

## РЕЦЕНЗИЯ

на выпускную квалификационную работу обучающегося СПбГУ Юй Чжигуана по теме «Развитие методов инвестиционного анализа на фондовом рынке Китая»  
Основная образовательная программа магистратуры «Финансовые рынки и банки» по направлению 38.04.08 «Финансы и кредит»

Выпускная квалификационная работа посвящена актуальной теме, имеющей важное научное и практическое значение. Содержание ВКР соответствует заявленной теме. Структура работы обоснована сформулированными во введении целями и задачами.

При подготовке ВКР использован большой массив актуальных источников информации теоретического, нормативно-правового и методического характера на русском и английском языках, интернет-источники. Автором применялись современные методы анализа экономической информации, что послужило основой для убедительно сформулированных самостоятельных выводов научного и прикладного содержания.

Работа написана доступным языком и приемлемым стилем. Содержание работы достаточно хорошо структурировано и наглядно проиллюстрировано таблицами, диаграммами и рисунками.

К достоинствам работы можно отнести следующее:

- В ВКР реализован количественный подход к инвестированию - это инвестиционная стратегия, которая использует современную статистику и математику для поиска и получения избыточной прибыли от большого количества исторических данных.
- В прикладной части работы показано использование Matlab для извлечения данных, анализа данных и создания инвестиционных стратегий для достижения количественных транзакций. В настоящее время основные приемы извлечения данных включают методы извлечения данных из терминала и методы извлечения данных по API. После извлечения данных они предварительно обрабатываются. Используя Matlab для оценки инвестиционных свойств акции можно оптимизировать выбор портфеля акций.

Реализованный подход обладает научной новизной. Он базируется на развитии теоретических аспектов разработки инвестиционной стратегии. Предложенная автором модель количественного инвестирования отражает особенности китайского фондового рынка и имеет высокую прикладную значимость. Алгоритм ее реализации может использоваться как для развития теоретических представлений о современных методах инвестиционного анализа, так и к практике инвестирования.

Таким образом, ВКР обладает научной новизной и практической значимостью. Она посвящена исследованию актуальных проблем теоретического и практического характера, в ней присутствует авторский подход к исследованию, а сделанные выводы самостоятельны и логически обоснованы.

В качестве замечания следует отметить, что пространные приложения не очень хорошо структурированы и затрудняют оценку достоверности результатов анализа данных. Необходимо остановиться на этом вопросе в ходе защиты.

Замечание не является критическим и не влияет на общую положительную оценку работы. Заявленная в названии тема полностью раскрыта, в работе присутствует научная новизна и практическая значимость, ВКР выполнена на хорошем исследовательском уровне и заслуживает оценки «отлично».

Рецензент:  
Доцент СПбГЭУ, к.э.н.

Павлов Глеб Стефанович

