

В диссертационный совет
ФГОБУ ВО «Финансовый университет при Правительстве Российской
Федерации» Д 505.001.111 по защите диссертаций на соискание ученой степени
кандидата наук, на соискание ученой степени доктора наук

ОТЗЫВ

на автореферат диссертации Бачаева Умара Александровича на тему: «Непараметрическое моделирование на основе копула-функций в анализе пространственного развития Российской Федерации», представленной на соискание ученой степени кандидата экономических наук по специальности 5.2.2 Математические, статистические и инструментальные методы в экономике.

Выбранная тема диссертационного исследования является актуальной, так как, как отмечено в автореферате, «региональные данные отличаются высокой неоднородностью, пространственной кластеризацией и асимметрией связей показателей..., что ограничивает применимость классических подходов к их моделированию». Соответственно, важно попробовать использовать более продвинутые, нежели классический эконометрический анализ, подходы.

Автор ставит основной целью исследовать влияние социально-экономических факторов на демографическую динамику, при этом основным инструментом введения в модель вышеуказанных особенностей региональных данных является использование Vine-копул. Это позволяет выявить скрытые нелинейные и хвостовые зависимости между социально-экономическими факторами. Далее, для получения практически значимых выводов проводится сценарный анализ.

Вместе с тем, автореферат не лишен некоторых недостатков.

Во-первых, в разделе «Степень разработанности темы исследования» недостаточно ясно перечисляемые работы разделены на теоретические и эмпирические. Из эмпирических работ упомянута только одна (О.А. Демидова. Д.С. Иванов). При этом перечисляются лишь фамилии авторов, но не даются точные библиографические ссылки.

Во-вторых, не совсем удачно сформулирована первая задача: «Систематизировать теоретические основы копула-моделирования...». В сущности, копулы являются классическим объектом в статистике, им посвящена в том числе и учебная литература, поэтому стоило точнее указать, в чем состоит первая задача, сделав акцент на применимости к региональному анализу.

Во-третьих, в разделе «Научная новизна» говорится, что она заключается в «разработке и апробации экономико-математического инструментария...». Но далее, из раздела «Основного содержания работы» все-таки не понятно, действительно ли в диссертации разрабатывается новый инструментарий, или применяется известный инструментарий.

Тем не менее, по представленному автореферату можно сделать вывод, что диссертация Бачаева Умара Аптиевича на тему: «Непараметрическое моделирование на основе копула-функций в анализе пространственного развития Российской Федерации» соответствует критериям, предъявляемым к диссертационным работам на соискание ученой степени

кандидата наук, Положения о присуждении ученых степеней, утвержденного Постановлением Правительства Российской Федерации от 24.09.2013 № 842, 2 а ее автор, У.А. Бачаев, заслуживает присуждения ученой степени кандидата экономических наук по специальности 5.2.2. Математические, статистические и инструментальные методы в экономике.

Доцент кафедры
математических методов анализа экономики,
к.ф.-м.н., доцент

Артамонов Дмитрий Вячеславович

23 июня 2026

ФГБОУ ВО
Московский Государственный Университет
имени М.В. Ломоносова,
119991, ГСП-1, Ленинские горы 1, с 46,
Экономический факультет.
artamonov@econ.msu.ru
+79104452646

Ко.
Зам.
Фак.

Ф.
В.
«.

Т.
Л.
Г.

От:
утв

