



Столыпинский
вестник

Научная статья

Original article

УДК 658.14

**УПРАВЛЕНИЕ РИСКАМИ В РАЗВИТИИ МЕТАЛЛУРГИЧЕСКОГО
ПРЕДПРИЯТИЯ**

**RISK MANAGEMENT IN THE DEVELOPMENT OF A METALLURGICAL
ENTERPRISE**

Карпов Иван Дмитриевич, магистрант 1 курса, СПбПУ «Санкт-Петербургский политехнический университет Петра Великого» (195251 Россия, г. Санкт-Петербург, ул. Политехническая, д. 29), тел. 8 (800) 707-18-99, ORCID: <https://orcid.org/0000-0002-7474-8463>

Karpov Ivan Dmitrievich, 1st year undergraduate, SPbPU "Peter the Great St. Petersburg Polytechnic University" (195251 Russia, St. Petersburg, Politekhnikheskaya str., 29), tel. 8 (800) 707-18-99, ORCID: <https://orcid.org/0000-0002-7474-8463>

Аннотация. В настоящее время, вся промышленность РФ подвержена влиянию большого количества рисков. Отрасль металлургии, в настоящее время, так же переживает определенные трудности в своем устойчивом развитии, прежде всего, в связи с колебанием курса национальной валюты России. В отличие от компаний, не участвующих в международном разделении труда, для поставщика, осуществляющего на постоянной основе работы для заказчика, находящегося за пределами страны своего базирования, или производящего

продукцию на внутренний рынок из компонентов зарубежного производства, валютный риск начинает играть существенную роль в планировании и осуществлении производственно-хозяйственной деятельности. В результате появляется необходимость в анализе, прогнозировании и планировании валютного риска. В настоящей статье, автором предпринята попытка научного анализа и критического осмысления управления рисками в развитии металлургического предприятия.

Abstract. At present, the entire industry of the Russian Federation is exposed to a large number of risks. The metallurgy industry, at present, is also experiencing certain difficulties in its sustainable development, primarily due to fluctuations in the exchange rate of the national currency of Russia. Unlike companies that do not participate in the international division of labor, for a supplier that performs work on a permanent basis for a customer located outside its home country, or manufactures products for the domestic market from components of foreign production, currency risk begins to play a significant role in planning and implementation of production and economic activities. As a result, there is a need for analysis, forecasting and planning of currency risk. In this article, the author made an attempt to scientific analysis and critical reflection on risk management in the development of a metallurgical enterprise.

Ключевые слова: развитие экономики, развитие металлургических предприятий, финансовая нестабильность, валютные риски, устойчивое развитие, антикризисная стратегия.

Keywords: economic development, development of metallurgical enterprises, financial instability, currency risks, sustainable development, anti-crisis strategy.

Анализируя классификацию валютных рисков, можно сделать следующий вывод, что для организаций, вовлечённых в международное разделение труда, валютный риск не является риском, влекущим исключительно потери. Данный риск является возможностью для извлечения прибыли как для отдельной компании, так и для экономической системы, включающей множество компаний.

Однако он может приводить как к бухгалтерским, так и экономическим последствиям, которые в свою очередь проявляются, не только явно, но и скрыто. То, что для одной компании несёт явную бухгалтерскую прибыль может нести скрытые негативные экономические последствия для всей экономической системы металлургического предприятия. [5, с. 58]

Также возможен обратный эффект, убыток для одной компании может повлечь положительный экономический эффект для всей системы в целом. Количество вариантов развития событий определяется количеством участников цепочки создания конечной ценности, количеством валют, используемых при расчётах и динамикой курсов валюты.

Исходным пунктом в отношениях валютного риска, как объекта управления и экономической системой как субъекта управления является цель. Цели управления валютным риском: [4, с. 115]

- полная нейтрализация рисков;
- частичная нейтрализация рисков;
- снижение неопределенности денежных потоков;
- нивелирование только отрицательных последствий реализации рисков при сохранении возможности улучшения бизнес-результатов за счет положительных последствий реализации рисков.

Таким образом, представляя валютный риск как риск, которому подвержена экономическая система через воздействие на её участников, можно подобрать наиболее подходящие достижению поставленной каждым участником цели методы управления.

Для управления валютным риском используются различные методы, которые позволяют снизить негативное воздействие или даже извлечь прибыль от изменения курса валюты. На сегодняшний день выделяют две крупных группы методов управления валютными рисками: внутренние и внешние.

К внутренним относятся методы снижения рисков в рамках коммерческой деятельности компании, использование различных внутренних организационных мер, связанных с соответствующим оформлением контрактов, варьированием

сроков платежей и поступлений, созданием встречных требований и обязательств и т.д. [1, с. 82]

К внешним методам относится хеджирование с помощью различных финансовых инструментов.

Таблица 1. Цели управления валютным риском, элементы возникновения и категории риска участников экономической системы.

Цель управления валютным риском	Элемент возникновения риска	Категория риска
Организация, осуществляющая реализацию конечной ценности		
- частичная нейтрализация рисков	Себестоимость процесса	Взаимозаменяемые риски
	Цена реализации	Взаимозаменяемые риски
Первая организация, осуществляющая часть производственного процесса		
- нивелирование только отрицательных последствий реализации рисков при сохранении возможности улучшения бизнес-результатов за счет положительных последствий реализации рисков.	Себестоимость процесса	Взаимозаменяемые риски
	Цена реализации	Взаимозаменяемые риски
Вторая организация, осуществляющая часть производственного процесса		
- нивелирование только отрицательных последствий реализации рисков при сохранении возможности улучшения бизнес-результатов за счет положительных последствий реализации рисков.	Себестоимость процесса	Взаимозаменяемые риски
	Цена реализации	Взаимозаменяемые риски
Организация, осуществляющая логистические операции		
- снижение неопределенности денежных потоков.	Себестоимость процесса	Взаимозаменяемые риски
	Цена реализации	Взаимозаменяемые риски

Так как осуществлялся такой метод управления валютным риском как изменение структуры производства металлургического предприятия, то до анализа реализуемого и остаточного риска необходимо отразить снижение самого валютного риска по каждому элементу возникновения в результате снижения объёмов производства, без учёта риска снижения покупательной способности.

Российские металлургические предприятия функционируют в условиях нестабильной экономической и политической ситуации в стране, недостаточной

покупательной способности населения, что приводит к высокой неопределенности прогнозов относительно возможного спроса, себестоимости продукции, уровня доходности (рентабельности) и результатов хозяйственной деятельности. [7, с. 102]

К тому же из-за продолжающегося кризиса современные металлургические предприятия, должны приводить свою деятельность в соответствие международным стандартам, чтобы занять достойное с точки зрения конкурентоспособности место в соответствующих сегментах мирового рынка и успешно конкурировать на них. Понимание и применение успешных методов управления рисками дает возможность принимать стратегически верные решения, занимать выгодную рыночную позицию с целью повышения уровня рентабельности и устойчивого развития предприятия. Именно поэтому анализ передового зарубежного опыта организации процесса принятия решений в области риск-менеджмента должно занимать ключевую позицию в структуре менеджмента современного металлургического предприятия.

Практика российских металлургических компаний в области организации процесса принятия решений при управлении рисками свидетельствует о том, что ряд из них ориентируется на концептуальные принципы и подходы к риск-менеджменту в соответствии со стандартами, но чаще всего, используются государственные стандарты (ГОСТ). [3, с. 122]

Таким образом, в результате построения концептуальной модели управления валютным риском металлургического предприятия, сформулированы критерии воздействия валютного риска на участников экономической системы и экономической системы в целом, такие как изменение цены и себестоимости конечной ценности, изменение структурной координации, нарушение функционирования организации, а также тесноты кооперационной связи. Определены наиболее целесообразные критерии эффективности управления валютным риском, к которым относятся устойчивость, результативность и экономичность. Установлено, что выбор методов управления

валютным риском, зависит не только от целей его управления, но и от величины воздействия валютного риска.

Реализация предложенной методики позволяет осуществить выбор метода управления валютным риском и оценить эффективность принимаемых управленческих решений для каждого металлургического предприятия.

Проблемы российских металлургических предприятия, в сфере управления валютными рисками в значительной степени являются результатом недостатка компетентности и осведомленности, отсутствия комплексного подхода к рискам. Это включает то, что менеджеры должны запрашивать действия по управлению рисками и результаты, что также связано с установлением приоритетов в управлении рисками. В некоторых случаях управление рисками также воспринимается как административное и бюрократическое, что отнимает много времени и не увеличивает добавленную стоимость. Управление рисками часто не документируется должным образом, что создает препятствия для накопления лучших практик и обмена знаниями.

Это затрудняет долгосрочное планирование и управление рисками, поскольку вероятность и последствия событий невозможно предсказать с какой-либо разумной точностью, формируется так называемая глубокая неопределенность. [6, с. 19]

Методы управления рисками в зарубежных металлургических компаниях различаются по четырем основным направлениям:

- многочисленные стратегии, которые они используют для управления своей подверженностью риску, во главе с разделением риска и корректировка потребности к риску;

- новые навыки, технологии и возможности, которые они постоянно добавляют по мере развития своих продуктовых линеек;

- широкий набор механизмов и показателей, которые они используют для мониторинга и измерения эффективности своих программ управления рисками, для корректировки уязвимостей по мере необходимости.

В целом компетентность и осведомленность в области управления рисками указываются как ключевые факторы успешного управления рисками в зарубежных металлургических компаниях.

В связи с этим металлургические предприятия должны использовать комплекс методов, который будет продолжать расти и развиваться вместе с возникающими новыми вызовами и новыми инструментами: автоматизация управления рисками, комплексный подход к используемым методам на всех уровнях управления; использование матриц рисков в процессе мониторинга рисков и др. При этом необходимо разрабатывать или внедрять разработанные сторонними поставщиками информационных решений системы поддержки принятия управленческих решений (с интегрированным функционалом по управлению рисками) и применять их в комплексе с другими процессами высокого уровня. [2, с. 73]

Поскольку исследованные зарубежные подходы являются эффективными и приносят определенные экономические выгоды компаниям, было бы целесообразным сделать выводы о возможности применения лучших зарубежных практик организации процесса принятия решений при управлении рисками наукоемких проектов на российских предприятиях и сформулировать предложения по их адаптации к российской специфике.

Литература

1. Альберто, Г.Э. Особенности управления инновационными рисками в наукоемких промышленных организациях (предприятиях) Российской Федерации / Г.Э. Альберто, Р.В. Шамин // Экономика и управление: проблемы, решения. - 2019. - Т. 7. - № 3. – С. 79-88.
2. Буньковский, Д.В. Инструменты управления предпринимательскими рисками / Д.В. Буньковский // Вопросы управления. - 2019. - № 1 (37). – С. 65-76.
3. Гепалова, Е.Д. Методы оценки рисков / Е.Д. Гепалова // E-Scio. - 2019. - № 7 (34). – С.115-127.

4. Довбий, И.П. Методические аспекты риск-менеджмента в системе управления качеством предпринимательских структур / И.П. Довбий, И.А. Кокорина, В.А. Довбий // Вестник МФЮА. - 2018. - № 1. – С. 103-121.
5. Кузнецова, М.О. Методика количественной оценки факторов риска промышленных организаций / М.О. Кузнецова // Экономические науки. - 2019. - № 180. – С. 54-60.
6. Шамин, Р.В. Оценка внутренних экономических рисков, связанных с инновационной деятельностью наукоемких предприятий / Р.В. Шамин, Г.Э. Альберто, И.В. Кирьяков // Инвестиционный, финансовый и управленческий анализ. - 2019. - Т. 7. - № 3. – С. 13.-24.
7. Эмексузьян, А.Р. Управление рисками и антикризисная политика: монография / А.Р. Эмексузьян, К.В. Балдин, А.Т. Алиев, О.С. Суртаева. - Сыктывкар, 2022. – С. 98-105.

Literature

1. Alberto, G.E. Peculiarities of innovation risk management in high technology industrial organizations (enterprises) of the Russian Federation / G.E. Alberto, R.V. Shamin // Economics and management: problems, solutions. - 2019. - Т. 7. - No. 3. – P. 79-88.
2. Bunkovsky, D.V. Business risk management tools / D.V. Bunkovsky // Issues of management. - 2019. - No. 1 (37). – P. 65-76.
3. Gepalova, E.D. Risk assessment methods / E.D. Gepalova // E-Scio. - 2019. - No. 7 (34). – P.115-127.
4. Dovbiy, I.P. Methodological aspects of risk management in the quality management system of entrepreneurial structures / I.P. Dovbiy, I.A. Kokorina, V.A. Dovbiy // Vestnik MFUA. - 2018. - No. 1. – P. 103-121.
5. Kuznetsova, M.O. Methods of quantitative assessment of risk factors for industrial organizations / M.O. Kuznetsova // Economic Sciences. - 2019. - No. 180. – P. 54-60.
6. Shamin, R.V. Assessment of internal economic risks associated with the innovation activity of science-intensive enterprises / R.V. Shamin, G.E. Alberto,

- I.V. Kiryakov // Investment, financial and management analysis. - 2019. - V. 7. - No. 3. – P. 13.-24.
7. Emeksuzyan, A.R. Risk management and anti-crisis policy: monograph / A.R. Emeksuzyan, K.V. Baldin, A.T. Aliev, O.S. Surtaev. - Syktyvkar, 2022. – P. 98-105.

© Карпов И.Д., 2021 Научный сетевой журнал «Столтыпинский вестник» №7/2022.

Для цитирования: Карпов И.Д. УПРАВЛЕНИЕ РИСКАМИ В РАЗВИТИИ МЕТАЛЛУРГИЧЕСКОГО ПРЕДПРИЯТИЯ // Научный сетевой журнал «Столтыпинский вестник» №7/2022.