

## ЗАКЛЮЧЕНИЕ

ДИССЕРТАЦИОННОГО СОВЕТА Д 002.013.04, СОЗДАННОГО НА БАЗЕ  
ФЕДЕРАЛЬНОГО ГОСУДАРСТВЕННОГО БЮДЖЕТНОГО УЧРЕЖДЕНИЯ НАУКИ  
ЦЕНТРАЛЬНОГО ЭКОНОМИКО-МАТЕМАТИЧЕСКОГО ИНСТИТУТА  
РОССИЙСКОЙ АКАДЕМИИ НАУК, ПО ДИССЕРТАЦИИ НА СОИСКАНИЕ  
УЧЕНОЙ СТЕПЕНИ КАНДИДАТА НАУК

Аттестационное дело № \_\_\_\_\_

Решение диссертационного совета

от 24 июня 2022 г. № 6

О присуждении Жуковой Людмиле Вячеславовне, гражданке Российской Федерации, ученой степени кандидата экономических наук.

Диссертация «Экспресс-анализ соответствия социально-экономического состояния предприятия нормативным требованиям на основе общедоступной информации» по специальности: 08.00.05 – «Экономика и управление народным хозяйством (экономика, организация и управление предприятиями, отраслями, комплексами — промышленность)» принята к защите 15 апреля 2022 г. (протокол заседания № 4) диссертационным советом Д 002.013.04, созданным на базе Федерального государственного бюджетного учреждения науки Центрального экономико-математического института Российской академии наук, подведомственного Министерству науки и высшего образования Российской Федерации. Адрес: 117418, г. Москва, Нахимовский проспект, д. 47 (приказ № 75/нк от 15 февраля 2013 г.).

Соискатель Жукова Людмила Вячеславовна, 22 июня 1981 года рождения, в 2004 году окончила Московский Государственный институт электроники и математики (технический университет), квалификация экономист-математик по специальности «Математические методы и исследование операций в экономике» (диплом ВСВ 0216152 от 28.02.2004 г.), с 23.06.2004 г. по 23.06.2008 г. обучалась в заочной аспирантуре Национального исследовательского университета «Высшая школа экономики» по специальности: 08.00.13 «Математические и инструментальные методы в экономике», была отчислена 23.06.2008. В период с 28.01.2022 г. прикреплена к аспирантской школе по экономике при факультете экономических наук ФГАОУ ВО «Национальный исследовательский университет «Высшая школа экономики»» для сдачи кандидатского экзамена без освоения образовательных программ по научной специальности: 08.00.05 –

«Экономика и управление народным хозяйством (экономика, организация и управление предприятиями, отраслями, комплексами — промышленность)».

Диссертация выполнена в департаменте прикладной экономики экономического факультета ФГАОУ ВО «Национальный исследовательский университет «Высшая школа экономики» (101000, Москва, ул. Мясницкая, д. 20).

Научный руководитель — кандидат экономических наук, доцент департамента бизнес-информатики Высшей школы бизнеса Федерального государственного автономного образовательного учреждения высшего образования «Национальный исследовательский университет «Высшая школа экономики» Богданова Татьяна Кирилловна.

Официальные оппоненты:

1. Тельнов Юрий Филиппович, доктор экономических наук, профессор, заведующий кафедрой прикладной информатики и информационной безопасности Федерального государственного бюджетного образовательного учреждения высшего образования «Российский экономический университет имени Г.В. Плеханова».

2. Трегуб Илона Владимировна, доктор экономических наук, профессор департамента математики Федерального государственного образовательного бюджетного учреждения высшего образования «Финансовый университет при Правительстве Российской Федерации» (Финансовый университет).

дали положительные отзывы на диссертацию.

Ведущая организация — Федеральное государственное учреждение «Федеральный исследовательский центр «Информатика и управление» Российской академии наук» (ФИЦ ИУ РАН) в своем положительном отзыве, подписанном заведующей отделом «Информационные технологии оценки эффективности инвестиций» ФИЦ ИУ РАН, доктором экономических наук, профессором Орловой Еленой Роальдовной, и утвержденном директором ФИЦ ИУ РАН, академиком РАН, членом Президиума РАН, доктором технических наук Игорем Анатольевичем Соколовым, указывает, что представленная диссертационная работа имеет теоретическую и практическую значимость, обладает научной новизной, выполнена на актуальную тему, соответствует требованиям «Положения о присуждении ученых степеней», утвержденного Постановлением Правительства Российской Федерации от 24.09.2013 № 842.

По теме диссертации соискателем опубликовано 6 печатных работ общим объемом 5,17 п.л., из них 5 работ — в научных журналах, рекомендованных ВАК



для публикации основных результатов диссертации на соискание ученой степени кандидата экономических наук и индексируемых в базе данных «Скопус» (Scopus).

В публикациях отражены основные теоретические и прикладные результаты выполненного диссертационного исследования.

Наиболее значимые публикации автора по теме диссертации:

1. Жукова Л.В. Экспресс-анализ состояния промышленных предприятий Москвы с использованием универсального комплексного индикатора // Экономическая наука современной России. 2021. Т.4 (95). С. 89–96. DOI: 10.33293/1609-1442-2021-4(95)-89-97;

2. Богданова Т.К., Жукова Л.В. Информационно — логическая модель экспресс-анализа соответствия состояния предприятия, удовлетворяющего нормативам и регламентам, на основе общедоступных данных // Бизнес-информатика. 2022. Т.16. №1 С. 42–55. DOI: 10.17323/2587-814X.2022.1.42.55;

3. Богданова Т.К., Жукова Л.В. Оценка состояния объекта управления на основе универсального комплексного индикатора с использованием структурированных и неструктурированных данных // Бизнес-информатика. 2021. Т.15, № 2. С. 21–33. DOI: 10.17323/2587-814X.2021.2.21.33;

4. Жукова Л.В., Поляков К.Л. Опыт моделирования вероятности кредитного дефолта клиентов микрофинансовых организаций (на примере одной МФО) // Экономический журнал Высшей школы экономики. 2019. Т.4, № 23. С. 497–523. DOI: 10.17323/1813-8691-2019-23-4-497-523;

5. Zhukova L.V., Polyakov K.L. Comparative Analysis of Predictive Analytics Models in Classification Problems // Actual Problems of Systems and Software Engineering APSSE 2019 (Invited Papers). Los Alamitos, Washington, Tokyo: IEEE Computer Society. 2019. p. 162–169. DOI: 10.1109/APSSE47353.2019.00028;

6. Zhukova L., Chugunov V., Kovaleva A., Kovalchuk I. Mathematical Methods of Grouping Data for Making Managerial Solutions in the Tasks of Planning // Actual Problems of System and Software Engineering 2017. Proceedings of the 5th International Conference on Actual Problems of System and Software Engineering Supported by Russian Foundation for Basic Research. Project #17-07-20565 Moscow, Russia, November 14–16, 2017. Ed. by A.R. Cavalli, A. Petrenko, B. Pozin. — Vol. 1989. p. 333–341.

На автореферат диссертации поступило 6 отзывов, в которых положительно оценены результаты выполненного исследования и приведены замечания и

рекомендации по улучшению работы:

1. Пяткина Дарья Анатольевна, к.ф.-м.н., доцент кафедры теории вероятностей ФГАОУ ВО «Российский университет дружбы народов» (РУДН), отметила что итоговая модель оценки вероятности банкротства промышленного предприятия основана лишь на одной спецификации при том, что спецификаций может быть достаточно большое количество, и точность моделей может существенно различаться.

2. Нежурина Марина Игоревна, к.т.н., заведующая кафедрой «Магистерская школа Информационных бизнес систем», доцент НИТУ «МИСиС» отмечает, что из текста автореферата не ясно, каковы, по мнению соискателя, отличительные особенности модели для оценки соответствия состояния предприятия требованиям контрольных и надзорных органов по сравнению с классическими моделями оценки финансового состояния предприятия.

3. Кравец Максим Александрович, д.э.н, профессор кафедры экономики труда и основ управления экономического факультета, ФГБОУ ВО «Воронежский государственный университет» высказал замечание о том, что соискателю следует уточнить определение термина «концептуальная модель», используемого в работе, что именно понимает соискатель под этим термином. В качестве второго замечания Кравец М.А. отметил, что недостаточно подробно раскрыто место функции «контроль» в управлении предприятием.

4. Кирсанов Александр Петрович, д.т.н., старший научный сотрудник АО «Концерн «Вега»» отметил, что из текста автореферата не ясно, как соотносится тема и выполненная соискателем работа с действующей в РФ промышленной политикой.

5. Шевгунов Тимофей Яковлевич, к.т.н., доцент кафедры «Теоретическая радиотехника», ФГБОУ ВО «Московский авиационный институт (национальный исследовательский университет)» (МАИ) в качестве первого замечания отметил что остался не раскрытым вопрос, для каких групп потенциальных пользователей предназначена разработанная соискателем концептуальная модель, а также при каких условиях она быть полезна предприятиям? В качестве второго замечания указал, что остался не раскрытым вопрос, каким образом модель и разработанный соискателем алгоритм расчета интегрального показателя будут адаптироваться при изменении структуры доступной для анализа выборки данных, а также возможно ли использование предложенной



модели в системах непрерывного мониторинга состояния предприятия. В качестве третьего замечания указано, что в тексте автореферата отсутствует упоминание о сравнении предложенной соискателем модели с другими отечественными и зарубежными моделями комплексной оценки состояния предприятия, что могло бы продемонстрировать потенциальный выигрыш, обеспечиваемый новой моделью.

6. Чикина Любовь Григорьевна, д.ф.-м.н., профессор кафедры информатики и вычислительного эксперимента, ФГБОУ ВО «Институт математики, механики и компьютерных наук им. И.И. Воровича» ЮФУ, в качестве замечаний отмечает что, во-первых, была проведена оценка только социально-экономического состояния предприятия, при наличии других видов деятельности. Во-вторых, при построении кластерного анализа было бы полезно использовать одинаковые группы показателей – капитал, баланс, финансовые результаты.

Выбор доктора экономических наук, профессора Тельнова Юрия Филипповича, заведующего кафедрой прикладной информатики и информационной безопасности ФГБОУ ВО «Российский экономический университет имени Г.В. Плеханова» в качестве первого официального оппонента обосновывается тем, что он является одним из ведущих специалистов в области проектирования информационно-аналитических экономических систем, методов и средств инжиниринга предприятий на основе интеллектуальных технологий, и управления бизнес-процессами. Являлся председателем организационного комитета двадцати двух Российских и международных научных конференций «Инжиниринг предприятий и управление знаниями».

Выбор доктора экономических наук, профессора Трегуб Илоны Владимировны, профессора департамента математики ФГБОУ ВО «Финансовый университет при Правительстве Российской Федерации» (Финансовый университет) в качестве второго официального оппонента обосновывается тем, что она является экспертом Российской академии наук, одним из ведущих специалистов в области моделирования социально-экономических процессов, анализа данных, а также методов статистического моделирования и систем принятия решений.

Выбор Федерального государственного учреждения «Федеральный исследовательский центр «Информатика и управление» Российской академии наук» (ФИЦ ИУ РАН) в качестве ведущей организации, обосновывается тем, что сфера научных исследований ФИЦ ИУ РАН, в частности, Института системного

анализа (ИСА РАН), связана с тем, что специалисты этого института занимаются фундаментальными и прикладными исследованиями в области математики, математического моделирования, информатики, информационных технологий. Под руководством доктора экономических наук, профессора Орловой Елены Роальдовны, заведующей отделом «Информационные технологии оценки эффективности инвестиций», коллектив отдела на протяжении более 20 лет занимается системным анализом широкого круга задач, связанных с разработкой стратегий развития природоэксплуатирующих систем, математическим моделированием экономических объектов, исследованием алгоритмов управления, включающих планирование и оперативное управление предприятиями, что позволяет определить как теоретическую, так и практическую значимость диссертационной работы Жуковой Л.В.

Диссертационный совет отмечает, что на основании выполненных соискателем исследований:

разработаны концептуальная модель и схема проведения экспресс-анализа, позволяющие выявить соответствие социально-экономического состояния предприятия нормативам и регламентам, установленным контрольными и надзорными органами, на основе расчета интегрального показателя с использованием общедоступной открытой статистической информации;

введена типологизация источников количественной и качественной общедоступной информации для мониторинга развития экономических систем, в отличие от известных, учитывающая степень их достоверности и периодичность обновления данных для формирования статистической базы расчета интегрального показателя; предложенная типологизация позволяет получить однородные по степени достоверности группы источников общедоступной информации;

предложен подход к оценке социально-экономического состояния предприятия, комбинирующий различные методы статистической обработки данных (логистическая регрессионная модель, кластерный анализ, семантический анализ, индексный метод) для учета количественной и качественной, структурированной и неструктурированной информации о предприятии;

Теоретическая значимость исследования обоснована тем, что в диссертации: изложен алгоритм преобразования различных компонент в значения интегрального показателя с использованием набора решающих правил и таблицы



поиска, представляющей собой способ реализации агрегирующей функции, при котором непосредственное вычисление значений этой функции заменяется поиском по таблице готовых решений. Соискатель, таким образом, расширил возможности получения значений интегрального показателя на основе взвешивания значений отдельных компонент, дополнив применение весовых коэффициентов таблицей поиска;

изложен и протестирован новый подход к оценке социально-экономического состояния предприятия на основе расчета интегрального показателя с использованием общедоступных структурированных и неструктурированных данных. Полученные результаты помогут обосновать методологию принятия стратегических решений, направленных на развитие российских предприятий и совершенствование промышленной политики в целом.

Значение полученных соискателем результатов исследования для практики подтверждается тем, что:

разработана и внедрена методика экспресс-анализа для оценки динамики устойчивости и состояния коммерческих банков в деятельности отдела больших данных ЗАО «ЕС-Лизинг»;

определены методики экспресс-анализа при разработке информационно-аналитических систем для формирования и развития промышленных предприятий;

представлена концептуальная методика анализа предприятий на основе предложенной соискателем типологизации общедоступной информации по видам и степени достоверности;

Оценка достоверности результатов исследования позволила:

обосновать качественное и количественное удовлетворение авторских результатов оценки соответствия промышленного предприятия нормам и регламентам оказания финансовой поддержки с данными о выданных субсидиях департаментом инвестиционной и промышленной политики г. Москвы;

установить на основе проведенного экспресс-анализа соответствие полученных в диссертации оценок реальному состоянию группы коммерческих банков и требованиям ЦБ;

Личный вклад соискателя состоит:

- в работе с общедоступными открытыми базами данных для получения

количественных и качественных характеристик промышленных предприятий, российских коммерческих банков, а также информации об источниках данных;

- в проведении многочисленных расчетов для оценки компонент и значений интегрального показателя;

- в подготовке основных публикаций по теме исследования: всего опубликовано 6 работ общим объемом 5,17 п.л. (вклад автора — 3,3 п.л.).

- в апробации полученных в ходе исследования методологических и научных положений и рекомендаций на шести международных и всероссийских научно-практических конференциях, а также на 1 научном семинаре;

- в разработке концептуальной модели и схемы экспресс-анализа соответствия социально-экономического состояния предприятия нормативным требованиям на основе общедоступной информации;

- в разработке подхода к формированию рекомендаций по финансовой поддержке промышленных предприятий, а также по усилению надзора над некоторыми банками на основе открытой общедоступной информации;

В ходе защиты диссертации критических замечаний высказано не было.

На заседании 24 июня 2022 г. Диссертационный совет Д 002.013.04 принял решение: за результаты, представленные в диссертационной работе, содержащие концептуальную модель и схему проведения экспресс-анализа социально-экономического состояния предприятия, присудить Жуковой Людмиле Вячеславовне ученую степень кандидата экономических наук.

При проведении тайного голосования Диссертационный совет в количестве 16 человек, участвовавших в заседании и указанных в явочном листе, из них 8 докторов наук по научной специальности рассматриваемой диссертации, из 23 человек, входящих в состав совета, проголосовали следующим образом:

«За» - 16, «Против» - 0, «Воздержалось» - 0.

Председатель  
диссертационного совета Д 002.013.04,  
чл.-корр. РАН, д.э.н., проф.



Клейнер Георгий Борисович

Ученый секретарь  
диссертационного совета Д 002.013.04,  
д.э.н., проф.

Качалов Роман Михайлович

«27» июня 2022 г.