

Рецензия
на выпускную квалификационную работу бакалавра
на тему
«Методы управления рисками инвестиционного проекта»

Студента Пунток Валерий Леонидович

ФИО студента

ООП ВО «Бакалавриат»

по направлению «Экономика»

Профиль: «Математические и статистические методы экономики»

1. Четкость постановки целей и задач исследования. Во введении сформулированы цели работы, которые связаны с исследованием методов анализа рисков инвестиционного проекта и управления ими, а также с практическим применением этих методов. Для достижения этой цели сформулированы 4 основных задачи. Можно отметить четкость и ясность постановки цели и задач работы.

2. Обоснованность структуры и логики исследования. Рецензируемая работа состоит из введения, трех глав и заключения, а также содержит список литературы и источников и приложения. В первой главе речь идет об определении и измерении риска, вторая посвящена методам управления рисками, третья - содержит результаты экспериментальных расчетов. Все изложено достаточно логически последовательно. В работе большой объем приложений, более 20 таблиц, которые содержат исходные данные рассматриваемых примеров и результаты экспериментальных расчетов.

3. Наличие вклада автора в результаты исследования. Вклад автора заключается в том, что им собраны и проанализированы материалы по теории управления рисками, построены практические примеры и грамотно выполнены экспериментальные расчеты, существенное внимание уделяется использованию реальных опционов в процессе управления рисками.

4. Новизна и практическая значимость исследования. Определенная новизна выполненного исследования связана особенностями и вариантами применения прямых и косвенных методов измерения риска для анализа рассматриваемых конкретных числовых примеров. Практическая значимость рецензируемой ВКР определяется тем, что предлагаемые методики расчетов поясняются большим объемом выполненных экспериментальных расчетов.

5. Корректность использования методов исследования и анализа экономической информации. Следует отметить корректность реализации рассматриваемых методов анализа моделей и применения методов имитационного моделирования на ЭВМ,

6. Актуальность используемых информационных источников. При написании работы использована современная литература, а также интернет-источники.

7. Достоинства работы. К числу достоинств работы можно отнести грамотный анализ методов управления рисками; корректное использование метода Монте-Карло при косвенной оценке риска; содержательный анализ метода дерева событий и сценариев будущего развития; корректное выполнение экспериментальных расчетов на ЭВМ

8. Замечания и недостатки работы. В их числе можно отметить следующие:

- необходимо уточнить, в чем смысл управления рисками, при каких условиях целесообразно увеличивать или сокращать риск;

- следует пояснить отличия и особенности выборочных мер риска приведенных в разделе 1.3 (стр.13-14) и расчетных мер риска, представленных в разделе 2.1.4 (стр.21-22), при каких условиях можно использовать выборочные меры риска при анализе инвестиционных проектов.

9. Вопросы для защиты

- Чем определяется выбор методов управления рисками?

- Какова роль и значение косвенных методов оценки риска?

10. Допуск к защите и оценка работы

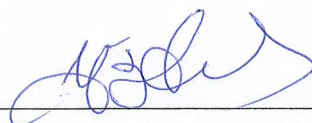
ВКР студента Пунтока В.Л вполне может быть допущена к защите и заслуживает оценки А -

отлично

Рецензент,

Д.э.н, проф, зав кафедрой СПбГУ _____

18.05.2016



/Иванов В.В./