

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: «Прогнозирование редких экономических событий с
помощью восстановления механизмов их образования»,
представленной на соискание ученой степени доктора
экономических наук по специальности 5.2.2 Математические,
статистические и инструментальные методы в экономике
(экономические науки)*

Способность анализировать и предсказывать редкие события в экономике являлась и всегда будет являться крайне необходимой для развития и выживания как организаций, так и отдельных индивидуумов. Выбранное направление исследований в диссертационной работе является важным и актуальным, поскольку получение достоверных прогнозных оценок появления событий на временной оси с помощью восстановления параметров

алгоритмических моделей образования событий может стать перспективным сегментом в современной аналитике данных.

В диссертационной работе автором разработана методология прогнозирования редких событий, которая основывается на изучении событий с точки зрения механизмов, происходящих в их источниках. В новом подходе предполагается: разделять данные событий по разным выборкам, в зависимости от того, каким механизмом они образованы; выдвигать предположение и строить модель механизма образования событий; восстанавливать неизвестные статические или динамические параметры этого механизма по имеющейся выборке событий; экстраполировать значения параметров на будущее любым подходящим способом; моделировать сам механизм с установленными значениями параметров и получать прогноз будущих событий.

В работе представлены различные примеры механизмов, основанные на процессах потребления, где события образуются в результате исчерпания запаса. В простейшей модели, использующейся в качестве сквозного примера, событием является пополнение запаса. В модели с двумя продуктами, событие появляется в результате исчерпания запаса любого из двух продуктов, в результате чего запасы обоих пополняются до максимума. В другой модели максимальный запас изменяется в зависимости от того, как быстро он израсходовался. Автор демонстрирует, как наблюдая только выборку событий, получается восстановить скорость расхода соответствующих ресурсов, максимальные и критические уровни запасов, раннее и позднее время исчерпания запаса. Экстраполировав восстановленные параметры и моделируя механизм, автор получает прогноз будущих событий. Автором разработаны как аналитические, так и численные методы восстановления параметров таких моделей механизмов. Предложена их программная реализация на языке R и Python. В последней главе автор приводит экономическое обоснование эффективности разработанного подхода.

Представленные результаты обладают научной новизной, теоретической и практической значимостью.

Следует констатировать, что выдвигаемые на защиту положения раскрывают результаты, соответствующие заявленным пунктам 11. «Компьютерные методы и программы моделирования экономических процессов», 14. «Эконометрические и статистические методы анализа данных, формирования и тестирования гипотез в экономических исследованиях. Эконометрическое и экономико-статистическое моделирование» Паспорта научной специальности 5.2.2. Математические, статистические и инструментальные методы в экономике (экономические науки).

Вместе с тем по содержанию диссертации можно сделать следующие замечания.

1) Ранее автор приводил список условий и допущений, необходимых для корректной работы нового подхода. В новой редакции автореферата этому внимание не уделяется.

2) В качестве объекта исследования заявлены экономические события, в том числе редкие, что является слишком широкой областью исследований. Возможно автору следовало бы конкретизировать объект исследования в целях доказательства эффектов практической апробации.

Указанные замечания не влияют принципиальным образом на качество представленных результатов, оценка работы положительная.

Заключение: содержание представленной к защите диссертационной работы на тему «Прогнозирование редких экономических событий с помощью восстановления механизмов их образования» имеет логическую и структурную связанность и соответствует критериям «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

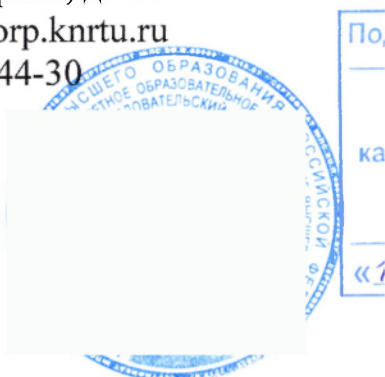
доктора экономических наук по специальности 5.2.2. Математические, статистические и инструментальные методы в экономике (экономические науки).

Заведующая кафедрой
Бизнес-статистики и экономики
Казанского национального исследовательского
технологического университета
д.э.н., доцент,

Аксянова Анна Владимировна

«13» 07 2026 г.

ФГБОУ ВО «Казанский национальный
исследовательский технологический университет»
Казань, ул. К. Маркса, д. 68
AksyanovaAV@corp.knrtu.ru
тел. +7 (843) 296-44-30



От:
утв

Ф
Вх