

на автореферат диссертационной работы Арбузова Вячеслава Олеговича
«Имитационное моделирование микроструктуры фондового рынка на основе
высокочастотной и транзакционной информации», представленной на соискание учёной
степени кандидата экономических наук по специальности 08.00.13 - «Математические и
инструментальные методы экономики»

Научная новизна диссертационной работы обоснована, разработанные подходы к моделированию микроструктуры фондового рынка позволяют эффективно исследовать задачу регулирования фондового рынка на основе имитационного эксперимента. Создан программный комплекс для развития системы поддержки принятия решений.

По автореферату диссертации имеются следующие замечания:

1. На стр. 15 автореферата даны характеристики, влияющие на вероятность отмены заявок, но не приведены формулы для их расчета.
2. Из автореферата не ясно, в чем измеряются моделируемые объемы заявок? В случае если измерения производятся в местной валюте, то на сколько корректно сравнивать рынки друг с другом?

Однако эти замечания не снижают положительного впечатления о работе. Анализ содержания автореферата позволяет сделать вывод о том, что работа выполнена на актуальную тему, обладает научной новизной и практической значимостью, отвечает требованиям ВАК России. Автор работы Арбузов Вячеслав Олегович заслуживает присуждения ученой степени кандидата экономических наук по специальности 08.00.13 — Математические и инструментальные методы экономики.

Михалёва Марианна Михайловна
к.э.н., н.с., отдел экономической информатики,
Институт экономики и организации промышленного производства
Сибирского отделения Российской академии наук

Адрес: Россия, 630090, Новосибирская область,
г. Новосибирск, просп. Академика Лаврентьева, д. 17
Рабочий телефон: (383) 330-89-53
Электронная почта: morozova.marianna@gmail.com

Богинь руки Михаил
еже-мо ксер/се р



25.04.2010