	Коммерциялық емес акционерлік қоғам «Д. Серікбаев атындағы Шығыс Қазақстан техникалық университеті»		1 бет 17
	Интеграцияланған менеджмент жүйесі	Н ШҚТУ 026-І-2023 Жұмыс оқу бөлімін әзірлеу және ресімдеу КЕАҚ-дағы «Д. Серікбаев атындағы ШҚТУ» бағдарламалар (Силлабус)	



Қазақстан Республикасы Ғылым және жоғары білім министрлігі

Д.Серікбаев атындағы ШҚТУ

БЕКІТЕМІН:

БМ деканы:

Закимова А.М.

\_\_\_\_\_ 2024 ж.

**ҚАРЖЫЛЫҚ ТӘУЕКЕЛДЕРДІ БАСАҚАРУ ЖӘНЕ ПОРТФЕЛЬДІК ТАЛДАУ**  
Жұмыс оқу бағдарламасы (силлабус)

Білім беру бағдарламасы: 6В04106 Ғылымды қажетсінетін кәсіпорынның қаржыларын басқару


Пәндерінің коды: UFRPA4310

Кредиттер саны: 5

Цикл: КП

Компонент: ТК

Өскемен, 2024

	Коммерциялық емес акционерлік қоғам «Д. Серікбаев атындағы Шығыс Қазақстан техникалық университеті»		2 бет 17
	Интеграцияланған менеджмент жүйесі	Н ШҚТУ 026-І-2023 Жұмыс оқу бөлімін әзірлеу және ресімдеу КЕАҚ-дағы «Д. Серікбаев атындағы ШҚТУ» бағдарламалар (Силлабус)	

Жұмыс оқу жоспары (силлабус) Жоғары және жоғары оқу орнынан кейінгі білімнің мемлекеттік жалпыға міндетті стандарттары (Қазақстан Республикасы Ғылым және жоғары білім министрінің 2022 жылғы 20 шілдедегі № 2 бұйрығы), қағидалар негізінде "БМ"-де әзірленді. Білім берудің кредиттік технологиясы бойынша оқу процесін ұйымдастыруға арналған (Қазақстан Республикасы Білім және ғылым министрінің 2011 жылғы 20 сәуірдегі № 152 бұйрығы), Білім беру бағдарламасы, оқу жұмыс жоспары, элективті пәндер каталогы.

Сапаны қамтамасыз ету жөніндегі комиссиясы мақұлдаған

Төрағасы

Күні 29.08.2024 ж. хаттама №1

Жанабаева А.С.

Оқу бағдарламасының басшысы


Варавин Е.В.  
6В04106

Кітапхана қызметкері

Бакишева М.Ж.

Әзірлеген

Ислям Г.И.  
Қауымдастырылған  
профессор

	Коммерциялық емес акционерлік қоғам «Д. Серікбаев атындағы Шығыс Қазақстан техникалық университеті»		3 бет 17
	Интеграцияланған менеджмент жүйесі	Н ШҚТУ 026-І-2023 Жұмыс оқу бөлімін әзірлеу және ресімдеу КЕАҚ-дағы «Д. Серікбаев атындағы ШҚТУ» бағдарламалар (Силлабус)	

## 1 ПӘННІҢ СИПАТТАМАСЫ, ОНЫҢ ОҚУ ҮРДІСІНДЕГІ ОРНЫ

### 1.1 Пәннің қысқаша сипаттамасы

Курс қаржылық тәуекелдерді анықтаудың және оларды басқарудың теориялық және практикалық аспектілерін зерттейді, тәуекел факторын есепке ала отырып тиімді қаржылық шешімдерді әзірлеу технологиясын қарастырады. Қаржы тәуекелдерінің табиғатын түсіну, портфельдік талдау және оларды бағалау әдістерін білу қазіргі экономикадағы қаржы-шаруашылық қызмет тиімділігінің маңызды факторы болып табылады.

### 1.2 Пәнді оқытудың мақсаты мен міндеттері

Пәнді оқытудың мақсаты:

Қаржылық тәуекелдерді басқарудың теориялық негіздерін ашу. Қаржылық тәуекелдерді бағалау әдістерімен, әртүрлі қаржылық активтердің тәуекелділігін сипаттайтын факторлармен және көрсеткіштермен танысыңыз. Қаржылық тәуекелдерді ұйымдастыру мен басқарудың ықтимал тәсілдерін көрсету, портфельдік талдау жүргізу кезінде олардың артықшылықтары мен кемшіліктерін салыстыру.

Пәнді оқытудың міндеттері:

- міндеттері: - қазіргі экономикадағы тәуекелдердің ұғымдарымен, жіктелуімен таныстыру; - экономикадағы қаржы тәуекелдерінің орнын, олардың жіктелуін көрсету; – экономикалық тәуекелдерді бағалау үшін қолданылатын жалпы әдістер мен көрсеткіштерді қарау және салыстыру – - қаржы тәуекелдерін бағалау көрсеткіштерінің жүйесін беру; - қаржы тәуекелдерін басқаруды ұйымдастыру қағидаттарын қарау – - тәсілдерді сипаттау және салыстыру және қаржылық тәуекелдерді басқару әдістері

### 1.3 Цели устойчивого развития

Мақсаты 1. Кедейлікті барлық нысандарда жаппай жою


Мақсаты 8. Үдемелі, толық қамтылған және орнықты экономикалық өсуге, толық және нәтижелі жұмыспен қамтуға және барлығына лайықты жұмысқа жәрдемдесу

Мақсаты 17. Орнықты даму мүддесінде Жаһандық әріптестік шеңберінде жұмысты жүзеге асыру құралдарын нығайту және жандандыру

### 1.4 Оқыту қортындысы

Оқыту нәтижелері Дублиндік дескрипторлар негізінде білім берудің тиісті деңгейіндегі құзыреттер арқылы көрсетіледі.

Қалыптасатын негізгі құзыреттер	Оқыту нәтижелері (түйінді құзыреттілік бірліктері)	
	білім бағдарламасы	пәндер
	PO16 - Тиімділік және тәуекелдер критерийлерін ескере отырып, қаржылық және басқа есептіліктің деректерін талдау, басқару шешімдеріне арналған нұсқаларды сыни бағалау	- дүниетанымы кең, ойлау мәдениеті жоғары білімді тұлғаны қалыптастыруға ықпал ететін жаратылыстану ғылымдары (әлеуметтік, гуманитарлық, экономикалық) пәндер саласындағы базалық білімді меңгереді - қоғамның әлеуметтік даму үрдістерін біледі, әртүрлі әлеуметтік жағдайларда адекватты бағдарлай алады
	PO18 - Оңтайлы инвестициялық портфельді	

	Коммерциялық емес акционерлік қоғам «Д. Серікбаев атындағы Шығыс Қазақстан техникалық университеті»		4 бет 17
	Интеграцияланған менеджмент жүйесі	Н ШҚТУ 026-І-2023 Жұмыс оқу бөлімін әзірлеу және ресімдеу КЕАҚ-дағы «Д. Серікбаев атындағы ШҚТУ» бағдарламалар (Силлабус)	

Қалыптасатын негізгі құзыреттер	Оқыту нәтижелері (түйінді құзыреттілік бірліктері)	
	білім бағдарламасы	пәндер
тәуекелдерді төмендету бойынша іс-шараларды жүзеге асыру, қаржылық шығындарды азайту үшін ресурстарды пайдалану тиімділігін бағалау қабілеті	қалыптастыру және қаржы инвестицияларының тәуекелдерін барынша азайту үшін қор нарығының қаржы құралдарын пайдалану	- қоғамның әлеуметтік даму тенденцияларын біледі, әртүрлі әлеуметтік жағдайларда барабар бағдарлауды біледі - іскерлік этика нормаларын сақтайды, мінез-құлықтың этикалық және құқықтық стандарттарына ие болады, қоғамдық пікірге негізделген әлеуметтік және этикалық құндылықтарды біледі - кәсіптік қызметті жүзеге асыру және магистратурада үздіксіз білім алу үшін қажетті негізгі білімді толықтыру және жанарту дағдылары бар

## 1.5 Пәнді игеруде қолданылатын білім беру технологиялары

### 1.5.1 Заманауи білім беру технологиялары

Оқу сабақтарын өткізу кезінде мынадай білім беру технологияларын пайдалану көзделеді:

- интерактивті дәріс (оқытудың келесі белсенді түрлерін қолдану: атқарушы (басқарылатын) пікірталас немесе әңгімелесу; модерация; слайдтарды немесе оқу фильмдерін көрсету; ми шабуылы; мотивациялық сөйлеу);
- берілген шарттар негізінде әртүрлі жағдайлардың даму сценарийлерін құру; - ақпараттық-коммуникациялық (мысалы, қолданбалы бағдарламалардың кәсіби пакеттерін пайдалана отырып, компьютерлік сыныптағы сабақтар);
- іздеу-зерттеу (оқу үрдісінде студенттердің өзіндік зерттеу қызметі); - оқу міндеттерін шешу.


### 1.5.2 Бейімделген білім беру технологиялары (инклюзивті оқыту)

Денсаулық мүмкіндіктері шектеулі тұлғаларды оқыту кезінде пәнді табысты меңгеру үшін келесі бейімделген білім беру технологиялары қолданылуы мүмкін:

- қашықтықтан оқыту - жеке бағытталған (мысалы, тірек-қимыл аппараты бұзылған студенттер үшін экрандағы пернетақтаны және ақпаратты енгізудің балама құрылғыларын пайдалану; есту қабілеті нашар студенттер компьютерлік техниканы, аудио жабдықтарды, видео жабдықтарды, электронды тақтаны оқитын оқу аудиториясына арналған жабдықтар);
- пәнге бағытталған (мақсатты қалыптастыру процесі, яғни мақсаттар оқушылардың іс-әрекетінде көрінетін олардың нәтижелері арқылы қалыптасады);
- оқу материалын жасауға көмектесу үшін ұйымдастырылған студенттермен қосымша жеке кеңестер мен сабақтар өткізу

## 1.6 Пререквизиттер

- Қаржыға кіріспе

	Коммерциялық емес акционерлік қоғам «Д. Серікбаев атындағы Шығыс Қазақстан техникалық университеті»		5 бет 17
	Интеграцияланған менеджмент жүйесі	Н ШҚТУ 026-І-2023 Жұмыс оқу бөлімін әзірлеу және ресімдеу КЕАҚ-дағы «Д. Серікбаев атындағы ШҚТУ» бағдарламалар (Силлабус)	

## 1.7 Постреквизиттер

## 1.8 Пәннің еңбек сыйымдылығы

Жұмыс түрлері	сағат
Дәрістер	15
Практикалық жұмыстар	30
СӨЖО	30
СӨЖ	75
Қорытынды бақылауды жүргізу нысаны /	емтихан

## 2 ПӘННІҢ МАЗМҰНЫ

### 2.1 Тақырыптық жоспар

№	Тақырыптың атауы және мазмұны	Еңбек сыйымдылығы сағат	Қол жеткізілген CDIO нәтижелері	Оқыту әдісі	Әдебиетке сілтеме
<b>Дәрістік сабақтар</b>					
1	<b>1 тақырып. Кәсіпорынның қаржылық тәуекелдерін басқарудың теориялық негіздері Қаржылық тәуекел түсінігі және оның эволюциясы.</b> Қаржылық тәуекелдің объективті және субъективті негіздері. Субъект және объектілер қаржылық тәуекелдің тасымалдаушылары. Қазіргі жағдайда қаржылық тәуекелдерді басқару міндеттері. Қаржылық тәуекелдің негізгі сипаттамалары.	1	Мәселелерді қою және тұжырымдау	Ауызша (түсіндіру, әңгімелесу, дискуссия), көрнекілік	1-5
2	<b>2 тақырып. Кәсіпорынның қаржылық тәуекелдерін басқарудың мәні, мақсаттары және функциялары.</b> Қаржылық тәуекелді басқару: негізгі принциптері мен әдістері. Қаржылық тәуекелді басқарудың негізгі мақсаты. Кәсіпорынның қаржылық	1	Бағалау және сапалық талдау	Ауызша (түсіндіру, әңгімелесу, дискуссия), көрнекілік	1-5



№	Тақырыптың атауы және мазмұны	Еңбек сыйымдылығы сағат	Қол жеткізілген CDIO нәтижелері	Оқыту әдісі	Әдебиетке сілтеме
	тәуекелдерін басқарудың функциялары мен механизмі. Ұйымның қаржылық тәуекелдерін басқару процесі. Ақша ағындарын дисконттау. Тәуекелдерді басқару процесіндегі инфляция факторы. Құралдардың рентабельділігі. Пайыз мөлшерлемесінің мерзімді құрылымы. Тәуекелдерді сипаттаудың ықтималды-статистикалық тәсілі				
3	<b>3 тақырып. Тәуекел және белгісіздік жағдайында шешім қабылдау Қаржылық ортаның белгісіздігі туралы түсінік.</b> Белгісіздік пен тәуекел арасындағы айырмашылық. «Шешім қабылдаушылар» (ШМ) түсінігі. Шешім қабылдаушылардың негізгі психологиялық портреттері және мінез-құлық үлгілері. Толық және ішінара белгісіздік жағдайында оңтайлы шешімдер қабылдау	1	Бағалау және сапалық талдау	Ауызша (түсіндіру, әңгімелесу, дискуссия), көрнекілік	1-5
4	<b>4 тақырып. Қаржылық тәуекелдердің жіктелуі Классификацияның негізгі түсініктері: тәуекел субъектісі, тәуекел түрі, тәуекелдің көрінісі.</b> Қаржылық тәуекелдердің жекелеген түрлерінің сипаттамасы.	1	Бағалау және сапалық талдау	Ауызша (түсіндіру, әңгімелесу, дискуссия), көрнекілік	1-5
5	<b>5 тақырып. Жүйелік және жүйелік емес қаржылық тәуекелдер.</b> Қаржы нарығының конъюнктурасы және оны зерттеудің әдістемелік тәсілдері. Техникалық талдау әдістері. Іргелі талдау әдістері. Кәсіпорындардың жұмыс істеуі үшін ішкі қаржылық орта. Кәсіпорынның қаржылық	1	Бағалау және сапалық талдау	Ауызша (түсіндіру, әңгімелесу, дискуссия), көрнекілік	1-5




№	Тақырыптың атауы және мазмұны	Еңбек сыйымдылығы сағат	Қол жеткізілген CDIO нәтижелері	Оқыту әдісі	Әдебиетке сілтеме
	қызметінің жекелеген аспектілері бойынша қаржылық саясатының түрі. Кәсіпорын қолданатын қаржы құралдарының жүйесі. Кәсіпорынның қаржылық операцияларының түрлері.				
6	<b>6 тақырып. Қаржылық тәуекелді басқару әдістері</b> <b>Тәуекелдерді басқару әдістерінің классификациясы.</b> Тәуекелді әртараптандырудың мәні. Сақтандырудың мәні, артықшылықтары мен кемшіліктері. Хеджирлеудің мәні, артықшылықтары мен кемшіліктері. Шектеудің мәні, артықшылықтары мен кемшіліктері. Өзін-өзі сақтандырудың мәні, артықшылықтары мен кемшіліктері.	1	Бағалау және сапалық талдау	Ауызша (түсіндіру, әңгімелесу, дискуссия), көрнекілік	1-5
7	<b>7 тақырып. Несиелік тәуекелді басқару</b> <b>Өтімділік тәуекелін басқару.</b> Шартты міндеттемелерді пайдалана отырып, несиелік тәуекелдерді сипаттау тәсілі. Несиелік тәуекелді өлшеудің актуарлық нысаны. Несиелік тәуекелді хеджирлеу. Секьюритилендіру несиелік тәуекелді басқару формасы ретінде. Нарық өтімділігі.	2	Бағалау және сапалық талдау	Ауызша (түсіндіру, әңгімелесу, дискуссия), көрнекілік	1-5
8	<b>8 тақырып. Пайыз мөлшерлемесі мен валюталық тәуекелді басқару.</b> Пайыздық тәуекелдерінің мазмұны, мәні және факторлары. Пайыздық тәуекелді басқарудың стратегиялық және тактикалық мақсаттары. Пайыздық тәуекелді басқару әдістері: теңгерімсіздік (саңылау), активтер мен пассивтердің	2	Бағалау және сапалық талдау	Ауызша (түсіндіру, әңгімелесу, дискуссия), көрнекілік	1-5



№	Тақырыптың атауы және мазмұны	Еңбек сыйымдылығы сағат	Қол жеткізілген CDIO нәтижелері	Оқыту әдісі	Әдебиетке сілтеме
	ұзақтығы, фьючерстік пайыздық келісімшарттармен хеджирлеу. Валюталық тәуекелдің мазмұны, мәні және факторлары. Валюталық тәуекелдің түрлері: оперативтік, қайта есептеу, экономикалық. Валюталық тәуекелді өлшеу әдістері. Валюталық тәуекелді басқару әдістері: саясат, ашық валюталық позиция стандарттары, мәмілелерді жасау, орындау және бақылау процедуралары, фьючерстік валюталық келісімшарттармен хеджирлеу.				
9	<b>9 тақырып. Банкроттық тәуекелі.</b> Кәсіпорынның қаржылық тәуекелдерінің негізгі көрінісі ретінде банкроттық тәуекелі. Банкроттықты диагностикалау әдістері. Кәсіпорынның банкроттық тәуекелін бағалауда кәсіпорынның төлем қабілеттілігі мен өтімділігі. Кәсіпорынның дағдарысқа қарсы саясаты және дағдарысқа қарсы басқару. Кәсіпорынды қайта ұйымдастыру және тарату.	2	Бағалау және сапалық талдау	Ауызша (түсіндіру, әңгімелесу, дискуссия), көрнекілік	1-5
10	<b>10 тақырып. Қаржылық тәуекелдерді талдау.</b> Тәуекелді сапалы талдау. Қаржылық тәуекел дәрежесін ықтималдық бағалау. Вариация коэффициенті арқылы тәуекелді бағалау. Корреляция коэффициенті арқылы тәуекелді бағалау. Корреляциялық-регрессиялық талдауды қолдану арқылы тәуекелді бағалау. Лаплас, Вальд, Саваж, Гурвиц критерийлері. Эксперттік тәуекелді талдаудың мәні. аналогтық әдіс. Шешім ағашы	3	Әдеп, адалдық және әлеуметтік жауапкершілік	Ауызша (түсіндіру, әңгімелесу, дискуссия), көрнекілік	1-5



	Коммерциялық емес акционерлік қоғам «Д. Серікбаев атындағы Шығыс Қазақстан техникалық университеті»		9 бет 17
	Интеграцияланған менеджмент жүйесі	Н ШҚТУ 026-І-2023 Жұмыс оқу бөлімін әзірлеу және ресімдеу КЕАҚ-дағы «Д. Серікбаев атындағы ШҚТУ» бағдарламалар (Силлабус)	


№	Тақырыптың атауы және мазмұны	Еңбек сыйымдылығы сағат	Қол жеткізілген CDIO нәтижелері	Оқыту әдісі	Әдебиетке сілтеме
	әдісі. Монте-Карло әдісі.				
<b>БАРЛЫҒЫ</b>				<b>15</b>	
<b>Практикалық сабақтар</b>					
1	<b>1 тақырып. Кәсіпорынның қаржылық тәуекелдерін басқарудың теориялық негіздері Қаржылық тәуекел түсінігі және оның эволюциясы.</b> Қаржылық тәуекелдің объективті және субъективті негіздері. Субъект және объектілер қаржылық тәуекелдің тасымалдаушылары. Қазіргі жағдайда қаржылық тәуекелдерді басқару міндеттері. Қаржылық тәуекелдің негізгі сипаттамалары.	2	Әлеуметтік ғылымдарды білу	Практикалық, проблемалық практикалық	1-5
2	<b>2 тақырып. Кәсіпорынның қаржылық тәуекелдерін басқарудың мәні, мақсаттары және функциялары.</b> Қаржылық тәуекелді басқару: негізгі принциптері мен әдістері. Қаржылық тәуекелді басқарудың негізгі мақсаты. Кәсіпорынның қаржылық тәуекелдерін басқарудың функциялары мен механизмі. Ұйымның қаржылық тәуекелдерін басқару процесі. Ақша ағындарын дисконттау. Тәуекелдерді басқару процесіндегі инфляция факторы. Құралдардың рентабельділігі. Пайыз мөлшерлемесінің мерзімді құрылымы. Тәуекелдерді сипаттаудың ықтималды-статистикалық тәсілі	2	Бағалау және сапалық талдау	Практикалық, проблемалық практикалық	1-5
3	<b>3 тақырып. Тәуекел және белгісіздік жағдайында шешім қабылдау Қаржылық ортаның белгісіздігі туралы түсінік.</b>	2	Бағалау және сапалық талдау	Практикалық, проблемалық практикалық	1-5



№	Тақырыптың атауы және мазмұны	Еңбек сыйымдылығы сағат	Қол жеткізілген CDIO нәтижелері	Оқыту әдісі	Әдебиетке сілтеме
	Белгісіздік пен тәуекел арасындағы айырмашылық. «Шешім қабылдаушылар» (ШМ) түсінігі. Шешім қабылдаушылардың негізгі психологиялық портреттері және мінез-құлық үлгілері. Толық және ішінара белгісіздік жағдайында оңтайлы шешімдер қабылдау				
4	<b>4 тақырып. Қаржылық тәуекелдердің жіктелуі</b> <b>Классификацияның негізгі түсініктері:</b> тәуекел субъектісі, тәуекел түрі, тәуекелдің көрінісі. Қаржылық тәуекелдердің жекелеген түрлерінің сипаттамасы.	2	Бағалау және сапалық талдау	Практикалық, проблемалық практикалық	1-5
5	<b>5 тақырып. Жүйелік және жүйелік емес қаржылық тәуекелдер.</b> Қаржы нарығының конъюктурасы және оны зерттеудің әдістемелік тәсілдері. Техникалық талдау әдістері. Іргелі талдау әдістері. Кәсіпорындардың жұмыс істеуі үшін ішкі қаржылық орта. Кәсіпорынның қаржылық қызметінің жекелеген аспектілері бойынша қаржылық саясатының түрі. Кәсіпорын қолданатын қаржы құралдарының жүйесі. Кәсіпорынның қаржылық операцияларының түрлері.	2	Бағалау және сапалық талдау	Практикалық, проблемалық практикалық	1-5
6	<b>6 тақырып. Қаржылық тәуекелді басқару әдістері</b> <b>Тәуекелдерді басқару әдістерінің классификациясы.</b> Тәуекелді әртарапандырудың мәні. Сақтандырудың мәні, артықшылықтары мен кемшіліктері. Хеджирлеудің мәні, артықшылықтары мен кемшіліктері. Шектеудің мәні,	2	Бағалау және сапалық талдау	Практикалық, проблемалық практикалық	1-5




№	Тақырыптың атауы және мазмұны	Еңбек сыйымдылығы сағат	Қол жеткізілген CDIO нәтижелері	Оқыту әдісі	Әдебиетке сілтеме
	артықшылықтары мен кемшіліктері. Өзін-өзі сақтандырудың мәні, артықшылықтары мен кемшіліктері.				
7	<b>7 тақырып. Несиелік тәуекелді басқару</b> <b>Өтімділік тәуекелін басқару.</b> Шартты міндеттемелерді пайдалана отырып, несиелік тәуекелдерді сипаттау тәсілі. Несиелік тәуекелді өлшеудің актуарлық нысаны. Несиелік тәуекелді хеджирлеу. Секьюритилендіру несиелік тәуекелді басқару формасы ретінде. Нарық өтімділігі.	4	Бағалау және сапалық талдау	Практикалық, проблемалық практикалық	1-5
8	<b>8 тақырып. Қаржылық тәуекелдерді талдау.</b> Тәуекелді сапалы талдау. Қаржылық тәуекел дәрежесін ықтималдық бағалау. Вариация коэффициенті арқылы тәуекелді бағалау. Корреляция коэффициенті арқылы тәуекелді бағалау. Корреляциялық-регрессиялық талдауды қолдану арқылы тәуекелді бағалау. Лаплас, Вальд, Саваж, Гурвиц критерийлері. Эксперттік тәуекелді талдаудың мәні. аналогтық әдіс. Шешім ағашы әдісі. Монте-Карло әдісі.	4	Бағалау және сапалық талдау	Практикалық, проблемалық практикалық	1-5
9	<b>9 тақырып. Банкроттық тәуекелі.</b> Кәсіпорынның қаржылық тәуекелдерінің негізгі көрінісі ретінде банкроттық тәуекелі. Банкроттықты диагностикалау әдістері. Кәсіпорынның банкроттық тәуекелін бағалауда кәсіпорынның төлем қабілеттілігі мен өтімділігі. Кәсіпорынның дағдарысқа қарсы саясаты және дағдарысқа қарсы басқару. Кәсіпорынды қайта ұйымдастыру және	5	Бағалау және сапалық талдау	Практикалық, проблемалық практикалық	1-5

	Коммерциялық емес акционерлік қоғам «Д. Серікбаев атындағы Шығыс Қазақстан техникалық университеті»		12 бет 17
	Интеграцияланған менеджмент жүйесі	Н ШҚТУ 026-І-2023 Жұмыс оқу бөлімін әзірлеу және ресімдеу КЕАҚ-дағы «Д. Серікбаев атындағы ШҚТУ» бағдарламалар (Силлабус)	

№	Тақырыптың атауы және мазмұны	Еңбек сыйымдылығы сағат	Қол жеткізілген CDIO нәтижелері	Оқыту әдісі	Әдебиетке сілтеме
	тарату.				
10	<b>10 тақырып. Қаржылық тәуекелдерді талдау.</b> Тәуекелді сапалы талдау. Қаржылық тәуекел дәрежесін ықтималдық бағалау. Вариация коэффициенті арқылы тәуекелді бағалау. Корреляция коэффициенті арқылы тәуекелді бағалау. Корреляциялық-регрессиялық талдауды қолдану арқылы тәуекелді бағалау. Лаплас, Вальд, Саваж, Гурвиц критерийлері. Эксперттік тәуекелді талдаудың мәні. аналогтық әдіс. Шешім ағашы әдісі. Монте-Карло әдісі.	5	Әдеп, адалдық және әлеуметтік жауапкершілік	Практикалық, проблемалық практикалық	1-5
<b>БАРЛЫҒЫ</b>				<b>30</b>	

## 2.2 Тапсырманы өздік жұмыс үшін оқыту (СӨЖ)

Тақырып	Тапсырманың мазмұны	Бақылау түрі	Тапсыру мерзімі, апта	Еңбек сыйымдылығы сағат	Результаты CDIO
1 Кәсіпорынның қаржылық тәуекелдерін басқарудың теориялық негіздері	Есептерді шешу	Тапсырманы тексеру	2	7	-
2 Кәсіпорынның қаржылық тәуекелдерін басқарудың мәні, мақсаттары және функциялары.	Эссе	Эссе	4	7	-
3 Тәуекел және белгісіздік жағдайында шешім қабылдау	Тақырып бойынша әдеби көздермен жұмыс	Тапсырманы тексеру	5	7	-
4 Қаржылық тәуекелдердің жіктелуі	Тақырып бойынша жеке тапсырманы орындау	Ауызша сұрау	6	7	-
5 Жүйелік және жүйелік емес	Реферат	Рефератты қорғау	8	7	-


	Коммерциялық емес акционерлік қоғам «Д. Серікбаев атындағы Шығыс Қазақстан техникалық университеті»		13 бет 17
	Интеграцияланған менеджмент жүйесі	Н ШҚТУ 026-І-2023 Жұмыс оқу бөлімін әзірлеу және ресімдеу КЕАҚ-дағы «Д. Серікбаев атындағы ШҚТУ» бағдарламалар (Силлабус)	

Тақырып	Тапсырманың мазмұны	Бақылау түрі	Тапсыру мерзімі, апта	Еңбек сыйымдылығы сағат	Результаты CDIO
қаржылық тәуекелдер					
6. Қаржылық тәуекелді басқару әдістері	Тест тапсырмаларын шешу	Есептеулерді тексеру	9	7	-
7. Несиелік тәуекелді басқару	Тақырып бойынша жеке тапсырманы орындау	Тапсырманы тексеру	10	7	-
8. Пайыз мөлшерлемесі мен валюталық тәуекелді басқару	Тақырып бойынша әдеби көздермен жұмыс	Есептеулерді тексеру	11	8	-
9. Банкроттық тәуекелі	Есептерді шешу	Ауызша сұрау	13	9	-
10. Қаржылық тәуекелдерді талдау	Есептерді шешу	Есептеулерді тексеру	14	9	-
<b>Барлығы</b>				<b>75</b>	

### 2.3 Пән бойынша тапсырмаларды тапсыру кестесі

Тапсырма түрі	Академиялық оқу кезеңі, апта														
	1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	11	12	13	14	15
<b>Білімі</b>															
Есептер шығару	+	+	+	+		+	+	+			+	+	+		
Коллоквиум/Тестілеу					+										
Коллоквиум									+						
Тестілеу										+					+
<b>Түсіну</b>															
Есептер шығару	+	+	+			+					+		+	+	
Коллоквиум/Тестілеу					+										
Коллоквиум									+						
Тестілеу										+					+
<b>Пайдалану</b>															
Коллоквиум									+						
Тестілеу										+					+
<b>Талдау</b>															
Есептер шығару	+	+	+	+		+					+			+	
Коллоквиум									+						
Тестілеу										+					+

### 3 БІЛІМ АЛУШЫНЫҢ БІЛІМІН БАҒАЛАУ

	Коммерциялық емес акционерлік қоғам «Д. Серікбаев атындағы Шығыс Қазақстан техникалық университеті»		14 бет 17
	Интеграцияланған менеджмент жүйесі	Н ШҚТУ 026-І-2023 Жұмыс оқу бөлімін әзірлеу және ресімдеу КЕАҚ-дағы «Д. Серікбаев атындағы ШҚТУ» бағдарламалар (Силлабус)	

Оқытушы ағымдағы бақылау жұмыстарының барлық түрлерін жүргізеді және академиялық кезеңде екі рет білім алушылардың ағымдағы үлгеріміне тиісті баға береді. Ағымдағы бақылау нәтижелері бойынша 1 және 2 рейтинг қалыптастырылады. Білім алушының оқу жетістіктері 100 балдық шкала бойынша бағаланады, Р1 және Р2 қорытынды бағасы ағымдағы үлгерім бағасынан орташа арифметикалық ретінде шығарылады. Академиялық кезеңде білім алушының жұмысын бағалауды пән бойынша тапсырмаларды тапсыру кестесіне сәйкес оқытушы жүзеге асырады. Бақылау жүйесі жазбаша және ауызша, топтық және жеке формаларды біріктіре алады.


Кезең	Жұмыс түрі	Қорытынды баға
1-ші рейтинг	Есептер шығару	0-100
	Есептер шығару	
	Есептер шығару	
	Есептер шығару	
	Коллоквиум/Тестілеу	
	Есептер шығару	
	Есептер шығару	
	Есептер шығару	
2-ші рейтинг	Коллоквиум	0-100
	Тестілеу	
	Есептер шығару	
	Есептер шығару	
	Есептер шығару	
	Есептер шығару	
	Тестілеу	
Қорытынды бақылау	емтихан	0-100

### 3.1 Жұмыс түрлері бойынша оқыту нәтижелерін бағалау саясаты

Жұмыс түрі	90-100	70-89	50-69	0-49
	Өте жақсы	Жақсы	Қанағаттанарлық	Қанағаттанарлықсыз
Бақылау мәселелері бойынша әңгімелесу	жүйелік теориялық білімді көрсетеді, терминологияны біледі, құбылыстар мен процестердің мәнін логикалық және дәйекті түрде түсіндіреді, дәлелді тұжырымдар мен жалпылаулар жасайды, мысалдар келтіреді, монологиялық сөйлеуді еркін	күшті теориялық білімді көрсетеді, терминологияны біледі, логикалық және дәйекті түрде мен процестерін түсіндіреді, дәлелді тұжырымдар мен жалпылаулар жасайды, мысалдар келтіреді, монологиялық сөйлеуді еркін	ол таяз теориялық білімді көрсетеді, құбылыстар мен процестерді талдаудың нашар қалыптасқан дағдыларын, дәлелді қорытынды жасай алмайтындығын және мысалдар келтіре алмайтындығын көрсетеді, монологиялық сөйлеуді,	ол таяз теориялық білімді көрсетеді, құбылыстар мен процестерді талдаудың нашар қалыптасқан дағдыларын, дәлелді қорытынды жасай алмайтындығын және мысалдар келтіре алмайтындығын көрсетеді, монологиялық сөйлеуді,



	меңгергенін және тез әрекет ету қабілетін көрсетеді	меңгергендігін көрсетеді, бірақ сонымен бірге мұғалімнің өз бетінше немесе шамалы түзетуімен түзететін маңызды емес қателіктер жіберед	сөйлеуді, терминологияны, логиканы және презентация дәйектілігін жете білмейді, мұғалім түзеткен кезде ғана түзете алатын қателіктер жібереді	терминологияны, логиканы және презентация дәйектілігін жете білмейді, мұғалім түзеткен кезде ғана түзете алатын қателіктер жібереді
Практикалық (семинарлық) сабақтарда жұмыс іжасау	қажетті әрекеттер тізбегін сақтай отырып, практикалық жұмысты толық көлемде орындады; жауапта барлық кестелерді, суреттерді, сызбаларды, графиктерді, есептеулерді дұрыс және ұқыпты орындайды; қателерді талдауды дұрыс орындайды	"5" бағасына қойылатын талаптарды орындады, бірақ 2-3 кемшіліктер жіберілді. Білім алушының сұрақтарға жауабы 5-ке жауапқа қойылатын негізгі талаптарды қанағаттандырады, бірақ жаңа жағдайда білімді қолданбай, бұрын зерттелген материалмен және басқа пәндерді оқу кезінде игерілген материалмен байланысты пайдаланбай берілген; бір қателік немесе екіден аспайтын кемшіліктер жіберілді, білім алушы оларды өз бетінше түзете алады	жұмысты толық орындамады, бірақ практикалық жұмыс көлемінің кем дегенде 50% - ы, бұл дұрыс нәтижелер мен қорытындылар алуға мүмкіндік береді; жұмыс барысында қателіктер жіберілді. Сұрақтарға жауап беру кезінде білім алушы сұрақтың мәнін дұрыс түсінеді, бірақ жауапта бағдарламалық материалды одан әрі игеруге кедергі келтірмейтін курс сұрақтарын игеруде жекелеген проблемалар бар; бір өрескел қателік пен екі кемшіліктен артық емес жіберілді	жұмысты толық орындамады немесе жұмыстың орындалған бөлігінің көлемі дұрыс қорытынды жасауға мүмкіндік бермейді. Сұрақтарға жауап беру кезінде Бағдарламаның талаптарына сәйкес негізгі білім мен дағдыларды меңгермегендігін көрсетеді; 3 бағалау үшін қажет болғаннан көп қателіктер мен кемшіліктер жіберілді немесе қойылған сұрақтардың ешқайсысына жауап бере алмайды
емтихан (қорытынды бақылау)	Курстың теориялық мазмұны толық игерілді, бос орындарсыз игерілген материалмен жұмыс істеудің қажетті практикалық дағдылары қалыптастырылды, оқу бағдарламасында көзделген барлық оқу тапсырмалары орындалды, олардың орындалу сапасы максимумға жақын балл санымен бағаланды	Курстың теориялық мазмұны толығымен игерілді, олқылықтарсыз, игерілген материалмен жұмыс істеудің кейбір практикалық дағдылары жеткіліксіз қалыптасқан, оқу бағдарламасында қарастырылған барлық оқу тапсырмалары орындалған, олардың ешқайсысының орындалу сапасы минималды балл санымен бағаланбаған,	Курстың теориялық мазмұны ішінара игерілген, бірақ олқылықтар маңызды емес, игерілген материалмен жұмыс істеудің қажетті практикалық дағдылары негізінен қалыптасады, оқу бағдарламасында қарастырылған оқу тапсырмаларының көпшілігі орындалады, кейбір орындалған тапсырмаларда қателер болуы мүмкін	Курстың теориялық мазмұны игерілмеген, қажетті практикалық жұмыс дағдылары қалыптаспаған, оқу орындалған оқу тапсырмаларында өрескел қателіктер бар, Курс материалында қосымша өзіндік жұмыс оқу тапсырмаларын орындау сапасының айтарлықтай артуына әкелмейді

	Коммерциялық емес акционерлік қоғам «Д. Серікбаев атындағы Шығыс Қазақстан техникалық университеті»		16 бет 17
	Интеграцияланған менеджмент жүйесі	Н ШҚТУ 026-І-2023 Жұмыс оқу бөлімін әзірлеу және ресімдеу КЕАҚ-дағы «Д. Серікбаев атындағы ШҚТУ» бағдарламалар (Силлабус)	

		тапсырмалардың кейбір түрлері қателіктермен орындалған		
--	--	--	--	--

Пән бойынша білім алушының білімін қорытынды бағалау 100 баллдық жүйе бойынша жүзеге асырылады және:

- Ағымдағы үлгерім нәтижелерінің 60%;
- Емтиханнан алынған нәтиженің 40%.

Қорытынды бағаны есептеу формуласы

$$И = 0,6 \frac{P_1 + P_2}{2} + 0,4Э \quad (1)$$

мұндағы, P1, P2-тіісінше бірінші, екінші рейтингті бағалаудың сандық эквиваленттері;  
Э – емтихандағы бағаның сандық баламасы.

Төрт балдық жүйе бойынша цифрлық баламаға сәйкес келетін білім алушылардың оқу жетістіктерін бағалаудың әріптік жүйесі:


Әріптік жүйе бойынша бағалар	Балдардың сандық эквиваленті	Балдар (%-тік құрамы)	Дәстүрлі жүйе бойынша бағалар
A	4.0	95-100	Өте жақсы
A-	3.67	90-94	
B+	3.33	85-89	Жақсы
B	3.0	80-84	
B-	2.67	75-79	
C+	2.33	70-74	
C	2.0	65-69	Қанағаттанарлық
C-	1.67	60-64	
D+	1.33	55-59	
D	1.0	50-54	Қанағаттанарлықсыз
FX	0.5	25-49	
F	0	0-24	

#### 4 ПӘНДЕР САЯСАТЫ

Білім алушы міндетті:

- шығармашылық, даралық және креативтілік көрсете отырып, оқу үдерісіне белсенді қатысу;
- аудиториялық сабақтардың барлық түрлеріне қатысу (дәрістер, практикалық сабақтар);
- "пән бойынша тапсырмаларды орындау және тапсыру кестесі" бойынша жұмысты уақытында орындау және тапсыру";
- дәлелді себеппен жіберілген аудиториялық сабақтарды құжатпен растау;
- оқытушы көрсеткен уақытта жіберілген барлық сабақтарды өтеу;
- сабаққа кешікпеу;



	Коммерциялық емес акционерлік қоғам «Д. Серікбаев атындағы Шығыс Қазақстан техникалық университеті»		17 бет 17
	Интеграцияланған менеджмент жүйесі	Н ШҚТУ 026-І-2023 Жұмыс оқу бөлімін әзірлеу және ресімдеу КЕАҚ-дағы «Д. Серікбаев атындағы ШҚТУ» бағдарламалар (Силлабус)	

- оқытушыға құрметпен қарау; - мінез-құлық мәдениетін сақтау

## 5 ҰСЫНЫЛАТЫН ӘДЕБИЕТТЕР ТІЗІМІ

### 5.1 Негізгі әдебиет

1. Каранина Е.В. Управление финансовыми рисками. Стратегические модели и профессиональные стандарты : учебное пособие / Каранина Е.В.. — Санкт-Петербург : Интермедия, 2017. — 152 с. — ISBN 978-5-4383-0124-0. — Текст : электронный // Цифровой образовательный ресурс IPR SMART : [сайт]. — URL: <https://www.iprbookshop.ru/>

2. Ларионова И.А. Управление финансовыми рисками : практикум / Ларионова И.А.. — Москва : Издательский Дом МИСиС, 2020. — 54 с. — Текст : электронный // Цифровой образовательный ресурс IPR SMART : [сайт]. — URL: <https://www.iprbookshop.ru/>

3. Лисицкая Т.С. Управление финансовыми рисками : учебно-методическое пособие / Лисицкая Т.С.. — Ростов-на-Дону : Донской государственный технический университет, 2020. — 70 с. — ISBN 978-5-7890-1741-8. — Текст : электронный // Цифровой образовательный ресурс IPR SMART : [сайт]. — URL: <https://www.iprbookshop.ru/>

4. Шапкин, А. С. Экономические и финансовые риски. Оценка, управление, портфель инвестиций / А. С. Шапкин, В. А. Шапкин. — 12- изд. — Москва : Дашков и К, 2023. — 538 с. — ISBN 978-5-394-05412-9. — Текст : электронный // Цифровой образовательный ресурс IPR SMART : [сайт]. — URL: <https://www.iprbookshop.ru/>

5. Мокропуло А.А. Управление финансовыми результатами предприятия : учебное пособие для студентов-бакалавров, обучающихся по направлению подготовки «Экономика» (профиль «Финансы и кредит») / Мокропуло А.А., Строгонова Е.И.. — Краснодар, Саратов : Южный институт менеджмента, Ай Пи Эр Медиа, 2017. — 82 с. — ISBN 978-5-93926-298-9. — Текст : электронный // Цифровой образовательный ресурс IPR SMART : [сайт]. — URL: <https://www.iprbookshop.ru/>

### 5.2 Қосымша әдебиеттер

1. <https://www.gov.kz/> - Официальный сайт Министерства финансов РК
2. <https://stat.gov.kz/> - Бюро национальной статистики Агентства по стратегическому планированию и реформам Республики Казахстан
3. <https://www.nationalbank.kz/kz> -Официальный сайт Национального Банка РК
4. IPR SMART <http://www.iprbookshop.ru>
5. ScienceDirect - <http://www.sciencedirect.com>.
6. EBSCO Discovery Service (EDS) - <http://search.ebscohost.com>