



ФАКУЛЬТЕТ БИЗНЕС-ИНФОРМАТИКИ
ОТДЕЛЕНИЕ ПРИКЛАДНОЙ МАТЕМАТИКИ И ИНФОРМАТИКИ

ОТЗЫВ НАУЧНОГО РУКОВОДИТЕЛЯ

На выпускную квалификационную работу студента 4 курса, группы 472ПМ отделения прикладной математики и информатики факультета бизнес-информатики
Рыбалка Алексея Игоревича

на тему: **Формирование сигнальной системы для организации макропруденциального надзора за ликвидностью коммерческих банков**

Актуальность работы

Выпускная квалификационная работа (ВКР) Рыбалка Алексея Игоревича является результатом его научной работы на кафедре «Банковское дело» в рамках научно-учебной группы (НУГ) «Моделирование дефолтов кредитных организаций» и посвящена созданию системы раннего оповещения системного кризиса. Считаю работу актуальной, в связи с тем, что мировой финансовый кризис 2008-2009 гг. подтвердил, что построение моделей раннего оповещения и мониторинга риска ликвидности является очень значимой и актуальной задачей всего банковского сообщества.

Самостоятельность выполнения работы

Работа представляет собой комплексное исследование, отражающее как теоретические, так и практические аспекты применения инструментальных средств оценки системных рисков в целом, и риска ликвидности, в частности. Основной характеристикой работы Рыбалка Алексей Игоревича является большой объем изученной литературы и достаточная самостоятельность, т.к. некоторые используемые для анализа темы не входят в изучаемые дисциплины бакалавриата.

Оценка работы

А.И. Рыбалка провел большую работу по систематизации моделей, по их адаптации к поставленной задаче. При построении моделей использовались современные экономические и математические подходы, а также адекватные критерии выбора моделей. Полученные сигнальные модели показали хорошие результаты на выбранном для анализа временном отрезке. Также А.И. Рыбалка были определены дальнейшие перспективы исследований и развития сформированных моделей.

Выпускная квалификационная работа Рыбалка А.И. выполнена на достаточно высоком уровне, соответствует по содержанию, структуре и оформлению требованиям, предъявляемым к выпускным работам бакалавриата. Это позволяет мне рекомендовать работу к защите на заседании экзаменационной комиссии. По моему мнению, работа заслуживает отличной оценки (9).

Д.т.н., д.э.н., проф.
Карминский А. М.

(подпись)

(расшифровка подписи, ученая степень,

ученое звание, должность)

«29» мая

(указать дату написания

заявления)

2013

год