

ОТЗЫВ

на автореферат диссертации Николаевой Юлии Викторовны
«Методы и алгоритмы интеллектуальной системы поддержки
принятия решений трейдеров финансовых рынков», представленной на
соискание ученой степени кандидата технических наук по специальности
05.13.10 – «Управление в социальных и экономических системах»

Общее совершенствование методов моделирования процессов принятия решений в социально-экономических системах ведет к росту прикладных исследований методов и алгоритмов систем поддержки принятия решений в узкоспециализированных областях. Диссертационная работа посвящена актуальной задаче разработки методики поддержки принятия решений трейдеров финансовых рынков. Автором предложена оригинальная методика для системы поддержки принятия решений, которая помогает в процессе торговли на финансовых рынках трейдерам осуществлять обоснованные решения при заключении сделок с финансовыми инструментами, что снижает риск финансовых потерь при заключении убыточных сделок.

Практический интерес представляет разработанная интеллектуальная система поддержки принятия решений, где реализованы метод генерации выходной выборки для обучения нейронной сети, метод исключения влияния квалификации эксперта при оценке работы нейронной сети, методика поддержки принятия решений трейдера по направлению сделок. Информационные связи, реализованные в системе, помогают лицу, принимающему решения, задавать параметры анализа, например, ожидаемую прибыль. Созданная база данных позволяет подбирать веса нейронов для сокращения времени обучения нейронной сети.

Научные результаты работы подтверждаются публикациями и аprobациями на конференциях, регистрацией разработанного программного продукта в реестре программ для ЭВМ.

К замечаниям по автореферату можно отнести:

1. Из текста автореферата не совсем ясно, почему при проектировании нейронной сети было задано именно три слоя, а ограничение на максимальное число нейронов выбрано равным 50;
2. Из текста автореферата не понятно, как коэффициент повышения волатильности зависит от влияния событий экономического календаря, так как в представленном алгоритме его определения нет шагов, где учитывается это влияние.

Замечания являются некритичными и не уменьшают общей значимости диссертационной работы.

Считаю, что представленная диссертационная работа является **законченной научно-квалификационной работой**, соответствует требованиям «Положения о порядке присуждения ученых степеней», предъявляемым к диссертациям, представленным на соискание ученой степени кандидата наук. Автор диссертации, Николаева Юлия Викторовна, заслуживает присуждения ученой степени кандидата технических наук по специальности 05.13.10 – «Управление в социальных и экономических системах».

Профессор кафедры «Системы автоматизации проектирования»
ФГБОУ ВО «Пензенский государственный университет»,
доктор технических наук, профессор

Финогеев Алексей Германович

«12» сентября 2018 г.

Специальности, по которым защищена докторская диссертация: 05.13.01 – «Системный анализ, управление и обработка информации (приборостроение)», 05.13.12 – «Системы автоматизации проектирования (вычислительная техника)»

Адрес: 440026, Россия, г. Пенза, ул. Красная, 40

Телефон: (8412) 36-82-47

E-mail: alexeyfinogeev@gmail.com

