





ФГБОУ ВО ПГУПС

РИСК'Э-2024

ОПАРИН Сергей Геннадиевич
член Наблюдательного совета
РусРиска, д.т.н., профессор



КРИТЕРИИ ПРИЕМЛЕМОСТИ И ДОПУСТИМОСТИ РИСКА В УСЛОВИЯХ БОЛЬШИХ ВЫЗОВОВ

14.11.2024



БОЛЬШИЕ ВЫЗОВЫ

Стратегия научно-технологического развития РФ,
утв. Указом Президента РФ от 28.02.2024 № 145

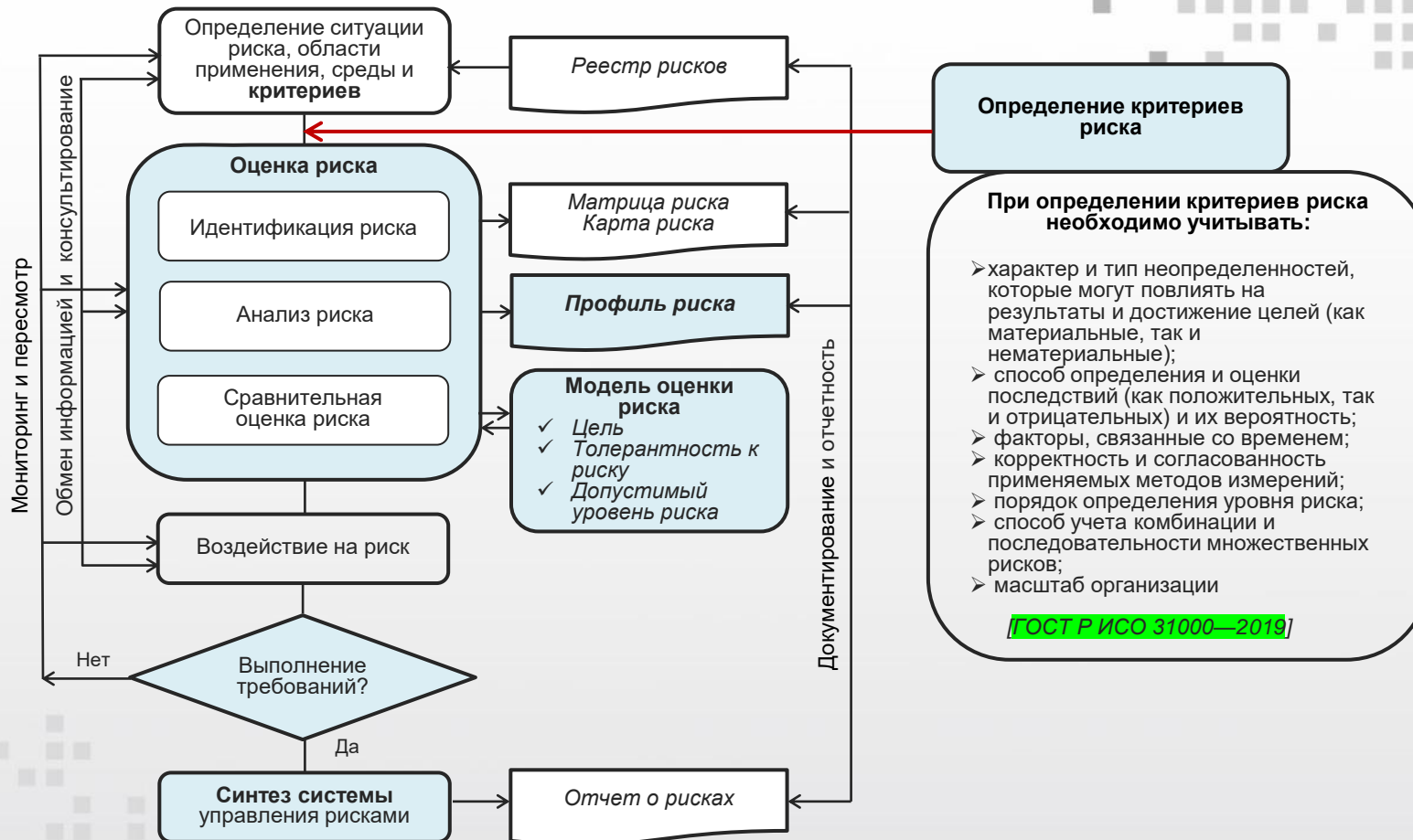
Большие вызовы - совокупность проблем, угроз и возможностей, объективно требующая реакции со стороны государства, сложность и масштаб которых таковы, что они не могут быть решены, устранены или реализованы исключительно за счет увеличения объема используемых ресурсов

Большие вызовы создают **существенные риски** для общества, экономики, системы государственного управления, но одновременно представляют собой важный фактор для появления новых возможностей и перспектив научно-технологического развития

Указанную особенность следует учитывать при прогнозировании устойчивого развития хозяйствующих субъектов, выборе **критериев риска** и последующей **оценке рисков** в условиях «больших вызовов»

ПРОЦЕСС УПРАВЛЕНИЯ РИСКАМИ

ГОСТ Р ИСО 31000—2019



КРИТЕРИИ РИСКА в ГОСТ Р 58771-2019

Технологии оценки риска



- Критерии риска** могут быть качественными или количественными
- В некоторых случаях не могут быть использованы явные критерии, и причастные стороны используют свое суждение для ответа на результаты анализа
- При рассмотрении критериев необходимо учитывать:
 - как будет принято решение о приемлемости риска;
 - как будет определяться относительная значимость рисков;
 - как риск будет приниматься во внимание при выборе между несколькими вариантами в ситуациях, когда каждый вариант связан с несколькими рисками, которые могут иметь положительные или отрицательные последствия, или и то и другое



- Технологии оценки риска могут предоставить помощь в** определении критериев риска организации, таких как толерантность к риску, риск-аппетит или допустимая рисковая нагрузка
- Критерии риска должны быть проанализированы до проведения оценки**



КРИТЕРИИ РИСКА

ГОСТ Р 58771-2019. Менеджмент риска.
Технологии оценки риска"

Критерии принятия риска

- Критерии определения характера и степени риска
- Риск-аппетит
- Критерии приемлемого различия в конкретных показателях эффективности, связанных с целями

Критерии значимости риска

- Критерии риска, которые могут быть определены с использованием любых характеристик и показателей риска

Критерии выбора между вариантами

- Критерии, имеющие отношение к принимаемому решению

КРИТЕРИЙ РИСКА



Определение критерия риска

- **Критерий риска:** Правило, признак, принцип, на основании которого формируется оценка существенности риска.

Примечание - Критерии риска могут быть сформированы на основе стандартов, законов, политик и иных требований

**[ГОСТ Р 51897—2021,
4.3.1.3, измененный]**



❑ Базовыми критериями оценки рисков выступают:

- ❖ целевой характер оценки рисков - оценка рисков осуществляется по отношению к конкретной цели проекта;
- ❖ временной характер оценки - для проведения оценки должен быть выбран конкретный прогнозный период, в котором оценивается риск (финансовый год, квартал, месяц, и иные);
- ❖ результатно-ориентированный подход - результатом оценки рисков должна стать оценка влияния рисков на цель реализации проекта в следующем виде:
 - вероятность достижения цели с учетом оцениваемых рисков;
 - приоритизация рисков по их влиянию на конкретную цель.

Постановление Правительства РФ от 22.12.2020 № 2204 (ред. от 15.06.2023) "О некоторых вопросах реализации государственной поддержки инновационной деятельности..."»

КРИТЕРИИ РИСКА В КОНТЕКСТЕ КОНЦЕПЦИИ ИНТЕГРАЦИИ

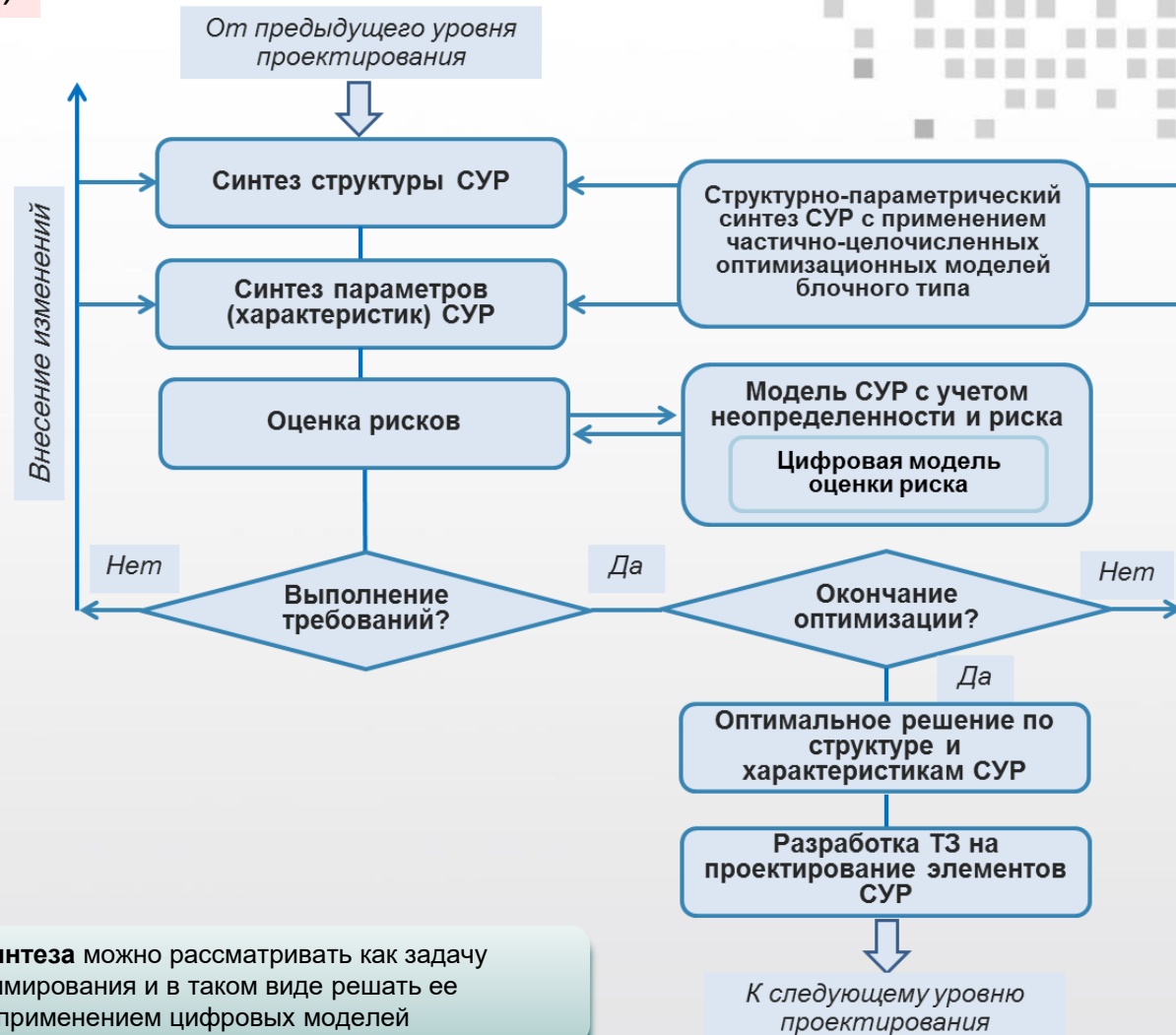


- При применении **концепции допустимого уровня риска** рекомендуется учитывать:
 - соответствие допустимого уровня риска ключевым стратегическим целям и наличие связи с ними;
 - формулирование допустимого уровня риска посредством обозначения четких и понятных ориентиров для принятия решений, таким образом, чтобы не оставалось сомнений и исключалась двусмысленность толкования допустимости риска;
 - изменяемость допустимого уровня риска, которая приводит к необходимости его пересмотра на регулярной основе для приведения в соответствие текущей ситуации с учетом изменений внешней и внутренней среды.
 - каскадирование допустимого уровня риска на все уровни принятия решений.

КРИТЕРИИ ОПТИМАЛЬНОСТИ (ПРИМЕР)

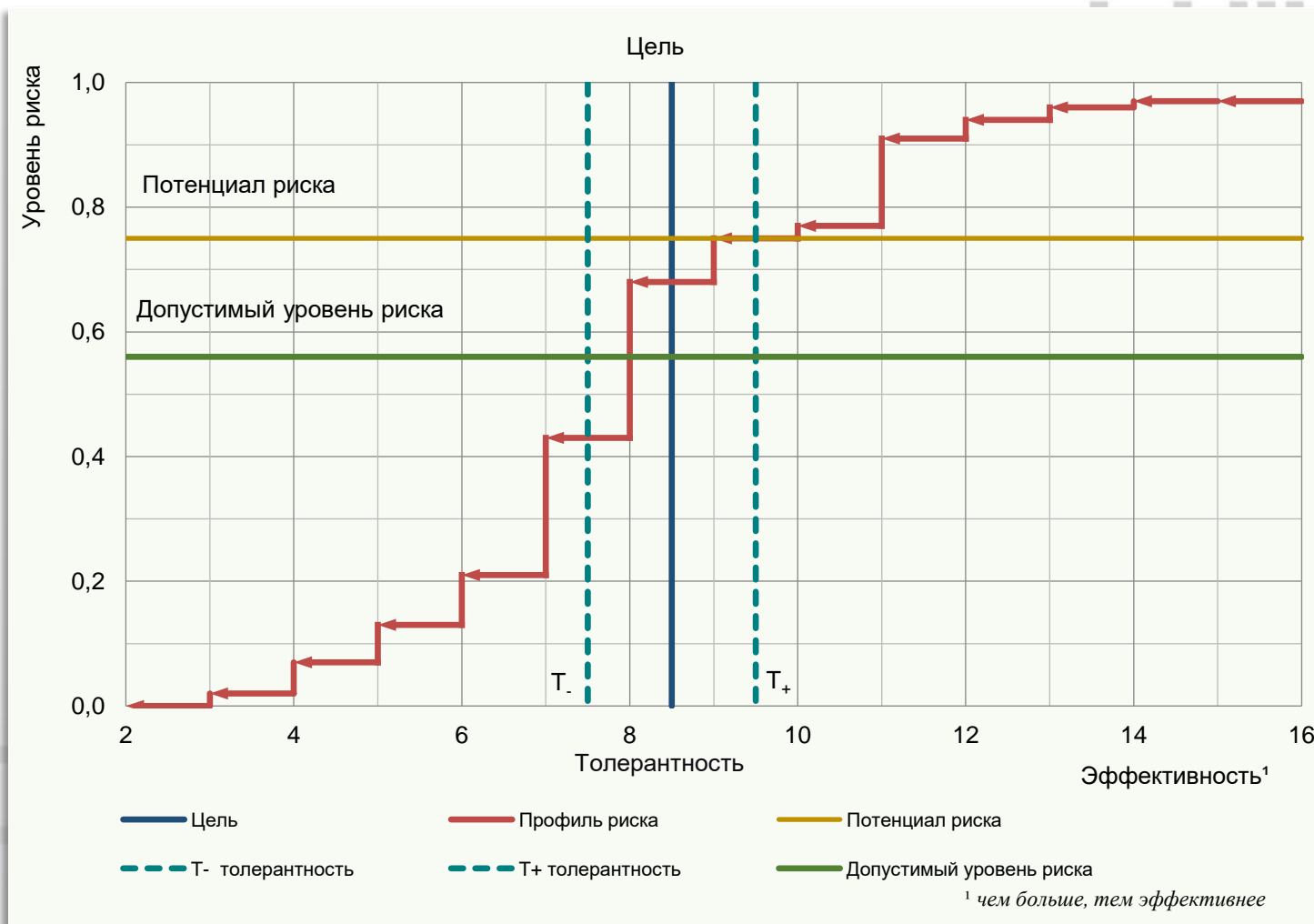
$$F(X, Y) \rightarrow \min(\max)$$

$$R(X, Y) < R^*$$



Задачу **оптимального синтеза** можно рассматривать как задачу математического программирования и в таком виде решать ее численными методами с применением цифровых моделей

ПРИЕМЛЕМОСТЬ И ДОПУСТИМОСТЬ РИСКА В КОНТЕКСТЕ КОНЦЕПЦИИ ИНТЕГРАЦИИ

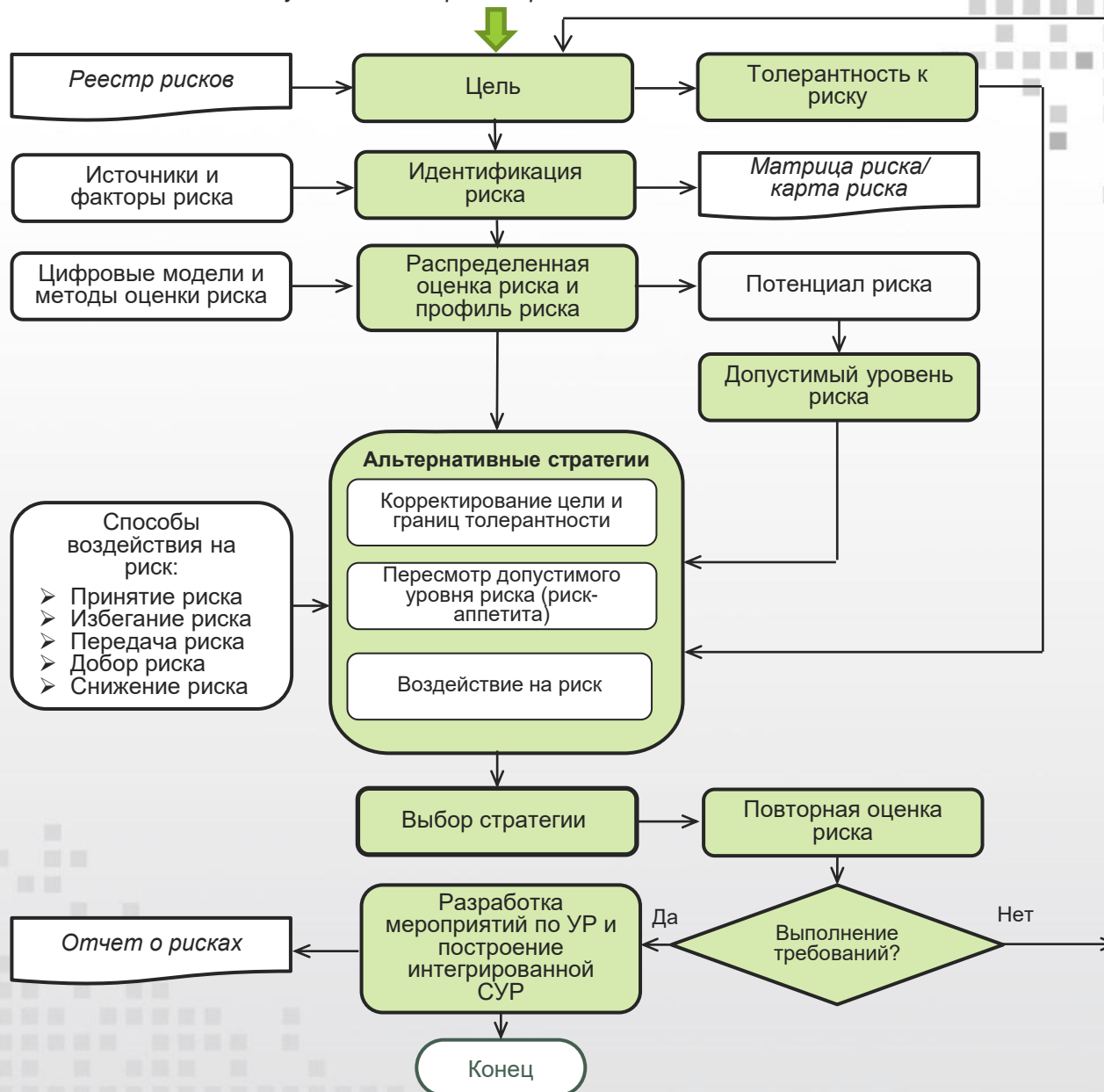


ВЫБОР СТРАТЕГИИ С УЧЕТОМ ПРИЕМЛЕМОСТИ И ДОПУСТИМОСТИ РИСКА

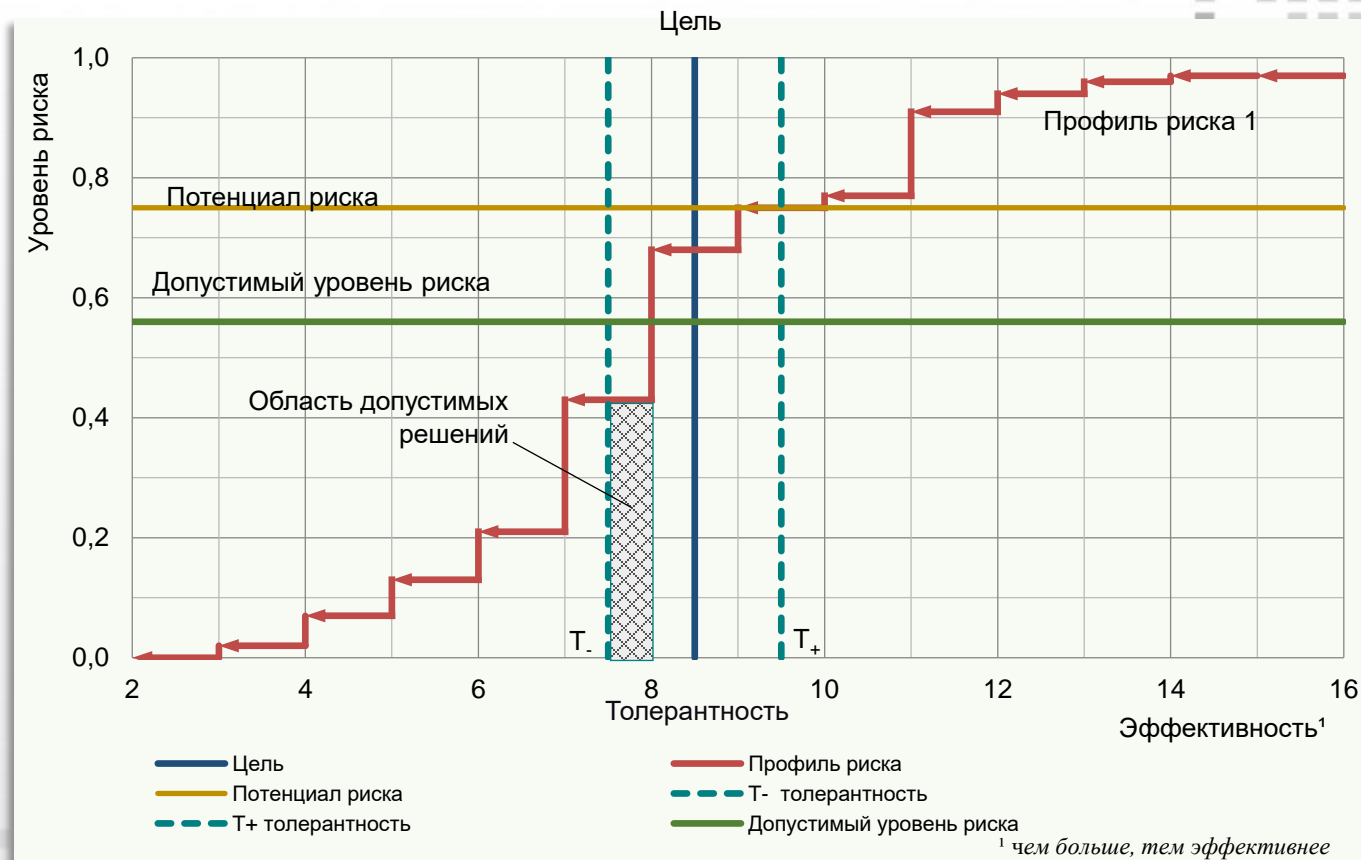


2024

Результативно-ориентированный подход



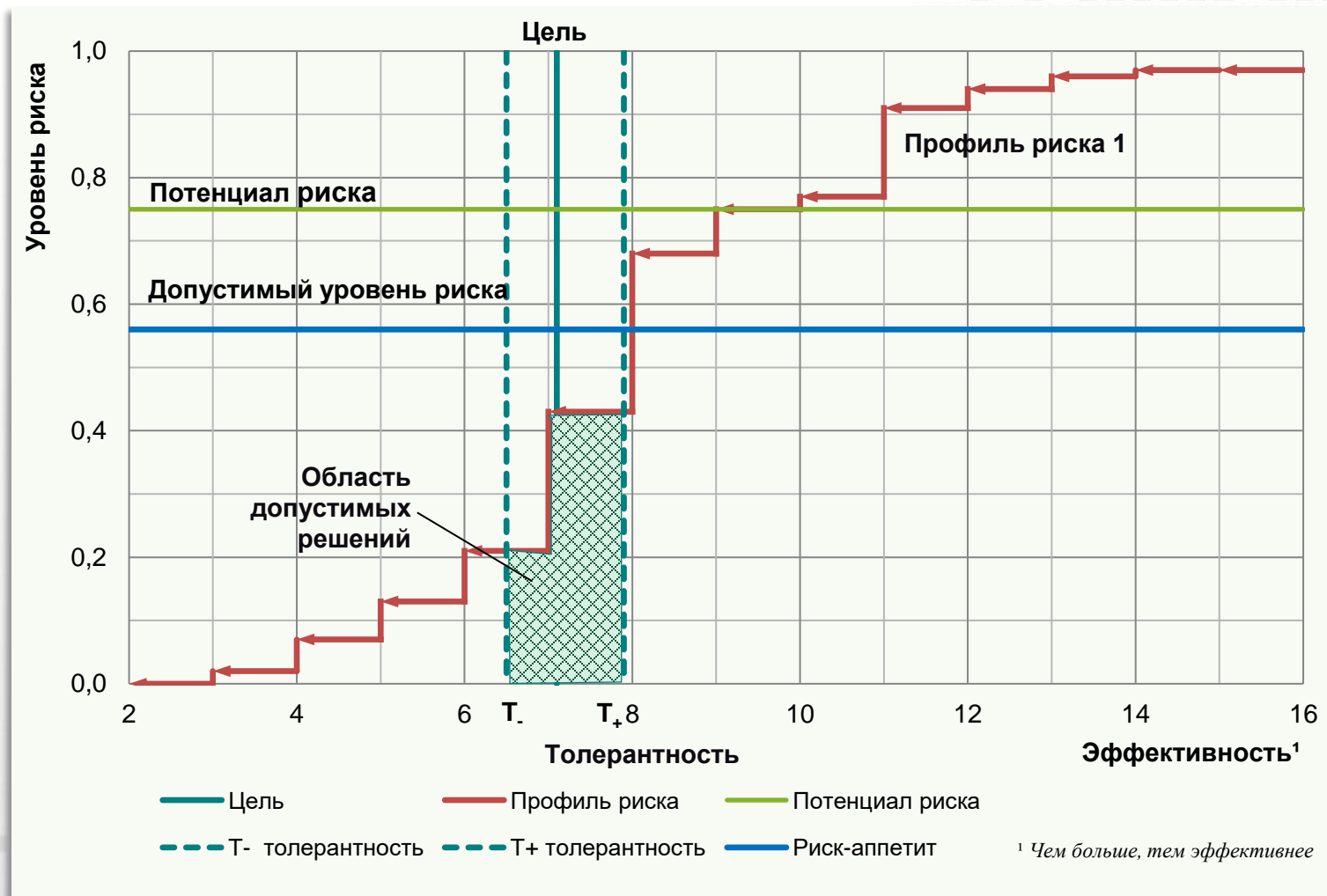
ВЫБОР СТРАТЕГИИ УПРАВЛЕНИЯ РИСКОМ



КОРРЕКТИРОВАНИЕ ЦЕЛИ И / ИЛИ ТОЛЕРАНТНОСТИ К РИСКУ



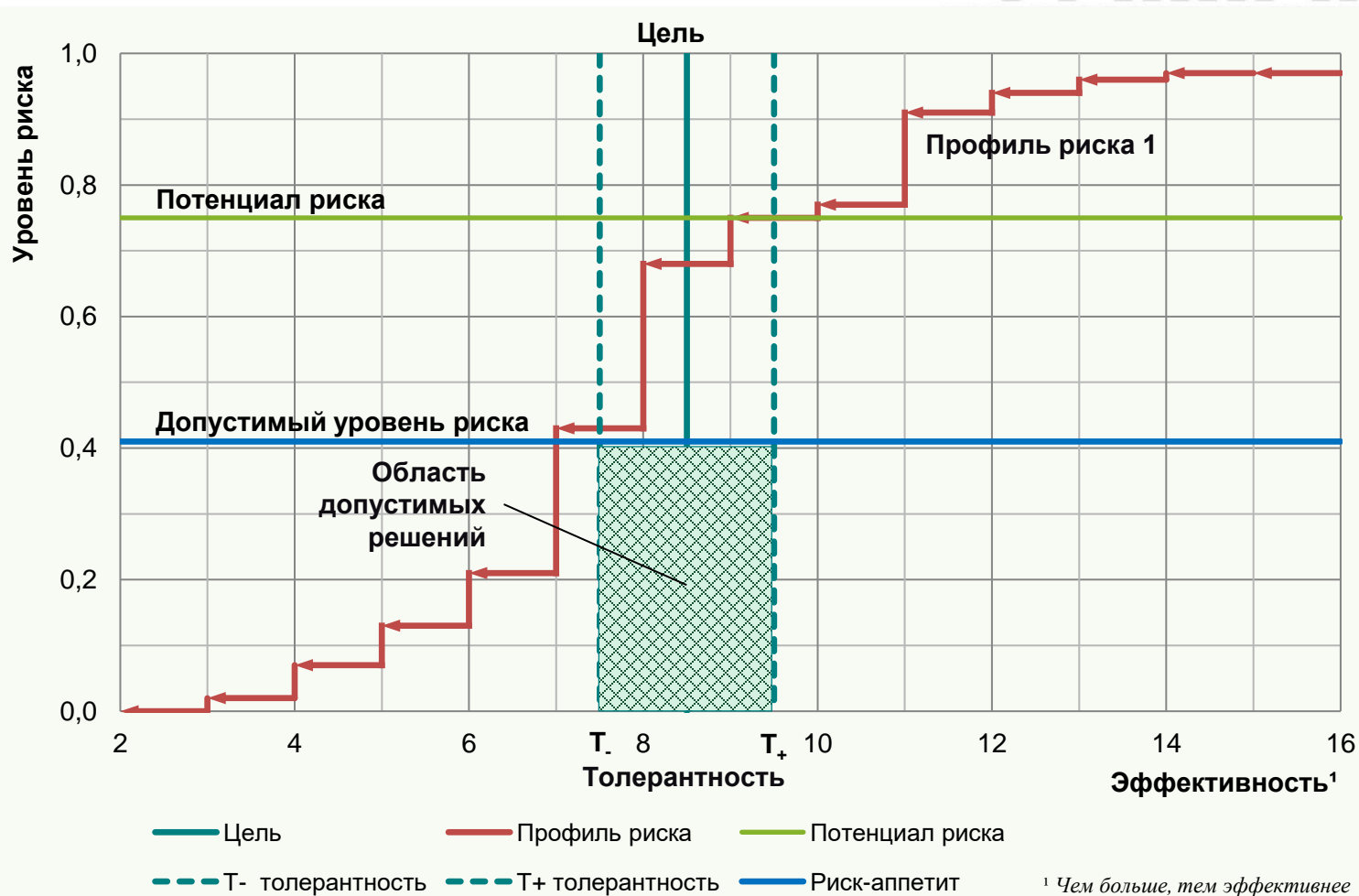
2024



ПЕРЕСМОТР ДОПУСТИМОГО УРОВНЯ РИСКА



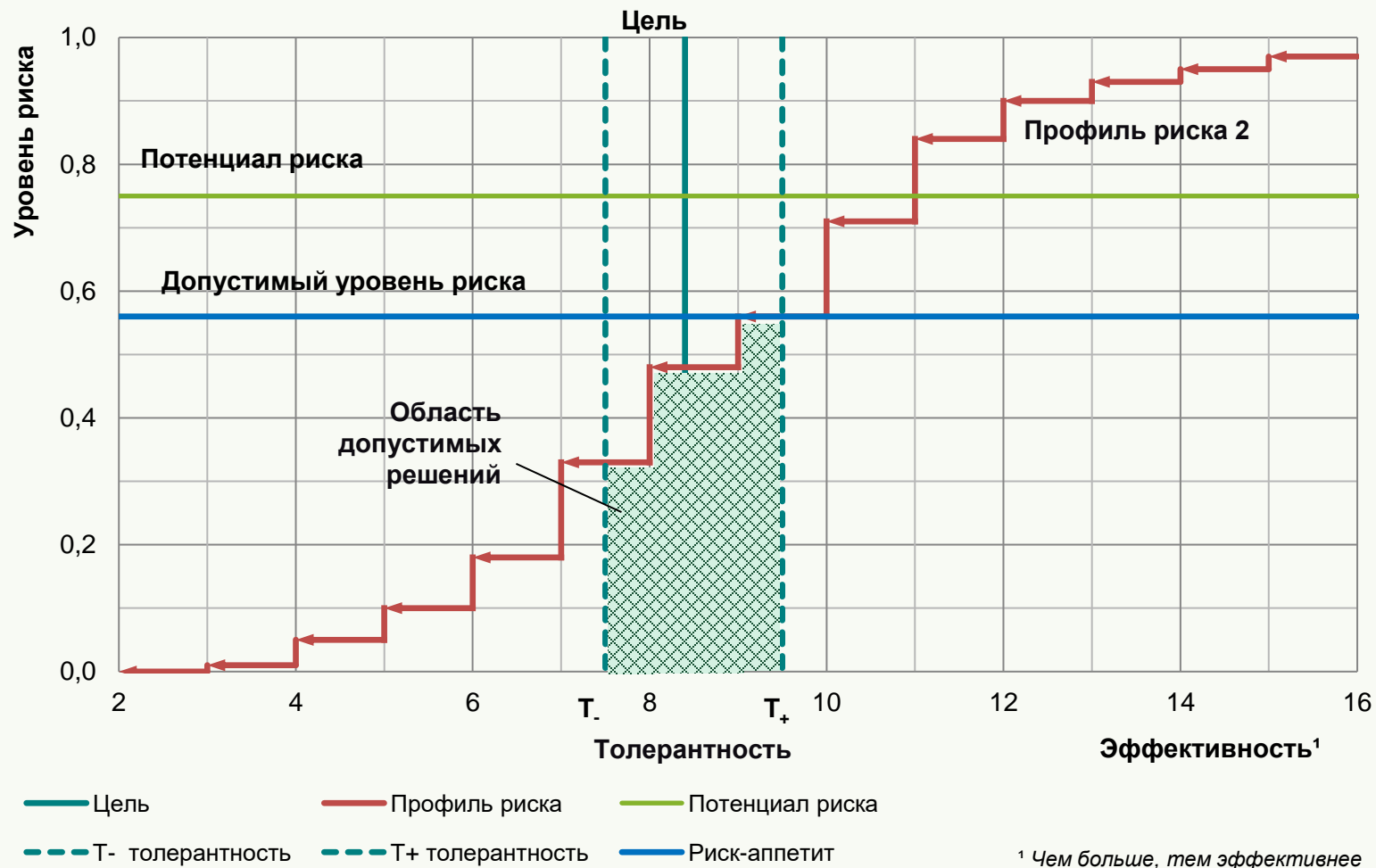
2024



ВОЗДЕЙСТВИЕ НА РИСК



2024





«...разумно изучение реальных явлений вести, избегая промежуточный этап их стилизации в духе представлений математики бесконечного и непрерывного, переходя прямо к дискретным моделям»

*Выдающийся математик XX века академик **А.Н. Колмогоров***

СПАСИБО ЗА ВНИМАНИЕ!



ОПАРИН Сергей Геннадиевич
e-mail: oparinsg@mail.ru