



УПРАВЛЕНИЕ РИСКАМИ ПОРТФЕЛЕЙ ПРОЕКТОВ

Яков Якубович, ЗАО «Ай-Теко»

*Международный Опыт Риск-Менеджмента и Особенности
Развивающихся Рынков - 2007
18-19 Июня 2007г*

- ✓ Понятие управления рисками портфеля проектов (УРПП)
- ✓ Эволюция и актуальность управления рисками портфелей проектов
- ✓ Место управления рисками портфелей проектов в системе управления компанией
- ✓ Отраслевой опыт
- ✓ Цикл УРПП
- ✓ Подход к внедрению УРПП
- ✓ Автоматизация процессов УРПП
- ✓ Выгоды и эффект от внедрения процессов УРПП

Управление проектами

Управление проектными
рисками

УПРАВЛЕНИЕ РИСКАМИ
ПОРТФЕЛЕЙ ПРОЕКТОВ

Управление портфелем
и программами
проектов

Управление
инвестиционным
портфелем

УПРАВЛЕНИЕ ПРОЯВЛЕНИЕМ И ПОСЛЕДСТВИЯМИ
РИСКАМИ РИСКОВ

&

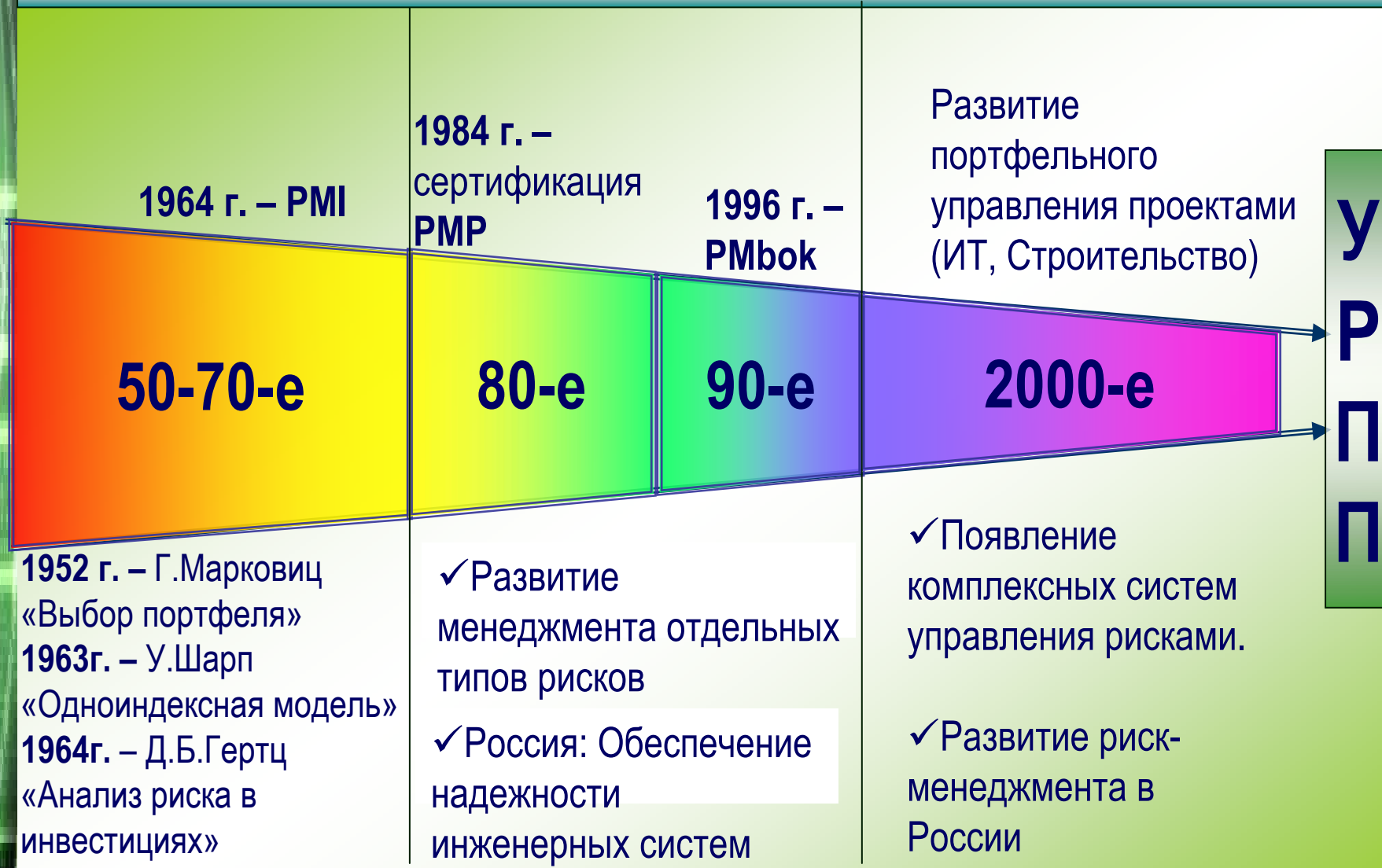
Оптимальный выбор и реализация
ПОРТФЕЛЯ ПРОЕКТОВ в соответствии со
ПРОЕКТОВ стратегическими целями



- формирование портфеля
УПРАВЛЕНИЕ проектами с точки зрения
оптимальности соотношения риск-
ПОРТФЕЛЯ доходности + контроль над
ПРОЕКТОВ верооятностью и последствиями
рисков проектов этого портфеля

ЭВОЛЮЦИЯ УРПП

УПРАВЛЕНИЕ ПРОЕКТАМИ



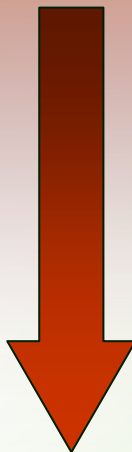
УПРАВЛЕНИЕ РИСКАМИ

УРПП - А НАДО ЛИ?

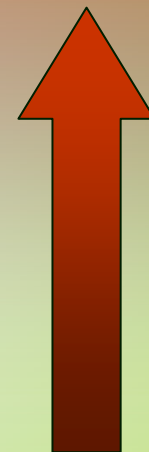
- ✓ Дублирование или противоречивость?
- ✓ Ориентация на устаревшие цели?
- ✓ Кажущая эффективность каждого проекта в отдельности?
- ✓ Сквозное распространение риска на несколько проектов?
- ✓ Избыточное использование ресурсов?



- ✓ Доходность
- ✓ Возможность обслуживать обязательства
- ✓ Инвестиционная привлекательность



- ✓ Неопределенность результатов проектов
- ✓ Объемы и стоимость обязательств







ИНДИВИДУАЛЬНОЕ УПРАВЛЕНИЕ ПРОЕКТНЫМИ РИСКАМИ

- ✓ Идентификация и анализ рисков в каждом проекте в отдельности
- ✓ Анализ причинно-следственных связей между рисками внутри проекта
- ✓ Анализ воздействия риска на показатели проекта при оценке
- ✓ Совокупный риск $\sim \sum_i \text{Риск}_i^{(\text{проекта})}$
- ✓ Планирование и реализация мероприятий по управлению рисками отдельного проекта
- ✓ Контроль рисков проекта на уровне менеджера проекта

УРПП

- ✓ Идентификация и анализ рисков в совокупности проектов
- ✓ Межпроектный анализ причинно-следственных связей
- ✓ Анализ воздействия риска на стратегические показатели
- ✓ Совокупный риск $\sim \sqrt{\sum_i \text{Риск}_i^2 + \sum_{i \neq j} \text{Риск}_i \text{Риск}_j \rho_{ij}}$
- ✓ Мероприятия проводятся в отношении рисков, охватывающих совокупность проектов
- ✓ Контроль рисков портфеля на уровне управляющего комитета

ЭТАП I. ДИАГНОСТИКА ПРОЦЕДУР УПРАВЛЕНИЯ ПРОЕКТАМИ

ЭТАП II. ФОРМИРОВАНИЕ МОДЕЛИ УРПП

ЭТАП III. АВТОМАТИЗАЦИЯ ПРОЦЕССОВ УРПП

ЭТАП IV. ВВОД ПРОЦЕССОВ УРПП В ЭКСПЛУАТАЦИЮ

ЭТАП V. МЕТОДОЛОГИЧЕСКОЕ СОПРОВОЖДЕНИЕ
И СОВЕРШЕНСТВОВАНИЕ ПРОЦЕССОВ УРПП

ИТОГИ: ЧТО ДАЕТ УРПП?



Систематизация информации о рисках проектов и учет рисковей составляющей при формировании портфеля проектов



Учет взаимосвязей между рисками проектов



Повышение адекватности оценки рисков



Снижение стоимости управления рисками за счет воздействия на сквозные риски проектов



Стратегический уровень принятия решений



Отказ от рискованных проектов



Оптимальное распределение ресурсов



- ✓ Доходность бизнеса
- ✓ Рентабельность проектов
- ✓ Инвестиционная привлекательность компании
- ✓ Уровень корпоративного управления
- ✓ Гарантии достижения целей



- ✓ Неопределенность результатов проектов
- ✓ Объемы внешнего финансирования
- ✓ Стоимость заемных средств



ЗАО «Ай-Техо»:

125009, Москва,
ул. Б.Никитская, д. 24, стр. 5

тел.: (495) 777-10 95 доб.4227

факс: (495)777-10 96



Яков Якубович

<http://www.i-teco.ru>

yakubovich@i-teco.ru

