

Отзыв на выпускную квалификационную работу бакалавра

на тему:

**«ФОРМИРОВАНИЕ И УПРАВЛЕНИЕ ИНВЕСТИЦИОННЫМ ПОРТФЕЛЕМ НА
РОССИЙСКОМ РЫНКЕ ЦЕННЫХ БУМАГ»,
МУСТАФАЕВА Орхан Панах оглы**

ООП ВО «бакалавриат»

по направлению «экономика»

профиль: «финансы, кредит, страхование и учет»

1. Соответствие цели, задач и результатов исследования требованиям образовательного стандарта СПбГУ и образовательной программы в части овладения установленными компетенциями

Цели, задачи и результаты исследования соответствуют требованиям образовательного стандарта СПбГУ и образовательной программы в части овладения установленными компетенциями.

2. Обоснованность структуры и логики исследования

Структура и Структура и логика исследования обоснованы.

3. Наличие вклада автора в результаты исследования с учетом результатов проверки ВКР на предмет наличия/отсутствия неправомερных заимствований

Основываясь на прочтении работы и ее обсуждении в ходе подготовки, считаю, что работа является самостоятельным исследованием, что подтверждается достаточно низким уровнем выявленного заимствования (15%). Заимствования определяются использованием цитат в теоретической части и обращением к источникам статистической информации.

4. Научная новизна и практическая значимость исследования

Научная новизна данного исследования состоит в эмпирическом подтверждении теоретического положения об обратной зависимости эффекта диверсификации, приводящего к снижению риска портфеля, и уровня корреляции доходностей акций, входящих в состав данного портфеля. Данный результат основан на построении и сравнении эффективной границы допустимых портфелей из акций нефте-газовой отрасли и портфелей из акций различных отраслей. Интересным так же представляется результат сравнения эффективных границ портфелей построенных в рамках теории Марковица и рыночной модели Шарпа.

5. Умение применять методологию и методики научного исследования

Автор продемонстрировал умение применять методологию и методики научного исследования, включая эконометрические методики.

6. Актуальность используемых информационных источников

Используемые информационные источники актуальны.

7. Соответствие предъявляемым требованиям к оформлению ВКР

Работа соответствует предъявляемым требованиям к оформлению ВКР.

8. Соблюдение графика выполнения ВКР

График выполнения ВКР соблюден.

9. Допуск к защите и оценка работы

Работа может быть допущена к защите с рекомендуемой оценкой «отлично» (А).

Научный руководитель
к.э.н., доцент СПбГУ

 Коршунов О.Ю.

дата 08.05.17