

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

Повышение уровня развитости рынка ценных бумаг и производных финансовых активов, как значимой части финансового рынка страны, является одной из приоритетных задач, стоящих перед правительством Российской Федерации. Помимо активной государственной политики, направленной на оздоровление финансового сектора страны, в частности осуществления ряда стратегий, принятых в течение последних 10 лет, множество исследований российских ученых посвящены поиску новых инструментов и подходов для работы на российском фондовом рынке, обладающим определенной спецификой. Все это делает тему работы и выбранный объект исследования актуальными и востребованными.

В диссертационной работе предложен новый подход к оценке взаимосвязи финансовых активов, отличающийся возможностью его применения в условиях ограниченной выборки. Ограничение на количество доступных исторических данных – частый случай при анализе ценных бумаг на российском рынке, где в большинстве преобладают средне и низко ликвидные активы. Применение данного подхода позволяет улучшить процедуру формирования портфеля ценных бумаг, что подтверждается проведенной серией экспериментов, как на синтетических, так и на реальных данных.

Полученные в диссертационном исследовании результаты имеют научную новизну, теоретическую значимость и практическую ценность. Содержание исследования соответствует пунктам 1, 4, 6 паспорта специальности 05.13.18 – «Математическое моделирование, численные методы и комплексы программ».

Судя по публикациям автора, материал прошел достаточную апробацию на научных конференциях и выставках. По теме диссертации опубликовано шесть статей, в том числе четыре в журналах, рекомендованных ВАК, получено одно свидетельство о государственной регистрации программ для ЭВМ.

Следует отметить хороший научный стиль и логичность изложения текста автореферата. Полученные в диссертации результаты соответствуют поставленным задачам.

В то же время по автореферату имеется замечание. На стр.18 нумерация таблицы 6 не соответствует ссылаемому на нее тексту на страницах 18–19.

Несмотря на указанное замечание, следует отметить, что диссертационная работа выполнена на высоком научном уровне, посвящена актуальной теме, 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».

Зимин Валерий Викторович,
доктор технических наук, доцент,
профессор кафедры
«Автоматизация и информационные
системы» ФГБОУ ВО «Сибирский
государственный индустриальный
университет» (г. Новокузнецк)

В.В. Зимин

Верно:
Написано отцом
кадров ФГБОУ ВО «Сибирский



Миронюта С. А.
25.05.2021

zimin.1945@mail.ru

(3843) 74-88-06

ул. Кирова, 42, Новокузнецк Кемеровской области