

Министерство образования и науки Российской Федерации  
Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение  
высшего образования  
«Магнитогорский государственный технический университет им. Г. И. Носова»  
(ФГБОУ ВО МГТУ им. Г.И. Носова)

Кафедра экономики и финансов

## **КУРСОВАЯ РАБОТА**

по дисциплине «Рискология»

на тему: «СОВЕРШЕНСТВОВАНИЕ ОЦЕНКИ ИННОВАЦИОННЫХ РИСКОВ  
В СИСТЕМЕ РИСК-МЕНЕДЖМЕНТА ВЕДУЩИХ ПРЕДПРИЯТИЙ  
МЕТАЛЛУРГИЧЕСКОГО КОМПЛЕКСА РОССИИ



---

**Магистрант:** [Иванов Иван Иванович](#), группа ЭЭм-16-2

**Научный руководитель:** Немцев Виктор Николаевич,  
доктор экономических наук, профессор

Магнитогорск, 2017



**МГТУ**

МАГНИТОГОРСКИЙ  
ГОСУДАРСТВЕННЫЙ  
ТЕХНИЧЕСКИЙ  
УНИВЕРСИТЕТ  
ИМ. Г. И. НОСОВА

## АКТУАЛЬНОСТЬ ИССЛЕДОВАНИЯ

Актуальность курсовой работы обусловлена настоятельной необходимостью решения важной народнохозяйственной задачи – повышения инновационной активности отечественных предприятий.

Явно недостаточная инновационная активность российских организаций обусловлена многими факторами, среди которых наиболее заметен **очень высокий риск**.

Для решения этой задачи требуются *адекватные* методики и процедуры управления высоким риском, *адаптированные* к конкретной отрасли экономики – черной металлургии



**МГТУ**

МАГНИТОГОРСКИЙ  
ГОСУДАРСТВЕННЫЙ  
ТЕХНИЧЕСКИЙ  
УНИВЕРСИТЕТ  
ИМ. Г. И. НОСОВА

## ЦЕЛИ И ЗАДАЧИ ИССЛЕДОВАНИЯ

*Цель работы* – совершенствование механизма управления инновационным риском в корпорациях черной металлургии на основе гармонизации требований к риск-менеджменту и систематизации экспертных исследований.

### *Задачи исследования:*

Исследовать теоретические и методологические аспекты оценки и управления инновационным риском современной корпорации.

Определить отраслевые особенности реализации инновационной стратегии и проблемы управления высоким инновационным риском.

Проанализировать типовые характеристики и системные недостатки современной парадигмы риск-менеджмента.

Сформировать итерационный алгоритм оценки инновационных рисков с использованием аппарата нечетких множеств.

Разработать предложения по совершенствованию элементов механизма управления инновационным риском корпорации черной металлургии.



**МГТУ**

МАГНИТОГОРСКИЙ  
ГОСУДАРСТВЕННЫЙ  
ТЕХНИЧЕСКИЙ  
УНИВЕРСИТЕТ  
ИМ. Г. И. НОСОВА

## ОБЪЕКТ И ПРЕДМЕТ ИССЛЕДОВАНИЯ

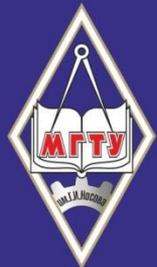


*Объект исследования* – инновационные риски корпораций черной металлургии

*Предмет исследования* – механизм управления инновационным риском в черной металлургии.

# Основные характеристики традиционной и современной парадигмы риск-менеджмента

ТРАДИЦИОННАЯ ПАРАДИГМА	СОВРЕМЕННАЯ ПАРАДИГМА
<p><u>Фрагментированный</u> риск-менеджмент: каждый отдел самостоятельно управляет рисками (в соответствии со своими функциями). Прежде всего, это касается бухгалтерии, финансового и ревизионного отделов</p>	<p><u>Интегрированный</u>, комплексный, системный риск-менеджмент: управление рисками координируется высшим руководством; каждый сотрудник организации рассматривает риск-менеджмент как часть своей работы</p>
<p><u>Эпизодический</u> риск-менеджмент: управление рисками осуществляется тогда, когда менеджеры посчитают это необходимым</p>	<p><u>Непрерывный</u> риск-менеджмент: процесс управления рисками непрерывен</p>
<p><u>Ограниченный</u> риск-менеджмент: касается, прежде всего, страхуемых и финансируемых рисков</p>	<p><u>Расширенный</u> риск-менеджмент: рассматриваются все риски и возможности их организации</p>





**МГТУ**  
МАГНИТОГОРСКИЙ  
ГОСУДАРСТВЕННЫЙ  
ТЕХНИЧЕСКИЙ  
УНИВЕРСИТЕТ  
ИМ. Г. И. НОСОВА

## Системные недостатки современного риск-менеджмента корпораций

1) отсутствие структурированной информации

2) отсутствие единой методологии и стандартов работы

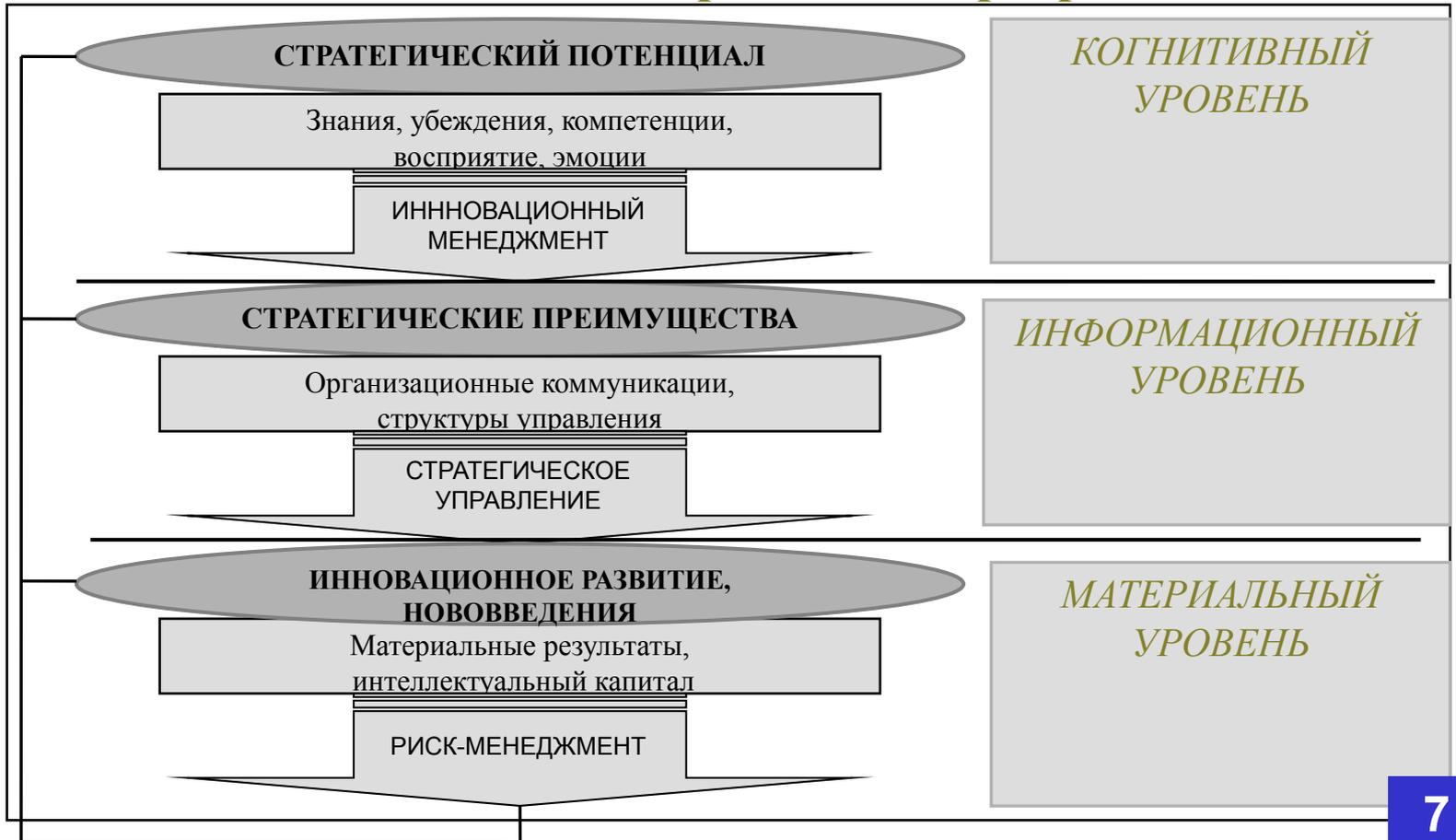
3) отсутствие управления рисками в целях реализации инновационной стратегии корпорации



# Уровни координации управления инновационной деятельностью современной корпорации



**МГТУ**  
МАГНИТОГОРСКИЙ  
ГОСУДАРСТВЕННЫЙ  
ТЕХНИЧЕСКИЙ  
УНИВЕРСИТЕТ  
ИМ. Г. И. НОСОВА

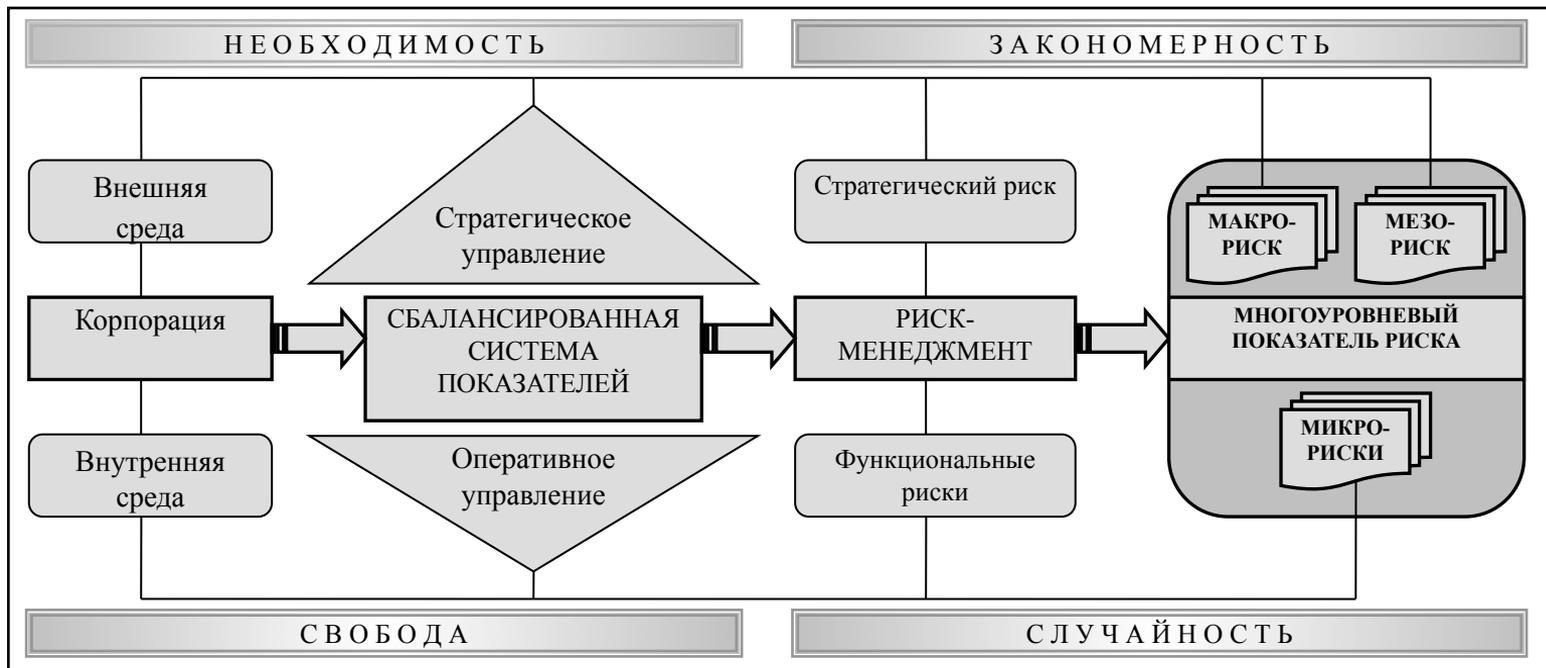




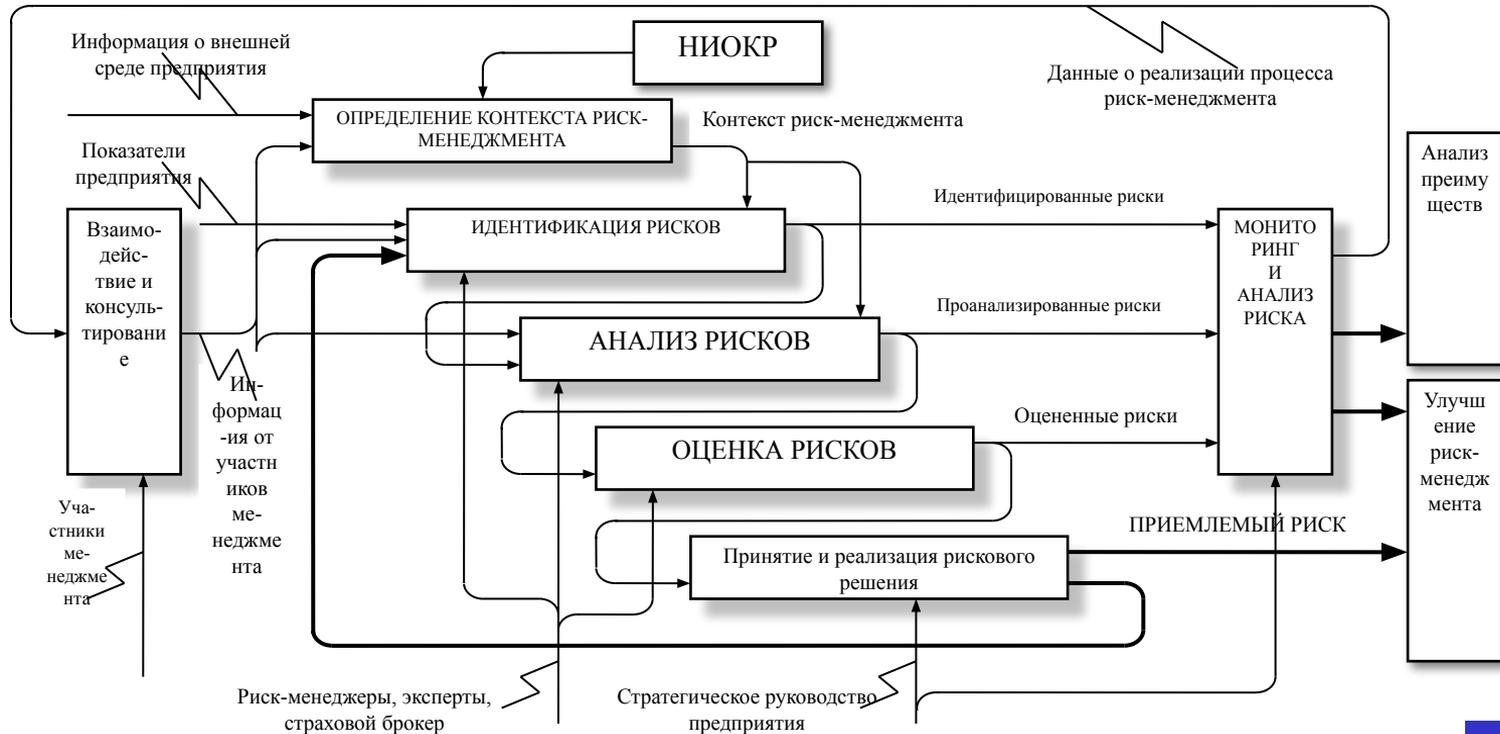
**МГТУ**

МАГНИТОГОРСКИЙ  
ГОСУДАРСТВЕННЫЙ  
ТЕХНИЧЕСКИЙ  
УНИВЕРСИТЕТ  
ИМ. Г. И. НОСОВА

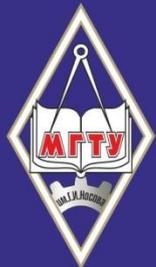
# Многоуровневый показатель инновационного риска корпорации



# Общая схема элементов процесса риск-менеджмента

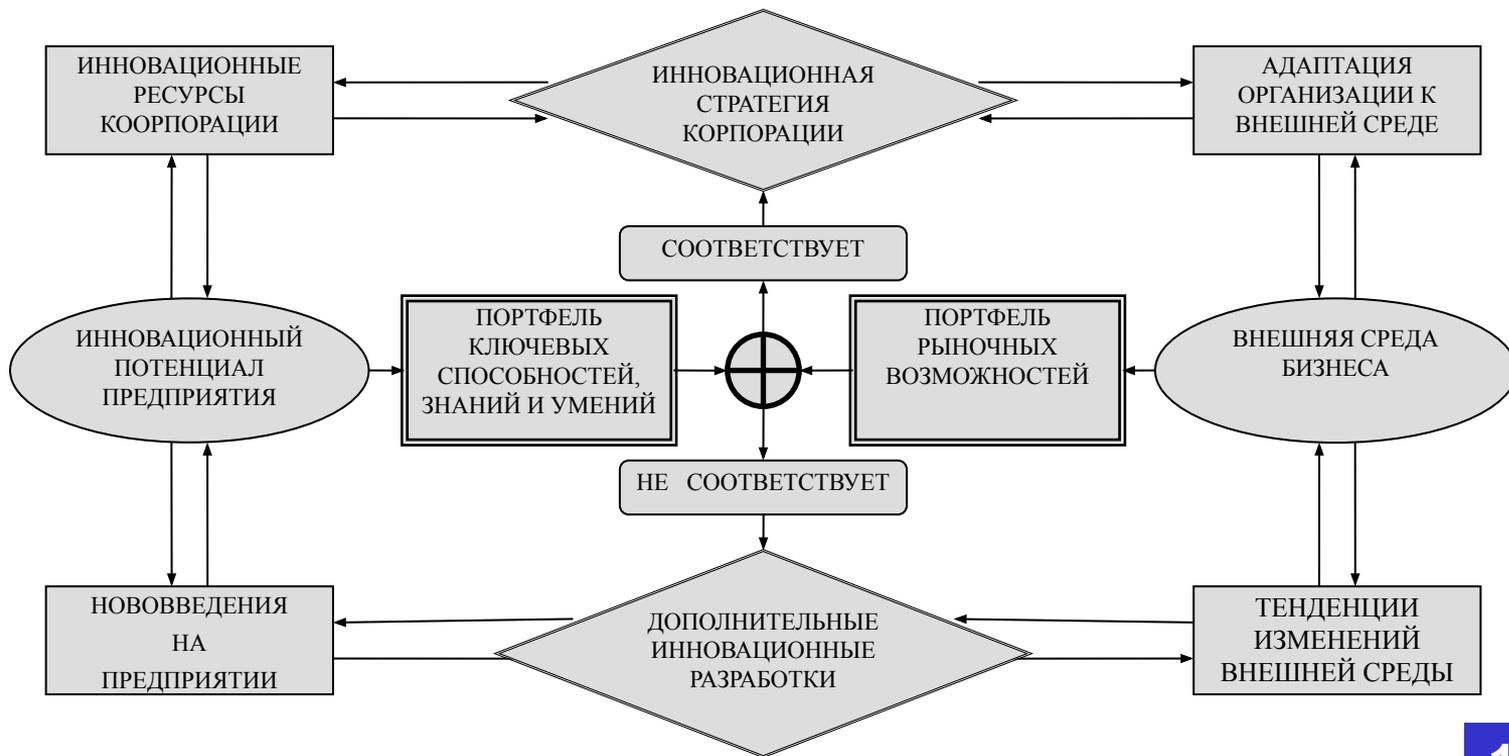


**МГТУ**  
МАГНИТОГОРСКИЙ  
ГОСУДАРСТВЕННЫЙ  
ТЕХНИЧЕСКИЙ  
УНИВЕРСИТЕТ  
ИМ. Г. И. НОСОВА



**МГТУ**  
МАГНИТОГОРСКИЙ  
ГОСУДАРСТВЕННЫЙ  
ТЕХНИЧЕСКИЙ  
УНИВЕРСИТЕТ  
ИМ. Г. И. НОСОВА

# Формирование инновационного потенциала в условиях высокого риска

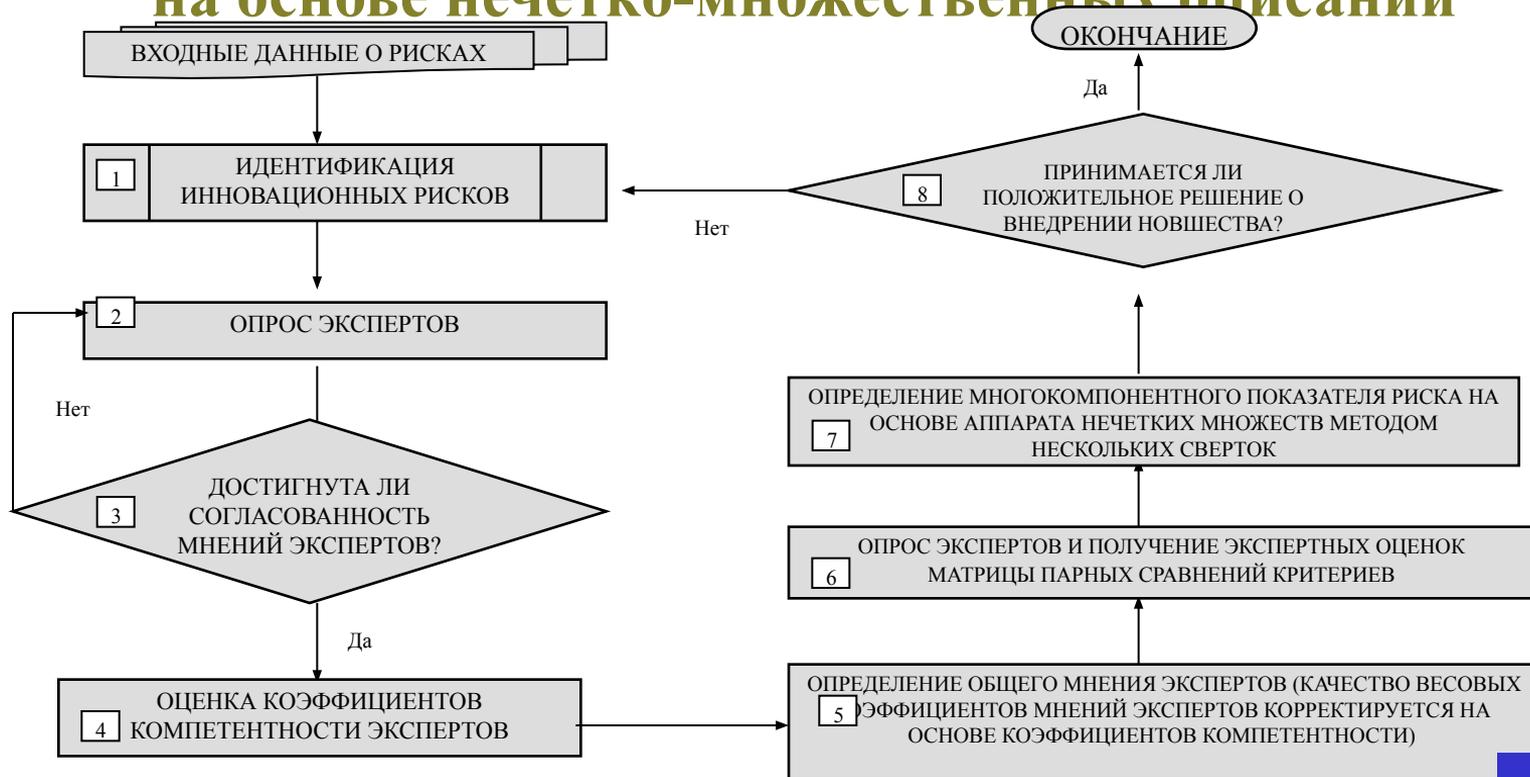


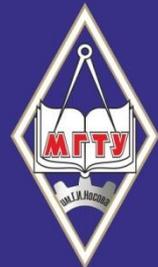


**МГТУ**

МАГНИТОГОРСКИЙ  
ГОСУДАРСТВЕННЫЙ  
ТЕХНИЧЕСКИЙ  
УНИВЕРСИТЕТ  
ИМ. Г. И. НОСОВА

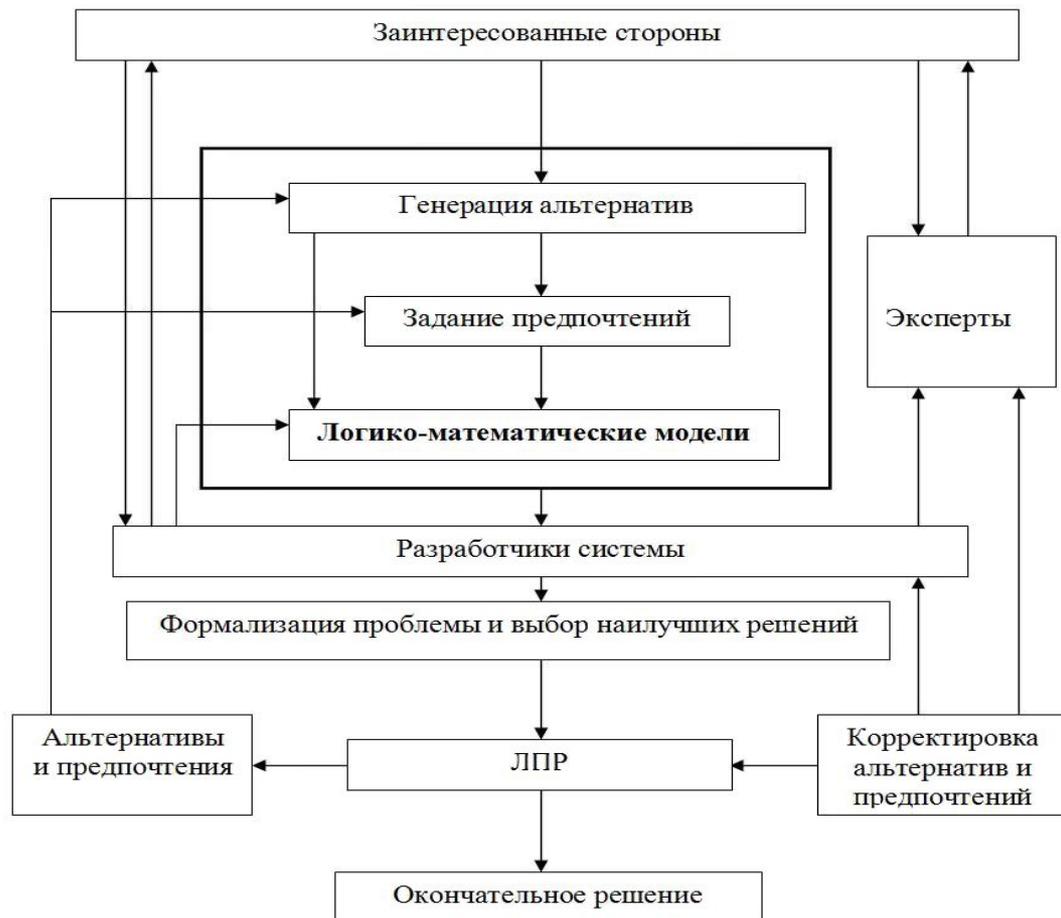
# Алгоритм оценки уровня инновационного риска на основе нечетко-множественных описаний





**МГТУ**  
МАГНИТОГОРСКИЙ  
ГОСУДАРСТВЕННЫЙ  
ТЕХНИЧЕСКИЙ  
УНИВЕРСИТЕТ  
ИМ.С.И.ЛОСОВА

# Структурная схема когнитивно-нечеткой процедуры управления риском





**МГТУ**  
 МАГНИТОГОРСКИЙ  
 ГОСУДАРСТВЕННЫЙ  
 ТЕХНИЧЕСКИЙ  
 УНИВЕРСИТЕТ  
 ИМ. Г. И. НОСОВА

# Квалификационные категории экспертов для процедуры оценки рисков

$$\delta \in \{I, II, III, \Omega\}$$

$$(e, s, t) \in E \times S \times T$$

$$E = \{e_1, e_2, e_3\}$$

$$S = \{s_1, s_2, s_3\}$$

$$T = \{t_1, t_2, t_3\}$$

$e_1$  – базовое образование совпадает с профилем приоритетного направления

$s_1$  – академик, чл.-корр. РАН; академик, чл.-корр. отраслевой академии

$t_1$  – опыт работы не менее 10 лет

$e_2$  – базовое образование по смежной специальности

$s_2$  – профессор, доктор наук

$t_2$  – опыт работы не менее 5 лет

$e_3$  – базовое образование по иной специальности

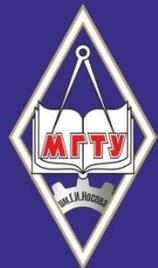
$s_3$  – доцент, кандидат наук, старший научный сотрудник

$t_3$  – опыт работы не менее 1 года

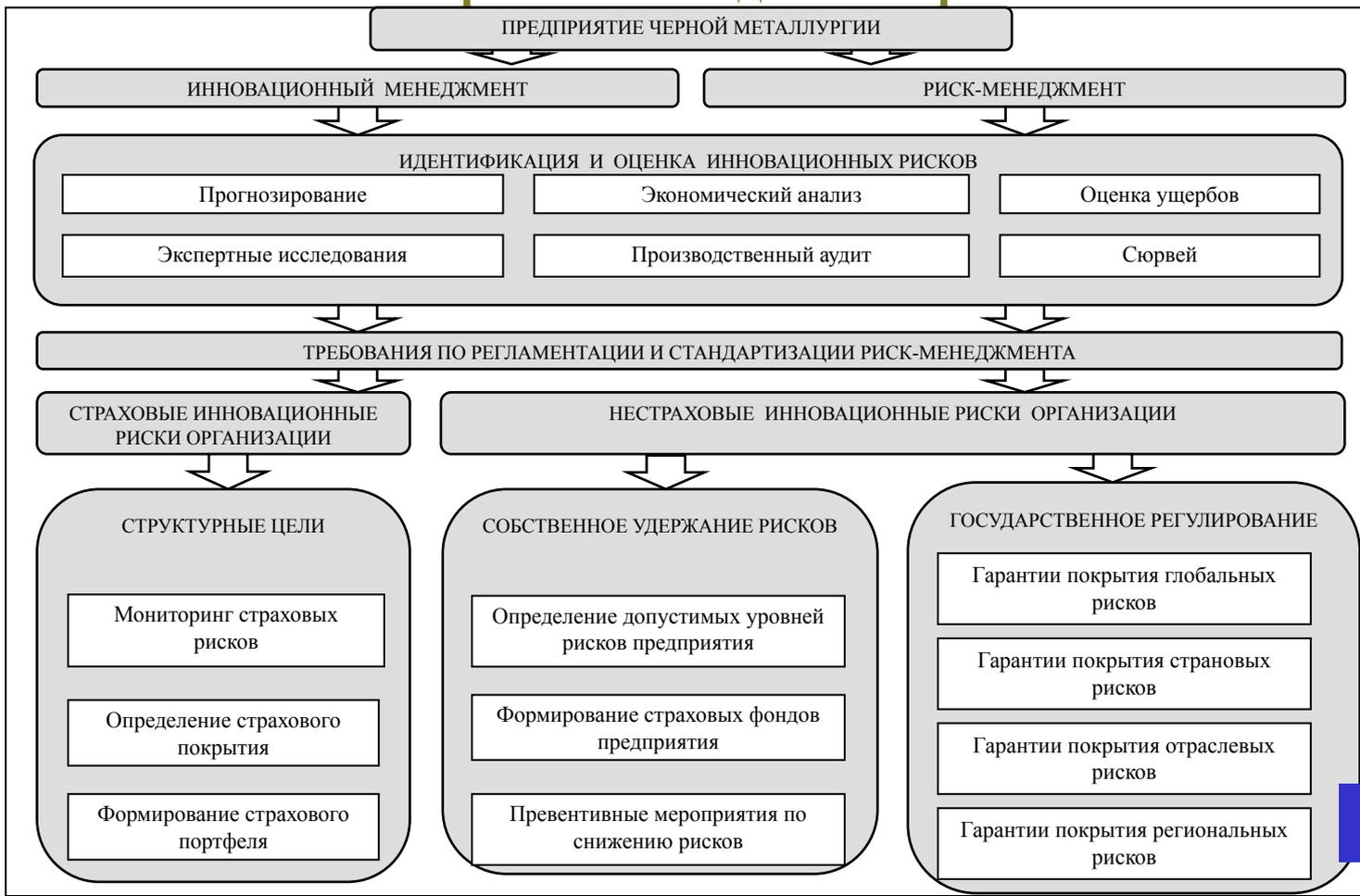
$$E \times S \times T \rightarrow \{I, II, III, \Omega\} \quad \delta = \delta(e, s, t)$$

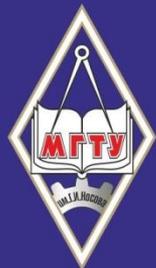
$$\delta = \begin{cases} I, \text{ если } : \bar{e}s_1t_1 \vee e_1s_1t_2 \vee e_1s_2t_1; \\ II, \text{ если } : e_1s_1t_3 \vee e_1s_2t_2 \vee e_1s_3t_1 \vee e_2s_1t_2 \vee e_2s_2t_1 \vee e_3s_1t_1; \\ III, \text{ если } : e_1\bar{s}t_3 \vee e_1s_3t_2 \vee e_2s_1t_3 \vee e_2s_s t_2 \vee e_3s_1t_2 \vee e_3s_2t_1; \\ \Omega, \text{ если } : \bar{\bar{e}}\bar{s}t_3 \vee \bar{\bar{e}}s_2\bar{t} \vee e_3s_1t_3 \vee e_3s_2t_2, \end{cases}$$

# Гармонизация требований стандартизации риск-менеджмента и экспертных исследований риска



**МГТУ**  
МАГНИТОГОРСКИЙ  
ГОСУДАРСТВЕННЫЙ  
ТЕХНИЧЕСКИЙ  
УНИВЕРСИТЕТ  
ИМ. Г. И. НОСОВА



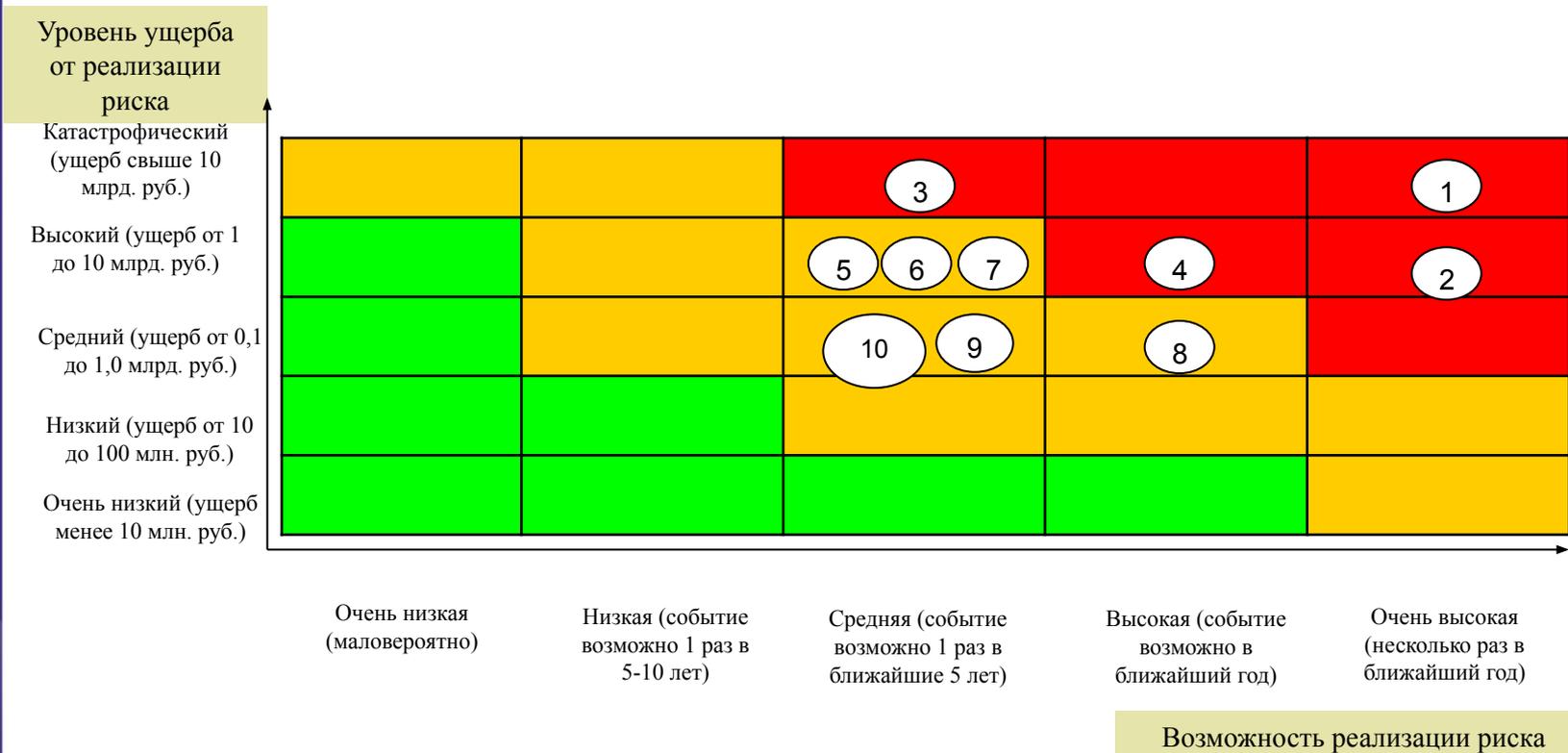


**МГТУ**

МАГНИТОГОРСКИЙ  
ГОСУДАРСТВЕННЫЙ  
ТЕХНИЧЕСКИЙ  
УНИВЕРСИТЕТ  
ИМ. Г. И. НОСОВА

# Карта рисков корпорации при внедрении инновационного проекта строительства прокатного стана

15





**МГТУ**

МАГНИТОГОРСКИЙ  
ГОСУДАРСТВЕННЫЙ  
ТЕХНИЧЕСКИЙ  
УНИВЕРСИТЕТ  
ИМ. Г. И. НОСОВА

**БЛАГОДАРЮ ЗА  
ВНИМАНИЕ!!!**

