

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.

Диссертационная работа посвящена решению проблемы совершенствования моделей формирования финансовых портфелей. Актуальность данной проблематики обусловлена повышающимся интересом к инструментам российской и зарубежной торговых площадок. В работе предлагается подход конструирования структурированных финансовых продуктов, в основе которых лежит формирование опционного портфеля. Проведенное исследование является новаторским и обладает научной новизной.

Основные теоретические аспекты изложены в первой и второй главах, посвященных современному состоянию проблемы формирования опционных портфелей, а также совершенствованию моделей формирования опционных портфелей структурированных продуктов. В двух последних главах предлагается практическая реализация в виде разработанной системы поддержки принятия решений (СППР), а также экспериментальной проверки. Положительной стороной полученных результатов работы является их практическая направленность и применение при формировании структурированных продуктов с помощью СППР. Важно подчеркнуть, что предложенная СППР позволяет формировать опционные портфели в отличие от имеющихся аналогов на российском рынке («робоэдвайзеров»).

В качестве замечания необходимо отметить, что для удобства восприятия информации конечным пользователем в интерфейс СППР следует добавить раздел, включающий описание стратегий и необходимых рыночных параметров.

Указанное замечание не снижает общей высокой оценки исследования. Диссертационная работа М.Э. Фатьяновой является завершенным исследованием и поставленная основная задача решена в рамках разработанных модификаций статической и динамической моделей и реализованных в виде программного комплекса (СППР).

Диссертация соответствует паспорту специальности 05.13.10 – «Управление в социальных и экономических системах» и полностью удовлетворяет требованиям положения о присуждении ученых степеней, утвержденным постановлением Правительства РФ от 24.09.2013 (ред. от 01.10.2018, с изм. от 26.05.2020) «О порядке присуждения ученых степеней», а ее автор Фатьянова Маргарита Эдуардовна

заслуживает присуждения ученой степени кандидата технических наук по специальности 05.13.10 – «Управление в социальных и экономических системах».

Заплетин Максим Петрович,

24.05.2021 г.

доцент кафедры общих проблем управления
механико-математического факультета
МГУ имени М.В.Ломоносова, к.ф.-м.н.
(zapletin_m@mail.ru, 8-495-939-56-32)



М.П. Заплетин