

ОТЗЫВ

научного руководителя на выпускную квалификационную работу обучающегося СПбГУ
Ивановой Анастасии Александровны
на тему «Математическое моделирование индивидуальной конкуренции на фондовых рынках»

Работа посвящена актуальной, на сегодняшний день, проблематике развития поведенческих моделей и методов оценки экономического поведения на основе аппарата математического моделирования. Анастасия Александровна сконцентрировалась на исследовании данного вопроса при помощи математических моделей и методов оптимизации, а также с привлечением теоретико-игровых подходов. Оказывается, в некоторых случаях поиск экономического равновесия может осуществляться путём решения задач оптимизации определенного класса, хотя в общем случае приходится прибегать к моделям теории игр. Иванова А.А. исследовала ряд частных случаев соответствующей задачи, когда функции, описывающие прибыльность активов в зависимости от вложенных средств, являются линейно убывающими.

Полученные Ивановой А.А. результаты ориентированы на современные вызовы со стороны практики и развитие указанной области исследований. В рамках принятых ограничений получены формулы для оценки привлекательности имеющихся на рынке активов в условиях конкуренции трейдеров. Более того, получен явный вид решения одного частного случая задачи конкуренции на фондовом рынке.

Работа Ивановой А.А. написана корректно и подтверждает достаточный уровень квалификации автора, умение применять полученные в процессе обучения знания на практике, навыки ведения самостоятельного научного исследования прикладного характера. Считаю, что полученные в работе результаты заслуживают положительной оценки.

Научный руководитель,
кандидат физ.-мат. наук



Крылатов А.Ю.