

Риск – это опасность потери ресурсов или дохода



Рис. 7.1 Схема зон риска

СТРУКТУРА ПРОЦЕССА УПРАВЛЕНИЯ РИСКОМ

- I. Выявление (идентификация) рисков
- II. Измерение риска
- III. Выбор методов воздействия на риск при оценке их сравнительной эффективности
- IV. Организация непосредственного воздействия на риск
- V. Контроль и корректировка результатов процесса управления проектом

Методы идентификации риска

- контрольные таблицы оценки степени риска;
- анализ заинтересованных кругов;
- анализ предположений;
- анализ зависимостей.

В контрольную таблицу включаются:

- технические риски;
- риски, связанные с ходом процесса;
- организационные риски;
- риски, связанные с соблюдением сроков;
- экономические риски;
- риски, связанные с заключением договора;
- риски, основанные на внешних воздействиях.

Система показателей для расчётов риска с использованием теории вероятности

1. Математическое ожидание (E_x – expectation)

$$E_x = \sum_{i=1}^n X_i P_i$$

Система показателей для расчётов риска с использованием теории вероятности

- Дисперсия

$$D_x = \sum_{i=1}^n X_i^2 P_i - (E_x)^2$$

- Среднеквадратическое отклонение

$$\sigma = \sqrt{D_x}$$

Система показателей для расчётов риска с использованием теории вероятности

Варианты:

а) $E_x(x) = E_x(y) \quad D_x < D_y$

б) $E_x(x) > E_x(y) \quad D_x = D_y$

в) $E_x(x) > E_x(y) \quad D_x < D_y$

г) $E_x(x) > E_x(y) \quad D_x > D_y$

д) $E_x(x) < E_x(y) \quad D_x < D_y$

Коэффициент вариации

$$CV = \frac{\sigma}{E_x}$$

Методы воздействия на риски

- снижение риска (уменьшение либо размеров возможного ущерба, либо вероятности наступления неблагоприятных событий);
- сохранение риска на существующем уровне (создание специальных резервных фондов);
- передача риска (страховой компании, различного рода финансовые гарантии, поручительства)

СТРУКТУРА ПРОЦЕССА УПРАВЛЕНИЯ РИСКОМ

- IV. Организация непосредственного воздействия на риск
- V. Контроль и корректировка результатов процесса управления проектом