

# Kockázatok kezelése a kontrolling gyakorlatban

---

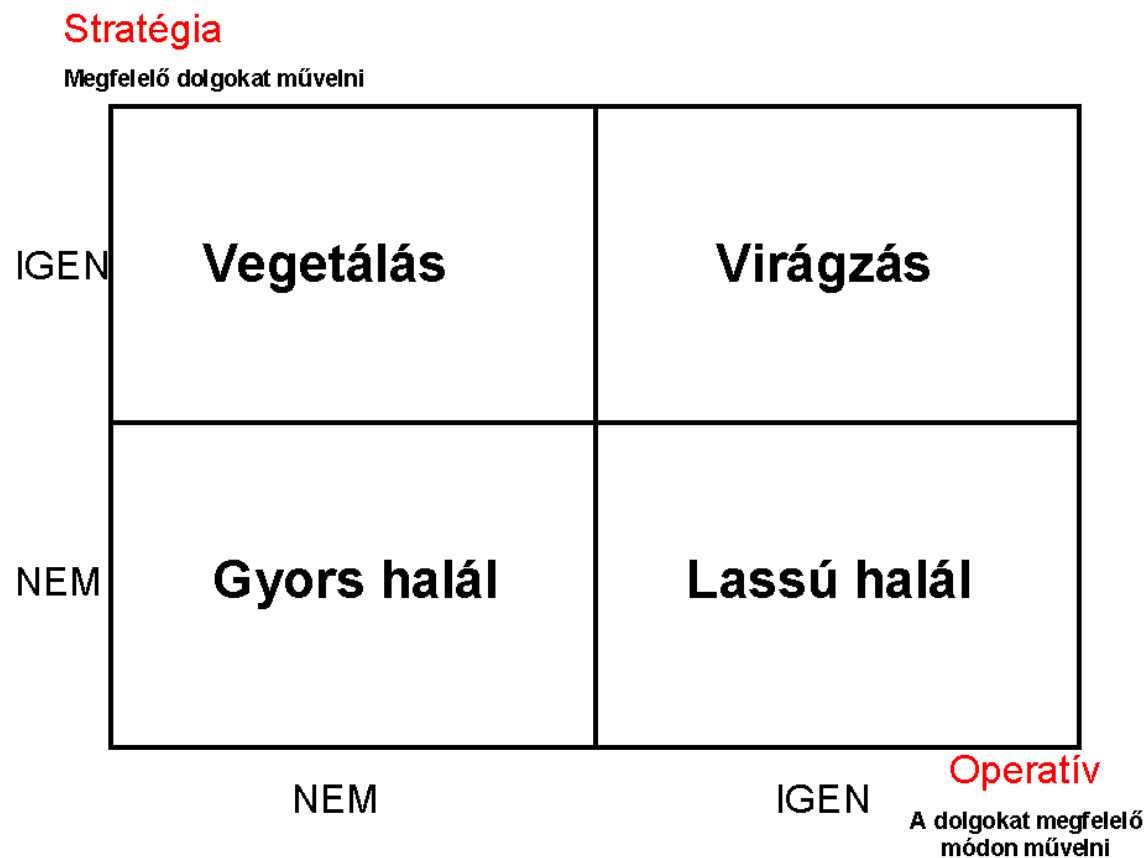
Kockázatok és kezelésük c. IFKA rendezvény  
2011. február 28.



- Dr. Boda György
- Szlávik Péter



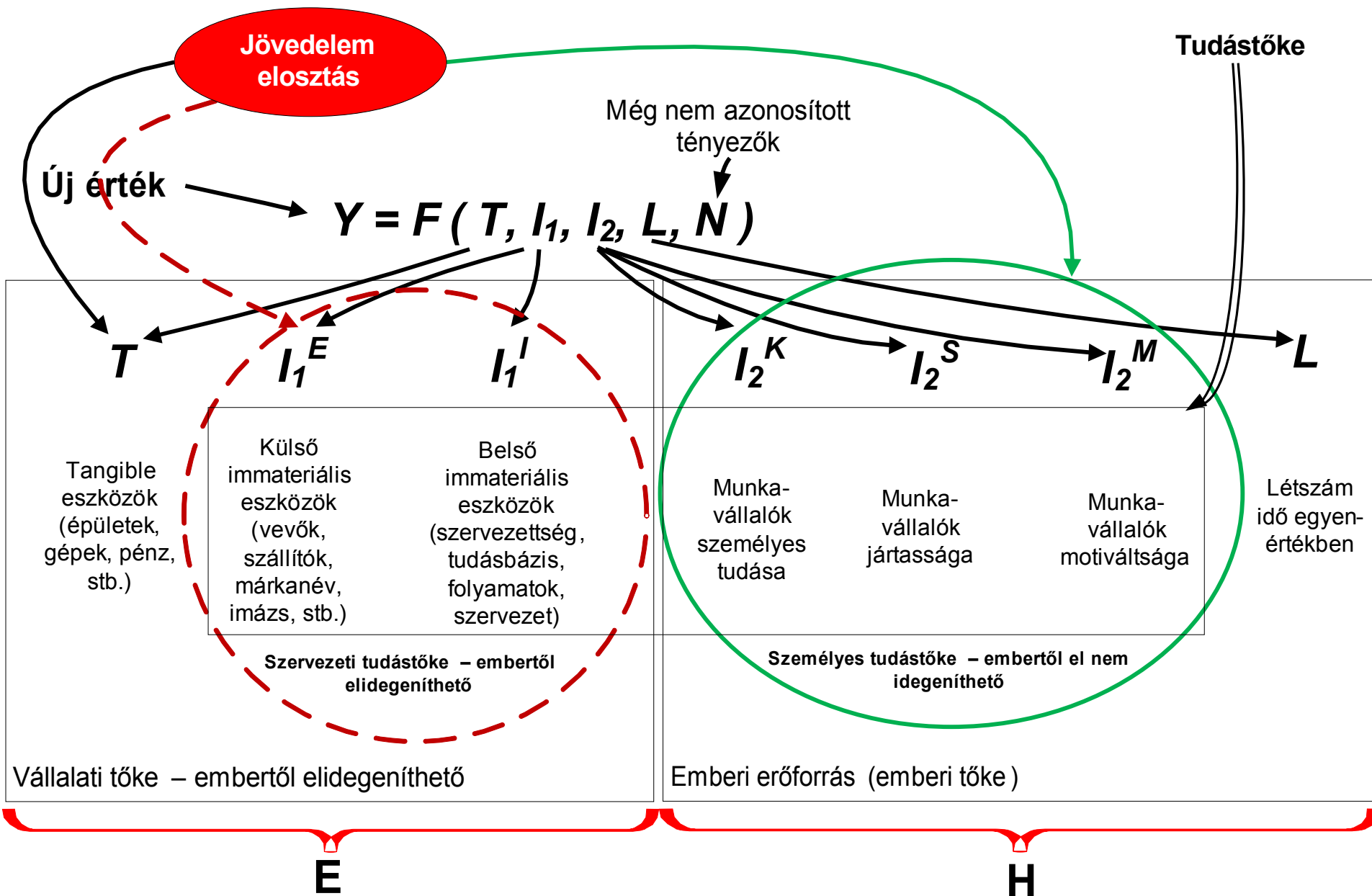
- Folyamatos működés
- Stratégiai fejlesztés



# A vállalati működés változói

---

- Exogén változók
  - Melyeket döntően a vállalati menedzsment határoz meg.
- Endogén változók
  - Melyek döntően az exogén változók és a vállalati működés belső törvényei határoznak meg.



# Vállalati modellek

---

- Az exogén és endogén változókat az operatív működés szintjén összekapcsoló modellek

A termelési függvény budgeting realizálása (Éves operatív terv modellek, MESTER)

- Az exogén és endogén változókat a termelési függvény alapján stratégiai időhorizonton összekapcsoló modellek

Üzleti tervezési modellek (STRATÉGA)

# A kockázatok két alapvető csoportja

---

- Operatív működés kockázatai
  - Soroljunk fel néhányat
  
- Stratégiai kockázatok
  - Soroljunk fel néhányat

## A kockázatok kontrollinja szempontból a legfontosabb kérdések

---

- Azonosítani tudjuk-e a kockázatokat az exogén változók és a megfelelő modellek összefüggésrendszerében?
- Azok bekövetkezési valószínűségeit milyen eszközökkel tudjuk leghatékonyabban befolyásolni?

- Kockázatok számbavétele; kulcs kockázati tényezők azonosítása
- Kockázati valószínűségek feltérképezése
- Kockázati tényezők hatásmechanizmusának feltérképezése
- Kezelési alternatívák / módszerek kidolgozása (projektek!)
- A tervezési modell kiemelt szerepe
- A tervezési modellben rejlő lehetőségek:
  - Kulcstényezők hatásmechanizmusának programozása
  - Érzékenységvizsgálatok és scenárió elemzés
  - Kulcstényezők változó értékei – eloszlásgörbék
  - Monte Carlo szimuláció a gyakorlatban
  - Reálopciók

**Köszönjük a figyelmet!**

---

gyorgy.boda@bodaandpartners.com  
peterszlavik@bodaandpartners.com

