

Управление Риском



ежеквартальный аналитический журнал

№4 (76) 2015

www.ankil.info/36.html

В номере:

УПРАВЛЕНИЕ РИСКОМ И БЕЗОПАСНОСТЬ

Учет фактора риска в организации жизнедеятельности моногорода как урбанистической системы

ТЕОРИЯ УПРАВЛЕНИЯ РИСКОМ

Проблемы и методология нелинейного синергетического анализа

Модель управления рисками COSO 2013 –
новый уровень риск-менеджмента

ТЕОРИЯ И ОБЩИЕ ВОПРОСЫ УПРАВЛЕНИЯ РИСКОМ

Оценка влияния климатических изменений на здоровье населения европейской части российской Арктики

Определение вероятности получения выигрыша при использовании опциона в качестве инструмента хеджирования

Особенности процесса управления проектными рисками: аксономия и синергия рисков

Методология оценки срочной структуры безрисковых процентных ставок по котировкам облигаций и CDS различных эмитентов



Управление Риском

ежеквартальный аналитический журнал



4 (76), 2015

Свидетельство о регистрации
в Министерстве печати и информации РФ № 014561

Научное издание «Управление риском» входит в новую редакцию (29.12.2015 г.) Перечня ведущих рецензируемых научных журналов, рекомендованных Высшей аттестационной комиссией (ВАК) при Министерстве образования и науки РФ для публикации материалов диссертационных работ на соискание ученой степени доктора и кандидата наук по экономической специальности

Редакция: ООО «Анkil»
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

Главный редактор: А.В. Мельников, д.ф.-м.н., профессор
Университета Альберта (Канада)
Шеф-редактор: Р.Т. Юлдашев, академик РАЕН, д.э.н.,
заведующий кафедрой управления рисками и страхования
МГИМО (У) МИД РФ

Отв. секретарь: Я.К. Макарова m_ankil@mail.ru
Компьютерная верстка: Т.Л. Забегаева
Корректор: Н.А. Соколова

Редакционный совет:

Акимов В.А., д.т.н., профессор, Всероссийский научно-исследовательский институт по проблемам гражданской обороны и чрезвычайных ситуаций МЧС России (Федеральный центр науки и высоких технологий) — начальник института

Бадюков В.Ф., д.ф.-м.н., профессор, зав. кафедрой теории риска и страхования Хабаровской государственной академии экономики и права (Хабаровск)

Балабанов В.С., д.э.н., профессор, президент Российской Академии предпринимательства

Бронштейн Е.М., д.ф.-м.н., профессор кафедры вычислительной математики и кибернетики Уфимского государственного авиационного технического университета (Уфа)

Гафуров И.Р., д.э.н., профессор, ректор Казанского федерального (Приволжского) университета

Дадалко В.А., д.э.н. профессор кафедры анализа рисков и экономической безопасности ФГБОУ ВПО «Финансовый университет при Правительстве Российской Федерации»

Лайков А.Ю., к.э.н., доцент, генеральный директор ООО СБ «РИФАМС»

Лесных В.В., д.т.н., профессор, директор Центра «Анализ рисков» в ООО «НИИгазэкономика»

Порфирьев Б.Н., член-корреспондент РАН, д.э.н., профессор Института народнохозяйственного прогнозирования РАН

Рачев С.Т., д.ф.-м.н., профессор Государственного университета штата Нью-Йорк «СТОНИ-БРУК» (Нью-Йорк, США)

Степанов А.В., д.ф.-м.н., профессор, зав. кафедрой математических методов и информационных технологий МГИМО (У) МИД РФ

Холодный В.А., д.ф.-м.н., профессор (Вена, Австрия)

Цветкова Л.И., к.э.н., доцент кафедры управления рисками и страхования МГИМО (У) МИД РФ

Юрьева Т.В., д.э.н., профессор, зав. отделением «Управления проектами и программами», Российская академия народного хозяйства и государственной службы при Президенте Российской Федерации

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-пресссервис» 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, 2015

Формат 60x84/8. Объем 6 печ. л. (усл.-печ. л. 7).

Бумага офсетная. Тираж 1000 экз.

Отпечатано в ОП и МТ МГИМО (У) МИД РФ

119454, Москва, проспект Вернадского, 76, (495) 434-93-69

В НОМЕРЕ:

УПРАВЛЕНИЕ РИСКОМ И БЕЗОПАСНОСТЬ

- 3 Элеонора Матюгина, Наталья Ярушкина
Учет фактора риска в организации жизнедеятельности моногорода как урбанистической системы

ТЕОРИЯ УПРАВЛЕНИЯ РИСКОМ

- 8 Геннадий Подшивалов
Проблемы и методология нелинейного синергетического анализа
- 26 Елизавета Сахарчук, Николай Артамонов, Людмила Цветкова
Модель управления рисками COSO 2013 — новый уровень риск-менеджмента

ТЕОРИЯ И ОБЩИЕ ВОПРОСЫ УПРАВЛЕНИЯ РИСКОМ

- 35 Борис Ревич, Николай Терентьев
Оценка влияния климатических изменений на здоровье населения европейской части российской Арктики
- 43 Маргарита Пинегина
Определение вероятности получения выигрыша при использовании опциона в качестве инструмента хеджирования
- 49 Юлия Слепыхина
Особенности процесса управления проектными рисками: таксономия и синергия рисков
- 59 Марат Курбангалеев, Виктор Лапшин, Сергей Смирнов
Методология оценки срочной структуры безрисковых процентных ставок по котировкам облигаций и CDS различных эмитентов

79 ПЕРЕЧЕНЬ ПУБЛИКАЦИЙ ЗА 2015 г.

Общие требования к статьям:

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 на русском и английском языках.
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. Одновременно предоставляются вариант английского написания фамилии автора, названия статьи и ключевых слов.
6. Если автор не имеет научных степеней по теме представленной статьи, необходимо предоставить рецензию и контактные данные рецензента. Плата с аспирантов за публикацию рукописей не взимается.
7. Предполагается, что автор при написании статей пользуется несколькими источниками.

Технические требования:

1. Статья должна предоставляться в редакцию, набранная общедоступным шрифтом 12 пт с полуторным интервалом, в электронном (Word, OpenOffice) и бумажном виде.
2. На страницах должны быть проставлены номера и оставлены поля.
3. При наборе формул должны быть использованы формульные редакторы: MS Equation, MathType 4 или OpenOffice. 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, Excel или OpenOffice 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 — <http://www.ankil.info/36.html>, и следить за ее актуальностью в случае изменения этого адреса.
- Автор и третьи лица обязаны получить предварительное письменное согласие издательства на публикацию статьи в других изданиях или по другим адресам в Интернете, а также при распространении текстов опубликованных статей за плату. 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» 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 2015 год

№ 1

№ 2

ТЕОРИЯ И ОБЩИЕ ВОПРОСЫ УПРАВЛЕНИЯ РИСКОМ

ТЕОРИЯ И ОБЩИЕ ВОПРОСЫ УПРАВЛЕНИЯ РИСКОМ

- 3 *Владислав Жуковский, Наталья Солдатова*
Риски при диверсификации вклада
- 14 *Валерий Лесных, Валентина Алексеева, Юрий Литвин*
Современное состояние проблемы анализа организационных рисков: терминология, классификация, методы качественной и количественной оценки
- 26 *Людмила Бабешко*
Модель равновесного рынка: точность оценок параметров СОУ в рамках косвенного метода наименьших квадратов

- 3 *Борис Матвеев*
Основы спектральной теории экономического риска
- 7 *Любовь Иванова*
Банковские гарантии как инструмент снижения кредитного риска в современных условиях российской экономики
- 15 *Рустем Юлдашев*
Рисками питания можно и нужно управлять

УПРАВЛЕНИЕ РИСКОМ И БЕЗОПАСНОСТЬ

ФИНАНСОВЫЕ ИНСТРУМЕНТЫ РЕГУЛИРОВАНИЯ

- 33 *Роман Дурнев, Алёна Котосорова, Рената Галиуллина*
Системно-динамическая модель информирования населения при аварии на химически опасном объекте

- 18 *Дмитрий Бураков*
Как обуздать кредитные циклы: опыт исламской банковской модели

УПРАВЛЕНИЕ РИСКОМ И БЕЗОПАСНОСТЬ

- 25 *Ксения Лебедева, Роман Лебедев*
Угрозы безопасности систем видео-конференц-связи

ЭКОНОМИЧЕСКИЕ МЕТОДЫ УПРАВЛЕНИЯ

ТЕОРИЯ УПРАВЛЕНИЯ РИСКОМ

- 43 *Александр Кабанов*
Методика оценки эффективности управления денежными потоками в холдинговых компаниях
- 52 *Алексей Голубин, Мария Апарина (Петрова)*
Оптимизация размера премии с учетом кривой спроса на страховые услуги
- 58 *Михаил Кричевский, Юлия Козлова*
Оценка привлекательности инновационных продуктов

- 29 *Владислав Жуковский, Антон Горбатов*
Нулевые риски в однокритериальных задачах
- 38 *Лев Лабскер, Светлана Петухова*
Оптимальный выбор страны – производителя коллекции моделей на основе обобщенного критерия Гурвица
- 50 *Алхозур Цакаев, Лемис Мусаев*
Синергетический эффект как индикатор эффективности стратегии управления рисками, основанной на сделках M&A

№ 3

**ТЕОРИЯ И ОБЩИЕ ВОПРОСЫ
УПРАВЛЕНИЯ РИСКОМ**

- 3 *Артут Мицель, Николай Красненко, Инна Скрипичникова*
Экономико-математическая модель анализа финансового состояния предприятия на примере ОАО «Газпром»
- 16 *Алексей Лапсарь, Сергей Лапсарь*
Метод снижения инвестиционных рисков при разработке высокотехнологичной продукции
- 22 *Елена Колясникова, Диана Гелемянова*
Оптимальный портфель на основе EWMA-модели и стоимости под риском
- 28 *Ким Галачян*
Механизмы управления рисками концессионных соглашений через конкурсные критерии

**УПРАВЛЕНИЕ РИСКОМ
И БЕЗОПАСНОСТЬ**

- 33 *Дмитрий Мельник*
Система управления качеством и Система управления безопасностью полетов в производственной деятельности эксплуатантов гражданской авиации РФ
- 41 *Сергей Кравченко, Валерий Салыгин*
Риски магистрального нефтепроводного транспорта: востребованность опыта США и ЕС по управлению ими

**ФИНАНСОВЫЕ ИНСТРУМЕНТЫ
РЕГУЛИРОВАНИЯ**

- 49 *Дмитрий Вердиев*
Повышение финансовой эффективности сделок слияний и поглощений международных холдинговых компаний

№ 4

**УПРАВЛЕНИЕ РИСКОМ
И БЕЗОПАСНОСТЬ**

- 3 *Элеонора Матюгина, Наталья Ярушкина*
Учет фактора риска в организации жизнедеятельности моногорода как урбанистической системы

ТЕОРИЯ УПРАВЛЕНИЯ РИСКОМ

- 8 *Геннадий Подшивалов*
Проблемы и методология нелинейного синергетического анализа
- 26 *Елизавета Сахарчук, Николай Артамонов, Людмила Цветкова*
Модель управления рисками COSO 2013 — новый уровень риск-менеджмента

**ТЕОРИЯ И ОБЩИЕ ВОПРОСЫ
УПРАВЛЕНИЯ РИСКОМ**

- 35 *Борис Ревич, Николай Терентьев*
Оценка влияния климатических изменений на здоровье населения европейской части российской Арктики
- 43 *Маргарита Пинегина*
Определение вероятности получения выигрыша при использовании опциона в качестве инструмента хеджирования
- 49 *Юлия Слепухина*
Особенности процесса управления проектными рисками: таксономия и синергия рисков
- 59 *Марат Курбангалеев, Виктор Лапшин, Сергей Смирнов*
Методология оценки срочной структуры безрисковых процентных ставок по котировкам облигаций и CDS различных эмитентов

79 ПЕРЕЧЕНЬ ПУБЛИКАЦИЙ ЗА 2015 г.