

ОТЗЫВ

на автореферат диссертации Барышевой Александры Евгеньевны «Модель, методика и программное обеспечение для формирования портфеля ценных бумаг в условиях ограниченной выборки» на соискание ученой степени кандидата технических наук по специальности 05.13.18 – Математическое моделирование, численные методы и комплексы программ

Тематика диссертации Барышевой А.Е. представляет научный интерес и является актуальной в научном плане и практическом отношении. Как справедливо утверждает диссертант, финансовый рынок России отличается от мировых рынков и требует для своего анализа особых подходов, учитывающих его специфику.

Вопросы, рассмотренные в диссертационном исследовании, имеют ценность с практической точки зрения формирования портфеля ценных бумаг. Актуальным является предложение диссертанта по разработке модели, методики и программного обеспечения для формирования портфеля ценных бумаг в условиях ограниченной выборки, что нередко наблюдается на российском рынке ценных бумаг, где в большинстве преобладают средние и низколиквидные активы.

Особую ценность представляет реализованный диссертантом комплекс программ, позволяющий осуществить подбор совместного вероятностного распределения к наблюдаемым данным о доходностях портфеля в автоматическом режиме, а также получить оценку корреляции интервальных временных рядов доходностей активов.

Отмечая положительные стороны диссертации Барышевой А.Е., по тексту автореферата можно выделить следующие замечания:

1. На стр.18 в тексте «В таблице 7 представлено сравнение основных характеристик, которые демонстрировали портфели на протяжении интервала для тестирования» и на стр. 19 в тексте «Как видно из таблицы 7, самую высокую доходность в 22% за 10 месяцев показал Портфель 3» должна быть ссылка на таблицу 6.

2. В рамках автореферата автор не дает определение понятиям «долгосрочная корреляция», «рыночный шум».

В целом работа является законченной и выполнена автором на достаточно научном уровне, представленные в автореферате результаты достоверны, выводы и рекомендации обоснованы. Достигнутые научные результаты, отраженные в автореферате, позволяют заключить, что диссертация Барышевой Александры Евгеньевны представляет собой самостоятельное и оригинальное исследование на актуальную тему, а автор заслуживает присуждения степени кандидата технических наук по специальности 05.13.18 – «Математическое моделирование, численные методы и комплексы программ».

Д.т.н., профессор,
главный научный сотрудник
лаборатории № 80
«Киберфизические системы»
ИПУ РАН

Мещеряков Роман Валерьевич,

ул. Профсоюзная, 65, Москва, 117997
+7 495 198 17 20, доб. 1625
e-mail: mrv@ipu.ru



Подпись

З.А.БЕРД
ЕД. ИНЖЕНЕР
ПОВОКШЕНОВА В.С.