**Карман Сергій Вікторович. Оцінка та прогнозування економічного ризику у сфері переробки соняшнику: дисертація канд. екон. наук: 08.07.02 / Харківський національний аграрний ун-т ім. В.В.Докучаєва. - Х., 2003**

|  |  |
| --- | --- |
| |  | | --- | | **Карман С.В. Оцінка та прогнозування економічного ризику у сфері переробки соняшнику. – Рукопис.**  Дисертація на здобуття наукового ступеня кандидата економічних наук за спеціальністю 08.07.02 – економіка сільського господарства і АПК. – Харківський національний аграрний університет ім. В.В. Докучаєва, Харків, 2003.  Уточнено об’єктивну та суб’єктивну складові економічного ризику, його класифікацію. Встановлено пріоритетний ряд факторів, які впливають на рівень ризику у сфері переробки соняшнику, та обґрунтовано застосування безвідходної, енергозберігаючої технології для його зниження. З використанням комплексного експертно-статистичного підходу виконано оцінку і короткотерміновий прогноз економічного ризику переробки соняшнику підприємствами асоціації "Укроліяпром". | |
| |  | | --- | | 1. Для більшості існуючих підходів до визначення економічного ризику характерною є дискретність щодо невизначеності, у той час як ризик – це невизначеність, реалізація якої в процесі господарської діяльності призводить до непередбачених втрат. Детермінантою невизначеності розвитку ринкової кон'юнктури і, як наслідок, економічного ризику є свобода реалізації суб'єктивного сприйняття ринкової ситуації кожним підприємцем. На макроекономічному рівні одним з об'єктивних факторів посилення невизначеності є збільшення кількості господарських суб'єктів. Між моментом настання ризикової події та виникненням небажаних наслідків є проміжок часу, який в залежності від тривалості й оптимальності його використання економічним агентом може дозволити останньому цілком чи частково уникнути втрат. Виходячи з цієї ознаки, пропонується розширити видову класифікацію поправними, частково поправними і непоправними ризиками. 2. Принципово проблема економічного ризику зводиться до точності прогнозування господарським суб'єктом своєї діяльності та розвитку ринкової кон'юнктури. Абсолютно точний прогноз виключає імовірність виникнення непередбачених втрат. Для зниження економічного ризику у сфері переробки соняшнику пропонується комплексний підхід на основі взаємодоповнюючого використання побудови довірчого інтервалу для математичного очікування випадкової величини та методу експертних оцінок, апробація якого в процесі дослідження показала високу точність результатів. Розрахунок довірчого інтервалу дозволяє з імовірністю 0,92-0,99 встановити межі середнього очікуваного рівня ризику, а експертна оцінка – виділити альтернативні варіанти його реалізації. Порівняльний аналіз результатів обґрунтовує висновок про можливі зміни відносно тенденцій, які спостерігалися раніше. 3. Для підвищення якості та рівня вірогідності оцінки ризиків доцільно проводити їх одночасне структурування по етапах операційного циклу і за ступенем впливу на діяльність суб'єкта економіки. Такий підхід дозволяє ідентифікувати ризики не тільки в часі, а й по відношенню до певного моменту господарського процесу. Оцінка ризику завжди відносна і для неї характерний ефект масштабу: поліпшення фінансового стану підприємства веде до розширення зон прийняття ризику і тим самим зменшує його оцінку за рахунок поглинання. На цьому положенні може ґрунтуватися пасивна стратегія управління економічним ризиком. 4. Економічний ризик підприємств асоціації "Укроліяпром" збільшився за 1996-2001 рр. з 142,6 млн. грн. до 273,8 млн. грн. Конкуренція з боку комерційних структур, яка виявляється у присутності посередників на ринку соняшнику та в поширенні давальницьких схем його переробки, визначає в середньому 105,6 млн. грн. непередбачених втрат прибутку, а фактор дефіциту сировини, яка складає основу виробничого ризику, – 50 млн. грн. Кількісна оцінка ризику відбиває сегментацію ринку соняшнику в Україні по окремих категоріях господарських суб'єктів. Частка комерційних структур складає 54 %, підприємств асоціації "Укроліяпром" - в середньому 25 %. Питома вага дрібних маслоробок за рахунок використання тіньового сектора економіки досягає практично рівня промислових підприємств (21 %). 5. Математичне очікування прогнозованої величини виробничого та комерційного ризиків підприємств асоціації "Укроліяпром" у сфері переробки соняшнику на 2001 р. склало відповідно 58,7 млн. грн. і 540,3 млн. грн., експертна оцінка - 70,5 млн. грн. і 151,7 млн. грн. Похибка прогнозної оцінки виробничого ризику на 2001 р., одержаної довірчим інтервалом математичного очікування, склала 18,9 млн. грн. (24 %), комерційного ризику - 416 млн. грн. (333%). Для експертної оцінки аналогічні показники склали відповідно 7,1 млн. грн. (9 %) і 26,7 млн. грн. (21%). Істотна похибка математичного прогнозу комерційного ризику обумовлена зниженням валового збору соняшнику та збільшенням його ціни, значення яких у 2001 р. виходять за межи закономірностей 1996-2000 рр. Згідно прогнозу протягом 2002-2003 рр. очікується зростання виробничого ризику переробних підприємств асоціації „Укроліяпром” з 45 млн. грн. до 47,9 млн. грн., а комерційного ризику з 201,8 млн. грн. до 255,6 млн. грн. 6. Вплив на рівень економічного ризику підприємств асоціації "Укроліяпром", обумовленого конкуренцією з боку комерційних структур у сфері переробки соняшнику, без істотних додаткових фінансових вкладень можливий тільки шляхом агропромислової інтеграції. Скорочення питомої ваги сировини, яка надходить на переробку через посередників, відкриває можливість зниження ризику на 37 %. Першим кроком у цьому напрямку повинно стати скорочення підприємствами асоціації "Укроліяпром" мінімальних норм постачання соняшнику для сільськогосподарських виробників, розташованих у їх сировинній зоні. 7. В умовах дефіциту оборотних коштів, відсутності пільгового кредитування переробних підприємств практичної цінності набувають заходи, які не вимагають значних разових фінансових вкладень і мають досить короткий період окупності. Найбільш перспективним, особливо при загостренні енергетичної кризи, є впровадження у сферу переробки соняшнику автономного виробництва теплової енергії на основі безвідходних технологій. Рентабельність упровадження такого проекту на Мелітопольському олійно-екстракційному заводі склала 65 %, період окупності 1,6 року. Практична цінність проекту полягає в тому, що рівень економічного ризику переробки соняшнику знижується як у результаті безпосереднього впливу на його абсолютну величину, так і шляхом поглинання за рахунок поліпшення фінансового стану підприємства. | |