



В. А. Кучнин

ПРЕВЕНТИВНОЕ УПРАВЛЕНИЕ
ПРЕДПРИНИМАТЕЛЬСКИМИ
РИСКАМИ
ПРОМЫШЛЕННЫХ
ПРЕДПРИЯТИЙ



САНКТ-ПЕТЕРБУРГСКАЯ АКАДЕМИЯ УПРАВЛЕНИЯ И ЭКОНОМИКИ

В. А. Кунин

ПРЕВЕНТИВНОЕ УПРАВЛЕНИЕ
ПРЕДПРИНИМАТЕЛЬСКИМИ РИСКАМИ
ПРОМЫШЛЕННЫХ ПРЕДПРИЯТИЙ

Издательство
Санкт-Петербургской академии
управления и экономики

Санкт-Петербург
2009

УДК 658.14-005
ББК 65.290-93
К91

Рецензенты:

заведующий кафедрой «Финансы и кредит»
Санкт-Петербургской академии управления и экономики,
доктор экономических наук, профессор *Б. Б. Коваленко*

профессор кафедры «Экономика и управления»
Ленинградского государственного университета им. А.С. Пушкина,
доктор экономических наук, профессор *Б. В. Лаиов*

Одобрено к печати Научно-экспертным советом
Санкт-Петербургской академии управления и экономики
24 июня 2008 г., протокол № 3

К91

Кунин В. А.

Предентивное управление предпринимательскими рисками промышленных предприятий. — СПб.: Издательство Санкт-Петербургской академии управления и экономики, 2009. — 192 с.

В монографии проведена систематизация предпринимательских рисков и критериев их оценки, разработана модель лавинной генерации рисков и методический подход применения этой модели для оценки результатов влияния рисков на эффективность предпринимательской деятельности. Сформулированы принципы и предложен методический подход формирования ядра сбалансированной системы показателей промышленных предприятий, обеспечивающей индикацию рисков и оценку вклада различных факторов в изменение ключевых показателей различных проекций деятельности предприятий. Проанализированы возможности и технологии имитационного моделирования бизнес-процессов промышленных предприятий в целях превентивного управления рисками и повышения эффективности принимаемых управленческих решений.

Монография предназначена для специалистов в области управления предприятием, риск-менеджеров, финансовых менеджеров, студентов магистратуры экономических вузов и слушателей профессиональных образовательных программ МВА.

ISBN 978-5-94047-121-9

© СПбАУЭ, 2009
© Кунин В. А., 2009

Содержание

Введение	6
-----------------------	---

ГЛАВА 1

Методология анализа и оценки влияния рисков на эффективность предпринимательской деятельности

1.1. Формирование системы риск-менеджмента как фактора повышения эффективности предпринимательской деятельности промышленных предприятий	10
1.2. Систематизация предпринимательских рисков.....	12
1.2.1. Классификация предпринимательских рисков	12
1.2.2. Иерархическая структура предпринимательских рисков	19
1.2.3. Структура управления предпринимательскими рисками.....	23
1.3. Формирование критериев оценки предпринимательских рисков промышленных предприятий	29
1.4. Методический подход к оценке влияния рисков на эффективность предпринимательской деятельности на основе модели лавинной генерации рисков	45
1.4.1. Сущность лавинной генерации рисков.....	45
1.4.2. Анализ вероятностей реализации факторных и результативных рисков	47
1.4.3. Модели потоков факторных и результативных рисков	55
1.4.5. Применение вероятностной модели лавинной генерации рисков для оценки их влияния на эффективность предпринимательской деятельности	74
1.5. Риски ошибочных управленческих решений как фактор лавинной генерации предпринимательских рисков и снижения эффективности предпринимательской деятельности.....	78

ГЛАВА 2
Сбалансированная система показателей
как фактор повышения эффективности
предпринимательской деятельности
на основе снижения рисков

2.1. Сбалансированная система показателей промышленных предприятий в текущем управлении, стратегическом планировании и прогнозировании предпринимательской деятельности	81
2.2. Совершенствование методических подходов к формированию сбалансированной системы показателей	88
2.2.1. Принципы построения сбалансированной системы показателей, на базе применения факторного метода	88
2.2.2. Формирование ядра сбалансированной системы показателей промышленных предприятий на основе принципов реализации факторного метода	90
2.2.3. Методический подход к определению требуемых значений ключевых показателей сбалансированной системы	111

ГЛАВА 3
Методические основы превентивного
управления рисками в целях повышения
эффективности предпринимательской деятельности

3.1. Превентивное управление рисками как инструмент повышения эффективности предпринимательской деятельности	118
3.2. Методический подход к снижению рисков ошибочных решений при увеличении объема реализации	120
3.2.1. Постановка задачи снижения рисков ошибочных решений при увеличении объема реализации.....	120
3.2.2. Определение условий целесообразности увеличения объема реализации	122
3.2.3. Практическое применение оценок эффекта операционного левеиджа для снижения рисков ошибочных решений при увеличении затрат на поддерживающую рекламу и PR	136
3.3. Методический подход к снижению рисков ошибочных решений при реинвестировании прибыли	141

3.4. Методический подход к снижению рисков ошибочных решений при финансировании развития предпринимательской деятельности	144
3.4.1. Постановка задачи	144
3.4.2. Расчет потоков платежей при финансовом кредитовании.....	145
3.4.3. Расчет потоков платежей при лизинге	151
3.4.4. Расчет потоков платежей при эмиссии облигаций	156
3.4.5. Сравнительный анализ потоков платежей при лизинге, финансовом кредитовании и эмиссии облигаций	157

ГЛАВА 4

Моделирование бизнес-процессов как инструмент повышения эффективности предпринимательской деятельности

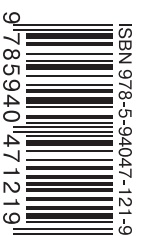
4.1. Концепция применения моделирования бизнес-процессов в целях повышения эффективности принятия управленческих решений в рисковом среде	160
4.2. Моделирование бизнес-процессов промышленных предприятий при принятии управленческих решений в сфере предпринимательства	167
Заключение	185
Список литературы	188



**Владимир Александрович
Кунин** — профессор
Санкт-Петербургской
академии управления
и экономики, кандидат
технических наук,
автор более 90 научных
и учебно-методических
работ.

В монографии проведена систематизация предпринимательских рисков и критериев их оценки, разработана модель лавинной генерации рисков и методический подход применения этой модели для оценки эффективности влияния рисков на эффективность предпринимательской деятельности. Сформулированы принципы и предложен методический подход формирования ядра сбалансированной системы показателей промышленности предприятий, обеспечивающей индикацию рисков и оценку вклада различных факторов в изменение ключевых показателей различных проекций деятельности предприятий. Проанализированы возможности и технологии имитационного моделирования бизнес-процессов промышленных предприятий в целях превентивного управления рисками и повышения эффективности принимаемых управленческих решений.

Монография предназначена для специалистов в области управления предприятием, риск-менеджеров, финансовых менеджеров, студентов магистратуры экономических вузов и слушателей профессиональных образовательных программ MBA.



ISBN 978-5-94047-121-9

91785940471219