В объединенный диссертационный совет 99.2.143.02 на базе ФГБОУ ВО «Костромской государственный университет» и ФГБОУ ВО «Санкт-Петербургский государственный университет промышленных технологий и дизайна»

ОТЗЫВ

на автореферат диссертации Макаренко Евгения Александровича «Методология управления рисками в системе контрактных отношений в условиях неопределенности внешней среды», представленной на соискание ученой степени доктора экономических наук по специальности 5.2.6. Менеджмент

Проблема управления рисками традиционно относится к числу тех проблем менеджмента, которые сохраняют актуальность независимо от конкретной экономической ситуации. Однако в последние годы содержание самой категории риска заметно усложнилось. Если ранее основное внимание уделялось преимущественно финансовым, производственным или рыночным последствиям неблагоприятных событий, то сегодня все большее значение приобретают институциональные изменения, качество информации, цифровые зависимости, изменение поведения участников экономических отношений и способность организации принимать решения в условиях принципиальной неопределенности.

Именно в таком контексте выполнено диссертационное исследование Е.А. Макаренко. Автор рассматривает контрактные отношения как динамическую систему, в которой действия участников и изменения внешней среды постоянно меняют уровень рисков. Отдельный интерес представляет введение категорий темпоральности и казуальности риска, позволяющих учитывать не только вероятность и последствия неблагоприятного события, но и время его возникновения и причины изменения, что представляется значимым для практики управления, поскольку даже заранее известный риск при несвоевременном выявлении может стать фактически неуправляемым.

Предложенное трехмерное представление риска через временной параметр, вероятность и величину потерь логично развивает эту идею, т.к. в данном случае выступает не технической характеристикой расчета, а самостоятельным элементом управленческого решения. Тем самым автор фактически ставит вопрос о границе, после прохождения которой организация уже не просто наблюдает развитие неблагоприятной ситуации, а должна переходить к активному воздействию на нее.

Отдельно следует остановиться на интеллектуальной системе риск-менеджмента. Эта часть работы, на мой взгляд, одновременно является одной из наиболее перспективных и одной из наиболее дискуссионных. Автор предлагает использовать массивы накопленной информации о контрактных взаимодействиях, цифровое профилирование контрагентов и интеллектуальные механизмы выявления скрытых закономерностей. При этом в архитектуру системы включен контроль достоверности исходных данных, что принципиально важно для любых алгоритмических моделей принятия решений.

Здесь проявляется важное достоинство исследования: искусственный интеллект рассматривается не как автоматически более совершенная замена традиционного управления, а как один из инструментов работы с неопределенностью, что делает такой подход методологически оправданным. Сегодня использование ИИ действительно способно уменьшить часть информационных рисков, однако одновременно оно создает новые зависимости от качества данных, алгоритмов, цифровой инфраструктуры и квалификации

пользователя, и подобная двойственная природа цифровых технологий сегодня становится одним из центральных вопросов экономической безопасности как бизнеса, так и страны в целом.

В этой связи интерес вызывает и предложенная автором идея суверенной когнитивной модели, т.к. уже само по себе включение проблемы технологической и информационной зависимости в архитектуру системы риск-менеджмента представляется значимым, а в условиях цифровизации управленческая автономность организации все в большей степени определяется не только собственностью на материальные ресурсы, но и контролем над данными, технологиями обработки информации и механизмами формирования рекомендаций.

Автор предлагает оценивать надежность контрагентов не по одному показателю, а по совокупности признаков: финансовому состоянию, рейтингу, размеру капитала, возрасту организации и другим характеристикам. Отдельный интерес представляет критический подход к самим источникам информации, поскольку даже кредитный рейтинг не является абсолютно объективной оценкой и зависит от используемой методики.

Значимым результатом является индекс недобросовестности заказчика, который частично снижает информационную асимметрию между сторонами контракта. Также в работе учитывается изменение влияния стейкхолдеров во времени, включая появление ранее малозаметных участников.

В целом достоинством исследования является объединение в одной методологии оценки контрагентов, качества информации, поведения участников, рыночной среды и цифровых технологий. Предложенные решения могут использоваться для мониторинга контрактных рисков и поддержки управленческих решений; часть разработок уже получила программную реализацию.

Вместе с тем вызывает вопросы следующие положения:

- Соотношение технологического суверенитета интеллектуальной системы и ее реальной автономности. Даже при использовании отечественных решений качество результата по-прежнему зависит от исходных данных, настроек модели и квалификации пользователя. В связи с этим дополнительного раскрытия требует соотношение технологического, информационного и когнитивного суверенитета в предлагаемой системе;

- Автор справедливо уделяет большое внимание качеству данных и алгоритмическому анализу, однако человеческий фактор в интеллектуальной системе раскрыт менее подробно. Между тем недостаток компетентности пользователя или, напротив, чрезмерное доверие к результату, сформированному алгоритмом, сами способны выступать источником управленческого риска. Представляется важным в дальнейшем дополнить предложенную модель оценкой уровня готовности пользователя к работе с интеллектуальными системами и механизмами предупреждения некритичного принятия алгоритмической рекомендации.

Указанные замечания носят дискуссионный характер и в большей степени определяют перспективные направления дальнейшего развития предложенной автором методологии. Они не снижают научной значимости выполненного исследования и общей положительной оценки его результатов.

Представленная работа отличается внутренней логикой, завершенностью и взаимосвязью теоретических, методологических и прикладных положений. Полученные результаты вносят вклад в развитие методологии риск-менеджмента и расширяют инструментарий управления контрактными отношениями в условиях высокой неопределенности и цифровой трансформации.

Диссертационная работа Макаренко Евгения Александровича «Методология управления рисками в системе контрактных отношений в условиях неопределенности внешней среды» соответствует требованиям Положения о присуждении ученых степеней, утвержденного постановлением Правительства Российской Федерации от 24 сентября 2013 г. № 842,

предъявляемым к диссертациям на соискание ученой степени доктора наук, а ее автор, Макаренко Евгений Александрович, заслуживает присуждения ученой степени доктора экономических наук по специальности 5.2.6. Менеджмент.

Я, Белоусова Наталья Валерьевна, даю свое согласие на включение моих персональных данных в документах, связанных с работой диссертационного совета, а также размещение предоставленной информации в сети Интернет.

д.э.н., профессор
Профессор кафедры экономики,
управления и предпринимательства
АНО ВО «МБИ имени Анатолия Собчака» Белоусова Н.В.

13.10.26г.

Подпись Н.В. Белоусовой Заверяю
Начальник отдела кадров
АНО ВО «МБИ имени Анатолия Собчака»
13.10.26г. О.А. Аникина

Почтовый адрес, телефон и адрес электронной почты организации:
АНО ВО «МБИ имени Анатолия Собчака»
191023, Санкт-Петербург, Невский пр., д.60
+7(812) 571-65-55
ibispb@ibispb.ru