

Отзыв
на автореферат диссертации Кривоносовой Екатерины Константиновны
«Разработка методов прогнозирования и анализа кредитных и
инвестиционных рисков с применением фрактальных и
мультифрактальных характеристик», представленной на соискание
учёной степени кандидата экономических наук

Актуальность темы исследования

Несмотря на многочисленные макроэкономические и глобальные меры воздействия на мировые финансовые рынки, а также и на отраслевые процессы кредитования и инвестирования, их нестабильность увеличивается.

Во многом это связано с неполной адекватностью средств воздействия на подобные процессы, не учитывающих их существенную фрактальную и мультифрактальную природу. Специалистами предполагаются попытки учесть это обстоятельство, но достигнутое продвижение пока не является достаточным. С этой точки зрения диссертационное исследование Кривоносовой Е.К., ставящее своей целью исследование фрактальных и мультифрактальных характеристик инвестиционных процессов является востребованным и актуальным.

Основные научные результаты исследования, их новизна и значимость

Можно выделить следующие результаты исследования:

1. Предложен метод оценки фрактальных характеристик временного ряда, не требующий большого числа измерений и в этом плане смысле более универсальный, чем принятый в настоящее время R/S - метод.

2. На основе использования свойств фрактальной размерности временного ряда предложено практически значимое понятие фрактальной стабильности предприятия.

3. Показатель фрактальной размерности использован для определения пороговых констант, характеризующих эффекты, связанные с памятью процесса, описываемого временным рангом, что позволяет делать обоснованные выводы о стабильности или нестальности экономического процесса.

4. Предложен подход, основанный на расчете показателя Гёльдера для определения критических точек при принятии инвестиционных и кредитных решений.

5. Осуществлено инструментальное оформление предложенных показателей и алгоритмов.

Все перечисленные характеристики научного вклада автора отличаются как новизной, так и прикладным значением.

Замечания по содержанию автореферата работы

1. Несколько некорректным является то, что цель работы определена во второй главе, а не раньше. Как правило, цель работы определяется в конце обзорно-аналитической первой главы, когда становится ясно, в чем несовершенство имеющихся подходов и методик.

2. Из текста автореферата не видно участвует ли в методике автора фактор масштаба экономической системы. Катастрофы в малых и больших системах имеют разные последствия для народного хозяйства. Это надо иметь ввиду, в том числе и при прогнозах и расчете упреждающих индикаторов.

Заключение

Считаю, что судя по автореферату, диссертационная работа Кривоносовой Е.К. соответствует требованиям, предъявляемым ВАК к кандидатским диссертациям. Кривоносова Е.К. заслуживает присуждения искомой степени по специальности 08.00.13.

Рецензент:

д. э. н., профессор,
профессор кафедры «Экономика
и менеджмент» Глазовского инженерно-
экономического института
Ижевского государственного технического
Университета имени М.Т. Калашникова
Заслуженный деятель науки
Удмуртской Республики



Л.А. Дедов

дом. адрес рецензента: 427622, г. Глазов, Глазовского, д.31, кв. 23.

дом. тел. 8(34141)3-61-62

сот.тел. 8-912-469-21-26

рабочий адрес: Глазовский инженерно-экономический институт (филиал) ФГБОУ ВПО «Ижевский государственный технический университет имени М.Т. Калашникова», ул. Кирова, 36.

раб. тел. 8(34141)5-34-09

e-mail: gfi@gfi.edu.ru

доктор экономических наук по специальности 08.00.05

кандидат экономических наук по специальности 08.00.13

07.09.2015