

ОТЗЫВ

на автореферат диссертации Прохоровой Марии Сергеевны
“МАТЕМАТИЧЕСКИЕ МЕТОДЫ И ИНСТРУМЕНТАЛЬНЫЕ СРЕДСТВА
ОБРАБОТКИ ИНФОРМАЦИИ В ЗАДАЧАХ УПРАВЛЕНИЯ РИСКАМИ”,
представленной на соискание учёной степени кандидата
физико-математических наук по специальности
05.13.17 – теоретические основы информатики

Оптимизационные модели принятия решения возникают при изучении процессов во многих областях человеческой деятельности, и финансовый рынок не является исключением. Анализ подобных систем можно производить на основании информационных моделей, которые могут характеризовать неточности, возникающие при формировании цели, ограничений или возможных вариантов решения. Хотя основной неопределённостью в этих задачах было и остаётся понятие критерия, а именно, целью формирования портфеля ценных бумаг может быть максимизация доходности, а может быть и минимизация риска. Хотя возможны и другие варианты работы с двухкритериальными задачами, и подходы на основании функции риска. Данные задачи исследуются достаточно давно, однако интересными остаются условия, при которых решения этих задач совпадают и принадлежат множеству паретооптимальных портфелей, а так же гарантируют устойчивость и эффективность. Именно исследованию этих задач и посвящена работа Прохоровой М. С., а потому актуальность работы не вызывает сомнений.

В первой главе диссертационной работе получены необходимые и достаточные условия принадлежности множеству паретооптимальных портфелей при решении задач минимизации дисперсии, максимизации доходности и использовании функции риска. Выбор наиболее приемлемого критерия остаётся за инвестором, поскольку именно он сам выбирает вариант решения исходя из своего отношения к риску.

Наряду с несомненной важностью результатов 1 главы диссертационной работы, на наш взгляд, результаты 2 главы особенно интересны, поскольку условие неопределённости в задачах управления риском не менее перспективное, чем условие стохастичности.

В качестве замечаний необходимо отметить следующее:

1. В автореферате только заявлено решение непрерывной минимаксной динамической задачи управления риском для некоррелированных стохастических процессов, однако не представлена сама постановка задачи и необходимые результаты.
2. Корректность и эффективность программной реализации задач управления риском не вызывает сомнения. При этом констатируется источник статистических данных и основные возможности данного программного продукта, однако из автореферата не понятно, как можно самостоятельно проверить работоспособность данного продукта.

Указанные замечания носят рекомендательный характер и ни в коей мере не снижают общей ценности проведённого диссертационного исследования. Полученные результаты вполне соответствуют уровню кандидатской диссертации по специальности 05.13.17 – теоретические основы информатики. Автореферат диссертации составлен с соблюдением установленных требований, даёт адекватное представление о работе. Основные положения проведённых исследований нашли отражение в 12 опубликованных научных трудах автора.

В итоге на основании автореферата можно сделать вывод о том, что представленное диссертационное исследование Прохоровой Марии Сергеевны отвечает требованиям п. 9 Положения о порядке присуждения учёных степеней, предъявляемым к кандидатским диссертациям, а её автор заслуживает присвоения учёной степени кандидата физико-математических наук по специальности 05.13.17 – теоретические основы информатики.

Кандидат физико-математических наук,
Доцент кафедры физики и
информационных технологий
Балашовского института (филиала)
ФГБОУ ВПО
«Саратовский государственный
университет имени Н.Г. Чернышевского»



/О.А. Кузнецов/

Кузнецова О.А. ЗАВЕРЯЮ
<i>О.А.</i> (подпись)
Кузнецова О.А. (фамилия)
" 02 " сентября 20 16 г.

Данные автора отзыва

Рабочий адрес: 412300, Саратовская область, г.Балашов, ул. Карла Маркса, 29

Рабочий телефон: +7(84545) 4-04-96

Рабочий Email: mail@bfsgu.ru

Email: oakuzn@yandex.ru