

## «QAZAQ PROFİ» ОҚЫТУ ОРТАЛЫҒЫ

ЖАУАПҚЕРШІЛІГІ ШЕКТЕУЛІ  
СЕРІКТЕСТІГІ

010000, Қазақстан Республикасы, Астана  
қ., Ақмешіт көш., 11, 435. БИН 170540030121

Тел.: 8 (7172) 53-77-11

Сайт: [www.qazaq-profi.kz](http://www.qazaq-profi.kz)

e-mail: [info@qazaq-profi.kz](mailto:info@qazaq-profi.kz)



## УЧЕБНЫЙ ЦЕНТР «QAZAQ PROFİ»

ТОВАРИЩЕСТВО С ОГРАНИЧЕННОЙ  
ОТВЕТСТВЕННОСТЬЮ

010000, Республика Казахстан, г. Астана, ул.  
Ақмешіт, 11, 435. БИН 170540030121

Тел.: 8 (7172) 53-77-11

Сайт: [www.qazaq-profi.kz](http://www.qazaq-profi.kz)

e-mail: [info@qazaq-profi.kz](mailto:info@qazaq-profi.kz)

№0047

«22» \_\_02\_\_ 2022ж.

г. Астана қаласы

### Руководителям государственных учреждений, АО, ТОО, РГП и других предприятий

#### Коммерческое предложение

ТОО «Учебный центр «QAZAQ PROFİ» (далее – Учебный центр), аккредитованная Министерством финансов РК в качестве организации по профессиональной сертификации бухгалтеров (Свидетельство №KZ30VНК00000333 от 22.06.2021г.) и ПОБ "Академия профессиональных бухгалтеров "Учёт" (свидетельство об №0401180101 от 04.01.2018г), приглашает Вас и Ваших сотрудников прослушать семинар по программе **«Практический риск-менеджмент»**.

**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 управления рисками предприятий.
2. Дать понимание ключевых идей в сфере международных стандартов риск-менеджмента.
3. Освоить практические инструменты в области учёта факторов риска.
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.

**Форма обучения:** онлайн (ZOOM).

*Учебный центр не является плательщиком НДС*

Наименование семинара	Кол-во акад. часов	Стоимость на 1 слушателя, тенге
<b>Практический риск-менеджмент</b>	20	90 000

Сроки проведения – 03-04 марта (с 10.00 до 17.00 ч.).

**Преимущества Учебного центра:**

- Аккредитована Министерством финансов РК в качестве организации по профессиональной сертификации бухгалтеров
- **Высококвалифицированные преподаватели-практики**, профессиональные бухгалтеры и аудиторы, авторы и разработчики НПА;
- Получила престижную международную награду **«ЛИДЕР ОТРАСЛИ в образовании 2020, 2021 гг.»**
- Относительно низкие цены;
- Комфортные учебные аудитории в бизнес-центрах и административных зданиях;
- Гибкая система скидок для корпоративных и постоянных клиентов;
- Проводимые Акции для слушателей;
- Большой опыт в организации выездного обучения, в том числе в курортных зонах Казахстана.

Для получения более подробной информации и подачи заявки просим обращаться по следующим контактам: 8 (7172) 53-77-11, 8(776)53-77-111, 26-67-23, эл. адрес: [info@qazaq-profi.kz](mailto:info@qazaq-profi.kz)

**Желаем Вам всего самого наилучшего и приглашаем Вас к взаимовыгодному и плодотворному сотрудничеству.**

Генеральный директор



К.Сагындыков

## Программа обучения по курсу

### «Практический риск-менеджмент»

---

ВРЕМЯ ПРОВЕДЕНИЯ: 2 дня

**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:

6. Ознакомить участников с основами управления рисками предприятий.
7. Дать понимание ключевых идей в сфере международных стандартов риск-менеджмента.
8. Освоить практические инструменты в области учёта факторов риска.
9. Помочь понять широко применяемые на практике методы количественной и качественной оценки рисков.
10. 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.

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.** COSOERM. ISO 31000. Стандарты FERMA. Стандарт Base III.
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, BasicIndicatorApproach), стандартизированный подход (TSA, The Standardized Approach) и продвинутые подходы (AMA, AdvancedMeasurementApproach). 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 стандарта COSOERM: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 COSOERM и Basell.

**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