В диссертационный совет по экономике НИУ ВШЭ

ОТЗЫВ
на диссертацию Фантаццини Деана
«Моделирование и прогнозирование одномерных и многомерных временных рядов с использованием данных Google и копул» (Modelling and forecasting univariate and multivariate time series using Google data and copulae), представленную на соискание ученой степени доктора экономических наук

Рассматриваемая диссертационная работа сформирована на основе 20 публикаций автора, вышедших с 2008 по 2020 годы в журналах, индексированных в Scopus, причем значительная часть статей опубликована в журналах с квартилями Q1-Q2 Scopus, а также в монографии 2019 года. Таким образом, требования Диссертационного совета по экономики НИУ ВШЭ к защите диссертации по опубликованным работам выполняется.

Резюме диссертации представлено на русском и английском языках и отражает содержание опубликованных работ, а также основные результаты, полученные в результате исследований автора.

Работа посвящена актуальной тематике, имеющей как научное значение, так и практическую целесообразность. Она отражает как теоретическую направленность работы на формирование математических моделей одномерных и многомерных временных рядов различной природы с использованием технологии BigData, основанной на возможностях Google Trends и аппарата моделей копул, так и практическую экономико-финансовую направленность исследований, ориентированных на различные аспекты деятельности и анализа финансовой устойчивости в различных регионах мира.

Основными компонентами работы, имеющими научную новизну и значимость, по мнению рецензента являются:

- адаптация возможностей, выделение достоинств и реализация практического потенциала технологии Google Trends для решения финансово-экономических задач широкого назначения;
- сравнительный анализ, обзор достоинств, а также выделение практических возможностей моделирования многомерных распределений с использованием копула – функций, в том числе применительно к оценке операционных рисков, а также прогнозированию экономического состояния, финансовых пузырей и устойчивости на финансовых рынках;
- отраслевое прогнозирование применительно к ряду отраслей обрабатывающей промышленности и добычи полезных ископаемых ряда стран, в том числе и России.

К достоинствам работы, по моему мнению, можно отнести следующие моменты:

- наличие практической направленности разработанных моделей и решений;
- высокий уровень журналов, в которых опубликованы основные работы автора;

- охват значительного числа стран – Россия, США, Германия и др.;
- апробация результатов, моделей и подходов на ряде отраслей экономики;
- наличие потенциала развития полученных результатов;
- доведение разработанных положений до программного кода и потенциального внедрения;
- широкая информационная основа проведенных работ.

Хотелось бы также отметить значимость работ Деана Фантацинни для развития образовательного поля как источников для построения учебных курсов и проведения научно-исследовательских семинаров для магистров и аспирантов.

Обоснованность научных положений, выводов и рекомендаций, сформулированных в диссертации, их достоверность и новизна, по моему мнению, сомнения не вызывают.

Естественно работа не лишена недостатков. Но такие недостатки, как опечатки в резюме (по крайней мере, на русском языке) вряд ли стоит отмечать для докторской диссертации. А наличие потенциальных областей использования полученных результатов или их развития на другие приложения трудно отнести к недостаткам работы, защищаемой по совокупности публикаций.

Поэтому я предпочту перейти к завершающей части отзыва, отметив в заключение, что работа выполнена на очень хорошем уровне, приведенные публикации свидетельствуют о высоком научном потенциале соискателя.

Считаю, что диссертация носит законченный характер, отвечает всем требованиям Положения о присуждения учёных степеней в Национальном исследовательском университете «Высшая школа экономики», а её автор, Фантаццини Деан, заслуживает присуждения учёной степени доктора экономических наук.

Профессор-исследователь школы финансов ФЭН НИУ ВШЭ,

д.э.н., д.т.н., профессор,

член комитета по защите диссертации А.М. Карминский

e-mail: akarminsky@hse.ru 13.05.2020

Тел. +7(495)772-9590, доб. 27420.

Москва, НИУ ВШЭ,

Покровский бул. 11, каб. S637.