

А. Г. Харамецкая, О. И. Еськова
(БТЭУ ПК, г. Гомель)
СТАТИСТИЧЕСКОЕ МОДЕЛИРОВАНИЕ
В ПРИЛОЖЕНИИ RISKYPROJECT

Метод статистического моделирования используется в ряде современных программных продуктов, одним из которых является приложение RiskyProject компании Intaver. Основное назначение этой программы – анализ и планирование инвестиционных проектов в условиях неопределенности и рисков. Это приложение может быть использовано как автономно, так и интегрировано с Microsoft Project. Анализ рисков выполняется методом Монте-Карло. При необходимости менеджер, основываясь на результатах анализа, может пересмотреть последовательность или содержание работ, зарезервировать дополнительные ресурсы или предусмотреть запас времени на критические работы, чтобы гарантировать выполнимость проекта в приемлемые сроки даже при неблагоприятных обстоятельствах.

Основной вид исследуемой неопределенности при анализе инвестиционного проекта – это неопределенность времени выполнения отдельных работ, для задания которой в программе используются 13 стандартных законов распределений. Риски задаются как случайные события, оказывающие определенное влияние на параметры проекта. Риск может быть локальным (привязанным к конкретной работе или ресурсу), либо глобальным, ассоциированным с проектом в целом. Для каждого риска задаются альтернативы и их вероятностные характеристики.

В приложении RiskyProject имеются также возможности анализа изменения стоимости проекта в процессе его реализации (как с учетом, так и без учета неопределенностей), управления ресурсами разных ви-

Аналитические и численные методы исследования в математике
Теория вероятностей и математическая статистика, теория массового обслуживания

дов, анализа критических работ и многое другое. Все это делает данный программный продукт достаточно мощным и эффективным средством поддержки принятия управленческих решений, ориентированным на интеграцию с другими популярными программами пакета Microsoft Office.

Целью данной работы является анализ возможностей приложения Risky Project в плане управления рисками и неопределенностями проекта. Рассматриваются способы задания различных видов неопределенностей (по длительностям работ, стоимости, прибыли, срокам начала работ), виды и параметры рисков, способы анализа влияния рисков и визуализации результатов этого анализа.

ЛИТЕРАТУРА

1. RiskyProject Professional Getting Started Guide // Руководство пользователя RiskyProject Professional [Электронный ресурс]. – Портал компании Intaver. – Режим доступа: <http://www.intaver.com/riskyprojectprof.html>. – Дата доступа 14.01.2015.