

Гусев Дмитрий Сергеевич

аспирант

Демидова Елена Георгиевна

канд. экон. наук, доцент

Новикова Ольга Александровна

канд. экон. наук, доцент

Старооскольский технологический институт им. А.А. Угарова (филиал)

ФГАОУ ВО «Национальный исследовательский

технологический университет «МИСиС»

г. Старый Оскол, Белгородская область

К ВОПРОСУ О СИСТЕМЕ УПРАВЛЕНИЯ РИСКАМИ КОМПАНИИ

Аннотация: статья посвящена вопросу о системе управления рисками компании. Авторами описаны этапы построения вышеупомянутой системы.

Ключевые слова: риск, управление риском, система управления рисками.

Современное промышленное предприятие при формировании системы управленческих решений сталкивается с проблемой возникновения риска. Снижение негативного воздействия невозможно без прогнозирования, анализа и оценки, поскольку функционирование предприятия происходит на рынке в условиях неопределенности. В связи с этим необходимо четко понимать принципы и формировать методические подходы к описанию рисков основных бизнес – процессов: поставка, производство, сбыт.

Новые реалии диктуют применение новых механизмов управления, которые должны быть трансформируемыми, способными изменяться в соответствии с основными бизнес-процессами промышленных предприятий и появлением новых производственных задач, решение которых требует совершенствования системы управления рисками [1].

Классификация рисков позволяет выявить и систематизировать риски по динамике их влияния на объект управления. При построении эффективной си-

стемы управления рисками необходимо выстроить определенную последовательность. Пример такой последовательности представлен в таблице 1 [2].

Таблица 1

Этапы построения системы управления рисками промышленного предприятия на основе анализа динамики их влияния на объект

Классификационный признак								
По этапам осуществления проекта	По уровню экономической системы	Сфера возникновения	Идентификационный признак	Место возникновения	По степени влияния на объект	Степень допустимости риска	По динамике влияния на объект	По возможности страхования
Этап 1	Этап 2	Этап 3	Этап 4	Этап 5	Этап 6	Этап 7	Этап 8	Этап 9
Блок 1 – Идентификация					Блок 2 – Оценка			
Риски прединвестиционного этапа Риски инвестиционного этапа Риски постинвестиционного этапа	Мегаэкономические	Политический, экологический, коммерческий, финансовый и др.	Функционирование экономики в целом	Внешний	Существующий Вероятный	Допустимый Критический Катастрофический	Растущий Снижающийся	Как правило не страхуемые
Риски прединвестиционного этапа Риски инвестиционного этапа Риски постинвестиционного этапа	Макроэкономические	Политический, экологический, коммерческий, финансовый и др.	Риски экономической системы государства	Внешний	Существующий Вероятный	Допустимый Критический Катастрофический	Растущий Снижающийся	Страховый Не страхуемый
Риски прединвестиционного этапа Риски инвестиционного этапа Риски постинве-	Мезоэкономические	Политический, экологический, коммерческий, финансовый, произ-	Формируются на уровне отраслей народного хозяйства	Внешний Внутренний	Существующий Вероятный	Допустимый Критический Катастрофический	Растущий Снижающийся	Страховый Не страхуемый

стиционного этапа		водственный и др.						
Риски прединвестиционного этапа Риски инвестиционного этапа Риски постинвестиционного этапа	Микроэкономические	Экологический, коммерческий, финансовый, производственный, транспортный и др.	Внутрифирменные риски.	Внутренний	Существующий Вероятный	Допустимый Критический Катастрофический	Растущий Снижающийся	Страховый Не страховой

Первый этап построения системы управления рисками необходимо установить на каком этапе реализации находится объект управления.

На следующем этапе происходит группирование рисков по уровню принадлежности экономической системы.

Третий этап построения системы управления рисками представляет собой определение принадлежности уровню экономической системы определенного риска.

Следующие два этапа – это база для оценки рисков, описывающие управляемый объект. Идентификация величины и вектора воздействия рисков осуществляется на основе анализа трендов развития экономической системы каждого анализируемого уровня, то есть трендов динамики макро, мезо – и микроэкономики. Внешние риски, как правило, трудно управляемы и задача риск – менеджмента здесь будет сводиться к минимизации их негативного влияния на управляемый объект.

Применение описанных этапов построения системы управления рисками приводит к выявлению и описанию рисков.

При реализации мероприятий второго блока на первом этапе осуществляется определение вероятности возникновения риска, то есть это уже существующий или только возможный риск. Далее устанавливается степень допустимо-

сти на основе трендовых характеристик экономической системы. Внешние критические и катастрофические риски делают управляемую систему крайне уязвимой и требуют пересмотра стратегических задач, то есть делают проект крайне рискованным и малоинтересным для инвестора, так как влечет за собой возникновение критических и катастрофических внутренних рисков [3; 4].

Список литературы

1. Гусев Д.С. К вопросу управления рисками промышленного предприятия / Д.С. Гусев, О.А. Новикова // *Материалы Семнадцатой Всероссийской научно-практической конференции студентов и аспирантов (20–21 апреля 2020 г.)* / редколлегия: Ю.И. Еременко, Е.В. Ильичева, Л.Н. Крахт, А.А. Кожухов, А.В. Макаров, С.Н. Востокова. – Старый Оскол, 2020. – С. 506–508.

2. Демидова Е.Г. Построение динамической системы управления рисками промышленного предприятия / Е.Г. Демидова, Д.С. Гусев, О.А. Новикова // *Фундаментальные исследования*. – 2020. – №10. – С. 50–55. №2155 перечень ВАК.

3. Langdalen H., Abrahamsen E.B., Selvik J.T. On the importance of systems thinking when using the ALARP principle for risk management. *Reliability Engineering & System Safety*. 2020. Vol. 204. Art. 107222

4. Parhizkar T., Hogenboom S., Bouwer I.U. Data driven approach to risk management and decision support for dynamic positioning systems. *Reliability Engineering & System Safety*. 2020. Vol. 201. Art. 10696414. Valeev S., Kondratyeva N. Risk control and process safety management systems. *Process Safety and Big Data*. 2021. Vol. 7. Pp. 271–294.