

ОТЗЫВ
на выпускную квалификационную работу
аспиранта Ледовской Вероники Александровны
Исследование мер риска в теории принятия решений

Исследование методов количественной оценки риска и предпочтений лиц принимающих решения в теории принятия решений является актуальной задачей нашего времени. Развитие данной теории позволяет создавать новые методы оценки и управления рисками, которые применяются на практике специалистами различных областей.

Ледовская Вероника Александровна в данной работе исследовала концепции оценки риска: аппарат мер риска, метод ожидаемой полезности и принцип стохастического доминирования, а также методы оценки интенсивности предпочтений. В работе проанализированы на когерентность меры рисков и их применение к эмпирическим данным. Изучена и описана взаимосвязь данных концепций. Найдены условия, накладываемые на функцию полезности мерами рисков. Так же автором была найдена и доказана взаимосвязь степеней рисковости и производных функции полезности, что позволяет применять понятие степени рисковости в методе ожидаемой полезности. Проведена работа по сравнению результатов применения трех концепций в условиях разных степеней рисковости и вне данных условий. Исследованы методы оценки интенсивности предпочтений с помощью функции полезности, предложены новые способы ранжирования предпочтений по интенсивности.

Замечания: в исследовании не освещается связь мер рисков и порядков рисков, соотношение интенсивности предпочтений и мер рисков.

Ледовская В. А. выполнила большую теоретическую и практическую научно исследовательскую работу, в которой проявила самостоятельность, инициативность и рассудительность.

Выпускная квалификационная работа Ледовской В. А. заслуживает оценки

« **отлично** »

Научный руководитель,

профессор д.ф.-м.н.

/Колбин В.В./



1.06.2018г.