

ӘЛ-ФАРАБИ АТЫНДАҒЫ ҚАЗАҚ ҰЛТТЫҚ УНИВЕРСИТЕТІ
Экономика және бизнес жоғары мектебі
Басқару бөлімі

«Басқарушылық талдау және болжау»
Дәріс жазбалары

Алматы 2025 ж

Мазмұны

- 1-бөлім: Басқару шешімдерін қабылдаудағы басқару талдауының рөлі: саланың ерекшеліктері
- 2-бөлім: Стратегиялық менеджментті талдаудың әдістері мен әдістері
- 3-бөлім: Операциялық және ағымдағы басқаруды талдаудың әдістері мен әдістері
- 4-бөлім: Жауапкершілік орталықтарын басқаруды талдау: негізгі бағалау көрсеткіштері
- 5-бөлім: Тиімділіктің негізгі көрсеткіштері
- 6-бөлім: өнімділіктің балама көрсеткіштері
- 7-бөлім: Басқару талдауындағы мінез-құлық туралы ойлау: Тәуекелдік аппетит критерийлері
- 8-бөлім: Басқару шығындарын талдау: өзара бағалау. 1-бөлім
- 9-бөлім: Басқару шығындарын талдау: өзара бағалау. 2-бөлім
- 10-бөлім: Басқару шешімдерін қабылдаудағы бюджеттік емес басқару
- 11-бөлім: Шешім қабылдаудағы белгісіздік және тәуекел
- 12-бөлім: Басқару шешімдерін қабылдаудағы рөл, тәсілдер және негізгі әдістердегі болжау және модельдеу
13. бөлім: Басқару шешімдерін қабылдаудағы болжау және модельдеу құралдары.
14. бөлім: Басқару шешімдерін қабылдаудағы болжау және модельдеу: Тестілеу
15. бөлім: Басқару шешімдерін қабылдаудағы болжау және модельдеу. Қолдану: Көрнекілік, Түсіндіру

13. Тақырып: Басқару шешімдерін қабылдаудағы болжау және модельдеу құралдары.

Мақсаты: Зерттеу бағытын ескере отырып, негізгі болжау және модельдеу құралдарын сипаттау.

Контур

1. Басқаруды талдаудағы болжаудың негізгі түрлері
2. Болжауға арналған деректер саны мен сапасы
3. Басқаруды талдауда болжау түрлерін таңдауды анықтайтын негізгі факторлар

Болжау әдістері

Болжамдардың классификациясы. Классикалық менеджментте болжау оны анықтау үшін өткен тәжірибені де, болашаққа қатысты ағымдағы жорамалдарды да қолданатын әдіс болып саналады. Бұл жоспарлау үшін негіз ретінде пайдалануға болатын болашақтың суретін береді.

Менеджменттегі болжау – басқарылатын объектінің даму үлгілерін әзірлеу технологиясы. Болжамдық көрсеткіштер (объектінің сандық сипаттамалары, жұмыс көлемі мен мерзімдері және т.б.) ықтималдық сипатта болады.

Болжамдар басқару шешімдерін болжау және қабылдау үшін қолданылады. Болжаудың мақсаты – басқарылатын объектінің (оның жай-күйінің көрсеткіштерінің) уақыт пен кеңістіктегі даму тенденцияларының (өзгерістерінің) ғылыми негізделген сценарийлерін алу. Болжау ақпараты адамдар арасындағы қарым-қатынас немесе қоғамдық игіліктер арқылы алынған ауызша және жазбаша мәтіндерге негізделген. Қажетті ақпаратты алу үшін жекелеген жеке кәсіпкерлік субъектілері өндірістік тыңшылықпен айналысады.

Қоғамдық игіліктерден ақпарат келесі әдістердің көмегімен алынады: құрылымдық және морфологиялық талдау; қоғамдық белсенділікті анықтау; патенттік құжаттардың топтарын анықтау; көрсеткіштерді талдау; және терминологиялық және лексикалық талдау.

Тәжірибеде болжау үшін әртүрлі сандық және сапалық әдістер қолданылады. Сандық әдістер (әдістер) басқарылатын объектінің өндірістік белсенділігін сипаттайтын параметрлердің өзгеру тенденцияларын білу немесе статистикалық сенімді байланыстары бар ақпаратқа негізделген. Бұл әдістердің мысалдарына уақыттық қатарларды талдау және себептік модельдеу жатады.

Сапалық әдістер сараптамалық бағалау әдістері, қазылар алқасының қорытындысы (тиісті салалардағы сарапшылық қорытындыларды орташалау) және тұтынушылардың күту үлгілері (тұтынушылар сауалнамасы) сияқты шешім қабылдау саласындағы мамандардың сараптамалық бағалауларына негізделген.

Ең жиі қолданылатын болжау әдістерінің қысқаша сипаттамасын берейік.

Сараптамалық әдістер

- Қолдану аймағы: Экономикалық жағдайлар. Ғылыми-техникалық прогрестің мәселелерін шешу. Күрделі объектілерді дамыту.
- Мақсат, шешілетін міндеттер. Дамуы объективті сипаттауға немесе математикалық формализацияға сәйкес келмейтін объект үшін. Бақыланатын объектіге қатысты сенімді статистика болмаған жағдайда. Жоғары белгісіздік жағдайында. Компьютерлер болмаған жағдайда. Экстремалды жағдайларда.
- Қолдану мүмкіндіктері: 7-9 маманның сараптамалық бағалауы негізінде. Сарапшылар тобының ұжымдық пікірін әзірлеу. Деректерді сұрау және өңдеу уақытты қажет етеді.

Эвристикалық болжау әдісі

- Қолдану аймағы: Ғылыми-технологиялық объектілер мен дамуын ресімдеу қиын мәселелер.
- Мақсат, шешілетін міндеттер. Жобаланған (жаңартылған) жүйелерді құрудың оңтайлы жолдарын табу. Тар саланың даму болашағының объективті көрінісін анықтау.
- Қолдану мүмкіндіктері: Математикалық құрылғы қолданылмайды. Нысан бойынша болжамды бағалау ғылымның, техниканың және өндірістің белгілі бір саласындағы сарапшылардың жүйелі сауалнамасы арқылы арнайы

өңделеді. Ақпараттық массив сарапшылар толтырған кестелер жиынтығы ретінде жасалады.

Ұжымдық идея генерациясы

- Қолдану аймағы. Болжау және шешім қабылдау үшін идеялар жиынтығын алу.
- Мақсат, шешілетін міндеттер. Басқарылатын нысан үшін дамудың ықтимал нұсқаларының барлық ауқымын анықтау. Болжау объектісіне әсер ететін факторлардың баламалы диапазонын анықтау. Басқарылатын нысан үшін даму сценарийін алу.
- Қолданба мүмкіндіктері. Болжау объектісін синтездеу, осы оқиғаны анықтайтын факторлар тұрғысынан оқиғаларды көпфакторлық талдау.

Морфологиялық талдау

- Қолдану аймағы. Зерттелетін мәселе туралы ақпарат шектеулі болған кезде, барлық ықтимал шешімдер үшін жүйелеуді алу.
- Мақсат, шешілетін міндеттер. Іргелі зерттеулердің мүмкін болатын нәтижесін болжау. Жаңа нарықтарды ашу, жаңа қажеттіліктерді қалыптастыру кезінде.
- Қолданба мүмкіндіктері. Объектілер, құбылыстар және ұғымдар арасындағы құрылымдық байланыстар. Әмбебаптық объект туралы білімнің толық жиынтығын пайдалануды білдіреді. Қажетті талап - алдын ала пікірлердің толық болмауы. Ол келесі кезеңдерді қамтиды: мәселені құрастыру; параметрлерді талдау; барлық ерітінділері бар «морфологиялық жәшік» салу; және барлық шешімдерді тексеру.

Болжам графигі және шешім ағашы

- Қолданба. Құрылымдық болжау: оның функцияларын сақтай отырып, бірақ объектінің құрылымын өзгерте отырып, мәселенің шешімін табу.
- Мақсат пен шешілетін міндеттер. Жалпы объектінің дамуын болжау. Болжалды мақсатқа, мақсат деңгейіне, критерий мен салмаққа, рейтингтік түйіндерге қол жеткізу сценарийін құрастыру.

Аналогия бойынша болжау

- Қолданба. Шешім қабылдаушыларға таныс жағдайларды шешу.
- Мақсат пен шешілетін міндеттер. Жағдаяттық басқару мәселелерін шешу.
- Қолданба мүмкіндіктері. Аналогтық объектілер мен процестер қол жетімді болған кезде әдісті қолдану. Әдісті қолдану арнайы дағдыларды қажет етеді.

Болжау мәселелерін шешу және шешім қабылдау кезінде маңызды мәселе қажетті ақпараттың саны мен сапасы болып табылады. Төменде шешім қабылдаушыларға ең аз материалдық және ұйымдастырушылық шығындармен ақпараттық дерекқорды толтыруға мүмкіндік беретін бірнеше әдістер (әдістер мен әдістер) берілген. Ақпаратты алудың әртүрлі әдістері бар:

- Құрылымдық-морфологиялық әдіс. Пәндік саланың ішкі құрамын анықтауға және компанияның ғылыми-техникалық прогресс стратегиясын дұрыс тұжырымдауға мүмкіндік беретін принципті жаңа әзірлемелердің (идеялар, техникалық шешімдер және т.б.) пайда болуын тіркеуге арналған.
- Жариялану белсенділігін анықтау әдісі. Өртүрлі білім салаларына қатысты құжаттар ағыны циклдік сипатта болады. Осы циклдарды бақылай отырып, елдегі немесе кәсіпорындардағы белгілі бір мәселенің даму жағдайын анықтауға және өз ұйымының ішінде ғылыми-техникалық прогрестің стратегияларын түзету шараларын қолдануға болады.
- Патенттік құжаттардың топтарын анықтау әдісі. Кез келген ұйым, әдетте, оның дамуы мен бизнесі үшін практикалық маңызы бар идеяларды ғана патенттейді. Жетекші компаниялардың ұқсас патенттерін зерттей отырып, олардың қызметінің бағытын және олардың қызығушылық проблемасын шешу деңгейін анықтауға болады.
- Көрсеткіштер әдісі. Әрбір техникалық жүйе құжаттарда көрсетілген үнемі жетілдіріліп отыратын көрсеткіштер жиынтығымен сипатталады. Бұл жүйе көрсеткіштерінің сипаттамаларының өзгеру динамикасын талдай отырып, оның даму тенденциялары туралы қорытынды жасауға болады.
- Терминологиялық және лексикалық талдау әдісі. Әр түрлі білім салалары дамыған сайын терминология табиғи түрде ауысады. Мәтіндерді лексикалық талдау іргелі жаңалықтардың пайда болуын ерте кезеңде анықтауға және өз ұйымының әрекеттерін болжауға мүмкіндік береді.

Болжау әдісін таңдау

Сәйкес таңдалған болжау құралдары болжау сапасын айтарлықтай жақсартады, себебі:

- олар болжамның функционалдық толықтығын, сенімділігін және дәлдігін қамтамасыз етеді;
- олар болжауға уақыт пен материалдық шығындарды азайтады.

Болжау әдісін таңдауға мыналар әсер етеді:

- шешілетін практикалық мәселенің сипаты;
- нарықтық ортадағы болжамдық объектінің динамикалық сипаттамалары;
- қолда бар ақпараттың түрі мен сипаты, болжау объектісінің типтік тұжырымдамасы;
- өнімнің немесе қызмет ету мерзімінің және нарықтық циклдің фазаларының үйлесімі;
- жетекші кезең және оның нарықтың күтілетін ұзақтығына, өнімнің немесе қызметтің өмір сүруіне, дамуына немесе модификация цикліне қатынасы;
- болжамдық нәтижелерге қойылатын талаптар және мәселенің басқа да спецификалық ерекшеліктері.

Осы факторлардың барлығын жүйе ретінде қарастыру керек, тек болмашы факторларды қарастырудан шығару керек. Тәжірибеде болжау әдісін таңдаған кезде ең маңызды екі факторды ескеру ұсынылады: құны мен дәлдігі. Болжамды дайындауға бөлінген ресурстарды, болжамды қателердің ықтимал

құнын және кірістілігін анықтау маңызды. Ең жақсы болжам әдетте дәлдік пен құнның оңтайлы үйлесімін білдіреді.

Болжау әдісін таңдаған кезде мыналарды ескеру қажет:

- қажетті кезеңдегі статистикалық мәліметтердің болуы;
- болжаушының құзыреттілігі және есептеу техникасының болуы;
- ақпаратты жинау және талдау үшін қажетті уақыт.

Кейбір жағдайларда тәуелсіз болжамдарды алу үшін бір мезгілде бірнеше әдістер қолданылады. Болжам талаптары:

- басқа көрсеткіштердің белгілі бір дәрежеде дәлдігі мен сенімділігімен уақтылылығы;
- сенімділік, маңызды бірліктермен (доллар, өнім бірлігі, жабдық, персонал біліктілігі және т.б.) көрсетілген және қағазға жазылған;
- болжау әдістемесін қолданудың қарапайымдылығы.

Қорытындылар

1. «Көрнекілік» түсінігіне мыналар кіреді: болжау (болашақ жағдайдың бір мәнді мәлімдемесі); болжам (ең ықтимал жағдай); болжам (нұсқаларды, гипотезаларды сипаттау). Форсайт басқару аппаратының белсенді қатысуымен басқару шешімдерін қабылдаушылармен жүзеге асырылады. Болжау факторлар әсерінің салдарындағы белгісіздік дәрежесін төмендетуге мүмкіндік береді.

2. Форсайт шешім қабылдаушылардың, басқару қызметкерлерінің, мамандандырылған фирмалар сарапшыларының жүйелі қызметі. Ол ғылыми негізделген дәйектілікпен жүзеге асырылады және ойлау, басқару, еңбекті ұйымдастыру заңдарының белгілі (ең алдымен эмпирикалық) талаптарына бағынады. Болжау жеке тұлғаның жеке басына және дайындық деңгейіне байланысты (кәсіби және тұлғалық).

3. Болжаудың әртүрлі технологиялары жасалып, тәжірибеде сыналған. Дегенмен, әртүрлі ғылымдардан алынған білімдерді интеграциялау үшін қажетті әдістемелік қамтамасыз етудің жоқтығы және адамның ойлау процестеріне жеткілікті кешенді зерттеулер жүргізілмеуі білім мен болжау ұсыныстарының үйлесімді, дәйекті жүйесін құруға кедергі келтіреді. Осы себепті болжау әдістерінің әртүрлі классификациялары бар, қолданыстағы математикалық аппарат болжау есептерін шешуге жеткіліксіз бейімделген және т.б.

4. Болжау әдісін таңдаудың негізділігі оны қолдану шарттарымен және шешілетін мәселелерге жарамдылығымен анықталады. Тәжірибеде әдістерге нақты талаптарды қанағаттандыратын әртүрлі болжау көрсеткіштері қолданылады: дәлдік, сенімділік, құны, ақпарат мазмұны және т.б.

5. Болжау әдістері сапалық және сандық болып екіге бөлінеді. Сапалық әдістер пайымдауға, тәжірибеге және сараптамаға негізделген; сандық әдістер белгілі бір уақыт аралығындағы статистикалық мәліметтерді пайдалануға немесе айнымалылар арасындағы байланыстарға сүйенеді. Ешбір әдіс әмбебап емес. Әдістер қарапайым немесе күрделі болуы мүмкін.

6. Барлық болжамдар әдетте дәл емес. Олардың нақты емес немесе нақты көрсеткішке сәйкес келмеу дәрежесін анықтау қажет. Болжаудың дәлдігін есептеу, белгілі бір әдістің тиімділігін бағалау және әртүрлі болжау әдістерін таңдау үшін әртүрлі ұсыныстар әзірленді. Болжамдық мониторинг оның орындалуының сәйкестігін қамтамасыз етеді. Іс жүзінде бақылау диаграммасын немесе ауытқу көрсеткішін пайдалану ұсынылады. Болжау әдісін таңдау дегеніміз – қолайлы баға мен дәлдік деңгейінде қойылған міндетке жауап беретін әдістемені таңдау.

Сұрақтар

1. Өзіңіздің зерттеу пәніңіздің контекстінде менеджменттік талдаудағы болжаудың негізгі түрлерін түсіндіріңіз.
2. Зерттеу пәніңіздің контекстінде болжау мақсатында деректердің саны мен сапасының негізгі критерийлерін түсіндіріңіз.
3. Зерттеу пәніңіздің контекстінде болжау түрлерін таңдауды анықтайтын негізгі факторларды түсіндіріңіз.

Дереккөздер

- 1 «ӘЛ-ФАРАБИ АТЫНДАҒЫ ҚАЗАҚ ҰЛТТЫҚ УНИВЕРСИТЕТІ» ҰБТ-НЫҢ 2022-2026 ЖЫЛҒА АРНАЛҒАН ДАМУ БАҒДАРЛАМАСЫ
- 2 "ҚАЗАҚСТАН РЕСПУБЛИКАСЫНЫҢ КӘСІПКЕРЛІК КОДЕКСІ (12.09.2022 жылғы өзгерістер мен толықтырулармен)" Қазақстан Республикасының Заңы.
- 3 "Акционерлік қоғамдар туралы" Қазақстан Республикасының 2003 жылғы 13 мамырдағы N 415-ІІ Заңы.
4. Мемлекет басшысы Қасым-Жомарт Тоқаевтың « «Жасанды интеллект дәуіріндегі Қазақстан: өзекті мәселелер және оны түбегейлі цифрлық өзгерістер арқылы шешу»» атты Қазақстан халқына Жолдауы, 8 қыркүйек 2025 ж.
5. «Цифрлық Қазақстан» мемлекеттік бағдарламасы
6. «Қазақстан Республикасының мемлекеттік қызметі туралы» Қазақстан Республикасының Заңы
- 2015 жылғы 23 қарашадағы № 416-V ҚРЗ.

Additional

7. Amankeldi N. Svyatov S., A.Adambekova The Realization of Academic Freedom as the Basis of Assurance of Higher Education Quality. IJEFI-EconJ - International Journal of Economics and Financial Issues (ISSN21464138-Turkey-Scopus), 2015.-№5, 80-88p ИФ-0,15

Scopus indexed Journals

- 8 Azzbekova K. Bohayev D. Adambekova A. Bank Risk Management in the Conditions of Financial System Instability. Entrepreneurship and sustainability issues // Entrepreneurship and sustainability issues, Вильнюс 2020, 7. – С.1599-1614

9 SMALL FIRMS' CAPITAL STRUCTURE AND PERFORMANCE

Kokeyeva, S., Hájek, P., Adambekova, A.

Ikonomicheski Izsledvania, 2022, 31(4), стр. 128–144

10 THE INFLUENCE OF THE CAPITAL MARKET (FINANCIAL INSTRUMENTS) ON ECONOMIC GROWTH IN KAZAKHSTAN AND CIS COUNTRIES

Omira, A., Adambekova, A., Khishauyeva, Z., Zhanibekova, G., Amankeldi, N.

ECONOMICS - INNOVATIVE AND ECONOMICS RESEARCH JOURNAL, 2024, 12(1),
страницы 227–239

- 11 Kazakhstan and China in the context of economic oil and gas cooperation, Вестник ЕНУ им Л.Гумилева №2,2023 в соавторстве Хань Найчао
- 12 «Орталық Азия елдерінің инвестициялық тартымдылығы: факторлары және рейтингтік критерийлері» //Вестник университета Туран – 2023. – №. 3. – С. 153-169. В соавторстве Аппазов А, Адамбеков Н.Т., Аманкелды Н.А..
- 13 ЛИЗИНГ КАК ДЕЙСТВЕННЫЙ ИНСТРУМЕНТ ГОСУДАРСТВЕННОЙ ПОДДЕРЖКИ ПРЕДПРИНИМАТЕЛЬСТВА, \ \ Казахстан -Спектр (КИСИ) 2023, №3, с70-84. В соавторстве Урпежанов С. <https://doi.org/10.52536/2415-8216.2023-3.05>
- 14 Scientific justification for the specific application of ESG principles, Вестник КазНУ, 2023,№4
- 15 Investment Analysis Methodology: Overview and Application, Вестник ЕНУ, 2023 №4
- 16 Государственное управление через призму экономических теорий. САЕР. 2023. №6 . с.129-149 в соавторстве с Муслимовым Р. <https://doi.org/10.52821/2789-4401-2023-6-129-149>
- 17 REGIONAL RESOURCE PROVISION MAP: METHODOLOGY AND KEY APPROACHES Вестник Туран, 2024, №2
- 18 ESG commitment: scientific rationale for relevance and review of practice, ВЕСТНИК КАЗУЭФМТ (ЕСИЛЬ) 2024, №2
- 19 КАПИТАЛ ҚҰРЫЛЫМЫ, ТАБЫСТЫЛЫҚ ЖӘНЕ ТӘУЕКЕЛІ: ҚАЗАҚСТАН РЕСПУБЛИКАСЫНЫҢ ӨНЕРКӘСІП СЕКТОРЫНДАҒЫ ШАҒЫН КОМПАНИЯЛАРДЫ ЗЕРТТЕУ САЕР. 2024. №2
20. Economic Review of the National Bank of the Republic of Kazakhstan
21. The journal "Bulletin of KazNU named after al-Farabi (economic series)"
22. The magazine "Kazakhstan Securities Market"
23. www.nationalbank.kz.
24. www.kase.kz
- 25 <https://adilet.zan.kz/rus/docs/P2200000516>