

ОТЗЫВ

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

Актуальность темы диссертационной работы, посвященной вопросам разработки экономико-математического метода анализа и прогнозирования временных рядов, генерируемых системой фондового рынка, в условиях нестабильной экономики достаточно обоснована и не вызывает сомнений. Актуальность практического решения, приведенного в автореферате диссертационного исследования обусловлена следующими факторами: 1) неэффективностью традиционных подходов к прогнозированию динамики рынков ценных бумаг в быстроизменяющихся современных условиях; 2) развитием технических и программных средств, позволяющих применять нелинейные методы для прогнозирования цен финансовых инструментов.

Автор формулирует соответствующие теме цели и задачи исследования, связанные с разработкой нового метода анализа и прогнозирования финансовых временных рядов фондового рынка, позволяющего более эффективно прогнозировать динамику цен финансовых инструментов в условиях нестабильной экономики.

Работа содержит элементы научной новизны, наиболее существенные из которых: сгенерированный автором новый термин «финансовая антиинфекция» - снижение количества и силы связей между фондовыми рынками в результате наступления неблагоприятного события, происшедшего в одной стране или группе стран; результаты эксперимента, в ходе которого доказана краткосрочная устойчивость старшего показателя Ляпунова эволюционного финансового временного ряда, что в последствии послужило основой для разработки авторского метода анализа и прогнозирования динамики рынка ценных бумаг в условиях макроэкономической нестабильности.

Следует отметить приверженность автора избранной теме исследования, подтвержденную публикациями и выступлениями на научно-практических конференциях различных уровней.

Вместе с тем, судя по автореферату, работа не лишена недостатков.

1.Автором в ходе исследования проводится анализ финансовых временных рядов на наличие хаотических свойств, в частности «...финансовых

временных рядов, представляющих собой ежедневные максимальные значения индекса МІСЕХ...». Стоило пояснить почему автором выбрана именно эта частота временного ряда и что побудило его анализировать именно максимальные значения, а не, например, средние?

2.В автореферате наиболее полно представлена практико-прикладная часть диссертационного исследования, а результаты, отражающие приращение теоретического знания представлены довольно скупо.

Отмеченные замечания не носят концептуального характера и не снижают общее положительное мнение о диссертационной работе, которая представляет собой самостоятельное, законченное научное исследование, имеющее новизну, теоретическое и практическое значение.

Диссертационная работа отвечает требованиям, предъявляемым к кандидатским диссертациям ВАК России, соответствует паспорту специальности 08.00.13 – Математические и инструментальные методы экономики: 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. Автор, Федосова Маргарита Николаевна, заслуживает присуждения ученой степени кандидата экономических наук по специальности 08.00.13 – Математические и инструментальные методы экономики (экономические науки).

ИО заведующего кафедрой программной инженерии
ФГБОУ ВО «Государственный университет управления»,
доктор экономических наук,
кандидат технических наук, профессор
(научная специальность 08.00.13 Математические
и инструментальные методы экономики
(экономические науки))



Терелянский Павел Васильевич

24 января 2018г.

Контактная информация:

Россия, 109542, Москва, Рязанский проспект, 99
Тел/факс: +79629524673
e-mail: tereliansky@mail.ru