

МОДЕЛИРОВАНИЕ РИСКОВ КОНТРАКТНОЙ ДЕЯТЕЛЬНОСТИ ПРЕДПРИЯТИЯ

Горлов А. С.

ФГБОУ ВПО «Финансовый университет при Правительстве Российской Федерации»
125993, Москва, Ленинградский просп., 49.
E-mail: agorlov@proc.ru

В настоящее время большое количество предприятий Российской Федерации находятся в затруднительном финансовом состоянии. Но они необходимы для успешного развития экономики страны. Не смотря на то, что в контрактах прописаны суммы поступлений денежных средств по завершению некоторого этапа, эти деньги поступают предприятиям часто не в срок, более того предприятия из-за задержек на таможене ресурсов, необходимых для производства, вынуждены переносить этапы работ на следующие периоды. Также из-за таможенных задержек предприятие не может в срок поставить свою продукцию, что ведет к штрафным санкциям.

Для анализа потерь, связанных с вышеописанными проблемами, построена модель оценки рисков контрактной деятельности. Полученный прогнозная величина представляет собой α -процентный VAR (Value-at-Risk). Данная модель позволяет точнее составлять портфель заказов на предстоящий год с учетом выполнения критериальной базы, а также прогнозировать наиболее вероятную сумму убытков от контрактной деятельности, которая возникнет при невыполнении контрагентами своих договорных обязательств.

Литература

1. *Клейнер Г.Б.* Предприятие в нестабильной экономической среде, риски, стратегии, безопасность. – М.: Перспектива, 1997. – 286 стр.