

## ОТЗЫВ

на автореферат диссертационной работы

**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».

Совершенствование методов моделирования процессов принятия решений в социально-экономических системах ведет к росту прикладных исследований алгоритмов систем поддержки принятия решений в узкоспециализированных областях. Диссертационная работа посвящена актуальной задаче совершенствования моделей управления опционным портфелем. Автором описан подход к конструированию структурированных продуктов на основе приведенных модификаций статической и динамической моделей, позволяющий лицу, принимающему решение (ЛПР) самостоятельно сформировать финансовый портфель с возможностью дальнейшего его пересмотра в будущем.

Практический интерес представляет разработанная система поддержки принятия решений, которая дает рекомендации по количественному составу опционов для покупки (продажи) согласно статической или динамической моделям. Научные результаты подтверждаются публикациями и апробациями на конференциях, а также двумя регистрациями разработанных программных продуктов в реестре программ для ЭВМ.

К замечаниям по автореферату можно отнести:

1. Сравнение разработанной системы поддержки принятия решений (СППР) проведено с двумя программными продуктами Сбербанка и Банка Тинькофф. Хотелось бы увидеть в сводной таблице программные продукты других организаций.

2. Дерево сценариев изменения стоимости портфеля для 1000 экспериментов, представленное в тексте автореферата, изображено мелким шрифтом, что затрудняет возможность его прочтения.

Замечания являются некритичными и не уменьшают общей значимости диссертационной работы. Считаю, что представленная диссертационная работа является законченной научно-квалификационной работой и соответствует требованиям «Положения о присуждении ученых степеней», предъявляемым на соискание ученой степени кандидата технических наук. Автор диссертации, Фатьянова Маргарита Эдуардовна, заслуживает присуждения ученой степени кандидата технических наук по специальности 05.13.10 – «Управление в социальных и экономических системах».

к.ф.-м.н., доцент факультета экономических наук базовой кафедры инфраструктуры финансовых рынков Национального исследовательского университета «Высшая школа экономики»

Подпись заверяю

Наказываю  
по работе  
и  
Курочкин С.В.



Курочкин Сергей Владимирович

«17» Курочкин 2021 г.  
17.05.2021 г.

Федеральное государственное автономное образовательное учреждение высшего образования «Национальный исследовательский университет «Высшая школа экономики»

101000, г. Москва, ул. Мясницкая, д. 20

Телефон: +7 (495) 531-00-00 (внутр. номер 27380)

e-mail: skurochkin@hse.ru