарские занятия: коэффициент значимости совокупных результатов практических/семинарских занятий – 0.5		
Текущая аттестация на практических/семинарских занятиях	Сроки – семестр, учебная неделя	Максимальная оценка в баллах
<i>контрольная работа</i>	5	50
<i>активность на занятиях</i>	6	50
Весовой коэффициент значимости результатов текущей аттестации по практическим/семинарским занятиям – 0.5		
Промежуточная аттестация по практическим/семинарским занятиям – зачет		
Весовой коэффициент значимости результатов промежуточной аттестации по практическим/семинарским занятиям – 0.5		
3. Лабораторные занятия: коэффициент значимости совокупных результатов лабораторных занятий – не предусмотрено		
Текущая аттестация на лабораторных занятиях	Сроки – семестр, учебная неделя	Максимальная оценка в баллах
Весовой коэффициент значимости результатов текущей аттестации по лабораторным занятиям – не предусмотрено		
Промежуточная аттестация по лабораторным занятиям – нет		
Весовой коэффициент значимости результатов промежуточной аттестации по лабораторным занятиям – не предусмотрено		
4. Онлайн-занятия: коэффициент значимости совокупных результатов онлайн-занятий – не предусмотрено		
Текущая аттестация на онлайн-занятиях	Сроки – семестр, учебная неделя	Максимальная оценка в баллах
Весовой коэффициент значимости результатов текущей аттестации по онлайн-занятиям – не предусмотрено		
Промежуточная аттестация по онлайн-занятиям – нет		

Весовой коэффициент значимости результатов промежуточной аттестации по онлайн-занятиям – не предусмотрено

3.2. Процедуры текущей и промежуточной аттестации курсовой работы/проекта

Текущая аттестация выполнения курсовой работы/проекта	Сроки – семестр, учебная неделя	Максимальная оценка в баллах
Весовой коэффициент текущей аттестации выполнения курсовой работы/проекта– не предусмотрено		
Весовой коэффициент промежуточной аттестации выполнения курсовой работы/проекта– защиты – не предусмотрено		

4. КРИТЕРИИ И УРОВНИ ОЦЕНИВАНИЯ РЕЗУЛЬТАТОВ ОБУЧЕНИЯ ПО ДИСЦИПЛИНЕ МОДУЛЯ

4.1. В рамках БРС применяются утвержденные на кафедре/институте критерии (признаки) оценивания достижений студентов по дисциплине модуля (табл. 4) в рамках контрольно-оценочных мероприятий на соответствие указанным в табл.1 результатам обучения (индикаторам).

Таблица 4

Критерии оценивания учебных достижений обучающихся

Результаты обучения	Критерии оценивания учебных достижений, обучающихся на соответствие результатам обучения/индикаторам
Знания	Студент демонстрирует знания и понимание в области изучения на уровне указанных индикаторов и необходимые для продолжения обучения и/или выполнения трудовых функций и действий, связанных с профессиональной деятельностью.
Умения	Студент может применять свои знания и понимание в контекстах, представленных в оценочных заданиях, демонстрирует освоение умений на уровне указанных индикаторов и необходимых для продолжения обучения и/или выполнения трудовых функций и действий, связанных с профессиональной деятельностью.
Опыт /владение	Студент демонстрирует опыт в области изучения на уровне указанных индикаторов.
Другие результаты	Студент демонстрирует ответственность в освоении результатов обучения на уровне запланированных индикаторов. Студент способен выносить суждения, делать оценки и формулировать выводы в области изучения. Студент может сообщать преподавателю и коллегам своего уровня собственное понимание и умения в области изучения.

4.2 Для оценивания уровня выполнения критериев (уровня достижений обучающихся при проведении контрольно-оценочных мероприятий по дисциплине модуля) используется универсальная шкала (табл. 5).

Таблица 5

Шкала оценивания достижения результатов обучения (индикаторов) по уровням

Характеристика уровней достижения результатов обучения (индикаторов)				
№ п/п	Содержание уровня выполнения критерия оценивания результатов обучения (выполненное оценочное задание)	Шкала оценивания		
		Традиционная характеристика уровня		Качественная характеристика уровня
1.	Результаты обучения (индикаторы) достигнуты в полном объеме, замечаний нет	Отлично (80-100 баллов)	Зачтено	Высокий (В)
2.	Результаты обучения (индикаторы) в целом достигнуты, имеются замечания, которые не требуют обязательного устранения	Хорошо (60-79 баллов)		Средний (С)
3.	Результаты обучения (индикаторы) достигнуты не в полной мере, есть замечания	Удовлетворительно (40-59 баллов)		Пороговый (П)
4.	Освоение результатов обучения не соответствует индикаторам, имеются существенные ошибки и замечания, требуется доработка	Неудовлетворительно (менее 40 баллов)	Не зачтено	Недостаточный (Н)
5.	Результат обучения не достигнут, задание не выполнено	Недостаточно свидетельств для оценивания		Нет результата

5. СОДЕРЖАНИЕ КОНТРОЛЬНО-ОЦЕНОЧНЫХ МЕРОПРИЯТИЙ ПО ДИСЦИПЛИНЕ МОДУЛЯ

5.1. Описание аудиторных контрольно-оценочных мероприятий по дисциплине модуля

5.1.1. Лекции

Самостоятельное изучение теоретического материала по темам/разделам лекций в соответствии с содержанием дисциплины (п. 1.2. РПД)

5.1.2. Практические/семинарские занятия

Примерный перечень тем

1. Управление валютным риском ВЭД.
2. Управление процентными рисками ВЭД.
3. Выбор вида внешнеторговой сделки и формы оплаты как инструментов минимизации рисков.
4. Учет политических рисков при ВЭД.
5. Ценовые риски ВЭД

Примерные задания

Тема 1. Управление валютным риском ВЭД. Методическое указание: использовать Официальный сервер Центрального Банка РФ в интернете: <http://www.cbr.ru>

Тема 2. Управление процентными рисками ВЭД. Методическое указание: использовать yahoo.finance.com, в открытом доступе

Тема 3. Оценка риска банкротства внешнеторгового партнера при экспортном кредитовании. Методическое указание: использовать бухгалтерскую отчетность трех выбранных предприятий нефинансового профиля

Тема 4. Учет политических рисков при ВЭД. Методическое указание: использовать The Global Economy.com (2021), в открытом доступе

Тема 5. Управление ценовыми рисками ВЭД. Методическое указание: использовать yahoo.finance.com, в открытом доступе

LMS-платформа – не предусмотрена

5.2. Описание внеаудиторных контрольно-оценочных мероприятий и средств текущего контроля по дисциплине модуля

Разноуровневое (дифференцированное) обучение.

Базовый

5.2.1. Контрольная работа

Примерный перечень тем

1. Управление рисками (риск банкротства)
2. Минимизация валютных рисков
3. Управление ценовыми рисками
4. Страхование рисков ВЭД

Примерные задания

Задание 1. Описать механизм учета риска банкротства при экспортном кредитовании.

Методические указания: Использовать:

- страховые правила по экспортному страхованию Ингосстраха, в открытом доступе;
- Бухгалтерскую отчетность ОАО Уралэлектромедь/ ОАО ММК/ ОАО Сибур (на выбор), в открытом доступе

Задание 2. Описать методику минимизации валютных рисков предприятия экспортера

Методические указания: использовать

- Официальный сайт Центрального Банка РФ в интернете: <http://www.cbr.ru>, в открытом доступе
- годовой отчет ОАО ММК за 2021 год/ОАО Норильский никель за 2021(на выбор), в открытом доступе

Задание 3. Описать методику определение воздействия ценовых рисков на предприятие импортер нефти из Казахстана

Методические указания: использовать

- данные по рынку нефти Brent yahoo.finance.com, в открытом доступе
- Годовой отчет ОАО Транснефть за 2021 год, в открытом доступе

Задание 4. Разработать страховую защиту рисков ВЭД.

Методические указания:

- использовать страховые правила Ингосстраха, в открытом доступе;
- Бухгалтерскую отчетность ОАО Уралэлектромедь/ ОАО ММК/ ОАО Сибур (на выбор)

LMS-платформа – не предусмотрена

5.2.2. Домашняя работа

Примерный перечень тем

1. Оценка валютных рисков.
2. Измерение процентных рисков.
3. Оценка риска банкротства внешнеторгового партнера при экспортном кредитовании.
4. Учет политических рисков при ВЭД.
5. Управление ценовыми рисками ВЭД.

Примерные задания

Задание: написать эссе на заданную тему. Тема 1. Оценка валютных рисков.

Методическое указание: использовать Официальный сервер Центрального Банка РФ в интернете: <http://www.cbr.ru>

Задание: написать эссе на заданную тему. Тема 2. Управление процентными рисками ВЭД. Методическое указание: использовать yahoo.finance.com, в открытом доступе

Задание: написать эссе на заданную тему. Тема 3. Оценка риска банкротства внешнеторгового партнера при экспортном кредитовании. Методическое указание: использовать бухгалтерскую отчетность трех выбранных предприятий нефинансового профиля

Задание: написать эссе на заданную тему. Тема 4. Учет политических рисков при ВЭД. Методическое указание: использовать [The Global Economy.com](http://TheGlobalEconomy.com) (2021), в открытом доступе

Задание: написать эссе на заданную тему. Тема 5. Оценка ценовых рисков по выбранному активу. Методическое указание: использовать yahoo.finance.com, в открытом доступе

LMS-платформа – не предусмотрена

5.3. Описание контрольно-оценочных мероприятий промежуточного контроля по дисциплине модуля

5.3.1. Зачет

Список примерных вопросов

1. Разработки системы управления рисками на предприятии.
2. Применение «бесплатных» и платных инструментов минимизации рисков.
3. Бесплатные методы управления риском.
4. Платные инструменты минимизации рисков
5. Издержки риска.
6. Снижение риска.

7. Характеристика экспертных процедур.
 8. Методы экспертных оценок.
 9. Метод «Делфи».
 10. Теория Value-at-Risk.
 11. Var как стоимостная характеристика риска.
 12. Применение показателя Var для оценки рисков во внешнеэкономической деятельности.
 13. Последовательность моделирования методом Монте-Карло.
 14. Прогнозирование риска с помощью метода Монте-Карло. Оценка стоимости риска с помощью метода Монте-Карло
 15. Риск банкротства и его значение во внешнеэкономической деятельности.
 16. Риск банкротства как фактор влияния на политику продаж компании.
 17. Влияние риска банкротства на банковское и коммерческое кредитование.
 18. Учет риска банкротства в инвестиционной политике компании.
 19. Отраслевые риски банкротства. Влияние их на инвестиционную политику компаний.
 20. Прогнозирование риска банкротства. Модели прогнозирования риска банкротства компаний.
 21. Дебиторская задолженность как объект управления риск-менеджмента. Качество дебиторской задолженности и его анализ
 22. Оценка рисков невозврата и просроченности дебиторской задолженности.
 23. Оценка дебиторской задолженности с помощью методик ФСФО РФ, Григорьевой, метода дисконтирования.
 24. Учет риска банкротства при оценке дебиторской задолженности.
 25. Продажа дебиторской задолженности как инструмент управления рисками.
- Факторинг и форфейтинг.
26. Оценка стоимости дебиторской задолженности с учетом рисков при продаже дебиторской задолженности.
 27. Валютный риск: причины его появления, место и роль во внешнеэкономической деятельности. Оценка и анализ валютных рисков.
 28. Оценка и анализ валютных рисков.
 29. Показатели валютного риска. Var оценка стоимости валютного риска.
 30. Влияние валютного риска на экономические результаты участников компаний-участников ВЭД.
 31. Управление валютным риском: Принципы. Финансовые и нефинансовые инструмент.
 32. Валютные оговорки. Хеджирование. Опционы, форварды.
 33. Форвардные и опционные арбитражи. Страхование валютных рисков.
 34. Процентный риск: причины его появления, место и роль во внешнеэкономической деятельности.
 35. Показатели процентного риска. Var оценка стоимости валютного риска.
 36. Влияние процентного риска на экономические результаты участников компаний-участников ВЭД.
 37. Управление процентным риском: Фиксированные и нефиксированные ставки. Финансовые и нефинансовые инструмент. Процентные оговорки. Хеджирование. Опционы, свопы.

38. Ценовой риск: причины его появления, место и роль во внешнеэкономической деятельности.
39. Оценка и анализ валютных рисков. Показатели ценового риска. Vaг оценка стоимости ценового риска. Влияние ценового риска на экономические результаты участников компаний- участников ВЭД.
40. Управление ценовым риском: Принципы. Финансовые и нефинансовые инструмен
41. Ценовые оговорки. Фьючерсы.
42. Политический риск: причины его появления, место и роль во внешнеэкономической деятельности.
43. Оценка и анализ политических рисков. Рейтинги стран и регионов как измерители политического риска.
44. Влияние политического риска на инвестиционную деятельность компаний
45. Управление политическим риском: Учет при инвестиционной политике. Влияние на норму прибыли.
46. Страхование политических рисков и страхование экспортных кредитов как инструменты управления политическим риском.
47. Виды внешнеторговых сделок. Внешнеторговая сделка как источник рисков для ее участников.
48. Вид сделки как инструмент управления рисками. Выбор сделки с целью минимизации рисков.
49. Формы платежа как источник рисков для участников ВЭД. Форма платежа как источник рисков
50. Выбор формы платежа с целью минимизации рисков.
51. Место и роль страхования в системе управления рисками.
52. Разработка системы страховой защиты: принципы, этапы.
53. Анализ страховых продуктов по объектам страхования и страховым рискам.
54. Выбор страховщиков по выявленным страховым продуктам на основе анализа конкурентоспособности страховых продуктов.
55. Характеристики основных страховых продуктов.
- LMS-платформа – не предусмотрена

5.4 Содержание контрольно-оценочных мероприятий по направлениям воспитательной деятельности

Направления воспитательной деятельности сопрягаются со всеми результатами обучения компетенций по образовательной программе, их освоение обеспечивается содержанием всех дисциплин модулей.