

ВЫПИСКА ИЗ ПРОТОКОЛА
заседания диссертационного совета Д 212.232.34 по защите
докторских и кандидатских диссертаций
при Санкт-Петербургском государственном университете
№ 1.2 от «30» апреля 2014 года

ПРИСУТСТВОВАЛИ: 18 членов диссертационного совета из 20 человек.

Сутырин Сергей Феликсович	доктор экономических наук
Воронцовский Алексей Владимирович	доктор экономических наук
Попова Людмила Валерьевна	кандидат экономических наук
Дуболазов Виктор Андреевич	доктор экономических наук
Ефимова Елена Глебовна	доктор экономических наук
Захаров Виктор Васильевич	доктор физико-математических наук
Конюховский Павел Владимирович	доктор экономических наук
Кузнецова Наталия Петровна	доктор экономических наук
Ломагин Никита Андреевич	доктор исторических наук
Межевич Николай Маратович	доктор экономических наук
Панибратов Андрей Юрьевич	доктор экономических наук
Парфенова Валентина Евгеньевна	доктор экономических наук
Погорлецкий Александр Игоревич	доктор экономических наук
Светуных Сергей Геннадьевич	доктор экономических наук
Тютюкин Виктор Константинович	доктор экономических наук
Удовенко Сергей Петрович	доктор экономических наук
Хованов Николай Васильевич	доктор физико-математических наук
Шавшуков Вячеслав Михайлович	доктор экономических наук

ПОВЕСТКА ДНЯ

Принятие к защите диссертации Колодко Дмитрия Владимировича на тему «Применение стабильных агрегированных валют для анализа рынка Forex», представленной на соискание ученой степени кандидата экономических наук по специальности 08.00.13 – Математические и инструментальные методы экономики, утверждение официальных оппонентов и ведущей организации.

СЛУШАЛИ:

сообщение доктора экономических наук, доцента Конюховского П.В., члена комиссии в составе:

Парфенова В.Е., д.э.н., доцента, специальность 08.00.13 – математические и инструментальные методы экономики

Тютюкин В.К., д.э.н., профессор, специальность 08.00.13 – математические и инструментальные методы экономики

о диссертации Колодко Дмитрия Владимировича на тему «Применение стабильных агрегированных валют для анализа рынка Forex» по специальности 08.00.13 – Математические и инструментальные методы экономики, выполненной в Санкт-Петербургском государственном университете.

ПОСТАНОВИЛИ:

1. Утвердить заключение комиссии по решению вопроса о допустимости выявленного объема текстовых совпадений между текстом диссертации Колодко Дмитрия Владимировича «Применение стабильных агрегированных валют для анализа рынка Forex» и источниками, авторство которых установлено, и признать диссертацию оригинальной авторской работой.

2. Утвердить заключение комиссии по решению вопроса о соответствии диссертации Колодко Дмитрия Владимировича «Применение стабильных агрегированных валют для анализа рынка Forex» профилю Диссертационного Совета Д 212.232.34 и заявленной теме;

3. Принять диссертацию на соискание ученой степени кандидата экономических наук к защите;

4. Назначить официальных оппонентов:

№	Фамилия И.О.	Ученая степень	Ученое звание	Должность и место работы
1	Ильин Игорь Васильевич	д.э.н.	профессор	Профессор, заведующий кафедрой «Информационные системы в экономике и менеджменте», Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение высшего профессионального образования «Санкт-Петербургский государственный политехнический университет» (ФГБОУ ВПО СПбГПУ). Адрес структурного подразделения: 195251, Санкт-Петербург, ул. Политехническая, д. 29, III учебный корпус, ауд. 303. Официальный сайт структурного подразделения: http://www.isem-fem.spb.ru Официальный e-mail структурного подразделения: isem@fem.spbstu.ru Официальный телефон структурного подразделения: (812) 534-73-89 Личный e-mail оппонента: ivi2475@gmail.com Личный телефон оппонента: 8 (921) 876-38-95
2	Ичкитидзе Юрий Роландович	к.э.н.	доцент	доцент кафедры исследования операций в экономике имени Ю.А. Львова Федерального государственного бюджетного образовательного учреждения высшего профессионального образования «Санкт-Петербургский государственный

				<p>экономический университет» (ФГБОУ ВПО СПбГЭУ).</p> <p>Адрес структурного подразделения: 191002, Санкт-Петербург, ул. Марата, д. 27, к. 512.</p> <p>Сайт структурного подразделения: http://www.engec.ru/chair/ore</p> <p>Официальный e-mail структурного подразделения: dept.kioe@engec.ru</p> <p>Официальный телефон структурного подразделения: (812) 602-23-24</p> <p>Личный e-mail оппонента: ichkitidze@reflexivity.ru</p> <p>Личный телефон оппонента: 8 (921) 957-29-80</p>
--	--	--	--	--

5. Назначить ведущую организацию - Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение высшего профессионального образования «Санкт-Петербургский государственный аграрный университет» (ФГБОУ ВПО СПбГАУ).

Структурное подразделение: кафедра экономико-математических методов и статистики (экономический факультет СПбГАУ).

Почтовый адрес: 196601, Санкт-Петербург, г. Пушкин, Петербургское шоссе, дом 2.

Официальный сайт организации: srbgau.ru

Официальный e-mail организации: agro@srbgau.ru

Официальный телефон: (812) 470-04-22 (приемная ректора).

6. Назначить защиту диссертации на «24» сентября 2014 г.

7. Утвердить список организаций и лиц рассылки автореферата.

8. Разрешить опубликовать автореферат на правах рукописи.

Решение диссертационного совета принято единогласно.

Председатель Диссертационного Совета

Д 212.232.34, д.э.н., профессор



С.Ф. Сутырин

Ученый секретарь Диссертационного Совета

Д 212.232.34, к.э.н., доцент



Л.В. Попова

ЗАКЛЮЧЕНИЕ ЭКСПЕРТНОЙ КОМИССИИ

Диссертационного совета Д 212.232.34 по защите диссертаций
на соискание ученой степени кандидата наук
и на соискание ученой степени доктора наук
на базе Санкт-Петербургского государственного университета

В составе:

1. Колюховский Павел Владимирович – д.э.н., профессор, специальность 08.00.13 – математические и инструментальные методы экономики;
2. Парфенова Валентина Евгеньевна – д.э.н., профессор, специальность 08.00.13 – математические и инструментальные методы экономики;
3. Тютюкин Виктор Константинович – д.э.н., профессор, специальность 08.00.13 – математические и инструментальные методы экономики.

Ознакомившись с текстом диссертационного исследования Колодко Дмитрия Владимировича на тему «Применение стабильных агрегированных валют для анализа рынка Forex» экспертная комиссия Диссертационного совета пришла к следующим выводам.

1. Признать диссертацию Колодко Дмитрия Владимировича на тему «Применение стабильных агрегированных валют для анализа рынка Forex» соответствующей заявленной специальности.

2. Признать диссертацию Колодко Дмитрия Владимировича на тему «Применение стабильных агрегированных валют для анализа рынка Forex» соответствующей профилю диссертационного совета.

3. Рекомендовать совету принять диссертацию Колодко Дмитрия Владимировича на тему «Применение стабильных агрегированных валют для анализа рынка Forex» на соискание ученой степени кандидата экономических наук.

Диссертация Колодко Дмитрия Владимировича «Применение стабильных агрегированных валют для анализа рынка Forex» является оригинальной авторской работой. Проверка текста, представленного соискателем, на предмет присутствия в нём фрагментов, совпадающих с внешними источниками, производилась средствами программного обеспечения BlackBoard (BlackBoard Inc.), эксплуатируемого в Санкт-Петербургском государственном университете. Данная проверка не выявила фактов неправомерных заимствований, позволяющих усомниться в авторстве соискателя и самостоятельности результатов, выносимых на защиту.

Актуальность направления исследований, выбранного Д.В. Колодко, обусловлена потребностями постоянного совершенствования и развития экономико-математических методов и моделей, обеспечивающих решение задач прогно-

зирования динамики финансовых показателей и хеджирования краткосрочных валютных рисков.

Научная новизна диссертационного исследования определяется оригинальностью экономико-математических методов, разработанных соискателем. Данные методы обеспечивают на новом уровне решение задач мониторинга, анализа и прогнозирования внутридневной динамики валютных курсов и индексов, а также принятия решений на валютном рынке Forex, основанных на применении стабильных агрегированных валют.

К основным, наиболее существенным результатам, выносимым на защиту, относятся:

- Модификация байесовского метода оценивания вероятностей альтернатив динамики валютного рынка, пригодная для поддержки принятия решений при построении прогнозов динамики валютных курсов и позволяющая в дополнение к имеющейся статистической информации учитывать экспертную информацию;
- Выявление отличий реальных процессов внутридневной динамики валютных курсов от модели броуновского движения, а также выявление «эффекта дня недели» для валютных курсов и инвариантных индексов национальных валют.
- Обнаружение факта существенного уменьшения внутридневной волатильности стабильных агрегированных валют, оцениваемой с помощью стандартного отклонения значений нормированного индекса меновой ценности, по сравнению с аналогично измеряемой волатильностью национальных валют.
- Экономико-математическая модель хеджирования краткосрочных рисков с помощью стабильных агрегированных валют;
- Разработка новых финансовых инструментов валютного рынка, основанных на модели стабильных агрегированных валют, применимых для внутридневных финансовых операций. При этом для прогнозирования динамики курсов этих инструментов предложено использовать байесовский метод получения вероятностей альтернатив по системе индикаторов технического анализа и реальным статистическим данным.

Практическая значимость работы состоит в разработке совокупности экономико-математических методов принятия решений при внутридневной торговле на валютном рынке Forex, а также конструировании на основе модели хеджирования валютных рисков с помощью стабильных агрегированных валют новых финансовых инструментов, пригодных для совершения краткосрочных финансовых операций. Выводы и результаты проведенного научного исследования могут послужить основой для дальнейших разработок по данной тематике.


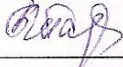

Представленная диссертация соответствует профилю Диссертационного Совета и паспорту специальности 08.00.13 – Математические и инструментальные методы экономики (экономические науки), а именно пунктам п. 1.6. Математический анализ и моделирование процессов в финансовом секторе экономики, развитие метода финансовой математики и актуарных расчетов, п. 2.3. Разработка систем поддержки принятия решений для рационализации организационных структур и оптимизации управления экономикой на всех уровнях. Содержание автореферата соответствует содержанию диссертации.

Основные результаты диссертации, выводы и рекомендации Колодко Дмитрия Владимировича изложены в публикациях. Автором опубликовано пять научных работ, в том числе четыре из них в журналах, рецензируемых ВАК.

Использование в диссертации источников заимствования обозначено ссылками автора на них.

4. На основании рассмотрения диссертации Колодко Дмитрия Владимировича на тему: «Применение стабильных агрегированных валют для анализа рынка Forex» признать, что диссертационное исследование Колодко Дмитрия Владимировича соответствует заявленной специальности (08.00.13 – Математические и инструментальные методы экономики) и профилю Совета, и может быть принято к защите Диссертационным советом 212.232.34 при Санкт-Петербургском государственном университете.

Члены комиссии

 /П.В. Конюховский/
 /В.Е. Парфенова/
 /В.К. Тютюкин/

«30» апреля 2014 г.

ЭКСПЕРТНОЕ ЗАКЛЮЧЕНИЕ

по диссертации Колодко Дмитрия Владимировича, выполненной на тему:
«Применение стабильных агрегированных валют для анализа рынка Forex»
по специальности 08.00.13 – математические и инструментальные методы экономики,
представленной на соискание учёной степени кандидата экономических наук,
о допустимости выявленного объёма текстовых совпадений между текстом диссертации
и источниками, авторство которых установлено, для рассмотрения рукописи диссертации
как оригинальной научно-квалификационной работы

Проверка текста, представленного соискателем, на предмет присутствия в нём фрагментов, совпадающих с внешними источниками, производилась средствами программного обеспечения BlackBoard (BlackBoard Inc.), эксплуатируемого в Санкт-Петербургском государственном университете.

Операции загрузки электронной версии работы в базу данных ПО BlackBoard и формирования технического отчёта о результатах проверки (Paperinformation) были выполнены доцентом кафедры экономической теории СПбГУ, к.э.н О.А. Дроздовым.

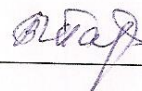
Общий показатель, характеризующий количество найденных совпадений с внешними источниками составил 19% (всего идентифицировано 14 внешних источников). Из них:

- два представляют собой ссылку на сайт <http://uecs.ru> (электронный журнал «Управление экономическими системами»), на котором расположена электронная публикация статьи соискателя «Экспертное краткосрочное прогнозирование валютного рынка Forex»;
- остальные ссылки на внешние источники представляют собой цитаты и сноски, некорректно идентифицированные ПО BlackBoard в качестве подозрительных.

Ряд ссылок не может быть расценен в качестве смысловых совпадений и их присутствие в техническом отчёте объясняется исключительно алгоритмическими погрешностями в работе применяемого программного средства.

На основании изложенных фактов, экспертиза не имеет оснований для сомнений относительно авторства представленного текста и позволяет сделать вывод, что он представляет собой оригинальную научно-квалификационную работу.

Член комиссии Диссертационного совета
Д 212.232.34 при Санкт-Петербургского государственного университета, д.э.н., профессор



/В.Е. Парфенова/

«28» апреля 2014 г.