

ОТЗЫВ

на автореферат диссертации Рекундаль Ольги Игоревны
«ФОРМИРОВАНИЕ И УПРАВЛЕНИЕ ИНВЕСТИЦИОННЫМ
ПОРТФЕЛЕМ ПЕНСИОННЫХ НАКОПЛЕНИЙ В ДЕЯТЕЛЬНОСТИ
НЕГОСУДАРСТВЕННЫХ ПЕНСИОННЫХ ФОНДОВ»,
представленной на соискание ученой степени кандидата
технических наук по специальности
05.13.10 – «Управление в социальных и экономических системах»

В диссертации Рекундаль Ольги Игоревны рассмотрена актуальная задача, связанная с решением задачи формирования и управления инвестиционного портфеля с целью повышения эффективности работы негосударственного пенсионного фонда в части обязательного пенсионного страхования.

Автором предложена методика оценки инвестиционной привлекательности облигаций субфедеральных и муниципальных заемщиков для последующего включения их в портфель пенсионных накоплений. Также автором предложена модель формирования инвестиционного портфеля пенсионных накоплений, основанная на модели Марковица, и включающая в свою структуру иммунизированный подпортфель облигаций, и динамическая модель управления сформированным портфелем с линейным и квадратичным критериями качества. По предложенным методике и моделям проведено численное моделирование на реальных данных, что подтверждает работоспособность полученных в диссертации результатов.

Основные результаты диссертационной работы отражены в 12 публикациях, 6 из которых в научных изданиях, рекомендуемых ВАК.

В качестве недостатков нужно отметить следующее:

- 1) из текста автореферата не понятно, как получено решение задачи управления инвестиционным портфелем;

2) имеются замечания к оформлению автореферата: некорректно используются знаки дефис, минус и тире, в ряде случаев отсутствуют необходимые знаки препинания.

Высказанные замечания не являются принципиальными и не уменьшают значимости проведенного Рекундаль О.И. исследования. Диссертация по объему и научной новизне является законченной научно-квалифицированной работой и удовлетворяет требованиям ВАК, предъявляемым к кандидатским диссертациям, а ее автор Рекундаль Ольга Игоревна заслуживает присуждения ученой степени кандидата технических наук по специальности 05.13.10 – «Управление в социальных и экономических системах».

Доктор физико-математических наук, профессор, Заслуженный работник Высшей школы РФ, заведующий кафедрой прикладной математики Новосибирского государственного архитектурно-строительного университета

Ю.Е. Воскобойников

voscob@mail.ru

630008, г. Новосибирск-8, ул. Ленинградская 113, оф.436

Новосибирский государственный архитектурно-строительный университет (Сибстрин)

