

Отзыв

на автореферат диссертации Юрченко В.Э. на тему: «Хеджирование рисков российских компаний с использованием инструментов биржевого сектора международного финансового рынка», представленной на соискание ученой степени кандидата экономических наук по специальности 5.2.5 – Мировая экономика

В текущих геополитических и внешнеэкономических условиях особую необходимость приобретает поиск новых инструментов хеджирования финансовых и валютных рисков участников российского биржевого рынка. Поэтому проведенное автором диссертации исследование с особым акцентом на финансовые риски компаний реального сектора экономики отличается, по нашему мнению, высокой актуальностью.

Как следует из содержания представленного автореферата диссертации, в рамках исследования проведен глубокий анализ обширного объема информации - научного, нормативного, статистического, публицистического характера, что позволило автору сформулировать признаки финансиализации мировой экономики и доказать обострение проблемы финансовых рисков компаний реального сектора.

Высокую методическую ценность с точки зрения практического использования результатов исследования имеют разработанные автором прикладной алгоритм управления риском и корпоративная концепция риск-менеджмента, которая включает в себя методы управления рисками, алгоритмы передачи риска и этапы хеджирования финансовых рисков. Проведенное автором во второй главе сравнение методов оценки финансовых рисков позволило доказать оптимальность применения модели VaR. При этом автором представлено обоснование этого подхода, а в третьей

главе приведены расчеты и предложены соответствующие метрики. Достоверность полученных результатов, высокий теоретический и практический уровень диссертационного исследования не вызывают сомнения.

Результаты исследования подкреплены публикациями автора в рецензируемых научных изданиях списка ВАК Минобрнауки РФ.

С учетом вышеизложенного на основании автореферата можно сделать вывод, что диссертация Юрченко В.Э. соответствует требованиям, которые предъявляются к диссертациям на соискание ученой степени кандидата наук, а ее автор заслуживает присуждения ученой степени кандидата экономических наук по специальности 5.2.5 – Мировая экономика.

Начальник Информационно-аналитического отдела
Межгосударственного банка,
к.э.н., доц.

Хомякова Любовь Игоревна

09.02.2023

Подпись Хомяковой Л.И. заверяю.

Межгосударственный банк
115162, Москва, ул. Шухова, 15
Тел.: +7 (495) 228-3100
e-mail: info@isbnk.org