

ОТЗЫВ НАУЧНОГО РУКОВОДИТЕЛЯ

кандидата экономических наук, доцента Шагас Наталии Леонидовны на диссертацию Сугаипова Д.Р. на тему «Моделирование влияния новостных шоков на основные макроэкономические показатели», представленную на соискание ученой степени кандидата экономических наук по специальности 5.2.2. Математические, статистические и инструментальные методы в экономике.

При принятии макроэкономических решений нередко приходится учитывать, как ожидания экономических агентов могут повлиять на основные показатели. В свою очередь эти ожидания во многом зависят от поступающих из различных источников новостей. В зарубежной литературе эта проблема обсуждается достаточно подробно, чего нельзя сказать об отечественных источниках. Между тем в нашей хозяйственной деятельности важную роль играют достаточно специфические новости, не характерные для других стран. Это, например, обсуждения возможных будущих санкций, которые способны повлиять на решения экономических агентов еще до их введения. Причем новостные шоки могут исходить не только от внешних источников, но и от внутренних, что требует адекватного отражения в научных исследованиях. Поэтому представленная работа, посвященная моделированию влияния новостных шоков на основные макроэкономические показатели в Российской Федерации, несомненно, является актуальной.

Цель и задачи исследования вытекают из обоснования актуальности и степени разработанности проблемы, сформулированы грамотно и логично. В работе используются продвинутое макроэкономические модели (DSGE), современные эконометрические методы и методы численных имитационных вычислений, что говорит о соответствии работы указанной специальности.

Основной теоретический результат состоит в разработке модификации динамической стохастической модели общего равновесия для российской экономики с учетом влияния новостей на рынок труда. Впервые показано, что направление влияния этих новостей на уровень занятости зависит от деятельности посредников на этом рынке.

Важным практическим результатом является демонстрация влияния новостных шоков на макроэкономические колебания в российской экономике. Выявление еще одного источника деловых циклов важно для проведения стабилизационной политики органами экономического управления.

В контексте научной специальности также важным результатом можно считать разработку методов идентификации новостных шоков, состоящих в выявлении ключевых показателей, которые необходимо учитывать при эконометрическом моделировании.

Содержание диссертации полностью соответствует Паспорту научной специальности.

Результаты работы доложены и одобрены на четырех международных конференциях, основные положения, выносимые на защиту, опубликованы в журналах, рекомендованных ВАК МГУ имени М.В. Ломоносова, что свидетельствует в пользу их значимости и достоверности. Применяемые эконометрические методы и методы имитационного моделирования использованы грамотно, это позволило подтвердить выдвинутые автором гипотезы о влиянии шоков условий торговли на экономические колебания, продемонстрировать степень и направление влияния этих шоков на основные макроэкономические показатели РФ.

Д.Р. Сугаипов работал над диссертацией последовательно и в достаточной мере самостоятельно, всегда живо откликался на критику и учитывал сделанные замечания. В процессе работы проявил навыки вдумчивого и глубоко погруженного в проблему исследователя, свободно владеющего современными методами математического и эконометрического моделирования, способного обсудить экономический смысл и прикладное значение полученных результатов

Считаю, что представленная работа соответствует всем требованиям, предъявляемым к диссертациям по специальности 5.2.2. Математические, статистические и инструментальные методы в экономике. Диссертация Д.Р. Сугаипова рекомендуется к защите в диссертационном совете МГУ.052.5.

Научный руководитель –
доцент кафедры микро- и
макроэкономического анализа
экономического факультета
МГУ имени М.В. Ломоносова
к.э.н., доцент

Шагас Н.Л.

11.09.2025