

ОТЗЫВ

на автореферат диссертации Барышевой Александры Евгеньевны на тему «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

Диссертация А.Е. Барышевой посвящена актуальной теме – развитию фондового рынка России, а именно адаптации существующих и разработке новых математических моделей и подходов к формированию портфеля ценных бумаг на внутреннем рынке страны, который, как известно, имеет ряд особенностей, в силу небольшой, сравнительно с мировыми рынками, капитализацией. Детальный анализ существующих подходов к формированию и управлению портфелем ценных бумаг, проведенный соискателем, позволил выявить ряд ключевых проблем, существующих в данной области, и сформулировать задачи исследования, которые, насколько можно судить по автореферату, соискатель успешно решил.

Автором предложено решение актуальных в научном и прикладном отношении задач оценки взаимосвязей активов в портфеле и подбора модели динамики базовых активов, что позволяет повысить эффективность процедуры формирования инвестиционного портфеля в условиях ограниченной выборки. Наиболее значимым научным результатом работы можно отметить предложенную математическую модель корреляции доходностей активов, формирующих портфель. Результаты диссертационной работы докладывались на всероссийских и международных конференциях, а также было опубликовано шесть статей, в том числе четыре в журналах, рекомендованных ВАК, и получено одно свидетельство о государственной регистрации программ для ЭВМ.

Замечание по автореферату:

Несмотря на то, что автором было проведена серия экспериментов предложенной модели как на синтетических, так и на реальных данных российского фондового рынка и было показано существенное улучшение доходности портфеля, построенного при помощи предлагаемой модели, из содержания автореферата не очевиден выбор, сделанный автором, касательно акций, включенных в портфель для тестирования. Указанное замечание не снижает общей положительной оценки работы, выполненной на высоком научном уровне.

Считаю, что данная диссертация соответствует требованиям ВАК РФ, предъявляемым к кандидатским диссертациям, а ее автор Барышева Александра Евгеньевна заслуживает присуждения ей ученой степени кандидата технических наук по специальности 05.13.18 – «Математическое моделирование, численные методы и комплексы программ».

Профессор кафедры «Логистика и коммерческая работа» ФГБОУ ВО «Петербургский государственный университет путей сообщения Императора Александра I», д-р техн. наук, доцент

Новичихин Алексей Викторович

190031, Россия, г. Санкт-Петербург, Московский пр., д. 9, тел.: +7(812) 457-80-94,
e-mail: novichihin_av@mail.ru.

