



пән бойынша оқыту  
бағдарламасының (Syllabus)  
құрылымдық парағы

Нысан  
ПМУ ҰС Н 7. 18. 3/30

Қазақстан Республикасының Білім және ғылым министрлігі

С. Торайғыров атындағы Павлодар мемлекеттік университеті

Қаржы-экономика факультеті

Қаржы кафедрасы

6М050900 «Қаржы» мамандығының магистранттарына арналған  
Тәуекел менеджменті

**ПӘНІ БОЙЫНША ОҚЫТУ БАҒДАРЛАМАСЫ  
(Syllabus)**

Павлодар



эн бойынша оқыту  
бағдарламасын (Syllabus)  
бекіту парағы

ПМУ ҰС Н 7.18.3/38

БЕКІТЕМІН  
ҚЭФ деканы  
\_\_\_\_\_ Т.Я. Эрназаров  
« \_\_\_\_ » \_\_\_\_\_ 20 ж.

Құрастырушы: аға оқытушы Мухамедова М.М. \_\_\_\_\_

Қаржы кафедрасы

6M050900 «Қаржы» мамандығының магистранттарына арналған  
Тәуекел менеджменті

**пәні бойынша оқыту бағдарламасы  
(Syllabus)**

Бағдарлама « \_\_\_\_ » \_\_\_\_\_ 20\_\_ ж. бекітілген жұмыс оқу бағдарламасының  
негізінде әзірленген.

20\_\_ ж. « \_\_\_\_ » \_\_\_\_\_ кафедра отырысында ұсынылған № \_\_\_\_\_  
хаттама.

Кафедра меңгерушісі \_\_\_\_\_ Н.С. Кафтункина 20\_\_ ж. « \_\_\_\_ »  
\_\_\_\_\_

Қаржы-экономика факультетінің оқу-әдістемелік кеңесімен  
құпталған \_\_\_\_\_ 20\_\_ ж. « \_\_\_\_ » \_\_\_\_\_ № \_\_\_\_\_ хаттама

ОӘК төрағасы \_\_\_\_\_ А. Б. Темиргалиева 20\_\_ ж.  
« \_\_\_\_ » \_\_\_\_\_



## 1 Оқытушылар туралы мәліметтер және байланысу ақпараттары

Кафедра А корпусында орналасқан (Ломов к., 64 үй, 5 қабат),  
511 аудитория, байланыс телефоны 673643

## 2 Пән туралы мәліметтер

Пән арнайы мамандық үшін таңдау бойынша модулдерге кіреді. Профильдік пән болып есептеледі. Оқу жұмыс бағдарламасы және пәні бойынша оқыту бағдарламасы оқу жоспары және мамандықтың элективті пәндер каталогы негізінде әзірленген.

## 3 Пәннің еңбек сыйымдылығы

Семестр	Кредиттер саны	Аудиториялық сабақтар түрлері бойынша байланыс сағаттарының саны						Магистранттың өздік жұмысының сағаттар саны		Бақылау нысандары
		барлығы	дәріс	тәжірибелік	лабораторлық	студиялық	дербес	барлығы	МӨЖМ	
4	3	45	30	15				180	45	емтихан
Барлығы	3	45	30	15				180	45	

## 4 Пәннің мақсаты және міндеттері

**Пәннің мақсаты** - кәсіпорында тәуекелді басқару және бағалау аясында мықты теориялық білімдер және тәжірибелік дағдыларын алуда тұрады. Кәсіпорынның тиімділігін анықтау және кешенді бағалау дағдыларын дамытуға мүмкіндік туғызады.

### Пәннің тапсырмасы:

- тәуекел теорияның сұрақтары бойынша терең теориялық білімдерді қалыптастыру;
- шаруашылық субъекттердің қызметіндегі формалар және тәуекелдердің түрлерінің зерттеуі;
- қауіп-қатерді бағалау әдістеменің зерттеуі;
- тәуекел шарттағы шешім қабылдаудың қазіргі әдістерінің зерттеуі;
- тәуекелдерді төмендету әдістерін және жолдарын зерттеу.

## 5 Білімге, икемділікке және машықтарға қойылатын талаптар

### Магистрант тәуекел пәндер зерттеудің нәтижесінде білуі керек:

- қаражаттар, салық салу, сақтандыру, кәсіпкерлікті ұйымдастыру төңірегіндегі негізгі нормативтік құжаттарды;
- тәуекелдердің түрлерін;
- тәуекелдерді талдауының сапалы және сандық негізгі әдістерін;
- тәуекел басқарудың негізгі әдістерін, тәсілдерін және қағидаларын;
- тәуекелдік жағдайлардағы шешім қабылдау процесстің ұйымдастыру және ақпараттық қамтамасыз етуі;
- тәуекелдерді минимизациялаудың негізгі бағыттары.

### Магистрант тәуекел пәндер зерттеудің нәтижесінде істеу білу керек:

- тәуекелдердің пайда болуының әр түрлі аясын талдау;
- тәуекелдің шамасын және дәрежесін бағалау;
- тәуекелдік жағдайлардағы қолданылған шешімдерді объективті түрде негіздеу;
- тәуекелдерді төмендетуінің тиімді әдістерінің жүйесін қалыптастыру.

Тәжірибелік сабақтары дәріс курста баяндалатын теориялық негіздерді бекіту

мақсаттарында жүргізіледі. Осы курсті зерттеу процесітегі алған тәжірибелік дағдылары өз тіршілік циклының кез келген кезеңде болатын компанияның тәуекел-менеджмент саласында қолдана алады.

## 6 Пререквизиты

«Тәуекел менеджменті» пәнін оқып білуде магистранттар «Қаржылық менеджмент (ілгерілетілген курс)», «Тереңдетілген қаржылық талдау» курстарын оқу үдерісінде алған білімдеріне сүйенеді.

## 7 Постреквизиты

Аталмыш пәнді үйрену барысында, алынған білім, білік, дағды, икем, машық лайықты мамандық бойынша қорытынды мемлекеттік аттестацияға дайындалу үшін қажет болып саналады.

## 8 Тақырыптық жоспар

### 8.1 6M050900 «Қаржы» мамандығының магистранттарына, 2011 ж. түскендерге

<b>ПӘННІҢ ТАҚЫРЫПТЫҚ ЖОСПАРЫ</b>				
<b>№ р/р</b>	<b>Тақырып аты</b>	<b>Сағат саны</b>		
		<b>Дәріс</b>	<b>Тәжірибе</b>	<b>МӨЖ</b>
1	Тәуекел менеджменттің негізгі аспектері және тенденциялары	3	2	23
2	Тәуекел-менеджменттің функциялары, ұйымдастыру және ережелері	3	2	23
3	Тәуекелдерді топтастыру	4	2	23
4	Тәуекел дәрежесін талдау және бағалау	4	2	22
5	Менеджмент жүйесі ретінде тәуекелдерді басқару	4	2	22
6	Банктік тәуекелдерді басқару	4	2	23
7	Тәуекелдерді сақтандыру	4	2	22
8	Портфел менеджменті	4	1	22
<b>ҚОРЫТЫНДЫ</b>		<b>30</b>	<b>15</b>	<b>180</b>

## 9 Пәннің қысқаша сипаттамасы

Тәуекел басқару саласындағы магистранттың көзқарас қалыптастыратын тәуекел-менеджмент бойынша әдістемелік материалдың бөлімдерінің зерттеуі пәннің міндеті болып табылады. Негізгі экономика-математикалық әдістерді және іскер терминдерді мықты меңгеруі, келешек маманына пайда болатын тәуекелдік жағдайлар мәселесіне өз көзқарасын және пікірлерін айқын білдіруге мүмкіндік береді. Тәуекел құнның қазіргі жағдайларын бағалауды зерделеп магистранттар өз зияткерлік потенциалын және дағдарысқа қарсы кәсіпорынды басқарудың кәсіби дағдыларын жетілдіреді.

Осы курс қазіргі тәуекелдердің классификациясын, тәуекелді ретке келтіруге және сақтандару әдістерін меңгеріп, анықсыздықты азайтып, сонымен бірге кәсіпорынның шаруашылық жұмысының әр түрлі кезеңдеріне оның құнын анықтауға мүмкіндік береді.

## **10 Курс компоненттері**

### **10.1 Дәріс сабақтарының тізімі мен мазмұны**

#### **Тақырып 1. Тәуекел менеджменттің негізгі аспектітері және тенденциялары**

Тәуекел- менеджменттің негізгі міндеттері. Тәуекел менеджментті қолдану. Тәуекелдердің түрлері бойынша тәуекелдерді басқару.

1 Смагулова Р. И. Тәуекелдерді басқару экон. мамандақтарының студ. арналған оқу құралы. – Павлодар : Кереку, 2009. – 68 с.

2 Кафтункина Н. С. , Мухамедова М. М. Қаржы менеджмент : экономика мамандықтарының студ. арналған : оқу құралы. – Павлодар : Кереку, 2009. –66 с.

3 Кадерова Н.Н. Корпоративтік қаржы : оқу қралы. – Алматы : Экономика, 2008. – 376 с.

#### **Тақырып 2. Тәуекел-менеджменттің функциялары, ұйымдастыру және ережелері**

Тәуекел-менеджменттің функциялары. Тәуекел- менеджментті ұйымдастыру. Тәуекел-менеджменттің ережелері.

1 Смагулова Р. И. Тәуекелдерді басқару экон. мамандақтарының студ. арналған оқу құралы. – Павлодар : Кереку, 2009. – 68 с.

2 Кафтункина Н. С. , Мухамедова М. М. Қаржы менеджмент : экономика мамандықтарының студ. арналған : оқу құралы. – Павлодар : Кереку, 2009. – 66 с.

3 Кадерова Н.Н. Корпоративтік қаржы : оқу қралы. – Алматы : Экономика, 2008. – 376 с.

#### **Тақырып 3. Тәуекелдерді топтастыру**

Шаруашылық келісім-шарттарды орындамаудың тәуекелдері. Нарықтық конъюнктураның өзгерісі және бәсекелестіктің күшейтуінің тәуекелдері. Жоспарламаған шығындардың пайда болуы және табыстардың төмендетуінің тәуекелдері. Қалған өндірістік тәуекелдіктер.

1 Смагулова Р. И. Тәуекелдерді басқару экон. мамандақтарының студ. арналған оқу құралы. – Павлодар : Кереку, 2009. – 68 с.

2 Кафтункина Н. С. , Мухамедова М. М. Қаржы менеджмент : экономика мамандықтарының студ. арналған : оқу құралы. – Павлодар : Кереку, 2009. – 66 с.

3 Кадерова Н.Н. Корпоративтік қаржы : оқу қралы. – Алматы : Экономика, 2008. – 376 с.

#### **Тақырып 4. Тәуекел дәрежесін талдау және бағалау**

Тәуекелдер талдауының теңестіру (идентификация) және концептуалды бағыттары. Идентификацияның және тәуекелдерді талдауының мазмұны. Идентификацияның және тәуекелдерді талдауының кезеңдері.

Тәуекелді басқару жүйесінің ақпараттық қамтамасыз етуінің қағидалары. Мәліметтің сыртқы және ішкі көздері. Тәуекелді анықтау үшін мәліметтің көздері. Ақпараттық жүйе. Тәуекелдердің көруі.

1 Смагулова Р. И. Тәуекелдерді басқару экон. мамандақтарының студ. арналған оқу құралы. – Павлодар : Кереку, 2009. – 68 с.

2 Кафтункина Н. С. , Мухамедова М. М. Қаржы менеджмент : экономика мамандықтарының студ. арналған : оқу құралы. – Павлодар : Кереку, 2009. – 66 с.

3 Бигельдиева З. А. Корпоративтік қаржы : оқу құралы : 050509 - Қаржы мамандығының студенттеріне арналған. – Алматы : Экономика, 2010. – 152 б.

### **Тақырып 5. Менеджмент жүйесі ретінде тәуекелдерді басқару**

Кәсіпорындағы тәуекелдерді басқарудың процессі. Тәуекелдерді басқаруының әдістері. Тәуекелді өтеуден қашудың әдістері. Тәуекелді оқшалау және диссипациялау әдістері. Тәуекелді өтеу әдістері.

1 Смагулова Р. И. Тәуекелдерді басқару экон. мамандақтарының студ. арналған оқу құралы. – Павлодар : Кереку, 2009. – 68 с.

2 Кафтункина Н. С. , Мухамедова М. М. Қаржы менеджмент : экономика мамандықтарының студ. арналған : оқу құралы. – Павлодар : Кереку, 2009. – 66 с.

3 Бигельдиева З. А. Корпоративтік қаржы : оқу құралы : 050509 - Қаржы мамандығының студенттеріне арналған. – Алматы : Экономика, 2010. – 152 б.

### **Тақырып 6. Банктік тәуекелдерді басқару**

Банктін орналастырылған қорлардың өтелмеу тәуекелі. Банк тәуекелдігінің көрсеткіштері.

1 Шелекбай Ә. Д. Банк ісіндегі тәуекел-менеджмент: теориясы, әлемдік практика, Қазақстан тәжірибесі : оқу құралы. – Алматы : Экономика, 2007. – 207 б.

2 Бигельдиева З. А. Корпоративтік қаржы : оқу құралы : 050509 - Қаржы мамандығының студенттеріне арналған. – Алматы : Экономика, 2010. – 152 б.

### **Тақырып 7. Тәуекелдерді сақтандыру**

Форвард және фьючерс шарттары. Опциондар. Сақтандыру немесе хеджеландыру.

1 Шелекбай Ә. Д. Банк ісіндегі тәуекел-менеджмент: теориясы, әлемдік практика, Қазақстан тәжірибесі : оқу құралы. – Алматы : Экономика, 2007. – 207 б.

2 Бигельдиева З. А. Корпоративтік қаржы : оқу құралы : 050509 - Қаржы мамандығының студенттеріне арналған. – Алматы : Экономика, 2010. – 152 б.

### **Тақырып 8. Портфель менеджменті**

Несиелер тарту инвестициялық бағдарламасындағы тәуекелдерді талдау. Негізгі ұғымдар және инвестициялардың тиімділігінің бағалау принциптары.

1 Шелекбай Ә. Д. Банк ісіндегі тәуекел-менеджмент: теориясы, әлемдік практика, Қазақстан тәжірибесі : оқу құралы. – Алматы : Экономика, 2007. – 207 б.

2 Бигельдиева З. А. Корпоративтік қаржы : оқу құралы : 050509 - Қаржы мамандығының студенттеріне арналған. – Алматы : Экономика, 2010. – 152 б.

## **10.2 Тәжірибелік сабақтарының тізімі мен мазмұны**

### **Тақырып 1. Тәуекел менеджменттің негізгі аспектері және тенденциялары**

Тәуекел- менеджментті компанияда қалыптастыруі. Тәуекелдердің өлшемінде бағалаудың дәлдігі

1 Смагулова Р. И. Тәуекелдерді басқару экон. мамандақтарының студ. арналған оқу құралы. – Павлодар : Кереку, 2009. – 68 с.

2 Кафтункина Н. С. , Мухамедова М. М. Қаржы менеджмент : экономика мамандықтарының студ. арналған : оқу құралы. – Павлодар : Кереку, 2009. – 66 с.

3 Кадрова Н.Н. Корпоративтік қаржы : оқу құралы. – Алматы : Экономика, 2008. – 376 с.

### **Тақырып 2. Тәуекел-менеджменттің функциялары, ұйымдастыру және ережелері**

Тәуекел- менеджменттің жұмыс жасауын ақпараттық қамтамасыз ету.

1 Смагулова Р. И. Тәуекелдерді басқару экон. мамандақтарының студ. арналған оқу құралы. – Павлодар : Кереку, 2009. – 68 с.

2 Кафтункина Н. С. , Мухамедова М. М. Қаржы менеджмент : экономика мамандықтарының студ. арналған : оқу құралы. – Павлодар : Кереку, 2009. –66 с.

3 Кадрова Н.Н. Корпоративтік қаржы : оқу қралы. – Алматы : Экономика, 2008. – 376 с.

### **Тақырып 3. Тәуекелдерді топтастыру**

Коммерциялық тәуекелдер. Қаржы-қаражаттық тәуекелдіктер. Өндірістік тәуекелдіктер.

1 Смагулова Р. И. Тәуекелдерді басқару экон. мамандақтарының студ. арналған оқу құралы. – Павлодар : Кереку, 2009. – 68 с.

2 Кафтункина Н. С. , Мухамедова М. М. Қаржы менеджмент : экономика мамандықтарының студ. арналған : оқу құралы. – Павлодар : Кереку, 2009. –66 с.

3 Кадрова Н.Н. Корпоративтік қаржы : оқу қралы. – Алматы : Экономика, 2008. – 376 с.

### **Тақырып 4. Тәуекел дәрежесін талдау және бағалау**

Қолайлы тәуекелдің тұжырымдамасы. Тәуекелдін шекті мәндері. Тәуекелді капитал. Екіұштылықтардың жүйесі. Екіұштылықты саладағы ұтымдылықтың анықтауының белгілері.

Тәуекел дәрежесінің анықтауы. Тәуекелдердің нормалы үлестірілу және қисығы. Тәуекел дәрежесінің анықтауында сарапшылық бағалау әдістері. Тәуекел құнның тұжырымдамасы (value at risk - var).

1 Смагулова Р. И. Тәуекелдерді басқару экон. мамандақтарының студ. арналған оқу құралы. – Павлодар : Кереку, 2009. – 68 с.

2 Кафтункина Н. С. , Мухамедова М. М. Қаржы менеджмент : экономика мамандықтарының студ. арналған : оқу құралы. – Павлодар : Кереку, 2009. – 66 с.

3 Бигельдиева З. А. Корпоративтік қаржы : оқу құралы : 050509 - Қаржы мамандығының студенттеріне арналған. – Алматы : Экономика, 2010. – 152 б.

### **Тақырып 5. Менеджмент жүйесі ретінде тәуекелдерді басқару**

Кәсіпкерлік тәуекелдердің төмендету. Ақпараттық тәуекелдерді басқару. Тәуекелдердің қаржыландыру әдістері.

1 Смагулова Р. И. Тәуекелдерді басқару экон. мамандақтарының студ. арналған оқу құралы. – Павлодар : Кереку, 2009. – 68 с.

2 Кафтункина Н. С. , Мухамедова М. М. Қаржы менеджмент : экономика мамандықтарының студ. арналған : оқу құралы. – Павлодар : Кереку, 2009. – 66 с.

3 Бигельдиева З. А. Корпоративтік қаржы : оқу құралы : 050509 - Қаржы мамандығының студенттеріне арналған. – Алматы : Экономика, 2010. – 152 б.

### **Тақырып 6. Банктік тәуекелдерді басқару**

Банк тәуекелдіктің бағалау әдістемесі. Банк қорлар объектінің орналастырудың тәуекелдігін рәсми бағалау әдістемелігі.

1 Шелекбай Ә. Д. Банк ісіндегі тәуекел-менеджмент: теориясы, әлемдік практика, Қазақстан тәжірибесі : оқу құралы. – Алматы : Экономика, 2007. – 207 б.

2 Бигельдиева З. А. Корпоративтік қаржы : оқу құралы : 050509 - Қаржы мамандығының студенттеріне арналған. – Алматы : Экономика, 2010. – 152 б.

### **Тақырып 7. Тәуекелдерді сақтандыру**

Хеджеландыру үлгісі

1 Шелекбай Ә. Д. Банк ісіндегі тәуекел-менеджмент: теориясы, әлемдік практика, Қазақстан тәжірибесі : оқу құралы. – Алматы : Экономика, 2007. – 207 б.

2 Бигельдиева З. А. Корпоративтік қаржы : оқу құралы : 050509 - Қаржы мамандығының студенттеріне арналған. – Алматы : Экономика, 2010. – 152 б.

### **Тақырып 8. Портфель менеджменті**



Инвестициялық портфельді тиімді таңдауы. Инвестициялық портфельді таңдауының мәселесі. Диверсификацияланған портфель.

1 Шелекбай Ә. Д. Банк ісіндегі тәуекел-менеджмент: теориясы, әлемдік практика, Қазақстан тәжірибесі : оқу құралы. – Алматы : Экономика, 2007. – 207 б.

2 Бигельдиева З. А. Корпоративтік қаржы : оқу құралы : 050509 - Қаржы мамандығының студенттеріне арналған. – Алматы : Экономика, 2010. – 152 б.

### 10.3 Магистранттың өздік жұмысының мазмұны

#### 6M050900 «Қаржы» мамандығының магистранттарына, 2011 ж. тускендерге

№	СӨЖ түрлері	Есеп беру пішіні	Бақылау түрі	Сағат көлемі
1	Дәрістерге қатысу және жұмыс түрлерін атқару	Конспект	Сабақтарға қатысу	36
2	Тәжірибелік сабақтарға дайындалу, үй тапсырмаларды орындау	Конспект	Сабақтарға қатысу	36
3	Аудиторлық сабақтарға кірмеген материалдарды оқу	Конспект	Конспектте тексеру	54
4	Бақылау шараларына дайындалу барысы		МБ1, МБ2, жазбаша	54
<b>Барлығы</b>				<b>180</b>

### 7.4 Магистранттың өздік үйренуіне шығарылған тақырыптардың тізімі

Магистранттарға реферат формасында жазбаша түрде әзірлеуге бір ғылыми баяндама ұсынылады және оны ауызша қорғау қажет. Баяндамаға қойылатын негізгі талаптар: таңдаулы тақырып бойынша тәжірибелік мәліметтерінің мазмұндамасы, көзқарастарды, пікірлерді, ұсыныстарды дәлелдеу, қысқа және нақтымазмұндамалар. Баяндама өте көкейкесті сұрақтар бойынша дамиды, ғылыми конференцияға толықтырып қатысуына тапсырылады. Рефераттарының тақырыбы көрсетілген төменде толықтыра алады келісуде оқытушымен магистрантпен.

#### Тақырып 1. Тәуекел менеджменттің негізгі аспектері және тенденциялары

Тәуекел- менеджментті компанияда қалыптастыруі. Тәуекелдердің өлшемінде бағалаудың дәлдігі

1 Смагулова Р. И. Тәуекелдерді басқару экон. мамандақтарының студ. арналған оқу құралы. – Павлодар : Кереку, 2009. – 68 с.

2 Кафтункина Н. С. , Мухамедова М. М. Қаржы менеджмент : экономика мамандықтарының студ. арналған : оқу құралы. – Павлодар : Кереку, 2009. –66 с.

3 Кадерова Н.Н. Корпоративтік қаржы : оқу қралы. – Алматы : Экономика, 2008. – 376 с.

#### Тақырып 2. Тәуекел-менеджменттің функциялары, ұйымдастыру және ережелері

Тәуекел- менеджменттің жұмыс жасауын ақпараттық қамтамасыз ету.

1 Смагулова Р. И. Тәуекелдерді басқару экон. мамандақтарының студ. арналған оқу құралы. – Павлодар : Кереку, 2009. – 68 с.

2 Кафтункина Н. С. , Мухамедова М. М. Қаржы менеджмент : экономика мамандықтарының студ. арналған : оқу құралы. – Павлодар : Кереку, 2009. – 66 с.

3 Кадерова Н.Н. Корпоративтік қаржы : оқу қралы. – Алматы : Экономика, 2008. – 376 с.

#### Тақырып 3. Тәуекелдерді топтастыру

Коммерциялық тәуекелдер. Қаржы-қаражаттық тәуекелдіктер. Өндірістік тәуекелдіктер.

1 Смагулова Р. И. Тәуекелдерді басқару экон. мамандақтарының студ. арналған оқу

құралы. – Павлодар : Кереку, 2009. – 68 с.

2 Кафтункина Н. С. , Мухамедова М. М. Қаржы менеджмент : экономика мамандықтарының студ. арналған : оқу құралы. – Павлодар : Кереку, 2009. – 66 с.

3 Кадрова Н.Н. Корпоративтік қаржы : оқу құралы. – Алматы : Экономика, 2008. – 376 с.

#### **Тақырып 4. Тәуекел дәрежесін талдау және бағалау**

Қолайлы тәуекелдің тұжырымдамасы. Тәуекелдің шекті мәндері. Тәуекелді капитал. Екіұштылықтардың жүйесі. Екіұштылықты саладағы ұтымдылықтың анықтауының белгілері.

Тәуекел дәрежесінің анықтауы. Тәуекелдердің нормалы үлестірілу және қисығы. Тәуекел дәрежесінің анықтауында сарапшылық бағалау әдістері. Тәуекел құнның тұжырымдамасы (value at risk - var).

1 Смагулова Р. И. Тәуекелдерді басқару экон. мамандықтарының студ. арналған оқу құралы. – Павлодар : Кереку, 2009. – 68 с.

2 Кафтункина Н. С. , Мухамедова М. М. Қаржы менеджмент : экономика мамандықтарының студ. арналған : оқу құралы. – Павлодар : Кереку, 2009. – 66 с.

3 Бигельдиева З. А. Корпоративтік қаржы : оқу құралы : 050509 - Қаржы мамандығының студенттеріне арналған. – Алматы : Экономика, 2010. – 152 б.

#### **Тақырып 5. Менеджмент жүйесі ретінде тәуекелдерді басқару**

Кәсіпкерлік тәуекелдердің төмендету. Ақпараттық тәуекелдерді басқару. Тәуекелдердің қаржыландыру әдістері.

1 Смагулова Р. И. Тәуекелдерді басқару экон. мамандықтарының студ. арналған оқу құралы. – Павлодар : Кереку, 2009. – 68 с.

2 Кафтункина Н. С. , Мухамедова М. М. Қаржы менеджмент : экономика мамандықтарының студ. арналған : оқу құралы. – Павлодар : Кереку, 2009. – 66 с.

3 Бигельдиева З. А. Корпоративтік қаржы : оқу құралы : 050509 - Қаржы мамандығының студенттеріне арналған. – Алматы : Экономика, 2010. – 152 б.

#### **Тақырып 6. Банктік тәуекелдерді басқару**

Банк тәуекелдіктің бағалау әдістемесі. Банк қорлар объектінің орналастырудың тәуекелдігін рәсми бағалау әдістемелігі.

1 Шелекбай Ә. Д. Банк ісіндегі тәуекел-менеджмент: теориясы, әлемдік практика, Қазақстан тәжірибесі : оқу құралы. – Алматы : Экономика, 2007. – 207 б.

2 Бигельдиева З. А. Корпоративтік қаржы : оқу құралы : 050509 - Қаржы мамандығының студенттеріне арналған. – Алматы : Экономика, 2010. – 152 б.

#### **Тақырып 7. Тәуекелдерді сақтандыру**

Хеджеландыру үлгісі

1 Шелекбай Ә. Д. Банк ісіндегі тәуекел-менеджмент: теориясы, әлемдік практика, Қазақстан тәжірибесі : оқу құралы. – Алматы : Экономика, 2007. – 207 б.

2 Бигельдиева З. А. Корпоративтік қаржы : оқу құралы : 050509 - Қаржы мамандығының студенттеріне арналған. – Алматы : Экономика, 2010. – 152 б.

#### **Тақырып 8. Портфель менеджменті**

Инвестициялық портфельді тиімді таңдауы. Инвестициялық портфельді таңдауының мәселесі. Диверсификацияланған портфель.

1 Шелекбай Ә. Д. Банк ісіндегі тәуекел-менеджмент: теориясы, әлемдік практика, Қазақстан тәжірибесі : оқу құралы. – Алматы : Экономика, 2007. – 207 б.

2 Бигельдиева З. А. Корпоративтік қаржы : оқу құралы : 050509 - Қаржы мамандығының студенттеріне арналған. – Алматы : Экономика, 2010. – 152 б.

**6M050900 «Қаржы» мамандығының магистранттарына арналған «Тәуекел менеджменті» пәні бойынша ағымдағы үлгерімді бақылау шараларының күнтізбелік кестесі**

1 рейтинг										
Апталар		1	2	3	4	5	6	7	8	Барлығы
Апта ішіндегі максды балл		10	10	16	10	10	10	16	18	100
Дәрістерге қатысу және дайындалу	СӨЖ түрі/есеп беру нысаны	ДҮТ 1,2	ДҮТ 3,4	ДҮТ 5,6	ДҮТ 7,8	ДҮТ 1,2	ДҮТ 3,4	ДҮТ 5,6	ДҮТ 7,8	16
	Бақылау нысаны	Қ	Қ	Қ	Қ	Қ	Қ	Қ	Қ	
	Макс.балл	2	2	2	2	2	2	2	2	
Практикалық сабақтарға қатысу және дайындалу	СӨЖ түрі/есеп беру нысаны	ПҮТ 1,2	ПҮТ 3,4	ПҮТ 5,6	ПҮТ 7,8	ПҮТ 1,2	ПҮТ 3,4	ПҮТ 5,6	ПҮТ 7,8	32
	Бақылау нысаны	Қ	Қ	Қ	Қ	Қ	Қ	Қ	Қ	
	Макс.балл	4	4	4	4	4	4	4	4	
Материалды өздігінен меңгеру	СӨЖ түрі/есеп беру нысаны		О		О		О			32
	Бақылау нысаны				ӨО ҮТ 1		ӨО ҮТ 2		ӨОҮ Т 3	
	Макс.балл	4	4	4	4	4	4	4	4	
Пән тақырыптары бойынша білімді бақылау	СӨЖ түрі/есеп беру нысаны			КЖБ Ж1				КЖБ Ж	Ж	20
	Бақылау нысаны			К				К		
	Макс.балл			6				6	8	
2 рейтинг										
Апталар		9	10	11	12	13	14	15		Барлығы
Апта ішіндегі максды балл		11	19	11	19	11	11	19		100
Дәрістерге қатысу және дайындалу	СӨЖ түрі/есеп беру нысаны	ДҮТ 9	ДҮТ 10	ДҮТ 11	ДҮТ 12,1 3	ДҮТ 14	ДҮТ 15,1 6	ДҮТ 17		14
	Бақылау нысаны	Қ	Қ	Қ	Қ	Қ	Қ	Қ		
	Макс.балл	2	2	2	2	2	2	2		
Практикалық сабақтарға қатысу және дайындалу	СӨЖ түрі/есеп беру нысаны	ПҮТ 9	ПҮТ 10	ПҮТ 11	ПҮТ 12,1 3	ПҮТ 14	ПҮТ 15,1 6	ПҮТ 17		28
	Бақылау нысаны	Қ	Қ	Қ	Қ	Қ	Қ	Қ		
	Макс.балл	4	4	4	4	4	4	4		
Материалды өздігінен меңгеру	СӨЖ түрі/есеп беру нысаны		О		О		О			34
	Бақылау нысаны				ӨО ҮТ 1		ӨО ҮТ 2			
	Макс.балл	5	5	5	5	5	5	4		
Пән тақырыптары бойынша білімді бақылау	СӨЖ түрі/есеп беру нысаны									24
	Бақылау нысаны		Ж		Ж			Ж		
	Макс.балл		8		8			8		

20\_ж. «\_\_» \_\_\_\_\_ кафедра отырысында ұсынылған №\_\_\_\_\_ хаттама.

Кафедра меңгерушісі \_\_\_\_\_ Н.С. Кафтункина 20\_\_ ж. «\_\_» \_\_\_\_\_

## 11 Курс саясаты

Оқу процесіне қатысу дегеніміз сабақтарға қатысу, белсенді болу, берілген тапсырмаларды және үй тапсырмаларын уақытысында орындау және тапсыру. Сабаққа қалмау тиіссіз. Біз жұмыстарға кешікпеу сізді сұраймыз, дәл осылай қалай мынау жұмыстардың уақытына сіздердің курстастарыңыздың нормалы жұмысына кедергі жасайды. Көрез телефондар өшірілген болу тиісті.

Үй тапсырмасы жазба түрінде орындайды да сабақтарды өткізу графигіне сәйкес тексеруге беріледі. Мен келесі айып баллдарды орнатамын:

- дәріс сабаққа дәлелді себептерсіз қатыспаған үшін осы сабақтың түріне есептейтін бәрі баллдар шешіледі. Егер магистрант сабаққа дәлелді себеппен келген жоқ, онда ол оқытушыға келмеген дәрістің конспектісін береді. Осы конспект үшін ол 1 баллды ала алады;

- тәжірибелік сабағында дәлелдік себептерсіз болмау - осы сабақтың түріне есептейтін бәрі баллдар шешіледі. Егер магистрант сабаққа дәлелді себеппен келген жоқ, онда ол оқытушыға орындалған тәжірибелік сабақтың конспектісін береді. Осы конспект үшін ол 2 балл ала алады.

- сабаққа кешеуілдеп келгені үшін 0,5 балл төмен бағаланады.

Семестрде екі межелік бақылау өткізіледі: сегізінші және он бесінші апталарында. Ол бақылау жұмыс арқылы өткізіледі. Межелік бақылау сәйкестік блоктың материалдары бойынша өткізіледі. Егер магистрант межелік бақылауда болмаса, ол оны оқытушымен айтылған уақытысында тапсыра алады. Бірақ онда межелік бақылауынан алынған баллдар 0,7 коэффициентке көбейеді.

Межелік бақылау 100 балға тең. Межелік бақылауға ағымды үлгерім балдары болған магистранттер жіберіледі.

(1,2) Рейтинг келесі формула бойынша есептеледі

$$(1,2) P = (1,2)AY*0,7 + (1,2)MB*0,3$$

Егер магистрант аралық бақылаудан 50 кем балл алса, рейтинг анықталмайды. Сонда декан АБ тапсыруының жеке мерзімін белгілейді.

Емтиханға рұқсат (PP) алу келесі формула бойынша есептеледі

$$PP = (1P + 2P)/2$$

Егер магистрант рейтинг рұқсатынан (PP) 50 баллдан кем алса, емтиханға жібарілмейді. Қорытынды баға (ҚБ) рейтинг рұқсаттың (PPCY) және емтиханның қорытынды бақылауының (ЕҚСҮ) салмақтық үлестерінен құралады. ҚБ келесі формала бойынша есептеледі

$$ҚБ = PP*0,6 + ЕҚ*0,4$$

Салмақтық үлес Университетін Ғылыми Кеңесімен жылсайын бекітіледі.

ҚБ 50 кем болса, магистрант ақылы түрде пәнді қайта оқиды. Емтихан тест арқылы өткізіледі. Емтиханда алынатын максималды балл - 100 балл, 50 сұрақтан тұрады.

## **12 Әдебеттер тізімі**

### **Негізгі**

1 Смагулова Р. И. Тәуекелдерді басқару экон. мамандақтарының студ. арналған оқу құралы. – Павлодар : Кереку, 2009. – 68 с.

2 Кафтункина Н. С. , Мухамедова М. М. Қаржы менеджмент : экономика мамандықтарының студ. арналған : оқу құралы. – Павлодар : Кереку, 2009. – 66 с.

### **Қосымша**

3 Шелекбай Ә. Д. Банк ісіндегі тәуекел-менеджмент: теориясы, әлемдік практика, Қазақстан тәжірибесі : оқу құралы. – Алматы : Экономика, 2007. – 207 б.

4 Бигельдиева З. А. Корпоративтік қаржы : оқу құралы : 050509 - Қаржы мамандығының студенттеріне арналған. – Алматы : Экономика, 2010. – 152 б.

5 Кадрова Н.Н. Корпоративтік қаржы : оқу құралы. – Алматы : Экономика, 2008. – 376 с.