

Санкт-Петербургский государственный университет
Кафедра математической теории экономических решений

Отзыв научного руководителя на выпускную квалификационную работу
Кравченко Любови Андреевны на тему:
«Функция субъективного благополучия с эндогенными базисными точками»

Выпускная квалификационная работа Кравченко Л.А. посвящена актуальной теме исследования субъективного благополучия индивида. Проведенный анализ базируется на математической модели Koszegi, Rabin (2009). Используемая при моделировании функция субъективного благополучия является агрегатом стандартной функции полезности потребления и так называемой «поведенческой» полезности, связанной с различием между реальным потреблением и ожиданиями индивида (их точками отсчета).

Кравченко Л.А. проявила увлеченность и достаточную самостоятельность. В частности, ею был проведен обширный обзор англоязычной литературы, посвященной исследованиям субъективного благополучия экономических агентов. Качество использованных источников является высоким.

В рамках модели Koszegi, Rabin (2009) рассматривалась задача оптимального выбора ожиданий. Авторами принималось предположение о кусочной линейности функции отношения к отклонениям от точки отсчета. Целью работы Кравченко Л.А. являлось исследование решений задачи рационального формирования ожиданий при отсутствии данного упрощающего предположения. В работе рассмотрена двухпериодная модель с детерминированным уровнем благосостояния.

В ходе исследования был выбран специальный вид функции отношения к отклонениям от точки отсчета, удовлетворяющий всем стандартным свойствам, но не являющийся кусочно линейным. Проведен численный анализ задачи нахождения предпочитаемого персонального равновесия. Исследована зависимость решений от различных параметров модели, работа содержит большое количество наглядных иллюстраций.

В результате выявлено, что при использовании выбранного вида функции отношения к отклонениям от точки отсчета и при некоторых наборах параметров множество оптимальных ожиданий пусто, что свидетельствует о несостоятельности предложенной Koszegi, Rabin концепции предпочитаемого персонального равновесия при рассмотрении общего вида функции полезности от соотношения выгод и потерь.

Работа не лишена некоторых недостатков, в частности, содержит большое количество опечаток (например, «основающихся», стр. 4; «не выполняются», стр. 19; «существуют», стр. 23 и т.д.). Кроме того, наблюдается некоторая небрежность в формулировках (например, «очищаем PE», стр. 14; «точки несуществования равновесных ожиданий», стр. 25). Однако в целом работа написана на достаточно высоком уровне.

Обозначенные выше замечания носят непринципиальный характер и не влияют на общее положительное впечатление от работы. Считаю, что Кравченко Л.А. заслуживает оценки «отлично».

25.05.2017

К.ф.-м.н., старший преподаватель каф. МТЭР, Лукина А.А.

