

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

Наличие эффективной математической системы прогнозирования экономических процессов является необходимым условием стратегического планирования и управления народным хозяйством. Это представляется возможным только при наличии соответствующего инструментария, в том числе, позволяющего осуществлять моделирование и прогнозирование временных рядов.

Научная новизна результатов диссертационного исследования обусловлена предложенными соискателем подходами к формированию более совершенных, по сравнению с традиционными, экономико-математических методов построения многофакторных регрессионных моделей временных рядов социально-экономической динамики. Здесь необходимо отдельно выделить метод оптимизации весовых коэффициентов для взвешенной суммы набора как вложенных, так и невложенных многофакторных моделей временного ряда. Данный метод имеет широкую сферу применения, поскольку взвешиваемые модели могут различаться как по составу предикторов, так и по длине окна наблюдений. Это позволяет решать как проблему arbitrarности выбора модели, так и проблему выбора длины окна. Также заслуживает внимания метод учета функциональных и корреляционных зависимостей между макроэкономическими индикаторами, с помощью которого можно согласовать прогнозы функционально и корреляционно связанных экономических индикаторов и сократить ошибку прогноза по каждому из них.

Результаты, полученные в диссертационном исследовании, согласуются с базовыми понятиями и положениями классического параметрического регрессионного анализа, прошли апробацию на Международных и Всероссийских конференциях и представлены в опубликованных соискателем работах, в т. ч. в статьях в рецензируемых научных журналах. Публикации соответствуют требованиям к опубликованию основных научных результатов диссертации, предусмотренным п. 11 и п. 13 Положения о присуждении ученых степеней.

В работе присутствует ряд недостатков, которые, впрочем, не снижа-

ют ее научного уровня. Например, в работе недостаточно четко прописан алгоритм спецификации подмоделей, которые подвергаются процедуре взвешивания. Более детальное описание алгоритма могло бы повысить возможности практического применения данного подхода к взвешиванию регрессионных моделей. Недостаточное внимание уделено описанию характерных черт временных рядов, при наличии которых подходы, предлагаемые автором, позволяют создавать более точные модели по сравнению с моделями, построенными на базе традиционных методов. Необходимо также заметить, что название работы не соответствует ее содержанию, поскольку в названии работы речь идет о развитии методологии повышения качества эконометрических исследований, а в самой работе – о совершенствовании конкретных методов, применяющихся в эконометрических исследованиях.

Автореферат дает достаточно полное представление об актуальности, теоретической и практической значимости, научной новизне полученных соискателем результатов.

Диссертационное исследование Н.А. Моисеева является законченной научно-квалификационной работой, выполненной на актуальную тему и содержащей важные для науки и практики результаты в сфере совершенствования и разработки экономико-математического инструментария формирования многофакторных регрессионных моделей временных рядов социально-экономических процессов.

Автореферат полностью соответствует критериям п. 9 «Положения о присуждении ученых степеней» (утвержденного Постановлением Правительства Российской Федерации № 842 от 24.09.2013 г.), а его автор – Моисеев Никита Александрович заслуживает присуждения ученой степени доктора экономических наук по специальности 08.00.13 – Математические и инструментальные методы экономики.

Руководитель отделения
Моделирования производственных
объектов и комплексов
ФГБУН «Центральный
экономико-математический
институт РАН», д.э.н., профессор,
член-корр. РАН


Г.Б. Клейнер

Нахимовский пр., д. 47, г. Москва, 117418
Телефон рабочий: 8 (499) 124-28-81
E-mail: george.kleiner@inbox.ru

Клейнер Георгий Борисович
Подпись Г.Б. Клейнера заверяю
Ученый секретарь ЦЭМИ РАН, к.э.н.

03.06.2020




А.И. Ставчиков