

УДК 338.2
ББК 65.05
А50

Рецензенты:

Н. А. Лебедев – д.э.н., профессор, почетный работник высшего профессионального образования РФ, Институт экономики РАН;

Л. П. Дашков – д.э.н., профессор, академик РАЕН, Российский университет кооперации.

Алиев, А. Т.

А50 Основы инвестиционно-инновационного риск-менеджмента в системе управления хозяйствующими субъектами России : монография / А. Т. Алиев. К. В. Балдин. Е. Н. Романов, Н. Б. Москалева. – Москва : Издательско-торговая корпорация «Дашков и К°», 2023. – 484 с.

ISBN 978-5-394-05459-4.

В монографии изложены теоретико-методологические основы инвестиционного поведения хозяйствующих субъектов в современной трансформационной экономике страны, инвестиционный риск-менеджмент в системе антикризисного управления, основы активизации инновационного инвестирования хозяйствующих субъектов и комплекс механизмов управления инвестиционными рисками в производственных системах. Рассмотрен риск-менеджмент в инвестиционно-инновационной сфере.

Разработаны модели и методы риск-менеджмента в системе инвестиционно-инновационной деятельности хозяйствующих систем на основе концепции адаптивного динамического управления рисками. Раскрыта система инновационно-инвестиционного проектного анализа как инструментария управления научно-технологическим процессом. Предложены методологические подходы формирования инвестиционного проектирования как инструмента управления инновационной деятельностью и упреждающего риск-менеджмента в инвестиционном процессе предприятия.

Для научных работников, преподавателей вузов, студентов магистратуры, слушателей бизнес-школ, предпринимателей.

ISBN 978-5-394-05459-4

© Алиев А. Т., Балдин К. В.,
Романов Е. Н., Москалева Н. Б., 2023
© ООО «ИТК «Дашков и К°», 2023

СОДЕРЖАНИЕ

Введение.....	6
Глава 1. ТЕОРЕТИКО-МЕТОДОЛОГИЧЕСКИЕ ОСНОВЫ ИНВЕСТИЦИОННОГО ПОВЕДЕНИЯ ХОЗЯЙСТВУЮЩИХ СУБЪЕКТОВ В ТРАНСФОРМАЦИОННОЙ ЭКОНОМИКЕ	10
1.1. Понятие инвестиционного поведения как экономической категории в системе инвестиционных отношений	10
1.2. Принципы инвестиционного поведения	27
1.3. Инструменты инвестиционного поведения	41
1.4. Инвестиционный климат как институциональное пространство поведения инвестора	61
1.5. Модели инвестиционного поведения фирм в трансформационный период	77
Глава 2. ИНВЕСТИЦИОННЫЙ РИСК-МЕНЕДЖМЕНТ В СИСТЕМЕ АНТИКРИЗИСНОГО УПРАВЛЕНИЯ.....	96
2.1. Концепция управления развитием промышленного производства в условиях неопределенности и риска.....	96
2.2. Функционально-алгоритмическая структура подсистемы идентификации рисков факторов в системе управления инвестициями.....	118
2.3. Особенности инновационного проекта как объекта риск-менеджмента	143
2.4. Антикризисное управление предприятием с учетом факторов риска его инвестиционной деятельности	154

Глава 3. МЕТОДОЛОГИЧЕСКИЕ ОСНОВЫ АКТИВИЗАЦИИ ИННОВАЦИОННОГО ИНВЕСТИРОВАНИЯ ПРОИЗВОДСТВЕННЫХ СИСТЕМ ...171

3.1. Методы оценки инновационных проектов.....	171
3.2. Построение концептуальной математической модели	185
3.3. Формализация управляющих процедур	192
3.4. Феноменологическое представление о системе инструментов внутреннего инвестирования	198
3.5. Методологические разработки и структурно-логические схемы управления инновационной деятельностью.....	208
3.6. Информационная поддержка управленческих решений при внедрении инноваций	256

Глава 4. КОМПЛЕКС МЕХАНИЗМОВ УПРАВЛЕНИЯ ИНВЕСТИЦИОННЫМИ РИСКАМИ В ПРОИЗВОДСТВЕННЫХ СИСТЕМАХ270

4.1. Механизм управления факторами чувствительности к инвестиционным рискам.....	270
4.2. Механизм управления факторами и причинами инвестиционных рисков на разных уровнях управления в трансформационной экономике	297
4.3. Механизм управления последствиями инвестиционных рисков	319

Глава 5. МЕТОДОЛОГИЧЕСКИЕ ОСНОВЫ ФОРМИРОВАНИЯ СИСТЕМЫ ИНВЕСТИЦИОННОГО ПРОЕКТИРОВАНИЯ КАК ИНСТРУМЕНТА УПРАВЛЕНИЯ ИННОВАЦИОННОЙ ДЕЯТЕЛЬНОСТЬЮ ПРЕДПРИЯТИЯ.....344

5.1. Концептуальные основы формирования системы инновационно-ориентированного инвестиционного проектирования	344
--	-----

5.2. Совершенствование методических подходов к учету научно-технического фактора при формировании критериев принятия инвестиционных решений	380
5.3. Разработка концептуальных подходов к формированию норматива дисконтирования как инструмента управления научно-техническим развитием	391
Глава 6. МЕТОДОЛОГИЧЕСКИЕ ПОДХОДЫ УПРЕЖДАЮЩЕГО РИСК-МЕНЕДЖМЕНТА В ИНВЕСТИЦИОННОМ ПРОЦЕССЕ ПРЕДПРИЯТИЯ.....	421
6.1. Системный подход в риск-менеджменте и разработка комплекса мер по его реализации	421
6.2. Обеспечение рискоустойчивости проектов реальных инвестиций	433
6.3. Функциональный контроллинг и формирование информационной базы риск-менеджмента	451
6.4. Корректировка стратегии риск-менеджмента предприятия с учетом динамики факторов риска	464
БИБЛИОГРАФИЧЕСКИЙ СПИСОК	473