Оценка рисков и ограничений реализации инновационного проекта.

Подготовил: Студент группы ИФИмд_01-19 Кочетков С. С.

Методы анализа рисков

- Качественный
- Количественный

Качественные методы анализа рисков

- метод мозгового штурма;
- метод Дельфи;
- метод аналогий;
- метод экспертных оценок;
- различные методы балльной оценки риска.

	Тип воздействия					Вероятность/частота		
	Техника безопасности	Окружающая среда	Репутация	Стоимость и график	Риск	Низкая	Средняя	Высокая
Уровень воздействия	Один летальный исход или более, множественные телесные повреждения	Долгосрочный и (или) сильный ущерб	Серьезный ущерб. Судебное преследование. Возможна потеря рабочей лицензии	Норма: >25% бюджета или графика	Опасный	Средняя	Высокая	Высокая
	Серьезные телесные повреждения или ТВПТ	Краткосрочный ущерб на территории объекта	Участие официальных органов	Норма: 5–25% бюджета или графика	Значительный	Низкая	Средняя	Высокая
	Необходимость оказания первой медицинской помощи	Необходимость быстрой очистки по месту	Жалобы местного населения	Норма: 1–5% бюджета или графика	Незначительный	Низкая	Низкая	Средняя

Количественные методы анализа рисков

- анализ влияния отдельных факторов (анализ чувствительности)
- анализ влияния комплекса факторов (сценарный анализ)
- метод дерева решений;
- имитационное моделирование (метод Монте-Карло).

Этапы осуществления анализа чувствительности проекта
Выбор для анализа приоритетного показателя эффективности проекта
Выбор для анализа системы основных исходных показателей, оказывающих влияние на возможное изменение избранного показателя эффективности проекта
Построение модели расчета влияния каждого из исходных показателей на избранный показатель эффективности проекта
Определение аналитического периода осуществления расчетов
Установление базового значения каждого из исходных (факторных) показателей, по которому рассчитывался избранный показатель эффективности проекта
Определение возможного диапазона изменения каждого исходного показателя в ходе реализации проекта
Расчет ожидаемого изменения избранного показателя эффективности проекта при экстремальных значениях возможного изменения каждого исходного показателя
Установление возможного диапазона значений избранного показателя эффективности проекта в диапазоне изменения каждого исходного показателя
Определение уровня чувствительности избранного показателя эффективности проекта к изменению каждого исходного показателя
Ранжирование исходных показателей по степени их влияния на изменение избранного показателя эффективности проекта

Основные исходные показатели, влияющие на формирование эффективности проекта

Основные исходные (факторные) показатели, влияющие на формирование эффективности проекта	
Влияющие на формирование объема инвестиционных затрат	• Цены на отдельные приобретаемые инвестиционные товары • Тарифы на осуществление строительно-монтажных работ • Продолжительность строительства объекта • Стоимость привлечения инвестиционных ресурсов • Структура инвестиционных ресурсов
Влияющие на формирование суммы чистого денежного потока	• Объем реализации продукции в натуральном выражении • Уровень цен на продукцию • Уровень налоговых платежей • Структура операционных издержек • Темп инфляции

Спасибо за внимание