

МИНИСТЕРСТВО ВЫСШЕГО ОБРАЗОВАНИЯ, НАУКИ И
ИННОВАЦИЙ РЕСПУБЛИКИ УЗБЕКИСТАН

САМАРКАНДСКИЙ ИНСТИТУТ ЭКОНОМИКИ И СЕРВИСА



“УТВЕРЖДАЮ”

проректор по учебным работам

Г.С. Шарипов

08 2024 года

СИЛЛАБУС ДИСЦИПЛИНЫ

УПРАВЛЕНИЕ ФИНАНСОВЫМИ РИСКАМИ

для Отдела магистратуры

Область знаний: 400 000 – Бизнес, управление и право

Область образования: 410 000 – Бизнес и управление

Специальность
магистратуры: 70410501 – Финансы

Самарканд – 2024



Модуль / СИЛЛАБУС
ДИСЦИПЛИНЫ
Отдел магистратуры
Специальность магистратуры:
70410501 – Финансы



| | |
|--|--------------------------------|
| Наименование дисциплины: | Управление финансовыми рисками |
| Тип дисциплины: | Обязательный |
| Код дисциплины: | MRB1205 |
| Год: | 1 |
| Семестр: | 1 |
| Форма образования: | Очная |
| Форма занятия и количество выделенных часов: | 150 |
| Лекции | 30 |
| Практические занятия | 30 |
| Лабораторные занятия | - |
| Семинары | - |
| Самостоятельное образование | 90 |
| Объем кредитов: | 5 |
| Форма контроля: | Итоговый контроль |
| Язык дисциплины: | Русский |

| Цель предмета (ЦП) | |
|--------------------|--|
| ЦП1 | На основе данной Программы целью преподавания предмета науки является предоставление студентам магистратуры теоретических знаний о финансовых рисках и их видах, основных направлениях эффективного управления финансовыми рисками на современном этапе экономических реформ, реализуемых в деятельности субъектов, и на основе передового опыта развитых стран, развитии практических навыков управления финансовыми рисками. |

| Первичные знания, необходимые для усвоения дисциплины | |
|---|-----------------------------------|
| 1 | Финансы FINASC06 |
| 2 | Государственный бюджет STABUD04 |
| 3 | Финансовый контроль FINCON08 |
| 4 | Теория финансовых рисков FINRIS06 |

| Результаты образования (РО) | |
|-----------------------------|---|
| Аспект знаний: | |
| PO1 | объяснить экономическую природу финансовых рисков и необходимость управления ими; |
| PO2 | изучение понятия риска и его видов; |
| PO3 | раскрытие понятия управления рисками и его сущности; |
| PO4 | анализ методов оценки финансовых рисков; |
| PO5 | ознакомиться с сутью методологии оценки стоимости риска (VaR); |
| Аспект навыков: | |
| PO6 | иметь теоретические знания по управлению рисками в финансовых организациях; |
| PO7 | управление фондовым рынком, банковскими рисками, кредитными рисками, валютными рисками, процентными рисками, инфляционными рисками, инвестиционными рисками и бизнес-рисками; |
| PO8 | анализ путей снижения финансовых рисков; |
| PO9 | приобретение знаний по управлению финансовыми рисками предприятий. |

| Содержание предмета | | часы |
|---|--|------|
| Форма занятий: лекции (Л) | | |
| Л1 | Экономическая природа финансовых рисков и необходимость управления ими | 2 |
| Л2 | Понятие риска и его виды | 2 |
| Л3 | Сущность понятия риск-менеджмента, его виды, способы оценки | 2 |
| Л4 | Методология оценки риска, модели Блэка-Шоулза и Марковица | 2 |
| Л5 | Управление рисками, связанными с финансовыми учреждениями | 2 |
| Л6 | Управление рисками фондового рынка | 2 |
| Л7 | Риски, связанные с банками и их органами, их координирующих | 2 |
| Л8 | Управление кредитным риском | 2 |
| Л9 | Управление валютным и процентным риском | 2 |
| Л10 | Управление процентным риском | 2 |
| Л11 | Инфляция и управление рыночными рисками | 2 |
| Л12 | Управление операционными рисками | 2 |
| Л13 | Управление бизнес-рисками | 2 |
| Л14 | Пути снижения финансовых рисков | 2 |
| Л15 | Управление финансовыми рисками предприятий | 2 |
| ИТОГО | | 30 |
| Форма занятий: практические занятия (П) | | |
| П1 | Экономическая природа финансовых рисков и необходимость управления ими | 2 |
| П2 | Понятие риска и его виды | 2 |

| | | |
|-----|---|-----------|
| ПЗ | Сущность понятия риск-менеджмента, его виды, способы оценки | 2 |
| П4 | Методология оценки риска, модели Блэка-Шоулза и Марковица | 2 |
| П5 | Управление рисками, связанными с финансовыми учреждениями | 2 |
| П6 | Управление рисками фондового рынка | 2 |
| П7 | Риски, связанные с банками и их органами, их координирующих | 2 |
| П8 | Управление кредитным риском | 2 |
| П9 | Управление валютным и процентным риском | 2 |
| П10 | Управление процентным риском | 2 |
| П11 | Инфляция и управление рыночными рисками | 2 |
| П12 | Управление операционными рисками | 2 |
| П13 | Управление бизнес-рисками | 2 |
| П14 | Пути снижения финансовых рисков | 2 |
| П15 | Управление финансовыми рисками предприятий | 2 |
| | ИТОГО | 30 |

| № | Самостоятельное образование (СО) | Выделен о часов |
|------|--|--------------------|
| СО1 | Экономическая природа финансовых рисков и необходимость управления ими | 6 |
| СО2 | Понятие риска и его виды | 6 |
| СО3 | Понятие риск-менеджмента и его сущность | 6 |
| СО4 | Изучение методов оценки финансовых рисков | 4 |
| СО5 | Методология оценки риска (VaR) | 4 |
| СО6 | Изучение моделей Блэка-Шоулза и Марковица | 4 |
| СО7 | Значение управления рисками в финансовых учреждениях | 4 |
| СО8 | Сущность управления рисками фондового рынка | 4 |
| СО9 | Изучение управления банковскими рисками | 6 |
| СО10 | Сущность управления кредитными рисками | 6 |
| СО11 | Значение управления валютными рисками | 6 |
| СО12 | Сущность управления процентными рисками | 6 |
| СО13 | Методы управления инфляционными рисками | 6 |
| СО14 | Сущность управления инвестиционными рисками | 6 |
| СО15 | Анализ управления бизнес-рисками | 6 |
| СО16 | Методы снижения финансовых рисков | 6 |
| СО17 | Управление финансовыми рисками предприятий | 6 |
| | ВСЕГО: | 90 |

| Основная литература | |
|---------------------------|---|
| 1 | Malikov T., Olimjonov O. Moliya. Darslik. – T.: “Iqtisod-moliya”, 2019. – 920 b. |
| 2 | Malikov T. Moliya. O’quv qo’llanma. – T.: “Iqtisod-moliya”, 2018. – 274 b. |
| 3 | Шапкин И.А. Теория риска и моделирование рискованных ситуаций: Учебник для бакалавров / А.С. Шапкин, В.А. Шапкин. – 6-е изд. – М.: Издательско-торговая корпорация «Дашков и Ко», 2014. – 880 с. |
| 4 | Fozilchayev Sh.Q., Xidirov N.G’. Moliyaviy risklar nazariyasi. O’quv qo’llanma. O’zbekiston Respublikasi Oliy va o’rta maxsus ta’lim vazirligi. – T.: “Iqtisod-Moliya”, 2019. – 240 b. |
| 5 | Rasulov Z. J. Antiinqiroziy boshqaruv. O’quv qo’llanma. – T.: 2019. – 300 b. |
| 6 | Зайналов Ж.Р., Ибрагимов Н.А., Ахромов З.О. Корхоналар молияси. Ўқув қўлланма. СамИСИ: “STAP-SEL” МЧЖ. 2023. – 268 b. |
| Дополнительная литература | |
| 1 | Указ Президента Республики Узбекистан, от 28.01.2022 г. № УП-60 “О Стратегии развития Нового Узбекистана на 2022 — 2026 годы”. |
| 2 | Zaynalov J.R., Xusanov B.Sh., Aliyeva S.S., Ro’zibayeva N.X. va b. Moliya bozori: Darslik -T.: “Iqtisod-moliya”, 2020. – 480 b. |
| 3 | Zaynalov J.R., Xodjayev E.N., Xusanov B.Sh., Ro’zibayeva N.X. va b. Investitsiya: Darslik -T.: “Iqtisod-moliya”, 2020. – 316 b. |
| 4 | Латипова Ш.М. Антиинфляционный молиевий бошқарув. Ўқув қўлланма. – Самарканд: СамИСИ, “STAP-SEL” МЧЖ. – 2022 й. 309-б. |
| 5 | Солодов А.К. «Основы финансового риск-менеджмента»: учебник и учебное пособие // Солодов А.К. – М.: Издание Александра К. Солодова // Технический редактор Солодова Е.А.; корректор Нейц Е.А. // 2017 – 24,0 п.л., 286 стр. |
| 6 | www.gov.uz - Правительственный портал Республики Узбекистан. |
| 7 | www.lex.uz - Национальная база данных законодательства Республики Узбекистан. |
| 8 | www.cbu.uz - Национальная база данных законодательства Республики Узбекистан. |
| 9 | www.stat.uz - Агентство статистики при Президенте Республики Узбекистан. |
| 10 | www.soliq.uz - Официальный сайт Налогового комитета при Министерстве экономики и финансов Республики Узбекистан |
| 11 | www.openbudget.uz - Портал “Ochiq byudjet” Республики Узбекистан |

Для контроля уровня усвоенности дисциплины студентами магистратуры 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.

Если студент магистратуры оценивается по системе Hemis, он оценивается следующим образом:

0-59 баллов, оценка «2»; 60-69 баллов, оценка «3».

70-89 баллов, оценка «4»; 90-100 баллов, оценка «5»

СВЕДЕНИЯ О ПРЕПОДАВАТЕЛЕ ДИСЦИПЛИНЫ

| | |
|--------------|---|
| Автор: | Эрназаров Нуриддин Эламонович, доктор философии по экономическим наукам (PhD) |
| E-mail: | p.ernazarov@gmail.com |
| Организация: | Самаркандский институт экономики и сервиса, кафедра «Финансы» |
| Рецензенты: | И.Саламов – к.э.н., доцент кафедры “Экономическая эффективность и бухгалтерский учет в животноводстве” Самаркандского государственного университета ветеринарной медицины, животноводства и биотехнологий. О.Х. Окбутаев - Заместитель начальника Главного управления экономики и финансов Самаркандской области |

Данный Силлабус утвержден учебно-методическим Советом института протокол №1 от “29” 08 2024 г. S-09 28/2.

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

Руководитель Учебно-методического отдела И.Э. Шодмонов

Руководитель Отдела магистратуры Ш.С. Султонов

Заведующий кафедрой Ж.Р. Зайналов

Составитель Н.Э. Эрназаров