

Отзыв

на автореферат диссертации Федосовой Маргариты Николаевны на тему «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)

Рынок ценных бумаг – сложная, динамическая и вероятностная система, доказанная нелинейность процессов, протекающих в ней, служит стимулом для исследования новых путей и возможностей для анализа и прогнозирования её поведения. В данном контексте представленное исследование обладает неоспоримой актуальностью, так как, несмотря на развитость концептуальных подходов к анализу фондового рынка как нелинейной системы, на данный момент не предложены конкретные методы и алгоритмы, способные не только показывать большую эффективность в сравнении с классическими методами прогнозирования динамики финансовых инструментов, но также и быть доступными широкому кругу лиц для использования в своей профессиональной деятельности.

Целью диссертационного исследования Федосовой М.Н. являлась разработка метода анализа и прогнозирования финансовых временных рядов рынка ценных бумаг адаптивного к использованию в условиях нестабильной экономики. Автором успешно решены задачи анализа существующих предпосылок к развитию методического инструментария анализа и прогнозирования динамики фондовых рынков, выявления несовершенств в сложившихся подходах к анализу рынков ценных бумаг и разработки нового экономико-математического метода прогнозирования цен финансовых инструментов фондового рынка.

Особый интерес вызывает предложенный автором метод, базирующийся на принципах и методах теории хаоса, предполагающий рассмотрение фондового рынка как динамическую хаотическую систему, результативность которого доказана при прогнозировании динамики биржевых индексов российского и американского рынков ценных бумаг.

Не вызывает сомнения практическая значимость, а также достаточная апробация и полнота публикаций основных результатов проведенного автором исследования.

К замечаниям можно отнести:

1. Автор применяет несколько методов для определения размерности пространства вложения исследуемых систем фондового рынка, но в дальнейшем использует размерность, вычисленную методом ложных ближайших соседей. Требуется более детальное объяснение почему автор ориентируется на результаты только данного метода.

2. Одна из задач исследования, выделенная автором: «обосновать возможность и выявить перспективы применения методов теории хаоса для анализа и прогнозирования состояния рынка ценных бумаг...». В автореферате представлены аргументы автора, подтверждающие возможность применения методов теории хаоса для анализа и прогнозирования фондового рынка, но не отражены перспективы их применения.

Приведенные замечания не влияют на положительную оценку диссертационного исследования, содержание которого раскрыто в автореферате.

Диссертация «Разработка метода анализа и прогнозирования финансовых временных рядов фондового рынка в условиях нестабильной экономики» соответствует п.9 «Положения о порядке присуждения ученых степеней», а автор – Федосова Маргарита Николаевна – достойна присуждения искомой ученой степени кандидата экономических наук по специальности 08.00.13 – Математические и инструментальные методы экономики (экономические науки).

Старший преподаватель кафедры
информационных технологий и
моделирования экономических процессов
ФГБОУ ВО «Дагестанский государственный
университет», кандидат экономических наук,
(научная специальность – 08.00.13 Математические
и инструментальные методы экономики
(экономические науки))


Касимова Таиса Маллаевна

02 февраля 2018г.

Контактная информация:

367000, Россия, Республика Дагестан, г. Махачкала, ул. Гаджиева, д. 43-а

Тел.: (8722) 68-23-26, 8-989-664-39-85

e-mail: taisa.kasimova@mail.ru

