

СПИСОК

публикаций, в которых излагаются основные научные результаты диссертации
на соискание ученой степени кандидата экономических наук

по научной специальности 5.2.2 – *Математические, статистические и инструментальные методы в экономике на тему:*
«Методические основы применения фрактального анализа для формирования инвестиционных портфелей на международных финансовых рынках»,
опубликованных в рецензируемых изданиях

Гарафутдинова Роберта Викторовича

Author ID (Scopus) – 57315408800

Researcher ID (Web of Science) – A-9122-2019

SPIN (РИНЦ) – 9107-0341

ORCID – 0000-0002-2130-9352

№ п/п	Название публикации на языке оригинала (при иноязычном названии – перевод на англ. / русс. яз.)	Тип публикации	DOI	Наименование издания	ISSN издания	Выходные данные публикации (Номер тома, Номер части тома, Номер журнала, Страницы размещения публикации в журнале, Год)	Интернет - адрес публикации в журнале	Библиографическая база данных (eLIBRARY, Web of Science, Scopus и др.), в которой индексируется публикация	№ публикации в списке литературы диссертации	№ страницы диссертации, на которой приводится ссылка на публикацию	Объем публикации (печ,л/авт.л, личн. вклад)*	Соавторы
1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	11	12	13
1	Применение моделей с долгой памятью для прогнозирования динамики фондового индекса	Статья в сборнике трудов конф.	–	Математика и междисциплинарные исследования – 2018: Материалы Всероссийской научно-практической конференции молодых ученых с международным участием	ISBN: 978-5-7944-3091-2	С. 158–161, 2018	https://elibrary.ru/item.asp?id=35624221	eLibrary (РИНЦ)	23	95, 142	0,46 п.л. / личный вклад 0,46 п.л.	–
2	Анализ фрактальных свойств финансовых рынков для целей прогнозирования	Статья в сборнике трудов конф.	–	Математическое и компьютерное моделирование в экономике, страховании и управлении рисками: Материалы VII Международной молодежной научно-практической конференции	eISSN: 2686-9659	С. 56–61, 2018	https://elibrary.ru/item.asp?id=42577223	eLibrary (РИНЦ)	14	46, 74	0,53 п.л. / личный вклад 0,53 п.л.	–
3	Обзор методов оценивания фрактальных характеристик финансовых временных рядов	Статья в сборнике трудов конф.	–	Аналитические и численные методы моделирования естественно-научных и социальных проблем: Материалы XIII Международной научно-технической конференции	ISBN: 978-5-907102-70-5	С. 97–103, 2018	https://elibrary.ru/item.asp?id=36636604	eLibrary (РИНЦ)	21	35, 46	0,58 п.л. / личный вклад 0,58 п.л.	–

4	Моделирование и прогнозирование динамики курсов финансовых инструментов с применением эконометрических моделей и фрактального анализа	Статья в журнале – научная статья	10.17072/1994-9960-2019-2-268-288	Вестник Пермского университета. Серия «Экономика» = Perm University Herald. ECONOMY	ISSN: 1994-9960	Т. 14, № 2, с. 268–288, 2019	https://elibrary.ru/item.asp?id=38514380	eLibrary (РИНЦ), перечень ВАК	72	31, 46, 76, 95, 101, 142	2,73 п.л. / личный вклад 1,37 п.л.	Симонов П.М.
5	К задаче классификации участков финансовых временных рядов различной размерности	Статья в сборнике трудов конф.	–	Татищевские чтения: актуальные проблемы науки и практики: Материалы XVII Международной научно-практической конференции в 3 томах. Том 1. Гуманитарные и социальные науки, образование. Актуальные проблемы социально-экономического развития	ISBN: 978-5-94510-150-0	С. 226–230, 2020	https://elibrary.ru/item.asp?id=42788793	eLibrary (РИНЦ)	17	76, 91	0,38 п.л. / личный вклад 0,38 п.л.	–
6	Методика формирования инвестиционного портфеля Марковица на базе прогнозных доходностей с ребалансировкой	Статья в сборнике трудов конф.	–	Татищевские чтения: актуальные проблемы науки и практики: Материалы XVII Международной научно-практической конференции в 3 томах. Том 1. Гуманитарные и социальные науки, образование. Актуальные проблемы социально-экономического развития	ISBN: 978-5-94510-150-0	С. 230–233, 2020	https://elibrary.ru/item.asp?id=42788794	eLibrary (РИНЦ)	30	141, 142	0,26 п.л. / личный вклад 0,13 п.л.	Гурова Е.П.
7	Адаптированный метод клеточного покрытия для оценивания фрактальной размерности финансовых временных рядов	Статья в журнале – научная статья	10.15593/2499-9873/2020.3.10	Прикладная математика и вопросы управления	ISSN: 2499-9873	№ 3, с. 185–218, 2020	https://elibrary.ru/item.asp?id=44046154	eLibrary (РИНЦ), перечень ВАК	27	68, 91	2,42 п.л. / личный вклад 1,21 п.л.	Ахуньянова С.А.
8	Программный модуль адаптированного метода клеточного покрытия для оценивания фрактальной размерности временных рядов	Свидетельство о регистрации и программы для ЭВМ № 2020619625 от 20.08.2020	–	–	–	–	–	–	25	60, 91	–	–
9	Влияние «длины» памяти на точность прогнозирования временных рядов с применением модели ARFIMA	Статья в сборнике трудов конф.	–	Математика и междисциплинарные исследования – 2020: Материалы Всероссийской научно-практической конференции молодых ученых с международным участием	ISBN: 978-5-7944-3547-4	С. 226–231, 2020	https://elibrary.ru/item.asp?id=44279594	eLibrary (РИНЦ)	15	116, 142	0,39 п.л. / личный вклад 0,39 п.л.	–

10	Сравнение моделей ARFIMA и ARFIMA-GARCH при формировании инвестиционных портфелей акций на базе прогнозных доходностей	Статья в сборнике трудов конф.	–	Математическое и компьютерное моделирование в экономике, страховании и управлении рисками: Материалы IX Международной научно-практической конференции	eISSN: 2686-9659	С. 59–61, 2020	https://elibrary.ru/item.asp?id=44669780	eLibrary (РИНЦ)	26	140, 142	0,29 п.л. / личный вклад 0,29 п.л.	–
11	Об одном подходе к формированию инвестиционного портфеля Марковица с применением фрактального анализа	Статья в журнале – научная статья	10.3108/5/1814-4802-2021-17-1-77-93	Финансы и бизнес	ISSN: 1814-4802	Т. 17, № 1, с. 77–93, 2021	https://elibrary.ru/item.asp?id=45708025	eLibrary (РИНЦ), перечень ВАК	31	89, 91	1,92 п.л. / личный вклад 0,96 п.л.	Гурова Е.П.
12	Сравнение двух методов фрактального анализа финансовых временных рядов	Статья в журнале – научная статья	10.1559/3/2224-9354/2021.1.14	Вестник ПНИПУ. Социально-экономические науки	ISSN: 2224-9354	№ 1, с. 182–193, 2021	https://elibrary.ru/item.asp?id=45543690	eLibrary (РИНЦ), перечень ВАК	32	73, 91	0,96 п.л. / личный вклад 0,48 п.л.	Куваев В.А.
13	Исследование влияния некоторых параметров модели ARFIMA на точность прогноза финансовых временных рядов / Influence of some ARFIMA model parameters on the accuracy of financial time series forecasting	Статья в журнале – научная статья	10.2239/4/1993-7601-2021-62-85-100	Прикладная эконометрика	ISSN: 1993-7601	Т. 62, № 2, с. 85–100, 2021	https://elibrary.ru/item.asp?id=46180771	eLibrary (ядро РИНЦ), перечень ВАК, Scopus, RSCI	16	95, 116, 142	1,62 п.л. / личный вклад 1,62 п.л.	–
14	Программная реализация дробно-интегрированной модели авторегрессии – скользящего среднего ARFIMA	Свидетельство о регистрации и программы для ЭВМ № 2021616678 от 26.04.2021	–	–	–	–	–	–	24	104, 142, 170	–	–
15	Formation of Investment Portfolios of Two Assets Based on Forecast Returns Using the ARFIMA-GARCH Model	Статья в журнале – научная статья	10.1568/8/ek.jvol su.2021.2.11	Вестник Волгоградского государственного университета. Экономика Journal of Volgograd State university. Economics	ISSN: 2713-1599	Т. 23, № 2, с. 130–136, 2021	https://elibrary.ru/item.asp?id=46414271	eLibrary (РИНЦ), перечень ВАК	101	140, 142	0,83 п.л. / личный вклад 0,83 п.л.	–
16	Применение моделей с длинной памятью для прогнозирования доходности при формировании инвестиционных портфелей	Статья в журнале – научная статья	10.1559/3/2499-9873/2021.2.10	Прикладная математика и вопросы управления	ISSN: 2499-9873	№ 2, с. 171–191, 2021	https://elibrary.ru/item.asp?id=46444979	eLibrary (РИНЦ), перечень ВАК	22	126, 142	1,45 п.л. / личный вклад 1,45 п.л.	–

18/

17	Методика формирования оптимального инвестиционного портфеля Марковица с применением методов фрактального анализа и прогнозных моделей	Статья в сборнике трудов конф.	–	Математика и междисциплинарные исследования – 2021: Материалы Всероссийской научно-практической конференции молодых ученых с международным участием	ISBN: 978-5-7944-3719-5	С. 20–22, 2021	https://elibrary.ru/item.asp?id=47481762	eLibrary (РИНЦ)	19	146, 181	0,34 п.л. / личный вклад 0,34 п.л.	–
18	Сравнение фрактальной и p -адической методик исследования финансовых рынков с использованием модели ARFIMA и p -адической кусочно-линейной функции	Статья в сборнике трудов конф.	–	Математическое и компьютерное моделирование в экономике, страховании и управлении рисками: Материалы X Международной научно-практической конференции	eISSN: 2686-9659	С. 18–22, 2021	https://elibrary.ru/item.asp?id=47888088	eLibrary (РИНЦ)	5	22, 46	0,47 п.л. / личный вклад 0,23 п.л.	Ахуньянова С.А.
19	An Optimal Investment Portfolio Constructed with Fractal Analysis and Long Memory Models	Статья в журнале – материалы конф.	10.1007/978-3-030-89477-1_99	Lecture Notes in Networks and Systems	ISSN: 2367-3370	Vol 342, pp. 1116–1131, 2022	https://elibrary.ru/item.asp?id=47518947	eLibrary (ядро РИНЦ), Scopus	99	146, 158, 181	1,4 п.л. / личный вклад 1,4 п.л.	–
20	Конструктор инвестиционных портфелей с применением фрактального анализа и прогнозных моделей	Свидетельство о регистрации и программы для ЭВМ № 2022662916 от 07.07.2022	–	–	–	–	–	–	18	171, 181	–	–

Подтверждаю, что все основные научные результаты моей диссертации «*Методические основы применения фрактального анализа для формирования инвестиционных портфелей на международных финансовых рынках*» опубликованы в вышеприведенных 20 публикациях, в том числе: в рецензируемых научных изданиях из перечня, утвержденного Минобрнауки РФ – 6 публикаций; в изданиях, индексируемых в наукометрических базах данных Web of Science и Scopus – 2 публикации, в том числе 9 статей – материалов конференций и 3 свидетельства о регистрации программы для ЭВМ.

Вышеуказанные публикации прилагаются на электронном носителе.

Дата

07.11.2022

/ подпись



/ Гарафутдинов Роберт Викторович