

ОТЗЫВ

на автореферат диссертации Черкасовой Н.А. на тему:

«Разработка методики оптимизации параметров отраслевого развития»,
представленной на соискание ученой степени кандидата экономических наук
по специальности 5.2.2 Математические, статистические и инструментальные
методы в экономике.

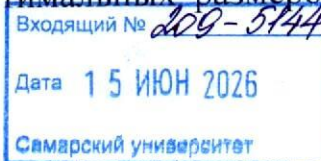
Диссертационное исследование Черкасовой Н.А. посвящено актуальной и научно значимой проблеме построения экономико-математических моделей управления развитием отраслей реального сектора в условиях нестабильной макроэкономической среды. Работа выполнена в рамках специальности 5.2.2. Математические, статистические и инструментальные методы в экономике и направлена на решение прикладных задач, связанных с оптимизацией распределения ресурсов, учетом влияния денежно-кредитной политики и инфляционных процессов на производственные показатели.

Актуальность темы обусловлена необходимостью перехода от агрегированного макроэкономического прогнозирования к адресному отраслевому моделированию в РФ. В условиях геополитической турбулентности, санкционного давления и высокой волатильности инфляционных и процентных ставок, традиционные методы прогнозирования становятся недостаточно точными.

Ключевые результаты, обладающие новизной и выносимые на защиту:

– интегрированная модель динамики. Автор предлагает оригинальную систему уравнений, где эндогенные факторы (собственные средства, накопленная прибыль, основные фонды) и экзогенные факторы (кредитные ставки, инфляция) рассматриваются в единой динамической системе, что позволяет учитывать временные лаги в формировании финансового состояния отрасли.

– аналитическое решение задачи оптимизации параметров отраслевого развития. Получены аналитические выражения для оптимальных размеров



операционных расходов и инвестиций в основные фонды, как функций от кредитной ставки и инфляции, что дает возможность сценарного анализа.

– алгоритм методики оптимизации параметров отраслевого развития. Разработан детальный алгоритм, представленный в виде блок-схемы, для построения сценариев развития отрасли, который может быть представлен в программной реализации.

– идентификация моделей для ВЭД и сценарный анализ. Работа содержит конкретные результаты калибровки моделей для четырех ключевых ВЭД (ОКВЭД В07, С24, С20, С25) и демонстрирует различия в чувствительности секторов к изменению процентных ставок. В работе доказано, что ВЭД с высокой долей заимствований (например, добыча руд) критически более чувствительны к росту ставок, чем ВЭД с высоким собственным финансированием (металлургическое производство).

Достоверность результатов обеспечивается использованием обширного массива официальной статистической базы данных Росстата, применением апробированных методов эконометрического анализа и корректной постановкой задачи оптимизации с применением реалистичных ограничений.

Однако, в работе присутствуют отдельные недостатки, требующие внимания:

1. В теоретической части работы достаточно подробно рассматриваются рекуррентные зависимости, отражающие влияние результатов прошлых периодов на текущие финансовые возможности отрасли. Однако менее детально проработан обратный канал связи: как текущие решения по инвестициям и операционной деятельности влияют на формирование будущих внутренних условий?


2. В работе инфляция рассматривается как внешний параметр. Возникает вопрос о том, как гипотетически может измениться модель, если отрасли оказывают обратное влияние на инфляцию (например, через инфляционные ожидания).

Указанные замечания не умаляют научной и практической ценности диссертационной работы, которая содержит оригинальные результаты, представляющие научную новизну.

Таким образом, диссертационная работа Черкасовой Н.А. представляет собой законченное научное исследование, в котором решена актуальная задача разработки методики оптимизации параметров отраслевого развития.

Диссертационное исследование вносит существенный вклад в развитие математических методов в экономике, предлагая эффективный инструмент для анализа сценариев развития промышленного комплекса в условиях изменяющейся денежно-кредитной политики. Автор демонстрирует глубокое понимание предмета исследования, владеет современными методами эконометрического моделирования и оптимизации.

На основании вышеизложенного можно сделать вывод о том, что диссертация Н.А. Черкасовой «Разработка методики оптимизации параметров отраслевого развития» соответствует требованиям, предъявляемым к диссертациям на соискание ученой степени кандидата экономических наук пунктам 9 – 14 Положения о присуждении ученых степеней, утвержденного постановлением Правительства Российской Федерации от 24 сентября 2013 года № 842, а ее автор, – Черкасова Наталия Анатольевна, заслуживает присуждения ученой степени кандидата экономических наук по специальности 5.2.2 Математические, статистические и инструментальные методы в экономике.

ФГБОУ ВО «КНИТУ-КАИ», доцент кафедры ЭТиУР, к.э.н., доцент	Юнусов Ильдар Альбертович 
420111, Россия, Республика Татарстан, г. Казань, ул. К. Маркса, 10, Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение высшего образования «Казанский национальный исследовательский технический университет им. А.Н. Туполева-КАИ», 79276777434@yandex.ru, +79276777434	



Подпись
за Верью

