

**Коммерческое предложение  
по обучению  
для компании «»**

**По теме:**

**«ВСТРАИВАНИЕ КОЛИЧЕСТВЕННОЙ  
ОЦЕНКИ РИСКОВ В ПЛАНИРОВАНИЕ  
ДЕЯТЕЛЬНОСТИ КОМПАНИИ  
(ИМИТАЦИОННОЕ МОДЕЛИРОВАНИЕ  
МЕТОДОМ МОНТЕ-КАРЛО)»**

**От ИП International Business Academy**

**2026**

**International Business Academy благодарит Вас за внимание к нашей компании  
и предлагает ознакомиться с коммерческим предложением по организации  
и проведению семинара**

**Наши конкурентные преимущества:**

- **Индивидуальная разработка программ под заказ**
- **Mini ассессмент + отчет (по договорённости с клиентом)**
- **Большой выбор тренеров**
- **Персональный менеджер, курирующий проект**
- **Посттренинговая поддержка 6 месяцев**
- **Программы лояльности для постоянных клиентов**
- **Высокая репутация компании IBA и рекомендации от ведущих компаний**

## УСЛОВИЯ СОТРУДНИЧЕСТВА:

ИП International Business Academy приглашает Вас принять участие в обучении по теме: "Встраивание количественной оценки рисков в планирование деятельности компании (имитационное моделирование методом Монте-Карло)".

**Стоимость обучения:** 296500 тенге без НДС. Цена на 2027 год с учетом индексации 10% составит 326150 тенге без НДС.

\*Компания ИП International Business Academy с 2026 года работает на общеустановленном режиме налогообложения с НДС.

\*НДС 16% будет добавлен в счет на оплату.

**Место проведения:** очно территория Поставщика/ онлайн платформа ZOOM

### Даты проведения:

Алматы:

19-20 января 2026  
23-24 марта 2026  
7-8 мая 2026  
20-21 июля 2026  
14-15 сентября 2026  
9-10 ноября 2026  
15-16 февраля 2027  
7-8 апреля 2027  
21-22 июня 2027  
12-13 августа 2027  
21-22 октября 2027  
6-7 декабря 2027  
17-18 января 2028  
29-30 марта 2028  
22-23 мая 2028  
20-21 июля 2028  
18-19 сентября 2028  
23-24 ноября 2028

Онлайн:

19-20 февраля 2026  
27-28 апреля 2026

18-19 июня 2026  
24-25 августа 2026  
29-30 октября 2026  
7-8 декабря 2026  
25-26 января 2027  
29-30 марта 2027  
13-14 мая 2027  
8-9 июля 2027  
20-21 сентября 2027  
25-26 ноября 2027  
3-4 февраля 2028  
20-21 апреля 2028  
22-23 июня 2028  
10-11 августа 2028  
23-24 октября 2028  
4-5 декабря 2028

\* даты требуют дополнительного согласования

**Продолжительность:** 16 академических часов

**Время:** с 10:00 до 17:30.

**Количество участников:** 1 человек

**В стоимость обучения входит:** обучение, комплект эксклюзивных обучающих материалов, блокнот, ручка, сертификат International Business Academy, посттренинговая поддержка (6 месяцев), 2 кофе-брейка в каждый день занятий (при условии, что обучение очное).

Просим заключить договор заранее как минимум за 1-2 месяца до начала обучения и забронировать даты с тренером.

Исполнитель: Батухтина Н.Е



## Информация о компании.

International Business Academy– это:

1. Рекомендации. Высокая репутация компании IBA и рекомендации от ведущих компаний Казахстана. Компания более 10 лет на рынке за это время зарекомендовала себя, как надежного поставщика услуг.
2. Персональный менеджер, курирующий проект. Каждый проект курирует отдельный менеджер, который закреплен за Вашей компанией
3. Лучшие эксперты. Профессиональный состав привлекаемых к процессу обучения преподавателей, успешных экспертов, консультантов, топ-менеджеров крупных корпораций.
4. Актуальность и польза. Наши программы отражают самые современные методики с учетом изменения рынка и законодательства.
5. Формат обучения. Мы предлагаем нашим клиентам несколько форматов обучения: — Очный и Онлайн формат открытых, корпоративных и индивидуальных семинаров.
6. Пост-тренинговые анализ и поддержка в течении 6 месяцев. Мониторинг результатов тренингов в рабочем процессе, рекомендации от тренера.
7. Индивидуальный подход. Все, начиная от содержания, места и времени проведения тренингов может быть настроено в соответствии Вашим потребностями.
8. Принципиально высокий уровень сервиса. Мы создали все условия для максимального вовлечения в обучение: от удобных кресел и современного презентационного оборудования, до удобной локации.
9. Международные стандарты обучения. Обучение в рамках международных стандартов, с адаптаций под реалии казахстанского бизнеса.

## ОПИСАНИЕ ПРОГРАММЫ:

1 день

**Основы теории вероятности в управлении рисками. Анализ случайных величин и связь с анализом рисков в бизнесе.**

Введение в количественную оценку риска.

Понятие «вероятность». Формулы расчета вероятности из классической теории вероятностей.

Е-mail: [info@iba.kz](mailto:info@iba.kz)

Сайт: <http://www.iba.kz/> Телефон и WhatsApp: +7 702 777 4411

Адрес: РК, г. Алматы ул. Пашкина д. 24 БЦ К Plaza (уг. проспекта Аль-Фараби) офис 1

Понятие «случайной величины».

Моделирование случайной величины.

Законы распределения вероятности, которым подчиняется случайная величина.

Непрерывные и дискретные распределения.

Процентили и VaR (Value at Risk), наиболее популярные разновидности VaR.

### **Фундаментальные основы анализа бизнес-рисков.**

Моделирование рисков.

Законы поведения случайных величин и их моделирование.

Алгоритм выбора оптимального закона поведения случайных величин.

Баланс между правдоподобием модели и сложностью модели.

### **Построение моделей оценки рисков, отработка практических упражнений.**

Различие между моделированием «от цели, на которую влияет риск» и моделированием отдельно взятых событий, влияющих на достижение цели, находящейся под риском.

Построение модели количественной оценки рисков «от цели».

Принципы построения модели.

Ключевые допущения и принципы учета допущений при моделировании.

- **Практический кейс: «Количественная оценка рисков выполнения бизнес-плана».**

### **Результаты количественной оценки рисков, их интерпретация и основы доведения результатов до руководителей бизнеса.**

- Продолжение практического кейса «Количественная оценка рисков выполнения бизнес-плана».

Моделирование взаимосвязей между рисками бизнес-плана.

Прямые функциональные связи и корреляционные связи (обзор).

Анализ рисков методом имитационного моделирования.

Детали методов имитационного моделирования «Монте-Карло» и «Латинский гиперкуб» (наиболее

распространенные в мире методы имитационного моделирования).

Интерпретация результатов количественной оценки рисков по влиянию на бизнес-план.

Анализ напряженности бизнес-плана под рисками.

Определение погрешности количественной оценки рисков.

- **Расчет погрешности и сходимости моделей количественной оценки рисков на примере практического кейса.**

2 день

**Ключевые детали основных методов риск анализа и приоритизации рисков.**

Моделирование корреляции между рисками (детали).

Статистические и экспертные методы определения корреляций и их учет в моделях.

Переход от моделирования рисков «от цели» к «событийному моделированию».

Понятие «случайного события» и определение его вероятности.

Различие между априорной и условной вероятностями и детали их определения / учета при моделировании (на основе классической теории вероятностей).

Приоритизация рисков количественными методами.

Регрессионный и корреляционный анализ (детали и различия методов) в целях приоритизации рисков.

**Практические упражнения на основные методы моделирования рисков, получение результата, приоритизацию рисков.**

Построение диаграмм торнадо (бриджей, водопадов), как наиболее распространенных в мире способов визуализации по итогам ранжирования / приоритизации рисков.

- **Принципы и различия приоритизации рисков по влиянию как на целевые значения показателей бизнеса, а также на пессимистичные и оптимистичные сценарии (на примере практического кейса бизнес-планирования с учетом рисков).**

Переход от «экспертного реестра рисков» к количественной оценке рисков и моделирование совокупного риска (риска влияния всей совокупности случайных событий, оценку которых на достижение целей требуется оценить).

Особенности моделирования на различных горизонтах планирования деятельности компании (квартал, год, стратегический долгосрочный период).

### **Практические упражнения на использование всех имеющихся данных и статистики при моделировании рисков.**

Учет предполагаемой частоты реализации событий на горизонте планирования и количественной оценки рисков.

Различия в понятиях «вероятность» и «частота».

Совместное моделирование частоты и вероятности событий с учетом различных последствий при неоднократном наступлении одного и того же события.

Статистические модели.

Анализ поведения случайных величин на основе имеющейся статистики (на примере кейсов валютного или ценового рисков, или любого другого из рисков, по которому у обучаемого класса имеется статистика).

Подбор наиболее правдоподобного закона распределения вероятности (на основе имеющейся статистики), описывающего поведение случайной величины и учет при количественной оценке рисков.

### **Практические упражнения на принятие решений по результатам количественной оценки рисков.**

Принятие решений с помощью количественной оценки рисков.

Критерии принятия решений при наличии модели количественной оценки.

- **Построение деревьев решений (детали и правила) на примере практического бизнес-кейса.**

Выбор оптимальной стратегии реализации бизнеса / проекта при много-вариантности будущего развития событий (с помощью количественной оценки возможных исходов и вариантов).

Измерение чувствительности принятых решений к параметрам, заложенным в модель количественной оценки риска.

Моделирование остаточного риска (оценка риска при условии реализации тех или иных мер, снижающих риск).

Количественная оценка эффективности мероприятий, направленных на митигацию риска.

Постановка и решение оптимизационных задач: в каких пределах должен находиться риск или

совокупность рисков, чтобы целевой показатель бизнеса принял запланированное целевое значение.

- **Определение соответствующих лимитов на риски расчетными методами (на практических примерах).**

**Ответы на вопросы**

**Завершение тренинга**