

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



„УТВЕРЖДАЮ“
профессор Учен. работам
У.С. Шарипов
2024 года

**СИЛЛАБУС ДИСЦИПЛИНЫ
ТЕОРИЯ ФИНАНСОВЫХ РИСКОВ**

для очной формы обучения

Область знаний: 400 000 – Бизнес, управление и право
Область образования: 410 000 – Бизнес и управление
Направление образования: 60410400 – Финансы и финансовые технологии



Модуль / СИЛЛАБУС ДИСЦИПЛИНЫ
Факультет Банковско-финансовые
услуги
Направление образования: 60410400 –
Финансы и финансовые технологии



Наименование дисциплины:	<i>Теория финансовых рисков</i>
Тип дисциплины:	Обязательный
Код дисциплины:	THFINR106
Год:	3
Семестр:	6
Форма образования:	очная
Форма занятия и количество выделенных часов:	180
Лекции	44
Практические занятия	46
Лабораторные занятия	-
Семинары	-
Самостоятельное образование	90
Объем кредитов:	6
Форма контроля:	экзамен
Язык дисциплины:	русский

Цель предмета (ЦП)

ЦП 1	Основной целью дисциплины «Теория финансовых рисков» является формирование у студентов теоретических знаний выявления и оценки финансовых рисков, приобретение навыков обоснования управленческих решений в организациях различных отраслей, сфер и форм собственности, направленных на их снижение с использованием внутренних механизмов их нейтрализации и методов страховой защиты.
-------------	---

Первичные знания, необходимые для усвоения дисциплины

1	Эконометрика (ECON1108)
2	Экономическая теория (ECONTH106)
3	Микроэкономика (MICROE106)
4	Финансы (FINANC112)
5	Статистика (STATIS106)

Результаты образования (РО)

Аспект знаний

PO1	знать сущность финансовых рисков и их классификацию;
PO2	обладать знаниями о современных методах управления финансовыми рисками;
PO3	изучить существующие процедуры и технологий управления финансовыми рисками;
PO4	сформировать специфическое научное представление о методах и инструментах финансового риск-менеджмента различных экономических субъектов.
Аспект навыков	
PO5	способность осуществлять сбор, анализ и обработку данных, необходимых для решения профессиональных задач
PO6	способность на основе описания экономических процессов и явлений анализировать и содержательно интерпретировать полученные результаты
PO7	способность формировать систему управления рисками
PO8	способность критически оценить предлагаемые варианты управленческих решений и разработать и обосновать предложения по их совершенствованию с учетом критериев социально-экономической эффективности, рисков и возможных социально-экономических последствий.

Содержание предмета

Форма занятий: лекции (Л)		часы
Л1	Теории финансового риска	2
Л2	Сущность и содержание финансового риска, его и влияние на экономические процессы	2
Л3	Классификация финансовых рисков	2
Л4	Рыночные риски	2
Л5	Кредитные риски	2
Л6	Валютные риски	2
Л7	Процентные риски	2
	Инфляционные риски	
Л8	Инфляционные риски	2
Л9	Влияние инфляции на различные процессы	2
	Инвестиционные риски	
Л10	Инвестиционные риски, их особенности	2
Л11	Чистая дисконтированная стоимость	2
Л12	Риски активов	2
Л13	Риск ликвидности	2
Л14	Риски, возникающие на страховом рынке	2
Л15	Налоговые риски	2
	Методы оценки финансовых рисков	
Л16	Методы оценки финансовых рисков	2
Л17	Количественные методы оценки рисков	2

Л18	Методы оценки стоимости	2
Л19	Риск и доходность портфеля	2
Л20	Риск-менеджмент: понятие, стратегия и методы	2
Л21	Методы снижения финансовых рисков	2
Л22	Риски финансового мошенничества	2
ИТОГО		44

Форма занятий: практические занятия (II)		часы
П1	Теории финансового риска	2
П2	Сущность и содержание финансового риска, его и влияние на экономические процессы	2
П3	Классификация финансовых рисков	2
П4	Рыночные риски	2
П5	Кредитные риски	2
П6	Валютные риски	2
	Процентные риски	4
П7	Процентный риск, его сущность и особенности	
П8	Средние значения процентных рисков	
	Инфляционные риски	
П9	Инфляционные риски	2
П10	Влияние инфляции на различные процессы	2
	Инвестиционные риски	
П11	Инвестиционные риски, их особенности	2
П12	Чистая дисконтированная стоимость	2
П13	Риски активов	2
П14	Риск ликвидности	2
П15	Риски, возникающие на страховом рынке	2
П16	Налоговые риски	2
	Методы оценки финансовых рисков	
П17	Методы оценки финансовых рисков	2
П18	Количественные методы оценки рисков	2
П19	Методы оценки стоимости	2
П20	Риск и доходность портфеля	2
П21	Риск-менеджмент: понятие, стратегия и методы	2
П22	Методы снижения финансовых рисков	2
П23	Риски финансового мошенничества	2
ИТОГО		46

№	Самостоятельное образование (СО)	Выделено часов
СО1	Развитие теории финансового риска в различных экономических течениях	4

СО2	Роль финансового риска в условиях глобализации	4
СО3	Критерии и признаки классификация финансовых рисков	4
СО4	Роль и значение рыночных рисков в условиях глобализации	4
СО5	Значение кредитных рисков в деятельности банковских учреждений	4
СО6	Особенности валютных рисков в условиях глобализации	4
СО7	Процентные риски в жизнедеятельности человека	6
СО8	Влияние инфляционных рисков на деятельность предприятия	4
СО9	Влияние инфляции на жизнедеятельность населения	4
СО10	Оценка инвестиционных рисков в условиях либерализации	4
СО11	Расчет чистой дисконтированной стоимости в инвестиционных проектах	4
СО12	Оценка рисков активов в деятельности предприятия	4
СО13	Определение риска ликвидности хозяйствующего субъекта	4
СО14	Характеристика рисков страхового рынка	4
СО15	Роль налоговых рисков в экономике	4
СО16	Классификация методов оценки финансовых рисков, их характеристика	4
СО17	Применение количественных методов оценки рисков в практике	4
СО18	Использование методов оценки стоимости на предприятиях	4
СО19	Оценка риска и доходности портфеля	4
СО20	Важность риск-менеджмента в управлении предприятием	4
СО21	Применение методов снижения финансовых рисков на предприятии	4
СО22	Последствия рисков финансового мошенничества в экономике	4
ИТОГО		90

Основная литература	
1.	Боди З., Мертон Р. Финансы. Учебник. Пер. с англ. – М.: “Вильямс”, 2007.
2.	Malikov T., Olimjonov O. Moliya. Darslik. – T.: “Iqtisod-moliya”, 2019. – 920 b.
3.	Malikov T. Moliya. O'quv qo'llanma. – T.: “Iqtisod-moliya”, 2018. – 274 b.
4.	Финансовые и банковские риски: учебник / Л. И. Юзвович, Ю. Э. Слепухина, Ю. А. Долгих, В. А. Татьянников, Е. В. Стрельников, Р. Ю. Луговцов, М. Н. Клименко; под ред. Л. И. Юзвович, Ю. Э. Слепухиной; Министерство науки и высшего образования Российской Федерации, Уральский государственный экономический университет. – Екатеринбург: Изд-во Урал. ун-та, 2020. – 336 с.
5.	Fozilchayev Sh.Q., Xidirov N.G'. Moliyaviy risklar nazariyasi. O'quv qo'llanma. O'zbekiston Respublikasi Oliy va o'rta maxsus ta'lim vazirligi. –

	Т.: "Iqtisod-Moliya", 2019. – 240 b.
6.	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 К°», 2014. – 880 с.
7.	Зайналов Ж.Р., Ибрагимов Н.А., Ахроров З.О. Корхоналар молияси. Ўқув қўлланма. СамИСИ: "STAP-SEL" МЧЖ. 2023. – 268 б.

Дополнительная литература

1.	Zaynalov J.R., Xusanov B.Sh., Aliyeva S.S., Ro'zibayeva N.X. va b. Moliya bozori: Darslik -T.: "Iqtisod-moliya", 2020. - 480 b.
2.	Zaynalov J.R., Xodjayev E.N., Xusanov B.Sh., Ro'zibayeva N.X. va b. Investitsiya: Darslik -T.: "Iqtisod-moliya", 2020. - 316 b.
3.	Латипова Ш.М. Антиинквизиций молиявий бошқарув. Ўқув қўлланма. – Самарканд: СамИСИ, "STAP-SEL" МЧЖ. – 2022 й. 309-б.
4.	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.

Интернет-сайты:

1.	www.gov.uz – Правительственный портал Республики Узбекистан.
2.	www.lex.uz - Национальная база данных законодательства Республики Узбекистан
3.	www.imf.uz – официальный сайт Министерства экономики и финансов Республики Узбекистан.
4.	www.cbu.uz – Официальный сайт Центрального банка Республики Узбекистан.
5.	www.stat.uz – Агентство статистики при Президенте Республики Узбекистан.
6.	www.soliq.uz - Официальный сайт Налогового комитета при Министерстве экономики и финансов Республики Узбекистан
7.	www.scopus.com – Международная база научной информации.

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 оценен 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 учащийся 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:	Алиева Сусанна Сейрановна, к.э.н., доцент
E-mail:	susanna2003@rambler.ru

Организация:	Самаркандский институт экономики и сервиса, кафедра «Финансы»
Рецензенты:	Ганиев И.М. – к.э.н., доцент, Руководитель отдела контроля качества образования Самаркандского филиала Ташкентского государственного экономического университета Курбонова Б. – Директор ООО «ATLANT PROJECT»

Данный Силлабус утвержден учебно-методическим Советом института протокол №1 от 29 08 2024 г. 5-09-08/2

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

Руководитель Учебно-методического отдела  И.Э.Шодмонов

Декан факультета  О.М. Пардаев

Заведующий кафедрой  Ж.Р. Зайналов

Составитель  С.С. Алиева