

В Диссертационный совет 24.2.386.09
При ФГБОУ ВО «Санкт-Петербургский государственный
экономический университет»
191023, Санкт-Петербург, наб. канала Грибоедова, д. 30–32, литер А

ОТЗЫВ

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

Традиционные методы построения портфеля ценных бумаг в условиях эффективного рынка наряду с бесспорными достоинствами имеют явные слабые стороны.

Альтернативный эффективному фрактальный рынок из-за отсутствия необходимых средств моделирования многовариантной динамики формирования доходности финансовых активов не обеспечивает инвесторов новыми надежными рекомендациями портфельного инвестирования. В то же время появился новый аппарат моделирования процессов с дихотомической динамикой, прикладные возможности которого недостаточно изучены.

Вопросы исследования этих возможностей в задачах портфельного инвестирования являются актуальными и позволяют надеяться на уточнение интерпретационных фактов и алгоритмических схем формирования оптимальных портфельных решений. Этим вопросам посвящена значительная часть диссертационного исследования М.В. Добриной.

Диссертация и автореферат М.В. Добриной представляют собой целостное, структурированное и логически выстроенное научное исследование на актуальную тему, содержащее новые научные результаты. Автореферат полностью отражает основное содержание диссертации.

Результаты диссертации М.В. Добриной были использованы в исследованиях по НИР «Методы и модели прогнозирования социально-экономического развития Воронежской области» и «Разработка теории

адаптивно-таргетированных моделей прогнозирования в задачах стратегического планирования социально-экономических процессов», проведенные в Воронежском государственном университете и поддержаные грантами РФФИ.

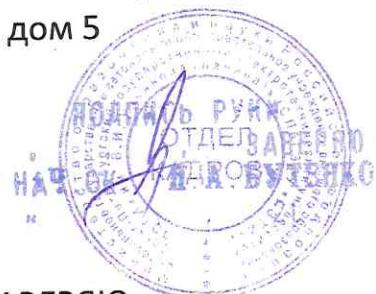
Несмотря на общее положительное впечатление, в качестве замечания к проведенному исследованию следует отметить отсутствие анализа проблемы идентификации числовых характеристик бинарной неопределенности.

Судя по автореферату диссертационное исследование М.В. Добриной соответствует требованиям Положения о присуждении ученых степеней, предъявляемым к кандидатским диссертациям, а автор, Добрина Мария Валерьевна, заслуживает присуждения ученой степени кандидата экономических наук по специальности 5.2.2 – «Математические, статистические и инструментальные методы в экономике».

Заслуженный деятель науки РФ, лауреат премии Правительства РФ в области образования, профессор, доктор технических наук, профессор кафедры информационных систем Санкт-Петербургского государственного электротехнического университета (ЛЭТИ)

Павел Иосифович Падерно

Санкт-Петербургский государственный электротехнический университет,
197022, г. Санкт-Петербург, ул. Профессора Попова, дом 5
Телефон: +7 812 234-46-51;
E-Mail: info@etu.ru; сайт: <http://www.etu.ru/>



«06» мая 2024 г.

Подпись профессора Падерно П.И. ЗАВЕРЯЮ