

УТВЕРЖДАЮ

и. о. директора ФИЦ ИУ РАН,

Фисн-корр. РАН

Посыпкин М. А.

2024 г.



ЗАКЛЮЧЕНИЕ

Федерального государственного учреждения
«Федеральный исследовательский центр «Информатика и управление»
Российской академии наук»

Диссертационная работа Макарова Ивана Сергеевича «Разработка методов прогнозирования точек разворота на многомерных временных рядах финансовых рынков на основе моделей машинного обучения с подкреплением», представленная на соискание ученой степени кандидата технических наук по специальности 1.2.1 – «Искусственный интеллект и машинное обучение», выполнена в отделе №13 Федерального исследовательского центра «Информатика и управление» Российской академии наук.

В период подготовки диссертации и в настоящее время соискатель ученой степени Макаров Иван Сергеевич контактировал с компанией Общество с ограниченной ответственностью «Интеллектуальные Системы Управления» в целях внедрения результатов работы.

В 2020 г. окончил Физтех-школу прикладной математики и информатики Московского физико-технического института (национального исследовательского университета) по специальности «Прикладные математика и физика». С 2020 по 2024 г. обучался в очной аспирантуре МФТИ (НИУ). В 2024 г. был прикреплен к аспирантуре ФИЦ ИУ РАН как соискатель.

Научный руководитель – д.ф.-м.н., проф. Цурков Владимир Иванович – работает в федеральном государственном учреждении «Федеральный исследовательский центр «Информатика и управление» Российской академии наук» в должности Заведующего Отделом №13 (сложных систем) ФИЦ ИУ РАН.

По итогам обсуждения было принято следующее заключение:

Актуальность темы исследования:

Разработка систем автоматизированной торговли и инвестиционных стратегий является основной задачей управляющих финансовых организаций и обычно сводится к решению задач прогнозирования показателей на многомерных финансовых временных рядах (MFTS -

