

## ОТЗЫВ

на автореферат диссертации Фатьяновой Маргариты Эдуардовны «Модели и система поддержки принятия решений для управления опционным портфелем структурированного продукта», представленной на соискание ученой степени кандидата технических наук по специальности 05.13.10 – «Управление в социальных и экономических системах».

В настоящее время модели и инструменты управления социально-экономическими системами имеют широкие перспективы использования для решения специализированных прикладных задач во многих отраслях. В связи с этим диссертационная работа, направленная на совершенствование моделей и разработку программного комплекса, является актуальной.

Представленные в диссертационном исследовании результаты обладают новизной и достаточно высоким уровнем научного содержания. Предложенные модификации статической и динамической моделей адаптированы к условиям биржевого рынка, что подтверждает возможность их реального применения для формирования портфелей.

Главным оригинальным отличием разработанной системы поддержки принятия решений от подобных систем является наличие возможности формирования опционных продуктов, что подтверждает высокую практическую значимость работы.

Результаты диссертации подтверждаются экспериментальными исследованиями в виде:

- 1) проведенного имитационного моделирования для 1000 экспериментов;
- 2) СППР, зарегистрированной в реестре программ для ЭВМ;
- 3) апробации формирования восьми опционных портфелей в торговом терминале Quik;
- 4) апробации на международных, всероссийских конференциях и публикациями в рецензируемых изданиях.

В автореферате имеются некоторые недостатки:

1. Не обоснован выбор торгового терминала Quik для построения опционных портфелей.

2. Для иллюстрации преимуществ разработанной системы было бы целесообразно рассмотреть большее количество различных финансовых инструментов.

Несмотря на указанные недостатки, диссертационная работа заслуживает положительной оценки.

Представленная диссертационная работа Фатьяновой М.Э. имеет научную и практическую ценность, удовлетворяет требованиям «Положения о присуждении ученых степеней», предъявляемым к диссертациям на соискание ученой степени кандидата технических наук.

Автор работы, Фатьянова Маргарита Эдуардовна, заслуживает присуждения ученой степени кандидата технических наук по специальности 05.13.10 – «Управление в социальных и экономических системах».

Сидоров Сергей Петрович,

д.ф.-м.н., доцент, зав. кафедрой теории функций и стохастического анализа механико-математического факультета Саратовского государственного университета имени Н.Г. Чернышевского



Сидоров С.П.

« 14 » мая 2021 г.

Саратовский национальный  
исследовательский государственный  
университет имени Н. Г. Чернышевского

410012, г. Саратов,  
ул. Астраханская, 83  
телефон: +7 (8452) 51 - 15 - 32  
SidorovSP@info.sgu.ru

