

В диссертационный совет Д 505.001.111
Финансового университета при
Правительстве РФ

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

Для изучения редких событий применяются статистические методы классификации, выявляющие в наблюдаемых признаках паттерны-предвестники появления событий на интервале времени, или регрессионные методы, определяющие закономерность интервалов между событиями. Данный подход сопряжен с рядом проблем: несбалансированность данных, возможная нерепрезентативность выборки из-за редкости наблюдений и, главное, возможность возникновения события до изменения признаков, что делает классификацию неприменимой. Альтернативные подходы (например, представление событий как потока со случайными интервалами, закон распределения которых требуется определить) также затруднены из-за редкости событий, мешающей эффективной оценке распределения. Кроме того, предположение о случайности экономических событий является дискуссионным. Следовательно, актуальна разработка новой методологии

анализа редких событий в экономике на основе алгоритмических моделей механизма их возникновения и оценки параметров.

Диссертационная работа Кораблева Ю.А. посвящена: разработке методологии прогнозирования редких событий в экономике, базирующейся на использовании информации о механизмах образования редких событий, составлении алгоритмических моделей, решении обратной задачи восстановления их параметров по выборке событий, экстраполяции параметров на будущее и прогнозировании событий с помощью моделирования механизма. Для восстановления параметров таких моделей автор предлагает использовать методы сплайновой коллокации в качестве аналитического решения, и методы численной оптимизации для сложных моделей, для которых аналитическое решение не подходит.

Автором разработаны соответствующие алгоритмы, составлена их программная реализация на языках программирования R и Python, предложены метрики качества оценки результатов прогнозирования дискретных событий, предложены способы проверки адекватности получающихся моделей, проведено сравнение с современными существующими методами.

В качестве замечания следует указать следующее. На странице 25 автореферата в формуле 8 представлены выражения с матрицами, однако как заполняется каждая матрица указано смотреть в самой диссертационной работе, что затрудняет восприятие материала.

Указанное замечание не носит принципиального характера

По автореферату можно сделать вывод, диссертация Кораблева Юрия Александровича на тему: «Прогнозирование редких экономических событий с помощью восстановления механизмов их образования» соответствует требованиям, 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 заслуживает присуждения ученой степени доктора экономических наук по специальности 5.2.2. Математические, статистические и инструментальные методы в экономике.

И.о. заведующего кафедрой «Управление высокотехнологичными предприятиями» федерального государственного автономного образовательного учреждения высшего образования «Московский авиационный институт (национальный исследовательский университет)»

доктор экономических наук, профессор

Н.С. Ефимова

«10» июля 2026 г.

Подпись Ефимовой Натальи Сергеевны заверяю.

Заместитель начальника отдела кадров

М.А. Иванов

ФГАОУ ВО «Московский авиационный институт (национальный исследовательский университет)»
125993, Москва, Волоколамское шоссе, д. 4,
efimova_ns@mail.ru, +7 (916) 184-43-17

у

Ф
В
«

Г
л.
г.