

нечеткие критерии комплексной оценки рисков нефтедобывающих организаций

Аннотация

В статье приводятся аргументы, доказывающие необходимость выработки нечетких критериев комплексной оценки рисков для нефтедобывающих организаций в рамках заданной оценочной функции, сделан акцент на их значимости и влиянии на эффективность управления компаниями в условиях неопределенности.

Ключевые слова: нефтяной рынок, природа риска, многоаспектность риска, отклонения резульгитивных показателей, нефтедобывающая организация

Наулов

Александр Васильевич

*д-р экон. наук,
профессор,
заведующий кафедрой
государственного
и муниципального
управления,
Сургутский
государственный
университет
ХМАО – Югры*

Коновалова

Елена Александровна

*аспирантка,
факультет управления,
Сургутский
государственный
университет
ХМАО – Югры
konovalova_ea@mail.ru*

На современном этапе развития важность и значимость нефти сопровождается качественными изменениями мирового нефтяного рынка, который обретает иные параметры. По прогнозам аналитиков лондонского Центра глобальных экономических исследований уже сформировалась его новая структура в условиях неопределенности, что непременно отразится на эффективности деятельности нефтедобывающих организаций [6].

Не стоит забывать и о том, что сырьевой сектор экономики имеет ряд особенностей:

- высокую капиталоемкость проектов освоения и использования природных ресурсов;
- длительные сроки их реализации;
- усложнение техники и технологии поисков, разведки, освоения, добычи и переработки;
- ухудшение сырьевой базы и влияние институциональных условий.

При этом потенциальные и реальные результаты чаще всего отличаются в силу действия этих и других факторов и характеризуют рисковую ситуацию для компаний нефтедобычи [1].

Изучая категорию «риск», авторы заметили ее многоаспектность. Под риском можно понимать вероятность наступления некоего события, отклонение от цели или частный его случай – финансовый результат. Также они отмечают, что согласно Международным стандартам финансовой отчетности традиционными видами деятельности организации признаются операционная, инвестиционная и финансовая активность, что вообще не принимается во внимание при определении риска.

Поэтому уточняя трактовку понятия, авторы определяют риск как вероятность отклонения результативных показателей эффективности ведения операционной, финансовой и инвестиционной деятельности нефтедобывающей организации от планово-прогнозного уровня, связанную с субъективными способностями менеджеров принимать решения в условиях неопределенности.

Комплексная оценка рисков

Такой подход отражает объективно-субъективную природу риска и намечает основные критерии для его оценки. Ссылаясь на причинно-следственную связь и многогранность категории, авторы полагают, что отклонения от цели для организации влекут за собой ряд последствий. Это могут быть как потери, так и выигрыши. Все они имеют разную физическую природу, связанную с материальными сторонами деятельности, трудовыми, финансовыми, временными, моральными и социально-этическими. Последствия рискового события распространяются по цепочке по «принципу домино» и системно взаимосвязаны. Наступление результатов по разным направлениям деятельности у нефтедобывающей компании также неравномерно, потери в одной сфере могут сопровождаться выигрышем или экономией в другой. Все это дает авторам право подойти к проблеме комплексно [3].

Аргументируя собственную позицию, авторы полагают, что комплексная оценка позволяет обеспечить принцип многоцелевой оптимизации. Реализация его происходит на основе взаимосвя-

изучая категорию «риск», авторы заметили ее многоаспектность. Под риском можно понимать вероятность наступления некоего события, отклонение от цели или частный его случай – финансовый результат

зи задач компании, направлений ее активности и интересов участников. Комплексная оценка предполагает выработку критериев. Выбор критериев должен учитывать возможности технической, социальной и экономической подсистем и их связь с внешней средой. Таким образом, комплексная оценка носит компромиссный характер. При разработке и выборе критериев комплексной оценки важную роль следует отвести системному подходу, он отражает взаимосвязь их по объекту оценки в целом. Также системность позволит скорректировать последствия наступления рисковогó события, поддержать баланс потерь и выигрышей, и добиться синергетического эффекта в управлении за счет гибкости и оперативности действий. Так, считают авторы, появится возможность более адаптивного управления посредством защиты уязвимых мест организации и концентрации усилий на ее ведущих сторонах.

Нечеткие критерии оценки

В науке и практике управления учесть все факторы теоретически невозможно и практически нереально, поэтому авторы предлагают раздвинуть возможности проведения оценки рисков и сделать ее границы нечеткой. Для этого они вводят нечеткую оценочную функцию (V), задаваемую по критериям: нечеткая оценка уровня информированности предприятия нефтедобывающей промышленности ($U_{инф}$); нечеткая оценка уровня безопасности предприятия нефтедобывающей промышленности ($U_{б/о}$) и нечеткая оценка уровня прибыли предприятия нефтедобывающей промышленности ($U_{пр}$) [4].

Каждый из выбранных нечетких критериев имеет свою логику.

Первый критерий связан с нечеткой оценкой уровня безопасности нефтедобывающей организации. Авторы полагают, что с точки зрения сущности риска, безопасность как оценочный критерий отражает степень возможного отрицательного отклонения результирующих показателей эффективности деятельности нефтедобывающей компании от прогнозных целей. Кроме того, интерес любой группы стейкхолдеров всегда будет направлен на сохранение безопасности их

**последствия
рискового события
распространяются
по цепочке
по «принципу
домино» и системно
взаимосвязаны**

участия в данном бизнесе. Ну и наконец, направленные активности, отвечающее за данный параметр, характеризует операционная деятельность компании. Она является приоритетной по отношению к инвестиционной и финансовой, она регулярна и ориентирована на товарный рынок, она осуществляется циклично и постоянно возобновляется, от нее зависит жизненный цикл нефтедобывающей организации и ее конкурентоспособность на рынке.

Второй критерий, выбранный авторами, – нечеткая оценка уровня прибыли организаций по добыче нефти. Логика предпочтения данного оценочного варианта также ясна. Прибыль в сущности риска проявляется с обратной стороны как степень возможного, но уже положительного отклонения результирующих показателей эффективности деятельности нефтедобывающей компании от прогнозных целей. Также именно прибыль толкает различные группы стейкхолдеров вступать в предпринимательские проекты. Именно она содержит вознаграждение за риск и выступает платой за его принятие. В этом аспекте актуальность подтверждают два других, не менее важных направления деятельности – инвестиционная и финансовая составляющие [2].

Операционная, инвестиционная и финансовая деятельность

Очевидно, что все три вида ведения бизнеса играют важную роль в формировании конечных результатов нефтедобывающей организации и влияют на эффективность управления ею в целом. Но если операционный менеджмент обеспечивает статику, то без инвестиционной и финансовой деятельности организация просто не в состоянии получить приток и размещение капитала для дальнейшего стратегического развития. Именно инвестиционное и финансовое направления придают динамику организации. В то время как инвестиционная активность отвечает за рост и расширение экономического потенциала компании, является формой реализации ее стратегии и характеризует темпы экономического развития, финансовая деятельность аккумулирует и привлекает внешние источники средств для ее

***...системность
позволит
скорректировать
последствия
наступления
рискового события,
поддержать баланс
потерь и выигрышей,
и добиться
синергетического
эффекта
в управлении
за счет гибкости
и оперативности
действий***

**...одна из сторон
сущности риска
проявляется через
вероятностную
категорию**

текущего и перспективного функционирования. Она проводится в рамках заданной операционной деятельности и выработанной стратегии, подчинена целям компании, косвенно влияет на размер прибыли, снижая уровень операционных затрат. По инвестиционной и финансовой активности денежные потоки колеблются, не имеют систематического и регулярного характера на протяжении всего жизненного цикла организации. Все это оправдывает осуществление финансовых инвестиций, особенно в периоды затишья на товарном рынке и подъема на фондовом. Инвестиционную и финансовую составляющие можно рассматривать как формы диверсификации свободного капитала операционной деятельности.

Третий критерий – нечеткая оценка уровня информированности. Авторы полагают, что одна из сторон сущности риска проявляется через вероятностную категорию. Существует прямая взаимосвязь между количеством получаемой информации и видом неопределенности, с которой сталкивается лицо, принимающее решение. Кроме того, важность данного оценочного критерия заключается в обеспечении обратной связи компании с внешней средой. Интересы участников бизнеса реализуются внутри нефтедобывающей организации, однако возможности для их приобретения всегда находятся за ее пределами. Поэтому крайне важно, считают авторы, учитывать данный аспект в комплексном подходе к оценке рисков [5].

Выводы

Таким образом, можно сделать вывод, что в настоящее время для успешного функционирования нефтедобывающих организаций в сложных постоянно изменяющихся условиях требуется выработка и применение более адаптивных методов управления, каким представляется механизм комплексной оценки рисков на основе нечетких критериев, определяющих потенциал организации и учитывающих интересы ее участников. Такой вариант гарантирует компаниям эффективное ведение бизнеса и помогает удержать им статус, невольно заданный сложившимися условиями.

Литература

1. Акиндинов Н. Российская экономика на фоне мирового кризиса: текущие тенденции и перспективы развития // Вопросы экономики. – 2009. – № 2.
2. Воробьев С.Н., Балдин К.В. Управление рисками в предпринимательстве. – М.: Дашков и Ко, 2006. – 772 с.
3. Иода Е.В., Иода Ю.В., Мешкова Л.Л., Болотина Е.Н. Управление предпринимательскими рисками. – 2 изд., испр. и перераб. – Тамбов: Изд-во Тамб. гос. техн. ун-та, 2002. – 212 с.
4. Коновалова Е.А. Нечеткая оценка рисков предприятий нефтедобывающей промышленности // Российское предпринимательство. – 2009. – № 1.
5. Мамаева Л.Н. Управление рисками: учебное пособие. – М.: Дашков и Ко, 2009. – 256 с.
6. Россия на мировых рынках традиционной и новой энергетики / под общ. ред. С.А. Ситаряна. – М.: Книжный дом «ЛИБРОКОМ», 2009. – 264 с.

pn

Alexandr V. Naumov

Dr. of Econ. Sci., Professor, Head of Chair of Public and Municipal Administration, Surgut State University, Khanty-Mansi Autonomous District - Ugra

Elena A. Konovalova

Postgraduate Student, Department of Management, Surgut State University, Khanty-Mansi Autonomous District - Ugra

Fuzzy Criteria for Comprehensive Risk Assessment of Oil-Producing Organizations

Abstract

The article presents arguments proving the need to develop fuzzy criteria for comprehensive risk assessment for oil-producing organizations in the framework of a given evaluation function. The authors focus on the significance and impact of such criteria on the effectiveness of companies' management in the conditions of uncertainty.

Keywords: oil market, nature of risk, multidimensionality of risk, deviation of performance indicators, oil-producing organization