

ОТЗЫВ

научного руководителя, доктора экономических наук, профессор Кадырова Абдурахмона Лакимовича на диссертационную работу Шариповой Мухбир Мухторовны на тему «Эконометрическое моделирование прогнозирования курса валюты», представленная на соискание ученой степени кандидата экономических наук по специальности 08.00.13 - Математические и инструментальные методы экономики (экономические науки)

Шарипова Мухбира Мухторовна в 2006 году окончила ГОУ «Худжандский государственный университет им. академика Б.Гафурова» по специальности «Автоматизированные системы обработки информации и управление». С 2013 года работает преподавателем кафедры информационных технологий в экономике. Продолжая работать преподавателем, она с 2017 года является соискателем кафедры информационных технологий в экономике и проводила научное исследование по выбранной тематике и полученные результаты были внедрены в микродепозитной организации «Душанбе Сити» на практике торгов и в учебном процессе при создании и совершенствовании программ учебных курсов по макроэкономике, банковское дело, эконометрике, а также моделирования макроэкономических процессов.

Представленное на защиту диссертационное исследование М.М. Шариповой имеет как научную, так и методологическую обоснованную модель прогнозирования курса валют и выбора стратегии ведения торгов.

Поставленные в диссертации конкретные задачи решались автором последовательно и целеустремленно. Основные результаты проведенных М.М. Шариповой исследований и вычислительных экспериментов соответствуют паспорту специальности 08.00.13 и формулируются следующим образом:

- предложен методологический подход исследования, определения и прогнозирования валютного курса, отражающий эволюцию взглядов и теорий валютного курса в экономической науке;

- обоснован выбор алгоритма прогнозирования валютного курса методом k – ближайших соседей и необходимость его совершенствования с целью

повышения эффективности и точности прогнозирования валютного курса, выработки обоснованных торговых стратегий на торгах в валютном рынке;

- определена мера степени точности алгоритмов прогнозирования валютного курса как: средняя квадратичная ошибка; U – статистика; нормированная среднеквадратичная ошибка;

- разработан алгоритм прогнозирования валютного курса методом k – ближайших соседей на основе расстояния Махаланобиса. Эффективность применения расстояния Махаланобиса в заменах традиционного евклидового расстояния в алгоритме k – ближайших соседей сводится к следующему;

- доказаны преимущества разработанной модели k – ближайших соседей расстоянием Махаланобиса по точности прогнозирования по сравнению с моделями авторегрессии, скользящих средних, смешанной авторегрессии скользящих средних и авторегрессии интегрированной и скользящих средних (АРИСС);

- разработан многоступенчатый алгоритм прогнозирования методом k – ближайших соседей, на основе расстояния Махаланобиса, позволяющий сравнить точные прогнозы и выработать рациональные стратегии торгов на валютном рынке.

По данной теме Шариповой М.М. было опубликовано 10 научных статей, Она участвовала в работе 4 научных конференциях.

Полученные результаты исследования и их научная новизна, выносимые на защиту в специализированном совете являются личным достижением соискателя.

Считаю, что диссертация Шариповой Мухбире Мухторовны «Эконометрическое моделирование прогнозирования курса валюты» представляет собой законченное самостоятельное научно-квалификационное исследование актуальных проблем разработки инструментальных средств поддержки управленческих решений, имеет теоретическую и практическую значимость, соответствует требованиям ВАК РТ при Президенте Республики Таджикистан к кандидатским диссертациям.

В этой связи диссертационная работа Шариповой М.М. рекомендуется к публичной защите, и диссертант заслуживает присуждения ученой степени кандидата экономических наук по специальности 08.00.13 - Математические и инструментальные методы экономики (экономические науки).

Научный руководитель, доктор
экономических наук, профессор,
декан факультета «Финансы
и экономики рынка» ГОУ
«Худжандский государственный
университет им. академика Б. Гафурова»



Кадыров А. Л.

735700, г.Худжанд, пр.
Мавлонбекова 1 тел (83422) 24769
e-mail: kadir55@mail.ru