

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»

Серия финансовых кризисов в различных странах, начиная с 90-х годов прошлого столетия, повлиявших на мировую экономику и финансовые системы других стран, подтвердила актуальность проблемы оценки валютного риска и прогнозирования валютного курса. Существующие макроэкономические модели прогнозирования, как показывает практика, не дают сегодня объяснения возникающей динамики макроэкономических показателей, поскольку не учитывают особенности национальной экономики России. В связи с этим, а также в связи с возрастанием значения прогнозирования валютного курса и количественной оценки валютного риска для сохранения устойчивого положения субъектов экономики в условиях глобализации и либерализации валютных рынков и необходимостью совершенствования российской практики прогнозирования макроэкономических показателей в условиях интеграции России в мировое сообщество тема диссертации является актуальной.

Наиболее существенные результаты диссертационного исследования, содержащие научную новизну:

1. На основе динамического стохастического моделирования построены новые модели, учитывающие современные правила денежно-кредитной политики и позволяющие проводить более глубокий анализ процесса регулирования макроэкономических параметров России благодаря учёту адаптивных ожиданий экономических агентов.

2. Построена краткосрочная динамическая стохастическая модель общего равновесия экономики России, основанная на эконометрических методах и позволяющая повысить точность прогнозных оценок равновесных значений макроэкономических показателей

3. Предложена качественно новая методика прогнозирования валютного курса доллара к рублю, основанная на паритете процентных ставок и рублевой цене на нефть, учитывающая дополнительные факторы развития экономики России.

Практическая значимость результатов диссертационного исследования заключается в том, что разработанный в рамках диссертационного исследования программный комплекс АО «ПРОГНОЗ» может быть применен для построения краткосрочного макроэкономического прогноза с высокой точностью.

Теоретическая значимость исследования состоит в развитии теории и методологии экономико-математического моделирования национальной экономики на основе динамических стохастических моделей общего равновесия с адаптивными инфляционными ожиданиями.

Высоко оценивая автореферат представленной работы, следует сделать некоторые замечания.

Вынесенная на защиту модель прогнозирования валютного курса доллара к рублю (пункт 3 автореферата) недостаточно подробно отражена в автореферате, что не позволяет

понять, является ли предложенный подход лучше существующих на сегодня методик, и если является, то почему.

В пункте 2 автореферата автором предложена краткосрочная динамическая стохастическая модель общего равновесия экономики России, построенная на данных с января 2000 года по декабрь 2016 года. Однако верификация модели производилась по кризисному 2014 году (рис. 2). Возникает естественный вопрос, на сколько качественно произведена верификация в условиях стресс-тестирования экономики и можно ли применять эту модель в условиях, отличных от кризиса.

Перечисленные замечания носят дискуссионный характер и не снижают значения полученных в процессе исследования результатов.

Исходя из вышеизложенного, диссертационное исследование на тему «Повышение точности макроэкономического анализа и прогнозирования в РФ на основе динамического стохастического моделирования» является законченной научной работой, соответствует требованиям ВАК, предъявляемым к кандидатским диссертациям, а его автор – Ощепков Иван Алексеевич заслуживает присуждения ученой степени кандидата экономических наук по специальности 08.00.13 – «Математические и инструментальные методы экономики».

Доктор физико-математических наук,
профессор, заведующий кафедрой
математических методов в экономике
ФГБОУ ВО «Удмуртский государственный
университет»

Лётчиков Андрей Владимирович

«10» мая 2017 г.

Подпись Лётчикова А.В. заверена
Надпись: 000000113
10.05.2017.

Т. Н. Радзевская

Адрес: 426034, Удмуртская Республика, г. Ижевск, ул. Университетская, 1.

Телефон: 8 (3412) 916-065

E-mail: letchi@udm.ru