

ОТЗЫВ

на автореферат кандидатской диссертации

Шимановского Дмитрия Викторовича на тему:

«Разработка методов прогнозирования российского рынка корпоративного кредитования с учетом неценовых ограничений»,
представленной на соискание учёной степени кандидата экономических наук по специальности 08.00.13 – «Математические и инструментальные методы экономики»

Актуальность темы диссертационной работы связана с необходимостью прогнозирования и оценки возможностей рынка корпоративного кредитования российскими банками, а также повышения прогнозной силы разрабатываемых моделей.

Судя по автореферату, работа хорошо структурирована и логично выстроена. Используются достаточно современные методы прогнозирования, которые основываются на тщательном отборе и спецификации параметров кредитного рынка, связанные с моделированием именно рынка корпоративного кредитования. Используемый статистический материал представляется достаточно обоснованным.

Полученные результаты исследования отличаются достаточной теоретической новизной, которая заключается в разработке новых методов прогнозирования показателей корпоративного кредитования на основе выбранного математического аппарата. Автор сформировал методику, обеспечивающую повышение уровня достоверности прогнозирования основных параметров рынка заемных средств, учитывающих неценовую политику кредитных организаций.

Весьма важно, что полученные научные результаты доведены до практической реализации, что, согласно автореферату, подтверждено актом внедрения в ОАО «Прогноз» и учебных курсах ПГУ. Результаты работы потенциально могут быть использованы Банком России. Возможность использования полученных результатов крупнейшими отечественными банками не совсем очевидна, но после определенной модификации и конкретизации предложенных моделей может быть возможной.

Вместе с тем следует отметить, что:

1. Автором не рассмотрены возможности оценки неизвестных параметров методами, альтернативными МНК, например, методом максимального правдоподобия.
2. Модель была построена на выборке, предшествующей либерализации валютного рынка. Поэтому неизвестно, нужна ли фиктивная переменная, отражающая тип валютной политики макрорегулятора.

Указанные замечания не снижают научной и практической значимости проведенного исследования и не влияют на основные теоретические и практические результаты диссертации.

В целом, автореферат и список публикаций автора позволяют сделать вывод, что диссертационная работа является законченным научным исследованием, имеет теоретическую значимость и практическую ценность. Она, судя по автореферату, соответствует критериям «Положения о порядке присуждения ученых степеней», предъявляемым к кандидатским диссертациям, а ее автор – Шимановский Дмитрий Викторович, заслуживает присуждения ученой степени кандидата экономических наук по специальности 08.00.13 – «Математические и инструментальные методы экономики».

Доктор экономических наук,
доктор технических наук, профессор,
профессор кафедры экономики и организации производства
факультета инженерного бизнеса и менеджмента,
Московский государственный технический университет
им. Н.Э. Баумана

Александр Маркович Карминский

Подпись профессора Карминского А.М. заверяю



Ж. бухгалтер
Сапрокина Н.С.

Московский государственный технический университет им. Н.Э. Баумана

Адрес: Россия. 105005, г. Москва, ул. 2-ая Бауманская, д. 7

Тел.: (499) 267-02-22

E-mail: ibm2@ibm.bmstu.ru