

## Отзыв

на автореферат диссертационной работы Ощепкова Ивана Алексеевича на тему **«Повышение точности макроэкономического анализа и прогнозирования в РФ на основе динамического стохастического моделирования»**, представленной на соискание ученой степени кандидата экономических наук по специальности 08.00.13 – Математические и инструментальные методы экономики

### Актуальность темы исследования

Диссертационная работа Ощепкова Ивана Алексеевича посвящена проблемам моделирования экономики России с помощью аппарата динамического стохастического общего равновесия (DSGE). В существующих DSGE-моделях России недостаточно внимания уделено проблеме моделирования ожиданий экономических агентов (по аналогии с западными моделями используется концепция рациональных ожиданий), а также взаимосвязи цены на нефть с национальной российской валютой. Из-за этого ранее разработанные DSGE-модели оказываются не вполне приспособленными к экономике России, что приводит к снижению качества прогнозов. Необходимость развития данного типа моделирования, его адаптации к условиям стран с развивающейся экспортноориентированной экономикой обуславливают актуальность темы исследования.

### Новизна и научная значимость диссертационной работы

1. Разработан новый класс DSGE-моделей, основанный на гипотезе адаптивных ожиданий и использовании нелинейных зависимостей между инфляцией и ставкой процента.
2. Разработана DSGE-модель России, предназначенная для краткосрочного прогнозирования влияния мер экономической политики на макроэкономические процессы в месячной динамике.
3. Разработана модель прогнозирования валютного курса, позволяющая учитывать фактор цены на нефть, характерный для национальной экономики, и свойственный DSGE-моделям подход на основе паритета процентных ставок.
4. Создан специализированный программный комплекс, реализующий авторский подход к DSGE-моделированию и автоматизирующий весь жизненный цикл разработки и эксплуатации DSGE-модели, начиная от сбора и обработки статистической информации и заканчивая

построением отчетных форм по результатам проведенных прогнозных расчетов.

#### Практическая значимость исследования

По результатам диссертации получено государственное свидетельство о регистрации разработанного программного обеспечения, что свидетельствует о существенном практическом значении диссертационной работы.

#### Замечания по диссертационной работе

1. В автореферате автором не рассмотрена возможность использования для моделирования фильтров, отличных от фильтра Ходрика-Прескотта;
2. Концентрируясь в своем исследовании на политике Центрального банка, автор оставляет без внимания моделирование наполнения доходной части бюджета РФ, находящегося в ведении Министерства финансов.

#### Заключение по диссертационной работе

Сделанные замечания не носят принципиального характера.

В целом диссертация Ощепкова Ивана Алексеевича является квалифицированной научной работой в области DSGE-моделирования макроэкономического уровня экономики.

Автореферат отвечает требованиям ВАК, а его автор – Ощепков Иван Алексеевич – заслуживает присуждения ему ученой степени кандидата экономических наук по специальности 08.00.13 – математические и инструментальные методы экономики.

Руководитель направления,  
ООО «Информ-Консалтинг»,  
кандидат экономических наук

Дьячков Николай Викторович

«16» июня 2017 г.

Почтовый адрес: 614068, Россия, г. Пермь,  
ул. Сергея Данцина, д.5, офис 223  
Рабочий телефон: (342) 237-14-77  
E-mail: [info@incon.ru](mailto:info@incon.ru)



*Подпись  
первого  
главного уч...* 2