

РЕЦЕНЗИЯ

на выпускную квалификационную работу студента 4 курса

Кафедры системного программирования СПбГУ

Андреева Романа Олеговича,

обучающегося по направлению 010500 (02.03.03)

(математическое обеспечение и администрирование информационных систем)

Тема выпускной квалификационной работы:

Создание биржевого робота с параметризуемыми торговыми стратегиями

В выпускной квалификационной работе рассматриваются вопросы построения биржевых роботов. Тема является важной и актуальной. Автоматизация биржевой торговли – востребованная деятельность. Алгоритмика, лежащая в основе таких программ, весьма наукоемка. С одной стороны, она требует глубокого понимания предметной области, с другой, понимания математических методов, лежащих в основе программ. Также имеет место следующая особенность, которую отмечает автор в выпускной работе: специалисты по биржевым операциям глубоко понимают всю специфику этой деятельности, но редко располагают знаниями и практическими навыками в области разработки ПО. Программисты же редко имеют глубокое понимание специфики торговли финансовыми инструментами. В этой связи особое значение приобретает создание удобного инструментария, который бы инкапсулировал базовые алгоритмы предметной области в некоторые блоки, позволяя трейдеру, желающему запрограммировать некоторую стратегию, делать это формируя ее из готовых блоков. Тем самым трейдер избавляется от необходимости кодировать алгоритмы на алгоритмическом языке, делая это, например, в специализированном редакторе, графически формирующем стратегию из готовых блоков.

В своей работе автор анализирует известные системы автоматизации биржевой торговли. Характеризует их как с точки зрения «мощности» в смысле развитости предоставляемого инструментария, так и с точки зрения удобства использования.

В качестве основной задачи выпускной работы автор рассматривает построение инструментария в рамках системы TSLab. Инструментарий состоит из достаточно многочисленных блоков, которые делятся на несколько групп в соответствии со своей функциональностью. Реализованный набор блоков позволяет создавать законченные торговые стратегии, не опускаясь до уровня программирования базовых алгоритмов.

Для тестирования и апробации созданной инструментальной системы было реализовано две торговых стратегии, которые, в свою очередь, были проверены на исторических данных.

В работе были выявлены также следующие недостатки:

1. Остается не вполне понятным, какое наполнение имеет платформа TSLab вне рассматриваемого проекта, и возможно ли совмещение этого наполнения с блоками, реализованными автором.

2. Хотелось бы понимать выразительную силу созданного инструментария, иными словами, насколько глубокие и разнообразные торговые стратегии могут быть созданы на его основе.

Проверка ВКР на предмет наличия/отсутствия неправомерных заимствований показала, что работа неправомерных заимствований не содержит.

На основании вышеизложенного можно заключить, что выпускная квалификационная работа соответствует основным требованиям, предъявляемым к выпускной квалификационной работе бакалавра, недостатки не снижают общего хорошего впечатления о работе. Работа заслуживает оценки «отлично».

В.М.Нестеров, д.ф.-м.н.

Генеральный директор Центра разработок Dell EMC

Дата: 22 мая 2017 г.

Подпись: _____

