

# 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 (Value at 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 ВР 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

Казахстан, город Алматы, ул. Жарокова 318, офис 23

[www.iba.kz](http://www.iba.kz)

[info@iba.kz](mailto:info@iba.kz)