



**МИНИСТЕРСТВО НАУКИ И ВЫСШЕГО ОБРАЗОВАНИЯ
РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ**

**МОСКОВСКИЙ ГОСУДАРСТВЕННЫЙ УНИВЕРСИТЕТ
ТЕХНОЛОГИЙ И УПРАВЛЕНИЯ
им. К.Г. Разумовского (ПКУ)**

Библиотека «МГУТУ им. К.Г. Разумовского (ПКУ)»

Дайджест

Оценка рисков в экономике

Москва,

2020

Монографии

БАЗИСНАЯ СИСТЕМА РИСК-МЕНЕДЖМЕНТ ОРГАНИЗАЦИЙ РЕАЛЬНОГО СЕКТОРА ЭКОНОМИКИ

Авторы: Соколов В.Д., Барчуков Алексей Валерьевич

Издатель: ИНФРА-М

Вид издания: монография

Год: 2020

Аннотация

В монографии предложен новый подход к классификации рисков организации и усовершенствована методика их выявления и оценки. Определены теоретические основы базисной системы риск-менеджмента, выявлены основные стороны и лица, принимающие участие в управлении рисками, сформулированы рекомендации, направленные на формирование подразделения по управлению рисками. Предложен новый подход к оценке эффективности базисной системы риск-менеджмента, сформированы методические указания по проектированию внутренних нормативных документов и разработан Порядок по управлению операционными рисками для организаций реального сектора экономики. Издание предназначено для специалистов в сфере риск-менеджмента и может представлять интерес для преподавателей вузов.

<https://new.znaniium.com/catalog/document?pid=1036512>

РИСКИ ФИНАНСОВОЙ БЕЗОПАСНОСТИ

Авторы: Кучеров И.И., Поветкина Н.А., Акопян С.Я., Боженок С.Я. и др.

Издатель: НОРМА

Вид издания: монография

Год: 2020

Аннотация

Монография является второй книгой из трилогии, посвященной изучению правовых аспектов обеспечения финансовой безопасности Российской Федерации. Работа нацелена на формирование комплексного и системного подхода к теоретико-правовой идентификации сущности рисков финансовой безопасности и определению их видовой модификации. Исследуется генезис понятия рисков (философский, теоретико-правовой, экономический, финансовый и др.). Раскрываются проблемы выявления, идентификации и оценки рисков, а также особенности их предупреждения и ликвидации; проводится исследование системы органов, уполномоченных на управление рисками. Уникальность данной работе придает многоуровневый анализ правового регулирования наиболее острых вопросов управления рисками финансовой безопасности — от актов органов местного самоуправления до международных и зарубежных документов. Сохраняя научную преемственность, заложенную в первой книге «Институты финансовой безопасности» (2017), особое внимание авторы уделяют рискам финансовой безопасности

в бюджетной, налоговой и публичной банковской системах, системе валютно-денежного обращения, в таких сферах, как золотовалютные резервы, финансовые рынки, обязательное государственное социальное страхование, обращение драгоценных металлов и драгоценных камней, противодействие легализации (отмыванию) доходов, полученных преступным путем. Для научных работников, практикующих юристов и экономистов, должностных лиц государственных и муниципальных органов, преподавателей, аспирантов, студентов юридических вузов, обучающихся по юридической и экономической специальностям, углубленно изучающих проблемы финансовой безопасности и финансово-правового обеспечения деятельности государства.

<https://new.znaniium.com/catalog/document?pid=1079226>

РЫНКИ КАПИТАЛА И КРИПТОАКТИВОВ: ТРЕНДЫ И ПОВЕДЕНИЕ ИНВЕСТОРОВ

Автор: Михайлов А.Ю.

Издатель: ИНФРА-М

Вид издания: монография

Год: 2020

Аннотация

В монографии представлены закономерности исторической эволюции финансовых теорий цен на активы (усиление субъективности в оценке рисков) и моделей прогнозирования волатильности цен на активы на рынках капитала (учет структурных сдвигов на рынке). Собраны доказательства высокой точности и надежности моделей долгой памяти для прогнозирования волатильности динамики цен для различных классов финансовых активов. Предложены теоретические основы формирования истинной рыночной стоимости цифровых финансовых активов как нового сегмента глобального рынка капитала. Для студентов и преподавателей, а также всех интересующихся вопросами экономики, в частности рынков капитала.

<https://www.elibrary.ru/item.asp?id=41337306>

ОЦЕНКА КОРРУПЦИОННЫХ РИСКОВ КОМПАНИИ

Авторы: Трунцевский Ю.В., Карпович О.Г.

Издатель: ИНФРА-М

Вид издания: монография

Год: 2019

Аннотация

В настоящее время крупные, наиболее активные, в том числе транснациональные, государственные компании и корпорации подлежат дополнительному антикоррупционному регулированию. Такое законодательство становится все более строгим и получает широкое распространение. Деловой мир приобретает глобальный характер, и в этой среде понимание того, как и где организация может столкнуться с

коррупцией, поможет управлять коррупционными рисками. Оценка риска — это базис для развития сильной программы по обеспечению соблюдения законодательных норм. В работе доказана важность проведения эффективной оценки риска и использования ее результатов в деятельности хозяйствующего субъекта. Представлены практические рекомендации и ряд инструментов, способных помочь лидерам бизнеса в выявлении потенциально опасных ситуаций в борьбе с коррупцией в пределах своего предприятия. Предлагается методика системного качественного анализа коррупционных рисков компании с акцентом на улучшение их идентификации. Это поможет организациям в разработке инструмента самооценки, позволяющего отслеживать возникновение новых коррупционных угроз. Для научных работников, практикующих юристов, представителей бизнес-сообщества, преподавателей, студентов и аспирантов юридических вузов и факультетов, а также для всех, кто интересуется антикоррупционным комплаенсом.

<https://new.znaniium.com/catalog/document?pid=1018453>

РИСКИ ОРГАНИЗАЦИИ И ВНУТРЕННИЙ ЭКОНОМИЧЕСКИЙ КОНТРОЛЬ

Автор: Серебрякова Т.Ю.

Издатель: ИНФРА-М

Вид издания: монография

Год: 2019

Аннотация

В монографии освещены концепции внутреннего контроля в целях снижения рисков организации, значение таких функций, как учет и анализ для внутреннего контроля организаций, методологические и методические аспекты внутреннего экономического контроля информационных основ контроля: бухгалтерского учета и анализа. Для специалистов, студентов, аспирантов, докторантов и практических работников, занимающихся проблематикой и организацией внутреннего контроля.

<https://new.znaniium.com/catalog/document?pid=1031520>

ИНСТРУМЕНТЫ ОЦЕНКИ И ОБЕСПЕЧЕНИЯ УСТОЙЧИВОГО РАЗВИТИЯ ОТРАСЛЕЙ РОССИЙСКОЙ ЭКОНОМИКИ

Авторы: Кожевина О.В., Ботаева Б.С., Богачев Ю.С., Гуриева П.К., Пиндер Н.В., Сиротенко М.В.

Издатель: ИНФРА-М

Вид издания: монография

Год: 2019

Аннотация

В монографии представлены результаты научного исследования проблем устойчивого развития отраслей российской экономики. Предложены инструменты многокритериальной оценки устойчивого развития, разработаны направления совершенствования институциональных механизмов, позволяющие реализовать

структурную политику и минимизировать экономические риски. Обоснованы положения динамической устойчивости отраслей и отраслевых комплексов (по ОКВЭД), определены функциональные составляющие модели устойчивого развития отраслей российской экономики. Монография подготовлена по результатам исследований в рамках Государственного задания Финансового университета. Монография рекомендуется специалистам в сфере государственного и регионального управления, стратегического управления экономикой и оценки устойчивости развития отраслей, научным работникам, аспирантам, магистрантам.

<https://new.znaniium.com/catalog/document?pid=1002711>

МЕТОДЫ ЭКОНОМИЧЕСКОЙ ОЦЕНКИ УСТОЙЧИВОСТИ РАЗВИТИЯ ПРЕДПРИЯТИЯ

Авторы: Кукукина И.Г., Климова С.В.

Издатель: ИНФРА-М

Вид издания: монография

Год: 2019

Аннотация

Монография посвящена исследованию проблемы завышенного предпринимательского риска и совершенствованию методов оценки экономической устойчивости предприятия. Экономическая устойчивость предприятия в исследовании авторов рассмотрена с позиции теории заинтересованных сторон и современной методологии оценки предпринимательских рисков через призму непроизводительных затрат и «неработающего» капитала собственников. Предложен комплексный подход к оценке влияния факторов завышенного предпринимательского риска и сохранения экономической устойчивости предприятия в долгосрочной перспективе. Рекомендуется преподавателям вузов, аспирантам, магистрам, руководителям и специалистам аналитических служб.

<https://new.znaniium.com/catalog/document?pid=912419>

МЕТОДЫ УПРАВЛЕНИЯ И ОЦЕНКИ РИСКОВ ПРЕДПРИЯТИЙ В УСЛОВИЯХ КЛАСТЕРА

Автор: Стрельник М.М.

Издатель: Санкт-Петербургский государственный экономический университет

Вид издания: монография

Год: 2018

Аннотация

Монография посвящена проблемам управления рисками и их оценки предприятиями в условиях кластера. Анализируются теоретические и практические аспекты развития кластеров. Рассматриваются взаимосвязь влияния рисков на кластер и участников кластера, методы управления рисками предприятия в условиях кластера.

Обосновывается применение метода Интегральной суммы разностей взвешенных индексов рисков (ISDWIR метод) в качестве метода оценки рисков. Предложены рекомендации управления рисками при разработке стратегии развития кластера, рассматривается обеспечение, необходимое для управления рисками предприятия в условиях кластера. Монография может быть полезна студентам, магистрантам, аспирантам, специалистам в области кластерного подхода развития экономики
<https://www.elibrary.ru/item.asp?id=36306997>

ОЦЕНКА СТОИМОСТИ ПРЕДМЕТОВ ЗАЛОГА В НЕСТАБИЛЬНОЙ ЭКОНОМИКЕ: ПРОБЛЕМЫ И ПУТИ ИХ РЕШЕНИЯ

Автор: коллектив
Издатель: ИНФРА-М
Вид издания: монография
Год: 2018

Аннотация

Книга известных специалистов по стоимостной оценке и корпоративным финансам посвящена одному из наиболее актуальных, но в то же время наименее проработанных аспектов корпоративных финансов и стоимостной оценки — совершенствованию механизма оценки предметов залога в условиях нестабильной экономики. Авторы не только помогают финансистам более глубоко постичь сущность, содержание и принципы функционирования механизма оценки стоимости предметов залога, особенности его действия в условиях нестабильной экономики, но и раскрывают нюансы зарубежного и отечественного опыта работы залоговой службы банка и независимых оценщиков по определению и мониторингу стоимости предметов залога. В книге обоснованы предложения авторов по совершенствованию оценки стоимости предметов залога разных классификационных групп, а также по оптимизации системы взаимодействия коммерческих банков и независимых оценщиков. Работа основана на обширном практическом материале и личном профессиональном опыте авторов. Книга предназначена для оценщиков стоимости, сотрудников залоговой службы коммерческих банков, студентов бакалавриата и магистратуры, аспирантов и докторантов, преподавателей финансово-экономических вузов.

<https://new.znaniium.com/catalog/document?pid=925470>

Учебники

УПРАВЛЕНИЕ РИСКАМИ ОРГАНИЗАЦИИ

Автор: Антонов Г.Д., Иванова О.П., Тумин В.М.
Издатель: ИНФРА-М
Вид издания: учебник
Год: 2020

Аннотация

Рассмотрены вопросы управления рисками, которые могут систематически возникать в хозяйственно-финансовой деятельности организации. Изложено понимание сущности и содержания рисков, процесса управления рисками. Рассмотрены виды рисков, методы оценки рисков и управления рисками. Для студентов, обучающихся по направлениям «Экономика» и «Менеджмент», а также по инженерным и технологическим направлениям вузов, изучающих дисциплины экономико-организационного цикла; для аспирантов, слушателей школ бизнеса и системы повышения квалификации и переподготовки кадров. Может быть полезно преподавателям вузов, работникам предпринимательских структур, руководителям и специалистам предприятий.

<https://www.elibrary.ru/item.asp?id=41597547>

УПРАВЛЕНИЕ БАНКОВСКИМИ РИСКАМИ

Авторы: Бережная Е.В., Зенченко С.В., Сероштан М.В., Бережная О.В.

Издатель: Дашков и К

Вид издания: учебник

Год: 2020

Аннотация

Учебник представляет собой сочетание теории банковских рисков и практики управления ими с учетом действующей нормативно-правовой базы. Особое внимание уделено сущности и классификации рисков, системе управления ими, основным видам частных и комплексных рисков, а также проблемам современного банковского риск менеджмента в российской и зарубежной практике. В практической части учебника приведены методики и расчёт основных показателей оценки рисков, представлены ситуационные задачи и кейсы, используемые в практике российских банков, даны вопросы для самопроверки, тестовые задания и кроссворды.

Для студентов вузов, обучающихся по направлениям подготовки «Экономика» (бакалавриат и магистратура) и «Финансы и кредит» (магистратура), а также для преподавателей вузов и практических работников кредитных учреждений.

<https://www.elibrary.ru/item.asp?id=42364263>

ОЦЕНКА РИСКОВ

Автор: Воронцовский А.В.

Издатель: Юрайт

Вид издания: учебник

Год: 2019

Аннотация

В учебнике рассматриваются различные методы оценки и измерения рисков инвестиционных проектов в реальном секторе экономики; показаны особенности оценки

многопериодных рискованных инвестиций; приведены методы обоснования текущей стоимости рискованных активов капитала и размеров вложений в рискованные инвестиционные проекты. Все главы учебника сопровождаются вопросами и заданиями для самопроверки. Для всех методов оценки рисков сформулированы практические рекомендации и показана их реализация в Microsoft Excel, приведены практические расчетные задания.

<https://www.elibrary.ru/item.asp?id=41256948>

Учебные пособия

РИСК-МЕНЕДЖМЕНТ - ОСНОВА УСТОЙЧИВОСТИ БИЗНЕСА

Авторы: Ряховская А.Н., Крюкова О.Г., Кузнецова М.О.

Издатель: Магистр

Вид издания: учебное пособие

Год: 2019

Аннотация

Рассматриваются теоретические аспекты риска, инструменты и методы управления рисками в основных функциональных системах организации: производственно-технологической, финансово-экономической, социальной, организационно-управленческой, информационной, экологической; комплексный (интегрированный) подход к оценке рисков организации в целом. Подробно представлен процесс формирования системы предупреждения рисков, разработки программы управления рисками. По каждой главе даны рекомендуемая литература, вопросы для контроля знаний и обсуждения; примеры применения конкретных методов и инструментов диагностики, анализа и оценки рисков, расчетно-аналитические задания.

<https://new.znaniium.com/catalog/document?pid=1019768>

АНАЛИЗ И УПРАВЛЕНИЕ РИСКАМИ ОРГАНИЗАЦИИ

Автор: Рыхтикова Н.А.

Издатель: ИНФРА-М

Вид издания: учебное пособие

Год: 2019

Аннотация

Учебное пособие направлено на формирование системы знаний и навыков в области построения структуры риск-менеджмента организации, реализации методов диагностирования, оценки и управления рисками и антикризисного управления организацией в целом. В пособии рассмотрены: природа экономической категории риска; эволюция представлений о риске; подходы к построению системы риск-менеджмента организации, осуществлению программ мониторинга риска. Подробно представлены современные технологии оценки и управления рисками; приведены примеры расчетов

и конкретные практические ситуации. Отдельная глава посвящена основам антикризисного управления. Соответствует требованиям Федерального государственного образовательного стандарта высшего образования последнего поколения. Учебное пособие предназначено для студентов высших учебных заведений, обучающихся по направлениям подготовки в области экономики и финансов, сотрудников консалтинговых фирм, риск-менеджеров.

<https://new.znaniium.com/catalog/document?pid=991965>

УПРАВЛЕНИЕ РИСКАМИ

Автор: Воронцовский А.В.

Издатель: Юрайт

Вид издания: учебное пособие

Год: 2019

Аннотация

Изложены основы теории принятия рискованных решений для бизнеса в сфере реальной экономики; подробно рассмотрены практические рекомендации по учету риска при обосновании решений и управлении рисками. Проведен анализ факторов риска, представлены различные подходы к измерению риска, дано описание методов учета риска при оценке материальных инвестиций и особенностей учета риска в процессе исполнения долгосрочных проектов материальных инвестиций. Показаны возможности управления рисками на основе воздействия на денежные потоки бизнеса и применения контрактных и встроенных реальных опционов. Представлены условия использования эквивалентных портфелей при оценке рискованных решений, оценке инвестиций и рискованных активов капитала. Описаны возможности реализации представленных методов управления рисками на ЭВМ. Приведены практические рекомендации по осуществлению расчетов по обоснованию управления рисками на ЭВМ. Для слушателей бакалаврских и магистерских программ по направлению «Экономика», обучающихся на экономических факультетах университетов и других вузов при очной и дистанционной формах обучения.

<https://www.elibrary.ru/item.asp?id=41245793>

ПРЕДПРИНИМАТЕЛЬСКИЕ РИСКИ В УСЛОВИЯХ ИННОВАЦИОННОГО РОСТА

Авторы: Безденежных В.М., Яковлев В.М.

Издатель: КноРус

Вид издания: учебное пособие

Год: 2019

Аннотация

В учебном пособии рассматриваются основные направления распознавания, анализа, оценки, классификации и управления предпринимательскими и иными рисками с учетом возникающих обстоятельств неопределенности и непредсказуемости рыночной ситуации в условиях усиления внешнего экономического давления и санкций, диктуемых

странами однополярного мироустройства. Подчеркивается, что указанным негативным обстоятельствам, провоцирующим кризисные тенденции и угрозы снижения экономической безопасности, результативности производственного комплекса России и качества жизнеобеспечения граждан может противостоять прогнозируемый инновационный рост на основе вырабатываемого предпринимательского конструктивизма с учетом квалифицированного предпринимательского риска в условиях подобной рыночной неопределенности.

<https://www.elibrary.ru/item.asp?id=41268579>

ОЦЕНКА РИСКОВ

Автор: Уколов А.И.

Издатель: Директ-Медиа

Вид издания: учебное пособие

Год: 2018

Аннотация

В данной книге освещаются вопросы оценки и управления финансовыми рисками. Рассматривается экономическая сущность, классификация и системы обеспечения управления рисками, рисковые показатели основных финансовых инструментов инвестирования, концепция оценки "стоимости под риском" VaR. Значительное место отведено вопросам интегрированного риск-менеджмента на уровне предприятия, управлению операционными и кредитными рисками, рисками ликвидности, инвестиционными рисками, включая проектные и портфельные риски. Изложение материала построено на основе лекционного курса по предмету "Оценка рисков", читаемого на кафедре финансов факультета Экономики и финансов РГАУ-МСХА имени К. А. Тимирязева. Учебник предназначен для специалистов, обучающихся по направлению 080101 "Экономическая безопасность" специализация "Экономико-правовое обеспечение экономической безопасности", может быть использован для самостоятельной аудиторной и внеаудиторной работы. Текст печатается в авторской редакции.

<https://www.elibrary.ru/item.asp?id=35083205>

АНАЛИЗ И УПРАВЛЕНИЕ РИСКАМИ ОРГАНИЗАЦИИ

Автор: Рыхтикова Н.А.

Издатель: ИНФРА-М

Вид издания: учебное пособие

Год: 2018

Аннотация

Учебное пособие направлено на формирование системы знаний и навыков в области построения структуры риск-менеджмента организации, реализации методов диагностирования, оценки и управления рисками и антикризисного управления организацией в целом. В пособии рассмотрены: природа экономической категории риска;

эволюция представлений о риске; подходы к построению системы риск-менеджмента организации, осуществлению программ мониторинга риска. Подробно представлены современные технологии оценки и управления рисками; приведены примеры расчетов и конкретные практические ситуации. Отдельная глава посвящена основам антикризисного управления. Соответствует требованиям Федерального государственного образовательного стандарта высшего образования последнего поколения.

Учебное пособие предназначено для студентов высших учебных заведений, обучающихся по направлениям подготовки в области экономики и финансов, сотрудников консалтинговых фирм, риск-менеджеров.

<https://www.elibrary.ru/item.asp?id=30629901>

Журнальные публикации

ПРИНЯТИЕ УПРАВЛЕНЧЕСКИХ РЕШЕНИЙ В УСЛОВИЯХ РИСКА

Авторы: Глушаков В.Е., Цыганков Д.Г.

Издано: ВЕЛЕС

№1/2020

Аннотация

Статья посвящена вопросам анализа принятия управленческих решений в условиях риска, являющейся насущной практической задачей устойчивого функционирования субъектов хозяйствования на современном этапе развития экономики. Анализируются и классифицируются возможные риски, встречающиеся в сфере бизнеса. Рассматриваются возможность и целесообразность использования методик SNW и SWOT-анализа для выявления рисков, оценки вероятности возникновения рисков ситуаций, а также их упреждения и минимизации. Предлагаются инструменты анализа управленческих проблем, что позволяет снизить риск принятия запоздалых и неоптимальных управленческих решений.

<https://www.elibrary.ru/item.asp?id=42363383>

УПРАВЛЕНИЕ РИСКАМИ В ОРГАНИЗАЦИИ

Авторы: Силка Н.О., Гурнович Т.Г.

Издано: Вестник современных исследований

№5/2019

Аннотация

В условиях неопределенности экономики внедрение подходов управления рисками является необходимым условием для обеспечения стратегической конкурентоспособности бизнеса, вне зависимости от сферы деятельности. Система управления рисками предполагает всесторонний анализ совокупности имеющихся рисков, их идентификацию, оценку и выработку механизмов контроля. Систематическая и непрерывная

последовательная реализация основных этапов управления рисками позволит организации не только избежать значительных убытков, но и извлекать из рискованной ситуации дополнительные выгоды.

<https://www.elibrary.ru/item.asp?id=36885573>

ПРОБЛЕМА ВЫБОРА АНАЛИТИЧЕСКОГО ИНСТРУМЕНТАРИЯ ПРИ УПРАВЛЕНИИ РИСКАМИ БАНКРОТСТВА

Авторы: Маркова Я.А., Мартынова Т.А.

Издано: Научный вестник южного института менеджмента

№4/2019

Аннотация

В условиях мирового экономического кризиса многочисленные риски оказывают значительное и непредсказуемое влияние на финансовое положение каждой организации. Последствия влияния рисков обусловили наступление периода в развитии экономики, характерной чертой которого является резкий рост числа банкротств экономических субъектов. В данной ситуации основным правилом стабильного функционирования организации является своевременная оценка факторов, влияющих на возникновение риска банкротства. Однако при многообразии существующих способов оценки вероятности банкротства перед аналитиком возникает проблема выбора наиболее подходящего метода для конкретной организации с учетом отраслевых особенностей. Этот факт обуславливает степень актуальности разработки универсальной модели оценки риска банкротства. В данной статье нами были изучены существующие подходы, используемые для оценки рисков финансовой несостоятельности. Приведены результаты оценки вероятности банкротства организации с использованием существующих подходов.

<https://www.elibrary.ru/item.asp?id=41851871>

ОПЫТ ПРОЕКТИРОВАНИЯ БАЗЫ ДАННЫХ И АЛГОРИТМА ЕЁ ИСПОЛЬЗОВАНИЯ ДЛЯ ОЦЕНКИ И ПРОГНОЗИРОВАНИЯ СОЦИАЛЬНО ЭКОЛОГИЧЕСКИХ РИСКОВ В РЕГИОНАЛЬНЫХ ЭКОНОМИКАХ

Авторы: Лясников Н.В., Буркальцева Д.Д.

Издано: Экономика и социум: современные модели развития

№1/2019

Аннотация

В настоящей статье определена сущность проектирования базы данных. Проведен анализ алгоритма её использования для оценки и прогнозирования социально-экологических рисков в региональных экономиках. Выводы. На сегодняшний день базы данных (БД) используются повсюду. Они бывают самых разных видов и могут использоваться для самых различных отраслей и для самых различных целей. Так, к примеру могут создаваться различные базы данных по социально-экологическим рискам, которые затем можно применить в разрезе отдельно взятой региональной экономики.

Применение. Полученные выводы и результаты исследования могут быть использованы при разработке современных баз данных для дальнейшего использования его в оценке и прогнозировании социально-экологических рисков в региональных экономиках.

<https://www.elibrary.ru/item.asp?id=38479964>

ПОСТУПЛЕНИЕ ПРЯМЫХ ИНОСТРАННЫХ ИНВЕСТИЦИЙ В РОССИЙСКИЕ РЕГИОНЫ: ФАКТОРЫ ПОТЕНЦИАЛА И РИСКА

Автор: Изотов Д.А.

Издано: Экономические и социальные перемены: факты, тенденции, прогноз
№2/2019

Аннотация

Российская экономика является тесно интегрированной с мировым рынком капитала, характеризуясь видимыми региональными различиями в динамике поступления прямых иностранных инвестиций (ПИИ). Цель исследования - количественная оценка факторов притока ПИИ в российские регионы в 2011-2017 гг. в рамках агрегированных и частных показателей риска и потенциала. Полученные оценки указали на положительное влияние агрегированного показателя инвестиционного потенциала на приток ПИИ в регионы. Обнаружено, что по мере нарастания рисков для отечественной экономики, статистически значимая обратная зависимость между притоком ПИИ и агрегированным показателем инвестиционного риска перестала наблюдаться с 2014 г., при видимой конвергенции между российскими регионами по данному показателю. Полученные оценки дают основание предположить, что без преодоления высоких рисков, генерируемых национальной экономикой в целом, снижение агрегированных рисков между российскими регионами в целом незначимо для увеличения притока ПИИ.

<https://www.elibrary.ru/item.asp?id=38029289>

ПРАКТИЧЕСКОЕ ПРИМЕНЕНИЕ ОТДЕЛЬНЫХ ИНСТРУМЕНТОВ ОЦЕНКИ ФИНАНСОВОЙ НЕСТАБИЛЬНОСТИ ЭКОНОМИКИ РЕГИОНА

Автор: Граница Ю.В.

Издано: Региональная экономика: теория и практика
№8/2019

Аннотация

Исследование экономического и статистического инструментария, адекватного для прогнозирования финансовой нестабильности региональной экономической системы. Спецификация моделей экономических индикаторов финансовой нестабильности, оценка их параметров, проверка качества моделей и интерпретация полученных результатов.

<https://www.elibrary.ru/item.asp?id=39196063>

РИСКИ ИНВЕСТИРОВАНИЯ В СТРАНЫ С РАЗВИВАЮЩИМИСЯ РЫНКАМИ

Авторы: Матюшок В.М., Петренко И.А.

Издано: Вопросы новой экономики

№2/2-19

Аннотация

В настоящее время многие крупные организации и предприятия ориентированы на вложение финансовых ресурсов в экономику как развитых, так и развивающихся зарубежных стран, сталкиваясь при этом с рядом рисков, воздействие которых может не просто снизить предполагаемый доход, но и полностью лишить инвестора вложенных средств. Вследствие роста неопределенности в рамках международной инвестиционной деятельности, обусловленной негативными тенденциями в экономике и политике многих зарубежных стран, оценка рисков является чрезвычайно важной для инвесторов, поскольку инвестиционная деятельность будет реализовываться в новых условиях. Целью данной статьи является исследование инвестиционных тенденций в странах с развивающимися рынками, анализ факторов инвестиционных рисков рассматриваемой группы стран и комплексная оценка их инвестиционной привлекательности. В процессе оценки рисков инвестирования в экономику рассматриваемой группы стран для обеспечения ее полноты были подробно рассмотрены макроэкономические показатели стран с развивающимися рынками, детально проанализированы действующие государственные программы и стратегии экономического развития.

<https://www.elibrary.ru/item.asp?id=38941220>

ОЦЕНКА ФИНАНСОВОГО РИСКА В ИННОВАЦИОННЫХ МОДЕЛЯХ ЭКОНОМИКИ

Авторы: Атоян С.В., Бухтоярова М.В., Матвеев Г.С., Паршиков Г.Ю., Силаев А.А.

Издано: Инновации и инвестиции

№6/2019

Аннотация

Вводится функция риска как переменная величина, пропорциональная среднеквадратическому отклонению (СКО). Рассмотрены функции риска для равномерного, показательного и нормального распределения случайной величины. Установлена связь моделей распределенного лага (Л. Койка и Р. Солоу) с эластичностью функции риска. Исследованы прямая и обратная связи функции рисков со структурой и динамикой распределенного лага. Подчеркнута важность появления компьютерных разработок и моделирования, процессов с детерминированным математическим ожиданием и значительной, практически неограниченной дисперсией. Выявлена связь между функциями риска, СКО и факторами времени. Отмечена связь прикладной теории катастроф и точек разрыва второго рода у функции (финансовых) рисков. Приведены примеры областей исследования, где может быть применен построенный авторами комплекс моделей, синтезирующих риски и лаги.

<https://www.elibrary.ru/item.asp?id=41393061>

СИСТЕМНАЯ ОЦЕНКА УГРОЗ СТРАТЕГИИ ТЕХНОЛОГИЧЕСКОГО РАЗВИТИЯ РФ

Автор: Никонова А.А.

Издано: Проблемы анализа риска

№6/2019

Аннотация

Статья посвящена исследованию факторов, которые препятствуют созданию знаний и технологий, применению, распространению их в российской экономике и которые создают угрозы для технологического развития страны. Исследование базируется на методологии системной теории экономики и методах системного анализа, которые предполагают изучать экономику и общество как целостную социально-экономическую систему, в единстве и взаимной зависимости ключевых подсистем, влияющих на инновации. Такой подход нацелен на получение оценок, отражающих реальное состояние и динамику всех секторов, от которых зависит создание инноваций: производства, кредитно-финансовой системы, институциональной среды, науки, образования, социума. На схеме изображены зоны рисков, свойственных российской практике стратегического планирования и управления. С системной точки зрения выводы сводятся к тому, что объективные системные оценки должны быть в основе стратегии. Ненадлежащее качество планирования, игнорирование системных связей в принятии решений, использование недостоверных данных, иные огрехи управления создают значительную угрозу для развития РФ. В качестве направлений дальнейших исследований с целью снижения рисков стратегии технологического развития предложено совершенствовать методы измерения и индикаторы характеристик социально-экономической системы, которые могут дать истинную картину системы, и продолжить разработку концепции стратегирования изменений в нестационарной экономике.

<https://www.elibrary.ru/item.asp?id=41531203>

КОЛИЧЕСТВЕННАЯ ОЦЕНКА РИСКОВ: ЧЕМ ТОЧНЕЕ, ТЕМ ЛУЧШЕ?

Авторы: Полянская Э.В., Педань А.В.

Издано: Экономика и управление: проблемы, решения

№1/2019

Аннотация

Управленческое решение - тонкий многогранный механизм, существующий в условиях неопределенности и, соответственно, риска. Для обеспечения его эффективности лицо, принимающее решение, вынуждено снижать степень информационной неопределенности и соотносить множество факторов, от степени точности определения которых зависит, в какую сторону перевесит чаша весов. В таких условиях возникают вопросы: «А сколько вешать в граммах?» и «Нужно ли «вешать в граммах»? Авторами статьи рассмотрен механизм повышения точности количественной оценки рисков; данный

механизм соотнесен с механизмом возникновения мультипликативного эффекта в экономике; предпринята также попытка определить случаи, когда максимизация точности количественной оценки рисков становится целесообразной.

<https://www.elibrary.ru/item.asp?id=37606918>

ОРГАНИЗАЦИОННО-ЭКОНОМИЧЕСКИЙ МЕХАНИЗМ УПРАВЛЕНИЯ УСТОЙЧИВЫМ РАЗВИТИЕМ ПРЕДПРИЯТИЯ С УЧЕТОМ ПРОИЗВОДСТВЕННОГО РИСКА

Авторы: Коваленко И.И., Соколицин А.С.

Издано: Научно-технические ведомости

№6/2019

Аннотация

Инновационный путь развития российской экономики ориентирован на технологическое развитие отечественного производственного комплекса, что требует разработки соответствующих механизмов, обеспечивающих устойчивое развитие экономики промышленных предприятий. Стабилизация производственной деятельности связана с управлением рисками. Поскольку долгосрочное сохранение конкурентного преимущества в условиях нового технологического уклада зависит не только от традиционной ресурсной базы, но и от развития социального и человеческого капитала, исследователи естественным образом повышают свое внимание к рискам предприятия, связанным с условиями труда работников и влиянием этих условий на экономические показатели производственной деятельности. Цель исследования состоит в разработке организационно-экономического механизма управления устойчивым развитием предприятия на основе оценки производственного риска. В статье решены задачи: проведен анализ подходов к дефиниции «устойчивое развитие предприятия»; дана оценка влияния производственного травматизма на показатели устойчивости предприятия; разработана система управления устойчивым развитием предприятия; сформулирован организационно-экономический механизм управления устойчивым развитием промышленного предприятия.

<https://www.elibrary.ru/item.asp?id=41802894>

СПОСОБЫ И МЕТОДЫ ОЦЕНКИ РИСКОВ ПРОЕКТА

Автор: Андросюк А.Б.

Издано: Вектор экономики

№8/2019

Аннотация

В настоящее время, в рыночной экономике, при управлении каким-либо проектом, нужно оценить всевозможные риски, которые в будущем могут навредить бизнесу. При инвестициях в проект, оценка рисков особенно важна, так как можно потерять значительную сумму своего капитала. В статье дано определение понятиям «проект» и

«риск», показаны три способа оценки рисков проекта. Также в статье раскрыты различные методы оценки инвестиционных рисков, как качественные, так и количественные. Очень важно уметь правильно оценивать риски, так как в дальнейшем это может помочь своевременно выявить все возможные исходы событий, эффективнее завершить проект и получить как можно больше прибыли от инвестиций.

<https://www.elibrary.ru/item.asp?id=39374099>

УПРАВЛЕНИЕ РИСКАМИ В УСЛОВИЯХ НЕОПРЕДЕЛЕННОСТИ

Автор: Аристархов С.С.

Издано: COLLOQUIUM-JOURNAL

№7/2019

Аннотация

Риски представляют собой сложную экономическую категорию, которая неразрывно связана с фактом осуществления предпринимательской деятельности. Процесс оценки, выявления и определения рисков усложняется фактом неопределенности. В связи с этим, полностью избежать рисков в условиях рыночной экономики невозможно. Поэтому управление рисками, в условиях неопределённости, приобретает все большее значение в менеджменте фирм. В данной статье описывается не только сущность категорий «риск» и «неопределенность», но и их взаимосвязь, а также выделяются важность и значение управления рисками в условиях неопределенности.

<https://www.elibrary.ru/item.asp?id=41552857>

РИСКИ РОССИЙСКИХ ЛИЗИНГОВЫХ КОМПАНИЙ: ОЦЕНКА И ПУТИ МИНИМИЗАЦИИ

Авторы: Чирская М.А., Чумаченко Е.А.

Издано: Вестник евразийской науки

№5/2019

Аннотация

Авторами дана оценка современных тенденций в отечественной экономике, имеющих позитивную направленность, приведены данные по Ростовской области. Выделена роль лизинговых компаний в повышении уровня технической оснащенности производственной базы российских организаций. Указана динамика развития лизинговых компаний в текущем году, а также препятствия, затрудняющие полноценное использование ключевых преимуществ лизинга. Проведено изучение и систематизация финансовых рисков, характерных для участников лизинговых отношений в современной российской экономике. Охарактеризованы типы гарантий, применяемых лизинговыми компаниями для минимизации возникающих финансовых рисков. Аргументировано положение о взаимном влиянии всех возникающих рисков в лизинговых отношениях. Дана характеристика конфликта интересов сторон лизинговых отношений. Указана роль

фактора принятия риска в целях получения прибыли. Выделены приоритетные направления взаимодействия сторон лизинговых отношений, снижающие финансовые риски.

<https://www.elibrary.ru/item.asp?id=41833756>

ВЛИЯНИЕ РИСКА НА РАСПРЕДЕЛЕНИЕ РЕСУРСОВ В СЕКТОРАХ ЭКОНОМИКИ И ИНДУСТРИАЛИЗАЦИЮ

Авторы: Сухарев О.С., Ворончихина Е.Н.

Издано: Проблемы анализа риска

№5/2019

Аннотация

Цель исследования - влияние риска хозяйственной деятельности, сосредоточенной в секторах экономики, на распределение ресурсов между секторами, изменение инвестиций в новые и старые технологии, технологичность и создаваемую валовую добавленную стоимость, темп ее роста. Количественная оценка риска осуществляется по стандартному квадратичному отклонению валовой прибыли в секторах и в российской экономике. Технологичность определяется соотношением производства на новых и старых технологиях, причем новые технологии представляют собой вновь созданные передовые технологии. Методологию исследования составляет структурный анализ, позволяющий представить российскую экономику в виде дихотомии секторов - обрабатывающего и транзакционно-сырьевого. Данная дихотомия применена в силу необходимости оценки хода индустриализации и влияния риска в обрабатывающем секторе на динамику общего и специального критериев индустриализации. Результат исследования состоит в том, что подтверждено положительное влияние понижения риска в обрабатывающем секторе на изменение его технологичности и улучшение параметров индустриализации экономики.

<https://www.elibrary.ru/item.asp?id=41218495>