

В Диссертационный совет Д 002.013.04
при ФГБУН Центральный экономико-
математический институт РАН

Отзыв

официального оппонента, доктора экономических наук Ключкова Владислава Валерьевича на диссертацию Слепцовой Юлии Анатольевны на тему **«Управление риском в деятельности производственного предприятия на основе инструментария системной экономической теории и нечеткой логики»**, представленную на соискание ученой степени кандидата экономических наук по специальности 08.00.05 «Экономика и управление народным хозяйством», специализация «Экономика, организация и управление предприятиями, отраслями, комплексами (промышленность)».

Актуальность выбранной темы исследования

С одной стороны, в экономической науке традиционно уделяется значительное внимание проблемам хозяйственного риска, его оценки, управления рисками. В этой сфере получен ряд широко известных теоретических результатов, причем, весьма формализованных. С другой стороны, практическая применимость таких, на первый взгляд, безусловно обоснованных научно, результатов крайне низка. В хозяйственной практике – как в России, так и за рубежом – как правило, руководители в лучшем случае ограничиваются применением «мягких», качественных рекомендаций и принципов управления риском, основанных на соображениях здравого смысла и практическом опыте, но не на формальных научных результатах. Такой разрыв между наукой и практикой пагубен для обеих сторон (в силу ухода науки от изучения экономической реальности, и потому, что предприятия в высокорисковой среде нередко несут большие потери от недостаточно точных и выверенных решений, принятых волюнтаристским образом). Есть основания полагать, что он вызван, во многом, излишним схематизмом и упрощенным характером предпосылок формальных моделей рисков, разрабатываемых в экономической теории. Как правило, они основаны на теоретико-вероятностных подходах, что подразумевает возможность идентификации вероятностных характеристик рисков, наличие представительных выборок, достаточно длинных временных рядов. Однако такие допущения в реальности почти никогда не выполняются. Кроме того, само по себе вероятностное описание неопределенности (тем более, применительно к хозяйственному

рisku на предприятии) далеко не всегда содержательно оправдано. Более естественной формой представления возможностей наступления рисков событий является нечеткая форма, интуитивно понятная экспертам и лицам, принимающим решения. Экспертные оценки, по-видимому, и далее будут преобладать в сфере количественной оценки рисков на предприятиях – но целесообразно сделать эти оценки, по возможности, более объективными. В сфере моделирования рисков и выработки мер по управлению рисками актуально более широкое применение нечеткой математики.

При этом целесообразно системно, структурированным образом выявлять и систематизировать риски, формировать систему мер по управлению ими. Весьма перспективным представляется в качестве концептуальной базы для такой структуризации использовать системную экономическую теорию, предложенную Г.Б. Клейнером и развитую далее рядом экономистов.

Эти соображения и обусловили актуальность постановки цели и задач диссертационного исследования Ю.А. Слепцовой.

Структура работы

Диссертация состоит из введения, 3 глав, заключения, списка литературы и приложений.

Во **введении** обоснована актуальность поставленных цели и задач исследования, проведен анализ степени разработанности темы диссертации, критический предшествующих и смежных работ. Описаны информационная база и методологическая основа диссертационного исследования, сформулированы основные результаты диссертационного исследования, их новизна, теоретическая и практическая значимость.

В **первой главе**, которая носит обзорный и постановочный характер, проведен критический анализ современной теории и практики управления рисками на предприятии. Проанализированы приложения нечеткой математики к моделированию и управлению рисками. Сформулирована авторская позиция в отношении системы управления риском на предприятии и ее влияния на качество управления предприятием в целом.

Во **второй главе**, содержащей основные авторские теоретические разработки, изложены методы классификации рисков, основанные на принципах системной экономической теории; методы количественного измерения эффективности антирисковых мероприятий и оптимизации их состава с применением аппарата нечеткой математики; модель управления рисками на предприятии с нечетко заданными целями развития.

В **третьей главе** проводится разработка прикладных методов управления рисками на предприятии с учетом склонности руководства к риску. Здесь проведена конкретизация классификации факторов экономического риска и мер по управлению рисками (по принадлежности к проектной, объектной, процессной и средовой подсистемам предприятия) применительно к инновационным проектам.

Диссертация обладает внутренней целостностью и логичной структурой. Текст обладает как научной строгостью, так и доступностью изложения.

Основные результаты диссертационного исследования и их научная новизна

В соответствии с поставленными целью и задачами, автором были получены следующие основные **результаты**, обладающие **научной новизной**.

1. На основе системной теории предприятия, разработана классификация факторов экономического риска (с. 62-70). В соответствии с положениями системной теории предприятия, выделены его объектные, проектные, процессные и средовые подсистемы. Факторы экономического риска классифицированы в соответствии с этим делением, перечислены (хотя, возможно, и не полностью) конкретные виды факторов риска, проявляющихся в каждой из этих подсистем, и описаны их характеристики.

2. Разработан новый подход к формализации антирисковых управляющих воздействий и количественной оценке их эффективности (с. 81-87). В соответствии с положениями операциональной теории риска, эффект антирисковых управляющих воздействий подразделяется на минимизацию возможности наступления нежелательных событий и на минимизацию последствий их наступления. Количественное измерение влияния антирисковых мероприятий на эти категории предложено проводить путем экспертного оценивания по нечеткой шкале. Далее производится свертка влияния комплекса антирисковых мероприятий на возможность проявления и последствия факторов риска, и вычисляется интегральная оценка эффективности данного комплекса антирисковых мероприятий.

3. Предложена модель системы управления рисками на предприятии с формализацией функции «Контроль» как обратной связи (с. 94-100). Обосновано, что функция контроля обеспечивает ЛПР обратные связи с объектом управления. Разграничены стратегический и тактический уровни систем управления риском, уровни высшего и линейного руководства. Также теоретически разграничены функции служб внутреннего контроля и аудита в рамках системы управления риском.

4. Обосновано использование индекса избегания неопределенности Хофстеде как универсальной характеристики предпочтений менеджмента при выборе стратегии управления рисками (с. 112-117). Проведен анализ известных в экономической науке моделей предпочтений относительно риска. Показано, что индекс избегания неопределенности наиболее универсален и отражает культуру принятия риска, не требует сложных измерений, но позволяет классифицировать антирисковые мероприятия в зависимости от градаций данного индекса.

5. Конкретизирована авторская классификация факторов риска и антирисковых управляющих воздействий применительно к инновационным рискам (с. 124-134).

Таким образом, можно считать, что поставленная цель диссертационного исследования достигнута – разработан комплекс методов формализованного выявления, классификации, оценивания экономических рисков на предприятии, а также методов формирования эффективного комплекса антирисковых управляющих воздействий и организационной системы управления риском.

Заключение о соответствии диссертации заявленной специальности

Совокупность полученных научных результатов соответствует следующим пунктам паспорта специальности 08.00.05 «Экономика и управление народным хозяйством», специализация «Экономика, организация и управление предприятиями, отраслями, комплексами (промышленность)»:

➤ п. 1.1.1. «Разработка новых и адаптация существующих методов, механизмов и инструментов функционирования экономики, организации и управления хозяйственными образованиями в промышленности».

➤ п. 1.11. «Оценки и страхование рисков хозяйствующих субъектов».

Таким образом, диссертационная работа на тему «Управление риском в деятельности производственного предприятия на основе инструментария системной экономической теории и нечеткой логики» соответствует заявленной специальности 08.00.05 «Экономика и управление народным хозяйством», специализация «Экономика, организация и управление предприятиями, отраслями, комплексами (промышленность)».

Обоснованность научных положений, выводов и рекомендаций, сформулированных в диссертации, и их достоверность обеспечиваются:

- всесторонним критическим анализом известных трудов зарубежных и отечественных ученых в области экономики промышленных предприятий, теории и методологии управления рисками, нечеткой математики;

- корректным использованием экономико-математического инструментария;
- опорой на достоверные источники данных о хозяйственной деятельности предприятий и сопровождающих ее факторах риска.

Теоретическая значимость диссертационного исследования состоит в разработке операциональных приложений системной теории предприятия к управлению рисками. Также к вкладу автора в теорию следует отнести формализацию комплекса антирисковых мероприятий, разработку модели двухуровневой системы управления предприятием и обоснование теоретико-управленческой интерпретации контроля как функции управления.

Практическая ценность и внедрение результатов диссертации

Практическая значимость полученных автором результатов состоит в том, что они позволяют разработать и внедрить систему научно обоснованного управления рисками на предприятиях, основанную на количественных оценках, однако не требующую от ЛПР высокой математической квалификации. Кроме того, классификация факторов риска и антирисковых управляющих воздействий в соответствии с 4 подсистемами – проектной, объектной, процессной и средовой – позволяет повысить качество и комплексность идентификации рисков, поскольку делает процесс анализа рисков и эффективности антирисковых управляющих воздействий более регулярным и системным.

Разработанный автором нечетко-логический инструментарий анализа и управления рисками, вероятно, может получить применение не только на промышленных предприятиях, но и в научных организациях при управлении рисками научно-исследовательских проектов.

Апробация результатов диссертации и публикации по теме исследования

Основные результаты диссертационного исследования опубликованы автором в 18 печатных научных работах, в т.ч. в 5 статьях в ведущих рецензируемых журналах, рекомендованных ВАК Минобрнауки РФ. Авторские подходы и результаты исследований прошли апробацию на ряде всероссийских и международных научных конференций, конгрессов и симпозиумов, соответствующих тематике диссертации. Перечень публикаций свидетельствует об исключительном личном вкладе диссертанта в получение основных результатов, выносимых на защиту.

Отдельные замечания по диссертационной работе

1. Для практического применения разработанных автором формализованных методов анализа и управления рисками требуется их реализация в виде информационно-управляющей системы, которая должна быть встроена в систему управления предприятием, требует весьма обширного информационного обеспечения. При этом возможны проблемы низкой мотивации со стороны персонала и менеджмента, оппортунизма, искажения информации и т.п. Эти организационные аспекты применения предложенных автором методов пока не проработаны в достаточной степени.

2. Неясно, каким образом будут балансироваться интересы менеджеров или владельцев предприятия, если различным ЛПР (например, разным членам совета директоров) свойственны неодинаковые индексы избегания неопределенности, по какому именно его значению будет строиться система и стратегия управления рисками.

3. Помимо теории вероятности и нечетко-логических подходов, существуют и иные способы математического описания неопределенностей и рисков, в т.ч. теоретико-игровые. Следовало более четко обосновать их малую применимость к управлению рисками, и выбор, сделанный автором именно в пользу нечеткой математики.

Тем не менее, сделанные замечания не снижают общей положительной оценки научной новизны, теоретической значимости и практической ценности полученных автором результатов. Они могут рассматриваться как рекомендации для дальнейшего развития авторских исследований и разработок.

Заключение о соответствии диссертации критериям, установленным Положением ВАК Минобрнауки России

На основании изложенного считаю, что диссертация Слепцовой Юлии Анатольевны на тему «Управление риском в деятельности производственного предприятия на основе инструментария системной экономической теории и нечеткой логики» представляет собой целостную научно-квалификационную работу, выполненную на высоком научно-методологическом уровне. На основе проведенных автором исследований получено новое решение актуальной научной задачи повышения эффективности управления рисками на предприятии на основе их систематического представления и количественной оценки эффективности антирисковых мероприятий. Полученные научные результаты обладают теоретической значимостью для теории экономического риска и системной экономической теории (с точки зрения ее приложения в предметной области анализа и управления рисками), а также практической

ценностью для руководства предприятий, нуждающихся в повышении качества управления рисками.

Диссертационная работа по своему содержанию и оформлению отвечает требованиям Положения о присуждении ученых степеней, полностью соблюдается требование о наличии ссылок на источники используемого материала. Диссертант четко и корректно оговаривает использование в диссертации результатов, полученных в соавторстве.

Автореферат в целом отражает основные научные положения диссертации, размещенной на официальном сайте ЦЭМИ РАН РАН по адресу http://www.cemi.rssi.ru/dissertation/defense/sleptsova/Диссертация_Слепцовой_Ю.А..pdf

Таким образом, диссертационная работа на тему «Управление риском в деятельности производственного предприятия на основе инструментария системной экономической теории и нечеткой логики» удовлетворяет требованиям, предъявляемым к диссертациям на соискание ученой степени кандидата наук согласно «Положению о порядке присуждения ученых степеней» (утв. постановлением Правительства Российской Федерации от 24 сентября 2013 г. № 842). Ее автор, Слепцова Юлия Анатольевна, заслуживает присуждения ученой степени кандидата экономических наук по специальности 08.00.05 «Экономика и управление народным хозяйством», специализация «Экономика, организация и управление предприятиями, отраслями, комплексами (промышленность)».

Официальный оппонент,
директор департамента стратегии и методологии
управления созданием научно-технического задела
ФГБУ «Национальный исследовательский центр
«Институт имени Н.Е. Жуковского»,
доктор экономических наук

Клочков Владислав Валерьевич

Юр. адрес: 140180, Московская обл.,
г. Жуковский, ул. Жуковского, д. 1
Факт. адрес: Москва, ул. Викторенко, д. 7, к. 204
Телефон: +7 916 177 01 30
E-mail: vlad_klochkov@mail.ru



*Марина Владимировна А.Б.
Заведующий*

28.09.2016г.