

ВЫБОР ДИНАМИЧЕСКОЙ МОДЕЛИ УПРАВЛЕНИЯ РИСКАМИ

М.Н. Татьяна, аспирант

Уральский государственный экономический университет

(Россия, г. Екатеринбург)

DOI:10.24412/2411-0450-2024-10-2-101-104

Аннотация. Современная состояние корпоративного сектора ИТ-сферы требует нового подхода к управлению рисками, поскольку тенденции изменения внешней среды все чаще приобретают негативный характер. Такая ситуация порождает необходимость формирования механизма выбора наиболее подходящей динамической модели управления рисками. Целью исследования является формирование рекомендаций по выбору подходящей динамической модели управления рисками для ИТ-корпорации. Методы исследования включают компаративный анализ, сравнительный анализ, метод Черчмена-Аккофа. Результатом исследования выступают рекомендации по выбору динамической модели управления рисками для ИТ-корпорации. Авторы делают вывод, что выбор динамической модели управления рисками должен осуществляться на основе значимых критериев, которые отражают потребности конкретной ИТ-компании в управлении рисками.

Ключевые слова: риск, управление рисками, динамическая модель управления рисками, ИТ-корпорации, корпоративный сектор экономики.

Управление рисками представляет собой сложный комплексный процесс, который в последние пять лет приобрел дополнительную значимость, поскольку все отрасли экономики испытывают последствия нескольких экономических кризисов, что создает новые угрозы их устойчивому развитию. Все это характерно и для корпоративного сектора ИТ-сферы. Развитие корпоративного сектора ИТ-сферы в России имеет достаточно специфичных черт, которые определяют наличие рисков, которые характерны в основном для российского рынка. Необходимость выбора модели управления рисками обуславливается этапом развития российских ИТ-корпораций. Динамические модели управления рисками в настоящее время оправдывают свое применение в ИТ-сфере, поскольку внешняя среда российских ИТ-корпораций соответствует условиям их применения [1, с. 135]. Таким образом, вопросы выбора динамической модели управления рисками для российских ИТ-корпораций являются очень актуальными и требуют инициализации научных исследований. Целью исследования является формирование рекомендаций по выбору подходящей динамической модели управления рисками для ИТ-корпорации. Задачами исследования являются: уточнить необходимые термины на

основе компаративного подхода; сравнить статистическую и динамическую модели управления рисками; провести экспертную оценку подходящей модели для ИТ-корпорации. Практическая значимость исследования заключается в возможности использовать его результаты в процессе управления рисками в ИТ-корпорациях.

Результаты исследования

Концепция применения моделей управления рисками является развитием риск-менеджмента и на сегодняшний момент имеет значительную теоретическую и эмпирическую базу. В самом общем виде модели управления рисками делятся на:

- 1) статические;
- 2) динамические.

Определение сущности вышеуказанных моделей управления рисками на сегодняшний день является дискуссионным вопросом, однако, в процессе исследований было сформировано три наиболее распространенных подхода к статичности и динамичности в управлении рисками [3, с. 224]. Наиболее обоснованным является третий подход. Сравнительная характеристика статистической и динамической моделей управления рисками согласно третьему подходу представлена в таблице 1.

Таблица 1. Сравнительная характеристика статистической и динамической моделей управления рисками

Критерии\модели управления рисками	Статистическая	Динамическая
Специфика риск-менеджмента	1. создание резервов (поправок) для покрытия последствий реализации риска 10-15% бюджета 2. страхование рисков	1. организация штаба управления рисками для координации деятельности компании с учетом постоянно меняющейся внешней среды 2. экспресс-анализ постоянно меняющейся внешней среды
Характер затрат	Постоянная величина, равна стоимости страхования рисков	Постоянно меняющаяся величина
Достоинства	Высокоэффективны в условиях, когда потери от рисков небольшие, сроки реализации проектов короткие, а также не-большой периодичности экономических процессов, воздействующих на компанию	Высокоэффективны в условиях, когда риски постоянно меняются и действуют на разных уровнях управления компанией
Недостатки	Высокая цена страхования рисков, необходимость постоянно пересматривать перечень рисков для страхования, наличие рисков, которые нет возможности застраховать.	Необходимость постоянно мониторить риски, затраты на отдельный штат сотрудников и т.п.

На основе характеристики динамической модели, представленной в таблице 1, можно сделать вывод, что именно динамические модели управления рисками должны быть частью системы стратегического управления ИТ-корпораций в текущих условиях. На данный момент наибольшее распространение получили две динамические модели управления рисками:

- 1) имитационные модели;
- 2) модели на основе сценарного подхода.

Имитационные модели управления рисками характеризуются использованием математической статистики для описания и воспроизводства поведенческих параметров моделируемого объекта [7, с. 239]. Достоинством таких моделей является простота в использовании, их интерпретация достаточно очевидна легко перекладывается в аналитические выводы. Недостатком моделей такого типа выступает невозможность применения в широком диапазоне ситуаций, т.е. данные модели ограничены в использовании.

Модели на основе сценарного подхода основаны «на разработке трех сценариев: нормального, оптимистического и пессимистического» [4, с. 103]. Разработка данных сценариев осуществляется на основе системы показателей, которые характеризуют моделируемых объект. Достоинством таких моделей является прозрачность построения модели и ее

элементарная интерпретация, которая исключает двусмысленность в толковании результата моделирования. Недостатком является субъективность оценок показателей, однако, данная проблема решается при использовании достаточного количества экспертов и подходящей процедуры экспертного анализа, например, можно использовать метод Дельфи. Выбор одного из двух представленных выше типов моделей можно осуществлять для каждой ИТ-корпорации отдельно, это обусловлено набором индивидуальных характеристик каждой компании, которые могут приобретать различные значения и, как следствие, влиять на эффективность применения той или иной модели. Проведем отбор наиболее подходящей модели для АО «Инфосистемы Джет», которая представляет собой динамично развивающуюся организацию, осуществляющую свою деятельность с 2022 года на рынке компьютерных технологий, для этого используем экспертный метод Черчмена-Аккофа. Прежде всего, необходимо определиться с критериями, по которым будет осуществляться отбор. В рамках исследования были выделены универсальные критерии, указанные в таблице 2. Для получения релевантного результата мнения экспертов должны быть согласованы, поэтому необходимо провести расчет коэффициента нормирования.

Таблица 2. Критерии оценки альтернатив

Критерии	Ранг	Оценка	Расчет НК	НК
1. Спектр учитываемого риска (K1)	4	0,9	0,9/3,5	0,26
2. Сложность реализации на практике (K2)	1	0,2	0,2/3,5	0,06
3. Потенциал использования (K3)	2	0,6	0,6/3,5	0,17
4. Предполагаемая эффективность (K4)	5	1	1/3,5	0,29
5. Простота в интерпретации результата (K5)	3	0,8	0,8/3,5	0,23
Итого		3,5	0,9/3,5	0,26

Данные таблицы 2 показывают, что мнения экспертов согласованы. Далее необходимо оценить каждую альтернативу, а именно:

имитационные модели (А) и модели на основе сценариев (В), по всем критериям (табл. 3).

Таблица 3. Расчет уровня полезности альтернатив

Критерии \ Альтернативы	Нормированный коэффициент	А	В
K1	0,26	0,6	0,7
K2	0,06	0,5	0,9
K3	0,17	0,8	0,7
K4	0,29	0,9	0,8
K5	0,23	0,9	0,9
Полезность	-	0,69	0,78

Данные таблицы 3 демонстрируют, что в текущих условиях для компании АО «Инфосистемы Джет» подходящей альтернативой является модель на основе сценариев (А=0,78), поскольку ее полезность превышает альтернативу В (0,69). Необходимо отметить, что данный результат может быть распространен на другие ИТ-компании с подобными параметрами.

Заключение. Выбор динамической модели управления рисками должен осуществляться на основе значимых критериев, которые отражают потребности конкретной ИТ-

компании в управлении рисками. В целом, наиболее универсальным критерием является спектр оцениваемых рисков, остальные критерии могут в значительной степени различаться для разных ИТ-компаний. Кроме того, необходимо отметить, что выбор динамической модели также зависит от подхода к управлению, который использует та или иная компания. Направлением дальнейших исследований является формирование методического подхода к стратегии управления рисками на основе динамического моделирования.

Библиографический список

1. Армашова-Тельник, Г.С. Значимость процесса управления рисками в эффективной реализации инновационно-инвестиционной деятельности субъекта хозяйствования / Г.С. Армашова-Тельник, А.В. Рыжова // Экономика и управление: проблемы, решения. – 2024. – Т. 1, № 1(142). – С. 135-144.
2. Демидова, Е.Г. Построение динамической системы управления рисками промышленного предприятия / Е.Г. Демидова, Д.С. Гусев, О.А. Новикова // Фундаментальные исследования. – 2020. – № 10.
3. Димитриади, Н.А. Сценарный анализ в стратегическом управлении современным бизнесом / Н.А. Димитриади, Е.А. Иванова, Ю.В. Левина, О.И. Щепилов. – М.: Первое экономическое издательство, 2023. – 224 с.
4. Заворотная, А.Б. Оценка рисков предприятия с целью обеспечения его устойчивого развития / А.Б. Заворотная // Финансы устойчивого развития: вызовы и стратегии 2023 (SFCS2023): сборник статей IV Международной научно-практической конференции, Москва, 02 марта 2023 года / Российский университет дружбы народов им. Патриса Лумумбы. – Москва: Российский университет дружбы народов (РУДН), 2023. – С. 103-110.

5. Кузнецова, М.О. Практики внедрения риск-менеджмента в российских промышленных компаниях: результаты эмпирического исследования / М.О. Кузнецова // СРРМ. – 2019. – №4.
6. Структурная модернизация российской экономики: условия, направления, механизмы / под ред. Е.Б. Ленчук, Н.Ю. Ахапкина, В.И. Филатова. – СПб.: Алетейя, 2022. – 276 с.
7. Халиков, М.А. Динамическое моделирование производственной сферы предприятия с учетом риска структуры рабочего капитала / М.А. Халиков, Е.С. Кулинченко, А.А. Струкова // Вестник Алтайской академии экономики и права. – 2021. – № 3-2. – С. 239-253
8. Щербак, А.В. Управление рисками в сфере IT: монография. – М.: ООО «Научно-издательский центр Инфра-М», 2023. – 243 с.
9. Suriyankietkaew, S. Sustainable leadership and entrepreneurship for corporate sustainability in small enterprises: An empirical analysis // World Review of Entrepreneurship, Management and Sustainable Development. – 2019. – № 15(1-2). – P. 256-275.
10. Valeev S., Kondratyeva N. Risk control and process safety management systems // Process Safety and Big Data. – 2021. – Vol. 7. – Pp. 271-294.

CHOOSING A DYNAMIC RISK MANAGEMENT MODEL

M.N. Tatyannin, *Postgraduate Student*
Ural State University of Economics
(Russia, Yekaterinburg)

Abstract. *The current state of the corporate IT sector requires a new approach to risk management, as trends in the external environment are increasingly becoming negative. This situation creates the need to form a mechanism for choosing the most appropriate dynamic risk management model. The purpose of the study is to form recommendations on the choice of a suitable dynamic risk management model for an IT corporation. The research methods include comparative analysis, comparative analysis, and the Churchman-Akkoff method. The result of the study is recommendations on the choice of a dynamic risk management model for an IT corporation. The authors conclude that the choice of a dynamic risk management model should be based on significant criteria that reflect the needs of a particular IT company in risk management.*

Keywords: *risk, risk management, dynamic risk management model, IT corporations, corporate sector of the economy.*