

ОТЗЫВ

научного руководителя, доктора экономических наук, профессора Чернова В.П.

о диссертации Добриной Марии Валерьевны на тему «Моделирование инвестиционных решений в условиях бинарной неопределенности фондового рынка», представленную на соискание ученой степени кандидата экономических наук по специальности 5.2.2. – Математические, статистические и инструментальные методы в экономике

В 2019 году М.В. Добрина закончила очную аспирантуру ФГБОУ ВО «Воронежский государственный университет» по направлению подготовки 36.06.01 Экономика, профиль 08.00.13 – Математические и инструментальные методы экономики. В настоящее время работает старшим преподавателем департамента анализа данных и машинного обучения факультета информационных технологий и анализа больших данных Финансового Университета при Правительстве РФ и проходит научную стажировку для завершения диссертации в ФГБОУ ВО «Санкт-Петербургский государственный экономический университет» на кафедре прикладной математики и экономико-математических методов.

В периоде стажировки подготовлен окончательный текст диссертации и большой раздел монографии, посвященной вопросам математического моделирования инвестиционных портфелей.

За время стажировки М.В. Добрина проявила себя ответственным, активным и инициативным исследователем, целеустремленно и настойчиво работающим над решением поставленных задач. Полученные теоретические и практические результаты позволяют сделать вывод о высокой квалификации автора, его способности глубоко осмысливать и анализировать предмет исследования, успешно применять математические модели и методы решения, грамотно интерпретировать полученные результаты.

Проведенный в работе анализ достаточно обширного статистического материала обеспечил высокую научную и практическую аргументированность исследования.

Выбранное М.В. Добриной направление исследования является весьма актуальным. Фондовый рынок был и остается весьма привлекательным для инвесторов, несмотря на высокий уровень неопределенности и риска. Любое модельное исследование аспектов и особенностей работы фондового рынка вызывает интерес участников.

Прикладные возможности современного аппарата моделирования процессов с дихотомической динамикой на данный момент недостаточно исследованы, проблема изучения этих возможностей в сфере портфельного инвестирования остается актуальной и перспективной. Автор предлагает и исследует на статистическом материале новые принципы и методы построения инвестиционных портфелей и проведения портфельного анализа.

В работе реализуются новые подходы к моделированию портфелей ценных бумаг в условиях бинарной неопределенности фондового рынка, имеющие важное теоретическое и прикладное значение.

Результаты, полученные в диссертации М.В. Добриной на основе математического моделирования инвестиционных портфелей, существенно уточняют понимание механизма работы фондового рынка и могут служить модельной основой разработки принимаемых инвестиционных решений и оценки их риска. Они могут быть также основой тематических разделов дисциплин, связанных с курсом финансовой математики для студентов экономических вузов.

Результаты исследований многократно докладывались и получали положительную оценку на международных и всероссийских научных и научно-практических конференциях, представлены в 37 публикациях, из которых 10 в

источниках из перечня, рекомендуемого ВАК РФ, 3 в изданиях, входящих в базу Scopus и Web of Science и одно соавторство в монографии.

Диссертационное исследование М.В. Добриной является завершенным научно-исследовательским трудом, выполненным автором самостоятельно на высоком научном уровне. Полученные результаты работы достоверны, обладают научной новизной, соответствующей паспорту специальности 5.2.2., выводы подтверждаются логикой проведенного исследования и обширным статистическим материалом.

Считаю, что работа М.В. Добриной «Моделирование инвестиционных решений в условиях бинарной неопределенности фондового рынка» соответствует требованиям, предъявляемым к диссертациям на соискание ученой степени кандидата экономических наук по специальности 5.2.2. – Математические, статистические и инструментальные методы в экономике, и может быть представлена для защиты в профильном диссертационном совете, а автор работы заслуживает присуждения ученой степени кандидата экономических наук по указанной специальности.

Научный руководитель

профессор кафедры прикладной математики и экономико-математических методов Санкт-Петербургского государственного экономического университета, доктор экономических наук, профессор

26.02.2024



В.П. Чернов

