

УТВЕРЖДАЮ

Ректор ГОУ «Худжандский
государственный университет
имени академика Бободжон
Гафурова» д.и.н., профессор
Джуразода Д.Х.

«09» ноября 2019 г.

ЗАКЛЮЧЕНИЕ

ГОУ «Худжандский государственный университет имени академика Бободжон Гафурова» Министерства образования и науки Республики Таджикистан

Диссертация Шариповой Мухбири Мухторовны на тему «Эконометрическое моделирование прогнозирования курса валюты», выполнена при кафедре управления экономикой и маркетинга ГОУ «Худжандский государственный университет имени академика Б.Гафурова» Министерства образования и науки Республики Таджикистан.

В период подготовки диссертации и по настоящее время Шарипова Мухбира Мухторовна работает в ГОУ «Худжандский государственный университет имени академика Б.Гафурова» в должности преподавателя кафедры информационных технологий в экономике. В 2006 году окончила ГОУ «Худжандский государственный университет имени академика Б.Гафурова» по специальности «Автоматизированная система обработки информации и управления».

Шарипова Мухбира Мухторовна с 2017 года является соискателем кафедры управления экономикой и маркетинга ГОУ «Худжандский государственный университет имени академика Б.Гафурова» по специальности 08.00.13 – Математические и инструментальные методы экономики.

Научный руководитель - Кадыров Абдурахмон Лакимович, доктор экономических наук, профессор кафедры управления экономикой и

маркетинга факультета финансов и экономики рынка ГОУ «Худжандский государственный университет имени академика Б.Гафурова».

Тема диссертационной работы Шариповой Мухбиры Мухторовны утверждена на заседании Ученого совета ГОУ «Худжандский государственный университет имени академика Б.Гафурова» от 28 декабря 2017, протокол № 5.

Удостоверения о сдаче кандидатских экзаменов по истории и философии науки (отлично) 2018 г., иностранный язык (английский – отлично) 2017 г., которые выданы ГОУ «Худжандский государственный университет имени академика Б.Гафурова».

По итогам обсуждения диссертации Шариповой Мухбиры Мухторовны на тему «Эконометрическое моделирование прогнозирования курса валюты» по специальности 08.00.13 – Математические и инструментальные методы экономики принято следующее заключение:

Оценка выполненной работы. Диссертация Шариповой Мухбиры Мухторовны на тему «Эконометрическое моделирование прогнозирования курса валюты» на соискание ученой степени кандидата экономических наук по специальности 08.00.13 - Математические и инструментальные методы экономики представляет собой самостоятельно выполненную научно – исследовательскую работу, результаты которой обеспечивают решение актуальных теоретических и практических задач.

В работе исследована проблема эконометрического моделирования прогнозирования курса валюты. Целью диссертационного исследования заключается в теоретико–методологическом обосновании моделирования прогнозирования курса валюты и выбора стратегии ведения торгов.

Для достижения указанной цели в ходе проведения диссертационного исследования поставлены и решены следующие задачи:

- осуществить анализ эволюции взглядов на теорию валютного курса в экономической науке и на основе этого предложить методологический подход к исследованию валютного курса;

- выявить закономерности развития валютного рынка и обосновать возможность моделирования курса валют, оптимизировать ведение торгов и получение прибыли от колебания курса валют и выгодной сделки на рынке;

- обосновать выбор метода определения расстояния, меры близости для алгоритма прогнозирования курса валют;

- произвести анализ существующих моделей и алгоритмов прогнозирования курса валют при торгах. Осуществить обоснование оценок их эффективности;

- оценить практическую эффективность, высокую точность прогнозирования курса валют предложенным методом и алгоритмом. Разработать программное обеспечение реализации алгоритма прогнозирования в реальном масштабе времени;

- доказать эффективность, точность прогнозирования курса валют алгоритмом ближайшего соседа на основе расстояния Махаланобиса;

- разработать метод ступенчатого прогнозирования курса валют алгоритмом k – ближайшего соседа на основе расстояния Махаланобиса.

Личное участие автора в получении результатов, изложенных в диссертации. Результаты диссертационного исследования и научные положения, выводы и рекомендации автора получены на основе глубокого научного анализа, проведенных математических расчётов и сопоставлений. Выводы соискателя подтверждены расчётами.

Степень достоверности результатов проведенных исследований. Обоснованность и достоверность научных положений, выводов и рекомендаций, сформулированных в диссертации, обеспечивается работами зарубежных и отечественных ученых, имеющих большое значение для прогнозирования и регулирования валютного курса, принятия управленческих решений на всех уровнях функционирования экономики.

Научная новизна диссертационного исследования состоит в следующем:

- в повышении эффективности и точности моделей и алгоритмов прогнозирования валютного курса и стратегии ведения торгов на валютном рынке и их апробации. Получены следующие новые научные результаты:

- 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.

Научное и практическое значение результатов исследования заключается в предложенной модели прогнозирования валютного курса на валютном рынке обоснованного выбора стратегии торгов, эффективно применяется в микродепозитной организации «Душанбе Сити» на практике торгов, так как оценка поведения валютного курса осуществляется в соответствии с данными прогноза. Применение разработанных моделей участниками валютного рынка будет способствовать сокращению издержек, снижению риска принятия необоснованных решений при появлении новых данных, тенденций или существенном изменении внешних факторов.

Ценность научных работ соискателя заключается в том, что в основном были использованы теоретические научные и практические разработки, а также основные положения научных трудов зарубежных, российских и отечественных ученых посвященных проблемам фундаментального, технического, психологического анализа, статистических исследований, разработки теории формирования валютного курса, экономико-математического моделирования прогнозирования валютного курса. В процессе диссертационного исследования применялись общенаучные методы индукции и дедукции, статистические и эконометрические методы, метод максимального правдоподобия, системный анализ.

В качестве информационную базу исследования были использованы данные статистических сборников Агентства статистики при Президенте Республики Таджикистан, законодательные и другие документы органов государственной власти и управления, данные из официальных сайтов международных организаций и банков, а также данные исследований и обработок, полученных автором.

Соответствие содержания диссертации избранной специальности. Диссертационная работа Шариповой Мухбиры Мухторовны на тему «Эконометрическое моделирование прогнозирования курса валюты» выполнена в соответствии со следующими пунктами Паспорта номенклатуры

специальностей научных работников: 1.6 – «Математический анализ и моделирование процессов в финансовом секторе экономики, развитие метода финансовой математики и актуарных расчётов» и 2.10. «Развитие инструментальных методов анализа механизмов функционирования рынков товаров и услуг в условиях глобализации мировой экономики и свободной торговли» паспорта специальности 08.00.13. «Математические и инструментальные методы экономики».

Полнота изложения материалов диссертации в работах, опубликованных соискателем. Основные результаты проведённых исследований и полученных результатов отражены в 10 публикациях, общим объёмом 4,41 п.л., из них 6 публикаций в рецензируемых журналах, рекомендованных ВАК при Президенте Республики Таджикистан.

Список опубликованных работ по теме диссертации:

а) публикации в изданиях, включенных в Перечень ведущих рецензируемых научных журналов и изданий, рекомендуемых ВАК при Президенте Республики Таджикистан:

1. Методы определения курса валют//Учёные записки, Серия естественные и экономические науки – Худжанд: “Нури маърифат”, 2018 - № 4 (47) - С.156-160. (0,5 п.л.).
2. Прогнозирование методом расстояние k -ближайших соседей//Учёные записки, Серия естественные и экономические науки – Худжанд: “Нури маърифат”, 2019 - № 1 (48) – С. 169-172. (0,5 п.л.).
3. Преимущества k -ближайшего прогнозирования по сравнению с традиционными методами// Учёные записки, Серия естественных и экономические науки – Худжанд: “Нури маърифат”, 2019 - № 4 (51) – С. 138-144. (0,7 п.л., в соавтор., автором 0,23).
4. Обоснование размерности вложения и числа ближайших соседей алгоритма k -NN//Учёные записки, Серия естественных и экономические науки – Худжанд: “Нури маърифат”, 2020 - № 1 (52) - С. 171-176. (0,37 п.л.).

5. Прогнозирование методом k -ближайших переменных//Учёные записки, Серия естественных и экономические науки – Худжанд: “Нури маърифат”, 2020 - № 2 (53) - С. 171-176. (0,56 п.л.).
6. Криптовалюта Биткойн: деньги или финансовые инвестиции//Учёные записки, Серия естественных и экономические науки – Худжанд: “Нури маърифат”, 2020 - № 2 (53) - С. 171-176. (0,6 п.л., в соавтор., автором 0,15).

б) в других изданиях:

7. Инструментально – математические исследования курса валют методом Махаланобиса//Материалы республиканской научно-практической конференции “Перспективы и факторы обеспечения устойчивого развития экономики” – (г.Худжанд, 15 – 16 ноября 2018г.) – Худжанд: “Меҳвари дониш”, 2018 – С. 342 – 347, (0,4 п.л.).
8. Прогнозирование валютного курса//Материалы международной научно – практической конференции “Социально – экономическое и культурное сотрудничество Таджикистана и Узбекистана: история и современность” – (г.Худжанд, 21 – 22 июня 2019г.) – Худжанд: “Нури маърифат”, 2019 – С.803 – 809, (0,4 п.л.).
9. Многоступенчатое прогнозирование алгоритмом ближайших соседей//Республиканской научно – практической конференции на тему “Развитие науки и ее практика реализации в период формирования цифровой экономики” – (г.Худжанд, 24 – 25 декабря 2019г.) – Худжанд: “Нури маърифат”, 2019 – С. 224 – 228, (0,8 п.л.).
10. Сравнение точности прогнозирования методов ближайшего соседа k –NN и АРИССа//Материалы международной научно – практической конференции на тему “Индустриализация страны и обеспечение устойчивого развития экономики” – (27 – го февраля 2002г.) – Душанбе: Типография ТНУ, 2020 – С.557 – 560, (0,5 п.л.).

Диссертационная работа Шариповой Мухбирой Мухторовны на тему «Эконометрическое моделирование прогнозирования курса валюты»

рекомендуется к защите на соискание ученой степени кандидата экономических наук по специальности 08.00.13 - Математические и инструментальные методы экономики.

Присутствовало на заседании 15 человек, из них с правом решающего голоса 15 человек, из них по специальности рассматриваемой диссертации докторов наук – 1.

Результаты открытого голосования:

«за» - 15 человек;

«против» - нет;

«воздержавшиеся» - нет.

Заключение принято на заседании кафедры управления экономикой и маркетинга ГОУ «Худжандский государственный университет имени академика Б.Гафурова» от 09 ноября 2019 года, протокол № 4/а.

Председатель

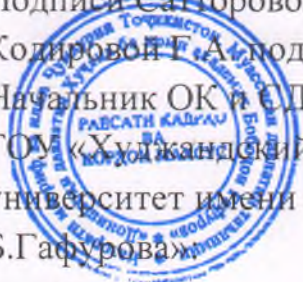
Заведующий кафедрой управления экономикой и маркетинга ГОУ «Худжандский государственный университет имени академика Б.Гафурова», к.э.н.

Сатторова М.Р.

Секретарь

Кодирова Г.А.

Подписи Сатторовой М.Р. и Кодировой Г.А. подтверждаю:
Начальник ОК и СД
ГОУ «Худжандский государственный университет имени академика Б.Гафурова»



Ашрапова З.Н.