

Управление риском

ежеквартальный аналитический журнал

№1 (65) 2013

www.library.ankil.ru

В номере:

Теория управления риском

Риск ошибочных прогнозных оценок параметров социально-экономических систем
Синергетический аспект обоснования теории и технологии исчисления хаоса в нелинейных процессах и системах

Общие вопросы управления риском

Управление бюджетными рисками субъектов Российской Федерации на современном этапе управления государственными финансами

Модели и методы управления рисками в социально-экономических системах

Основные принципы стандартизации процесса идентификации рисков промышленного предприятия

Финансовые инструменты регулирования

Модели риска и прогнозирования банкротства предприятия

Ценообразование кредитов на основе подхода «денежный поток под риском»: комплексный подход к кредитному риску и риску ликвидности

Моделирование амортизации в задаче оценки динамики восстановления капитала инвестиционного проекта

Советы риск-менеджера

Риски новых медицинских технологий на примере телемедицины

Проблемы устойчивого развития экономики в мировом и региональном измерении

УПРАВЛЕНИЕ РИСКОМ

ежеквартальный аналитический журнал



1(65), 2013

Свидетельство о регистрации
в Министерстве печати и информации
РФ №014561

Журнал рекомендован ВАК для научных
публикаций

Редакция: ООО «Анкил»

105005, Москва, Елизаветинский пер., 6, оф. 23.

Тел./факс: (499)265-37-18, 267-75-73.

Учредитель: Р.Т. Юлдашев
Над номером работали:

Шеф-редактор: Р.Т. Юлдашев
академик РАЕН, д.э.н., профессор
yuldashev@ankil.ru

Главный редактор: А.В. Мельников
д.ф.-м.н., профессор Университета Альберта
(Канада)

Отв. секретарь: Я.К. Макарова
makarova@ankil.ru

Компьютерная верстка: О.А. Снегирева

Корректор: Н.С. Горбатюк

Редакционный совет:

Акимов В.А., д.т.н., профессор
Бадюков В.Ф., д.ф.-м.н., профессор (Хабаровск)
Балабанов В.С., д.э.н., профессор
Гафуров И.Р., д.э.н., профессор
Кирсанов К.А., д.э.н., профессор
Ларионов В.И., д.т.н., профессор
Лесных В.В., д.т.н., профессор
Порфирьев Б.Н., д.э.н., профессор
Рачев С.Т., д.ф.-м.н., профессор (Германия)
Степанов А.В., д.ф.-м.н., профессор
Холодный В.А., профессор (США)
Юрьева Т.В., д.э.н., профессор

Коммерческий отдел:

Отдел подписки: Н.С. Смирнова smirnova@ankil.info

Реализация книг: А.В. Павлова pavlova@ankil.info

Журнал "УПРАВЛЕНИЕ РИСКОМ"
принимает к публикации балансы и отчеты

Подписные индексы журнала в агентствах:

"Книга-Сервис" – 88743, "Роспечать" – 48993,
а также в комплектах

Альтернативная подписка: "Союзпечать" 707-12-88,
707-12-89, 707-16-58; "Бизнеспресс Курьер" (Нижний
Новгород) (8312) 28-10-14; "Вся пресса" 787-34-48; "Дельта
Пост" 928-87-62; "Гелиус-Гранд" 684-55-34, 500-00-60;
"Курьер-прессервис" 933-30-72; "МК-периодика" 281-57-15;
"Корпоративная почта" 953-92-62; "Орион-М" (Тольятти)
(8482) 30-08-84, 937-49-59(58); "Аргос-ГАЛ" 603-27-31(32);
"Урал-пресс XXI" в городах: (Екатеринбург) (343) 375-80-71,
(Нижний Тагил) (3435) 41-14-48; «Южно-уральская почта»
(Челябинск) (351) 262-90-03; «Парма-пресс» (Пермь) (3422)
60-24-40; "ООО «Коммерсант-курьер» в городах: (Казань)
(8432) 91-09-99(48); (Уфа) (3472) 79-99-24; (Волгоград) (8442)
33-22-07; (Пермь) (3422) 40-89-68; (Набережные Челны)
(8552) 59-82-93; (Самара) (8462) 65-41-64; (Саратов) (8452)
27-32-25; (Тольятти) (8482) 20-83-78.

© УПРАВЛЕНИЕ РИСКОМ, 2013

Формат 60x84/8.

Объем 6 печ. л. (усл.-печ. л. 7).

Бумага офсетная. Тираж 1000 экз.

Отпечатано в ОП и МТ МГИМО(У) МИД
119454, Москва, проспект Вернадского, 76
8-495-434-93-69

В НОМЕРЕ:

ТЕОРИЯ УПРАВЛЕНИЯ РИСКОМ

- 2 С.И. Спивак, О.Г. Кантор
Риск ошибочных прогнозных оценок параметров
социально-экономических систем
- 7 Геннадий Подшивалов
Синергетический аспект обоснования теории
и технологии исчисления хаоса в нелинейных процессах
и системах

ОБЩИЕ ВОПРОСЫ УПРАВЛЕНИЯ РИСКОМ

- 22 Дарья Горохова
Управление бюджетными рисками субъектов Российской
Федерации на современном этапе управления государствен-
ными финансами
- 28 Марина Николаева, Ольга Зотова, Айгуль Агадуллина,
Модели и методы управления рисками
в социально-экономических системах
- 35 Игорь Ларионов
Основные принципы стандартизации
процесса идентификации рисков промышленного
предприятия

ФИНАНСОВЫЕ ИНСТРУМЕНТЫ РЕГУЛИРОВАНИЯ

- 44 Артур Мицель, Александр Кабалин
Модели риска и прогнозирования банкротства предприятия
- 53 Игорь Волошин
Ценообразование кредитов
на основе подхода «денежный поток под риском»:
комплексный подход к кредитному риску
и риску ликвидности
- 58 Людмила Бабешко, Вячеслав Царьков
Моделирование амортизации в задаче оценки динамики вос-
становления капитала инвестиционного проекта

СОВЕТЫ РИСК-МЕНЕДЖЕРА

- 66 Ольга Шимбирева
Риски новых медицинских технологий
на примере телемедицины
- 68 Борис Порфирьев, Николай Терентьев
Проблемы устойчивого развития экономики в мировом
и региональном измерении

Требования к статьям**Общие требования:**

1. Статья должна быть оригинальной, не опубликованной ранее и не представленной к печати в других изданиях;
2. В приложении к статье должны быть даны аннотация (до 200 знаков) и ключевые слова;
3. Статья обязательно должна содержать вступительную и заключительную части, в которых отражаются цель написания статьи и выводы автора, содержащие описание возможностей практического применения;
4. Весь библиографический аппарат должен быть оформлен в соответствии с требованиями, предъявляемыми к научным публикациям.
5. Желательно предоставление варианта английского написания фамилии автора, а также названия статьи;
6. Если автор не имеет научных степеней по теме представленной статьи, необходимо предоставить рецензию и контактные данные рецензента. Статьи, не содержащие ссылки на рецензентов, публикуются по остаточному принципу или на платной основе;
7. Предполагается, что автор при написании статей пользуется несколькими источниками.

Технические требования:

1. Статья должна представляться в редакцию в электронном (Word) и в бумажном виде, распечатанная общедоступным шрифтом 12 пт с полуторным интервалом;
2. На страницах должны быть проставлены номера и оставлены поля;
3. При наборе формул должны быть использованы формульные редакторы: MS Equation или MathType 4. При этом однострочные формулы могут быть набраны обычным текстом с надстрочными и подстрочными индексами;
4. Формулы, таблицы и сноски (не концевые) должны быть оформлены стандартными средствами редактора;
5. Графики, диаграммы и т.п. могут быть оформлены в Word'e или Excel'e и вставлены в текст по смыслу. Допускается использование графического векторного файла в формате wmf/emf или cdr v.10. Такие объекты должны быть пронумерованы и иметь название.

Авторское право:

Автор соглашается с условиями публикации статьи в журнале с учетом следующего:

1. Издательство получает исключительное право на публикацию и распространение статьи под именем автора, включая переиздание, опубликование в электронном виде и иными доступными способами, а также перевод статьи или ее части на иностранные языки.
2. Автор имеет право однажды опубликовать статью в другом издании (предварительно указать) с обязательной ссылкой на первую публикацию. При публикации в Интернете автор обязуется указать сроки публикации и источник публикации с активной гиперссылкой на страницу журнала — www.library.ankil.ru и следить за ее актуальностью в случае изменения этого адреса.
3. Во всех остальных случаях автор и третьи лица обязаны получить предварительное согласие издательства на публикацию статьи в других изданиях или по другим адресам в Интернете. Автор, при обращении к нему третьих лиц, должен сообщить о таких условиях.

Ответственность за достоверность фактов, изложенных в материалах номера, несут их авторы.

Риск ошибочных прогнозных оценок параметров социально-экономических систем

Risk of erroneous forecasts of socio-economic systems parameters

Спивак С.И.,

доктор физико-математических наук, профессор, зав. кафедрой математического моделирования БашГУ

Кантор О.Г.,

кандидат физико-математических наук, доцент, старший научный сотрудник ИСЭИ УНЦ РАН

Spivak S.I.,

Kantor O.G.

***Аннотация:** в целях снижения риска ошибочных прогнозных оценок параметров социально-экономических систем предложено применять метод построения аппроксимирующей функции, в основу которого положен подход Л.В. Канторовича. Предлагаемый метод нивелирует неточности социально-экономических наблюдений и в отличие от классических статистических методов позволяет учитывать дополнительные условия.*

***Ключевые слова:** прогнозирование, риск ошибочных прогнозных оценок, математическая обработка наблюдений, подход Л.В. Канторовича.*

***Annotation:** based on the approach of L.V. Kantorovich, a new method of constructing the approximating function proposed to apply to reduce the risk of erroneous forecasts of socio-economic systems parameters. The proposed method eliminates the inaccuracies of socio-economic observations and in contrast to the classical statistical methods allow to take into account additional requirements.*

***Key words:** prediction, risk of erroneous forecasts, mathematical treatment of observations, approach of L.V. Kantorovich.*