

**Kravchenko V.A.**

Kandidat der Wirtschaftswissenschaften, Professor

**Malûtenko A.U.**

*graduate Student*

*Odessa Wirtschafts-Nationaluniversität, Odessa, Ukraine*

## **DER ANWENDUNGSZWECKMÄSSIGKEIT VON METHODEN DER EXPERTENEINSCHÄTZUNG STRATEGISCHER RISIKEN**

**Кравченко В.О.**

к.е.н., професор

**Малютенко О.Ю.**

аспірант

*Одеський національний економічний університет, м. Одеса, Україна*

## **ДОЦІЛЬНІСТЬ ВИКОРИСТАННЯ ЕКСПЕРТНИХ МЕТОДІВ ОЦІНКИ СТРАТЕГІЧНИХ РИЗИКІВ**

*В статті розглянуті питання доцільності використання експертних методів оцінки стратегічних ризиків. Визначено основні проблеми використання експертних методів оцінки стратегічних ризиків. Запропонована процедура оцінки ризику невиконання цілей враховує характеристики персоналу по відношенню до цілей.*

*Ключові слова: ризики, стратегічні ризики, експертні методи оцінки ризиків, опір змінам.*

*Im Beitrag wurden die Fragen der Anwendungszweckmäßigkeit von Methoden der Experteneinschätzung strategischer Risiken betrachtet. Es wurden Hauptprobleme der Anwendung von Methoden der Experteneinschätzung strategischer Risiken festgestellt. Die vorgeschlagene Einschätzungsprozedur des Risikos der Nichterreicherung von Zielen berücksichtigt Charakteristiken des Personals nach dessen Verhalten gegenüber den Zielen.*

***Schlüsselwörter:** Risiken, strategische Risiken, Methoden der Experteneinschätzung von Risiken, Widerstand gegen Veränderungen.*

**Einleitung.** Das Risiko ist eine universelle Kategorie, die auf alle Tätigkeitsarten der Gesellschaft und des Menschen Beziehung hat. Das Risikomanagement bekam seine Entwicklung als selbständiger Wissenszweig relativ vor kurzem, erst in zweiter Hälfte des XX Jahrhunderts. Aus einem Hilfsbestandteil der Wirtschaftstätigkeit ist das Risikomanagement zu deren wesentlicher Komponente geworden und gewinnt einen allumfassenden Charakter. Die Risiken entstehen bei der Lösung von unstrukturierten, strukturierten und schwach strukturierten Problemen und fehlen bei der Lösung von Standardproblemen. Das Risiko der Nichterreicherung von Zielen hängt damit zusammen, dass die Realisierung strategischer Ziele kein automatischer Prozess ist. Neue Ziele einer Organisation und entsprechende künftige Veränderungen darin sind mit

einem Widerstand verbunden, somit bietet sich ein Problem des Risikos der Nichterreichung von Zielen oder der Verluste durch unbenutzte Möglichkeiten (Opportunitätskosten) dar.

**Aufgabestellung.** Insofern beeinflussen die Risiken in erheblichem Maße das wirtschaftliche Betriebsergebnis von Unternehmen, standen die Fragen des Risikomanagements immer im Blickfeld von Wissenschaftlern, Spezialisten und Praktikern und hat eine gebührende Abspiegelung in wissenschaftlichen Werken vieler einheimischer und ausländischer Gelehrten bekommen, und zwar: W. Witlinskyj, W. Granaturow, S. Illiaschenko, V. Momot, B. Andruschkin, O. Kusmin, S. Nakonetschnyj, O. Ustenko, V. Tscherkasow, W. Ferrell, D. Stefanytsch, A. Ashton, R. Ashton u.a. Daneben bedürfen die Fragen des Managements strategischer Risiken weiterer Forschung.

**Forschungsergebnisse.** Der Verwaltungsprozess strategischer Risiken soll sich aus typischer Etappen des Risikomanagementverfahrens zusammensetzen, die anhand der Systematisierung von Errungenschaften gegenwärtiger Forscher festgestellt wurden (Formulierung von Zielen des Risikomanagements; Risikoanalyse oder -Identifikation; Risikobewertung; Risikobearbeitung und Kontrolle von Ergebnissen des Risikomanagements), und die von den Autoren bestimmte Spezifik strategischer Risiken berücksichtigen: sie entstehen auf der Realisierungsetappe während der Aufstellung des langfristigen Plans; sind verbunden mit Umweltfaktoren, die bei der Erreichung von gestellten strategischen Zielen stören können; sind hochabhängig von der Auffassung strategischer Ziele vom Personal.

Die Qualität der Experteneinschätzung von Risiken hängt weitgehend von der Auswahlqualität der Experten ab. Bei der Anwendung von Expertenmethoden ist die Erreichung einer Abstimmung unter den Fachleuten von Bedeutung, deshalb werden die Einschätzungen von Experten einer Diskrepanzanalyse unterworfen: maximal zulässiger Unterschied zwischen den Einschätzungen zweier Experten bezüglich jedes Faktors darf nicht 50 Prozent übersteigen. Ist die Expertenanzahl mehr als drei, so werden die Einschätzungen paarweise verglichen. Im Falle des Vorhandenseins

wesentlicher Unterschiede zwischen Meinungen von Experten werden sie in speziellen Beratungen besprochen.

In praktischer Tätigkeit benutzt man sowohl individuelle als auch gruppenweise (kollektive) Experteneinschätzungen von Risiken. Die Vorteile einer individuellen Expertise sind die Operativität der Informationsgewinnung zur Beschlussfassung und relativ niedrige Kosten. Der Nachteil ist aber ein hoher Subjektivitätsgrad und als Folge das Fehlen der Sicherheit bezüglich der Glaubwürdigkeit von erhaltenen Schätzungen. Dieser Nachteil wird durch kollektive Experteneinschätzungen beseitigt. Die Bearbeitung der von den Experten erhaltenen Information sieht die Anordnung aller Schätzungen in abnehmender Reihenfolge und die Bestimmung einer Mediane und von Quartilen, die sie in vier Intervalle aufteilen. Die Experten, deren Schätzungen in Randintervalle fallen, haben ihre Gesichtspunkte begründen. Mit ihren Schätzungen, ohne Angabe, von wem sie erhalten wurden, macht man andere Experten bekannt. Solche Prozedur ermöglicht den Fachleuten bei Bedarf, ihre Schätzung unter Berücksichtigung von Umständen zu ändern, die sie in erster Befragungsrunde außer Acht lassen konnten. Dank solcher Prozedur geben die Ergebnisse der zweiten und nachfolgenden Befragungsrunden geben in der Regel eine kleinere Gedankenstreuung. Man führt den Prozess so lange fort, bis das Vordringen zur Annäherung von Expertenmeinungen geringfügig wird.

Bei der Verwendung einer Experteneinschätzungsmethode können Fehler entstehen, verbunden mit: einem Informationsmangel über den Untersuchungsobjekt; mangelhafter Kompetenz von Experten; der Befangenheit von Experten, die sich unvermeidlich auf die Glaubwürdigkeit von Gutachtensergebnissen auswirkt. Diese Fehler kann man durch richtige Organisation des Gutachtensverfahrens beseitigen, beginnend mit dem Expertenauswahl und endend mit der Bearbeitung ihrer Stellungen.

Die Verwendung von Expertenmethoden ist mit einer Reihe von Problemen verbunden, und zwar: Feststellung optimaler Expertenanzahl; Auswahl von Experten; Formalisierung von Experteneinschätzungen; Abstimmung von Experteneinschätzungen. Alle genannten Probleme werden unter Berücksichtigung

des Kompliziertheitsgrades der von den Experten zu bewertenden Aufgaben und der Zweigspezifität gelöst. Das heißt, die Verwendung kann für einen bestimmten Zweig und für bestimmte Aufgaben typisch sein.

Am meisten akzeptabel ist der Ansatz der Bildung einer Expertengruppe, der auf der Grundlage basiert, dass die Anzahl von Spezialisten der Anzahl von zu behandelnden Problemen entsprechen soll. Solcher Ansatz führt zur Bildung der Expertengruppe, in der je ein Fachmann pro Aufgabenrichtung der zu lösenden Aufgabe vorgestellt wird. Die Expertenanzahl wird von uns später, nach der Feststellung von Segmenten des Risikofaktors bestimmt sein. Zur Expertenauswahl stellt man zunächst eine Liste sachverständiger Personen und wählt man die Experten mit Hilfe spezieller Methoden[1, S. 34-43; 2] aus:

- nach dem Dienstalter und der bekleideten Stellung;
- nach dem Zuverlässigkeitsgrad des Experten (relativer Häufigkeit von Fällen, in denen der Experte am meisten wahrheitsnahe Einschätzungen abgab);
- nach dem Grad der relativen Zuverlässigkeit des Experten (dem Verhältnis des Zuverlässigkeitsgrades eines bestimmten Experten zum Zuverlässigkeitsgrad der Gruppe von Experten, die Teilnehmer einer bestimmten Expertise waren);
- nach der Selbsteinschätzung;
- nach der Einschätzung jedes Spezialisten von der Gruppe.

Die Vor- und Nachteile der genannten Methoden sind in [3, S. 48], Tab.1 angeführt.

Die Autoren schlagen vor, die Experten aus den Mitarbeitern des Unternehmens auszuwählen. Bei der Aufstellung der Liste der sachverständigen Personen ist unserer Ansicht nach zweckmäßig, die Methode nach dem Dienstalter und der Stellung zu benutzen. Dies wird erlauben, die Methode der Einschätzung jedes Spezialisten von der Gruppe zu benutzen, insofern man den Experten anwärter im Unternehmen kennt.

## Bewertung von Auswahlmethoden der Spezialisten

Auswahlmethoden	Vorteile	Nachteile
Nach dem Dienstalter und der Stellung	Einfach in der Handhabung	Gibt unsichere Ergebnisse
Nach dem Zuverlässigkeitsgrad des Experten	Die Bewertung von Experten erfolgt nach Ergebnissen ihrer vorhergehenden Tätigkeit	Erfordert die Sammlung der Informationen über die Tätigkeit einzelner Experten
Nach dem Grad der relativen Zuverlässigkeit des Experten	Die Bewertung von Experten erfolgt nach Ergebnissen ihrer vorhergehenden Tätigkeit	Erfordert die Sammlung der Informationen über die Arbeit von Expertenkommissionen und vereinzelt Experten
Nach der Selbsteinschätzung	Erlaubt das Fähigkeitsniveau des Spezialisten zu bestimmen	Weniger objektiv, als statistische Methoden
Nach der Einschätzung jedes Spezialisten von der Gruppe	Erlaubt das Fähigkeitsniveau des Spezialisten zu bestimmen	Erfordert, dass die Expertenwärter einander gut kennen

Die ausgewählten Experten werden selbstverständlich eine unterschiedliche Kompetenz haben. Deshalb halten wir für zweckmäßig, Expertenkompetenzfaktoren zur Einschätzung des Einflusses von Risikofaktoren einzuführen.

Bei der Aufstellung langfristiger Pläne entstehen die mit Kommunikationsbarrieren Risiken gebundenen Risiken. Das sind falsche Übertragung oder falsche Interpretation der Information bezüglich der Zielsetzung, die das Unverständnis vom Personal der Ziele der Organisation zur Folge hat. Das Ergebnis: neue Orientierungspunkte werden von den Mitarbeitern nicht unterstützt und haben das Risiko, nicht erreicht zu bleiben.

Man kann zwei Faktoren aussondern, die das Risiko der Nichterreicherung der Ziele beeinflussen: Anerkennung von den Mitarbeitern der Ziele der Organisation, was eine Zustimmung bedeutet, ihnen zu folgen; richtiges Verständnis der Ziele. Die Nichterreicherung der Ziele der Organisation kann man als einen vereinzelt Fall des Widerstandes gegen die Änderungen. In diesem Falle werden dies jede Taten von Mitarbeitern, gerichtet auf Diskreditierung, Verzögerung oder Gegenwirkung der Verwirklichung strategischer Ziele der Organisation sein. Dieser Widerstand kann unterschiedlich stark und intensiv sein.

Zur Bestimmung, zu welcher Kategorie die Mitarbeiter gehören, ist es zweckmäßig, spezielle Tests mit zwei Fragentypen zu erarbeiten: zur Prüfung des Verständnis und der Loyalität der Mitarbeiter und zur Kontrolle der Wahrhaftigkeit ihrer Antworten.

Aufgrund der Bearbeitung der Tests und im Wege logischer Überlegungen sind die Autoren zum berechtigten Schluss gekommen, dass man unter der Benutzung der bekannten Matrix «Änderungen – Widerstand» [4, S. 630-645] alle Mitarbeiter nach ihrem Verhalten zu den Zielen der Organisation in vier Gruppen aufteilen kann: Anhänger, passive Anhänger, Gegner und gefährliche Elemente.

Es ist zweckmäßig, die Bearbeitung von Testergebnissen der Mitarbeiter nach der Bewertung des Verhaltens der Mitarbeiter zu den Zielen der Organisation, Tab. 2, durchzuführen.

Tabelle 2

Bewertung des Verhaltens der Mitarbeiter gegenüber den Zielen der Organisation

Kategorie von Mitarbeitern	Charakteristik von Mitarbeitern nach ihrem Verhalten zu den Zielen der Organisation	Bedeutung der Charakteristik des Mitarbeiters für die Organisation	Punktzahl
Anhänger	Volles Verständnis der Ziele und Einverständnis damit	Optimalste Variante	3 Punkte
Passive Anhänger	Einverständnis, die gewählten anzunehmen, jedoch falsches Verständnis der Ziele	Kommunikationsprobleme	2 Punkte

Gegner	Verständnis, jedoch Aberkennung des Ziels	Illoyale Mitarbeiter	1 Punkt
Gefährliche Elemente	Aberkennung und Unverständnis des Ziels	Negativste Variante für die Organisation	0 Punkte

Die Bestimmung von Gründen des Widerstandes gegen die Erreichung der Ziele bedarf einer Aufteilung der Mitarbeiter nach ihrer Loyalität und ihrem Verständnis der Ziele der Organisation. Dazu ist es zweckmäßig, entsprechende Koeffizienten zu berechnen, und zwar: den Koeffizienten des Verständnisses der Ziele der Organisation von den Mitarbeitern; den Koeffizienten der Loyalität der Mitarbeiter gegenüber den Zielen der Organisation. Der Koeffizient der Loyalität gibt eine Information bezüglich der Zustimmung der Mitarbeiter den Zielen zu folgen, und der Koeffizient des Verständnisses bezüglich des Zustandes von Kommunikationskanälen der Organisation.

**Zusammenfassung.** Zum einen ist das Risiko der Nichterreichung von Zielen mit dem Einfluss zweier Faktoren verbunden: Anerkennung von den Mitarbeitern der Ziele der Organisation, was eine Zustimmung bedeutet, ihnen zu folgen; richtiges Verständnis der Ziele. Das erlaubt, die Nichterreichung der Ziele der Organisation als einen vereinzelt Fall eines Widerstandes gegen die Änderungen zu betrachten, was zum Grund geworden ist, Gruppen der Mitarbeiter nach dem Widerstand gegen die Änderungen auszusondern. Zur Art des Arrangierens von Risikofaktoren (des Widerstandes gegen die Änderungen) soll die von den Autoren entwickelte Skala werden, die die Charakteristiken der Mitarbeiter nach ihrem Verhalten gegenüber den Zielen der Organisation und die Bedeutung der Charakteristik des Mitarbeiters nach den Mitarbeitergruppen für die Organisation berücksichtigt.

Zum anderen ist es zweckmäßig, den Block der Einschätzung des Risikos der Nichterreichung der Ziele durch eine Reihe logischer Prozeduren zu konkretisieren: Entwicklung von Tests; Testen von Mitarbeitern; Behandlung von Testergebnissen und Aufteilung der Mitarbeiter nach Kategorien des Widerstand gegen die Änderungen; Berechnung von Koeffizienten des Widerstands, der Informiertheit und Loyalität; Gegenüberstellung der Koeffizienten mit normativen Werten;

Beschlussfassung bezüglich der Notwendigkeit der Erarbeitung bestimmter Maßnahmen. Die aufgezählten Handlungen ermöglichen, eine Reihe von Maßnahmen zu begründen, die die Kenntnisse des Personals und der Leiter und ihre Bereitschaft zu den Änderungen erhöhen und letztendlich dem Risiko der Nichterreichung der Ziele entgegenwirken.

### **Literatur:**

1. Бешелев С.Л. Математико-статистические методы экспертных оценок / С.Л. Бешелев, Ф.Г. Гуревич - 2-е изд. перераб. и доп. – М.: Статистика, 1980. – 263 с.

2. Соловьева Д. Экспертные методы в маркетинге / Д. Соловьева: [Электронный ресурс ПУСКУ]. □ Режим доступа:  
[http://www.iteam.ru/publications/marketing/section\\_22/article\\_1321/](http://www.iteam.ru/publications/marketing/section_22/article_1321/)

3. Кравченко В.О., Малютенко О.Ю. Формалізація оцінювання ризик-факторів в процесі управління стратегічними ризиками діяльності зернопереробних підприємств. / Економіка: реалії часу. Науковий журнал. 2014. – № 2(12). – С. 47-51. Режим доступу до журн.:  
<http://economics.opu.ua/files/archive/2014/n2.html>

4. Дженстер П. Анализ сильных и слабых сторон компании: определение стратегических возможностей / П.Дженстер, Д.Хасси. Пер. с англ. О.Л. Пелявского – М.: Вільямс, 2004. – 368с.