



ФГБОУ ВО РГАУ-МСХА
имени К.А. Тимирязева

ПРОГРАММА

курсов повышения квалификации

«Оценка рисков в системе экономической безопасности предприятия»

2018

Цель курсов: – развитие профессиональной компетентности, получение теоретических и практических знаний в области использования современных методов оценки и управления рисками, адекватных рыночной экономике;

– ознакомление с современными финансовыми технологиями и инструментами, используемыми в отечественной и зарубежной практике управления рисками;

– усвоение новой финансовой философии и культуры этого вида управленческой деятельности, выработка логики принятия рискованных решений, обеспечивающих их динамизм и вариативность.

Приобретаемые компетенции. По окончании курса обучающийся будет обладать:

– способностью осуществлять сбор, анализ, систематизацию, оценку и интерпретацию данных, необходимых для решения профессиональных задач;

– способностью выбирать инструментальные средства для обработки финансовой, бухгалтерской и иной экономической информации и обосновывать свой выбор;

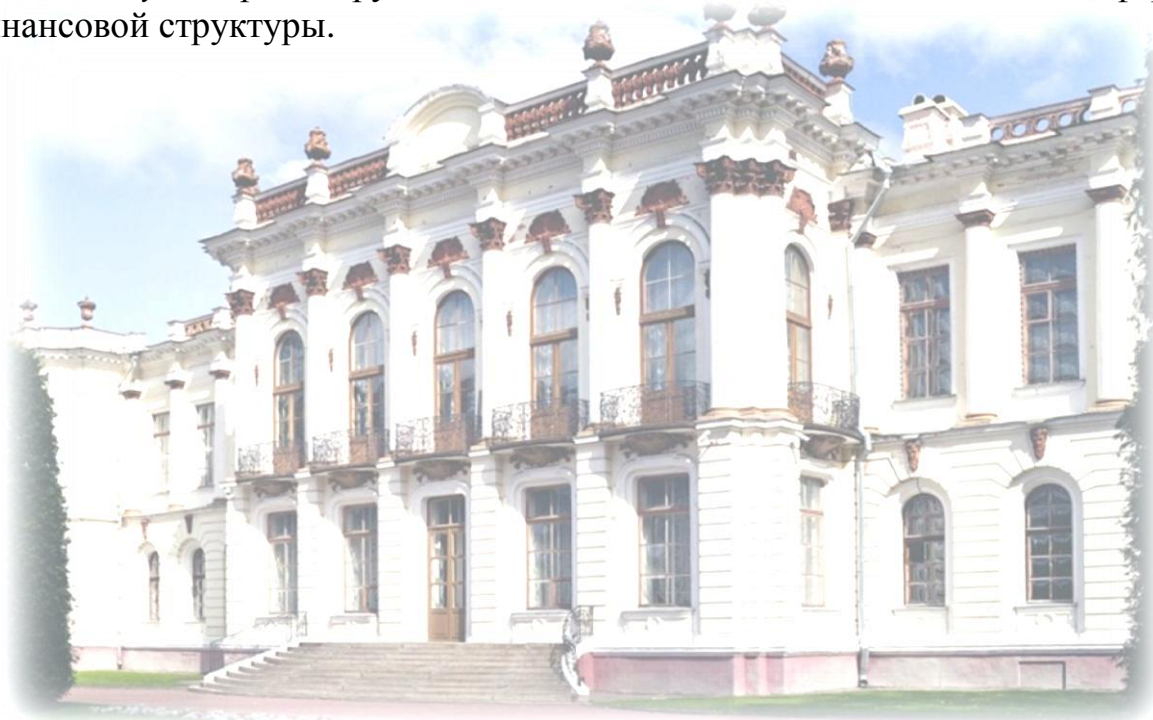
– способностью строить стандартные теоретические и эконометрические модели, необходимые для решения профессиональных задач, анализировать и интерпретировать полученные результаты;

– способностью анализировать состояние и перспективы развития внешнеэкономических связей и их влияние на экономическую безопасность .

Срок обучения: 46 часов – очно, 26 – дистанционно

Слушатели: преподаватели вузов, специалисты.

Целевая аудитория: руководители, специалисты банковской сферы, финансовой структуры.



Аннотация курса

Рассматривается основной круг вопросов, связанных с управлением финансовыми рисками предприятий агропромышленного комплекса. Уровень принимаемого риска оказывает определяющее воздействие на формирование доходности финансовых операций – эти два показателя находятся в тесной взаимосвязи, и представляют единую систему под названием «доходность-риск». Финансовые риски генерируют прямую угрозу банкротства предприятия.

В курсе изложены теоретические основы и методический инструментарий оценки рисков и вызванного ими максимального уровня потерь, снижения негативных последствий реализации рискованных событий. Программа курса предусматривает проведение лекционных и практических занятий, на которых углубляются теоретические знания будущего специалиста. В процессе проведения практических занятий запланировано решение задач по текущему материалу.

№	Содержание занятий	Кол-во часов
1	ПОНЯТИЕ РИСКА И МЕТОДЫ ЕГО ОЦЕНКИ	26
1.1	Понятие и классификация риска	8
	Экономическая сущность рисков и их классификация	2
	Доходность и риск актива, кривая нормального распределения	2
	Инструментарий оценки риска	2
	Правило «трёх сигм», доверительный интервал	2
1.2	Оценка доходности и риска портфеля финансовых активов	6
	Риск портфеля, состоящего из двух активов	2
	Риск портфеля, состоящего из нескольких активов	2
	Эффективная граница портфелей, решение задачи Марковца	1
	Кредитный и заёмный портфели	1
1.3	Модели оценки доходности активов	12
	Модель оценки стоимости активов CAPM	2
	Линия рынка капитала	1
	Рыночный и нерыночный риски, эффект диверсификации	1
	Измерение рыночного риска актива (портфеля)	1
	Линия рынка актива	1
	Оценка актива рынком	1
	Модель Шарпа	1
	CAPM и модель Шарпа	1

	Допустимость (толерантность) риска	1
	Оценка фактической доходности портфеля	1
	Определение фактического риска портфеля	1
2	КОНЦЕПЦИЯ «СТОИМОСТИ РИСКА»	20
2.1	Оценка рыночных рисков и определение «стоимости риска»	2
	Оценка рыночного риска	1
	Определение понятия «стоимости риска»	0,5
	Верификация моделей расчёта по историческим данным	0,5
2.2.	Методология оценки «стоимости риска»	16
	Аналитический (параметрический) метод	4
	Показатель средних ожидаемых потерь. Вектор дельта VAR. Приростной VAR	4
	Метод исторического моделирования	4
	Метод Монте-Карло	4
2.3	Проверка на устойчивость (стресс-тестирование)	2
	Цель проведения стресс-тестирования	1
	Подходы к проведению стресс-тестирования	1
3	УПРАВЛЕНИЕ РИСКАМИ В РЕАЛЬНОМ ИНВЕСТИРОВАНИИ (дистанционно)	26
3.1	Цели и основные этапы анализа проектных рисков	2
3.2	Анализ чувствительности проекта	6
	Назначение метода	1
	Этапы проведения анализа чувствительности проекта	2
	Эластичность показателей эффективности проекта к изменениям исходных (факторных) показателей	1
	Сравнительный анализ альтернативных проектов при помощи построения розы (звезды) рисков	2
3.3	Анализ сценариев проекта	4
	Назначение метода	1
	Этапы проведения анализа сценариев проекта	1
	Формула полной вероятности (Байеса)	1
	Сравнительный анализ альтернативных проектов	1
3.4	Метод «дерева решений» («дерева вероятностей») проекта	4
	Назначение метода	1
	Этапы проведения анализа проектного риска	2
	Сравнительный анализ альтернативных проектов	1
3.5	Имитационное моделирование по методу Монте-Карло	4
	Назначение и основные особенности использования метода	1
	Этапы оценки уровня проектного риска	2
	Сравнение метода Монте-Карло с методами анализа чувствительности, сценариев проекта и «дерева решений»	1
3.6	Оценка инвестиционных рисков с учётом ликвидности активов	6
	Анализ портфельного риска без учёта ликвидности активов	3
	Оценка влияния ликвидности активов на общий уровень портфельного риска	3
	ВСЕГО:	72

Место проведения: РГАУ-МСХА имени К.А. Тимирязева, г. Москва,
ул. Верхняя аллея, д.4

Необходимые документы для зачисления на курсы:

- Заполненная [анкета](#);
- Копия паспорта;
- Копия диплома о высшем образовании.

На обучение принимаются граждане, уже имеющие любое законченное высшее или среднее профессиональное образование

По всем вопросам обращаться к заместителю директора Института непрерывного образования **Постниковой Дарье Дмитриевне**

Тел **8-499-977-92-19, 8-499-977-92-20**

dpostnikova@rgau-msha.ru

**С уважением, директор
Института непрерывного образования**

И.В. Харчева

