Отзыв

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

В проблеме анализа эффективности финансовой системы мало уделяется внимания учету факторов, выходящих за рамки ценовой политики кредитных организаций. Очевидно, что факторы, связанные с планируемыми банками неценовыми параметрами кредитного портфеля, влияют на конъюнктуру кредитного рынка и представляют интерес со стороны Центрального Банка Российской Федерации при разработке рациональной кредитно-денежной политики. Учет данных факторов дает новое понимание причин изменения равновесного состояния на кредитном рынке и позволяет разработать новые методы прогнозирования его важнейших показателей.

В данном диссертационном исследовании решена проблема повышения достоверности прогнозирования макропоказателей российской банковской системы за счет разработки новых методов, учитывающих неценовую политику кредитных организаций, а также предложены новые механизмы управления конъюнктурой кредитного рынка через инструменты кредитно-денежной политики. Инструмент прогнозирования, разработанный в рамках диссертационной работы, позволяет управлять двумя важнейшими показателями рынка корпоративного кредитования (процентной ставкой и темпом прироста объема портфеля корпоративных кредитов) с помощью основного инструмента кредитно-денежной политики Банка России – ставки рефинансирования.

Замечания по оформлению автореферата:

1) на стр. 8 в формулах (2) и (3) не раскрыто содержание параметров a и b;
2) на стр. 12 небрежно написана формула (6): одна и та же переменная в разных уравнениях имеет разное количество индексов. Если это полиморфизм, то следовало бы дать пояснения.

Замечания по содержанию:

1) к сожалению, в работе отсутствует анализ стрессоустойчивости банков и банковской системы, а также влияние эволюции количества агентов;
2) отсутствует государственная регистрация разработанных инструментальных средств.

Несмотря на отмеченные замечания, анализ автореферата позволяет охарактеризовать диссертационную работу как самостоятельное завершенное исследование, выполненное в соответствии с Паспортом специальности 08.00.13 – Математические и инструментальные методы экономики. Диссертационная работа содержит элементы научной новизны, является теоретически и практически значимой. Автор работы Шимановский Дмитрий Викторович заслуживает присуждения ученой степени кандидата экономических наук по специальности 08.00.13 – Математические и инструментальные методы экономики

Зав. кафедрой «Экономико-математических
методов и статистики» ФГБОУ ВПО ЮУрГУ (НИУ),
454080, г. Челябинск, пр. Ленина, 76
8-351 -267-90-39, paniukovav@susu.ac.ru,
д.ф.-м.н., профессор А.В.Панюков

10.05.2016

ВЕРНО
Начальник службы
делопроизводства ЮУрГУ
Чиклина