

АННОТАЦИЯ

научного исследования по теме: «Комплекс моделей и методик анализа рисков и угроз экономической безопасности Российской Федерации»

Актуальность исследований. Современное состояние отечественной экономики характеризуется неустойчивостью, наличием большого количества угроз, влекущих существенные риски, которые подрывают возможности реализации целей социально-экономического развития, в целом создают экономические проблемы обеспечения национальной безопасности.

Наличие широкого спектра вызовов, угроз и рисков, реализация которых может не только привести к нарушению устойчивости функционирования хозяйственного комплекса страны или важнейших его секторов, но и создать ограничения для поступательного экономического развития, что потребует дополнительных временных и ресурсных издержек, направленных на адаптацию национальной экономической системы к сложившимся внутренним и внешним условиям. Это обуславливает высокую актуальность создания системы управления суверенными рисками и разработки способов упреждающих действий по минимизации возможного ущерба, связанного с реализацией угроз экономической безопасности, либо заранее спланированного оперативного реагирования при возникновении кризисных ситуаций.

В соответствии со Стратегией экономической безопасности Российской Федерации на период до 2030 года, утвержденной Указом Президента Российской Федерации от 13 мая 2017 г. № 208, должна быть разработана система управления рисками, которая станет основным инструментом стратегического подхода по обеспечению национальной безопасности в сфере экономики.

Создание федеральной системы управления рисками экономической безопасности Российской Федерации (далее - ФСУР) предполагает качественный переход от проводимой в предыдущие годы ретроактивной

государственной политики по защите национальных интересов в сфере экономики к упреждающему характеру реагирования на прогнозируемые и существующие вызовы.

Комплекс моделей и методик анализа рисков и угроз экономической безопасности Российской Федерации, разрабатываемый в данной НИР, является методическим заделом создания ФСУР.

Цель настоящего исследования - разработать научно обоснованную функциональную структуру и основные требования к комплексу моделей и методик анализа рисков и угроз экономической безопасности Российской Федерации, его методическому, алгоритмическому и информационному обеспечению в интересах создания Федеральной системы управления рисками в экономической сфере России.

В ходе работы в результате обобщения и анализа научных работ, нормативных документов и проектных материалов по созданию ФСУР предложена и научно обоснована функциональная структура комплекса моделей, которые целесообразно включать в состав ФСУР на начальном этапе ее создания. Разработан ряд методик, как развитие ранее выполненных в Финансовом университете работ по созданию ФСУР, как по концептуальным и системным проблемам создания ФСУР, так и по факторным моделям различных сфер социально-экономической системы.

Краткий анализ результатов НИР:

1) Проведен анализ используемых в настоящее время в отечественной и международной практике моделей и методик анализа рисков и угроз экономической безопасности государства, в частности, систем количественных показателей экономической безопасности, что позволило обоснованно подойти к разработке методик в настоящей НИР.

2) Проанализированы существующие источники информации, используемые в моделях и методиках анализа рисков и угроз экономической безопасности государства. Этот анализ показал, что официальные источники информации, к которым в основном относятся данные Росстата, необходимо

дополнять независимыми источниками, материалами СМИ. Необходимо также в перспективе разработать методику автоматизированной оценки качества различных источников. Материал может быть использован при подготовке предложений по развития информационного обеспечения ФСУР и Федеральной информационной системы стратегического планирования (далее - ФИС СП).

3) Проведено исследование перспективных направлений развития моделей и методик анализа рисков и угроз экономической безопасности государства в части, касающейся их методического, алгоритмического и информационного обеспечения. Основным направлением является внедрение методологии и инструментария искусственного интеллекта, экспертных систем, создания АРМов. При этом важнейшее значение имеет верификация используемых моделей в части, касающейся информационной безопасности их применения, контролируемости их поведения со стороны человека.

4) Разработана структура информационной модели угроз и рисков экономической безопасности Российской Федерации и их источников, которую целесообразно использовать при создании семантических, логических и информационных интерфейсов взаимодействия ФСУР и ФИС СП.

5) Разработанные информационно-функциональная структура ФСУР и функциональная структура комплекса моделей и методик анализа рисков и угроз экономической безопасности Российской Федерации и требований по информационному обеспечению его эксплуатации фактически представляют собой эскизный проект по развитию модельного комплекса ФСУР.

6) Разработанная методология оценки состояния экономической безопасности Российской Федерации для решения задач поддержки принятия управленческих решений в рамках Федеральной системы управления экономическими рисками Российской Федерации направлена на создание нового инструментария для оценки экономической безопасности на временном интервале и может служить дополнением, математической

надстройкой над факторной моделью, однако для его внедрения требуется сбор информации, привлечение квалифицированного экспертного сообщества, разработка системы частных моделей для анализа динамических отношений между факторами.

7) Разработана также методика сбора первичной информации для актуализации базы данных и знаний по угрозам и рискам в интересах Федеральной системы управления экономическими рисками Российской Федерации, которая может служить основой для разработки инструкции оператора.

8) При разработке методического обеспечения обработки неструктурированных текстовых массивов информации по проблематике Федеральной системы управления экономическими рисками Российской Федерации проведен анализ большого методического задела в этой области и предложено решение, которое с помощью алгоритмизации и программирования может быть внедрено в ФСУР на начальных этапах ее реализации в «металле».

9) В ходе НИР также разработана методика анализа конкретных ситуаций рисков и угроз экономической безопасности Российской Федерации для комплекса многофакторных моделей, как руководство аналитика при решении практических задач.

10) Разработаны предложения по реализации комплекса многофакторных моделей оценки рисков реализации угроз экономической безопасности, реализованный как единая цифровая, т.е. автоматизированная технология работы операторов при решении сложных задач анализа рисков.

11) В ходе НИР предложен комплекс прогнозирующих моделей рисков и угроз (многофакторные модели, вероятностные модели, адаптивные модели, нейросетевые модели, модели сценарного анализа) экономической безопасности Российской Федерации. Рассмотрены возможности использования тех или иных подходов. Эти исследования требуют развития в

направлении создания инженерных методик, однако это целесообразно при развертывании ОКР по созданию ФСУР.

12) Разработан алгоритм анализа приоритетности мероприятий и их реализации по парированию угроз и нейтрализации рисков экономической безопасности Российской Федерации для комплекса многофакторных моделей, а также модель рационального распределения ресурсов на мероприятия по предотвращению и парированию угроз и рисков экономической безопасности.

Для решения этих задач использован новый подход оценки важности факторов на уровне структуры факторной модели, а также предложена интерпретация методов дискретного программирования. Предложена методика использования имитационного моделирования для большеразмерных задач поиска рационального решения. Очевидно, что для задач масштаба макроэкономики и социально-экономической системы масштаба страны и региона для нахождения достаточно адекватных решений требуется использования суперкомпьютеров.

На основе использования концептуальной модели источников рисков и угроз разработана методика организации мероприятий по нейтрализации источников рисков и угроз экономической безопасности, которая может служить средством организации аналитической и организационной работы, а также информации в этом направлении деятельности.

Разработанный комплекс методик и моделей в целом вписывается в методологию мониторинга экономической безопасности Российской Федерации, в механизмы его осуществления, основную институциональную структуру как она вписана в концептуальной модели государственной системы обеспечения экономической безопасности, создаваемой в рамках реализации ФЗ «О стратегическом планировании в Российской Федерации» на основе ГАС «Управления», ФИС СП, ФСУР. При этом разработанный в НИР усовершенствованный вариант методологии является прикладным форматом реализации общей методологии и ориентирован на ее реализацию в

непосредственной управленческой практике, создает основание взаимодействия лиц, принимающих решения (ЛПР) и лиц, принимающих стратегические решения (ЛПСР), с автоматизированными информационными системами высокой сложности.

Область применения результатов – разработка механизмов стратегического управления в Российской Федерации в части, касающейся мониторинга рисков и угроз экономической безопасности на федеральном уровне и аналитической обработки результатов мониторинга для вынесения суждений о состоянии экономической безопасности и актуальных задачах по ее обеспечению, а также подготовка проектов концептуальных и плановых документов государственного уровня.

Результаты работы рекомендуется внедрять при разработке модельного и информационного обеспечения ФСУР, а также развитии аналитической надстройки автоматизированной информационной системы «Управление» (Постановление Правительства Российской Федерации от 27.11.2015 г. № 1278).