

ОТЗЫВ НА АВТОРЕФЕРАТ ДИССЕРТАЦИИ

Проскурякова Александра Юрьевича

«Математические методы и информационные технологии управления торговыми операциями с цифровыми валютами»,
представленной на соискание ученой степени доктора экономических наук по специальности 5.2.2. Математические, статистические и инструментальные методы в экономике.

Представленная диссертационная работа посвящена исследованию и разработке новых методов, моделей, комбинированных алгоритмов и реализующих их информационно-аналитических и торговых систем для автоматизированного мониторинга, управления и прогнозирования временных рядов данных, при выполнении торговых операций с цифровыми финансовыми активами (ЦФА), в том числе стейблкоинами и криптовалютой.

В настоящее время наблюдается значительный рост интеграции и внедрения в различные сферы человеческой деятельности и бизнеса технологий цифровой экономики, технологий блокчейн и искусственного интеллекта для принятия управляющих решений, направленных на минимизацию риска потери покупательной способности портфеля активов. При этом задачам научно-исследовательского плана, которые посвящены методам обработки данных о цифровых финансовых активах, с учетом их существенной волатильности и изменчивости параметров, практически не уделено внимание, степень их проработанности недостаточная, что обуславливает актуальность проведенного научного исследования.

В представленной работе поставлены и решены следующие научно-практические задачи, такие как исследование особенностей в области ценообразования криптовалютных активов цифровой экономики, математических моделей динамично изменяющихся нестационарных временных рядов стоимостных показателей ЦФА.

Разработаны алгоритмы предварительной обработки и сглаживания временных рядов параметров ЦФА с применением алгоритмов, основанных на вейвлет-преобразования исходных временных рядов котировок, обеспечивающих адаптивное подавление нежелательных составляющих временных рядов, таких как ложные всплески и флуктуации значений ряда.

Проработаны вопросы исследования методов автоматизированного мониторинга портфеля ЦФА с применением комбинированного алгоритма прогнозирования значений временных рядов на основе интеграции подходов применения технологий искусственных нейронных сетей, технологий вейвлет-преобразования и волнового экономического анализа.

Уделено внимание вопросам оптимального принятия решений по совершению торговых операций с криптоактивами, представлены результаты работы торгового робота с применением облачных технологий. Вышеуказанные задачи позволили разработать адаптивную информационно-аналитическую систему управления финансовыми активами.

К теоретической значимости представленной работы можно отнести формирование научно-методологических основ работы с цифровыми финансовыми активами и повышение эффективности применения информационных технологий для мониторинга и управления торговыми операциями с цифровыми валютами на основе разработанных подходов, методов и алгоритмов с учетом специфики временных рядов ЦФА, на основе прогнозных и беспрогнозных методов управления, а также трендового и волнового анализа.

Результаты проведенного исследования могут быть полезны при решении задач криптовалютного регулирования, проводимого Центральным банком РФ, могут использоваться как надежный инструмент поддержки принятия решений по управлению работой с ЦФА в корпоративном секторе, позволят минимизировать риски потери покупательной способности криптовалютных активов, геополитические валютные риски.

В качестве замечаний по автореферату можно отметить следующее.

1. По данным раздела «Научная новизна» п.5 в неполной степени понятно, какой из методов прямого или обратного распространения ошибки применяется при обучении искусственной нейронной сети.

2. В автореферате не представлены результаты сравнения данных прогнозирования, полученных с использованием разработанных автором подходов и результатов, полученных с применением сторонних модулей искусственного интеллекта.

3. Из текста автореферата недостаточно ясно как определены оптимальные параметры настройки торгового робота на основе метода трендового управления.

4. При продолжительном тренде нисходящего движения стоимости выбранной криптовалюты существует не только риск «неполучения прибыли»,

но и обесценивания криптовалютного актива при вынужденной фиксации убыточной позиции, даже при спотовой торговле.

Однако, отмеченные замечания не снижают научной и практической значимости проведенного исследования, и не влияют на главные теоретические и практические результаты диссертации. Приведенные научные результаты можно квалифицировать как новые, они в достаточной степени апробированы. Согласно автореферату результаты исследований по теме диссертации опубликованы в 16 рецензируемых научных изданиях, подготовлено 2 монографии, 9 статей в изданиях, индексируемых системой Scopus.

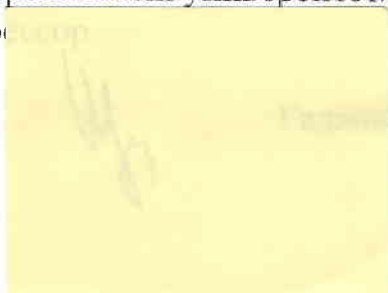
В целом, исходя из представленных в автореферате сведений, диссертация написана на высоком научном уровне, соответствует требованиям п. 9 Положения о присуждении учёных степеней, предъявляемым к докторским диссертациям, а её автор Проскураков А.Ю. заслуживает присуждения учёной степени доктора экономических наук по специальности 5.2.2. Математические, статистические и инструментальные методы в экономике.

Заведующий кафедрой

«Экономическая безопасность, анализ и аудит»

ФГБОУ ВО «Дагестанский государственный университет»,

доктор экономических наук, проф.



Назирхан Гаджиевич

15 апреля 2024 г.

Контактные данные:

E-mail: nazirhan55mail.ru

Тел.: 7 967 395 9394

Диссертация д.э.н. защищена по специальности: 08.00.12 Бухгалтерский учет, статистика
Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение высшего образования
«Санкт-Петербургский государственный экономический университет»

Адрес: e-mail: rector@unecon.ru

Тел.: 7 (812) 458 – 97 - 27

Федеральное государственное бюджетное
образовательное учреждение высшего
образования «Дагестанский
государственный университет».
Россия, 367000, Республика Дагестан,
ул. Магомета Гаджиева, дом 43 А



Гаджиева, Н.С.
4 20 24 г.