

На правах рукописи



ВАНЮРИХИН ФИЛИПП ГЕННАДЬЕВИЧ

**МОДЕЛИ И МЕТОДЫ ДИНАМИЧЕСКОГО УПРАВЛЕНИЯ РИСКАМИ
ПРЕДПРИЯТИЙ**

Специальность: 08.00.05 — Экономика и управление
народным хозяйством (менеджмент)

АВТОРЕФЕРАТ
диссертации на соискание ученой степени
кандидата экономических наук

Москва – 2019

Диссертация выполнена на кафедре «Прикладная экономика» Экономического факультета Федерального государственного автономного образовательного учреждения высшего образования «Российский университет дружбы народов» (РУДН).

Научный руководитель: доктор экономических наук, профессор **Овчинникова Оксана Петровна**, профессор кафедры «Прикладная экономика» Экономического факультета ФГАОУ ВО «Российский университет дружбы народов».

Официальные оппоненты: доктор экономических наук, профессор **Бадалова Анна Георгиевна**, профессор кафедры экономики и управления предприятием Института экономики и технологического менеджмента МГТУ СТАНКИН;
доктор экономических наук, доцент **Серебрякова Надежда Александровна**, профессор кафедры экономической теории и учетной политики ФГБОУ ВО «Воронежский государственный университет инженерных технологий».

Ведущая организация: **АНОО ВО Центросоюза Российской Федерации «Российский университет кооперации».**

Защита состоится «05» марта 2020 г. в 16:00 на заседании объединенного диссертационного совета Д 999.058.03 на базе ФГАОУ ВО «Российский университет дружбы народов» (РУДН), Госкорпорации «Ростех» и АО «ЦНИИ «Электроника» по адресу: 117198, Москва, ул. Миклухо-Маклая, д. 6.

С диссертацией можно ознакомиться в библиотеке ФГАОУ ВО «Российский университет дружбы народов» (РУДН), Госкорпорации «Ростех» и АО «ЦНИИ «Электроника».

Объявление о защите и текст автореферата размещены на официальном сайте Высшей аттестационной комиссии при Министерстве науки и высшего образования Российской Федерации и на сайте РУДН.

Автореферат разослан «__» _____ 2020 г.

Ученый секретарь
диссертационного совета Д 999.058.03
кандидат экономических наук

А.А. Островская

ОБЩАЯ ХАРАКТЕРИСТИКА РАБОТЫ

Актуальность диссертационной работы определяется необходимостью реализации интенсивных преобразований в реальном секторе экономики Российской Федерации, связанных с переходом на новый уровень экономических и хозяйственных отношений, модернизацией систем корпоративного управления, внедрением новых информационных и производственных технологий.

В этих условиях наиболее остро проявляются проблемы в области контроля и управления рисками на предприятиях наукоемких отраслей экономики и промышленности.

Решение данной проблемы относится к типу сложных многокритериальных задач и актуализирует научно-исследовательскую работу через преодоление различных препятствий в следующих плоскостях:

- преобладание консервативных моделей управления рисками, которые являются причиной низкой эффективности оценки современных рисков и ограничивают горизонты контроля. Как показывают исследования состояний риск-менеджмента и внутреннего аудита, проводимые FERMA, PWC и Институтом внутренних аудиторов в 2016-2018гг., в России управление рисками преимущественно ассоциируется со страхованием и строится по формальным критериям;

- трансформация внешней и внутренней деловой среды. На фоне усложнения международных отношений и ужесточения политики сотрудничества в области высоких технологий, финансов и бизнеса возникают и усиливаются соответствующие риски, управление которыми требует всесторонней модернизации системы риск-менеджмента. Существующие системы не позволяют качественно и в полном объеме осуществлять контроль и управление рисками среды;

- невысокие темпы адаптации нормативной базы и стандартов, регламентирующих деятельность в области внутреннего контроля, аудита и управления рисками. Наличие большого количества локальных нормативных документов, иногда противоречащих друг другу, приводит к возникновению конфронтаций и конфликтов различного характера и усложняет процедуры анализа, оценки и управления рисками и тем самым снижает эффективность бизнес-процессов;

- недостаточное внимание со стороны научно-практического сообщества к динамическим аспектам управления рисками: отсутствие теоретической базы по творческим, нетривиальным подходам к вопросам оценки и управления рисками предприятий, недостаточная вовлеченность специалистов и ученых в процессы разработки новых решений динамического управления рисками, отсутствие научного обоснования возможности искусственного формирования рисков и «ручного управления» рисковым потоком.

Для преодоления указанных препятствий необходимо системное совершенствование управления процессами анализа, оценки и контроля рисков с использованием более эффективных инструментов. При этом важно подчеркнуть, что в условиях интенсивного развития информационных и

научно-технологических технологий, допускается подход к динамическому управлению рисками предприятий наукоемких отраслей с позиции метапредметности, с применением подходов, концепций, методик и инструментов из различных областей знаний – инновационного и креативного менеджмента, психологии, маркетинга, экономический и др.

Степень разработанности темы диссертации. Вопросам оценки и управления рисками посвящены труды и научные исследования отечественных и зарубежных авторов, ученых–теоретиков, практиков и аналитиков консалтинговых компаний. Значительный вклад в развитие современной теории риска внесли: В.Ю. Абрамов, С. Александер, П. Джорион, Ж.-К. Колли, Ф.Х. Найт, Л.Н. Тэпман, М. Фридман.

Проблематика риска нашла отражение в трудах отечественных ученых Н.И. Аристера, Л.И. Абалкина, И.Т. Балобанова, С.А. Белоусова, В.В. Верещагина, О.В. Кудиновой, Ю.А. Ключевой, М.А. Рогова, В.И. Соловьева, и др.

Теоретико-методологические подходы к вопросам управления промышленным предприятием в условиях неопределенности и риска описаны в работах В.И. Асриева, К.В. Балдина, А.М. Батьковского, Г.И. Ванюрихина, В.П. Варфоломеева, С.Н. Воробьева, С.А. Жданова, Р.М. Качалова, Н.В. Князевской, В.С. Князевского, А.А. Лобанова, Ю.Н. Макарова, Д. А. Медведчикова, О.П. Овчинниковой, Д.Б. Пайсона, Г.Г. Райкунова, Н.И. Турко, С.В. Чемезова, А.В. Чугунова, А.А. Чурсина, Р.В. Шамина, В.С. Шутова и др.

Основы современного риск-менеджмента и практические аспекты управления рисками отражены в научных и практических работах В.Н. Вяткина, И.В. Вяткина. В.А. Гамзы, Ю.Ю. Екатеринославского, П.Н. Иванушко, А.В. Фоминой. Вопросы совершенствования внутреннего контроля и аудита раскрыты в работах П. Викторова, А. Войлукова, Д. Малыхина, М. Симмонса, М. Павлова, А. Сониной, Р. Чемберса.

Несмотря на то, что в последние годы проблема управления рисками выходит на передовые рубежи фундаментального исследования, ощущается недостаток внимания к практическим аспектам динамического управления рисками и дефицит методологического обеспечения риск-менеджмента предприятий. Вопросы активного воздействия на факторы риска и совершенствования методик формирования особой рабочей среды практически не затронуты научным сообществом.

Объектом исследования является процесс управления рисками предприятия.

Предмет исследования – организационно-экономические и управленческие отношения, возникающие в процессе мониторинга, контроля и управления рисками на предприятиях.

Цель диссертационной работы состоит в разработке научно обоснованных предложений и рекомендаций по динамическому управлению рисками предприятий.

Цель исследования предопределила постановку и необходимость решения следующих задач:

- обосновать теоретико-методический подход к организации комплекса внутреннего контроля, аудита и управления рисками предприятий на

основе креативного и метапредметного подходов с учетом динамического характера риска;

- предложить методические подходы к организации эффективной системы риск-менеджмента на предприятиях
- разработать инструментарий количественной и качественной оценки рисков предприятий, включающий статические и динамические методы и модели;
- обосновать концептуальные положения комбинированного управления рисками, включающих усовершенствованные подходы и инструменты их оценки;
- разработать методические и практические рекомендации по динамическому управлению рисками предприятий.

Теоретико-методологической основой диссертации являются теоретические работы и прикладные исследования российских и зарубежных ученых, экспертов по техническому и фундаментальному анализу, внутреннему контролю, аудиту и управлению рисками, корпоративному управлению, направленные на совершенствование системы внутреннего контроля и риск-менеджмента предприятий в условиях развития инновационной экономики, трансформации современной системы государственного и отраслевого управления, активного развития государственно-частного партнерства; действующие законодательные и нормативно-правовые акты и конструктивные инициативы по их совершенствованию; международные и отечественные профессиональные стандарты и практические рекомендации, определяющие порядок контроля и управления риском на предприятиях.

Информационной основой послужили материалы Министерства экономического развития и торговли РФ, Федерального агентства по промышленности РФ (Роспрома), ГК «Роскосмос», Министерства энергетики России, Министерства Финансов РФ, Центрального банка РФ, Базельского Комитета по банковскому контролю, Комитета ТРЭДУЭЙ (COSO), Ассоциации сертифицированных экспертов по расследованию и противодействию мошенничеству (ACFE), Международного института внутренних аудиторов (IIA), профессиональных ассоциаций риск-менеджеров ERMA, FERMA, РусРиск; публикации и отчеты научно-исследовательских институтов; отчеты страховых и консалтинговых компаний, национальных и международных рейтинговых агентств; авторские аналитические работы, исследования, статьи.

Гипотеза исследования заключается в предположении, что повышение эффективности управления рисками предприятий возможно за счет комплексного использования динамических и креативных методов и моделей управления.

Научная новизна диссертационного исследования заключается в решении важной научной задачи, заключающейся в разработке и обосновании теоретико-методических положений и практических рекомендаций по модернизации системы риск-менеджмента предприятий с использованием методов активного динамического управления рисками.

Наиболее существенные результаты, обладающие научной новизной исследования, заключаются в следующем:

- На основе исследования эволюции подходов к управлению рисками на предприятиях выявлен и обоснован динамический характер рискового события, заключающийся в том, что рассматриваемая категория учитывает все этапы возникновения и развития риска (статическую, пассивную динамику, активную динамику), что обуславливает комплексный характер реализации политики риск-менеджмента на предприятии;

- Обоснован теоретико-методический подход к организации риск-менеджмента, состоящий в совокупности управленческих решений менеджмента предприятий, основанных на использовании креативного и метапредметного подхода (учет риск-аппетита, составление тепловой карты рисков и т.п.), ориентированных на гармонизацию разнонаправленных интересов стейкхолдеров, и учитывающих динамический и многофакторный характер рискового события; отличающиеся авторской группировкой подходов к организации управления рисками предприятий (формальное, стандартное, прогрессивное) и использованием тепловой карты рисков предприятия, позволяющей на этапе разработки комплекса анализа, оценки и управления рисками определить уровень текущего состояния риск-менеджмента и перспективы дальнейшего развития;

- Разработана креативная (творческая) модель динамического управления рисками предприятия, базирующаяся на принципах трех линий защиты (операционное управление, внутренний контроль (первая линия), комплаенс, риск-менеджмент (вторая линия), внутренний аудит (третья линия)), отличительной особенностью которой является модульность, позволяющая синхронизировать оценку внешней среды предприятия, постановку целей развития и выявление потенциальных рисковых событий, реализация которой позволяет осуществлять текущий и итоговый мониторинг рисков и превентивно реагировать на рисковое событие с помощью соответствующего уровня риска инструментария;

- Предложена методика повышения эффективности риск-менеджмента предприятия с учетом качественных и количественных критериев в контексте выделения особого качества деятельности предприятия – экономической энергии, накапливаемой в течении жизненного цикла, что позволяет рационально использовать экономический и управленческий потенциал по двум основным направлениям (массовому, предполагающему максимальное использование имеющихся ресурсов, и скоростному, обеспечивающему использование новейших технологий, знаний, креативных методов принятия решений при оценке и нивелировании рисков предприятия);

- Обоснован метод динамического управления рисками предприятия «по правилам Керлинга», заключающийся в применении комплексных подходов и моделей управления факторами неопределенности и риска посредством воздействия на риски внутренней и внешней среды через искусственное редактирование характеристик рисков, формирование рискового потока и рискового профиля предприятия под индивидуальные особенности и комплексные возможности (финансовые, технические, интеллектуальные и пр.) отдельного предприятия.

Объективность и достоверность определений, положений, выводов и рекомендаций работы обеспечивается совокупностью используемых аналитических инструментов и научных методов оценки деятельности менеджмента предприятий в области планирования, принятия и реализации решений в различных иерархических системах, в том числе государственного и корпоративного управления, статистических данных, экономико-математического моделирования, креативных и информационных технологий. В рамках систематизации полученных данных применялись также методы экспертных оценок, сравнения, классификации и группировок.

Область исследования соответствует пункту Паспорта ВАК Министерства образования и науки РФ по специальности 08.00.05 «Экономика и управление народным хозяйством (экономика, организация и управление предприятиями, отраслями, комплексами – менеджмент»): п. 10.11. Процесс управления организацией, ее отдельными подсистемами и функциями. Целеполагание и планирование в управлении организацией. Контроль, мониторинг, бенчмаркинг. Механизмы и методы принятия и реализации управленческих решений. Риск-менеджмент. Современные производственные системы.

Теоретическая значимость диссертации состоит в разработке и обосновании теоретико-методических основ эффективного динамического управления рисками предприятия, возникающих и протекающих в условиях перманентной трансформации активной деловой среды.

Практическая значимость исследования заключается в том, что полученные выводы и рекомендации подлежат применению при разработке и реализации основных направлений стратегий и программ риск-менеджмента предприятий, в том числе наукоемких отраслей экономики.

Отдельные положения работы, содержащие в себе теоретико-методические основы динамического риск-менеджмента, внедрены в практику деятельности предприятий реального сектора экономики.

Теоретические и практические разработки, направленные на формирование эффективной политики риск-менеджмента, применимы в преподавании и изучении учебных курсов: «Внутренний контроль и управление рисками»; «Методы принятия социально-экономических решений в условиях неопределенности и риска»; «Технологии внутреннего контроля, аудита и управления рисками».

Апробация результатов диссертационного исследования. Основные положения и выводы диссертации опубликованы в научных статьях, а также докладывались на научно-практических конференциях различного уровня: НПК «Новые горизонты менеджмента» ТулГУ, Тула, 1999г.; НТК МГТУГА г. Москва, 2004г.; НПК МППГУ, Москва, 2006г.; «Российская государственность в XXI веке и глобальные проблемы мирового развития». Научная конференция. МГУ, Москва, 2009; «Проблемы и перспективы экономического развития ракетно-космической отрасли промышленности на период до 2030 года и его ресурсное обеспечение». РУДН, 2013г.; VI Всероссийская студенческая научно-практической конференция. Екатеринбург, 7–8 ноября 2018 г. и пр.).

Результаты исследования, связанные с разработкой процесса управления и контроля рисков предприятия были разработаны в рамках НИР «Разработка теоретических основ управления конкурентоспособностью наукоемких отраслей промышленности РФ в кризисных и посткризисных условиях» (этапы 3,4); «Разработка моделей и методик оценки эффективности, реализуемости, фактического выполнения и согласованности космических программ с учетом прогнозирования макроэкономических показателей развития экономики России и учетом возможных рисков» (этапы 4, 5).

Отдельные результаты работы были использованы рядом коммерческих предприятий и внедрены в учебный процесс ФГАОУ ВО «Российский университет дружбы народов» (г. Москва).

Структура и объем диссертации обусловлены целью, задачами и логикой проведенного исследования. Работа состоит из введения, трех глав, последовательно раскрывающих понятие, сущность и особенности исследуемых проблем, а также заключения, библиографического списка и приложений. Список использованной литературы включает 185 наименований.

По теме опубликовано 18 научных статей, общим объемом 16 п.л., авторский объем – 15 п.л., в том числе 8 статей в рецензируемых научных журналах, рекомендованных ВАК Министерства науки и высшего образования РФ.

ОСНОВНЫЕ ПОЛОЖЕНИЯ ДИССЕРТАЦИОННОЙ РАБОТЫ, ВЫНОСИМЫЕ НА ЗАЩИТУ

Наиболее важные результаты, отражающие научную новизну исследования, выполнение поставленных в работе задач, заключаются в следующем:

1. Выявлен и обоснован динамический характер рискового события, заключающийся в том, что рассматриваемая категория учитывает все этапы возникновения и развития риска (статическую, пассивную динамику, активную динамику), что обуславливает комплексный характер реализации политики риск-менеджмента на предприятии.

В современных условиях задача управления рисками состоит в решении проблемы, связанной с необходимостью максимизировать вероятность реализации положительного результата при одновременном ограничении отрицательного аспекта влияния конкретного риска предприятия.

В диссертации проведен анализ эволюции подходов к определению, оценке и управлению рисками с точки зрения различных теорий.

Для повышения эффективности управления и снижения эффекта кумуляции рисков в деятельности предприятия предложено осуществлять оценку рисков на ранних стадиях, максимально учитывая генезис и особенности факторов риска.

В диссертации проведен сравнительный анализ парадигм развития управления риском в зависимости от интеграции риск-менеджмента в систему управления предприятием.

Таблица 1 - Сравнительный подход к оценке парадигм

Традиционная парадигма	Интегративная парадигма
Дифференцированный риск-менеджмент: каждое подразделение самостоятельно управляет риском в соответствии со своими функциями. Финансовая служба, планово-экономический и ревизионный отделы, кадровая служба.	Интегративный, объединенный риск-менеджмент: управление рисками координируется высшим руководством; каждый сотрудник фирмы принимает риск-менеджмент как часть своей работы.
Риск-менеджмент «от случая к случаю»: управление рисками осуществляется по необходимости, определяемой менеджментом	Непрерывный риск-менеджмент: процесс управления рисками непрерывен, достаточен и четко управляем.
Организационный риск - менеджмент: касается страховых и финансируемых рисков.	Расширенный (зрелый) риск-менеджмент: рассматривает все категории риска и формирует возможности их организации.

Источник: составлено автором

В ходе анализа ключевых свойств отраслевых рисков предприятий были выявлены специфические динамические характеристики рисков, для которых предложено авторское определение:

- Трансформация риска – особенность, связанная с переходом и слиянием или замещением характерных признаков риска, вызванных эффектом технического и экономического развития;

- Мутация риска – особенность, при которой характеристики конкретного риска изменяются под влиянием других рисков и приобретают их квалификационные признаки;

В настоящее время отмечается необходимость развития особых управленческих компетенций, направленных на активную работу с рисками предприятий. В работе предложена трактовка понятия администрирование рисков как комплекса мероприятий, включающих в себя действия, направленные на: а) изменение конфигурации риска – его классификационных признаков и направленности воздействия на структурные и функциональные элементы производственно-экономической системы; б) редактирование архитектуры риска – изменение ключевых элементов – факторов риска и их сочетание с целью управления развитием рискового события в приемлемых для предприятия по количественным параметрам и комфортных по качественным показателям границах; в) моделирование рисковой ситуации – искусственное контролируемое развитие рисковой ситуации с целью получения сведений о процессах протекания и выявления деструктивных воздействий на текущую и перспективную деятельность предприятия.

Наиболее актуальным с точки зрения автора становится направление в риск-менеджменте, связанное с изучением динамики развития и протекания рисков, и комплексной оценки последствий их реализации. В диссертации сформулировано определение динамического риска – особой категории риска, процессы зарождения и развития которого: а) имеют ярко выраженную детерминированность; б) не поддаются традиционным способам обнаружения и

анализа, и могут быть идентифицированы и оценены эмпирическими или творческими методами, с использованием специальных технологий и инструментов. Динамический риск обуславливается глобальными изменениями в мировой экономике, давлением на цены в ключевых сегментах, ускоряющимся ростом нестабильности на ресурсных рынках, политической напряженности, усложнением межгосударственных отношений и другими факторами, влияющими на перспективы и условия реализации самых негативных последствий.

В диссертации сформулировано, что динамическое управление риском – это комплекс мер, направленных на изменение характеристик риска с учетом динамических особенностей его зарождения, развития и реализации в рисковое событие с целью недопущения неблагоприятных последствий для устойчивости и управляемости экономических процессов предприятий, или реализации рискового события в пределах расчетных и безопасных экономических значений.

Динамическое управление рисками должно осуществляться следующим образом – механизмы оценки и управления должны быть настроены не на подавление деструктивного эффекта рисков (воздействие на риск), а на активное управление процессом формирования и развития рисков в определенное событие с рассчитанными последствиями. Таким образом расширяется горизонт управления рисками с тактического или стратегического уровня до комбинированного, смешанного. При активном управлении необходимо учитывать индивидуальный рисковый профили предприятия.

2. Обоснован теоретико-методический подход к организации риск-менеджмента, состоящий в совокупности управленческих решений менеджмента предприятий, ориентированных на гармонизацию разнонаправленных интересов стейкхолдеров, и учитывающих динамический и многофакторный характер рискового события. Предложена авторская группировка подходов к организации управления рисками предприятий, позволяющая на этапе разработки комплекса анализа, оценки и управления рисками определить уровень текущего состояния риск-менеджмента и перспективы дальнейшего развития.

В ходе исследования предложен способ ранжирования рисков, позволяющий определить место каждого из них в общей хозяйственно-экономической системе предприятия, позволяющий разрабатывать соответствующую систему приемов реагирования и управления.

Таблица 2 – Ранжирование рисков по вероятности и значимости

Рейтинг	Вероятность	Влияние
(Незначительный)	0-0,5% - Риск	Минимальные потери. Минимальные отклонения

тип А)	практически невозможен	от планов и в процессах. Моментальное восстановление
(Незначительный тип Б)	6-20% - Возникновение риска слабое	Небольшие потери. Отклонения от планов и в процессах. Минимальное влияние на репутацию. Низкая стоимость восстановления
Существенный	21-50% - Возможность возникновения риска	Значительные потери времени и ресурсов. Существенное влияние на процессы. продолжительный эффект реализации риска. Стоимость восстановления - высокая
Критический	51-80% - Вероятность риска большая	Существенные потери. Критическое влияние на стоимость продукции и услуг, качество и репутацию. Восстановление дорогое и долгосрочное
Катастрофический	> 81% - Риск неизбежен	Тяжелые потери. Катастрофическое влияние на хозяйственную деятельность, репутацию, финансовую устойчивость. Дорогое, долгосрочное восстановление (в самых тяжелых случаях - восстановление невозможно)

Источник: составлено автором

Предложенный метод позволяет оценивать риск следующим образом: если известно место и тип риска, но точно не определено время его реализации – риск находится в зоне «относительного комфорта», если фактор времени отчетливо проявляется – риск переходит в стадию события и развивается интенсивно. Таким образом, различное сочетание факторов приводит в одном случае к формированию риска, в другом – к развитию рискового события.

Схематически динамика формирования факторов риска в рисковые события имеет вид:

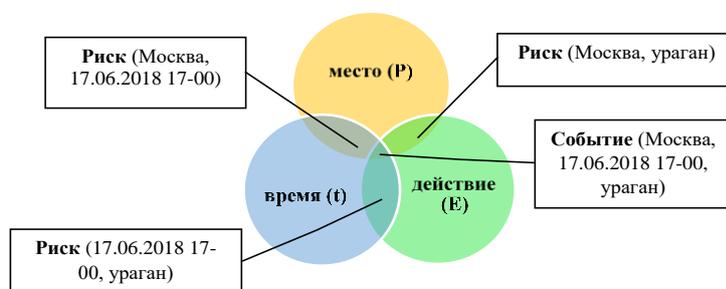


Рисунок 2 - А) Неуправляемый риск.

Источник: составлено автором

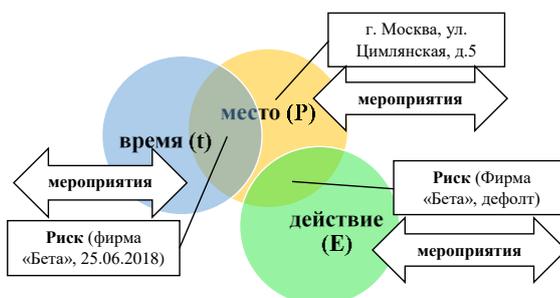


Рисунок 3 - Б) Управляемый риск.

Источник: составлено автором.

Определено, что рисковый профиль предприятий под воздействием дестабилизирующих факторов, в силу своей специфики, в большей степени характеризуется как силой воздействия на менеджмент и экономику предприятия, так и интенсивностью возникновения, проявления и реализации рисков. Совершенствование управленческой компетенции, способной принимать и реализовывать нестандартные решения, гибко и динамично менять стратегию и тактику поведения, позволит максимально реализовать творческий потенциал системы управления предприятия.

Также выявлено, что рисковые ландшафты промышленных предприятий и финансовых организаций, сервисных компаний в современных условиях становятся более масштабными, а колебания (вариативность, турбулентность) рисков – более динамичными. Это проявляется главным образом в постоянном смешивании, переходе факторов риска из одного вида в другой, при котором происходит истончение граней приемлемого понимания типов рисков, усложняется их идентификация и оценка.

Таблица 3 - Матрица динамического управления рисками предприятия

Подход к оценке	Статистический Актуарные расчеты	Анализ и мониторинг Стресс- тестирование	Творческий Сценарный анализ Прогнозирование Моделирование
Динамическое состояние риска	Инструменты управления Риском		
Статический	Страхование, Резервирование, Включение расходов на риск- менеджмент в цену продукции (ценообразование)	–	–
Пассивный динамический	+	Количественная оценка, Управление издержками, Дробление и передача риска Коррекция риск- политики	□–
Активный динамический	+	+	Пересмотр параметров риск- аппетита. Коррекция стратегии. Воздействие на активную деловую среду: Юридические, Экономические, Политические меры

Источник: составлено автором

В практиках риск-менеджмента для визуализации уровня риска предприятия и последующей разработки управленческих решений, составляется тепловая карта рисков предприятия, отражающая степень значимости сочетания факторов риска на динамику развития события.

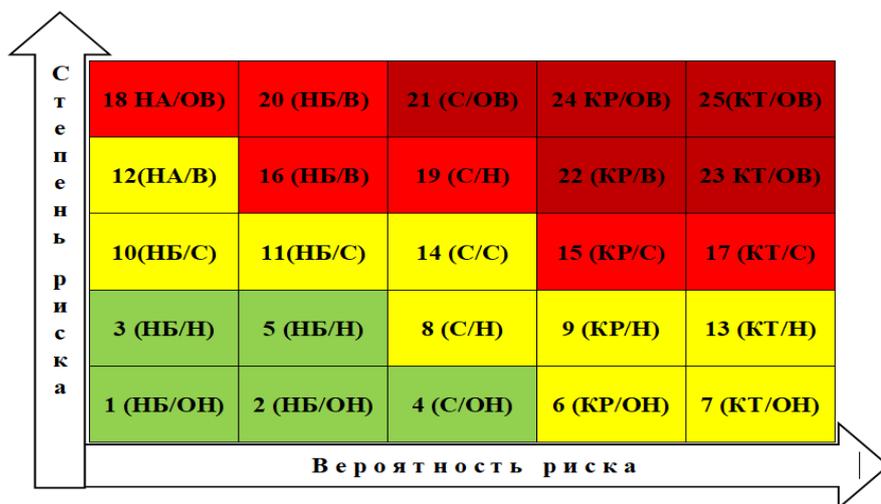


Рисунок 4 - Тепловая карта рисков предприятия.

Источник: составлено автором

Для получения полной картины динамических возможностей управления рисками в диссертации предложено делать акцент на специфическом показателе толерантности к риску – риск-аппетите предприятия.

Вероятность, P

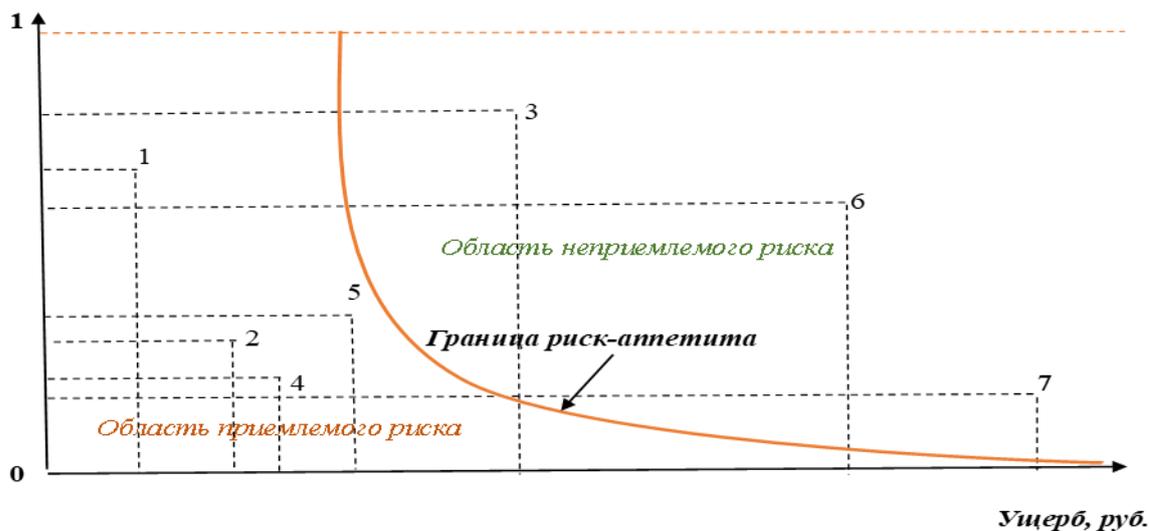


Рисунок 5 – График толерантности к риску (риск-аппетит предприятия).

Источник: Составлено автором

Подходы к управлению рисками предложено объединить в три рабочие группы:

1. Формальная группа (базовые подходы) Basic;
2. Стандартная группа (статические подходы) Standard;
3. Прогрессивная группа (динамические подходы) Improvements Dynamic.

Таблица 4 – Группы подходов к организации управления рисками предприятий

Группа	Характеристики	Преимущества	Недостатки
Формальная, Basic	Система контроля и управления риском, строится на выполнении формальных требований закона, регулятора или заказчика. На предприятии отсутствует философия управления риском, руководство не заинтересовано в «лишних» тратах на сбор статистики и составление программы риск-менеджмента. Применяемые инструменты – тривиальные, не адаптированные. Применяется шаблонный (типовой) подход к выбору инструментария и методики его применения.	При достаточном потенциале роста тарифа или цены на товары и услуги все издержки и потери при реализации риска компенсируются за счет добавочной стоимости и дополнительной прибыли. Расходы на риск-менеджмент в данном случае минимальны.	Уровень угроз полностью неизвестен, статистика по рискам и событиям самостоятельно не ведется, динамика рискового потока не отслеживается. Расходы на компенсацию убытков, потерь, а также на страхование рисков стремятся к максимуму.
Стандартная, Standard	Большая часть присущего риска дробится, распределяется, компенсируется на ранних стадиях зарождения и проявления деструктивных факторов, а также продается на более выгодных условиях остаточный риск. Система контроля рисков и предупреждения наступления рисков событий имеет достаточную зрелость и оснащена необходимым инструментарием, но не достаточна для эффективного противодействия сложным рискам, со значительной деструктивной динамикой и обладающим свойствами «адаптация» и «мимикрия».	Затраты на риск-менеджмент компенсируются за счет роста доходов, обеспеченных повышением качества управления. Большинство деструктивных факторов риска предприятия идентифицировано и нейтрализовано. За счет применения большего маневра в бизнес-процессах реализуются новые конкурентные преимущества.	За счет передачи функции риск-менеджмента на аутсорсинг, контроль рисков осуществляется на непостоянной («время от времени») основе.
Прогрессивная Improvements Dynamic.	Функции оценки, анализа рисков управления рисками не находятся в противодействии или взаимозависимости (соблюдается баланс интересов). На предприятии достигнут баланс «контроль – риск». Риски известны, просчитаны, взвешены, нейтрализованы или минимизированы. Достигнуты максимальные показатели вовлеченности в процесс и понимание значимости управления рисками всех работников предприятия.	Максимальные условия обеспечения защищенности, безопасности и непрерывности ключевых процессов. Система менеджмента предприятия эффективна за счет обеспечения равномерного распределения функций управления, контроля и мониторинга.	Создание и поддержание системы на работоспособном уровне финансово и ресурсно-затратно.

Источник: составлено автором

Предложенная в диссертации классификация позволяет менеджменту предприятия более эффективно и динамично выстраивать работу по управлению рисками предприятия в зависимости от текущих возможностей, перспектив и условий – рискового профиля предприятия. Таким образом, возможно достижение более высокого уровня экономической эффективности риск-менеджмента, основными задачами которого является сохранение акционерной (рыночной) стоимости компании и обеспечение непрерывности бизнес-процессов.

3. Разработана креативная (творческая) модель динамического управления рисками предприятия, базирующаяся на принципах «трех линий защиты», отличительной особенностью которой является модульность, позволяющая синхронизировать оценку внешней среды предприятия, постановку целей развития и выявление потенциальных рисков событий, реализация которой позволяет осуществлять текущий и итоговый мониторинг рисков и превентивно реагировать на рисковое событие с помощью соответствующего уровню риска инструментария.

Разработанные концептуальные положения комбинированного управления рисками предприятий включают уточненные критерии формирования риск-менеджмента предприятий с учетом зрелости и гибкости общей системы управления. На их основе предложены: 1) методический аппарат управления рисками предприятия, предполагающий глубокую интеграцию функций контроля, аудита и управления рисками в общую систему управления; 2) модифицированные инструменты динамической оценки рисков предприятий, позволяющие эффективно управлять рисками предприятия на всех стадиях жизненного цикла и более качественно решать задачи повышения акционерной и рыночной стоимости компании, совершенствования системы управления и повышения эффективности производственных и бизнес-процессов.

Опираясь на допустимость многообразия взглядов и способов принятия решений в менеджменте, в диссертации предложен творческий (креативный) подход при разработке методов организации риск-менеджмента предприятия наукоемкой отрасли, основанный на метапредметности в познании.

В основе метода – условие, что предприятие существует в определенной активной среде и со временем накапливает кинетический экономический потенциал, который преобразуется в особую «экономическую энергию предприятия». Символически экономическую энергию предложено представить как результат произведения массовых и скоростных параметров m и s ¹:

$$E = ms, \quad (1)$$

где E – кинетический потенциал предприятия («экономическая энергия»);

¹ Применение физических законов в общественной (экономической) деятельности на современном этапе развития общества оправдано и закономерно, в том числе и с точки зрения синергии. Такие допущения, в частности, описаны в книге Джеймса Трефила «200 законов мироздания». Пер. с англ.–Москва: Гелеос, 2007.– 744с.). Также, такой подход соответствует экономфизике – науке в которой применяется методология физики к анализу экономических данных.

m – «экономическая масса» применяемых мер и средств;
s – «экономическая скорость» принятия перечисленных выше мер, характеризующая динамику и гибкость риск-менеджмента.

Значение **m** формируется как сумма количественных показателей Q_1 , накапливаемых предприятием за время **t**:

M_{кпр} – капитал и резервы фирмы;

M_{ос} – основные средства и активы (материальные и нематериальные);

M_{пас} – сумма пассивов, обязательств (отрицательный показатель);

M_{без} – затраты на безопасность (физическую, технологическую, ИТ и пр.).

$$m = \sum_{Q_1}^t (M_{кп}; M_{акт}; M_{пас}; M_{без}; \dots M_n) \quad (2)$$

Значение **v** имеет вид суммы качественных показателей Q_2 , также накопленных за время **t**:

S_{лк} – показатель ликвидности активов;

S_{пр} – время реагирования принятия управленческих решений;

S_{восст} – время восстановления деятельности (операционной, хозяйственной, научно-исследовательской и пр.)

S_м – зрелость и гибкость менеджмента, управляемость предприятия.

$$s = \sum_{Q_2}^t (S_{лк}; S_{пр}; S_{восст}; S_m; \dots S_n) \quad (3)$$

Необходимо учитывать, что для соблюдения законов физики, показатель **s** подразумевается как квадратическое выражение (s^2).

Таким образом получены две потенциальные модели организации риск-менеджмента предприятия:

1. Модель, основанная на концентрации сил и средств при построении системы защиты от рисков – «Массовая», характерная для крупных холдингов, корпораций, предприятий «старого» типа, производящих узконаправленную продукцию;

2. Модель, основанная на динамике и гибкости применения инструментов управления рисками – «Скоростная», характерная для предприятий нового типа, имеющих модульную или свободную внутреннюю структуру, особую, максимально диверсифицированную систему управления.

В разработанный комплекс управления рисками включены аналитические инструменты, которые действенны в различных динамических условиях и обеспечивают соблюдение экономического и функционального баланса «контроль – риск»:

- метод математического прогнозирования и оценки рисков на основе принципов «Опоры на собственные силы»;

- метод многокритериальной оценки риска;

- метод, основанный на принципе разнообразия У. Эшби;

- метод, основанный на многофакторных Z-моделях;

- метод «Древо событий», позволяющий составить полную картину по количественным и качественным показателям и установить причинно-следственную связь факторов риска и рискового события;

- креативные (творческие) методы, которые позволяют разыгрывать различные сценарии развития той или иной рискованной ситуации и разрабатывать соответствующие меры реагирования и воздействия.

В качестве доказательства преимущества активного динамического подхода, в диссертации рассмотрена фундаментальная логика управления рисками предприятия, суть которой состоит в развитии на предприятии особого качества – преодоления порогового уровня чувствительности к управлению как результата организационной инерции, накопленных и устоявшихся привычек и традиций в организационной культуре предприятия. Развитие этого качества в новую компетенцию позволит удерживать баланс «контроль-управление» на приемлемом, с точки зрения затрат, и эффективном, с точки зрения устойчивости к риску, уровне.

4. Предложена методика повышения эффективности риск-менеджмента предприятия с учетом качественных и количественных критериев в контексте выделения особого качества деятельности предприятия – экономической энергии, что позволяет рационально использовать экономический и управленческий потенциал по двум основным направлениям («массовому» и «скоростному»).

В качестве инструмента оценки рисков, учитывающего статические и динамические параметры рисков и состояния внешней и внутренней активной среды предприятия, предложен комбинированный метод, позволяющий осуществлять мультифакторную многокритериальную оценку всех выявленных ранее, актуальных на текущий момент, возможных, прогнозируемых и искусственно моделируемых – еще никогда не проявлявшихся, но потенциально возможных рисков. В основу метода положен принцип необходимости понимать генезис, сущность, динамику, особенности и возможные трансформации факторов риска как в процессе их естественного развития, так и под влиянием мер воздействия. Предложено совершенствовать систему управления рисками предприятия через интеграцию в нее элементов системы – внутреннего контроля, аудита и риск-менеджмента по двум направлениям:

1) Как структурной системы управления.



Рисунок 6 – Структура управления рисками предприятия.

Источник: составлено автором

2) Как комплекса мер и приемов управления.

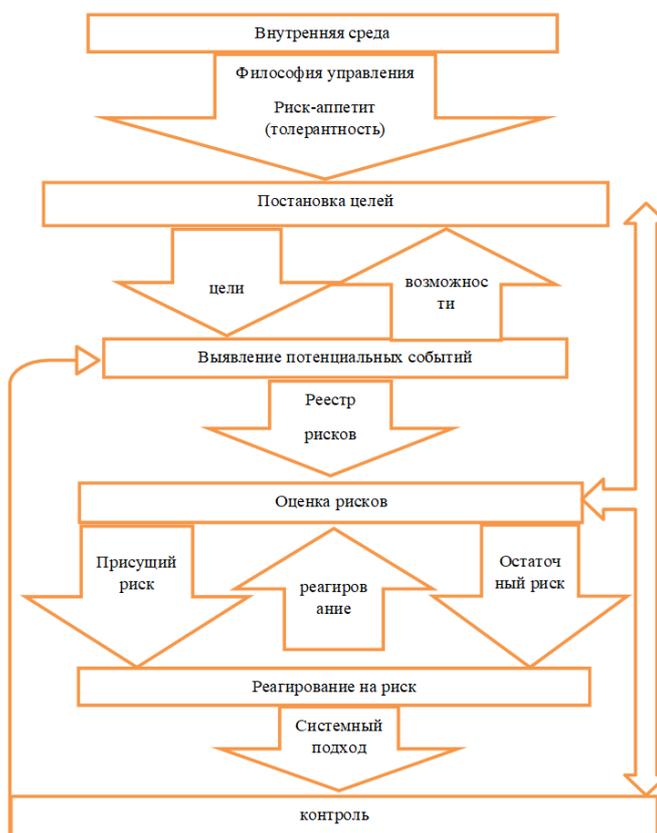


Рисунок 7 – Система управления рисками предприятия.

Источник: составлено автором

Разработаны положения интегративного риск-менеджмента базирующиеся на следующих принципах:

- целостное исследование рискового ландшафта организации,
- выявление актуального риск-профиля как единого комплекса,
- управление этим комплексом при помощи новой общекорпоративной стратегии.

Предложенный подход к управлению рисками основывается на предложенном в диссертации принципе, что любой риск может быть благоприятен там и тогда, где и когда сам уровень угрозы (потери) соизмерим с уровнем выгоды (дохода). Это позволяет осуществлять как управление процессами выявления и анализа возможных рисков предприятия, так и активно менять архитектуру рисков, то есть непосредственно участвовать в создании или редактировании условий, среды, характеристик и свойств факторов риска, максимально контролировать и управлять жизненным циклом определенного рискового события от зарождения до реализации.

С учетом степени интеграции подсистемы управления риском в менеджмент предприятия, получаем позитивный эффект – парирование и минимизацию более сложных с позиций управляемости и экономических последствий рисков за счет перемещения рискового потока в контролируемое русло или допускаем реализацию риска в приемлемых, просчитанных значениях, безопасных для финансовой устойчивости и управляемости предприятия, исключая опасную кумуляцию последствий.

В диссертации выделены два стратегических направления динамического управления рисками:

- *Пассивный метод* предполагает реагирование на риск и организацию процессов управления риском в реальном времени, с использованием современных инструментов и технических средств.

- *Активный метод* является более наукоемким и более прогрессивным и предполагает приложения сил и средств, воздействующих не на риск, а на среду и условия формирования и активного воздействия риска, на факторы, которые порождают угрозы и перспективы.

При комплексном управлении рисками предприятия необходимо добиваться выполнения условия, что динамический риск-менеджмент должен реализовываться не как однократный акт, а как долгосрочный, непрерывный процесс.

Предложен модульный подход к организации риск-менеджмента предприятия в соответствии с целями, задачами и возможностями предприятия.

Разработаны принципы, на базе которых должна строиться система управления рисками предприятий:

1. Выживаемость.
2. Приемлемый уровень «беспокойства».
3. Стабильность доходов.
4. Непрерывность бизнес-процессов.
5. Целесообразный темп устойчивого роста предприятия.
6. Социальная ответственность бизнеса.
7. Удовлетворение ограничений внешнего характера.
8. Экономичность.

Таким образом, менеджменту компании представляется возможность осуществлять управление рисками предприятия комплексно, с наибольшим практическим эффектом, адекватным формирующимся событиям и цене последствий их реализации.

5. Обоснован метод динамического управления рисками предприятия «по правилам Керлинга», заключающийся в применении комплексных подходов и моделей управления факторами неопределенности и риска посредством воздействия на риски внутренней и внешней среды через искусственное редактирование характеристик рисков, формирование рискового потока и рискового профиля предприятия под индивидуальные особенности и комплексные возможности (финансовые, технические, интеллектуальные и пр.) отдельного предприятия.

Отличительной особенностью метода «По правилам Керлинга» является возможность в динамике и в реальном времени регулировать процессы управления рисками предприятия. Регулирование предлагается осуществлять следующим образом:

1. Ступенчатое воздействие (единичное) – единовременное усилие, направленное на решение комплекса задач по уже рассчитанным значениям.

$$X(t)=L(t)$$

$$x(t)=\begin{cases} 0, & \text{при } t < 0 \\ 1, & \text{при } t \leq 0 \end{cases} \quad (4)$$

2. Импульсное воздействие $X(t)=\sigma(t)$

$$\sigma(t)=\begin{cases} \infty, & \text{при } t = 0 \\ 0, & \text{при } t \neq 0 \end{cases} \quad (5)$$

3. Периодическое воздействие.

Предложены два базовых (рабочих) варианта решения поставленных менеджментом задач управления риском: статический и динамический, а также два метода противодействия: количественный и качественный, в соответствии с предложенной символической формулой (1).

При использовании *статической программы* риск-менеджмента все мероприятия, направленные на минимизацию риска, выполняются до начала операционных действий. Результат управления рисками в данном случае оценивается по завершении полного цикла хозяйственной операции (проекта, или выполнения работ). Соответственно, коррекция возможна только на основании собранной статистики и обработанной информации. Данный модуль управления соответствует группе подходов, «Формальная» (базовые подходы), Basic, охарактеризованных в диссертации.

Динамическая программа, помимо обязательного применения процедур, статической программы, включает активное использование мер и средств по координации, исходя из возникающих в динамике особенностей изменения внешних и внутренних факторов и предполагает незамедлительное реагирование на изменение контрольных параметров и принятие соответствующих решений. Таким образом, достигается состояние системы, при котором большинство факторов риска, формирующих развитие рискового события, находятся под постоянным контролем. Данный модуль соответствует параметрам группы подходов «Стандартная» (статические подходы), Standard.

Активная динамическая программа управления риском фирмы заключается в том, что все меры направлены на редактирование условий непосредственно внутри активной среды, в которой происходят все процессы. Таким образом, данный модуль соответствует группе подходов «Прогрессивная» (динамические подходы), Improvements Dynamic.

В качестве вспомогательного модуля комбинированного метода, применяется математическая модель контроля параметров активной среды, влияющих на вероятностные характеристики рисков. Обозначим зависимость параметров X от времени t через:

$$X(t)=(x_1, x_2, x_3, \dots, x_n) \quad (6)$$

Вектор, зависящий от времени, описывает динамику факторов активной среды, формирующих риск. Параметры активной среды в данном случае, имеют разнообразную размерность и различную природу, поэтому для применения математической модели нужно привести эти параметры в единую шкалу. Допустим, что компоненты вектора, описывающего параметры внешней среды, удовлетворяют следующим соотношениям:

$$0 \leq x_i(t) \leq 1, \quad i=1, 2, 3, \dots, N \quad (7)$$

Нулевое значение параметра активной среды указывает на отсутствие влияния этого параметра на риск. Значение, равное единице означает, что данный параметр имеет максимальное влияние на факторы риска. Учитывая неоднородность среды и различные аспекты ее существования, для математического моделирования используются импульсные значения параметров внешней среды, которые возникают исключительно в определенный момент времени:

$$x_i(t) = \begin{cases} 0, & 0 \leq t \leq t_i \\ 1, & t = t_i \\ 0, & t > t_i \end{cases} \quad (8)$$

Такие параметры могут соответствовать определенным событиям, формирующимся или происходящим в активной среде, например, проведения различного рода опытно-конструкторских работ, испытаний техники, освоения новых технологий и т.п. Показательно, что момент протекания этих событий совпадает по времени с зарождением и развитием специфического риска, характерного именно для данных параметров и условий.

Функции параметров активной среды могут иметь ярко выраженную временную зависимость, то есть являются как детерминированными, так и случайными – со свободными векторами и траекториями распространения.

Влияние параметров активной среды на зарождение и формирование рискового потока описаны с помощью пороговых функций следующего вида:

$$\varphi(x_{i1}(t), x_{i2}(t), x_{i3}(t), \dots, x_{iz}(t)) = \begin{cases} 0, & x_{i1}(t) + x_{i2}(t) + x_{i3}(t) + \dots + x_{iz}(t) < A \\ 1, & x_{i1}(t) + x_{i2}(t) + x_{i3}(t) + \dots + x_{iz}(t) \geq A \end{cases} \quad (9)$$

При расчете интенсивностей возникновения рисков предложено использовать следующие функции:

$$u_i(t) = Q(t, \eta_1(x_{i1}(t), x_{i2}(t), \dots, x_{iL_1}(t)), \dots, \eta_J(x_{i1}(t), x_{i2}(t), \dots, x_{iL_J}(t))) \quad (10)$$

Таким образом, функции интенсивности рисков формируются благодаря различным комбинациям пороговых функций, зависящих от изменения параметров активной среды.

Использование пороговых функций позволяет не только проводить мониторинг активной среды для анализа возможных рисков, но и фиксировать моменты времени, когда интенсивность влияния факторов риска резко возрастает. Этот метод анализа полезен для выявления новых рисков, и включается в качестве компонента (модуля) комбинированного метода в дополнение к логической и имитационной моделям.

В диссертации разработаны и предложены методические рекомендации по управлению рисками для предприятий РКП «Оценка рисков и угроз национальной безопасности, влияющих на реализацию космической деятельности России».

Алгоритм разработки методического обеспечения имеет вид:



Рисунок 8 - Логическая схема управления рисками предприятия.
 Источник: составлено автором



Рисунок 9 -Управление рисками предприятия (на примере предприятия РКП).
 Источник: составлено автором

Рекомендации также направлены на развитие перспективной творческой компетенции высшего и исполнительного руководства предприятия «Создатель (творец) риска» («risk creator») вместо принятой в настоящее время «Владелец риска» («risk holder»).

В заключении диссертационной работы обобщены основные итоги проведенного исследования и сформулированы следующие результаты:

1. Определено, что отличительной особенностью современных рисков, оказывающих влияние на деятельность предприятий наукоемких отраслей, является их сложная идентифицируемость, количественная и качественная оценка, так как факторы риска динамично изменяются в пространстве и времени, тем самым воздействуя на формирование и характер развития рискованных событий.

2. Выделены и проанализированы основные этапы эволюции

инструментария оценки и управления рисками, предложена классификация рисков предприятий, методов и инструментов их оценки.

3. Выявлены недостатки существующих подходов и ограниченность применяемых инструментов управления динамическими рисками. Обосновано предложение усовершенствовать инструментарий оценки и управления рисками.

4. Обоснована необходимость модернизации системы управления путем глубокой интеграции функций внутреннего аудита и риск-менеджмента во все подсистемы управления предприятием. Предложен комплекс методических подходов к организации деятельности по оценке и управлению рисками активной деловой среды.

5. Разработаны методические рекомендации по организации деятельности системы управления рисками на предприятиях наукоемких отраслей, ориентированные на совершенствование качества оценки и управления рисками в условиях нестабильности и неопределенности внешних и внутренних факторов среды.

ПУБЛИКАЦИИ ПО ТЕМЕ ДИССЕРТАЦИИ

Статьи в рецензируемых журналах, рекомендуемых ВАК РФ

1. Ванюрихин Ф.Г. Проблема риска в задачах управления летательными аппаратами. / Г.И. Ванюрихин, Ф.Г. Ванюрихин // Научный вестник МГТУГА – 2003. – № 58. – С.7-17. – 1,3п.л., (доля автора 0,65п.л.).

2. Ванюрихин Ф.Г. Управление финансово-экономическими рисками в условиях глобализации. /Ф.Г. Ванюрихин // Научный вестник МГТУГА, серия Менеджмент, Экономика, Финансы. – 2005 – № 88. – С.110-115. – 0,8п.л.

3. Ванюрихин Ф.Г. Финансовое управление в ГА в условиях глобализации. /Ф.Г. Ванюрихин // Научный вестник МГТУГА, серия Экономика, Общество, Образование. – 2006 – № 100. – С. 121-124. – 0,7п.л.

4. Ванюрихин Ф.Г. Интегрированный риск-менеджмент: роль и значение в менеджменте. /Ф.Г. Ванюрихин // Экономика. Предпринимательство. Окружающая среда. (ЭПОС) – 2008 – № 4 (36). – С. 76-81. – 0,8п.л.

5. Ванюрихин Ф.Г. Роль и место страхования в системе управления рисками в гражданской авиации РФ. /Ф.Г. Ванюрихин // Научный вестник МГТУГА – 2009 – № 110. – С.105-111. – 0,9 п.л.

6. Ванюрихин Ф.Г. Антикризисное управление персоналом на современном производственном предприятии. /Ф.Г. Ванюрихин, О.В. Писаренко // Бизнес в законе. – 2016. – № 6. – С. 221-223. – 0,6п.л., (доля автора 0,3п.л.).

7. Ванюрихин Ф.Г. О совершенствовании системы управления рисками предприятий в условиях современных внешнеэкономических вызовов. /Ф.Г. Ванюрихин // Экономика и управление: проблемы решения. – 2019 – Вып.2. – том 8 (86). – С.126-130. – 0,7п.л.

8. Ванюрихин Ф.Г. Новые задачи в динамическом управлении рисками предприятий наукоемких отраслей. /Ф.Г. Ванюрихин, С.В. Карабахчиев // Управление экономическими системами. Электронный научный журнал. (УЭКС) – 2019. – № 7. – 1,3п.л., (доля автора 0,65п.л.).

Монографии

9. Ванюрихин Ф.Г. Интеграционные процессы в обществе и управление рисками. Актуальные проблемы современной социологии и политологии: Монография. // Под общей редакцией Л.Н. Панковой – М.: КДУ. – 2006. – С.48-58. – 1,2п.л.

Статьи, опубликованные в других научных изданиях

10. Ванюрихин Ф.Г. Профессиональная ответственность руководителя предприятия. /Ф.Г. Ванюрихин // Всероссийский студенческий конкурс-конференция «Новые горизонты менеджмента» (с международным участием) Сборник докладов. – 1999. – Тула, ТулГУ. – С.111-116. – 0,8п.л.
11. Ванюрихин Ф.Г. Роль и значение интегрированного риск-менеджмента в экономике. /Ф.Г. Ванюрихин // Научно-техническая конференция «Гражданская авиация на современном этапе развития науки, техники и общества». – 2006. – г. Москва. МГТУГА. – С. 31-36. – 0,8п.л.
12. Ванюрихин Ф.Г. Управление риском как динамическая задача. /Ф.Г. Ванюрихин // Научный вестник МГУ им. М.В. Ломоносова. – 2010. – С. 3-6. – 0,4п.л.
13. Ванюрихин Ф.Г. Задачи и перспективы привлечения частного капитала в космическую промышленность России: Частно-государственное партнерство как инструмент коммерциализации космической деятельности. /Ф.Г. Ванюрихин, В.А. Красавина //Современные тенденции развития науки и технологий. – 2016. – Вып. 6-3. – С. 41-46. – 0,8п.л. (доля автора 0,4 п.л.).
14. Ванюрихин Ф.Г. Глобализация и проблемы неравной конкуренции /Ф.Г. Ванюрихин // Университетские чтения: Сборник статей /Редкол: Воронкова Л.П., Бажуков В.И. – М.: МАКС Пресс. – 2005. – Вып.10 – С. 3-8. – 0,6п.л.
15. Ванюрихин Ф.Г. Управление рисками при планировании и производстве наукоемкой продукции ракетно-космической промышленности. Организационная модернизация риск-менеджмента отрасли. / Ф.Г. Ванюрихин // Сборник материалов Первой Всероссийской научно-практической конференции «Проблемы и перспективы экономического развития ракетно-космической отрасли промышленности на период до 2030 года и ее ресурсное обеспечение» (РУДН, 21-23 ноября 2013года). – М.: Издательство «МАКД», 2014. – Т.2. – С. 151-155. – 0,7п.л.
16. Ванюрихин Ф.Г. Риск-ориентированный аудит в наукоемких отраслях экономики – современная трансформация контрольно-ревизионной функции менеджмента. /Ф.Г. Ванюрихин // Современные тенденции развития науки и технологий. – 2016. – Вып. 7-7. – С. 33-42. – 1,1п.л.
17. Ванюрихин Ф.Г. Об оценке конкурентоспособности предприятий ракетно-космической отрасли. /Ф.Г. Ванюрихин, Т.О. Губашева // Вестник «НПО «ТЕХНОМАШ». – 2017-2018. – Выпуск № 4-5. – С. 6-9. – 0,5п.л., (доля автора 0,25 п.л.).
18. Ванюрихин Ф.Г. Задачи совершенствования системы управления рисками предприятий в условиях глобализации и современных внешнеэкономических вызовов. /С.В. Безуглый, Ф.Г. Ванюрихин // Сборник: потенциал роста современной экономики: возможности, риски, стратегии. Материалы V международной научно-практической конференции. Под редакцией А.В. Семенова, М.Я. Парфеновой, Л.Г. Руденко, Новосибирск. – 2018. – С. 1111-1119. –1,1п.л., (доля автора 0,55 п.л.).

Ванюрихин Филипп Геннадьевич (Россия)

Модели и методы динамического управления рисками предприятий

В диссертации в рамках исследования современного состояния риск-менеджмента предприятий были разработаны модели и методы оценки, анализа и управления рисками, а также механизмы совершенствования комплексной системы управления рисками.

Предложены методические и практические рекомендации по организации динамического управления рисками на предприятиях. Применение данных рекомендаций позволит повысить эффективность управления предприятием в условиях нарастающих неопределенностей и рисков, сохранить стоимость компании и ее экономическую устойчивость, а также обеспечить безопасность бизнес-процессов на всех стадиях жизненного цикла.

Vanyurikhin Philip Gennadevich (Russia)

Models and methods of dynamic risk management of enterprises

In dissertation within the framework of research of modern state of risk-management of enterprises models and methods of risk assessment, analysis and management, as well as mechanisms for the modernization of the risk management system were developed.

Methodical and practical recommendations on organization of dynamic risk management at the enterprises are offered. Application of these recommendations will allow to increase efficiency of enterprise management in conditions of increasing uncertainties and risks, to save the value of the company and its economic stability as well as to ensure the safety of business processes at all stages of the life cycle.