

3. МОДЕЛЮВАННЯ ПРИЙНЯТТЯ РІШЕНЬ ЗА УМОВ НЕВИЗНАЧЕНОСТІ ТА РИЗИКУ

Вітлінський В.В.

*ДВНЗ «Київський національний економічний університет імені
Вадима Гетьмана», завідувач кафедри економіко-математичного
моделювання, доктор економічних наук, професор*

МОДЕЛЮВАННЯ РИЗИКУ ТА БЕЗПЕКИ ЕКОНОМІЧНИХ СИСТЕМ

У наші часи, коли в світі поширюються інтеграційні процеси, наростають конфлікти, нестабільність, для безпечного функціонування соціально-економічних систем, необхідно напрацьовувати, імплементувати та розвивати дієві програми реагування на загрози як внутрішні, так і зовнішні, враховуючи неспівпадаючі інтереси людей та їх різноманітних асоціацій. Зазначимо, що конфлікти інтересів держав, а також держави, бізнесу й населення визначають систему потенційних суперечностей та зумовленого цим ризику, що проявляється також в асиметрії інформації, непередбачуваності реакцій і, як наслідок, зниженні ефективності та дієвості системи управління безпекою економічних систем.

Аналізуючи наукові праці стосовно цієї проблематики, зокрема [1, 2], можна дійти висновку, що розроблення механізмів ідентифікації, оцінювання стану безпеки економічних систем потребує уточнення методологічних положень стосовно адекватного інструментарію моделювання в управлінні безпекою, а також урахування таких системних характеристик як стійкість, надійність, ризик, керованість, життєздатність тощо.

Категорії безпеки й ризику економічних систем пов'язані між собою низкою концептуальних аспектів та складних співвідношень, зокрема: чинники та джерела, що призводять до підвищення ступеня ризику (невизначеність, конфліктність, загрози, збурення тощо) спричиняють також зниження рівня економічної безпеки; ризик характеризує ступінь загроз щодо можливого понесення збитків, невдачі, віддалення від цілей, тобто ризик є одним із передвісників зниження рівня безпеки економічної системи; інформаційний ризик характеризується як можливість того, що певна загроза, впливаючи на вразливості інформаційних ресурсів, може спричинити шкоду економічній системі; небезпека вимірюється ступенем ризику попадання економічної системи в небезпечний стан, який

характеризується збитками «великого масштабу»; катастрофічний ступінь ризику може призвести до повної втрати безпеки певної економічної системи аж до припинення її функціонування.

На нашу думку, економічна безпека – це інтегрована системна характеристика, що залежить від стійкості, допустимого ступеня ризику, керованості параметрів, з метою забезпечення розвитку та захисту життєво важливих економічних інтересів особистості й суспільства, економічної стабільності суб'єктів економічних відносин та економіки країни загалом.

Пропонуємо також уточнене означення категорії ризику в сфері економіки.

Ризик – це економічна категорія, що характеризує ступінь загроз щодо можливого понесення збитків, невдачі, відхилення від цілей, зниження рівня безпеки. Водночас, ризик відображає особливості сприйняття зацікавленими суб'єктами економічних відносин невизначеності, конфліктності, загроз, пов'язаних з поточним станом і прогнозованим перебігом подій, які можуть призвести як до позитивного, так і до негативного (небажаного) економічного результату, з урахуванням зворотніх зв'язків

Наголосимо, що ризик має діалектичну об'єктивно-суб'єктивну структуру, про що детально йдеться, зокрема в [3]. Методологія моделювання ризику в системі економічної безпеки має спиратися на системно-синергетичну парадигму, низку виокремлених постулатів, принципів, застосуванні математичного моделювання, механізму та інструментарію моніторингу, одним із головних елементів якого має бути діагностика.

Для оцінювання та управління ризиком у системі економічної безпеки має застосовуватись інструментарій штучного інтелекту, нечітка логіка, штучні нейронні мережі, штучні імунні системи, їх гібридний інструментарій, апарат метамоделювання, нелінійна економічна динаміка, а також сучасні інформаційні технології інтелектуального здобуття та аналізу даних тощо.

ЛІТЕРАТУРА

1. Забродский В.А. Собственность, экономическая безопасность и государство. / В.А. Забродский, Н.А. Кизим. – Харьков: АО «Бизнес Информ», 1997. – 96.с
2. Моделювання економічної безпеки: держава, регіон, підприємство: [монографія] / [В.М. Геєць, М.О. Кизим, Т.С. Клебанова, О.І. Черняк]; за ред. В.М. Гейця. – Х.: Вид-во «ІНЖЕК», 2006. – 240с.

3. Вітлінський В.В. Штучний інтелект у системі прийняття управлінських рішень /В.В. Вітлінський // Нейро-нечіткі технології моделювання в економіці. – 2012. – №1. – С.97-118.

Валкаускас Р. А.

Вильнюсский университет ,

доцент кафедры Количественных методов и моделирования.

доктор социальных наук, доцент

ЧЕРТЫ ПРИНЯТИЯ РЕШЕНИЙ АКТИВНЫМИ МЕТОДАМИ ЭКСПЕРТНЫХ ОЦЕНОК

В литературе описываются различные методы исследования операций, эконометрии, изучения балансовых связей и многие другие методы, способы анализа, способствующие принятию управленческих решений (См.: Mackevičius, 2007; Palepu, Healy, Bernard, 2004; Rutkauskas, Damašienė, 2002; Савицкая, 2013; Schlittgen, 2012.). Применение таких методов часто эффективен. Они дают объективную оценку финансового положения и результатов деятельности предприятий, содействуют принятию оптимальных управленческих решений. Однако, эвристические методы и их возможности в принятии управленческих решений исследуются только фрагментно. Один из эффективных эвристических методов является способ экспертной оценки.

Schlittgen, (2012), Kardelis (2016) и другие авторы представляют различные классификации методов экспертной оценки. Они выделяют две их группы: пассивные (наблюдение, анализ процесса рассуждений и др.) и активные. Исследования показывают, что в целях формирования и принятия управленческих решений наиболее эффективны активные методы экспертной оценки. Рис. 1 является возможной классификацией таких методов.

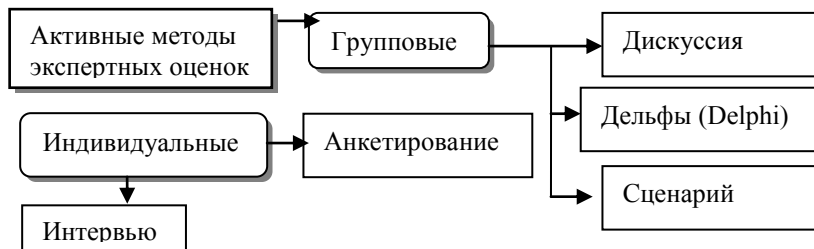


Рис. 1. Активные методы экспертной оценки