

Отзыв научного руководителя о диссертации Шимановского Дмитрия Викторовича «Разработка методов прогнозирования Российского рынка корпоративного кредитования с учетом неценовых ограничений» на соискание ученой степени кандидата экономических наук по специальности «08.00.13 - Математические и инструментальные методы экономики»

Диссертация Д.В. Шимановского посвящена актуальной задаче развития и повышения эффективности математических и инструментальных методов исследования экономических процессов на уровне банковской системы Российской Федерации, на основе класса используемых эконометрических моделей и разработки современного компьютерного инструментария с целью повышения научной обоснованности принимаемых управленческих решений.

Реализация поставленной цели определила необходимость решения следующих задач:

- 1) построить экономико-математическую модель равновесного состояния на кредитном рынке, содержащую наиболее значимые неценовые детерминанты спроса и предложения на банковские ссуды;
- 2) на основе системы эконометрических уравнений построить экономико-математическую модель, позволяющую проводить краткосрочное прогнозирование важнейших показателей российского кредитного рынка;
- 3) разработать методы управления макроэкономическими показателями на основе экономико-математических моделей, состоящих из систем эконометрических уравнений

Поставленные в диссертации конкретные задачи решались автором последовательно и целеустремленно. Основные результаты проведенных Д.В. Шимановским исследований и вычислительных экспериментов соответствуют паспорту специальности 08.00.13 и формулируются следующим образом: предложен авторский подход к моделированию равновесного состояния на кредитном рынке, существенное значение в котором имеют факторы неценовой конкуренции между кредитными организациями, позволяющий выявить основные неценовые детерминанты спроса и предложения на кредиты и

проводить анализ зависимости траектории развития кредитного рынка от изменения политики банков относительно неценовых характеристик кредитования. На основе данного подхода построена экономико-математическая модель равновесного состояния кредитного рынка.

Разработана модель прогнозирования показателей кредитного рынка на основе системы эконометрических уравнений, которая позволяет вывести зависимость будущего развития конъюнктуры рынка заемных средств от изменения ключевой ставки Банка России в текущий момент времени, а также отличается наличием факторов, отвечающих за неценовую политику кредитных организаций.

Предложены новые методы управления параметрами и инструментами кредитно-денежной политики в их системной взаимосвязи на основе использования авторской системы эконометрических уравнений, описывающих состояние кредитного рынка.

Дмитрий Викторович Шимановский проявил способности к научной работе, будучи еще студентом экономического факультета ПГНИУ. За время обучения в аспирантуре он вырос до специалиста, способного решать трудные и актуальные задачи в сфере разработки современных средств поддержки обоснованных управленческих решений на различных уровнях экономики. Замечу, что Шимановский Д.В. учился на бюджетном месте в аспирантуре экономического факультета в ПГНИУ.

Результаты диссертации Д.В. Шимановского использованы при выполнении комплексных проектов фирмы ЗАО «ПРОГНОЗ» по заказу с Центрального банка Российской Федерации.

Считаю, что диссертация Д.В. Шимановского «Разработка методов прогнозирования Российского рынка корпоративного кредитования с учетом неценовых ограничений» представляет собой завершенное самостоятельное научно-квалификационное исследование актуальных проблем разработки инструментальных средств поддержки управленческих решений, имеет

теоретическую и практическую значимость, удовлетворяет требованиям ВАК Министерства образования и науки РФ к кандидатским диссертациям, а Дмитрий Викторович Шимановский заслуживает присуждения ученой степени кандидата экономических наук по специальности «08.00.13 - Математические и инструментальные методы экономики».

Доктор физико-математических наук, профессор
кафедры «Информационные системы и
математические методы в экономике» ФГБОУ
ВПО «Пермский государственный
национальный исследовательский университет»



/Пётр Михайлович Симонов/

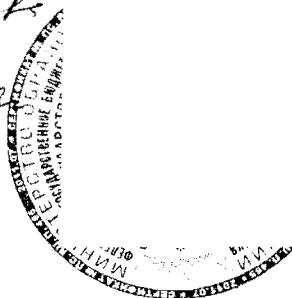
Симонов Пётр Михайлович
614990, Пермь, ул. Букирева, 15,
Экономический факультет ПГНИУ,
8(342)2396849, 8(342)243028,
E-mail: simpm@mail.ru

Подтверждаю свое согласие на обработку моих персональных данных.



/Пётр Михайлович Симонов/

Сторжис Симонов
Ученый секретарь



8.11.2017
Е.П. Анисимов