

Управление Риском

АНКИМ®
А

ежеквартальный аналитический журнал

№4 (72) 2014

www.library.ankil.ru

В номере:

ТЕОРИЯ И ОБЩИЕ ВОПРОСЫ УПРАВЛЕНИЯ РИСКОМ

Оценка экономической эффективности инвестиционного проекта в нефтегазовой отрасли

Интервальное оценивание параметров математических моделей с учетом «старения» информации

Оценка рисков поступления доходов консолидированных бюджетов регионов Северо-Западного федерального округа

УПРАВЛЕНИЕ РИСКОМ И БЕЗОПАСНОСТЬ

Классификация методологических принципов организационно-технического управления процессами защиты информации, обеспечивающего снижение риска несанкционированного доступа к информационным ресурсам потенциально опасных объектов

Управление рисками – важнейший ресурс развития предприятия

ЭКОНОМИЧЕСКИЕ МЕТОДЫ УПРАВЛЕНИЯ

Неравновесие – условие жизни экономических систем

СОВЕТЫ РИСК-МЕНЕДЖЕРА

Концепция риск-менеджмента виртуальной торговой площадки (портала) микрофинансирования

ПЕРЕЧЕНЬ ПУБЛИКАЦИЙ ЗА 2014 г.

СТРАХОВОЕ
Дело

Финансовый
Бизнес

СТРАХОВОЕ
ПРАВО

ISSN 1684-6303



9 771684 630005

УПРАВЛЕНИЕ РИСКОМ

ежеквартальный аналитический журнал



4(72), 2014

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.

E-mail: info@ankil.info

Учредитель: Р.Т. Юлдашев
Над номером работали:

Шеф-редактор: Р.Т. Юлдашев
академик РАЕН, д.э.н., профессор

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

Отв. секретарь: Я.К. Макарова

Компьютерная верстка: Т.Л. Забегаева

Корректор: Н.А. Соколова

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 (Казань)
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 info@ankil.info

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

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; “Оризон-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, 2014

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 И ОБЩИЕ ВОПРОСЫ

УПРАВЛЕНИЯ РИСКОМ

- 3 *Артур Мицель, София Козловских*
Оценка экономической эффективности
инвестиционного проекта в нефтегазовой отрасли
- 12 *Семен Спивак, Ольга Кантор*
Интервальное оценивание параметров математических
моделей с учетом «старения» информации
- 23 *Антон Галухин*
Оценка рисков поступления доходов
консолидированных бюджетов регионов
Северо-Западного федерального округа

УПРАВЛЕНИЕ РИСКОМ И БЕЗОПАСНОСТЬ

- 29 *Алексей Окрачков*
Классификация методологических принципов
организационно-технического управления
процессами защиты информации, обеспечивающего
снижение риска несанкционированного доступа
к информационным ресурсам потенциально
опасных объектов
- 39 *Ирина Вавилова*
Управление рисками – важнейший ресурс развития
предприятия

ЭКОНОМИЧЕСКИЕ МЕТОДЫ УПРАВЛЕНИЯ

- 47 *Владимир Знаменский, Елена Вагина*
Неравновесие – условие жизни экономических систем

СОВЕТЫ РИСК-МЕНЕДЖЕРА

- 59 *Виктор Терюхов*
Концепция риск-менеджмента виртуальной торговой
площадки (портала) микрофинансирования

63 ПЕРЕЧЕНЬ ПУБЛИКАЦИЙ ЗА 2014 Г.

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 конечные) 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.

Вниманию авторов!

Руководство издательства «Анкил» для продвижения журналов «Страховое дело», «Страховое право», «Финансовый бизнес» и «Управление риском» в современном научно-образовательном пространстве, а также для повышения эффективности своей работы и доступности информации широкому кругу читателей, авторов на территории России, стран СНГ и Балтии, а также для присвоения номера DOI автору и его статье, предлагает следующее.

В дополнение к ОБЩЕЙ инструкции по оформлению статей, расположенной рядом и опубликованной на сайте www.info.ankil.ru, и дальнейшей публикации статей в журналах издательства ООО «Анкил» и для размещения в библиотеке РИНЦ (или иначе НЭБ) необходима регистрация авторов на сайте <http://naukaru.ru/>.

Авторы статей, которым присваивается номер DOI, заполняют как минимум раздел «Научные сведения» и часть раздела «Общие сведения» Профиля в Личном кабинете. О регистрации и заполнении Профиля есть видеоинструкция, расположенная в разделе «Помощь»: <http://naukaru.ru/articles/help#videoinstructions>.

Требования к предоставлению метаданных

Необходимо предоставлять следующую информацию об авторах и статье:

- Ф.И.О. на русском и английском языках;
- телефон автора, e-mail автора;
- страна, область, город проживания;
- ученая степень, ученое звание, место работы;
- название статьи на русском и английском языках;
- аннотация на русском и английском языках;
- ключевые слова на русском и английских языках;
- список литературы на русском.

Укажите журнал, в котором хотите опубликовать свою статью (на русском и английском языке):

1. Страховое дело / Insurance business
2. Страховое право / Insurance right
3. Финансовый бизнес / Financial business
4. Управление риском / Management of risk.

Перечень публикаций журнала за 2014 год

№ 1

№ 2

ТЕОРИЯ И ОБЩИЕ ВОПРОСЫ УПРАВЛЕНИЯ РИСКОМ

ТЕОРИЯ И ОБЩИЕ ВОПРОСЫ УПРАВЛЕНИЯ РИСКОМ

2 *Мария Коробко*
Анализ и систематизация основных методов и подходов к управлению репутационными рисками предприятий

3 *Александр Бардин, Наталья Солдатова*
Гарантии и риски в одной иерархической игре

6 *Сергей Белкин, Елена Котова*
Факторы риска в целеполагании инновационного развития России и трансформации «симулякризиса» власти в «нематериальные авуары» экономического роста

УПРАВЛЕНИЕ РИСКОМ И БЕЗОПАСНОСТЬ

УПРАВЛЕНИЕ РИСКОМ И БЕЗОПАСНОСТЬ

11 *Владимир Галайко*
Управление рисками проектов в условиях неопределенности

11 *Евгений Захаров, Михаил Пучков, Владимир Ушаков*
Анализ существующих методик оценки эффективности систем физической защиты потенциально опасных объектов

17 *Вадим Белик*
Совершенствование системы маркетинга персонала на предприятиях энергетической сферы в условиях риска

15 *Владислав Жуковский, Наталья Солдатова*
Риски при диверсификации вклада

21 *Сергей Ермасов, Наталья Ермасова*
Формирование систем многоуровневого финансирования рисков инноваций

25 *Николай Мельников, Виктор Фин, Денис Леонов*
Способы уменьшения коммерческого риска разработки современных отечественных ультразвуковых медицинских диагностических устройств экспертного класса в рыночных условиях

37 *Евгений Захаров, Михаил Пучков*
Анализ существующих методик обоснования систем физической защиты потенциально опасных объектов

31 *Владимир Знаменский*
Кризисы, антикризисное управление, генезис антикризисного управления

ЭКОНОМИЧЕСКИЕ МЕТОДЫ УПРАВЛЕНИЯ

ЭКОНОМИЧЕСКИЕ МЕТОДЫ УПРАВЛЕНИЯ

41 *Валентина Каргинова*
Компенсация финансовых потерь на фондовом рынке: необходимость и оптимальная доля

41 *Михаил Кричевский*
Мягкие вычисления при оценке кредитоспособности

ФИНАНСОВЫЕ ИНСТРУМЕНТЫ РЕГУЛИРОВАНИЯ

52 *Роман Максимов*
Снижение рисков инвестиционной деятельности с помощью лизинга

47 *Андрей Фалин, Геннадий Фалин*
Квалификационный экзамен по финансовой математике Института и факультета актуариев Великобритании

58 *Дмитрий Бураков*
Кредитный риск и стадное поведение: взаимосвязь и методы идентификации

62 *Ефим Бронштейн, Фан Исхаков*
Чувствительность компромиссного договора перестрахования к изменениям предпочтений участников договора

№ 3

**ТЕОРИЯ И ОБЩИЕ ВОПРОСЫ
УПРАВЛЕНИЯ РИСКОМ**

- 2 *Наталья Ермасова, Сергей Ермасов*
Параметризация моделей смешанного финансирования управления чистым интегральным риском инновационной организации
- 11 *Мария Прохорова*
О связи решений задач управления портфелем с линейной сверткой «математическое ожидание – дисперсия» и с ограничением по величине риска

УПРАВЛЕНИЕ РИСКОМ И БЕЗОПАСНОСТЬ

- 18 *Ильдар Тазутдинов*
Особые экономические зоны в контексте экономической безопасности государства
- 26 *Евгений Захаров, Михаил Пучков*
Основа методического аппарата оценки эффективности и обоснования систем физической защиты потенциально опасных объектов
- 36 *Татьяна Самсонова*
Риски и кризисы в организационном развитии современных компаний: проблемы взаимосвязи

**ЭКОНОМИЧЕСКИЕ МЕТОДЫ
УПРАВЛЕНИЯ**

- 44 *Наталья Ермасова, Сергей Ермасов*
Модели смешанного финансирования управления чистым интегральным риском организации

ОРГАНИЗАЦИЯ УПРАВЛЕНИЯ

- 50 *Рустем Юлдашев, Юрий Фирсов*
Организационное моделирование как процесс преобразования знаний

№ 4

**ТЕОРИЯ И ОБЩИЕ ВОПРОСЫ
УПРАВЛЕНИЯ РИСКОМ**

- 3 *Артур Мицель, София Козловских*
Оценка экономической эффективности инвестиционного проекта в нефтегазовой отрасли
- 12 *Семен Спивак, Ольга Кантор*
Интервальное оценивание параметров математических моделей с учетом «старения» информации
- 23 *Антон Галухин*
Оценка рисков поступления доходов консолидированных бюджетов регионов Северо-Западного федерального округа

УПРАВЛЕНИЕ РИСКОМ И БЕЗОПАСНОСТЬ

- 29 *Алексей Окрачков*
Классификация методологических принципов организационно-технического управления процессами защиты информации, обеспечивающего снижение риска несанкционированного доступа к информационным ресурсам потенциально опасных объектов
- 39 *Ирина Вавилова*
Управление рисками – важнейший ресурс развития предприятия

**ЭКОНОМИЧЕСКИЕ МЕТОДЫ
УПРАВЛЕНИЯ**

- 47 *Владимир Знаменский, Елена Вагина*
Неравновесие – условие жизни экономических систем

СОВЕТЫ РИСК-МЕНЕДЖЕРА

- 59 *Виктор Терюхов*
Концепция риск-менеджмента виртуальной торговой площадки (портала) микрофинансирования
- 63 **ПЕРЕЧЕНЬ ПУБЛИКАЦИЙ ЗА 2014 г.**