

ОТЗЫВ

на автореферат диссертации Мусина Артура Рустамовича

«МОДЕЛИ И МЕТОДЫ ПРИНЯТИЯ РЕШЕНИЙ В АВТОМАТИЗИРОВАННОЙ ТОРГОВЛЕ АКТИВАМИ ФИНАНСОВОГО РЫНКА»,

представленной на соискание учёной степени кандидата экономических наук по специальности 08.00.13 – Математические и инструментальные методы экономики (экономические науки)

Актуальность задачи прогнозирования поведения цен на финансовом рынке не подлежит сомнению. Подтверждением этому является множество существующих научных исследований, посвященных ее решению, имеющему помимо общенаучного очевидный экономический интерес. Важнейшей отличительной особенностью современного финансового рынка от того, что было в прошлом, является присутствие на нем значительного числа автоматизированных торговых систем или т.н. роботов, обусловленное существенным ростом их популярности среди участников рынка за последние годы. На базе подобных систем, помимо автоматизации самих торговых процессов, стало возможным реализовывать любые присутствующие в существующей литературе способы и методы прогнозирования рыночной динамики, прикладное применение которых ранее осложнялось неразвитостью соответствующих инструментальных средств и необходимостью осуществления непосредственных действий со стороны желающего их использовать участника рынка. Таким образом, сформировавшаяся на современном финансовом рынке тенденция к роботизации всех сопутствующих торговле процессов и открывшиеся в соответствии с этим возможности характеризуют востребованность проведенного А.Р. Мусиным диссертационного исследования, направленного на разработку подхода к принятию решений в области автоматизированной торговли, объединяющего существующие, пользующиеся наибольшей популярностью подходы к описанию поведения цены торгуемого актива, в частности базирующиеся на методах эконометрического моделирования и технического анализа.

В ходе выполнения исследования соискателем были получены значимые научные результаты, некоторые из которых хотелось бы особо отметить в рамках данного отзыва. Во-первых, диссидентом был представлен метод агрегации рыночных данных, направленный на повышение однородности в их статистических свойствах. Во-вторых, были разработаны эконометрические модели, позволяющие описывать и прогнозировать движение цены торгуемого инструмента на основе учета закономерностей поведения участников рынка, выраженных в виде концептуальных основ технического анализа. Стоит подчеркнуть взаимосвязанность полученных результатов, состоящую в том, что верификация предложенного метода работы с рыночными данными была проведена соискателем в рамках процедуры верификации

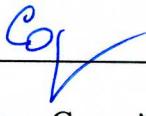
построенных моделей. В-третьих, построенные прогнозные модели вместе с методом обработки данных были реализованы автором в рамках единой автоматизированной торговой системы. В-четвертых, в работе были представлены процедуры обучения автоматизированных систем, опирающиеся на традиционный для подобных инструментальных средств функционал, что, в свою очередь, обеспечивает практическую значимость данного результата для автоматизирующих свои торговые стратегии участников финансового рынка.

Из недостатков прорецензированной на основе автореферата работы следует отметить, что проверка прогнозных способностей представленных моделей проводилась в соответствии с введенным соискателем термином «ограниченного горизонта прогнозирования». В свою очередь, базирующаяся на одной из этих моделей автоматизированная система позволяла осуществлять торговые операции на основе прогнозов, имеющих в том числе «неограниченный горизонт». Таким образом, из автореферата осталось неясным, почему не было проведено оценки возможностей моделей в рамках аналогичного «неограниченного горизонта прогнозирования».

Несмотря на этот недостаток, можно сделать заключение, что диссертационная работа «Модели и методы принятия решений в автоматизированной торговле активами финансового рынка» представляет собой законченное научное исследование, обладающее бесспорными элементами новизны и практической значимостью, а также отвечает основным требованиям ВАК. По нашему мнению, ее автор, Мусин Артур Рустамович, заслуживает присуждения ученой степени «кандидат экономических наук» по специальности 08.00.13 – Математические и инструментальные методы экономики (экономические науки).

28 марта 2019

Кандидат физико-математических наук,
доцент кафедры Информационных технологий
ФГБОУ ВО «Тверской государственный университет»


Сорокин Сергей Владимирович

Контактные данные:

Почтовый адрес: 170002, г. Тверь, Садовый переулок, д.35, каб. 225

Телефон: +7 (4822) 58-53-20 (доб. 123)

Email: Sorokin.SV@tversu.ru

Подпись Сорокина С.В.
УДОСТОВЕРЯЮ
Ученый секретарь Совета Тверского
государственного университета
Кравченко П.Н.

