

МИНИСТЕРСТВО ВЫСШЕГО ОБРАЗОВАНИЯ, НАУКИ И
ИННОВАЦИЙ РЕСПУБЛИКИ УЗБЕКИСТАН
САМАРКАНДСКИЙ ИНСТИТУТ ЭКОНОМИКИ И СЕРВИСА



“УТВЕРЖДАЮ”

профессор по Учебным работам

Т.С. Шарипов

08 2024 года

СИЛЛАБУС ДИСЦИПЛИНЫ
УПРАВЛЕНИЕ ФИНАНСОВЫМИ РИСКАМИ
для очной формы обучения

Сфера знаний: 200000 - Социальная, экономика и право
Сфера образования: 230000 – Экономика
Направление образования: 5230600 - Финансы и финансовые технологии
Направление подготовки: 38.03.01. Экономика
Программа подготовки: Финансы и кредит

Самарканд – 2024



Модуль / СИЛЛАБУС ДИСЦИПЛИНЫ
Факультет Отдел координации
совместных образовательных
программ с зарубежными высшими
образовательными учреждениями
Направление образования: 38.03.01. –
Экономика



Наименование дисциплины:	Управление финансовыми рисками
Тип дисциплины:	Обязательный
Код дисциплины:	Б1.0.16.
Год:	4
Семестр:	7
Форма образования:	очная
Форма занятий и количество выделенных часов:	108
Лекции	16
Практические занятия	32
Лабораторные занятия	-
Семинары	-
Самостоятельное образование	60
Объем кредитов:	8
Форма оценки:	письменно
Язык дисциплины:	русский

Цель предмета (ЦП)

ЦП 1	Основной целью дисциплины «Управление финансовыми рисками» является формирование у студентов знаний, навыков и компетенций в области финансов, финансовой политики, финансовых отношений, движения денежных потоков, финансового менеджмента, финансовых событий, периодической стоимости денег и дисконтного анализа денежных потоков, финансовых отчетов, финансовой деятельности государственных и негосударственных финансовых учреждений, финансовых рисков, финансирования стартапов, основ организации финансового контроля, страхования и других подобных финансовых понятий.
-------------	---

Первичные знания, необходимые для усвоения дисциплины

1	Эконометрика (MTE1114)
2	Экономическая теория (ECONOM6)

3	Микроэкономика (MICROE6)
4	Менеджмент (MANAGER06)

Результаты образования (РО)

	<i>Аспект знаний</i>
PO1	знать предмет управления финансовыми рисками его место, функции и роль финансов в воспроизводственных процессах современной рыночной экономики;
PO2	обладать знаниями об формировании, распределении и использовании государственных финансов;
PO3	изучить теоретические основы и общие закономерности функционирования современного финансового рынка;
PO4	знать специфические особенности формирования и управления общественными и частными финансами.
	<i>Аспект навыков</i>
PO5	анализ и управление денежными рисками в целях роста благосостояния
PO6	качественное управление финансовыми рисками в целях защиты интересов владельцев бизнеса
PO7	анализ тенденций, процессов и инструментов финансового рынка и поиск обоснованных инвестиционных решений
PO8	проведение проектного анализа с использованием современного аналитического аппарата, учитывающего фактор неопределенности.

Содержание предмета

Форма занятий: лекции (Л)		Часы
Л1	Введение в управление финансовыми рисками	2
Л2	Организация управления финансовыми рисками	2
Л3	Риск в инвестиционных операциях	2
Л4	Оценка финансовых рисков	2
Л5	Принятие решений в условиях риска и неопределённости	2
Л6	Стресс-тестирование	2
Л7	Оптимизация финансовых рисков	4
7.1	Виды рисков предприятия и их классификация	2
7.2	Состав риска и его функции	2
	Итого	16

Содержание предмета

Форма занятий: практика (П)		Часы
П1	Введение в управление финансовыми рисками	4
1.1	Управление финансовыми рисками	2
1.2	Понятие и классификация финансовых рисков	2
П2	Организация управления финансовыми рисками	4
2.1	Организация управления финансовыми рисками	2
2.2	Риск и доходность	2
П3	Риск в инвестиционных операциях	4
3.1	Риск в инвестиционных операциях	2
3.2	Оценка уровня риска и доходности при осуществлении инвестиционных операций	2
П4	Оценка финансовых рисков	6
4.1	Понятие риска, его причины и экономическая сущность	2
4.2	Механизмы нейтрализации финансовых рисков	2
4.3	Источники и факторы риска	2
П5	Принятие решений в условиях риска и неопределённости	4
5.1	Подходы к управлению рисками предприятия	2
5.2	Риск и доходность	2
П6	Стресс-тестирование	6
6.1	Факторы риска	2
6.2	Агрегированное стресс-тестирование	2
6.3	Однофакторные стресс-тесты (анализ чувствительности)	2
П7	Оптимизация финансовых рисков	4
7.1	Виды рисков предприятия и их классификация	2
7.2	Состав риска и его функции	2
Итого		32

Самостоятельное образование (СО)		
1.	Осуществлять подготовку к практическим занятиям и выполнять домашние задания	10 часов
2.	Выполнять ситуационные задачи (казусы)	10 часов
3.	Написать литературный обзор по выбранной теме	10 часов
4.	Написать эссе по заданным темам	10 часов
5.	Создать презентацию по заданной теме	10 часов
6.	Провести анализ финансовой отчетности предприятия	10 часов

Основная литература

1.	Белов П. Г. Управление рисками, системный анализ и моделирование в 3 ч. Часть 1: Учебник и практикум для вузов. - Москва: Юрайт, 2020. - 211 с. - Текст: электронный // ЭБС «ЮРАЙТ» [сайт]. - URL: https://urait.ru/bcode/451702
2.	Белов П. Г. Управление рисками, системный анализ и моделирование в 3 ч. Часть 2 : Учебник и практикум для вузов. - Москва: Юрайт, 2020. - 250 с. - Текст: электронный // ЭБС «ЮРАЙТ» [сайт]. - URL: https://urait.ru/bcode/451703
3.	Белов П. Г. Управление рисками, системный анализ и моделирование в 3 ч. Часть 3: Учебник и практикум для вузов. - Москва: Юрайт, 2020. - 272 с. - Текст: электронный // ЭБС «ЮРАЙТ» [сайт]. - URL: https://urait.ru/bcode/451704
Дополнительная литература	
1.	Белов П. Г. Управление рисками, системный анализ и моделирование в 3 ч. Часть 3: Учебник и практикум для вузов. - Москва: Юрайт, 2020. - 272 с. - Текст: электронный // ЭБС «ЮРАЙТ» [сайт]. - URL: https://urait.ru/bcode/451704
2.	Белов П. Г. Системный анализ и программно-целевой менеджмент рисков: Учебник и практикум для вузов. - Москва: Юрайт, 2020. - 289 с. - Текст: электронный // ЭБС «ЮРАЙТ» [сайт]. - URL: https://urait.ru/bcode/454245
3.	Воронцовский А. В. Оценка рисков: Учебник и практикум для вузов. - Москва: Юрайт, 2020. - 179 с. - Текст: электронный // ЭБС «ЮРАЙТ» [сайт]. - URL: https://urait.ru/bcode/452702
Иные источники	
1.	Журнал «Финансы и кредит» - http://www.fin-izdat.ru/journal/fc/
2.	Журнал РИСК - http://www.risk-online.ru/

Для контроля уровня усвоенности дисциплины учащимся рекомендуются следующие критерии:

а) Для получения оценки «5» уровень знаний студента должен соответствовать следующим требованиям:

- способность осветить полностью сущность и содержание дисциплины;
- способность сохранить научность и логику при изложении, избегая при этом научных ошибок и путаницы;

- способность иметь ясное представление о теоретической или практической значимости материалов данной дисциплины;

- способность продемонстрировать умение мыслить самостоятельно и свободно в рамках дисциплины;

- способность ясно и точно отвечать на вопросы;

- способность тщательно готовиться к конспекту;

- способность выполнять задания для самостоятельного образования полностью и точно;

- способность полностью усвоить законодательные и другие нормативно-правовые акты.

б) Для получения оценки "4" уровень знаний студента должен соответствовать следующим требованиям:

- способность понять сущность и содержание дисциплины, излагать темы дисциплины, избегая при этом научных и логических ошибок;

- способность понять практическое содержание дисциплины;

- способность выполнять заданные задачи и задания;

- способность тщательно подготовить конспект;

- способность полностью выполнить задания самостоятельного образования;

- способствовать освоить законы и другие нормативные акты, имеющие отношение к предмету;

в) Для получения оценки "3" уровень знаний студента должен соответствовать следующим требованиям:

- способность иметь общее представление по предмету;

- способность кратко осветить темы дисциплины, допускать отдельные ошибки при изложении;

- неспособность бегло осветить тему;

- даются сложные и запутанные ответы на вопросы по дисциплине;

- неспособность ясно сформировать текст по предмету

г) в этих случаях уровень знаний студент может быть оценена оценкой "2":

- если студент не осуществлял подготовку к занятиям по предмету;

- если студент абсолютно не имеет представления о занятиях по предмету;

- если студент копировал ответы на задания у других студентов;

- если в заданиях по дисциплине есть серьезные ошибки;

- если на вопросы по дисциплине нет ответов;

- если не знает дисциплины.

СВЕДЕНИЯ О ПРЕПОДАВАТЕЛЕ ДИСЦИПЛИНЫ

Автор:	Ахмедова Азиза Тохировна, доцент
E-mail:	azizaaxmedova@gmail.com
Организация:	Самаркандский институт экономики и сервиса, кафедра «Финансы»
Рецензенты:	Ахроров З.О. - доцент кафедры "Финансы, налоги и банковское дело" Самаркандского филиала Ташкентского государственного университета экономики Окбутаев О.Х. - заместитель начальника Главного управления экономики и финансов Самаркандской области

Данный Силлабус утвержден учебно-методическим Советом института
протокол №1 "29" 08 2024 г. S-09-22.

Данный Силлабус утвержден на заседании кафедры "Финансы" протокол №1
от "26" 08 2024 г.

Руководитель Учебно-методического отдела

И.Э. Шодмонов

Декан факультета

Д.М. Абдураимов

Заведующий кафедрой

Ж.Р. Зайналов

Составитель

А.Т. Ахмедова