

РЕЦЕНЗИЯ
выпускной квалификационной работы
аспиранта Ледовской Вероники Александровны
Исследование мер риска в теории принятия решений

В нашей стране теория принятия решений получила не настолько интенсивное развитие, как за рубежом. Исследования в области принятия решений в условиях риска являются актуальными на сегодняшний день.

В диссертации исследованы концепции ожидаемой полезности, стохастического доминирования, мер риска и интенсивности предпочтений. Данные концепции принадлежат разным математическим аппаратам. Ледовская В.А. изучила и описала взаимосвязь данных концепций. Так ею была найдена и доказана взаимосвязь степеней рисковости и порядков неприятия риска лицом принимающим решение. В работе исследованы на когерентность меры рисков и их применение к эмпирическим данным, что было использовано позднее в работе. На основе данного исследования концепций, проведена работа по сравнению результатов применения трех концепций в условиях разных степеней рисковости и вне данных условий. Отдельным блоком проведено исследование интенсивности предпочтений, предложены новые способы оценки интенсивности, доказана возможность использования порога принятия решения. Использование предложенных Ледовской В.А. характеристик для оценки интенсивности продемонстрировано на практических примерах.

Замечания. Не освещается связь исследованных в работе мер риска и интенсивности предпочтений.

Выпускная квалификационная работа Ледовской В. А. заслуживает оценки «отлично».

Рецензент,
к.ф.-м.н, директор ЦПИ ФГАОУ ВО «СПбПУ»
/Козырев С.В./

