

В диссертационный совет Д 212.196.06 на базе
ФГБОУ ВО «Российский экономический
университет им. Г.В. Плеханова», 117997,
г. Москва, Стремянный пер., д. 36, корпус 3,
каб.353

ОТЗЫВ ОФИЦИАЛЬНОГО ОППОНЕНТА

**д.э.н., профессора Афанасьева Владимира Николаевича
на диссертационную работу Суркова Антона Александровича на тему
«Совершенствование статистических методов прогнозирования в
разработке стратегии экономического развития», представленную на
соискание ученой степени кандидата экономических наук по
специальности 08.00.12 - Бухгалтерский учет, статистика
(экономические науки)**

Актуальность темы исследования

Темой диссертации Суркова А.А. является совершенствование статистических методов прогнозирования в разработке стратегии экономического развития государства и использование для этих целей методики объединения прогнозов. Данная тема остается актуальной для современной России, так как одним из направлений экономического развития сегодня является становление системы государственного стратегического планирования и социально-экономического прогнозирования.

За рубежом имеется огромный опыт по применению стратегического планирования в экономике. Россия относительно недавно начала использовать экономическое планирование в своей деятельности по

принятию решений. В связи с этим, является актуальным исследование применения статистических методов прогнозирования для целей макроэкономического планирования.

Но для макроэкономического планирования чрезвычайно важно совершенствование качества полученных прогнозных значений экономических показателей. Одним из возможных направлений в достижении совершенствования экономического прогнозирования с точки зрения повышения точности и качества получаемых прогнозных результатов по мнению Суркова А.А. может стать использование методики объединения прогнозов.

Объединение прогнозов уже широко используемый инструмент в прогнозировании. Но автор, делая акцент на применении данной методики, определяет направления, которые являются проблематичными для объединения (с. 107). Такими направлениями является совершенствование методики построения весовых коэффициентов с целью исключения отрицательности весов и применение экспертных подходов при объединении. Последнее особенно актуально в условиях цифровизации общества и экономики, когда экспертное сообщество может дать более точный прогноз чем статистические методы, так как оперирует дополнительной информацией при составлении оценки.

Все вышесказанное определяет актуальность выбранной Сурковым А.А. темы исследования и позволяет говорить о том, что полученные результаты могут принести вклад в приращение научного знания о точности прогнозирования и экономическом прогнозе.

Область диссертационного исследования

Тема диссертационного исследования и содержание работы соответствует требованиям Паспорта научной специальности 08.00.12 – Бухгалтерский учет и статистика (экономические науки):

п. 4.1. Исходные парадигмы, базовые концепции, основополагающие принципы, постулаты и правила статистики;

п. 4.9. Методы статистического измерения и наблюдения социально-экономических явлений, обработки статистической информации, оценка качества данных наблюдений; организация статистических работ;

п. 4.11. Методы обработки статистической информации: классификация и группировки, методы анализа социально-экономических явлений и процессов, статистического моделирования, исследования экономической конъюнктуры, деловой активности, выявления трендов и циклов, прогнозирования развития социально-экономических явлений и процессов;

п. 4.16. Прикладные статистические исследования воспроизводства населения, сфер общественной, экономической, финансовой жизни общества, направленные на выявление, измерение, анализ, прогнозирование, моделирование складывающейся конъюнктуры и разработки перспективных вариантов развития предприятий, организаций, отраслей экономики России и других стран.

Степень обоснованности научных положений, выводов и рекомендаций, сформулированных в диссертации

Обоснованность научных положений, сформулированных в диссертации, заключается в обширной научно-теоретической, методологической и эмпирической базе исследования.

Автор работы достаточно глубоко изучил зарубежный и отечественный опыт разработки стратегии экономического развития государства, смог оценить соотношения плана и прогноза, разобрался в существующем положении направления объединения прогнозов, смог определить основные проблемы данного направления. Это подтверждается списком литературы, состоящим из 142 наименований, причем литературы как отечественных

ученых и исследователей, так и зарубежных. Первая глава диссертации отражает научно-теоретическую базу исследования.

Выполненный анализ проблематики прогнозирования и планирования, применяемых методов экономического прогноза и методики объединения прогнозов позволил сформулировать и обосновать цель исследования – повышение точности статистических методов прогнозирования.

Вторая глава исследования посвящена методологической базе исследования. В работе используется широкий круг статистических методов исследования, такие как регрессионный анализ, инструменты эконометрики, прогнозирования, методы построения интегрального показателя и другие. Кроме того, автор уделил много внимания исследованию области методик построения весовых коэффициентов при объединении прогнозов, что позволило ему выделить основные методики, совершенствующие точность экономического прогнозирования.

В третьей главе Сурков А.А. дал описание практической базы исследования, на которой были проверены выдвигаемые в работе выводы. В работе использовались временные ряды продукции, широко охватывающие промышленное производство России. Полученные результаты стали подтверждением цели и задач диссертационной работы.

Все это позволяет сделать вывод об обоснованности выдвигаемых научных положений в исследовании.

Научная новизна исследования, достоверность полученных результатов, выводов и рекомендаций, сформулированных в диссертации

Полученные основные научные положения и выводы диссертационной работы Суркова А.А. достоверны, имеют теоретическое и практическое значение. Это подтверждается анализом структуры и содержания диссертации.

Наиболее существенными результатами, полученными, в том числе и автором (авторство по программе антиплагиат – 27.95 %), как следует из диссертационной работы, являются:

1. Выявлены преимущества и недостатки применения методики объединения прогнозов на основе проведенного анализа существующих методов повышения точности экономического прогнозирования с использованием как статистических оценок качества методов прогнозирования, так и на иных подходах, связанных с последовательным и параллельным прогнозированием (с. 62-66).

2. Реализована классификация существующих методов построения весовых коэффициентов при объединении прогнозов, используемых в социально-экономическом прогнозировании, состоящая из семи основных подходов к объединению прогнозов, основанных на различных способах минимизации ошибки прогнозирования и построения весов (с. 88). С учетом данной классификации выделены наиболее часто встречающиеся на практике методы объединения, применение которых в большинстве случаев приводит к повышению точности прогнозирования (с. 98-105).

3. Разработаны методы объединения прогнозов, основанные на использовании последовательного объединения (с. 110), оптимизации весовых коэффициентов (с. 114) и применения аппарата гребневой регрессии (с. 117), исключающие возможность получения отрицательных весов и весов больше единицы при объединении.

4. Предложены методы объединения прогнозов, основанные на экспертной информации, позволяющие использовать дополнительную внешнюю информацию, не включенную в применяемых в объединении индивидуальных методов прогнозирования, что еще больше повышает точность прогнозирования (с. 130-132).

5. Проведенный сравнительный анализ точности полученных результатов прогнозирования с использованием частных методов и

описанных методов объединения прогнозов позволяет сделать практический вывод о целесообразности применения того или иного метода и выявить наиболее точный метод объединения прогнозов (с. 192-195).

6. Сформирована методика повышения точности социально-экономического прогнозирования через применение объединения прогнозов, которую можно использовать на уровне как частного прогнозирования отдельных экономических временных рядов, так и государственного стратегического планирования. (с. 133-140).

Полученные результаты и выводы в диссертационной работе имеют практическое внедрение в работу Центра макроэкономического анализа и прогнозирования Института Экономики РАН. На основе предложенных методов была скорректирована методика при расчетах Конъюнктурного Индекса Экономической Активности, который публикуется Центром на постоянной основе, а сами методы объединения прогнозов используются при прогнозировании промышленного производства, результаты которого так же постоянно публикуются Центром. Кроме того, полученные результаты исследования используются Департаментом учета, анализа и аудита ФГОБУ ВО «Финансовый университет при Правительстве РФ» в преподавании учебных дисциплин «Экономическая статистика» и «Статистика». Все это подтверждено соответствующими документами и справками о внедрении.

Достоверность результатов исследования подтверждается также и публикациями автора. Основные результаты исследования опубликованы в 6 научных работах общим объемом 8,0 п.л. в рецензируемых научных изданиях, определенных ВАК Минобрнауки России.

Теоретические и практические результаты исследования докладывались автором на 4 международных конференциях и научных семинарах, в том числе на XXII Международной научно-практической конференции «Совершенствование тенденций развития науки и техники» (г. Белгород, АПНИ, 2017 г.); на Международной научно-методической

конференции «Образование будущего: новые кадры для новой экономики» (Москва, Федеральное государственное образовательное бюджетное учреждение высшего образования «Финансовый университет при Правительстве Российской Федерации», 2018 г.); на XI Всероссийской научно-практической конференции «Социально-экономические и естественнонаучные парадигмы современности» (г. Ростов-на-Дону, Южный Университет (ИУБиП), 2018 г.); и на XIII Международном симпозиуме «Эволюция иерархических структур в экономике и экономический рост» (г. Пущино, ИЭ РАН, 2019 г.).

Все вышеуказанное подтверждает достоверность научных положений диссертационной работы.

Оценка содержания диссертации и ее завершенность

Анализируя полученные результаты, необходимо сделать вывод что автору диссертации удалось решить поставленные цель и задачи исследования. В работе были обоснованы научные положения, которые обеспечивают приращение знаний в области экономического прогнозирования.

Диссертация характеризуется внутренним единством, имеет четкую структуру, состоящую из введения, трех глав, заключения, списка литературы и приложения.

Автореферат диссертации и опубликованные научные работы по теме исследования полностью отражают основные выдвигаемые в работе выводы и положения.

Замечания и рекомендации

Несмотря на отмеченные достоинства, исследование Суркова А.А. имеет ряд недостатков, часть из них носит дискуссионный характер:

1. В качестве индивидуальных методов прогнозирования в работе на практике используются только адаптивные методы (с. 69), такие как экспоненциальное сглаживание, метод гармонических весов и модель Бокса-Дженкинса, при этом, в самой работе также дается описание и других методов, которые используются сегодня в экономическом прогнозировании: VAR-модели (с. 79-80), модели с использованием систем однородных уравнений (с. 79) и с использованием нейронных сетей (с. 80-81), что является достаточно актуальным направлением сегодня. Исследование приобрело бы дополнительную актуальность если бы автор рассмотрел бы использование объединения прогнозов и на указанных выше методах прогнозирования.

2. Прогноз по применяемым в исследовании методам строится на период 2019-2023 гг. Но при сравнении с результатами, прогнозируемыми МЭР период указан как 2018-2023 гг. (стр. 197). Видимо при обновлении фактических данных за 2018 г. был упущен этот момент в сравнении с данными министерства.

3. Стоило бы расширить описание полученных прогнозных результатов для используемых в работе временных рядов и раскрыть их экономическое значение.

4. В первых пяти пунктах новизны не просматривается явной связи с заявленной темой работы касательно разработки стратегии экономического развития. Говорится либо об экономическом, либо о социально-экономическом прогнозировании, только в п. 6 упоминается стратегическое планирование. Социально-экономическое прогнозирование очень обширная категория, тогда как прогнозирование в разработке стратегии экономического развития подразумевает исследование именно в данном контексте. Кроме того, если речь идет о стратегии экономического развития, и автор далее исследует временные ряды по РФ, следует отметить, что правительством РФ разрабатывается каждые 6 лет соответствующий

документ - «Стратегия социально-экономического развития РФ» (относится к документам стратегического планирования, разрабатываемым в рамках целеполагания на федеральном уровне). То есть, это важно, как таковой, без обязательной увязки с социальными процессами, целеполагания и, соответственно, прогнозирования, стратегии экономического развития быть не может.

5. Автор использует в работе понятие «отрасли экономики» (включая даже в название параграфов). С 1 февраля 2014 г. приказом Федерального агентства по техническому регулированию и метрологии введен в действие Общероссийский классификатор видов экономической деятельности (ОКВЭД) (с последующими редакциями) взамен отмененного Общероссийского классификатора отраслей народного хозяйства (ОКОНХ). Государственное статистическое наблюдение по видам деятельности за субъектами национальной экономики и социальной сферы, подготовка статистической информации для сопоставлений на международном уровне, обеспечение потребностей органов государственной власти и управления в информации о видах экономической деятельности при решении аналитических задач проводится согласно данному классификатору.

6. В первой главе автор отмечает, что «на сегодняшний день в отечественной литературе очень мало уделяется внимания использованию объединения прогнозов в экономическом прогнозировании». Объединение частных прогнозов (как правило, путем их суммирования с весовыми коэффициентами) - это получение «комбинированного» прогноза (гибридной модели). Данной тематике исследования посвящены труды многих отечественных ученых (Френкеля А.А., Васильева А.А., Ершова Э.Б., П.М. Брусиловского, С.М. Ковалева, А.А. Давыдова, В.Н. Афанасьева и др.) Так, например, метод комбинирования прогнозов в анализе инфляции

является важным прогнозным инструментом Банка России. Стратегия объединения прогнозов используется в долгосрочном прогнозировании ВВП, инвестиций, индекса промышленного производства.

6. В третьей главе (п. 3.1) автором анализируются уровни производства некоторых видов промышленной продукции, что не является обозначенными автором в названии параграфа «отдельными отраслями экономики России».

В названии п 3.5 некорректным является выражение «по отдельным продуктам промышленного производства». Статистический учет ведется по продукции (работам, услугам).

7. В третьей главе (с. 158) автор приводит следующее утверждение: «по результатам построения модели прогнозирования можно сделать вывод, что, хотя постоянный коэффициент «С» и коэффициент при скользящем среднем и являются статистически незначимыми при 5%-ном уровне значимости, модель в целом значима и является адекватной (по F-критерию Фишера). Таким образом, данной моделью можно пользоваться для прогнозирования».

Если значения вычисляемой t-статистики для оценки параметров незначимы, соответствующие параметры удаляются из модели.

Кроме того, диагностика модели предполагает оценку не только ее значимости, но и адекватности. Показателем качества построенной модели АРПСС (и вышеприведенных моделей экспоненциального сглаживания) является анализ остатков. Модель АРПСС адекватно описывает исходные данные, если остатки модели являются некоррелированными нормально распределенными случайными величинами. То есть необходимо провести анализ АКФ и ЧКФ, либо Q-тест остаточных отклонений и оценивание ряда остатков на близость к нормальному распределению. И только после этого делать вывод об адекватности модели и возможности ее использования в экономическом прогнозировании.

Указанные недостатки не снижают актуальности диссертационного исследования и не умаляют достоинств работы. Тем более что часть замечаний может быть учтена и использована в дальнейшей научной работе автора. Следует обратить внимание на то, что научный руководитель кандидат наук не имеющий по данной тематике публикаций.

Заключение о соответствии диссертации критериям, установленным Положением о присуждении ученых степеней

Представленная к рецензированию диссертация написана автором самостоятельно, обладает внутренним единством, четко структурирована. Результаты и положения, выдвигаемые для защиты, имеют как актуальность, так и научную новизну. Отмеченные выше замечания не снижают научной и практической значимости работы. Новые полученные результаты позволяют сделать вывод о том, что соискателем разработаны новые методы объединения прогнозов, решающие проблему отрицательности весовых коэффициентов при объединении и которые могут повысить точность прогнозирования. Предлагаемая в работе методика объединения прогнозов может быть использована для повышения качества прогнозных результатов при разработке стратегических планов и прогнозов экономического развития государства.

Диссертационная работа соответствует требованиям п. 9 «Положения о присуждении учёных степеней» (утв. постановлением Правительства РФ от 24 сентября 2013 № 842), предъявляемым к диссертациям на соискание учёной степени кандидата наук, а её автор Сурков Антон Александрович заслуживает присуждения учёной степени кандидата экономических наук по специальности 08.00.12 - Бухгалтерский учет, статистика (экономические науки).

Официальный оппонент:

доктор экономических наук, профессор,
заведующий кафедрой статистики
и эконометрики ФГБОУ

«Оренбургский государственный
университет»



Владимир Николаевич Афанасьев

Афанасьев Владимир Николаевич

доктор экономических наук, профессор,

Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение
высшего образования «Оренбургский государственный университет»,

460018, г. Оренбург, просп. Победы, д. 13,

Тел.: +7 (3532) 77-67-70,

E-mail: kstat@mail.osu.ru,

Научная специальность 08.00.11 – Статистика,

Год защиты докторской диссертации: 1996.

Подпись профессора Владимира Николаевича Афанасьева

ЗАВЕРЯЮ

Пр



А.С. Боровский