

ОТЗЫВ

на автореферат диссертации Федосовой Маргарита Николаевны «Разработка метода анализа и прогнозирования финансовых временных рядов фондового рынка в условиях нестабильной экономики» представленную на соискание ученой степени кандидата экономических наук по специальности 08.00.13 – математические и инструментальные методы экономики (экономические науки)

Диссертационная работа Федосовой Маргариты Николаевны посвящена исследованию перспектив развития инструментального аппарата анализа и прогнозирования поведения фондовых рынков, выявлению причин неэффективности традиционных подходов и разработке новых более эффективным методов для решения данных задач. Именно доказанная неэффективность классических методов прогнозирования динамики рынков ценных бумаг в периоды нестабильной, кризисной экономики, черты которой на протяжении нескольких последних лет довольно активно проявляются как на национальных, так и, в целом, на мировом финансовом рынке, определила направление диссертационного исследования.

Целью исследования явилась разработка метода анализа и прогнозирования финансовых временных рядов, эффективность которого была бы выше в сравнении с классическими методами при использовании в условиях макроэкономической нестабильности. Для достижения поставленной цели автор использовал большое многообразие современных методов исследования как традиционных, так и специфических методов нелинейной динамики, в том числе методы теории хаоса.

С учетом всего вышесказанного, можно сделать вывод об актуальности выбранных в диссертации объекте, предмете, цели исследования, актуальности разработки экономико-математических методов для прогнозирования динамики рынков ценных бумаг в условиях нестабильной экономики.

Наибольший интерес представляет разработанный автором метод анализа и прогнозирования динамики цен финансовых инструментов фондового рынка в условиях нестабильной экономики, который не только способствует приращению научного знания, но также и обладает бесспорной практической значимостью. При этом, стоит отметить, и перспективы применения авторского метода не только для финансовых временных фондового рынка, но и для других систем, описываемых временными рядами.

Достоверность результатов диссертационного исследования можно считать подтвержденной, автор не только представил обоснованные аргументы, логичные умозаключения, но также и апробировал разработанный метод, прогнозируя динамику российского и американского фондовых рынков при различных условиях экономической среды, в итоге доказав его высокую эффективность.

Однако представленный автореферат диссертационной работы не лишен недостатков:

1. Описывая 4 задачу исследования (стр.19), автор пишет, что в результате сравнительного анализа программных продуктов сформирован пакет программ для проведения дальнейшего исследования, но не указывает наименования данного ПО.

2. На стр.21 автореферата указано «5. Проведен эксперимент, результаты которого подтвердили выдвинутую автором гипотезу о значимости величины старшего показателя Ляпунова ...», однако нигде по тексту не пояснено что явилось предпосылками для выдвижения автором данной гипотезы.

Тем не менее высказанные замечания не снижают научной ценности работы, а автореферат достаточно полно отражает ее основные результаты.

Работа выполнена в соответствии с Паспортом специальности 08.00.13 «Математические и инструментальные методы экономики

(экономические науки)»: п.1.1 Разработка и развитие математического аппарата анализа экономических систем: математической экономики, эконометрики, прикладной статистики, теории игр, оптимизации, теории принятия решений, дискретной математики и других методов, используемых в экономико-математическом моделировании; п.1.6. Математический анализ и моделирование процессов в финансовом секторе экономики, развитие метода финансовой математики и актуарных расчетов и соответствует требованиям, предъявляемым к диссертациям на соискание ученой степени кандидата экономических наук. Федосова Маргарита Николаевна достойна присвоения ученой степени кандидата экономических наук по специальности 08.00.13 «Математические и инструментальные методы экономики (экономические науки)».

Заведующий кафедрой информационной безопасности и прикладной информатики факультета информационных систем в экономике и юриспруденции ФГАОУ ВО "Майкопский государственный технологический университет", доктор экономических наук, доцент, специальность 05.13.10 - Управление в социальных и экономических системах (экономические науки)

 С.Г. Чефранов

Личную подпись Чефранова С.Г. заверяю

Ученый секретарь
ученого совета
канд. истор. наук, доц.



С.Т. Чамокова

Чефранов Сергей Георгиевич, доктор экономических наук, доцент
Адрес: 385000, Республика Адыгея, г. Майкоп, ул. Первомайская, 191
ФГАОУ ВО "Майкопский государственный технологический университет"
Телефон: 8 (8772) 57-00-11
E-mail: kafedra.ibpi@gmail.com