

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

Диссертация И.В. Цветковой посвящена исследованию неполных финансовых рынков, определённых на счетном вероятностном пространстве. Эта тематика занимает значительное место в стохастической финансовой математике и находится в состоянии активного развития.

В автореферате И.В. Цветковой представлены объекты исследования и цель диссертационной работы. Описана важнейшая линия исследования: изучение множества мартингалных мер, удовлетворяющих ОСУХЕ. С помощью мартингалных мер, удовлетворяющих этому свойству, и специальных хааровских интерполяций можно интерполировать заданные неполные рынки до полных.

В автореферате подчеркнута новизна основных результатов диссертации, состоящая в том, что доказаны достаточные условия существования мартингалных мер, удовлетворяющих ОСУХЕ для различных моделей статических рынков со счётным числом состояний. Созданы алгоритмы для вычисления таких мартингалных мер. Следует отметить и практическую значимость полученных результатов: разработан новый научно-исследовательский программный комплекс, реализующий полученные в диссертации алгоритмы и формулы.


Подчеркну, что в автореферате адекватно изложено основное содержание диссертации. Следует также обратить внимание на содержательную апробацию работы, большое число выступлений на международных научно-практических конференциях.

Список публикаций, приведённых в автореферате, содержит 6 работ, опубликованных в изданиях из списка ВАК Минобрнауки РФ, и ещё 2 работы

опубликованы в журнале «Теория вероятностей и её применения», индексированном в базе Web of Science.

На основании вышеизложенного считаю, что диссертация Цветковой Инны Владимировны соответствует всем необходимым требованиям, предъявляемым к кандидатским диссертациям, а её автор заслуживает присуждения учёной степени кандидата физико-математических наук по специальности 05.13.18 — Математическое моделирование, численные методы и комплексы программ.

Зав. кафедрой «Вычислительная техника и автоматизированные системы управления» факультета «Информационные технологии управления» Ростовского государственного университета путей сообщения, доктор технических наук, профессор

 А.В. Чернов
Чернов Андрей Владимирович

344038, Ростов-на-Дону, пл. им. Ростовского Стрелкового Полка Народного Ополчения, 2, уч. корпус Д, факультет «Информационные технологии управления», комн. Д411, тел. (863) 2726380, e-mail: avche@yandex.ru, веб-сайт www.rgups.ru.

Подпись Чернова А.В.

УДОСТОВЕРЯЮ

Начальник управления делами
ФГБОУ ВО РГУПС

«16» 06




Т.М. Канина