Ігор В. Пономаренко
Державний торговельно-економічний університет
ORCID ID: https://orcid.org/0000-0003-3532-8332

Руслан М. Набока
Херсонський національний технічний університет
ORCID ID: https://orcid.org/0000-0002-3417-8216

Сергій А. Лубковський
Київський національний економічний університет імені Вадима Гетьмана
ORCID ID: https://orcid.org/0009-0007-5284-9275

ОЦІНЮВАННЯ НЕСИСТЕМНИХ РИЗИКІВ КОРПОРАТИВНОГО УПРАВЛІННЯ ДЕРЖАВНИХ ПІДПРИЄМСТВ НА ОСНОВІ МЕТОДІВ МАШИННОГО НАВЧАННЯ

У статті досліджено роль алгоритмів машинного навчання в системі оцінювання несистемних ризиків корпоративного управління державними підприємствами в умовах війни в Україні та цифрової трансформації державного сектору. Доведено доцільність розробки концептуальної моделі на базі високопродуктивних алгоритмів машинного навчання, що пов'язано зі зростанням різних типів даних (структурованих, напівструктурованих та неструктурованих) про функціонування державних підприємств та неспроможністю класичних методів достовірно оцінювати невизначеності. Розроблено п’ятирівневу схему застосування методів машинного навчання, яка передбачає послідовну реалізацію наступних етапів: вибір релевантних джерел даних про державні підприємства, обробку накопиченої різнорідної інформації, постановку аналітичних завдань, вибір алгоритмів та інтерпретацію отриманих результатів. Визначено шість основних напрямів використання алгоритмів машинного навчання для оцінювання несистемних ризиків корпоративного управління: класифікацію рівня ризику (Random Forest, Gradient Boosting), виявлення аномалій та ознак шахрайства (Isolation Forest, автоенкодери), аналіз репутаційного ризику методами обробки природної мови, прогнозування динаміки фінансово-операційних показників (LSTM/GRU), кластеризацію державних підприємств за профілем ризику та пояснення результатів моделі методами SHAP і LIME. Проведено порівняльний аналіз традиційних методів оцінювання невизначеності та високопродуктивних алгоритмів машинного навчання за критеріями масштабованості, здатності обробляти неструктуровані дані та інтерпретованості результатів. Доведено доцільність поєднання традиційних підходів (експертні оцінки, теорія Демпстера-Шейфера) з алгоритмами машинного навчання для підвищення якості управлінських рішень у державному секторі України в умовах війни та повоєнного відновлення.

Ключові слова: корпоративне управління; державні підприємства; несистемні ризики; машинне навчання; штучний інтелект; оцінювання ризиків; теорія Демпстера-Шейфера; цифровізація державного сектору.