

В диссертационный совет
ФГОБУ «Финансовый университет при
Правительстве Российской Федерации»
Д 505.001.111 по защите диссертаций на
соискание ученой степени кандидата наук, на
соискание ученой степени доктора наук

ОТЗЫВ

на автореферат диссертации Кораблева Юрия Александровича на тему:
«Емкостный метод анализа редких событий в экономике»,
представленной на соискание ученой степени доктора экономических наук по
специальности 5.2.2 Математические, статистические и инструментальные методы в
экономике (экономические науки)

Соглашаясь со справедливым утверждением автора на 3 странице автореферата о том, что способность анализировать и предсказывать будущие события всегда имела и будет иметь большое значение в деятельности любого любой организации, включая государственные органы управления, можно сделать вывод, что выбранное направление исследования является крайне интересным. С учетом отсутствия эффективных методов для анализа и прогнозирования редких событий в экономике тема диссертационного исследования является актуальной.

Объектом исследования являются редкие события и методы их анализа и прогнозирования. Целью исследования является разработка метода анализа и прогнозирования редких событий в экономике, базирующегося на рассмотрении событий с точки зрения процессов, протекающих внутри источников этих событий и приводящих к образованию этих событий. Предметом исследования являются процессы, протекающие в источниках редких событий, способы моделирования и восстановления их параметров. Поставленные в работе задачи задают правильную логику проводимого диссертационного исследования, благодаря которой достигается его цель.

Разработан метод анализа и прогнозирования редких событий в экономике, который базируется на использовании информации о процессах образования этих событий. Для процессов, схожих с наполнением/опустошением некоторых материальных или нематериальных емкостей, с помощью метода слайновой коллокации со штрафом на шероховатость восстанавливаются параметры такого процесса по наблюдаемым с погрешностью функционалам. Восстановленные параметры процесса экстраполируются на будущее определенным способом, а затем используются при моделировании самого процесса образования событий для получения прогноза будущих моментов времени возникновения новых событий и соответствующих им искомых количественных значений. Описанный в диссертационной работе подход, методы и модели являются оригинальными, несомненно, обладают свойством научной новизны.

Разработанный автором подход по представлению процесса образования событий в виде алгоритмической модели, а также метод, восстанавливающий неизвестные

параметры этих алгоритмических моделей процесса, представляет научный и практический интерес, обладает несомненным высоким потенциалом для дальнейшего развития.

В работе произведено изучение множества российских и зарубежных источников, произведено сравнение нового разработанного метода с существующими аналогами, которые в основном ограничиваются статистическими методами, показано превосходство предложенного автором метода. Сами результаты исследования опубликованы в достаточном количестве рецензируемых российских и зарубежных научных журналах, апробированы на множестве конференций, круглых столах, научных семинарах.

Отмечая ценность полученных автором результатов, автору следует обратить внимание на некоторые замечания по работе:

1. На странице 23 автореферата приводится формула (4) представления сплайна через значения и значения второй производной. Хотелось бы узнать подробнее преимущество именно такого представления. Почему не в виде привычных кусочков полиномов?

2. Аналогично на странице 39 автореферата. Не было бы проще и понятнее получать те же функционалы от знакомых полиномов вместо использования представления по формуле (4)?

Указанные замечания носят больше рекомендательный характер и не влияют на общую оценку выполненной работы.

Подводя итоги вышесказанному, констатируем, что диссертационная работа на тему «Емкостный метод анализа редких событий в экономике» соответствует критериям пункта 9 «Положения о присуждении ученых степеней», утвержденного Постановлением Правительства Российской Федерации от 24.09.2013 № 842, а ее автор Кораблев Юрий Александрович заслуживает присуждения ученой степени доктора экономических наук по специальности 5.2.2. Математические, статистические и инструментальные методы в экономике (экономические науки).

Доцент кафедры статистики и
математических методов в управлении
Института технологий управления
МИРЭА - Российского технологического университета
к. экон. н., доцент

Ольга Анагольевна Золотарева

«04» мая 2023 г.

Москва, Пр-т Вернадского, д. 78, 119454

Телефон: +7 499 215 65 65 доб.: 1131

E-mail: darda@mirea.ru

Под
удоч

Специалист
Управления

ИГ

ЕВА

МОСКВА