

УДК 338.242

© **Валентин Васильевич Катов,**
кандидат экономических наук,
Владимирский филиал РАНХиГС
E-mail: kwant55@ mail.ru

V. V. Katov,
PhD in Economics
The Vladimir Branch of the RANEPA

УПРАВЛЕНИЕ НЕОПРЕДЕЛЕННОСТЬЮ И РИСКАМИ В РЕГИОНАЛЬНЫХ ЭКОНОМИЧЕСКИХ ПРОЦЕССАХ

Uncertainty and risk management in regional economic processes

Аннотация: региональное управление экономико-социальными процессами при принятии множества решений подвержено влиянию определенных рисков и факторов неопределенности. Регион есть сложная, открытая, динамически развивающаяся система, с взаимосвязанностью большинства факторов развития, когда результативность при принятии решений не всегда очевидна. Неопределенность по своей природе имеет множество форм, проявление которых может зависеть как от человеческого фактора, так и от многих процессов, не всегда напрямую связанных с ним. Неопределенность и риск всегда взаимозависимы, риск при принятии управленческих решений однозначно высок при росте неопределенности. Во всех случаях высокий уровень неопределенности подразумевает и большие риски получения конечных результатов в экономике. В работе рассмотрены роль фактора неопределенности и рисков в управлении региональными социально-экономическими процессами.

Resume: Regional management of economic and social processes in making a variety of decisions is subject to the influence of certain risks and uncertainties. The region is a complex, open, dynamically developing system, with the interconnectedness of most development factors, when the effectiveness, when making decisions, is not always obvious. Uncertainty by its nature has many forms, the manifestation of which may depend on both the human factor and many processes, not always directly related to it. uncertainty and risk are always interdependent, the risk in making management decisions is unambiguously high with increasing uncertainty. In all cases, a high level of uncertainty also implies high risks of obtaining final results in the economy. The paper considers the role of the factor of uncertainty and risks in the management of regional socio-economic processes.

Ключевые слова: управление, регион, риски, неопределенность, прогнозирование, информация, экономическая среда.

Keywords: management, region, risks, uncertainty, forecasting, information, economic environment.

Решение многих экономических проблем регионального уровня невозможно без использования прогнозирования как важного фактора

системы управления процессами. Решение перспективных региональных задач без умелого прогнозирования представить сложно. Профессиональный подход к вопросам прогнозирования обеспечивает максимальный конечный результат как в решении экономических, так и иных проблем управления регионом. В то же время следует отметить наличие *фактора неопределенности*, зачастую очень высокого уровня, который не позволяет в полной мере достичь прогнозируемых результатов. Экономическая неопределенность как сумма отдельных факторов влияет на любую экономическую систему. Исследованиям влияния неопределенности на решение многих социально-экономических проблем уделяется многими учеными пристальное внимание.

Так, Кеннет Эрроу, автор теоремы Эрроу, или «*Парадокса Эрроу*», лауреат Нобелевской премии, о влиянии неопределенности на большинство социально-экономических задач, утверждает: «Наши познания о ходе дел в обществе и природе тонут в тумане неопределенности (курсив наш. – В. К.). Вера в определенность... бывала причиной многих бед. Освобождаясь от прошлого, мы можем стать рабами новой религии, убеждений столь же неправомерных, ограниченных и произвольных, как и старые предрассудки. Об этом следует помнить особенно в период реформ, трансформаций и других серьезных преобразований, когда наступает так называемая асимметрия взаимосвязи прошлых и будущих событий <...> где существует неопределенность, там и имеется возможность ее уменьшить, называемая информацией. Информация – понятие, прямо противоположное термину "неопределенность"...» [13].

Еще в 1888 году Томас Эдвард Клифф Лесли, североирландский экономист, входящий в список 100 великих экономистов до Кейнса, в своей работе «*История экономической мысли*» указывал, что «в той мере... в которой развивается промышленность и торговля, происходит... рост ее диверсификации, изменчивости, *неопределенности* (курсив наш. – В. К.), непредсказуемости даже на данном этапе ее существования...» [7].

Профессор Чикагского университета Френк Хайнеман Найт в своей монографии «*Риск, неопределенность и прибыль*» (1921г.) указывает, что «...*риск есть измеримая неопределенность* (курсив наш. – В. К.), отличающаяся от неизмеримой определенности настолько, что по существу ею не является, а собственно неопределенность связана со случаями неколичественного рода...» [9, 10]. Он считал, что риск предполагает ситуацию, когда известен вероятный, возможный результат, неопределенность же, наоборот, не предполагает такой сценарий, при наличии неопределенности конечный результат неизвестен. Недостаточность наших знаний о будущих событиях является основным критерием неопределенности.

Джон Мейнард Кейнс, английский экономист, ситуацию неопределенности в экономических процессах охарактеризовал как состояние когда «...нет научных оснований для вычисления какой-либо вероятности... тем не менее необходимость действовать и принимать решения заставляет нас

игнорировать этот неудобный факт, как если бы у нас был утилитаристский расчет будущих преимуществ и недостатков...» [6].

Неопределенность по своему влиянию на развитие экономики, по оперативному управлению, степени прогнозирования различна. По нашему мнению, экономическая неопределенность есть характеристика изменчивости среды, в том числе и экономической, которая затрудняет прогноз, оценку последствия принимаемых управленческих решений. Экономическая неопределенность характеризует, в первую очередь, изменчивость экономической системы, уровень неспособности субъектов экономики в оценке своих управленческих решений по совокупности ряда факторов, и в основном в силу отсутствия у них необходимой и в достаточном объеме *информации*. Неопределенность, по нашему мнению, не является какой-либо ситуацией, возникающей только и исключительно под воздействием тех или иных факторов и при их устранении исчезающей.

Процесс регионального прогнозирования может осуществляться по различным методикам, применение которых обусловлено рядом исходных данных и целей: точностью прогноза, качеством используемой информации, ожидаемых изменений того или иного параметра исследуемой системы. Регион есть сложная, открытая, динамически развивающаяся система, с взаимосвязанностью большинства факторов развития, когда результативность при принятии решений не всегда очевидна. В таких случаях следует проводить исследования какой-либо системы в режиме неоднозначности, *неопределенности*. Следует учитывать, что *неопределенность есть неотъемлемая характеристика экономической среды*, в которой находятся все субъекты экономики, в том числе и государство. И, как указывалось ранее, основным источником неопределенности является отсутствие информации в том объеме, который бы позволил дать полноценную и качественную оценку последствий принимаемых управленческих решений. Восприятие экономической неопределенности достаточно субъективно, соответственно и результаты противодействия могут быть неоднозначны. Следует учитывать основные параметры отбора показателей, влияющих на конечный результат: полнота и достаточность данных, их системность и открытость, непрерывность, качество информационного материала, доверие к источникам информации.

При принятии решений в условиях неопределенности и возможности получения желаемых, прогнозируемых результатов зачастую применяются три модели выбора решений:

- высокая степень *определенности*, когда заранее известен конечный результат при выполнении определенных требований;
- наличие *определенного риска*, когда возможность получения конкретного множества результатов можно просчитать с помощью экспертных оценок;

- высокая степень *неопределенности*, когда вероятность множества конкретных результатов вследствие тех или иных принимаемых решений сложно спрогнозировать или это не имеет смысла.

Характеристику ситуации при принятии решения в процессе деятельности экономических субъектов, связанную с субъективной оценкой конкретного лица сложившейся экономической ситуации, следует воспринимать как результат решения конкретного лица, основанный на риске, в состоянии неопределенности, зависящий от экономических интересов конкретного лица.

Неопределенность по своей природе имеет множество форм, проявление которых может зависеть как от человеческого фактора, так и от многих процессов, не всегда напрямую связанных с ним. Выделим некоторые из них:

- *естественная неопределенность*, влияющая неоднозначно на результаты различного рода деятельности многих субъектов экономики и в целом отраслей, основана на сочетании природно-климатических условий и иных факторов естественного характера;

- *социальная неопределенность*, в основном формируется условиями реализации социальных потребностей конкретных групп населения в существующих социальных параметрах и нормах;

- *поведенческая неопределенность* характеризует степень рациональности действий конкретного индивида как элемента социально-экономической системы;

- *стратегическая неопределенность* связана вариантами принятия решений в условиях существующей конкурентной среды, когда конкурирующим сторонам малоизвестны стратегии поведения, условия принятия решений, действующие бизнес-стратегии;

- *концептуальная неопределенность* проявляется в ситуациях принятия решений, влияющих на долгосрочную перспективу, долгосрочные прогнозы и планы, когда цели, потенциальные возможности, направления развития, цели собственные и цели конкурентов не имеют жестко очерченных границ, достаточно расплывчаты в существующей социально-экономической среде.

Возможна классификация неопределенности и по таким параметрам, как: неопределенность среды, неопределенность принятия решений, неопределенность последствий принятых решений, неопределенность вариационного свойства (в случае изменения параметров и условий функционирования исследуемой системы, рассматриваются различные варианты от принятых решений).

Говоря о факторах экономической неопределенности, следует учитывать, что они являются как отражением недостатка информации об экономической системе источников рисков, способствующих не в полной мере возможности спрогнозировать последствия управленческих решений, так и то, что они характеризуют ту часть неопределенности, выделенной из

множества направлений ее воздействия на экономику, увязанного с конкретным экономическим количественным прогнозируемым, ожидаемым конечным показателем, результатом.

Принятию решений по многим вопросам экономического и иного свойства в условиях неопределенности и различной степени риска способствует использование существующих методик, моделирование тех или иных ситуаций на получение желаемого результата. Путем различных экономико-математических методик расчета принятия решений в условиях неопределенности выверяется оптимальное решение в данной ситуации. К основным приемам расчета следует отнести: математическое программирование; теорию вероятностей; теорию стратегических игр; теорию статистических решений и др.

Определенность (неопределенность) ситуации в экономических системах формируется конкретными ограничениями, условиями и мерой, уровнем информации об этом. Зачастую имеющаяся информация не отражает состояние экономической системы с параметрами, близкими к тем, которые можно считать оптимальными.

Наличие альтернативных вариантов решения в условиях неопределенности позволяет в управлении экономическими параметрами эффективнее и с большей оптимальностью предвидеть конечный результат от деятельности.

Качество информации, объективность, неравномерность распределения обязывают участников экономических отношений восполнять требуемый объем информации за счет использования иных источников. Однородность информации зачастую не приводит к оптимальным решениям за счет ее возможной недостоверности, ошибочности, и, в конечном счете, участники экономических отношений не могут принять альтернативное решение, срабатывает «стадный» инстинкт.

Как известно, неопределенность и риск всегда взаимосвязаны, риск при принятии управленческих решений однозначно высок при росте неопределенности. Во всех случаях высокий уровень неопределенности подразумевает и большие риски получения конечных результатов в экономике. В то же время неопределенность подразумевает альтернативность и множественность выбора экономических решений, которые в дальнейшем влияют на оценку вероятности прогнозируемых результатов.

Неопределенность как ограничитель стабильности экономико-социальных систем во всех ее проявлениях определяет параметры системы в плане стабильности и устойчивости. При высоком уровне управляемости система более адекватно и прогнозируемо реагирует на вызовы внутренней и внешней среды.

Выводы

Управление социально-экономическими процессами в российских регионах, в существующей действительности, трудно представить без наличия *фактора неопределенности*, который, по нашему мнению, с каждым годом

возрастает. Остановимся на некоторых моментах, связанных с реализацией национальных проектов и «шоков» от эпидемии коронавируса [1, 2, 3].

«Ковидный» 2019 год стал первым годом торможения промышленной активности не только в нашей стране, но и во всем мире. Шоковое состояние торговых отношений 2019 года несравнимо с тем же кризисом 2009 года, когда темпы роста были гораздо выше темпов роста мирового ВВП [1]. К *росту неопределенности* в экономиках российских регионов следует отнести применение в 2019 году жесткой денежно-кредитной политики, повышение НДС, снижение роста располагаемых доходов. Повышение пенсионного возраста не смогло в планируемых объемах обеспечить экономику дополнительными трудовыми ресурсами [3].

На низкие темпы реализации национальных проектов, озвученных 8 мая 2018 года, по нашему мнению, кроме нерасторопности федеральных органов власти, сложности процедур получения бюджетных средств, сложившегося, в первоначальный период, мнения о некоем саботаже со стороны региональных властей, фактор неопределенности в управлении региональной экономикой имел место. Следует отметить, что важную, если не главную, проблему в реализации национальных проектов сыграли особенности формирования бюджетов всех уровней и их «долевое» участие, что в дальнейшем, в разрезе 12 национальных проектов, позволило разработать 76 федеральных проектов [2]. Новшество, которое бы следовало отнести также к *факторам неопределенности* в управлении экономикой регионов, в данном случае заключалось в том, что были сразу озвучены конкретные суммы бюджетных средств, вместо обычного сбора финансовых ресурсов по расчетам исполнителей проектов.

Новые формы межбюджетных трансфертов, запущенные в 2019 году, внесли свою лепту в управление регионами в режиме *неопределенности*. Распределение бюджетных средств с использованием трансфертов по 188 направлениям, из которых 78 привязаны к национальным проектам, определенности в принятии региональных решений не создают [2]. Количество соглашений, которые регион должен согласовать по любому федеральному проекту, зашкаливает, что приносит в управление финансами немалый *фактор неопределенности*. По нашему мнению, в существующих условиях роль *фактора неопределенности и рисков* в управлении региональными социально-экономическими процессами будет иметь тенденцию к постоянному росту.

Роль неопределенности в управлении экономико-социальными процессами региона



Примечание - составлено автором

Список литературы

1. Официальный сайт Федеральной службы государственной статистики Российской Федерации [Электронный ресурс]. URL: <https://rosstat.gov.ru>.
2. Официальный сайт Министерства финансов Российской Федерации [Электронный ресурс]. URL: <https://minfin.gov.ru>.
3. Официальный сайт Министерства труда и социальной защиты Российской Федерации [Электронный ресурс]. URL: <https://mintrud.gov.ru>.
4. Балынин И. В. Финансовое обеспечение муниципальных образований в условиях экономической турбулентности: приоритеты, проблемы и пути решения // Аудит и финансовый анализ. – 2016. – № 2. – С. 163-167.

5. Васюнина М. Л. Межбюджетные трансферты субъектам Российской Федерации. Современные проблемы и приоритеты // Финансовая аналитика. Проблемы и решения. – 2016. – № 45 (327). – С. 17-27.
6. Кейнс Дж. М., Мизес Л., Найт Ф. Неопределенность, вероятность, этика [Электронный ресурс]. URL: institutions.com/2251-neopredelennost-veroyatnost-etika.html.
7. Клифф Лесли Т. Е. и др. История экономической мысли [Электронный ресурс]. URL: ru.knowledgr.com.
8. Мониторинг экономической ситуации в России [Электронный ресурс] // Тенденции и вызовы социально-экономического развития. – 2020. – № 7 (109). URL: iep.ru/files/text.
9. Найт Ф. Х. Риск, неопределенность, прибыль [Электронный ресурс]. URL: baguzin.ru.
10. Найт Ф. Х. Риск, неопределенность, прибыль / пер. с англ. – М. : Дело, 2003. – 360 с.
11. Полякова О. А. и др. Бюджетная политика Российской Федерации в условиях экономической неопределенности // Вестник финансового университета. – 2015. – № 5. – С. 6-12.
12. Соляникова С. П. Ответственная бюджетная политика в условиях высокого уровня неопределенности: правила разработки и критерии оценки // Инновационное развитие экономики. – 2016. – № 3-2 (33). – С. 92-97.
13. Эрроу К. Парадокс Эрроу [Электронный ресурс]. URL: <https://studme.org>.