

3.7. ПРИМЕНЕНИЕ ВЕРОЯТНОСТНЫХ МОДЕЛЕЙ ДЛЯ АНАЛИЗА ЭФФЕКТИВНОСТИ ВНЕШНЕТОРГОВЫХ СТРАТЕГИЙ ОРГАНИЗАЦИИ В УСЛОВИЯХ АПРИОРНОЙ НЕОПРЕДЕЛЕННОСТИ

Мартыанова О.В., к.э.н., докторант, кафедра «Бухгалтерский учет, анализ и аудит»

Орловский государственный университет экономики и торговли, г. Орел

Функционируя в условиях экономической неопределенности организация должна оценивать влияние риска на свои бизнес-стратегии, в том числе и внешнеторговые, используя различные модели принятия решения. Правильный выбор методов поиска оптимального варианта определяет экономическое благополучие экономического субъекта. В статье предлагается дополнить методы выбора вариантов альтернативных решений, основанные на критериях Вальда, Сэвиджа, Гурвица, оценкой финальных вероятностей состояний для систем, в которых выполняются условия для существования дискретного однородного марковского процесса с непрерывным временем, что позволит, снизив величину риска, повысить эффективность внешнеторговой деятельности организации.

Литература

1. Гражданский кодекс РФ [Электронный ресурс] : часть первая от 30 нояб. 1994 г. №51-ФЗ. Доступ из справ.-правовой системы «КонсультантПлюс».
2. Вислогузов В. Бюджету-2015 убавили драматизма [Электронный ресурс] / В. Вислогузов // Коммерсант.ru : официальный сайт. URL: <http://www.kommersant.ru/doc/2821291>.
3. Интерфакс [Электронный ресурс]: официальный сайт. – Режим доступа: <http://www.interfax.ru/business/470249>.
4. Качурин М. Раньше срока: стоит ли досрочно выплачивать долги банкам [Электронный ресурс] / М. Качурин // РБК : официальный сайт. URL: <http://money.rbc.ru/news/5627876f9a7947a324bc74db>.
5. Лабскер Л.Г. Вероятностное моделирование в финансово-экономической области [Текст]: учеб. пособие / Л.Г. Лабскер. – 2-е изд. – М. : ИНФРА-М, 2014. – 172 с.
6. Малышева Е. Минфин приготовился к падению ВВП на 3,9% [Электронный ресурс] / Е. Малышева // РБК : официальный сайт. URL: <http://top.rbc.ru/economics/29/09/2015/560a6c849a79471c903e2f97>.
7. Мельник М.В. Анализ и контроль в коммерческой организации [Текст] : учеб. / М.В. Мельник, В.В. Бердников. – М. : Эксмо, 2011. – 560 с.
8. РБК [Электронный ресурс] : официальный сайт. – Режим доступа: <http://www.rbc.ru/rbcfreenews/560ba4f39a794719d37a377f>.
9. РИА Новости [Электронный ресурс] : официальный сайт. – Режим доступа: http://ria.ru/defense_safety/2015-09/19/1263945020.html.
10. Садчиков И.А. Системный анализ в управлении предприятием [Текст] : учеб. пособие / И.А. Садчиков, А.В. Амельченко. – СПб. : СПбГИЭУ, 2003. – 126 с.
11. ТАСС : информационное агентство [Электронный ресурс] : официальный сайт. Режим доступа: <http://tass.ru/ekonomika/2284135>.
12. ТАСС : информационное агентство [Электронный ресурс] : официальный сайт. Режим доступа: <http://tass.ru/ekonomika/2303240>

Ключевые слова

Эффективность; критерии принятия решения; матрица эффектов по вариантам альтернативных решений; риск; неопределенность; ожидаемое значение; вероятностная модель; матрица плотностей вероятностей переходов; финальные вероятности; процесс гибели и размножения; финальный стационарный режим случайного процесса; нормировочное условие; эргодическая система

Мартыанова Ольга Владиславовна

РЕЦЕНЗИЯ

Актуальность темы обусловлена необходимостью развития инструментария анализа бизнес-решений организации, сопровождающих внешнеторговую деятельность экономического субъекта, с целью повышения эффективности его проектов в условиях неопределенности.

Научная новизна заключается в предложенной автором модели выбора оптимального решения в условиях неопределенности, при которой методы отбора альтернатив, основанные на критериях максимакса, Вальда, Сэвиджа, Гурвица, дополняются оценкой финальных вероятностей для систем с дискретным однородным марковским процессом, что позволяет получить адекватные прогнозные оценки за счет снижения величины риска. Положительно можно оценить представленный иллюстративный материал, который может быть полезен специалистам в процедурах анализа и контроля.

Практическая значимость проведенной научной работы, результаты которой нашли свое отражение в данной статье, заключается в том, что они являются основой алгоритмов для компьютерной программы, позволяющей на различных моделях принятия решений анализировать влияние риска на переменные, существенно влияющие на эффективность внешнеторговых проектов организации в условиях неопределенности.

В качестве недостатка работы следует отметить отсутствие обоснования числовых величин вероятностей, используемых в вероятностных моделях. Имеются отдельные стилистические недостатки.

Заключение: несмотря на замечания, рецензируемая статья отвечает требованиям, предъявляемым к научным публикациям, и может быть рекомендована к опубликованию.

Васильчук О.И., д.э.н., профессор, заведующий кафедрой «Бухгалтерский учет, анализ и аудит» Поволжского государственного университета сервиса, г. Тольятти, финансовый директор ООО «Аудит-Право», г. Тольятти.

3.7. APPLICATION OF PROBABILISTIC MODELS FOR EFFICIENCY ANALYSIS OF THE FOREIGN TRADE STRATEGY OF THE ORGANIZATION IN THE CONDITIONS OF APRIORISTIC UNCERTAINTY

O.V. Martyanova, Ph.D. in Economics, doctoral candidate at the Department of accounting, analysis and audit
Orel state University of economy and trade, Orel city

Functioning in the conditions of economic uncertainty the organization shall estimate influence of risk on the business strategy including foreign trade, using various models of decision making. The right choice of methods of search of optimum option determines economic wellbeing of the economic actor. In article it is offered to add the methods of a choice of versions of alternative decisions based on Wald's criteria, Sevidzha, Gurvitsa by an assessment of final probabilities of conditions for systems in which conditions for existence of discrete uniform Markov process with continuous time are satisfied that will allow, having reduced risk size, to increase efficiency of foreign trade activity of the organization.

Literature

1. The civil code of the Russian Federation [Electronic resource] : part the first of nov. 30, 1994 no. 51-FZ. Access from sprav.-legal system "ConsultantPlus".
2. Visloguzov V. To the budget-2015 lowered dramatic nature [Electronic resource] / V. Visloguzov // Kommersant : official site. URL: <http://www.kommersant.doc/2821291>.
3. Interfax [Electronic resource]: official website. Mode of access: <http://www.interfax.ru/business/470249>.
4. Kachurin M. Before term: whether it is worth paying ahead of schedule debts to banks [Electronic resource] / M. Kachurin. URL: <http://money.rbc.ru/news/5627876f9a7947a324bc74db>.
5. Labsker L.G. Probabilistic modelling in the financial-economic field [Text]: textbook. manual / L.G. Labsker. – 2nd ed. – M. : INFRA-M, 2014. – 172 p.
6. Malysheva E. Minfin prepared for fall of GDP for 3,9% [Electronic resource] / E. Malysheva. URL: <http://top.rbc.ru/economics/-29/09/2015/560a6c849a79471c903e2f97>.
7. Melnik M.V. Analysis and control in the commercial organizations [Text] : textbook / M.V. Melnik, V.V. Berdnikov. – M. : Eksmo, 2011. – 560 p.
8. RBC [Electronic resource] : official website. – Regime of access: <http://www.rbc.ru/-rbcfreenews/560ba4f39a7947-19d37a377f>.
9. RIA Novosti [Electronic resource] : official website. – Mode of access: http://ria.ru/defense_safety/20150919/126394-5020.html.
10. Sadchikov I.A. The system analysis in enterprise management [Text] : textbook. the manual / I. A. Sadchikov, A.V. Amelchenko. – SPb. : Spbgieiu, 2003. – 126 p.
11. TASS : information agentstva [Electronic resource] : official website. Mode of access: <http://-tass.ru/ekonomika/2284135>.
12. TASS : information agentstva [Electronic resource] : official website. Mode of access: <http://-tass.ru/ekonomika/2303240>

Keywords

Efficiency; acceptance criterions of the decision; matrix of effects by versions of alternative decisions; risk; indeterminacy; expected value; probability model; matrix of density of probabilities of transitions; final probabilities; process of death and reproduction; final stationary mode of accidental process; normalizing condition; ergodic system