

В Диссертационный совет ФГБОУ ВО
«Российская академия народного хозяйства и
государственной службы при Президенте
Российской Федерации»
119571, г. Москва, проспект Вернадского, д.82

ОТЗЫВ

члена диссертационного совета
Российской академии народного хозяйства и государственной службы
при Президенте Российской Федерации
на диссертацию Никитинса Ильи
«Совершенствование методологии стратегического планирования бизнеса на
основе эволюционно-контекстных сценариев»
представленную на соискание ученой степени кандидата экономических наук
по специальности 5.2.6. – «Менеджмент»

Актуальность диссертационного исследования.

Представленное диссертационное исследование посвящено решению критически важной проблеме - адаптации стратегического планирования к условиям VUCA-мира (нестабильность, неопределённость, сложность, неоднозначность). Автор убедительно доказывает актуальность выбора темы, опираясь на статистику экономических потерь в глобальных цепочках поставок; закрытие предприятий малого бизнеса в России в 2020 г. из-за пандемии; потери США и ЕС от санкций против России. Акцент на ограниченности традиционных методов прогнозирования в контексте геополитической турбулентности и технологических сдвигов делает исследование своевременным и практически значимым.

Автор исследует нарастающее расхождение между классическим инструментарием стратегического планирования, сформированным в эпоху относительной стабильности, и хаотичной, нелинейной природой современной деловой среды. Автор не ограничивается констатацией данного разрыва, но и предлагает системную альтернативу в виде разработанного эволюционно-контекстного подхода, что придает работе характер не столько

прикладного усовершенствования, сколько концептуального развития методов сценарного моделирования.

Актуальность исследования носит не ситуативный, а сущностный характер, что подтверждается влиянием турбулентности внешней среды деятельности организаций, а также глубинным кризисом прогностических моделей, основанных на принципах линейной каузальности и ретроспективной экстраполяции. В этом контексте работа Никитинса Ильи представляет собой актуальный авторский подход к обоснованию новой парадигмы стратегического мышления, адекватной вызовам эпохи неопределенности.

Новизна научных положений, выводов и рекомендаций, сформулированных в диссертации.

Научная новизна исследования проявляется в следующих аспектах.

1. Концептуальная новизна. Автором предложено оригинальное определение сценария как альтернативных вариантов развития событий, основанных на триединстве: (1) анализе эволюции на горизонте истории и планирования; (2) интерпретации современного контекста; (3) установлении взаимозависимости событий. Введение термина «эволюционно-контекстные сценарии» представляет собой концептуальный вклад в теорию стратегического менеджмента.

Особую ценность представляет обоснование двух фундаментальных принципов сценарного анализа: принцип наследственности – учет факторов, которые не могут быть полностью определены, но влияют на будущее через историческую траекторию развития; принцип изменчивости – необходимость анализа динамики контекста, в котором эволюционируют события.

Эти принципы формируют методологическую основу для преодоления ограничений традиционных подходов, базирующихся на экстраполяции и авторегрессионных моделях.

2. Методологическая новизна. Диссертант убедительно демонстрирует инструментальную роль стратегических сценариев в преодолении

стратегического парадокса – необходимости принимать обязательства на будущее в условиях его неопределенности. Предложенный подход позволяет анализировать одновременно эволюцию событий и их контекст для определения адекватных стратегических намерений.

На этой основе автор разработал оригинальную шестиступенчатую методику сценарного планирования, отличающуюся от существующих подходов (Royal Dutch Shell, П. Шумейкера, М. Годэ, П. Шварца) следующими характеристиками:

- ✓ Комплексный анализ эволюции и контекста на первом этапе.
- ✓ Использование моделей машинного обучения для построения модели будущего.
- ✓ Четкая демонстрация перехода от сценариев к стратегии.

3. Инструментально-методическая новизна. Наиболее существенным вкладом работы является разработка методического обеспечения эволюционно-контекстного сценарного анализа на основе рекуррентных нейронных сетей класса LSTM (Long Short-Term Memory). Автор продемонстрировал, как эти модели могут быть обучены для распознавания как простого ситуационного контекста (предшествующие события), так и сложного (динамика множества фоновых факторов).

Преимущества предложенного подхода:

- ✓ Способность обрабатывать нестационарные данные.
- ✓ Учет нелинейных связей между переменными.
- ✓ Обработка многомерных данных (до 9 факторов в апробации).
- ✓ Способность работать с высокой волатильностью показателей.

Практическая апробация метода на примере прогнозирования цен на нефть марки Brent и курса рубля к доллару США подтвердила его работоспособность и превосходство над традиционными методами (полиномиальная аппроксимация, скользящая средняя).

Степень обоснованности и достоверности научных положений.

1. Теоретическая обоснованность. Диссертационное исследование базируется на глубоком анализе теоретических основ сценарного подхода. Автор провел критический анализ работ ведущих исследователей (Г. Кан, П. Шумейкер, М. Годэ, К. Ван Дер Хейден, П. Шварц и др.), выявил противоречия и пробелы в существующих определениях и методологиях.

Убедительно обоснована необходимость учета VUCA-принципов (волатильность, неопределенность, сложность, неоднозначность) в современном стратегическом мышлении. Автор аргументированно критикует традиционные подходы, основанные на принципах SCSU (стабильность, определенность, простота, однозначность), демонстрируя их неадекватность современным условиям.

Особо следует отметить глубокий анализ проблемы причинно-следственных петель в социально-экономической динамике. Диссертант показал ограниченность концепции «наше будущее определяется действием факторов в настоящем» и обосновал необходимость учета наследственности и изменчивости тенденций.

2. Методическая обоснованность. Выбор рекуррентных нейронных сетей класса LSTM для решения задачи построения эволюционно-контекстных сценариев хорошо обоснован. Автор провел сравнительный анализ различных подходов к прогнозированию и убедительно показал преимущества LSTM:

- ✓ Способность изучать долговременные зависимости.
- ✓ Наличие механизмов «вентилей» для селективного забывания/сохранения информации.
- ✓ Возможность обработки последовательных данных за несколько временных этапов.
- ✓ Преодоление проблемы «исчезающего градиента».

Методика экспериментального определения оптимального количества циклов обучения (50 000 для задачи прогнозирования цен на нефть)

демонстрирует понимание автором специфики работы с нейросетевыми моделями и проблем недообучения/переобучения.

3. Эмпирическая достоверность. Достоверность результатов исследования подтверждается:

- ✓ Использование репрезентативных данных: временные ряды за 37 лет (1987-2023) для анализа цен на нефть марки Brent; данные за 15 лет (2010-2024) для анализа курса рубля.

- ✓ Множественностью фоновых факторов: от 2 до 9 переменных, характеризующих контекст (агрегат М2, процентная ставка ФРС, цена золота, инфляция, безработица, ВВП и др.).

- ✓ Воспроизводимостью результатов: в приложениях представлен полный программный код на языке Python, позволяющий воспроизвести все расчеты.

- ✓ Сравнительным анализом: автор продемонстрировал превосходство предложенного метода над традиционными подходами (полином 6-го порядка, скользящая средняя с различными периодами).

- ✓ Апробацией на различных объектах: метод протестирован на двух существенно различающихся показателях (цены на нефть и валютный курс), что подтверждает его универсальность.

Графические материалы (44 иллюстрации) наглядно демонстрируют качество прогнозирования и обучаемость моделей. Особенно показательны результаты для периода 2008-2023 гг., характеризующегося высокой волатильностью.

4. Логическая непротиворечивость. Структура работы логична и последовательна. Автор движется от критического анализа существующих подходов (глава 1) через выявление их ограничений в современных условиях (глава 2) к разработке и апробации собственного метода (глава 3). Выводы каждой главы служат основой для следующей, что обеспечивает целостность исследования. Аргументация базируется на сочетании теоретического

анализа, математического моделирования и эмпирической верификации, что обеспечивает высокую степень обоснованности выводов.

Диссертация соответствует п. 4 «Управление экономическими системами, принципы, формы и методы его осуществления. Теория и методология управления изменениями в экономических системах», п. 5 «Разработка теории и методов принятия решений в экономических и социальных системах. Системы искусственного интеллекта для поддержки принятия управленческих решений», п. 14 «Стратегический менеджмент, методы и формы его осуществления. Бизнес-модели организации. Корпоративные стратегии. Стратегические ресурсы и организационные способности фирмы», п. 27 «Управление данными в организации. Применение методов искусственного интеллекта и «больших данных» в менеджменте» действующего Паспорта научной специальности 5.2.6. – Менеджмент.

Дискуссионные вопросы и замечания.

Несмотря на высокую научную и практическую ценность диссертационного исследования, в процессе ознакомления с работой возникли следующие вопросы, требующие обсуждения и уточнения:

Дискуссионный вопрос 1: о границах применимости метода и проблеме «черных лебедей». Автор справедливо критикует традиционные методы прогнозирования за неспособность предсказывать редкие, значимые события («черные лебеди»). Однако остается неясным, в какой степени предложенный метод эволюционно-контекстного сценарного анализа способен решить эту проблему. Если предложенная автором модель обучается на исторических данных, то как она может предсказать принципиально новые события, не имеющие аналогов в прошлом?

Например, пандемия COVID-19 (2020 г.) привела к беспрецедентному падению цен на нефть до отрицательных значений (что не отражено в использованных автором среднегодовых данных). Смогла бы модель LSTM, обученная на данных до 2020 года, предсказать такое развитие событий? Или

предложенный метод все же ограничен рамками «серых носорогов» (предсказуемых, но игнорируемых угроз)?

Представляется, что необходимо более четко определить границы применимости метода и его ограничения в условиях структурных разрывов и радикальных изменений контекста.

Дискуссионный вопрос 2: о выборе и обосновании фоновых факторов. Автор демонстрирует, что увеличение количества фоновых факторов (с 2 до 6-9) улучшает качество прогнозирования. Однако методология выбора этих факторов раскрыта недостаточно полно. В работе (с. 102-103) для построения когнитивной карты используется тест причинности Грейнджера и коэффициент корреляции (значимым считается $|r| > 0,5$). Но этот подход имеет существенные ограничения:

1. Автор сам отмечает (стр. 89-91), что «причинность по Грейнджеру» не является истинной причинно-следственной связью, а лишь показывает, что одна переменная предшествует другой во времени.

2. Коэффициент корреляции измеряет только линейную связь, в то время как автор подчеркивает важность нелинейных зависимостей в VUCA-мире.

3. Выбор порога $|r| > 0,5$ представляется произвольным и не обоснован теоретически.

Возникают вопросы:

- Как обеспечить полноту набора фоновых факторов? Не упущены ли важные переменные?
- Как учесть факторы, которые могут стать значимыми в будущем, но не проявляли себя в прошлом?
- Существуют ли формализованные критерии для определения оптимального набора факторов, или это остается областью экспертного суждения?

Было бы полезно увидеть анализ чувствительности результатов к составу фоновых факторов и рекомендации по их отбору для различных типов задач стратегического планирования.

Дискуссионный вопрос 3: о практической реализуемости метода и требованиях к компетенциям. Предложенный метод требует высокой квалификации в области машинного обучения, программирования на Python, работы с библиотеками TensorFlow/Keras. Это существенно ограничивает круг потенциальных пользователей метода в бизнес-среде.

В работе представлен программный код (Приложения 4-7, 10), но отсутствуют:

- Рекомендации по подготовке данных (обработка пропусков, выбросов, нормализация).
- Критерии оценки качества обученной модели (помимо визуального анализа графиков).
- Методика интерпретации результатов для лиц, принимающих стратегические решения.
- Оценка вычислительных ресурсов и времени, необходимых для реализации метода.

Автор справедливо отмечает (стр. 127), что разработанный метод представляется универсальным и может использоваться различными организациями. Однако для широкого практического применения необходимо:

1. Предложить упрощенную версию метода для малых и средних предприятий, не располагающих ресурсами для создания сложных нейросетевых моделей.

2. Оценить соотношение затрат на внедрение метода и получаемых выгод от повышения качества стратегического планирования.

Каково видение автора относительно практической реализации предложенного метода? Планируется ли разработка программного обеспечения или методических рекомендаций для практиков?

Сформулированные вопросы и замечания не умаляют научной и практической ценности диссертационного исследования, а направлены на уточнение и развитие предложенных автором идей. Они могут стать основой для дальнейших исследований в этой перспективной области.

Вывод: Диссертация Никитинса Ильи «Совершенствование методологии стратегического планирования бизнеса на основе эволюционно-контекстных сценариев» является научно-квалификационной работой, в которой содержится решение задачи, имеющей важное значение для развития экономической науки и практики, что соответствует требованиям Положения о присуждении ученых степеней, утвержденного Постановлением Правительства Российской Федерации от 24 сентября 2013 года № 842 и Порядка присуждения ученой степени кандидата наук, ученой степени доктора наук в Российской академии народного хозяйства и государственной службы при Президенте Российской Федерации, утвержденного приказом ректора ФГБОУ ВО «Российская академия народного хозяйства и государственной службы при Президенте Российской Федерации» (в редакции приказа от 30 апреля 2025 года № 02-763), а Никитинс Илья заслуживает присуждения ему ученой степени кандидата экономических наук по специальности 5.2.6. – «Менеджмент».

Член диссертационного совета РАНХиГС,
доктор экономических наук, профессор,
профессор кафедры теории менеджмента
и бизнес-технологий ФГБОУ ВО «Российский экономический
университет имени Г.В. Плеханова»

Валерий Владимирович Масленников

«16» октября 2025 г.



115054, Российская Федерация, г. Москва, Стремянный пер. 36
Телефон: +7-495-800-12-00 (доб. 1909)
Электронная почта: maslennikov.vv@rea.ru