

IV НАУЧНО-ПРАКТИЧЕСКАЯ КОНФЕРЕНЦИЯ «УПРАВЛЕНИЕ РИСКАМИ В ЭКОНОМИКЕ: ПРОБЛЕМЫ И РЕШЕНИЯ»

Р.М. Качалов, С.Г. Опарин

16 ноября 2018 г. завершила работу IV Научно-практическая конференция с зарубежным участием «Управление рисками в экономике: проблемы и решения» (РИСК'Э-2018), которая проходила в Петербургском государственном университете путей сообщения Императора Александра I (ПГУПС). Конференция организована при поддержке Центрального экономико-математического института РАН (ЦЭМИ РАН, Москва), Русского общества управления рисками «РусРиск» (Москва), факультета управления Санкт-Петербургского государственного экономического университета и АО «Институт “Стройпроект”» (Санкт-Петербург – Москва). Информационные партнеры Конференции – журнал «Экономическая наука современной России» (Москва, РАН) и научно-практический журнал «Проблемы анализа риска» (Москва).

На открытии Конференции с приветственным словом к участникам обратился проректор по экономике и информатизации Петербургского государственного университета путей сообщения Императора Алексан-

© Качалов Р.М., Опарин С.Г., 2019 г.

Качалов Роман Михайлович, д.э.н., профессор, научный руководитель лаборатории Центрального экономико-математического института РАН, Москва, kachalov1ya@yandex.ru

Опарин Сергей Геннадиевич, д.т.н., профессор, заведующий кафедрой Петербургского государственного университета путей сообщения Императора Александра I, Санкт-Петербург.

дра I д-р экон. наук *С.В. Коланьков*. В своем выступлении *С.В. Коланьков*, в частности, отметил, что Конференция РИСК'Э-2018 проходит в период проведения Бетанкуровского международного инженерного форума в стенах старейшего транспортного учебного заведения России – инициатора Конференции и открывает новую страницу в развитии риск-менеджмента в России. Первым ректором (инспектором) Института Корпуса инженеров путей сообщения (ныне Петербургский государственный университет путей сообщения Императора Александра I) был испанец Августин Бетанкур – ученый с мировым именем, выдающийся инженер-механик, строитель и педагог, автор научных статей по тематике обеспечения безопасности зданий и инженерных сооружений транспорта.

Обращаясь к участникам Конференции, председатель Организационного комитета д-р техн. наук, профессор *С.Г. Опарин* отметил, что последовательный переход России к рыночной экономике, рост рискованности и возникновение феномена риск-аппетита вызывают все больший интерес у государства и бизнеса, предприятий и организаций к управлению рисками в различных областях и сферах экономической деятельности. Это побуждает развивать теорию и практику управления рисками, создавать в сфере управления рисками специализированные организации и последовательно интегрировать их в интернациональные и европейские ассоциации. Влияние феномена риска на эффективность проектов и бизнес-процессов постоянно растет, а высокая цена экономического риска нередко становится определяющим фактором при принятии управленческих решений.

В работе Конференции участвовали представители экономической науки из авторитетных вузов России и стран Восточной Европы, представители бизнеса, предприятий и организаций Северо-Западного региона России. В рамках Конференции была организована панельная дискуссия «Проблемы управления рисками в цифровой экономике» и секции молодых ученых, магистрантов и аспирантов.

Особое внимание участников Конференции было уделено проблемам и перспективам развития теории и практики управления рисками в условиях беспрецедентного роста напряженности в экономике, оценке влияния экономических рисков на конкурентоспособность, экономику и финансы организаций, выявлению проблем и возможностей эффективного управления рисками в цифровой экономике, управлению инвестиционными проектами и бизнес-процессами. По результатам работы Конференции издан сборник научных трудов Конференции (Управление рисками..., 2018).

Основная дискуссия на Конференции развернулась по следующим научным направлениям:

- концептуальные и методологические основы управления рисками в экономике;
- управление рисками в цифровой экономике, качественные и количественные методы оценки рисков;
- моделирование и оценка рисков в реальном секторе экономики – строительство, транспорт, инвестиционная, проектная и транспортно-логистическая деятельность;
- экономическая безопасность и анализ влияния рисков на конкурентоспособность, экономику и финансы организации;
- автоматизация управления рисками с использованием цифровых технологий;
- контрактная система и управление рисками в сфере закупок товаров, работ, услуг;
- стоимостный инжиниринг и управление рисками в сфере недвижимости;
- стандарты и практика управления экономическими рисками;
- национальная и международная профессиональная сертификация риск-менеджеров.

С докладами в очной и заочной форме выступили более 75 участников из почти двух десятков научно-исследовательских, проектных и производственных организаций, национальных исследовательских и государственных образовательных учреждений. Среди участников были 15 докторов

и более 25 кандидатов наук. С докладами по актуальным проблемам управления риском выступили представители Центрального экономико-математического института РАН (Москва), Русского общества управления рисками (Москва), Экономического университета в Познани (Польша), АО «Институт “Стройпроект”» (Санкт-Петербург – Москва), ООО «РМС–ОЦЕНКА» (Санкт-Петербург), Национального исследовательского университета информационных технологий, механики и оптики (НИУ ИТМО), Санкт-Петербургского архитектурно-строительного университета (СПбГАСУ).

В своем докладе «Управление риском как мультидисциплинарное направление научных исследований» заведующий лабораторией ЦЭМИ РАН, д-р экон. наук Р.М. Качалов отметил, что риск можно трактовать как порожденную неопределенностью возможность нежелательного развития событий. Были определены функциональные компоненты рискогенного пространства, включающие ситуацию экономического риска, факторы риска, уровень риска, антирисковое управленческое воздействие и последствия отклонения от цели хозяйственной деятельности. При этом особое внимание было уделено сложности и разнородности этих компонентов, в силу чего не удастся достаточно полно изучить характеристики этих компонентов средствами исследовательских инструментов одной научной дисциплины. Именно поэтому развитие исследований феномена риска в управленческом контексте все более ориентируется на переход к статусу междисциплинарности, т.е. к поиску нового синтетического знания, расширяющего и углубляющего представления о реальности в рамках междисциплинарного научного пространства. Обращение исследователей риска к междисциплинарным формам организации научного процесса позволит преодолеть фрагментарность и создать новую исследовательскую программу для развития фундаментальной теории управления риском, ориентированную на улучшение качества управления предприятием.

Доклад исполнительного директора Русского общества управления рисками «Рус-Риск» канд. экон. наук *Т.Ю. Шемякиной* был посвящен актуальным вопросам национальной и международной профессиональной сертификации риск-менеджеров. В частности, отмечено, что особую значимость имеет уникальная направленность программы Конференции на тесное взаимодействие практиков и исследователей в вопросах формирования образовательных программ и систем профессиональной сертификации специалистов в области управления рисками. Начиная с 2015 г. Центр сертификации «РусРиск» провел 10 сертификационных сессий, сертифицировал около 100 специалистов в системе добровольной профессиональной национальной сертификации CRMPRR «Профессионал в области управления рисками», среди которых собственники бизнеса, генеральные и финансовые директора, директора и специалисты департаментов управления рисками, внутреннего аудита, внутреннего контроля и управления проектами, специалисты по страхованию. Определены уровни и раскрыты преимущества системы профессиональной международной сертификации риск-менеджеров RIMAP (European Risk Management Professional Certification). Центр сертификации НП «Рус-Риск» в 2018 г. получил аккредитацию европейской федерации FERMA на организацию подготовки риск-менеджеров к прохождению международной сертификации RIMAP с выдачей сертификата соответствия «Профессионал в области управления рисками».

В докладе «Концепция оптимального управления рисками проектов и возможности ее реализации в цифровой экономике» заведующий кафедрой Петербургского государственного университета путей сообщения Императора Александра I, д-р техн. наук *С.Г. Опарин* отметил, что, несмотря на заметный рост рискованности напряженности в управлении проектами, современный этап развития экономики характеризуется несоответствием результатов риск-менеджмента реальной ситуации риска требованию достоверности

получаемых оценок. Рассмотрена концепция оптимального управления рисками проектов, и предложены методы ее реализации в цифровой экономике. Задача оптимального синтеза системы управления рисками на отдельных этапах жизненного цикла проекта решена с применением цифровых методов оценки риска, процедур глобального случайного поиска и частично-целочисленных оптимизационных моделей блочного типа.

На реальных проектах в сфере транспортного строительства показано, что реализация цифровой парадигмы управления рисками, предусматривающей отказ от гипотезы о нормальном распределении параметров проекта, и сохранение требуемой информативности цифры в условиях процессного подхода обеспечивают возможность достижения приемлемой для практических целей достоверности оценок. Указанные положения открывают широкие возможности для оптимального управления рисками в цифровой экономике. Смена парадигмы менеджмента риска является закономерной и отражает результат внедрения современных цифровых технологий в теорию и практику управления рисками в реальном секторе экономики. Результаты вычислительного эксперимента подтверждают преимущества цифрового способа описания и распределенной оценки цены риска, а применение процедур структурно-параметрической оптимизации позволяет улучшить значение критерия эффективности мероприятий по управлению рисками проекта более чем в два раза при уменьшении объема вычислений в десятки раз.

В своем докладе «Логистические кластеры в Польше – условия создания и экономические последствия функционирования» профессор Познаньского университета экономики и бизнеса (Польша), д-р экон. наук *Вальдемар Буднер (Waldemar Budner)* отметил, что происхождение концепции кластера восходит к неоклассической экономике и исследованиям А. Маршалла. В современном виде концепция кластеров формулируется в общей теории М. Портера, в том числе в виде основных по-

ложений «логистических кластеров». В настоящее время логистические кластеры стали новым элементом экономического ландшафта в Польше. В докладе были рассмотрены условия создания, разработки и определения местоположения логистических кластеров и всесторонне обоснованы различные преимущества, связанные с функционированием логистических кластеров. Результаты рассмотрения указывают на важную роль, которую играют логистические кластеры в повышении конкурентоспособности предприятий и экономики. Логистические кластеры должны располагаться в местах формирования значительного потенциального спроса на логистические услуги под воздействием экономических и социальных факторов.

Заместитель начальника управления экономики строительства, главный экономист проекта АО «Институт “Стройпроект”» *Н.А. Алексеев* в своем докладе «Ключевые риски проектов по развитию транспортной инфраструктуры, реализуемых в рамках государственно-частного партнерства (ГЧП)» представил результаты экономического анализа рисков с учетом опыта участия в ГЧП-проектах Института “Стройпроект”, который возглавил рейтинг ТОП-3 технических советников концессионных проектов. Особое внимание в исследовании уделено рискам в реальном секторе экономики, в частности рискам, связанным с предоставлением и использованием земельного участка для строительства, проектным и строительным рискам, риску спроса на пользование автомобильной дорогой, финансовым, правовым и некоторым другим видам риска. Приведены примеры произошедших рискованных событий в российских проектах ГЧП по развитию транспортной инфраструктуры. Обоснованы практические рекомендации по минимизации рисков и снижению их влияния на проекты ГЧП в сфере транспортного строительства.

В докладе «Роль репутации в процессе изменений на примере телевизионной платформы NC+ (ITI Neovision и Canal+)» профессор Познаньского университета экономики

и бизнеса (Польша), д-р экон. наук *Вальдемар Рыжак (Waldemar Rydzak)* отметил, что при реализации риска кризисной ситуации репутация может служить одним из ресурсов или активов организации, обеспечивающих достижение ее целей, и использоваться как щит, предохраняющий бизнес-процессы от возможных негативных последствий. Для понимания характера кризисной ситуации и изменений необходимо изучать не только механизм сотрудничества между организацией и средствами массовой информации, но также поведение менеджеров и их намерения. Преимущества, достигнутые менеджерами в краткосрочной перспективе, более привлекательны с точки зрения управления риском, чем затраты или потери, которые могут возникнуть через несколько лет.

Профессор кафедры экономики и менеджмента в строительстве Петербургского государственного университета путей сообщения Императора Александра I, профессор, д-р техн. наук *П.В. Герасименко* в докладе «О некоторых методологических аспектах теории риска: оценивание и управление» рассмотрел ситуацию с позиций системной методологии. По мнению докладчика, риск – субъективная характеристика меры реальности отклонения от планируемой цели функционирования объекта (системы), предсказанной субъектом по прогнозной конечной цели, которая задается в условиях неопределенности, что может привести к различным размерам негативных последствий для субъекта. Управлять риском – значит целенаправленно, непрерывно или дискретно воздействовать на внешнюю среду или изменять внутреннее состояние объекта с целью изменения показателей риска. В качестве практического приложения рассматриваемой методологии приводится решение задачи прогнозирования и оценивания показателей риска. Управление риском иллюстрируется примером из области задач своевременной доставки груза по железной дороге.

Актуальность темы доклада профессора Познаньского университета экономики и бизнеса (Польша), д-ра экон. наук *Яцека Требецки*

(Jaceka Trębecki) «Сценарий создания симуляции кризиса» обусловлена тем, что имитация кризиса при помощи искусственных систем становится одним из наиболее эффективных инструментов обучения антикризисной команды в современных условиях. Сценарий, соответствующий целям имитирования (симуляции), должен быть технологически, экономически и психологически правдоподобным. Такой сценарий труднопредсказуем, но должен быть тем не менее разработан как компактная причинно-следственная цепочка знаний. Важной особенностью успешного сценария считается его эвокативность, т.е. свойство сценария сохранять единство и внутреннюю структуру связей между информационными концептами при взаимодействии сценария с другими структурами знаний. Это свойство реализуется путем вовлечения участников антикризисной команды в моделируемые процессы коммуникации и процессы принятия решений.

Главный эксперт ООО «РМС-Оценка», канд. техн. наук *Д.Д. Кузнецов* и эксперт ООО «РМС-Оценка», д-р техн. наук *П.А. Козин* в своем докладе «Судебные риски в управлении проектами и объектами недвижимости» отмечают, что фактически суд определяет не рыночную, а справедливую стоимость, понятие о которой как о базе оценки в законодательстве Российской Федерации отсутствует. В результате проведенного исследования обоснован подход судебного органа к поиску справедливой стоимости, а также показано, что процедура принятия решения путем сравнительного анализа позиций сторон состоит в формировании величины справедливой стоимости на базе двух инвестиционных стоимостей участников спора.

При этом докладчики призывают участников инвестиционной деятельности признать, что все параметры проекта являются нечеткими. Для обеспечения возможности снижения судебных рисков необходимо иметь доступ к базе выполненных заключений экспертов для их изучения, анализа и обобщения. При исследованиях и расчетах следует исполь-

зовать категорию качества и методы расчета коэффициента качества проекта. Качество проекта и справедливая стоимость должны оцениваться по специально разработанному коэффициенту качества проекта.

В рамках Конференции была организована панельная дискуссия по проблемам управления рисками в цифровой экономике, в ходе которой участники обсудили актуальные проблемы и перспективы развития теории и практики идентификации, управления рисками и контроллинга в интенсивно развивающейся цифровой экономике. Особое внимание участники дискуссии уделили контроллингу как комплексной системе поддержки принятия управленческих решений, которая включает управление рисками и информационное обеспечение процессов координирования взаимодействия систем управления и контроля эффективности. Таким образом, функция контроллинга обеспечивает количественное измерение и контроль рисков, а также оценку максимально ожидаемых потерь (Value at risk – цены риска) на основе применения цифровых моделей и методов. Одновременно контроллинг обеспечивает информационно-аналитическую поддержку систем управления рисками.

Очень правильно, что второй день Конференции был посвящен обсуждению докладов молодых ученых – студентов, магистрантов и аспирантов. Для того чтобы молодой талант смог проявиться, надо открыть для него возможности и подготовить почву для роста, предоставить квалифицированную поддержку. Причем это должна быть планомерная, систематическая работа, сопровождающая молодых людей, начинающих ученых со студенческой скамьи. Молодые люди должны получить возможность раскрыть свой талант, а преподаватели и работники науки должны его поддержать и достойно оценить.

Доклады молодых ученых были с интересом встречены аудиторией. Из них семь докладов аспирантов, магистрантов и студентов получили высокую оценку с точки зрения актуальности тематики, теоретической и прак-

тической значимости, оригинальности и научной новизны результатов.

Доклад аспирантки ПГУПС, экономиста инвестиционной службы ОктЖД – филиала ОАО «РЖД» *Анастасии Стасишиной-Ольшевской* был посвящен стоимостной оценке риска потребности в дополнительном финансировании реконструкции железнодорожной станции «Волховстрой». Такое исследование было предпринято для повышения достоверности определения сметной стоимости. Особое внимание при этом было уделено этапу идентификации риска и построению профиля риска. В итоге была предложена инновационная методика управления риском потребности в дополнительном финансировании строительства на этапе проектной подготовки и разработаны рекомендации для комплексного управления таким риском.

В докладе аспирантки СПбГЭУ *Маргариты Гончаровой* были рассмотрены институциональные аспекты риска нарушения прав собственности, возникающие в деятельности подрядных организаций, и приведена статистика положения России в мировом рейтинге стран по уровню защиты прав собственности. По результатам исследования сделан вывод о том, что снижение рисков прав собственности необходимо для повышения эффективности деятельности подрядных организаций путем снижения трансакционных издержек.

Аспирантка ПГУПС *Мария Щербакова* в своем докладе «Правовые аспекты и пути минимизации рисков заказчика при осуществлении закупок в строительстве» рассмотрела последние изменения контрактной системы в сфере государственных закупок и контрактные риски заказчика при определении поставщика (подрядчика, исполнителя) и заключении государственного контракта на поставку товаров, выполнение работ, оказание услуг в строительстве. Предложен метод конкурсного ценообразования и определения цены государственного контракта с учетом надежности поставщика.

Доклад магистранта ПГУПС *Ксении Синьковой* «Надежность поставщика и кон-

трактный риск: есть ли связь?» был ориентирован на анализ влияния надежности поставщика (подрядчика, исполнителя) на контрактный риск по договорам подряда на поставку товаров, работ, услуг. В докладе отражены полученные в ходе исследования детерминированные и вероятностные показатели надежности поставщика и возможности их применения в целях закупки. Показано, что применение критерия надежности поставщика в сфере закупок обеспечивает наибольшее раскрытие состояния конкурентной среды и объективно отражает способность поставщика выполнить требования контракта.

Магистранты ПГУПС *Мария Дюба* и *Евгения Парфенова* свой доклад посвятили исследованию риска спроса в проектах дорожного строительства, реализуемых в России в рамках государственно-частного партнерства (ГЧП). В частности, было отмечено, что риск спроса на пользование платными автомобильными дорогами растет, что неизбежно создает проблемы обеспечения эффективности проектов ГЧП и более обоснованного распределения риска между партнерами.

В докладе студентов ПГУПС *Александра Скоблика* и *Дмитрия Комарова* рассмотрены методы оценивания рисков инвестиционных проектов в строительной индустрии, а студент ПГУПС *Кирилл Травкин* в своем докладе раскрыл особенности управления рисками проекта на примере строительства моста Бетанкура через Малую Неву в районе о. Серный.

По результатам Конференции опубликован и размещен в информационно-аналитической системе РИНЦ на платформе eLibrary.ru сборник научных трудов Конференции «Управление рисками в экономике: проблемы и решения». Материалы сборника научных трудов отражают взгляды и мнения участников научно-практической Конференции РИСК'Э-2018 по рассматриваемым проблемным вопросам теории и практики управления рисками в экономике.

В рамках культурной программы участницы Конференции посетили Музей Петер-

бургского государственного университета путей сообщения Императора Александра I и кабинет Августина Бетанкура – с иллюстративными материалами, макетами и обстановкой XIX в. (https://www.pgups.ru/struct/muzey_pgups/kabinet-avgustina-betankura).

Список литературы

Управление рисками в экономике: проблемы и решения / Айбулатова Ю.А., Алексеев Н.А., Ардзинов В.Д. и др.; под ред. д-ра техн. наук, проф. С.Г. Опарина // Труды научно-практической конференции с международным участием (РИСК'Э-2018) 15–16 ноября 2018 г. СПб.: ПОЛИТЕХ-ПРЕСС, 2018. 395 с.