INTERNATIONAL BUSINESS ACADEMY

+7 727 328 02 02/03 hotline 24/7

+7 702 777 44 11

Риск-менеджмент

Программа

1 день

Риски в современном бизнесе

- Качественное и количественное понимание рисков
- Риски: положительная и негативная сторона прогнозов
- Риски: управление гибкостью (реактивной и проактивной)

Классификация рисков

- Общеэкономические и политические риски (риски окружающей среды)
- Риски бизнес-процессов
    - Операционный риск — эффективность, результативность управления инвестициями
    - Управленческий риск — незнание основ управления рисками, незаконные действия со стороны управляющего компанией
    - Риск информационных технологий — несоответствие информационных технологий компетенциям компании
    - Риск лояльности — мошенничество
    - Финансовый риск — ликвидность, концентрация кредитных ресурсов, изменение кредитной политики банков

- Риски, связанные с информацией для принятия решений
    - Операционный риск — неадекватность ключевых показателей

деятельности
    - Финансовый риск — неадекватное бюджетирование и неоптимальное налогообложение
    - Стратегический риск — неадекватная оценка стоимости бизнес-модели
    - Особенности рисков в развивающихся экономиках

2 день

Оценка рисков. Количественный анализ рисков

- Дисперсия
- Среднеквадратичное отклонение
- VaR (Valueat Risk) как инструмент для оценки и принятия краткосрочных решений
- ROV (Real Options Valuation) как инструмент для оценки и принятия долгосрочных решений в отношении инвестиционных проектов и сделок по слиянию и поглощению
- Применение дерева решений для принятия стратегических решений по развитию
- Метод Монте-Карло

Практикум: Определение взаимосвязи между риском и требуемой доходностью

Разработка противорисковых мероприятий

- Способы противодействия рискам
    - Избегание
    - Программы недопущения рисков
    - Мониторинг
    - Отсутствие действий (сознательное)
    - Иное
    - Оценка управляющих последствий противорисковых мероприятий
        - Изменение вероятности наступления события
        - Расходы на недопущение риска
        - Особенности работы по рискам группы HSC / ОТиТБ
        - Опыт компаний BP и Сибур по риск-менеджменту

Практикум: Разработка и оценка последствий противорисковых мероприятий

INTERNATIONAL BUSINESS ACADEMY

+7 727 328 02 02/03 hotline 24/7

+7 702 777 44 11

РК, г. Алматы ул. Шашкина 24БЦ K Plaza офис 1 (уг. проспекта Аль-Фараби)

www.iba.kz

info@iba.kz