**Болдирєва Тетяна Володимирівна. 1.Моделювання процесів аналізу ризику в управлінні інвестиційною діяльністю судноплавної компанії : Дис... канд. наук: 08.03.02 – 2002**

|  |  |
| --- | --- |
| |  | | --- | | Болдирєва Т.В. Моделювання процесів аналізу ризику в управлінні інвестиційною діяльністю судноплавної компанії. – Рукопис.  Дисертація на здобуття наукового ступеня кандидата економічних наук за спеціальністю 08.03.02 – “Економіко-математичне моделювання”. - Одеський державний морський університет, Одеса, 2001.  Дисертація присвячена моделюванню процесів аналізу ситуацій ризику в управлінні інвестиційними проектами судноплавних компаній. Досліджено особливості й основні задачі управління проектами судноплавних компаній України. Обґрунтовано необхідність системного підходу до оцінки ситуацій ризику при прийнятті інвестиційних рішень, уперше розглянутих з урахуванням системної сутності інвестиційного проекту. Розроблено систему класифікації ситуацій ризику з наступним її використанням в аналітичному моніторингу за сигнальними зонами інвестиційного середовища й інвестиційного потенціалу.  Розглянуто питання якісного аналізу впливу ситуацій ризику на формування індикатора результативності проекту – потоку грошових коштів, а також основного показника ефективності - чистої сучасної вартості проекту. Обґрунтовано послідовність якісного аналізу і розроблено форму специфікації ситуацій ризику. Запропоновано факторну модель індикатора проекту, що дозволяє оцінити комплексний вплив факторів ризику в будь-якому їхньому сполученні, як за весь заданий період проекту, так і по окремим часовим інтервалам. Розроблені форми і моделі аналізу чутливості дозволяють визначити критичні значення вхідних параметрів, установити зміни значень показника ефективності проекту при заданій варіації кожної вхідної величини або їх можливих комбінацій, а також оцінити перевагу альтернативних варіантів.  Запропонована економіко-математична модель аналітичного моніторингу і розроблений алгоритм дозволяють обґрунтовувати варіант експлуатації судна для забезпечення максимального значення цільового критерію.  **Ключеві слова:**економіко-математичне моделювання, морський транспорт, інвестиційна діяльність, ситуації ризику, факторний аналіз, аналіз чутливості, критичні значення, імовірність, математичне сподівання, чиста сучасна вартість. | |
| |  | | --- | | 1.Сучасний стан транспортного флоту судноплавних компаній потребує використання нових підходів в управлінні структурою наявного тоннажу, орієнтованих на забезпечення зовнішньоторговельних зв'язків України і затребуваність на міжнародному фрахтовому ринку, серед яких першорядного значення набуває інвестиційна діяльність.  2.Обґрунтовано необхідність системного підходу до оцінки ситуацій ризику при прийнятті інвестиційних рішень, уперше розглянутих з урахуванням системної сутності інвестиційного проекту.  3.Для виконання аналізу інвестиційної діяльності запропоновано комплексний аналітичний моніторинг проекту, що дозволяє виявити вплив інвестиційного середовища й інвестиційного потенціалу проекту на його результативність.  4.Розроблено систему класифікації ситуацій ризику з наступним її використанням в аналітичному моніторингу по сигнальним зонам інвестиційного середовища й інвестиційного потенціалу.  5.Обґрунтовано послідовність якісного аналізу і розроблено форму специфікації ситуацій ризику, що містить інформацію для проведення наступного кількісного аналізу.  6.Запропоновано факторну модель індикатора проекту, у якості якого прийнято потік грошових коштів, що дозволяє оцінити комплексний вплив факторів ризику в будь-якому їхньому сполученні, як за весь заданий період проекту, так і по окремим часовим інтервалам.  7.Розроблені форми і моделі аналізу чутливості дозволяють визначити критичні значення вхідних параметрів, установити зміни значень показника ефективності проекту при заданій варіації кожної вхідної величини, або їх можливих комбінацій, а також оцінити перевагу альтернативних варіантів.  8.Економіко-математична модель аналітичного моніторингу і розроблений алгоритм дозволяють обґрунтовувати варіант експлуатації судна для забезпечення максимального значення цільового критерію.  9.Виконані розрахунки підтверджують адекватність моделей, що пропонуються.  10.Практичне застосування результатів даного дисертаційного дослідження зв'язано з використанням їх для обґрунтування прийняття рішень з метою ефективної реалізації інвестиційних проектів судноплавних компаній. | |