

*В. П. Мешалкин, чл.-корр. РАН, докт. техн. наук, профессор,
директор Международного института логистики энергосбережения и технологической инноватики
Российского химико-технологического университета им. Д. И. Менделеева*

*А. Ю. Белозерский, канд. экон. наук, доцент Международного института логистики энергосбережения
и технологической инноватики Российского химико-технологического университета им. Д. И. Менделеева*

*М. И. Дли, докт. техн. наук, профессор филиала ГОУ ВПО «Московский энергетический
институт (технический университет)», г. Смоленск*

Методика построения комплексной математической модели управления рисками предприятия металлургической промышленности

Представленный авторами подход учитывает специфику информационных процессов одной из наиболее сложных областей менеджмента организации. Предложенный математический аппарат может быть реализован в составе специализированной системы поддержки принятия решений.

Введение

Современные условия хозяйствования металлургического предприятия характеризуются нестабильностью и высокой динамикой внутренней и внешней среды, отсутствием полной и актуальной информации о сфере деятельности, влиянием большого количества неконтролируемых и плохо контролируемых факторов, а также наличием элементов случайности. В связи с этим подавляющее большинство управленческих решений принимается в условиях неопределенности и риска.

Управление рисками представляет собой одну из основных современных концепций управления сложными системами и процессами. Необходимость использования и развития данной концепции в рамках предприятия исследуемой отрасли с точки зрения системного подхода обосновано большими размерами и сложностью управляемой системы, неясными и изменяющимися требованиями к ее структуре и функционированию.

Управление рисками — во многом субъективный процесс, в ходе которого учитываются не только количественные показатели, но и показатели, плохо поддающиеся формализации.

Под риском понимается сочетание вероятности события (нанесения ущерба) и его негативных последствий (тяжести этого ущерба). Риск является неизбежным, сопутствующим фактором функционирования предприятия. Для него характерны неожиданность и внезапность возникновения, что предполагает необходимость построения систем прогнозирования и управления рисками, основанных на мероприятиях, направленных на устранение источников риска (опасностей); предотвращение/снижение уровня риска; ликвидацию его последствий. При этом следует отметить, что наиболее эффективный механизм выработки мероприятий в процессе управления рисками металлургических предприятий — это разработка мер по устранению источников риска, а также по предотвращению (снижению)