

Стратегический анализ и прогнозирование

История и основные понятия
дисциплины

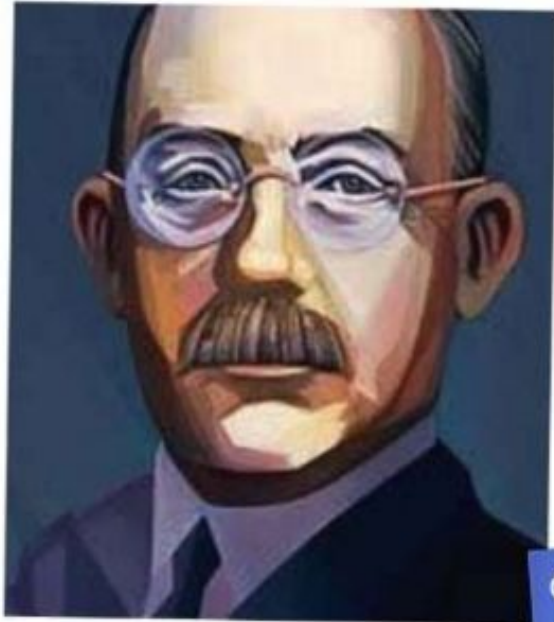
1 лекция

1. Стратегическое планирование

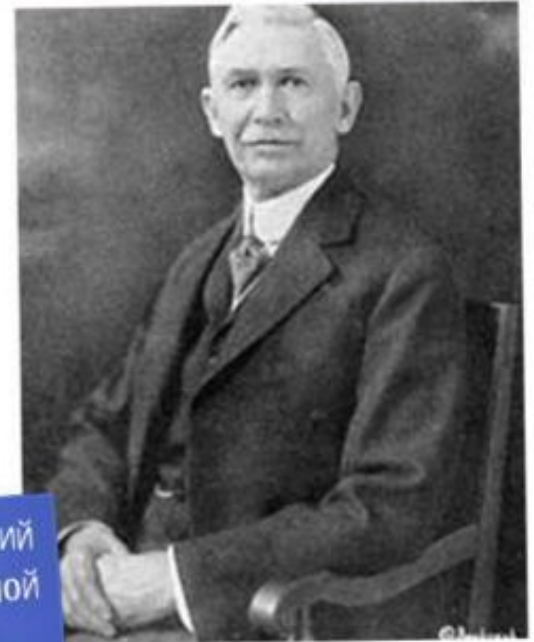
Главной целью предприятия является поддержание, развитие и упрочение позиций выбранного бизнеса в сложных рыночных и политических условиях и увеличение собственного потенциала. Для этого необходимо определить **стратегию** предприятия.

Стратегическое планирование и стратегическое управление – наиболее важные и глобальные задачи менеджеров предприятия.

Управление фирмой как научное направление в экономике сформировалось в начале XX века. Школа научного менеджмента (Ф. Тейлор, Г. Гант, Х. Эмерсон), а затем и классическая (административная) школа управления (А. Файоль, М. Вебер, Ч. Бернард) выделяли планирование как одну из основных функций управления предприятием.



Фредерик Тейлор — американский инженер, основоположник научной организации труда и менеджмента.



Генри Гант изучал менеджмент на примере постройки кораблей и предложил диаграмму из отрезков и точек для представления длительности и последовательности задач в проекте.

Гаррингтон Эмерсон — инженер, предприниматель и писатель: «работать напряженно - прилагать максимальные усилия; работать производительно - прилагать усилия минимальные».

Школа научного управления - основные представители

Основатели административной школы:



А. Файоль (1841-1925)



Макс Вебер (1864-1920),



Ч. Бернارد

При этом планирование было краткосрочным и носило форму бюджетирования и контроля. Оно было основано на постулате о стабильности внешней деловой среды и ресурсного потенциала предприятия, что в целом было характерно для экономики промышленно развитых стран первой четверти прошлого века.

В силу этого планирование деятельности фирмы рассматривалось как составление годового бюджета организации, где скрупулезно учитывались все доходы и расходы от

Однако первые волны научно-технической революции, начальное насыщение рынка товарами, возникновение первых транснациональных корпораций привели к тому, что возникла необходимость в долгосрочном планировании и управлении, нацеленном на будущее.

Исторически долгосрочное планирование на уровне предприятия в условиях рыночной экономики сформировалось в теоретическом и практическом плане в 50-х годах XX века. На первом этапе оно выступало как собственно долгосрочное планирование, когда ведущим было утверждение о перенесении тенденций развития предприятия на будущее. Особенно эффективные результаты достигались на стадии экономического подъема, когда тенденции роста **прогнозировались** в будущее. Ресурсное обеспечение при этом рассматривалось или как использование уже накопленного ресурсного потенциала для получения дополнительной прибыли, или как аккумулярование (накопление) ресурсов для возможного рывка в будущем.

Однако к началу 60-х годов деловая окружающая среда стала недостаточно стабильной, чтобы трендовые характеристики давали реалистичные результаты. Возросшая конкуренция, борьба за потребителей потребовали пересмотра концептуальных положений в области долгосрочного планирования предприятия. Поэтому планирование стало целевым, когда ресурсы рассматривались как средство достижения целей, а план представлял собой набор возможных альтернатив в соответствии с прогнозируемыми изменениями деловой окружающей среды. Данное направление получило название **«стратегическое планирование» (strategic planning)** и применялось в той или иной мере всеми преуспевающими фирмами промышленно развитых стран.

На сегодняшний день можно считать уже общепризнанным, что «отцами» стратегического планирования по праву считаются Альфред Д. Чандлер, Кеннет Эндрюс и Игорь Ансофф. Альфред Д. Чандлер впервые в рамках исторического анализа исследовал генезис фирмы через соотношение внешнего окружения, стратегии развития и организационной структуры управления. Кеннет Эндрюс сконцентрировал свое внимание исследователя на высшем руководстве в процессе разработки и реализации стратегии развития предприятия.

Игорь Ансофф в своих работах поставил и блестяще решил задачу реализации и некой схематизации процедуры стратегического планирования, особенно для процедур разработки стратегии роста крупных компаний.

Огромным прорывом в теории стратегического планирования явилась работа Майкла Портера «Конкурентные стратегии», опубликованная в 1980 году, которой широко пользуются предприятия.

Основными задачами стратегического управления является:

- видение предприятия **в перспективе** – представления его положения и состояния, как в разрезе внутреннего функционирования, так и в плане места в окружающей среде как элемента социальной, политической структуры общества и самостоятельной бизнес – единицы;

- планирование развития предприятия, направленное на усиление его конкурентоспособности и занятия доминирующих позиций на избранных в стратегии рыночных сегментах:

- планирование, направленное на достижение поставленных целей, формирования новой и коррекции старой стратегии.

Стратегическое развитие предприятия – это завоевание, удержание и укрепление рыночных конкурентных позиций предприятия в долгосрочной перспективе.

2. Стратегический анализ , методы и приемы анализа

Стратегический анализ - это комплексное исследование положительных и отрицательных факторов, которые могут повлиять на экономическое положение предприятия в перспективе, а также путей достижения стратегических целей предприятия.

С помощью стратегического анализа разрабатывается комплексный стратегический план развития предприятия, осуществляется научно обоснованная, всесторонняя и своевременная поддержка принятия стратегических управленческих решений.

Метод стратегического анализа базируется на определенной совокупности общенаучных и собственных (прикладных) методов и приемов исследования

Общенаучные методы и приемы основываются на методе философии. Они являются универсальными и могут применяться в любой сфере экономики, техники или искусства. К методам и приемам этой группы принадлежат анализ, синтез, индукция, дедукция, аналогия, наблюдение, сравнение, моделирование, абстрагирование, конкретизация, оценка,

идентификация и др.

Поскольку стратегический анализ использует информацию, которая характеризуется **высоким уровнем неопределенности**, его проведение требует глубокого системного исследования фактов и явлений с целью формулирования правил и критериев (индукция) для проведения исследований и оценки стратегий деятельности на их основе (дедукция) С помощью дедукции можно получить новые факты и выводы, которые в дальнейшем станут основой для индукции, причем этот процесс циклический Взаимосвязь индукции и дедукции обусловлено непрерывностью экономических процессов, а факты и выводы, которые фигурируют в этой системе, требуют тщательной проверки на каждом этапе

Кроме общенаучных методов в процессе проведения стратегического анализа возникает необходимость применения различных **прикладных методов и приемов**, которые в зависимости от объектов исследования можно объединить в 7 групп.

Каждый вид стратегического анализа охватывает несколько прикладных методов и приемов:

1) стратегический анализ макроокружения предприятия:

- о анализ информационных обзоров, проектов, отчетов, статистических справок;

- о кабинетные исследования, разнообразные методы сегментации, сбора данных, анализа и статистической оценки;

- о эконометрическое моделирование;

- о PEST-анализ;

2) стратегический анализ непосредственного окружения (отрасли и конкуренции):

- о анализ жизненного цикла отрасли:

- о анализ входных и выходных барьеров области;

- о бенчмаркинг

- о кластерный анализ;

- о метод сценариев;

- о имитационное моделирование;

- о методы экспертных оценок (Дельфи, мозгового штурма и др.);

3) стратегический анализ предприятия:

- о анализ основных компетенций и основных возможностей;
- о анализ вектора роста;
- о Эторе-анализ (анализ угроз внешнего окружения и профиля возможностей);
- о SWOT-анализ (анализ сильных и слабых сторон, возможностей и угроз);
- о SPACE-анализ (оценка стратегической позиции и действий);
- о матрица BCO (матрица \"рост / доля\", разработанная Бостонской консалтинговой группой);
- о матрица Ge / McKinsey (матрица \"Привлекательность отрасли / Позиция в конкуренции\");
- о матрица Shell / DPM (матрица направленной политики, разработанная компанией Shell)
- о PIMS-анализ (анализ воздействия рыночной стратегии на прибыль);
- о анализ жизненного цикла предприятия;
- о анализ временных рядов, экстраполяция тенденций;
- о анализ уязвимости предприятия;
- о сравнительный анализ \"цели - план - факт - оптимизация -

4) стратегический анализ:

- о анализ жизненного цикла продукта, маркетинг;
- о жизненного цикла продукта и финансовой ситуации;
- о жизненного цикла продукта и конкуренции;
- о жизненного цикла продукта и менеджмента;
- о жизненного цикла продукта и факторов производительности;
- о влияния заинтересованных сторон;

5) стратегический финансовый анализ:

- о подготовка проектируемых финансовых отчетов;
- о прогнозирования по методу процента от продаж;
- о стратегическая оценка финансовых результатов и финансовых потребностей;
- о расчет финансовых коэффициентов;
- о диагностика (прогнозирование) банкротства;

6) стратегический инвестиционный анализ:

- о чистая приведенная стоимость;
- о методы формирования хозяйственного портфеля;
- о методы вариантного анализа;
- о анализ рисков;

7) анализ стратегии и принятия стратегических решений:

- о матрица выбора главной стратегии;
- о анализ ключевых факторов успеха;
- о методы имитационного моделирования;
- о теория игр;
- о теория массового обслуживания;
- о методы сетевого анализа;
- о методы экспертных оценок;
- о подготовка стратегического плана

3. Методология прогнозирования и стратегического планирования

Современная концепция управления организациями и предприятиями – это концепция стратегического управления. Она основывается на соединении маркетинговой концепции и внутрифирменного экономического управления, центральным звеном которого является управление финансами. В условиях рыночной экономики деятельность предприятий в значительной степени зависит от того, насколько достоверно они могут предвидеть перспективы своего развития в будущем, т.е. от прогнозирования.

Прогноз - предположительная оценка будущего состояния предприятия. Предприятия используют прогнозы с целью предусмотрения возможных вариантов развития своего бизнеса, они прогнозируют будущие события или условия их возникновения.

Прогноз определяется как вероятностное научно обоснованное суждение о перспективах, возможных состояниях того или иного явления в будущем и (или) об альтернативных путях и сроках их осуществления.

Будущее стремятся предвидеть, предсказать, предвосхитить, предугадать, прогнозировать и т.д. Но будущее можно также планировать, программировать, проектировать.

Прогнозы должны предшествовать планам, могут охватывать в принципе любой отрезок времени.

Прогноз и план различаются способами оперирования информацией о будущем. **Вероятностное** описание возможного или желательного — это **прогноз**.

Директивное решение относительно мероприятий по достижению возможного или желательного - это **план**.

Прогноз и план могут разрабатываться независимо друг от друга. Но чтобы план был эффективным, оптимальным, ему должен предшествовать прогноз, по возможности непрерывный и, позволяющий научно обосновывать данный и последующие планы. Типология прогнозов может строиться по различным критериям в зависимости от целей, задач, объектов, предметов, проблем, характера, периода упреждения, методов, организации прогнозирования и т.д. основополагающим является проблемно-целевой критерий: для чего разрабатывается прогноз?

Поисковый принцип — определение возможных состояний явления в будущем. Такой прогноз отвечает на вопрос: что вероятнее всего произойдет при условии сохранения существующих тенденций?

Нормативный прогноз — определение путей и сроков достижения возможных состояний явления, принимаемых в качестве цели. Имеется в виду прогнозирование достижения желательных состояний на основе заранее заданных норм, идеалов, стимулов, целей. Такой прогноз отвечает на вопрос: какими путями достичь желаемого?

По периоду упреждения — промежутку времени, на который рассчитан прогноз, — различаются оперативные (текущие), кратко-, средне-, долго-, и дальнесрочные (сверхдолгосрочные) прогнозы.

Оперативный, как правило, рассчитан на перспективу, на протяжении которой не ожидается существенных изменений объекта исследования — ни количественных, ни качественных.

Краткосрочный — на перспективу только количественных изменений, **долгосрочный** — не только количественных, но преимущественно качественных.

Среднесрочный охватывает перспективу между кратко- и долгосрочным с преобладанием количественных изменений над качественными, **дальнесрочный** (сверхдолгосрочный) — перспективу, когда ожидаются столь значительные качественные изменения, что по существу можно говорить лишь о самых общих перспективах развития природы и общества.

Оперативные прогнозы содержат, как правило, детально-количественные оценки, краткосрочные — общие количественные, среднесрочные — количественно-качественные, долгосрочные качественно-количественные и дальнесрочные — общие качественные оценки.

Общая логическая последовательность важнейших операций разработки прогноза сводится к следующим основным этапам:

1. Предпрогнозная ориентация (программа, исследования). Уточнение задания на прогноз: характер, масштаб, объект, период основания и упреждения и т.д. Формирование целей и задач, предмета, проблемы и рабочих гипотез, определение методов, структуры и организации исследования.
2. Построение исходной (базовой) модели прогнозируемого объекта методами системного анализа. Для уточнения модели возможен опрос заседания и экспертов.

3. Сбор данных прогнозного фона (совокупность внешних по отношению к объекту прогнозирования условий, существенных для решения задачи прогноза.)

4. Построение динамических рядов показателей – основы, стержня будущих прогнозных моделей методами экстраполяции; возможно обобщение этого материала в виде прогнозных предмодельных сценариев.

5. Построение серии гипотетических (предварительных) поисковых моделей прогнозируемого объекта методами поискового анализа профильных и фоновых показателей с конкретизацией минимального, максимального и наиболее вероятного значений.

6. Построение серии гипотетических нормативных моделей прогнозируемого объекта методами нормативного анализа с конкретизацией значений абсолютного (т. е. не ограниченного рамками прогнозного фона) и относительного (т. е. привязанного к этим рамкам) оптимума по заранее определенным критериям сообразно заданным нормам, идеалам, целям.

7. Оценка достоверности и точности, а также обоснованности (верификация) прогноза — уточнение гипотетических моделей обычно методами опроса экспертов.

8. Выработка рекомендаций для решений в сфере управления на основе сопоставления поисковых и нормативных моделей. Для уточнения рекомендаций возможен еще один опрос населения и экспертов. Иногда (правда, пока еще редко) при этом строятся серии поствероятностных прогнозных моделей-сценариев с учетом возможных последствий реализации

9. Экспертное обсуждение (экспертиза) прогноза и рекомендаций, их доработка с учетом обсуждения и сдача заказчику.

10. Вновь предпрогнозная ориентация на основе сопоставления материалов уже разработанного прогноза с новыми данными прогнозного фона и новый цикл исследования, ибо прогнозирование должно быть таким же непрерывным, как целеполагание, планирование, программирование, проектирование, вообще управление, повышению эффективности которого оно призвано служить.

Различают три основных вида прогноза: технологический, экономический и прогноз объема продаж (спроса).

Технологические прогнозы охватывают уровень развития НТП или технологическое развитие в сферах, непосредственно влияющих на производство, в котором осуществляется прогноз. Например, предприятие, выпускающее компьютеры, интересуется перспективой расширения объема памяти на дискетах, т.к. они являются дополнительной продукцией для использования компьютеров, а предприятие, использующее вредные, токсичные вещества в своем производстве, интересуется разработкой технологий по очистке и утилизации отходов.

Развитие НТП приводит к появлению новых товаров и услуг, а те, в свою очередь, составляют серьезную конкуренцию существующим предприятиям. Грамотно сделанный прогноз позволит сэкономить финансовые ресурсы, предскажет развитие новых технологий даже если научно-технические изменения не повлияли на производство продукции.

Экономический прогноз позволяет предусмотреть будущее состояние экономики, процентные ставки и другие факторы, влияющие на развитие любого предприятия. От результатов экономического прогноза зависят такие решения как: расширение или сокращение производственных мощностей; заключение новых договоров; увольнение или наем рабочих и т.д.

Представление о реальном уровне спроса на продукцию предприятия на конкретный период в будущем дает прогноз объема продаж. Такой прогноз является основой для планирования и проведения экономических расчетов. На спрос влияют множество факторов, учет которых можно выявить с помощью составления прогноза объема продаж (спроса). В качестве базы для будущего прогноза используются такие показатели, как уровень спроса в предшествующем периоде, демографические изменения, изменения рыночных долей отраслевых организаций, динамику политической ситуации, интенсивность рекламы, конкурентов и др.