

## СВЕДЕНИЯ О ВЕДУЩЕЙ ОРГАНИЗАЦИИ

по диссертации Быстровой Дарьи Андреевны

на тему: «Модели и методы оптимального управления инвестиционными портфелями неинституциональных инвесторов», представленной на соискание ученой степени кандидата экономических наук по специальности 08.00.13 – Математические и инструментальные методы экономики (экономические науки) на соискание ученой степени кандидата экономических наук

Полное наименование организации в соответствии с Уставом	Федеральное государственное бюджетное учреждение науки Центральный экономико-математический институт Российской академии наук
Сокращённое наименование организации в соответствии с Уставом	ЦЭМИ РАН
Ведомственная принадлежность	Министерство науки и высшего образования Российской Федерации
Почтовый индекс, адрес организации	117418, Москва, Нахимовский пр., д. 47
Адрес официального сайта в сети «Интернет»	<a href="http://www.cemi.rssi.ru">http://www.cemi.rssi.ru</a>
Контактный телефон	8 (499) 129-08-22
Адрес электронной почты	<a href="mailto:director@cemi.rssi.ru">director@cemi.rssi.ru</a>
Сведения о руководителе ведущей организации: Ф.И.О., должность, ученая степень, ученое звание	Бахтизин Альберт Рауфович - Директор Института, член-корреспондент РАН, доктор экономических наук, профессор РАН
Наименование структурного подразделения, составившего отзыв	Лаборатория компьютерного моделирования социально-экономических процессов
Сведения о составителе отзыва ведущей организации: Ф.И.О., должность, ученая степень, ученое звание	Бахтизин Альберт Рауфович - Директор Института, заведующий лабораторией компьютерного моделирования социально-экономических процессов член-корреспондент РАН, доктор экономических наук, профессор РАН
Список основных публикаций работников ведущей организации по теме диссертации в рецензируемых научных изданиях за последние 5 лет (не более 15 публикаций)	

<p>1. Belkina, T.A., Konyukhova, N.B., Slavko, B.V. Solvency of an Insurance Company in a Dual Risk Model with Investment: Analysis and Numerical Study of Singular Boundary Value Problems // Computational Mathematics and Mathematical Physics. 2019. 59(11), с. 1904-1927.</p>
<p>2. Макаров В.Л., Ву Ц., Ву З., Хабриев Б.Р., Бахтизин А.Р. Современные инструменты оценки последствий мировых торговых войн. Вестник Российской академии наук. 2019. Т. 89. № 7. С. 745-754.</p>
<p>3. Егорова Е.Н., Вигриянова М.С. Макроэкономические предпочтения инвесторов на фондовых рынках России и Германии под влиянием цен на нефть и динамики глобальных ресурсного и технологического секторов в 2017 - начале 2018 г // Вестник ЦЭМИ. 2018. № 3. С. 16.</p>
<p>4. Седова С.В. Многокритериальная оптимизация в компьютерной системе формирования структуры инвестиционных программ // Вестник ЦЭМИ. 2018. № 4. С. 30.</p>
<p>5. Хрусталёв Е.Ю., Шрамко О.Г. Использование метода нейронных сетей для прогнозирования эффективности инвестиционных вложений // Экономический анализ: теория и практика. 2017. Т. 16. № 8 (467). С. 1438-1454.</p>
<p>6. Егорова Е.Н., Вигриянова М.С., Перминов С.Б. Влияние глобальных ресурсного и технологического секторов на фондовые рынки России и Германии // Российский экономический интернет-журнал. 2017. № 3. С. 15.</p> <p>5. Варшавский А.Е. Современные тенденции венчурного инвестирования и его роль для России на этапе реиндустриализации // Концепции. 2017. № 1 (36). С. 4-20.</p>
<p>7. Паламарчук Е.С. Анализ оптимальной стратегии управления в задаче портфельного трекинга с учетом временных предпочтений инвестора // Управленческие науки в современном мире. 2016. Т. 2. № 1. С. 25-29.</p>
<p>8. Иванюк В.А., Андропов К.Н., Егорова Н.Е. Методы оценки эффективности и оптимизации инвестиционного портфеля // Фундаментальные исследования. 2016. №3-3. С. 575-578.</p>
<p>9. Belkina, T.A., Konyukhova, N.B., Kurochkin, S.V. Dynamical insurance models with investment: Constrained singular problems for integrodifferential equations // Computational Mathematics and Mathematical Physics 2016. 56(1), с. 43-92.</p>
<p>10. Иванюк В.А., Андропов К.Н., Егорова Н.Е. Методы оптимизации инвестиционной стратегии // Фундаментальные исследования. 2016. № 3-1. С. 159-163</p>
<p>11. Belkina, T.A., Konyukhova, N.B., Slavko, B.V. Survival probability in the life annuity insurance model with stochastic return on investments 2016 CEUR Workshop Proceedings. 1726, с. 1-12.</p>
<p>12. Егорова Н.Е., Тихненко А.Н. Алгоритмы формирования стратегии инвестора, функционирующего на фондовом рынке // Экономика и предпринимательство. 2015. №3-2 (56). С.450-453.</p>
<p>13. Егорова Н.Е., Иванов К.А. Экономико-математический анализ</p>

задачи согласования экономических интересов различных уровней иерархической системы управления // Финансовая аналитика: проблемы и решения. 2015. №7(261). С.28-41.

14. Егорова Н.Е., Торжевский К.А. Модели и методы анализа фондовых рынков и опыт их применения в условиях России // Экономика и математические методы. 2015. Т.51. №1. С. 68-79.

15. Егорова Н.Е., Тихненко А.Н. Анализ ценовых рядов фондового рынка с использованием индикатора Хольта // Математический сетевой электронный научный журнал Кубанского государственного аграрного университета. 2015. №108. С 401-408.

Ведущая организация подтверждает, что соискатель и его научный руководитель не являются её сотрудниками и соискатель не имеет научных работ по теме диссертации, подготовленных на базе ведущей организации или в соавторстве с её сотрудниками.

Директор ЦЭМИ РАН, заведующий лабораторией компьютерного моделирования социально-экономических процессов член-корреспондент РАН, доктор экономических наук, профессор РАН



А.Р. Бахтизин

Подпись А.Р. Бахтизина удостоверяю.

Ученый секретарь ЦЭМИ РАН,  
кандидат экономических наук

А.И. Ставчиков

«04» февраля 2020 г.