

ОТЗЫВ

на автореферат диссертационной работы 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 по специальности 08.00.13 – «Математические и инструментальные методы экономики»

Актуальность темы диссертационной работы определяется особым вниманием в условиях сложившейся нестабильной экономической ситуации к теме прогнозирования рисков и идентификации показателей, определяющих степень стабильности организаций и возможности наступления кризисных явлений в экономических системах: банковский сектор нуждается в улучшении качества прогнозов относительно деятельности текущих и будущих заемщиков, а также отраслей в целом. Вопрос прогнозирования кризисных явлений по показателям и котировкам на финансовых рынках остается открытым.

Целью исследования автор ставит расширение функциональных возможностей инструментальных методов анализа степени стабильности предприятий и прогнозирования критических состояний экономических систем, для достижения данной цели использованы инструменты и понятия теории фракталов, приведена четкая аргументация выбранных подходов для решения конкретных задач. Стоит отметить, что фрактальная теория и ее инструменты сравнительно недавно используются в сфере экономики, в частности для оценки рисков.

Диссертационная работа содержит элементы научной новизны, к наиболее значимым можно отнести:

- введение автором понятия фрактальной стабильности предприятия, его определение и выделение критериев оценки предприятия на основе значения характеристики стабильности - фрактальной размерности;
- разработка методики идентификации критических точек рядов котировок на основе показателя гладкости, позволяющей прогнозировать точки смены тренда, резких скачков и падений исходного ряда;
- разработка программного комплекса, представляющего собой систему поддержки принятия решений с учетом экономических рисков, который предназначен для принятия инвестиционных и кредитных решений.

Несомненна и определенная практическая значимость результатов диссертационной работы: внедрение авторских методик в системе ОАО «Сбербанк России» подтверждает востребованность проведенного автором исследования.

Теоретические положения, отражающие основные результаты исследования, отражены в 10 работах, 4 из которых опубликованы в изданиях, входящих в список ведущих рецензируемых научных изданий,

рекомендованных ВАК для публикации результатов докторских и кандидатских диссертационных работ.

Тем не менее, по работе можно выделить следующее замечание: возможно, стоило рассмотреть результаты анализа стабильности предприятий не только в нефтесервисной отрасли, как показано в автореферате, но и в других отраслях.

Автореферат и научные публикации автора позволяют сделать вывод о том, что диссертация является законченным научно-исследовательским трудом, выполненным автором на высоком научном уровне. Диссертационная работа отвечает требованиям, предъявляемым к кандидатским диссертациям, а ее автор – Кривоносова Екатерина Константиновна – заслуживает присуждения степени кандидата экономических наук по специальности 08.00.13 – «Математические и инструментальные методы экономики».

Д.э.н., профессор,
Заместитель директора Бизнес-школы,
Директор МВА-Центра Бизнес-школы
Уральского федерального университета,
Заведующая кафедрой
Стратегического менеджмента



Л.А. Малышева

Подпись Малышевой Ларисы Анатольевны заверяю

Заверяю
Менеджер по персоналу

да
нет

Адрес: 620002, г. Екатеринбург, ул. Мира, 19
ФГАОУ ВПО «Уральский федеральный университет
имени первого Президента России Б.Н. Ельцина»
Тел.: +7 (343) 374-04-00