

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**

Судя по автореферату, в диссертации Н.А. Моисеева подытожены результаты обширного цикла работ, теоретического и прикладного характера, достаточно апробированных научным сообществом и опубликованных, в частности, в монографии «Методы повышения достоверности прогнозных эконометрических исследований», 2019 г. и др. изданиях.

Несмотря на наличие значительного числа публикаций по проблематике диссертационного исследования, до сих пор остаются задачи, требующие дополнительных их постановок с учетом специфики исследуемого объекта – временных рядов, связанных с макроэкономическими процессами.

Одной из таких задач является разработка методов построения комплексных регрессионных моделей, обладающих повышенной устойчивостью к неизбежно имеющимся место структурным сдвигам. В этой связи, при обсуждении научного вклада диссертанта я бы обратил особое внимание на разработанный им метод оптимального выбора весовых коэффициентов частных регрессионных уравнений в процедуре спецификации комбинированных макроэкономических моделей с «вложенными» факторами. Высокая актуальность указанной задачи и

предложенного ее решения не вызывает сомнений на фоне обстоятельно проанализированной диссертантом отечественной и зарубежной литературе по данной проблеме.

Концептуальные и методические предложения автора носят открытый для широкой дискуссии и научного обсуждения характер.

Теоретическая значимость исследования связана с развитием экономико-математического инструментария прогнозирования временных рядов социально-экономических процессов, отличающихся наличием структурных сдвигов.

Практическая значимость заключается в возможности использования разработанных моделей и методов в целях построения моделей макроэкономических процессов для их краткосрочного, среднесрочного и долгосрочного прогнозирования. Полученные модели и прогнозы могут быть использованы для принятия оптимальных управленческих решений органами государственной власти и управления.

Без сомнения можно констатировать, что представленные в работе математические модели и экономико-математические методы вполне оригинальны, отличаются целостностью и логической взаимосвязью в рамках сформулированной цели – развитие методологии повышения качества эконометрических моделей временных рядов макроэкономических индикаторов посредством достижения более высокой достоверности оценок параметров и надежности получаемых доверительных интервалов, по сравнению с существующими методами.

В качестве замечания отмечу недостаточную экспериментальную проверку предложенных в диссертации моделей и методов на исторических данных по отечественной экономике. Было бы желательно оценить их работоспособность в условиях российского рынка.

Данное замечание не снижает общей положительной оценки результатов научного исследования.

Автореферат диссертационного исследования Моисеева Н.А. дает полное представление об актуальности, теоретической и практической значимости и научной новизне полученных соискателем результатов.

На основании анализа текста автореферата можно утверждать, что диссертация Моисеева Никиты Александровича на тему «Развитие методологии повышения качества эконометрических исследований» является самостоятельным законченным исследованием и соответствует критериям «Положения о присуждении ученых степеней», утвержденного постановлением Правительства №842 от 24.09.2013, а ее автор заслуживает присуждения степени доктора экономических наук по специальности 08.00.13 – Математические и инструментальные методы экономики.

Главный научный сотрудник
лаборатории
Институциональной динамики
ФГБУН «Центральный экономико-
математический институт РАН»,
д.э.н., профессор

В.Г. Гребенников

Нахимовский пр., д. 47, г. Москва, 117418
Телефон рабочий: 8 (499) 129-15-44, 8 (499) 724-25-29.
E-mail: greb@cemi.rssi.ru
Гребенников Валерий Григорьевич

Подпись В.Г. Гребенникова заверяю
Ученый секретарь ЦЭМИ РАН, к.э.н.

А.И. Ставчиков.

10.06.2020

