

В диссертационный совет ФГОБУ ВО «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**

Выбранная тема диссертационного исследования является актуальной, так как разработка новых математических методов анализа и прогнозирования является важной задачей, особенно если это касается редких событий в экономике. Как отмечается на странице 3 автореферата диссертации, действительно трудно переоценить возможность предсказывать будущие события. Какими бы события ни были, положительными или отрицательными, возможность подготовиться к ним бесценна.

В диссертационной работе автором предлагается новый подход к исследованию событий. Вместо того, чтобы строить лишь статистические модели появления событий, автор предлагает исследовать процессы

образования событий в каждом отдельном источнике событий. Для событий, образованных процессом потребления, автор разработал математический метод восстановления параметров этого процесса по имеющейся выборке редких событий. Определив параметры и выявив закономерность их изменения со временем, можно предсказать моменты появления будущих событий, образованных исследуемым процессом в источнике событий. На продемонстрированных примерах наглядно раскрывается суть метода и преимущество по сравнению с существующими методами. Предложенный метод анализа и прогнозирования событий является оригинальным. Разработанные в диссертационной работе положения составляют научную новизну.

В качестве замечаний можно указать следующее.

В автореферате преимущественно рассматриваются события, образованные лишь процессами опустошения или наполнения некоторой емкости, т.е. такие как процесс потребления, в то время как предложенный новый подход не ставит ограничений на процесс образования событий.

Утверждения диссертации не оформлены в виде теорем со строгим математическим доказательством. Поэтому их обоснование выглядит достаточно расплывчатым и декларативным.

Сравнение результатов проводится визуально, хотя логично было бы использовать адекватные метрики.

Также недостаточно четко описана новизна полученных результатов.

В качестве пожелания дальнейшего развития направления исследования следует обратить внимание на другие виды событий, процессы образования которых могут иметь принципиально другой характер.

Высказанные замечания носят больше рекомендательный характер и не снижают научную и практическую значимость выполненной диссертационной работы.

По представленному на изучение материалу в автореферате можно сделать вывод, что диссертация Кораблева Юрия Александровича на тему: «Емкостный метод анализа редких событий в экономике» соответствует критериям, предъявляемым к диссертационным работам на соискание ученой степени доктора наук, Положения о присуждении ученых степеней, утвержденного Постановлением Правительства Российской Федерации от 24.09.2013 № 842, а ее автор, Ю.А. Кораблев, заслуживает присуждения ученой степени доктора экономических наук по специальности 5.2.2. Математические, статистические и инструментальные методы в экономике.

Заведующий научно-учебной лабораторией
моделирования и управления сложными системами
Департамента больших данных
и информационного поиска
Факультета компьютерных наук

Доктор физико-математических наук, профессор
14 апреля 2023 г.

ФГАОУ ВО

Национальный исследовательский
университет «Высшая школа экономики»

Москва, ул. Мясницкая, д. 20,

vyorov@hse.ru


Попов Виктор Юрьевич

[у]

РОССИЙСКИЙ
УНИВЕРСИТЕТ
ИМЕНИ
СЕРГЕЯ ЯЗАНСКОГО

14.04.2023