

БОЯРСКАЯ М.В., ИВАНИЦКИЙ В.Д., канд. техн. наук, доц.

ОПТИМИЗАЦИЯ УПРАВЛЕНИЯ ПОРТФЕЛЕМ ПРОДУКЦИИ ДЛЯ ПОВЫШЕНИЯ КОНКУРЕНТОСПОСОБНОСТИ ПРЕДПРИЯТИЯ

Ранее предложен алгоритм формирования оптимального портфеля, содержащего ценные бумаги [2].

В докладе рассматривается возможность расширения предложенного алгоритма на класс портфелей, содержащих в качестве активов продукцию предприятия.

Оптимальное управление портфелем продукции предприятия – одна из основных компетенций маркетологов компании. Неоптимальный портфель – одна из причин отсутствия гарантированной прибыли.

Компании необходимо регулярно обновлять свой ассортиментный набор продукции, так как рынок постоянно меняется и предъявляет новые требования и ожидания: меняются [потребительские предпочтения](#), меняются тактики и стратегии [конкурентов](#).

Оптимальный портфель товаров должен быть сбалансирован так, чтобы содержать товары с различными этапами жизненного цикла. Для этого он должен включать в себя как продукцию, приносящую стабильную, гарантированную прибыль компании, так и продукцию, которая пока еще не востребована рынком, но в будущем сулит хорошие перспективы.

Ранее была предложена матрица «доходность-риск» для выделения области оптимальных стратегий управления портфелем с ценными бумагами. Эта же матрица может быть использована для расширения предметного пространства, включающего в качестве портфельных активов не ценные бумаги, а продукцию предприятия.

Для этого расширения необходимо изменить смысл понятия «портфельного риска». Для портфеля ценных бумаг риск означает возможную потерю или доходность. В случае портфеля продукции под риском будем понимать возможность потери либо снижения конкурентоспособности продукта и необходимость последующего прекращения его производства (ζ , %).

Доходность портфеля как показатель его оптимальности трансформируется в понятие эффективности реализации продукта (σ , %).

В пространстве введенных показателей построена матрица «эффективность-риск» (рис. 1) для выделения области оптимальных стратегий управления ассортиментным портфелем продукции предприятия.

В результате анализа предложенной матрицы выбраны области В и С со стратегиями расширения ассортиментного портфеля. Установлено, что областям А и D должна соответствовать стратегия «Консервации существующей структуры портфеля».

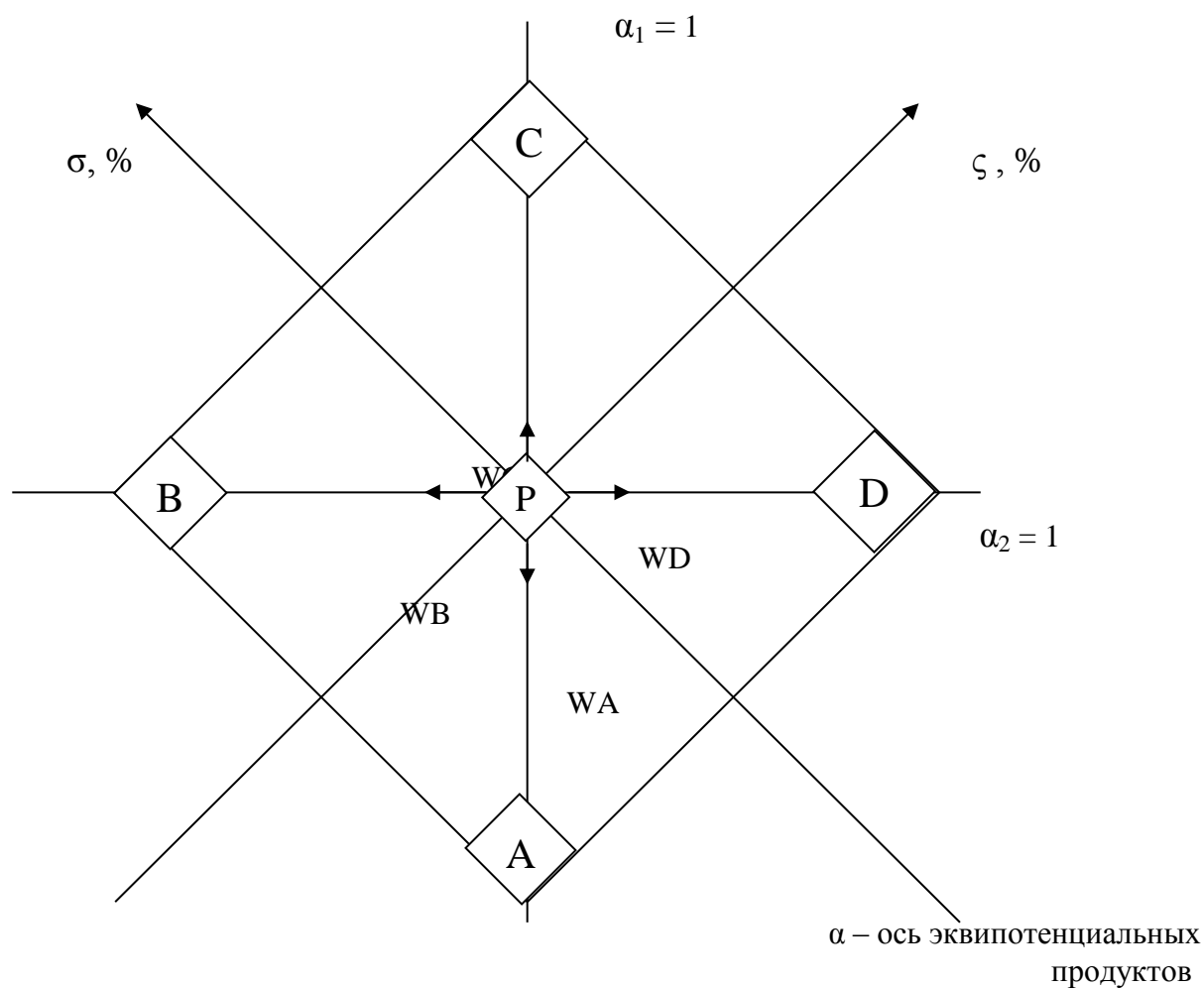


Рисунок 1. Матрица стратегий формирования портфеля продукции предприятия

Список литературы: 1. У.Шарп и др. «Инвестиции». – М.:Инфра М, 2001. – 1030 с. 2. Гавриш А.Н., Иваницкий В.Д., Боярская М.В. «Построение пространства оптимальных стратегий управления инвестиционным портфелем». Матер. VI м/н НП конференции «Исследование и оптимизация экон. процессов». НТУ «ХПИ», Харьков, 2008 с. 149