

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 последние десятилетия торговля на финансовых рынках распространяется быстрыми темпами, поэтому автоматизация и разработка системы поддержки принятия решений является актуальной областью приложений знаний по моделированию, проектированию приложений и методов анализа данных.

Работа Фатьяновой Маргариты Эдуардовны направлена на решение актуальной задачи в сфере принятия решения по формированию и перестроению финансового портфеля за счет применения методов стохастического программирования.

В ходе проведенного исследования автором получены следующие научные результаты:

- теоретически обосновано современное состояние проблемы развития российского рынка деривативов;
- описан подход к конструированию структурированных продуктов;
- предложены модификации статической и динамической моделей управления опционным портфелем структурированного продукта;
- создана система поддержки принятия решений, отличающаяся от подобных систем, наличием следующих модулей: построения структурированных финансовых продуктов, первоначального формирования опционного портфеля согласно статической модели, первоначального формирования и перестроения опционного портфеля согласно динамической модели, а также базы данных, хранящей рыночные показатели выбранного актива, введенные входные данные пользователем и результаты расчетов.

- проведена апробация статической и динамической моделей в торговом терминале Quik, а также реализовано имитационное моделирование процесса управления опционным портфелем.

Результаты работы имеют практическую значимость: разработанный программный продукт может быть использован профессиональными трейдерами для построения и корректировки торговой стратегии на различных финансовых рынках. Программный продукт СИПР зарегистрирован в реестре программ для ЭВМ.

В качестве замечания можно отметить, что работа содержит большое количество формул и обозначений, что затрудняет восприятие динамической модели задачи формирования и управления финансовым портфелем, представленной на страницах 9-12, а также в работе присутствует утяжеление текста сложными предложениями, что затрудняет его прочтение.

Приведенное замечание не снижает научной ценности работы. Диссертация обладает научной новизной и значимостью, соответствует требованиям Положения о присуждении ученых степеней, предъявляемым к кандидатским диссертациям. Автор работы, Фатьянова Маргарита Эдуардовна, заслуживает присуждения ученой степени кандидата технических наук по специальности 05.13.10 – «Управление в социальных и экономических системах».

Ефимова Ольга Евгеньевна

к.т.н., доцент Воронежского государственного технического университета

 Ефимова О.Е.

« 13 » июля 2021 г.

Федеральное государственное бюджетное
образовательное учреждение высшего образования
«Воронежский государственный технический
университет»

394006 г. Воронеж,
ул. 20-летия Октября, 84
Телефон: +7(473) 271-59-05
e-mail: rectorat@vgasu.vrn.ru

