

В диссертационный совет Д 212.196.15 на базе
ФГБОУ ВО «Российский экономический
университет им. Г.В. Плеханова»

ОТЗЫВ

на автореферат диссертации Моисеева Никиты Александровича на тему: «Развитие методологии повышения качества эконометрических исследований», представленной на соискание ученой степени доктора экономических наук по специальности 08.00.13 – Математические и инструментальные методы экономики

Актуальность темы диссертации Моисеева Н.А. не вызывает сомнения, что объясняется следующими обстоятельствами. Попытки непосредственного использования в условиях динамично меняющихся экономических процессов моделей на базе традиционного регрессионного анализа приводят к неудовлетворительным результатам. Решение проблемы повышения точности прогнозирования временных рядов макроэкономических процессов, а также повышения надежности получаемых доверительных интервалов связывается с совершенствованием экономико-математических методов многофакторного моделирования.

Как следует из автореферата, целью исследования является разработка и совершенствование экономико-математического инструментария прогнозирования временных рядов макроэкономических процессов с учетом их особенностей, а именно: наличия большого количества структурных сдвигов, наличия функциональных и корреляционных связей между моделируемыми индикаторами и ограниченности размера окна исходных данных.

Судя по автореферату, для достижения сформулированной цели соискателю удалось с успехом решить все поставленные задачи и предложить устойчивые решения таких проблем регрессионного анализа, как проблема определения уровня значимости предикторов при проведении процедуры спецификации, проблема вычисления весовых коэффициентов для набора подмоделей, рассчитанных на окнах данных различной длины и различающихся по составу, проблема определения надежных доверительных интервалов при проведении процедуры динамической спецификации и взвешивания моделей и проблема рассогласованности прогнозов при одновременном прогнозировании набора взаимосвязанных экономических процессов.

По тексту автореферата считаю необходимым сделать следующее замечание. Одним из ключевых результатов исследования является предложенный соискателем численный алгоритм построения интервальных прогнозов с помощью многофакторной регрессионной модели, в частности приводится метод вычисления числа степеней свободы для синергетической модели. Однако в соответствующей части автореферата этому методу уделяется незаслуженно малое внимание – приведены несколько формул, не позволяющих стороннему читателю самостоятельно воспроизвести расчеты автора и получить число степеней свободы для произвольной модели. В то же время объем автореферата позволяет рассмотреть предложенный алгоритм более детально и тем самым повысить его практическую применимость.

В целом, данное замечание не снижает общую положительную оценку обсуждаемой диссертационной работы, по отношению к которой можно сделать вывод, что она является законченным научно-практическим исследованием на актуальную, практически значимую тематику, связанную с разработкой и совершенствованием моделей и методов прогнозирования временных рядов социально-экономических процессов.

На основании автореферата считаю, что диссертация «Развитие методологии повышения качества эконометрических исследований» отвечает требованиям действующего Положения о порядке присуждения ученых степеней, утвержденного Постановлением Правительства Российской Федерации №842 от 24.09.2013 г., а Моисеев Никита Александрович заслуживает присуждения ученой степени доктора экономических наук по специальности 08.00.13 – Математические и инструментальные методы экономики.

Профессор кафедры экономики,
организации и стратегии развития
предприятия ФГБОУ ВО «Самарский
государственный экономический
университет», д.э.н., доцент

О.А. Булавко

Булавко Ольга Александровна
Адрес: 443090, Россия, г. Самара, ул. Советской Армии, д.141
Тел.: 8 (846) 933 87 78, www.sseu.ru, e-mail: ecun@sseu.ru

