

ОТЗЫВ

на автореферат диссертации

Цветковой Инны Владимировны

«Моделирование хааровских расширений статических процессов с

помощью интерполяционных мартингалных мер»,

представленной на соискание учёной степени кандидата физико-математических наук по специальности 05.13.18 — Математическое моделирование, численные методы и комплексы программ

Предметом исследования в диссертации И.В.Цветковой являются одношаговые (B, S) -рынки, определённые на счётном вероятностном пространстве. Основная задача — расширение таких рынков до полных.

Истоки стохастической финансовой математики берут своё начало от диссертации Башелье (L. Bachelier « Theorie de la speculation» Ann. Sci. Ecole Norm. Sup. 17, 1900). В нашей стране это направление начало развиваться с середины 90-х годов XX века в рамках семинара А.Н. Ширяева в Математическом институте имени В.А. Стеклова РАН и на механико-математическом факультете МГУ.

Результаты, полученные в диссертации И.В. Цветковой, представляют теоретический и практический интерес и вносят заметный вклад в стохастическую финансовую математику. А именно, счётное вероятностное пространство является той максимальной структурой, на которой возможно применение метода хааровских интерполяций. Исследования, проведенные в диссертации, позволяют преобразовывать неполные безарбитражные рынки со счётным числом состояний в полные безарбитражные рынки и как следствие производить все расчёты необходимые для оптимального поведения хеджеров на финансовых рынках. Полученные в диссертации алгоритмы и формулы реализованы в соответствующем программном комплексе.

При этом стоит отметить такой недостаток, как недостаточная оценка эффективности работы программного комплекса.

В целом, автореферат правильно отражает содержание диссертации, её структуру, содержит короткое историческое введение, обоснование темы работы, описание полученных результатов, сведения об апробации работы и об основных результатах соискателя.

Судя по автореферату, диссертационная работа Цветковой Инны Владимировны является законченной научно-квалификационной работой; результаты работы обладают научной новизной, практической и теоретической значимостью. Диссертационная работа соответствует критериям действующего «Положения о порядке присуждения учёных степеней», а Цветкова Инна Владимировна заслуживает присуждения степени кандидата физико-

математических наук по специальности 05.13.18 — Математическое моделирование, численные методы и комплексы программ.

Доктор физико-математических наук,

доцент, доцент кафедры математики и моделирования систем

Воронежского института МВД России

Контактная информация:

почтовый адрес: 394065, Воронеж, пр. Патриотов 53


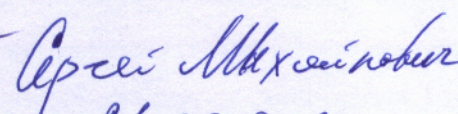
факс: 8 (473) 200-55-00

сайт: www.vimvd.ru

телефон: 8-910-243-7771

e-mail: mathsms@yandex.ru

Подпись С.М. Ситника заверяю

 С.М. Ситник

21.06.2017

