

ОТЗЫВ

на автореферат диссертации Клёвиной М.В.

“Экономико-математические модели оптимизации затрат в системе управления рисками предприятия”, представленной на соискание учёной степени кандидата экономических наук по специальности 5.2.2 – Математические, статистические и инструментальные методы в экономике

Диссертация М.В. Клёвиной посвящена исследованию проблем управления рисками предприятия. Актуальность данной темы не вызывает сомнений, несмотря на уже имеющуюся проработанность в специальной литературе. Естественным математическим аппаратом для описания моделей оптимизации затрат в контексте анализа и управления рисками в деятельности предприятия являются теория принятия решения и исследование операций, применение которых представлено в работе.

Диссертационное исследование выполнено достаточно квалифицированно и позволило получить ряд практических рекомендаций по оптимизации затрат в системе управления рисками предприятия. К безусловным плюсам работы следует отнести детальную проработку теоретической базы, грамотную математическую формализацию изучаемых экономических проблем и реализованную численную апробацию, иллюстрирующую эффективность практического применения полученных результатов.

Основные положения диссертации описаны в автореферате с надлежащей полнотой и ясностью, обоснована теоретическая и практическая значимость диссертационной работы. К основным результатам исследования относятся следующие:

1) классификация видов рисков промышленных предприятий с одновременным учётом внешних и внутренних факторов влияния в разрезе процессов деятельности предприятия;

2) задача принятия решений по минимизации затрат промышленного предприятия формализована и представлена в виде экономико-математической модели оптимизации распределения затрат на управление рисками и снижение ущерба от их возникновения; предложена методика оптимизации структуры затрат в системе управления рисками предприятия;

3) разработана экономико-математическая модель минимизации затрат предприятия на этапе принятия решения о ликвидации ущерба при наступлении рисков событий;

4) на основе построенных моделей сформирована комплексная программа управления рисками, позволяющая реализовать различные способы митигации промышленных рисков предприятия на разных этапах.

К автореферату имеется ряд замечаний.

- Отсутствует обоснование научной новизны проведенной классификации рисков промышленных предприятий (стр.8); отличие от уже имеющихся классификаций в тексте не акцентировано.
- В работе предложен комбинированный подход применения предупредительных мероприятий и страхования; сказано, что «при таком подходе размер ожидаемого ущерба может быть ниже, чем при страховании рисков событий» (стр. 9). Однако составленная система (7) (стр.10) не предполагает, что этот подход фор-

Входящий № 206-467
Дата 03 АЕН 2024
Самарский университет

мирует перераспределение средств из резервного фонда предприятия между мероприятиями по трансформации и финансированию рисков.

- Второе условие в системе (16) (стр.13) выглядит избыточным. Отсутствует определение множества E в тексте.
- В тексте имеются стилистические и синтаксические ошибки, а также опечатки.

Несмотря на указанные замечания, диссертация М.В. Клёвиной является самостоятельным, законченным научным исследованием, представляет научный и практический интерес и полностью удовлетворяет всем требованиям, предъявляемым к кандидатским диссертациям, а её автор заслуживает присуждения ученой степени кандидата экономических наук по специальности 5.2.2 – Математические, статистические и инструментальные методы в экономике

Сурия Шакировна Кумачева,
доцент кафедры управления рисками и страхования
федерального государственного
бюджетного образовательного учреждения высшего образования
«Санкт-Петербургский государственный университет»,
кандидат физико-математических наук Кумач С.Ш. Кумачева

«21» ноября 2024 г.

Я, Сурия Шакировна Кумачева, даю согласие на использование моих персональных данных в целях, связанных с защитой диссертации Клёвиной Марии Васильевны, и их дальнейшую обработку.

Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение высшего образования «Санкт-Петербургский государственный университет»
199034, Россия, Санкт-Петербург, Университетская наб., д. 7–9
тел.: 8 (812) 363–64–94 <https://spbu.ru/> e-mail: spbu@spbu.ru

Подпись С.Ш. Кумачевой удостоверяю:

Ведущий специалист по кафедре И.И. Думинков)
«21» ноября 2024 г.

