

В диссертационный совет 24.2.386.08
при ФГБОУ ВО «Санкт-Петербургский
государственный экономический университет»

ОТЗЫВ

**на автореферат диссертации Кузнецова Романа Сергеевича на тему
«Разработка системы предиктивной аналитики мирового рынка акций
на основе нейросетевых подходов», которая представлена на соискание
ученой степени кандидата экономических наук по специальности 5.2.5. –
Мировая экономика**

Развитие систем предиктивной аналитики мирового рынка акций является важным фактором повышения устойчивости и конкурентоспособности финансовых институтов, а также ключевым элементом формирования информационной основы для принятия инвестиционных решений. Усиление процессов цифровизации, широкое внедрение онлайн-платформ для торговли акциями и алгоритмических систем торговли, рост доли частных инвесторов в структуре участников мирового фондового рынка приводят к качественному изменению механизмов функционирования рынка акций и требуют применения новых подходов к его анализу и прогнозированию.

Необходимость разработки научно обоснованных решений в области предиктивной аналитики мирового рынка акций, основанных на современных технологиях нейронных сетей, является актуальной задачей как для отечественной, так и для мировой экономики. Исходя из вышеперечисленного, работа Кузнецова Романа Сергеевича представляется актуальной и значимой. Работа посвящена разработке и апробации системы предиктивной аналитики мирового рынка акций с использованием нейросетевых подходов, ориентированной на повышение качества краткосрочных прогнозов динамики котировок акций и улучшение информационной обеспеченности растущего класса участников мирового рынка акций – частных инвесторов.

В автореферате представлены результаты теоретических и эмпирических исследований, свидетельствующие о том, что автором решен комплекс научных задач, связанных с анализом современной структуры мирового рынка акций, выделением возрастающей роли частных инвесторов как класса участников мирового рынка акций, исследованием тенденций развития рынка предиктивной аналитики и обоснованием применения архитектур на базе LSTM для прогнозирования временных рядов. Особый интерес представляет разработанная Кузнецовым Р.С. система предиктивной аналитики мирового рынка акций, позволяющая проводить анализ и прогнозирование котировок акций российских и зарубежных компаний, выполнять торговые тесты на исторических данных и оценивать результаты с позиции практической применимости.

Следует отметить, что представленные в автореферате результаты исследования обладают теоретической и практической значимостью, они достоверны и обоснованы, а также соответствуют паспорту научной специальности ВАК РФ 5.2.5. – Мировая экономика. Заслуживает положительной оценки научная активность соискателя: опубликовано 6 статей (из них 3 – в изданиях, рекомендованных ВАК), получено 4 Свидетельства о регистрации программ для ЭВМ.

Содержание автореферата позволяет отметить высокий научный уровень работы, перспективность и значимость для мировой экономики. Положительно оценивая положения и результаты работы, выделенные автором, вместе с тем следует определить следующие замечания:

- в тексте автореферата в ограниченном объёме отражён анализ инфраструктуры цифровых платформ (брокеров, торговых терминалов, инвестиционных приложений) на формирование спроса на предиктивную аналитику и характер поведения частных инвесторов, тогда как данный аспект является значимым для понимания трансформации мирового рынка акций;
- в автореферате в меньшей степени представлены оценки возможных макроэкономических последствий широкого внедрения систем предиктивной

аналитики для мировой финансовой архитектуры, в частности влияния на волатильность международных рынков и трансграничные потоки капитала.

Отмеченные замечания не влияют на качество проведённого исследования и носят уточняющий, дискуссионный характер. В целом, судя по автореферату, представленная к защите диссертационная работа Кузнецова Романа Сергеевича «Разработка системы предиктивной аналитики мирового рынка акций на основе нейросетевых подходов» отвечает требованиям ВАК РФ к кандидатским диссертациям в соответствии с «Положением о порядке присуждения ученых степеней», утвержденных Постановлением Правительства РФ от 24.09.2013 №842 (в текущей редакции), а её автор заслуживает присуждения учёной степени кандидата экономических наук по специальности 5.2.5. – Мировая экономика.

Евстафьева Ирина Юрьевна – с.н.с. лаборатории «Моделирование евразийской интеграции и мирохозяйственных процессов» Центрального экономико-математический института Российской академии наук (Москва), к.э.н, доцент.

