

УТВЕРЖДАЮ:

Проректор по научной работе ФГБОУ ВО
государственный университет»
«БашГУ»), доктор химических наук

Захаров Вадим Петрович

2017г.

ОТЗЫВ

ведущей организации

на диссертацию Ощепкова Ивана Алексеевича

«Повышение точности макроэкономического анализа и прогнозирования
в РФ на основе динамического стохастического моделирования»,

представленную на соискание ученой степени кандидата экономических наук по
специальности 08.00.13 – «Математические и инструментальные методы экономики»

Актуальность темы диссертации

Развитие национальной экономики является одной из важнейших задач государственного управления. Большое значение при управлении национальной экономикой имеет точность оценки последствий принимаемых управленческих решений. Задача оценки последствий принимаемых управленческих решений решается с помощью экономико-математического моделирования. Игнорирование ожиданий экономических агентов приводит к снижению точности макроэкономических прогнозов, что обуславливает актуальность развития аппарата динамического стохастического моделирования. Для обеспечения органов государственной власти новым инструментом макроэкономического прогнозирования автор разработал программный комплекс.

Таким образом, диссертация И.А. Ощепкова затрагивает актуальную проблему, существующую сегодня в экономике России, этим определяется практическая ценность работы.

Автор диссертации разработал новый класс динамических стохастических моделей общего равновесия (DSGE-моделей), основанный на гипотезе адаптивных ожиданий экономических агентов, что позволяет построить непротиворечивое описание экономической системы. Автор диссертации также исследует проблему прогнозирования валютного курса национальной экономики России и на основании оригинального подхода выводит новую модель, позволяющую учитывать факторы со стороны мирового рынка нефти, потоков капитала, инфляционных процессов, а также монетарной политики Банка России. Данные результаты определяют научную ценность работы.

Исходя из актуальности данной темы, автор сформулировал цель диссертационного исследования, грамотно и логично декомпозировал цель работы на задачи исследования, которые нашли отражение в структуре и содержании диссертационного исследования.

Научная новизна, обоснованность и достоверность научных положений, выводов и рекомендаций, сформулированных в диссертации. Соответствие паспорту специальности ВАК РФ.

Новизна научной работы заключается в следующем.

1. На основе DSGE-подхода предложены новые уравнения, учитывающие правила денежно-кредитной политики, управление реальной ставкой процента и позволяющие проводить более глубокий анализ процесса регулирования макроэкономических параметров России благодаря учёту адаптивных ожиданий экономических агентов. В авторской модели, в отличие от существующих аналогов, используемых в DSGE-моделях, в качестве целей денежно-кредитной политики учитываются и экономический рост, и стабильность валютного курса, и достижение низкой инфляции, а также нелинейная зависимость от инфляции, что позволяет учитывать высокие темпы роста цен в российской экономике (п. 1.8. – *Математическое моделирование экономической конъюнктуры, деловой активности, определение трендов, циклов и тенденций развития* паспорта специальности 08.00.13 ВАК РФ) (глава 2, параграфы 2.1.1–2.1.5, стр. 46–53 диссертации).

2. Разработана краткосрочная динамическая стохастическая модель общего равновесия экономики России, в отличие от существующих аналогов включающая уравнения, полученные с помощью эконометрических методов, что позволило моделировать равновесные значения показателей на основе факторных, а не экстраполяционных зависимостей и, как следствие, повысить точность прогнозных оценок. В отличие от существующих моделей, авторская предусматривает не квартальные, а месячные данные ВВП, что позволяет повысить точность прогноза наступления кризисных событий (п. 1.3. – *Разработка и исследование макромоделей экономической динамики в условиях равновесия и неравновесия, конкурентной экономики, монополии, олигополии, сочетания различных форм собственности* паспорта специальности 08.00.13 ВАК РФ) (глава 2, параграфы 2.1.6, 2.2.1–2.2.5, глава 3, раздел 3.2, 3.3, стр. 62–76, 84–100 диссертации).

3. Выведена качественно новая модель прогнозирования валютного курса доллара к рублю, основанная на паритете процентных ставок и рублевой цене на нефть, отличающаяся от существующих аналогов объединением различных подходов к прогнозированию валютных курсов, что позволяет более полно анализировать курсообразование на российском валютном рынке и повысить точность прогнозирования за счет учета большего числа факторов (п. 1.6. – *Математический анализ и моделирование процессов в финансовом секторе экономики, развитие метода финансовой математики и актуарных расчетов* паспорта специальности 08.00.13 ВАК РФ) (глава 2, параграф 2.1.5, стр. 53–62 диссертации).

4. Разработан уникальный программный комплекс «ПРОГНОЗ. Динамическая стохастическая модель общего экономического равновесия Российской Федерации», предназначенный для краткосрочного прогнозирования влияния мер экономической политики на ключевые макроэкономические параметры РФ на основе DSGE-моделей и включающий средства интеграции с базами данных, необходимыми для DSGE-моделирования, визуальные средства разработки и отладки DSGE-моделей, возможность проведения многовариантных расчетов и хранения их результатов (п. 2.6. – *Развитие теоретических основ методологии и инструментария проектирования, разработки и сопровождения информационных систем субъектов экономической деятельности: методы формализованного представления предметной области, программные средства, базы данных, корпоративные хранилища данных, базы знаний, коммуникационные технологии* паспорта специальности 08.00.13 ВАК РФ) (глава 3, раздел 3.1, стр. 78–84 диссертации).

Научная аргументация и обоснованность положений базируется на анализе трудов отечественных и зарубежных авторов, касающихся различных аспектов работы, таких как вопросы макроэкономического моделирования, исследования подходов к моделированию ожиданий экономических агентов. Автор использует следующие инструменты научного анализа: методы макроэкономического анализа, статистического анализа, структурного и динамического анализа, динамического стохастического моделирования общего равновесия, эконометрического моделирования, экспертные методы.

Достоверность работы обеспечивают информационные источники, взятые за основу. Среди них официальные данные Федеральной службы государственной статистики, Министерства экономического развития РФ, Банка России, Международного валютного фонда. Таким образом, автор провел глубокое исследование научной и статистической литературной базы, различные аспекты которой нашли отражение в результатах работы.

Значение полученных результатов для науки и практики

Результаты работы имеют важное теоретическое и практическое значение. Теоретическая значимость работы состоит в предложенном подходе к решению задачи развития динамического стохастического моделирования, учитывающего адаптивные ожидания. Заслуживают внимания также результаты использования нелинейных зависимостей между инфляцией и ставкой процента, характерных для национальной экономики.

Реальной практической значимостью работы, можно назвать разработанный автором программный комплекс, предназначенный для автоматизации построения DSGE-моделей. Программный комплекс разработан на основе платформы бизнес-аналитики PrognozPlatform и является примером готового для внедрения в правительственные институты решения. На текущий момент в программном комплексе уже построена авторская динамическая стохастическая модель общего равновесия для экономики России, которая используется АО «Институт экономических исследований»

Министерства национальной экономики Республики Казахстан для краткосрочного прогнозирования экономики РФ и её влияния на экономику Республики Казахстан.

Апробация полученных результатов

Результаты работы апробированы в сфере государственного управления, сфере образования и коммерческой сфере.

Так, результаты, полученные в диссертационной работе, используются в прогнозно-аналитической деятельности АО «Институт экономических исследований» Республики Казахстан. Теоретико-методологические исследования автора используются при чтении лекций, проведении практических занятий в ФГБОУ ВО «Пермский государственный национальный исследовательский университет». Разработанный программный комплекс используется в коммерческих проектах АО «Прогноз». Автор представил результаты работы на многочисленных научно-практических конференциях, семинарах регионального и международного масштаба, получил положительные отзывы.

По теме работы опубликовано 7 научных работ в изданиях, входящих в список, определенный Высшей аттестационной комиссией Министерства образования и науки РФ.

Отдельно стоит отметить, что в результате выполнения диссертационной работы получено свидетельство о государственной регистрации программы для ЭВМ.

Замечания по диссертационной работе

В целом, положительно оценивая выполненную работу, отмечаем что работа выиграла бы при устранении ряда замечаний:

1. Диссертант использует ряд спецификаций уравнений из зарубежных исследований, не объясняя из каких соображений он выбирает именно эту форму моделей.
2. Автор строит прогнозы лишь на краткосрочную перспективу, хотя было бы полезно узнать более долгосрочные тенденции развития национальной экономики.
3. Диссертант представляет модельные прогнозы в табличном виде, в то время как было бы нагляднее сопроводить их диаграммами.
4. В работе используется фильтр Ходрика-Прескотта, при этом не приводится сравнение результатов его применения с другими статистическими фильтрами.

Заключение

Диссертация Ощепкова Ивана Алексеевича на соискание ученой степени кандидата экономических наук является выполненной на высоком уровне научно-квалификационной работой, в которой достигается цель повышения точности макроэкономического прогнозирования на основе динамического стохастического моделирования. Работа соответствует паспорту специальности 08.00.13. Ощепков Иван Алексеевич заслуживает присуждения степени кандидата экономических наук по специальности 08.00.13 – Математические и инструментальные методы экономики.

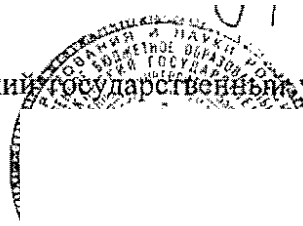
Отзыв подготовил доктор экономических наук, профессор Бахитова Раиля Хурматовна, текст отзыва обсужден и утвержден на заседании кафедры математических методов в экономике ФГБОУ ВО «Башкирский государственный университет» (протокол №8 от 26.04.2017).

Заведующий кафедрой
«Математические методы в
экономике» ФГБОУ ВО «Башкирский
государственный университет»,
доктор экономических наук,
профессор

п

Бахитова Раиля Хурматовна

Адрес ФГБОУ ВО «Башкирский государственный университет»: Россия, 450076, г. Уфа,
ул. Заки Валиди, д. 32
Тел.: (347) 229-96-06
E-mail: kaf_mme@mail.ru



Бахитова
ный секретарь БашГУ
Э.Р. Бахитова
профессор 20 17 г.