

ОТЗЫВ

на автореферат диссертации

Цветковой Инны Владимировны

«Моделирование хааровских расширений статических процессов с помощью интерполяционных мартингальных мер»,

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

Диссертация И.В. Цветковой лежит в русле стохастической финансовой математики, призванной исследовать свойства финансовых структур и оптимизировать процесс распоряжения финансовыми ресурсами. Основной целью работы является изучение различных моделей статических (B,S) -рынков со счётным числом состояний. Основная задача — построение хеджирующих стратегий. В автореферате представлены результаты, полученные в процессе решения этой задачи. Основной акцент в работе сделан на доказательстве существования интерполяционных мартингальных мер, обладающих ослабленным свойством универсальной хааровской единственности. Используемые при этом принципы моделирования и техника расчётов основаны на теории хааровских интерполяций финансовых рынков, предложенной профессором И.В. Павловым.

Полученные в работе новые вычислительные алгоритмы позволяют применить метод случайных хааровских интерполяций к реальным расчётам на безарбитражных финансовых рынках с бесконечным числом состояний. Таким образом, результаты исследований И.В. Цветковой позволяют не только производить вычисления, но и создавать программные комплексы, существенно облегчающие выбор оптимального поведения хеджеров на финансовых рынках.

Содержание автореферата соответствует паспорту специальности 05.13.18 — Математическое моделирование, численные методы и комплексы программ. Полученные в диссертации результаты имеют практическую ценность, хорошо обоснованы, прошли апробацию в форме докладов на различных конференциях и отражены в 23 научных работах, из которых 6 работ опубликованы в рецензируемых научных изданиях, рекомендованных ВАК, и ещё 2 опубликованы в журнале «Теория вероятностей и её применения» (индексированном в базе Web of Science).

К тексту автореферата имеется небольшое замечание. При описании программного обеспечения, использованного для разработки представленного в автореферате программного комплекса, следовало бы указать наличие лицензии на эти программные продукты. Приведенное замечание не влияет на общую положительную оценку диссертационного исследования.

Считаю, что диссертация Цветковой И.В. соответствует требованиям ВАК, предъявляемым п.9 Положения о присуждении учёных степеней в редакции Постановления Правительства РФ от 24.09.2013 № 842, предъявляемым к

кандидатским диссертациям, а её автор — Инна Владимировна Цветкова заслуживает присуждения степени кандидата физико-математических наук по специальности 05.13.18 — Математическое моделирование, численные методы и комплексы программ.

Доктор физико-математических наук, 08.00.13 - Математические и инструментальные методы экономики
доцент, профессор кафедры информатики и информационных таможенных технологий
Ростовского филиала ГКОУВО
«Российская таможенная академия»
Телефон: (863) 262-59-59
E-mail: koe@donrta.ru



(О.Е. Кудрявцев)
Кудрявцев Олег Евгеньевич

Ростовский филиал государственного казенного образовательного учреждения высшего образования «Российская таможенная академия»

Адрес: пр. Буденновский, д. 20, г. Ростов-на-Дону, 344002

Сайт: <http://donrta.customs.ru>

Телефон: (863) 262-38-18

Факс: (863) 262-00-04

E-mail: rta-rostov@donrta.ru

