

Қазақстан Республикасының білім және ғылым министрлігі

Қарағанды мемлекеттік техникалық университеті

**«Бекітемін»  
Ғылыми кеңес төрағасы,  
ректор, ҚР ҰҒА академигі  
Ғазалиев А.М.**

---

« \_\_\_\_ » \_\_\_\_\_ 2015 ж.

**СТУДЕНТКЕ АРНАЛҒАН ПӘН БОЙЫНША ОҚЫТУ  
БАҒДАРЛАМАСЫ ( SYLLABUS)**

ТВ 2208 «Тәуекелдерді басқару»

КК 7 Кәсіпкерлік қызмет модулі

5В090400 «Әлеуметтік-мәдени қызмет көрсету» мамандығы

Инженерлік экономика және менеджмент факультеті  
«Инженерлік кәсіпкерлік және маркетинг» кафедрасы

## АЛҒЫ СӨЗ

Студентке арналған пән бойынша оқыту бағдарламасы (syllabus) әзірлеген:  
Кошмаганбетова Ж.Б. аға оқытушы

«Инженерлік кәсіпкерлік және маркетинг» кафедрасының мәжілісінде  
талқыланады

« \_\_\_\_ » \_\_\_\_\_ 2015 ж. № \_\_\_\_\_ хаттама

Кафедра меңгерушісі \_\_\_\_\_ Стеблякова Л.П.

(КОЛЫ)

Инженерлік экономика және менеджмент факультеті оқу-әдістемелік  
кеңесі мақұлдайды

« \_\_\_\_ » \_\_\_\_\_ 2015 ж. № \_\_\_\_\_ хаттама

Төраға \_\_\_\_\_ Нурмагамбетова Н.А.

## Оқытушы туралы мәліметтер және байланыс ақпарат

Аты-жөні: Кошмағанбетова Ж.Б.

Ғылыми дәрежесі, өтініші, лауазымы: аға оқытушы

«Инженерлік кәсіпкерлік және маркетинг» кафедрасы ҚарМТУ 4 корпусында (Б.Бульвары, 56) орналасқан, 216 ауд., байланыс телефоны 56-75-94, 2029

### Пәннің еңбек сыйымдылығы

Семестр	Кредиттер саны	ECTS	Сабак түрі				СӨЖ сағаттарының саны	Жалпы сағат саны	Бақылау түрі	
			Қатынас сабақтарының саны			СОӨЖ сағаттарының саны				
			Дәріс	Практикалық сабақтар	Зертханалық сабақтар					
1 қысқ	2	3	15	15	-	30	60	30	90	Тест
3 тол	2	3	15	15	-	30	60	30	90	Тест

### Пәннің сипаттамасы

«Тәуекелдерді басқару» пәні базалық пәндердің таңдау бойынша циклына жатады.

### Пәннің мақсаты

«Тәуекелдерді басқару» пәні мақсаты қауіп-қатер ұғымына, маңызы мен топтамасына, қауіп-қатер шарттарындағы талдау таңдауына, қауіп-қатер таңдауына, қауіп-қатерді бағалау әдістері мен басқаруымен қатысты сұрақтарды оқу мақсаты ұстанады.

### Пәннің міндеттері

Осы пәнді оқу нәтижесінде студенттер:

түсінік алуы керек:

- тәуекел есебімен экономикалық процестердің сндық және сапалық қасиетін зерттеу;

- әдіснамаларды құру мен методологиясын оқу, тәуекелді есепке алатын экономика-математикалық модельдерді қолдану мен анализін оқу;

- типтік әдістерді модельдеу және меңгерушілік шешімдерді қабылдау кезіндегі экономикалық тәуекелдерді өлшеу;

білуы керек:

- бизнестің әр түрлі саласындағы өзіндік және шетелдік теоретикалық үйлесімдерді пайдалану арқылы тәуекел түсінігін анықтау туралы;

- практикада тәуекелді бағалаудың әр түрлі әдіснамаларын, әр түрлі экономикалық жүйесімен мемлекеттерде қолдану;

істей алуы керек:

- практикада тәуекелді төмендеу тәсілдерінің қабылдануы туралы түсінікке ие болуға;

- бизнестің әр түрлі саласындағы өзіндік және шетелдік теретикалық үйлесімдерді пайдалану арқылы тәуекел түсінігін анықтау;

практикалық машықтануы керек:

- практикада тәуекелді бағалаудың әр түрлі әдіснамаларын, әр түрлі экономикалық жүйесімен мемлекеттерде қолдану білуге;
- практикада тәуекелді төмендеу тәсілдерінің қабылдануы;
- тәуекелдің негізгі элементтері мен белгісі,
- кәсіпкерліктің әр түрлі саласы үшін тәуекелдің түрлерінің ерекшеліктері;
- тәуекелді басқарудың негізгі принциптері мен этапы;
- экономикалық тәуекелдің сандық жүйесінің бағасы істей білуге;
- практикада әр түрлі қызметтік көрсеткіштер және тәуекелдің әдістер бағасы қолдануы;
- Excel қолданбалы компьютерлік бағдарламаны тәуекел инвестициялық жобаны есептеу;
- сақтандыру және диверкациялау хиджерлеу әдісін қолдану;
- жұмыстың инструктивті-нормативтік құжатпен жұмысы жобалық және басқару бағамен тәуелділігі оқулық және ғылыми әдебиеттер жұмысы сұрақ бойынша ұйымдастыру;
- тәуекел құнының әдісі және нақты техникада қолдануы.

**Айрықша деректемелер**

Бұл пәнді оқу үшін кеосесі пәндерді игеру қажет: Экономикалық теория негіздері

**Тұрақты деректемелер**

«Тәуекелдерді басқару» пәнін оқу кезінде алынған білім, «Кәсіпорынның экономикалық қызметін талдау», «Маркетингтік коммуникациялар және PR» пәндерін игеру кезінде қолданылады.

**Пәннің тақырыптық жоспары**

Тарау атауы, (тақырыптар)	Сабақтардың түрлері бойынша еңбек сыйымдылығы, с.				
	Дәріс	практикалық	зертханалық	СОӨЖ	СӨЖ
1.Тәуекелді басқарудағы мәні.	2	2	-	3	3
2.Тәуекелді басқару процессін ұйымдастыру	2	2	-	3	3
3.Тәуелкелдер түрі.	2	2	-	3	3
4.Тәуекелділікті анықтау әдістері	2	2	-	3	3
5.Тәуекелділікті бағалау әдістері.	2	2	-	3	3
6.Тәуекелді интегралды бағалау.	2	2	-	3	3

7.Тәуекелділікті қаржыландыру. Сақтандыру.	2	2	-	3	3
8.Өзін-өзі сақтандыру.	1	1	-	9	9
Барлығы	15	15	-	30	30

### **Практикалық (семинарлық) сабақтардың тізімі**

1. Тәуекелді басқарудағы мәні.
2. Тәуекелді басқару процессін ұйымдастыру
3. Тәуелкелдер түрі.
4. Тәуекелділікті анықтау әдістері
5. Тәуекелділікті бағалау әдістері.
6. Тәуекелді интегралды бағалау.
7. Тәуекелділікті қаржыландыру. Сақтандыру.
8. Өзін-өзі сақтандыру.

### **СӨЖ-ге арналған бақылау тапсырмаларының тақырыптары**

1. Селективтік тәуекелдер. Банкроттылық тәуекелдер.
2. Биржалық тәуекелдер. Валюталық тәуекелдер.
3. Көліктік тәуекелдер – жауапкершілік дәрежесі бойынша төрт топ (E, F, C, D.).
4. Аймақтық тәуекелдер. Кешендік тәуекелдер. Инновациялық тәуекелдер.
5. Тәуекел жағдайында шешім қабылдау.
6. Лапластың жетпейтін негіздеуінің қағидалары. Вальдтың максималдық өлшемі, Севиджтің минималдық өлшемі, Гурвицтің макс-мини өлшемі.
7. Тәуекелдерді қаржыландыру әдістері және оларды жіктеу схемасы.
8. Ағымдағы табыстан шығынды жабу (Current expensing of losses).
9. Қордан шығынды жабу (Reserving). Несие қолдану арқылы шығынды жабу (Borrowing). Өзін-өзі сақтандыру негізінде шығынды жабу (Self-insurance).
10. Кэптингтік сақтандыру ұйымдарын құру (captive insurance).
11. Келісімшарт негізінде жауапкершілікті табыстау арқылы залалды жабу (Contractual transfer). Мемлекеттік немесе муниципалдық органдардың қолдауы негізінде шығынды жабу (Budget support). Демеушілік негізінде шығынды жабу (Sponsorship).
12. Банк тәуекелдерін басқару. Ф. Найттың математикалық база негізінде сандық өлшеу тәуекелдерді басқарудағы тіл табуы. Банк тәуекелдерін анықтау.
13. Лизингтік инвестициялауда пайда болатын тәуекелдерді басқару. Лизингтік мәміле қатысушыларын сақтандыру қорғанысы.
14. Агроөнеркәсіптік кешендегі тәуекел менеджменті.
15. Форвардтық және фьючерстік келісімшарттар. Опциондар.

### **Студенттер білімін бағалау критерийлері**

Пән бойынша емтихан бағасы межелік бақылаулар бойынша максимум көрсеткіштер (60%-ға дейін) мен қортынды аттестаттаудың (емтихан) (40%-ға

дейін) сомасы ретінде анықталады және кестеге сәйкес 100%-ға дейінгі мәнді құрайды.

### Пән бойынша тапсырмаларды орындау мен тапсыру кестесі

Бақылау түрі	Тапсырма мақсаты және мазмұны	Ұсынылатын әдебиет	Орындау ұзақтығы	Бақылау түрі	Тапсыру мерзімі	Балл
Практикалық тапсырманы орындау	Практикалық дағдыларды бекіту	[1,2,3,4,5,6,7,8,9,12,17,18]	1-14 апта	Ағымдағы	1-14 апта	20
СОӨЖ орындау	Теоретикалық білімін және практикалық дағдыларды бекіту	Дәріс конспектісі, практика сабақтың материалдары	1-14 апта	Ағымдағы	1-14 апта	10
СӨЖ орындау	Тақырыпты меңгеру және сұрақтарға жауап беру	Негізгі және қосымша әдебиеттің жалпы тізімі	1-14 апта	Ағымдағы	1-14 апта	10
Аралық бақылау (2 блок аттестациясы)	Теоретикалық білімін және практикалық дағдыларды бекіту	Дәріс конспектісі. Негізгі және қосымша әдебиеттің жалпы тізімі	1 қатынас сағаттары	межелік	7,14 апта	20
Емтихан	Пән материалының игерілуін тексеру	Негізгі және қосымша әдебиет тізімі	2 қатынас сағаттары	Қорытынды	Сессия кезінде	40
Барлығы						100

### Саясат және процедуралар

«Тәуекелдерді басқару» пәнін оқу кезінде келесі ережелерді ұстануды сұраймын:

- 1 Сабаққа кешікпей келуді.
- 2 Дәлелді себепсіз сабақ босатпауды, ауырған жағдайда анықтама, ал басқа жағдайларда түсініктеме хат ұсынуды.
- 3 Студенттің міндетіне барлық сабақтарға қатысу кіреді.
- 4 Оқу процесінің күнтізбелік жоспарына сәйкес бақылаудың барлық түрлерін тапсыру.
- 5 Жіберілген практикалық және зертханалық сабақтар оқытушы белгілеген уақытта қайта тапсыру.

### Негізгі әдебиеттер тізімі

1. Корпоративтік қаржы: оқу-әдістемелік оқулық. – Павлодар : Кереку, 2011. – 80 б.

2. Әлжанова Н.Ш. Инвестициялық жобалау : электрондық оқу құралы. – Алматы, Нұр-пресс, 2010. – 250 б.

3. Жобаларды талдау : Экономика мамандықтарының студенттеріне арналған оқу құралы. – Павлодар : Кереку, 2010. – 80 б.

4. Қаржы менеджмент : оқу құралы. – Павлодар : Кереку, 2009. – 65 б.

5. Авдошин, С.М. Информатизация бизнеса. Управление рисками / С.М. Авдошин, Е.Ю. Песоцкая. - М.: ДМК Пресс, 2011. - 176 с.

6. Балдин, К.В. Управление рисками в инновационно-инвестиционной деятельности предприятия: Учебное пособие / К.В. Балдин. - М.: Дашков и К, 2013. - 420 с.

7. Волков, А.А. Управление рисками в коммерческом банке: Практическое руководство / А.А. Волков. - М.: Омега-Л, 2013. - 156 с.

8. Воробьев, С.Н. Управление рисками в предпринимательстве / С.Н. Воробьев, К.В. Балдин. - М.: Дашков и К, 2013. - 482 с.

9. Домащенко, Д.В. Управление рисками в условиях финансовой нестабильности / Д.В. Домащенко, Ю.Ю. Финогенова. - М.: Магистр, ИНФРА-М, 2010. - 238 с.

10. Косолапов, А.Б. Управление рисками в туристском бизнесе: Учебное пособие / А.Б. Косолапов. - М.: КноРус, 2012. - 286 с.

11. Леонович, Т.И. Управление рисками в банковской деятельности: Учебный комплекс / Т.И. Леонович. - Минск: Дикта, Мисанта, 2012. - 136 с.

12. Лященко, В.П. Торговля оружием: проведение НИОКР, операции со стратегическими материалами и сырьем, риски и управление рисками / В.П. Лященко. - М.: Экономика, 2008. - 351 с.

13. Мамаева, Л.Н. Управление рисками: Учебное пособие / Л.Н. Мамаева. - М.: Дашков и К, 2013. - 256 с.

14. Новиков, А.И. Теория принятия решений и управление рисками в финансовой и налоговой сферах: Учебное пособие / А.И. Новиков, Т.И. Солодкая. - М.: Дашков и К, 2012. - 288 с.

15. Новиков, А.И. Теория принятия решений и управление рисками в финансовой и налоговой сферах: Учебное пособие / А.И. Новиков, Т.И. Солодкая. - М.: Дашков и К, 2013. - 288 с.

16. Плошкин, В.В. Оценка и управление рисками на предприятиях: Учебное пособие / В.В. Плошкин. - Ст. Оскол: ТНТ, 2013. - 448 с.

17. Рыхтикова, Н.А. Анализ и управление рисками организации: Учебное пособие / Н.А. Рыхтикова. - М.: Форум, 2012. - 240 с.

18. Стребел, П. Грамотные ходы. Как умные стратегия, психология и управление рисками обеспечивают успех бизнеса / П. Стребел, Э. Олссон; Пер. с англ. А. Столяров. - М.: Олимп-Бизнес, 2013. - 208 с.

19. Уродовских, В.Н. Управление рисками предприятия: Учебное пособие / В.Н. Уродовских. - М.: Вузовский учебник, ИНФРА-М, 2012. - 168 с.

20. Федорова, Т.А. Управление рисками и страхование в туризме: Учебное пособие / Т.А. Федорова. - М.: Магистр, НИЦ ИНФРА-М, 2013. - 192 с.

## **Қосымша әдебиеттер тізімі**

- 1 Кулмагамбетов А.Р.- Управление финансовыми рисками.// Рынок ценных бумаг Казахстана. 1998г.
- 2 Лисак Б.И. Банковские риски в Казахстане: в погоне за мировыми стандартами //Банки Казахстана.-2007.- №8.-с.13-18
- 3 Новиков И.А., Чумаченко Б.П., Шалгимбаева Г.Н. "Стратегия управления банковскими рисками". Алматы "Каржы-Каражат".
- 4 Бартон Т., Шенкир У., Уокер П. Риск-менеджмент. Практика ведущих компаний - М.: Вильямс, 2008. - 208 с.
- 5 Балдин К.В. Риск-менеджмент. Учебное пособие. - М.: Эксмо, 2006. - 368 с.
- 6 Вяткин В.Н. Управление рисками фирмы. Программы интегративного риск-менеджмента. - М.: Финансы и статистика, 2006. - 400 с.
- 7 Гончаренко Л., Филин С. Риск-менеджмент: Учебное пособие - М.: КноРус, 2007. - 216 с.
- 8 Малашихина Н., Белокрылова О. Риск - менеджмент: учеб. пособие. - М.: Феникс, 2004. - 320 с.
- 9 Фомичев А. Риск-менеджмент. - М.: Издательский дом "Дашков и К", 2007. - 374 с.
- 10 Холмс Э. Риск-менеджмент. - М.: Эксмо, 2007. - 304 с.
- 11 Шоломицкий А.Г. Теория риска. Выбор при неопределенности и моделирование риска. - М.: Высшая школа экономики, 2005. - 380 с.



**СТУДЕНТКЕ АРНАЛҒАН ПӘН БОЙЫНША ОҚЫТУ  
БАҒДАРЛАМАСЫ ( SYLLABUS)**

ТК 2208 «Тәуекелдерді басқару»

КК 7 Кәсіпкерлік қызметтік модулі

5B090400 «Әлеуметтік-мәдени қызмет көрсету» мамандығы

Инженерлік экономика және менеджмент факультеті  
«Инженерлік кәсіпкерлік және маркетинг» кафедрасы

31.03.2004 ж. берілген № 50 мем. баспа лиц.

Басуға қол қойылды ж. Пішімі 60 x 90/16

Есептік баспа табағы 0,1 ш.б.п. Таралымы дана

Тапсырыс Бағасы келісімді

---

Қарағанды мемлекеттік техникалық университетінің баспасы,  
100027, Қарағанды, Бейбітшілік бульвары, 56