

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.

Развитие экономико-математического инструментария моделирования и прогнозирования временных рядов в области экономики является актуальным направлением совершенствования методологии современной эконометрики. Социально-экономические процессы, а в особенности временные ряды, существенно отличаются от физических процессов своей нестабильностью и изменчивостью.

Целью диссертационного исследования Н.А. Моисеева является создание методологии проведения эконометрического исследования, которое основывается на применении экономико-математических методов и моделей прогнозирования временных рядов социально-экономических процессов.

По мнению соискателя, существующие методы регрессионного анализа не позволяют решать целый ряд проблем, возникающих при попытке построения моделей вышеупомянутых процессов, а именно: проблема интеграции подмоделей, построенных на окнах различной длины, проблема расчета уровня значимости объясняющих переменных в процессе отбора факторов, проблема рассогласованности прогнозов при одновременном моделировании системы взаимосвязанных показателей, а также проблема вычисления достоверных доверительных интервалов при процедуре динамического взвешивания моделей.

Как следует из автореферата, соискатель ставит перед собой и последовательно решает комплекс задач, которые способствуют разработке описываемых методов регрессионного анализа, позволяющих получать модели повышенной точности и более надежные доверительные интервалы для прогнозируемых значений.

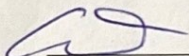
По автореферату имеется следующее замечание: исходя из его содержания, можно сделать вывод, что работа выполнена в рамках «классической» парадигмы параметрических методов моделирования и прогнозирования временных рядов. Одной из отличительных черт данной парадигмы является принятие гипотезы о нормальности в то время, как в реальности ошибки почти никогда не распределены согласно нормальному распределению. Желательно, чтобы автор адаптировал разработанные методы к

непараметрической парадигме. Данный недостаток не влияет на общую оценку работы и не снижает положительного впечатления от нее.

На основании автореферата диссертация Н.А. Моисеева на тему «Развитие методологии повышения качества эконометрических исследований» является научно-квалификационной работой, в которой содержится решение комплекса задач, имеющих важное народнохозяйственное значение в части развития методологии прогнозирования и моделирования временных рядов социально-экономических процессов.

Представленная к защите диссертационная работа является самостоятельным законченным исследованием и соответствует критериям п. 9 «Положения о присуждении ученых степеней» (утвержденного Постановлением Правительства Российской Федерации №842 от 24.09.2013 г.), а ее автор – Моисеев Никита Александрович заслуживает присуждения ученой степени доктора экономических наук по специальности 08.00.13 – Математические и инструментальные методы экономики.

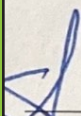
Ведущий научный сотрудник
ИПМ им. М.В. Келдыша РАН,
доктор технических наук

 Судаков В.А.

Судаков Владимир Анатольевич
125047, Москва, Миусская пл., д.4,
тел. 8(916) 804-83-01, e-mail: sudakov@keldysh.ru

Подпись Судакова В.А. удостоверяется
Ученый секретарь
ИПМ им. М.В. Келдыша РАН
кандидат физико-математических наук



 Маслов А.И.