

ТЕМА СЕМИНАРА:

«Управление рисками в практическом применении»

ДАТЫ ПРОГРАММЫ: 3-4 СЕНТЯБРЯ 2019 ГОДА

ВРЕМЯ ПРОВЕДЕНИЯ: С 10-00 ДО 18-00

МЕСТО ПРОВЕДЕНИЯ: Г. НУР-СУЛТАН, ПР. КАБАНБАЙ БАТЫРА, 15/1, БЦ "Q-2", 5 ЭТАЖ

Тренер: Ержан Акатаев, экономист-математик, финансовый обозреватель Forbes и Financial Times. Консалтинговая практика: более 10 лет (финансовый инжиниринг, проектный анализ, внедрение ERP-систем). Финансовая практика: 12 лет в ведущих московских банках (УРАЛСИБ, Русский стандарт, НКЦ (ММВБ), Российский кредит). Управленческая практика: 4 года на позициях первого руководителя в крупных компаниях (более 500 сотрудников).

Целевая аудитория: лица, ответственные за принятие финансовых и инвестиционных решений; финансовые и риск менеджеры; проектные и инвестиционные аналитики; архитекторы информационных систем, учитывающих факторы риска.

Цель программы:

1. Ознакомить участников с основами построения системы управления рисками предприятий.
2. Дать понимание ключевых стандартов международного риск-менеджмента.
3. Освоить практические инструменты в области управления рисками.
4. Помочь понять широко применяемые на практике методы количественной и качественной оценки рисков.
5. Укрепить профессиональные навыки путем решения задач, тестов и примеров, а также путем обсуждения практических кейсов.

Развиваемые компетенции: ориентация на результат; системное мышление; ответственность в принятии решений; адекватность реакций на практические вызовы; обучаемость, гибкость; умение аргументировать свою позицию и принимать обратную связь.

Синопсис. По окончании семинара участники будут понимать, *как на практике* строится система управления рисками предприятия во взаимосвязи с уровнями управления, *чем* отличаются друг от друга стандарты риск-менеджмента, *какими методами* осуществляется оценка рисков количественно и качественно. Особый акцент сделан на изменениях, имевших место в последние три года.

Содержание программы*:

I – день

1. **Введение.** События: риски и возможности. Взаимосвязь целей и рисков. Стохастичность и детерминированность. Аппетит к риску. Математика риск-менеджмента и методы прогнозирования. Применение статистических распределений. Измерение риска: «мягкие» и «жесткие» оценки. Примеры классификации рисков.
2. **Международные стандарты риск-менеджмента.** COSO ERM 2004. COSO ERM 2017. ISO 31000:2018. Стандарты FERMA. Стандарт Basel II.

3. **Подходы к обработке рисков.** Ключевые индикаторы риска (КИРы), примеры практически используемых КИРов. Деревья решений, деревья взаимосвязей. Метод анализа иерархий. Анализ чувствительности. Анализ сценариев. Имитационное моделирование.
4. **Взаимосвязь систем управления:** корпоративное управление, управление рисками, системы внутреннего контроля и внутреннего аудита.
5. **Управление рисками:**
 - a. корпоративный уровень;
 - b. операционная модель.
6. **Учёт риска в моделировании инвестиционных проектов.** Отбор проектов с применением методов моделирования. Стратегические проекты. Виды моделей, применяемых при анализе и управлении инвестициями. Примеры построения риск-матриц «вероятность-воздействие» для конкретных проектов. Управленческие опционы, пример расчета стоимости управленческого опциона.
7. **Управление рисками.** Присущий, остаточный и допустимый риск. Инвестиционный портфель: сбалансированность и диверсификация. Инструменты срочного рынка. Хеджирование рисков. Примеры хеджирования с помощью опционов. Анализ временных рядов.
8. **Практикум.** Решение задач и обсуждение кейсов.

II – день

9. **Количественная и качественная оценка рисков.**
 - a. **Подходы к оценке:** подход базового индикатора (BIA, Basic Indicator Approach), стандартизированный подход (TSA, The Standardized Approach) и продвинутые подходы (AMA, Advanced Measurement Approach). Обработка статистической информации. Построение профиля риска. Реагирование на риск.
 - b. **Количественные методы оценки риска: примеры расчета. Практикум.** 1) Оценка ожидаемой величины риска проекта. 2) Статистика распределения убытков. Распределение ошибок и имитационная модель (реальный пример). 3) Анализ чувствительности, пример. 4) Анализ сценариев, пример. 5) Страховая статистика и нормативные вероятности реализации рисков, пример. 6) Расчет волатильности и VaR (Value-at-Risk), пример.
 - c. **Качественные методы оценки риска: примеры. Экспертные оценки. Анкетные методы. Практикум.** 1) Ранжирование рисков, пример. 2) Применение метода анализа иерархий, пример.
10. **Стандарт COSO ERM 2017.** Риск-ориентированное принятие решений. Совет директоров, Правление и надзорная функция Совета директоров в свете COSO ERM 2017.
11. **Система управления рисками (СУР).** Архитектура СУР и типы архитектур информационных систем. Элементы инфраструктуры СУР. Применение и польза стандартов. Пример концепции построения СУР на основе COSO ERM и Basel II.
12. **Интеллектуальное казино.**
13. **Подведение итогов семинара.**
 - Обзор ключевых идей, резюме содержания курса.
 - Актуальные проблемы и перспективные идеи по тематике семинара.

*в программе могут быть изменения