

ОТЗЫВ

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

Портфельное инвестирование является объектом изучения многих российских и зарубежных ученых с момента появления фондового рынка. Как известно, классическая портфельная теория Марковица и ее расширения имеют ряд ограничений, которые не позволяют использовать существующие подходы в условиях российского рынка. Разработка математических моделей и подходов, способных работать в специфических условиях внутреннего рынка страны, имеет высокую степень актуальности.

На основе детального анализа существующих подходов, в диссертационной работе Барышевой А.Е. выделены две ключевые актуальные проблемы формирования и управления портфелем: оценка взаимосвязей активов портфеля в условиях ограниченной выборки и оценка влияния нарушений предположений модели динамики базовых активов на процесс ее построения и на получаемые с ее помощью целевые показатели портфеля. В рамках представленной диссертации соискателем успешно решены обе проблемы, основные результаты, полученные в диссертации, докладывались на различных всероссийских и международных конференциях, опубликовано шесть статей, в том числе четыре в журналах, рекомендованных ВАК, получено одно свидетельство о государственной регистрации программ для ЭВМ.

Практическая ценность работы состоит в разработанном авторе инструментарии построения оптимального портфеля ценных бумаг, в случае

ограниченности доступных исторических наблюдений по активам, включенным в данный портфель.

В качестве замечания можно отметить, что в работе не приводится тестирование и сравнительный анализ существующих математических моделей для описания динамики базовых активов, входящих в портфель. Однако, это скорее является пожеланием на будущее, для которого диссертация Барышевой А.Е. дает хорошую научную основу.

Содержание автореферата дает основание сделать заключение о том, что диссертационная работа Барышевой А.Е. «Модель, методика и программное обеспечение для формирования портфеля ценных бумаг в условиях ограниченной выборки» соответствует требованиям ВАК Министерства образования и науки Российской Федерации, предъявляемым к кандидатским диссертациям, в частности п.9 «Положения 3 о присуждении ученых степеней», а ее автор заслуживает присуждения искомой ученой степени кандидата технических наук по специальности 05.13.18 – «Математическое моделирование, численные методы и комплексы программ».

Доктор физико-математических наук, профессор,
заведующий кафедрой прикладной математики
ФГБОУ ВО «Новосибирский государственный
архитектурно-строительный университет (СИБСТРИН)

« 24 »_мая 2021 года

Ю.Е. Воскобойников

Адрес: 630008, Новосибирск-8, ул. Ленинградская, 113, оф. 436
Телефон: (383) 266-42-60
E-mail: voscob@sibstrin.ru
Сайт: <http://www.sibstrin.ru/struct/chair/prkl>



Воскобойников Ю.Е.
ЗАВЕРЯЮ
Начальник общего отдела ИГАСУ (Сибстрин)