

ЗАКЛЮЧЕНИЕ ДИССЕРТАЦИОННОГО СОВЕТА 24.2.379.06, СОЗДАННОГО  
НА БАЗЕ ФЕДЕРАЛЬНОГО ГОСУДАРСТВЕННОГО АВТОНОМНОГО  
ОБРАЗОВАТЕЛЬНОГО УЧРЕЖДЕНИЯ ВЫСШЕГО ОБРАЗОВАНИЯ  
«САМАРСКИЙ НАЦИОНАЛЬНЫЙ ИССЛЕДОВАТЕЛЬСКИЙ УНИВЕРСИТЕТ  
ИМЕНИ АКАДЕМИКА С. П. КОРОЛЕВА»  
МИНИСТЕРСТВА НАУКИ И ВЫСШЕГО ОБРАЗОВАНИЯ  
РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ  
ПО ДИССЕРТАЦИИ НА СОИСКАНИЕ УЧЕНОЙ СТЕПЕНИ КАНДИДАТА НАУК

аттестационное дело № \_\_\_\_\_

решение диссертационного совета от 18 декабря 2024 года №30 о присуждении  
Клёвиной Марии Васильевне, гражданке РФ, ученой степени кандидата  
экономических наук.

Диссертация «Экономико-математические модели оптимизации затрат в системе управления рисками предприятия» по специальности 5.2.2. Математические, статистические и инструментальные методы в экономике принята к защите 16 октября 2024 г. (протокол заседания № 21) диссертационным советом 24.2.379.06, созданным на базе федерального государственного автономного образовательного учреждения высшего образования «Самарский национальный исследовательский университет имени академика С.П. Королева» Министерства науки и высшего образования Российской Федерации (443086, г. Самара, Московское шоссе, 34) приказом Министерства науки и высшего образования Российской Федерации от 28.06.2022 г. № 768/нк, с изменениями, внесенными приказом Министерства науки и высшего образования Российской Федерации от 18.07.2023 №1567/нк.

Клёвина Мария Васильевна, 01.09.1997 года рождения, в 2021 г. с отличием освоила программу подготовки в магистратуре федерального государственного автономного образовательного учреждения высшего образования «Самарский национальный исследовательский университет имени академика С.П. Королева» по направлению 38.04.01 Экономика, присвоена квалификация «Магистр». В 2024 г. освоила программу подготовки научно-педагогических кадров в аспирантуре федерального государственного автономного образовательного учреждения высшего образования «Самарский национальный исследовательский университет имени академика С.П. Королева» по направлению подготовки 38.06.01 Экономика, присвоена квалификация «Исследователь. Преподаватель-исследователь». В настоящее время Клёвина М.В. работает в должности

ассистента кафедры экономики, по совместительству специалистом по связям с общественностью отдела по взаимодействию с работодателями федерального государственного автономного образовательного учреждения высшего образования «Самарский национальный исследовательский университет имени академика С.П. Королева» Министерства науки и высшего образования Российской Федерации.

Диссертация выполнена на кафедре менеджмента и организации производства федерального государственного автономного образовательного учреждения высшего образования «Самарский национальный исследовательский университет имени академика С.П. Королева» Министерства науки и высшего образования Российской Федерации.

Научный руководитель – доктор экономических наук, профессор Иванов Дмитрий Юрьевич, заведующий кафедрой менеджмента и организации производства, директор института экономики и управления федерального государственного автономного образовательного учреждения высшего образования «Самарский национальный исследовательский университет имени академика С.П. Королева».

Официальные оппоненты: **Шинкевич Алексей Иванович**, доктор экономических наук, доктор технических наук профессор, федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение высшего образования «Казанский национальный исследовательский технологический университет», кафедра логистики и управления, заведующий кафедрой; **Яшин Сергей Николаевич**, доктор экономических наук, профессор, федеральное государственное автономное образовательное учреждение высшего образования «Национальный исследовательский Нижегородский государственный университет им. Н.И. Лобачевского», кафедра менеджмента и государственного управления, заведующий кафедрой, – дали положительные отзывы на диссертацию.

Ведущая организация: федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение высшего образования «**Воронежский государственный технический университет**» (г. Воронеж) в своём положительном заключении, подготовленном д.т.н., профессором, заведующим кафедрой управления Баркаловым Сергеем Алексеевичем, к.э.н., доцентом, заведующим кафедрой цифровой и отраслевой экономики Анисимовой Надеждой Александровной, и утвержденном проректором по науке и инновациям, д.т.н., доцентом Башкировым Алексеем Викторовичем, указала, что диссертация представляет собой выполненную научно-квалификационную работу, в которой решена научная задача разработки и обосновании экономико-математических моделей оптимизации затрат

промышленного предприятия на управление рисками, что имеет существенное значение для экономики страны.

Соискатель имеет 14 опубликованных работ, в том числе по теме диссертации опубликовано 14 работ, общим объемом 8,32 п.л. (авторских – 5,9 п.л.), из них в рецензируемых научных изданиях из перечня Высшей аттестационной комиссии опубликовано 3 работы. Все публикации соответствуют теме диссертации и раскрывают ее основное содержание. В диссертации отсутствуют недостоверные сведения об опубликованных соискателем учёной степени работах. Наиболее значимые работы:

1. Клёвина, М.В. Сравнительный анализ материального ущерба от возникновения рисков событий на промышленных предприятиях и затрат на предупредительные мероприятия (на примере регионов ПФО) / М.В. Клёвина // Вестник Самарского университета. Экономика и управление. – 2022. – Т. 13. – № 2. – С. 41–50 (научная статья 1,25 п.л./ 0,6 п.л.).

2. Клёвина, М.В. Моделирование системы управления рисками промышленного предприятия / Д.Ю. Иванов, Е.П. Ростова, М.В. Клёвина // Вестник Пермского университета. Серия: Экономика. – 2023. – Т. 18. – № 3. – С. 247–257 (научная статья 1,3 п.л. / 0,8 п.л.).

3. Клёвина, М.В. Страховая компания в системе управления рисками производства / Д.Ю. Иванов, Е.П. Ростова, М.В. Клёвина // Вестник Самарского университета. Экономика и управление. – 2023. – Т. 14. – № 3. – С. 167–176 (научная статья 1,25 п.л. / 0,8 п.л.).

На автореферат диссертации поступило 8 отзывов от организаций:

1. Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение высшего образования «Тольяттинский государственный университет» (г. Тольятти), подписан директором института финансов экономики и управления доктором экономических наук, профессором Искосковым Максимом Олеговичем. Замечания: 1) Имеются замечания по оформлению иллюстраций, схем (стр. 12, 13, 29, 57). Следовало бы использовать стандартные нотации, соблюдать ГОСТ. 2) Не обозначено, какими компетенциями должен обладать работник, привлекаемый к применению методики проведения оптимизации структуры затрат в системе управления рисками.

2. Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение высшего образования «Санкт-Петербургский государственный университет» (г. Санкт-Петербург), подписан доцентом кафедры управления рисками и страхования, кандидатом физико-математических наук, Сурией Шакировой Кумачевой. Замечания: 1) Отсутствует обоснование научной

новизны проведённой классификации рисков промышленных предприятий (стр.8); отличие от уже имеющихся классификаций в тексте не акцентировано. 2) 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 формирует перераспределение средств из резервного фонда предприятия между мероприятиями по трансформации и финансированию рисков. 3) Второе условие в системе (16) (стр. 13) выглядит избыточным. Отсутствует определение множества  $E$  в тексте. 4) В тексте имеются стилистические и синтаксические ошибки, а также опечатки.

3. Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение высшего образования «Брянский государственный технический университет» (г. Брянск), подписан профессором кафедры отраслевой экономики и управления, доктором экономических наук Стрижаковой Екатериной Никитичной. Замечания: 1) Из автореферата не ясно, как именно соискатель предлагает учитывать внешние и внутренние факторы влияния в процессе классификации видов рисков промышленных предприятий. 2) Автором сформирован комплексный механизм управления промышленными рисками предприятия. Следовало бы указать, возможно ли применение данного механизма в процессе управления другими видами рисков предприятия.

4. Федеральное государственное автономное образовательное учреждение высшего образования «Казанский (Приволжский) федеральный университет» (г. Казань), подписан заведующим кафедрой финансовых рынков и финансовых институтов, доктором экономических наук, профессором Аюповым Айдаром Айратовичем. Замечание: В автореферате в рамках описания пятого пункта научной новизны (стр. 13-15) не указано разделение на заявленные этапы планирования и оценки, как осуществляется переход с одного этапа на другой, существует ли ограничение по числу рисков, входящих в перечень. Эти моменты требуют авторских пояснений.

5. Публичное акционерное общество «ОДК-Кузнецов» (г. Самара), подписан директором программы «РФ» ПАО «ОДК-Кузнецов», кандидатом экономических наук, Мартьяновым Константином Павловичем. Замечание: 1) Примененная экономико-математическая модель хорошо формализована, но требует дополнительных обоснований в части выбора параметров, таких как «параметр функции зависимости размера ущерба от затрат на предупредительные мероприятия» ( $A_j$ ). Поскольку этот параметр

определяется экспертным путём, возникает вопрос о степени точности и воспроизводимости модели в разных отраслях и условиях.

6. Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение высшего образования «МИРЭА - Российский технологический университет» (г. Москва), подписан заведующим кафедрой финансового учета и контроля, доктором экономических наук, профессором Банком Сергеем Валерьевичем. Замечания: 1) На странице 9 вводится переменная  $\Phi$ , обозначающая максимальный фонд затрат на систему управления рисками. На странице 10 данный показатель обозначен переменной  $\Phi^{max}$ . Исходя из текста работы неясно, является ли это опечаткой, или это разные переменные. 2) На страницах 15-18 выполнена апробация комплексного механизма, предложенного в новизне 5. Не указан временной период, в рамках которого выполнено исследование.

7. Федеральное государственное автономное образовательное учреждение высшего образования «Пермский национальный исследовательский политехнический университет» (г. Пермь), подписан профессором кафедры менеджмента и маркетинга, доктором экономических наук, доцентом Акатовым Николаем Борисовичем. Замечание: В исследовании предложена модель минимизации затрат предприятия на этапе планирования ликвидации ущерба при наступлении рискованных событий. Однако из содержания автореферата неясно, каким образом учитывается вероятность наступления рискованного события.

8. Федеральное государственное автономное образовательное учреждение высшего образования «Санкт-Петербургский государственный электротехнический университет «ЛЭТИ» им. В.И. Ульянова (Ленина)» (г. Санкт-Петербург), подписан доцентом кафедры экономики технологического предпринимательства, кандидатом экономических наук, Медведевой Екатериной Никитичной. Замечания: 1) На странице 12 представлено выражение (13), позволяющее выполнить расчёт затрат на страхование в том случае, если рискованное событие одновременно предупреждается и страхуется. Не приведено, по какому принципу необходимо относить рискованное событие к данной категории. 2) По нашему мнению, в автореферате следовало бы указать помимо таблицы 4 ещё графическую интерпретацию экономического эффекта реализации комплексного механизма.

Во всех отзывах отмечено, что указанные недостатки не снижают научную и практическую значимость работы и не влияют на общую положительную оценку диссертации. Во всех отзывах отмечено, что диссертация соответствует требованиям ВАК Минобрнауки России, предъявляемым к кандидатским диссертациям, и сделано заключение о

возможности присуждения Клёвиной Марии Васильевне ученой степени кандидата экономических наук по специальности 5.2.2. Математические, статистические и инструментальные методы в экономике.

Выбор официальных оппонентов и ведущей организации обосновывается высокой компетентностью ученых в области исследования научной работы Клёвиной Марии Васильевне, что подтверждается их научными публикациями в области экономико-математического моделирования и инструментального обеспечения экономической деятельности, а также работами по исследованию тематики управления рисками, оптимизации затрат на управление рисками. Оппоненты не являются работниками организации, где выполнялась диссертация, соавторами соискателя, членами диссертационного совета, а также являются работниками разных организаций. Ведущая организация является передовым научным учреждением в области моделирования логистических процессов и имеет специалистов, способных определить научную и практическую ценность диссертации.

Диссертационный совет отмечает, что на основании выполненных соискателем исследований:

**разработан** комплексный механизм управления промышленными рисками предприятия, позволяющий на этапе планирования оптимизировать затраты на их предупреждение и страхование, а на этапе оценки полученных результатов по истечению горизонта планирования минимизировать затраты на ликвидацию ущерба в случае, если рискованные события произошли (стр. 75-80);

**предложена** системная классификация видов рисков промышленных предприятий с одновременным учётом внешних и внутренних факторов влияния в разрезе процессов деятельности предприятия, позволяющая более эффективно оценивать влияние эндогенных и экзогенных факторов возникновения риска в конкретных видах деятельности промышленных предприятий (стр. 11-30);

**доказаны** зависимости, позволяющие оптимизировать структуру затрат в системе управления рисками предприятия, а именно аналитически рассчитать оптимальный размер затрат на предупредительные мероприятия и на страхование рискованных событий. (стр. 67-69);

**введена** уточненная трактовка зависимости вероятности наступления рискованного события и размера возможного ущерба от затрат на предупредительные мероприятия (стр. 65).

Теоретическая значимость исследования обоснована тем, что:

– **доказаны** теоретические положения, обосновывающие научный подход к экономико-математическому моделированию процессов принятия управленческих решений в системе управления рисками промышленных предприятий, позволяющий проводить оптимизацию затрат как на этапе планирования, так и на этапе устранения полученного ущерба (стр. 63-75);

– **применительно к проблематике диссертации результативно** (эффективно, то есть с получением обладающих новизной результатов) использованы методы эконометрического моделирования, экономико-математического моделирования, теории активных систем, методы анализа и синтеза;

– **изложены** этапы методики оптимизации структуры затрат в системе управления рисками предприятия, позволяющие получать аналитические выражения для определения оптимального размера затрат на страхование рисков и на их предупреждение;

– **раскрыты** существующие проблемы в области управления рисками промышленных предприятий, основанные на экономической нестабильности, усложнении производственных процессов, специфике производственной деятельности, а также непрерывности производственной деятельности, исследованы тенденции развития системы управления рисками предприятия (с. 30-38);

– **изучены факторы и причинно-следственные связи** в системе управления рисками промышленных предприятий, которые позволили разработать ряд экономико-математических моделей, направленных на оптимизацию затрат на страхование и предупреждение рисков событий и ликвидацию ущерба в результате их наступления (с. 18-30);

– **проведена модернизация существующих экономико-математических моделей**, в части предложенной функциональной зависимости между размером затрат на предупредительные мероприятия и величиной возможного ожидаемого ущерба (с. 63-66).

Значение полученных соискателем результатов исследования для практики подтверждается тем, что:

– **разработана и внедрена методика** минимизации затрат промышленного предприятия на этапе принятия решения о ликвидации ущерба при наступлении рисков событий, позволяющая осуществлять выбор подрядчиков в случае их привлечения по критериям минимизации сроков и стоимости выполнения работ (стр. 70-75);

– **определены** перспективы практического использования материалов диссертационного исследования на предприятиях в системе

управления рисками, так и высшими учебными заведениями при изучении различных дисциплин по направлениям «Экономика», «Менеджмент» и «Бизнес-информатика»;

– **создана** система практических рекомендаций, состоящих в возможности формирования и систематизации необходимой исходной информации для оптимального планирования затрат на страховые и предупредительные мероприятия с возможностью её актуализации по итогам оценки достигнутых результатов (стр. 75-80);

– **представлены** результаты апробации разработанных экономико-математических моделей, методик и механизмов оптимизации затрат на примере конкретного промышленного предприятия, подтверждающие их эффективность и целесообразность использования в системе управления рисками (с. 95-110).

Оценка достоверности результатов исследования выявила:

– **теория построена на использовании** теоретической и методологической базы трудов отечественных и зарубежных ученых в области экономико-математического моделирования оптимизации затрат в системе управления рисками;

– **идея диссертационного исследования базируется на обобщении передового опыта**, научных результатах современных исследователей в вопросах, связанных с направлениями развития системы управления рисками;

– **использовано сравнение авторских данных и данных, полученных ранее по рассматриваемой тематике** в области формирования экономико-математических моделей оптимизации затрат в системе управления рисками;

– **установлено качественное совпадение** авторских результатов с результатами, представленными в независимых источниках по данной тематике, опубликованными в работах различных авторов, аналитических обзорах, обобщающих опыт исследования процессов оптимизации затрат в системе управления рисками;

– **использованы** современные методики сбора и обработки исходной информации, позволившие представить значительный объем эмпирического материала в табличной и графической формах.

**Личный вклад соискателя состоит** в подготовке диссертационного исследования на каждом этапе и непосредственном участии соискателя в определении направления исследования, постановке его цели и задач; выявлении существующих проблем в предметной области исследования;

сборе, систематизации и обработке статистических и фактических данных; разработке основных положений и выводов исследования; личном участии в апробации результатов исследования; подготовке публикаций по выполненной работе.

В ходе защиты диссертации не было высказано критических замечаний.

Соискатель Клёвина М.В. обоснованно ответила на все задаваемые в ходе заседания вопросы.

На заседании 18 декабря 2024 года диссертационный совет за решение научной задачи, имеющей существенное значение для развития соответствующей отрасли знаний, принял решение присудить Клёвиной М.В. учёную степень кандидата экономических наук.

При проведении тайного голосования диссертационный совет в количестве 11 человек, из них 4 доктора наук по специальности рассматриваемой диссертации, участвовавших в заседании, из 15 человек, входящих в состав совета, проголосовали: за – 11, против – 0, недействительных бюллетеней – 0.

Заместитель председателя  
диссертационного совета 24.2.379.06



*[Handwritten signature]*

Тюкавкин Н. М.

Учёный секретарь  
диссертационного совета 24.2.379.06

*[Handwritten signature]*

Анисимова В. Ю.

18.12.2024