

«В диссертационный совет 24.2.386.09
при ФГБОУ ВО «Санкт-Петербургский
государственный экономический университет»

191023, г. Санкт-Петербург, наб. канала
Грибоедова, д. 30-32, литер А

ОТЗЫВ ОФИЦИАЛЬНОГО ОППОНЕТА

кандидата физико-математических наук Подкорытовой Ольги Анатольевны на диссертацию Вику Коджови Нельсона Крепина на тему «Методы измерения и перспективная оценка инфляции в Экономическом сообществе западноафриканских государств ЭКОВАС», представленную на соискание ученой степени кандидата экономических наук по специальности 5.2.2 «Математические, статистические и инструментальные методы в экономике».

Актуальность темы диссертационного исследования.

Инфляция играет большую роль в экономике и влияет на социально-экономические процессы страны. Без сомнения, методы расчёта инфляции и её моделирования актуальны для всех стран. Диссертант сосредоточил своё внимание на развитии методов измерения уровня инфляции Экономического сообщества западноафриканских государств (ЭКОВАС). Восемь задач, раскрывающих эту цель, определяет структуру диссертации.

Степень обоснованности и достоверности научных положений, выводов и рекомендаций определяется квалифицированным выбором теоретических и эмпирических подходов. Апробация результатов была проведена на 8

конференциях и в 16 научных работах, семь из которых опубликованы в научных журналах, рекомендованных Высшей аттестационной комиссией при Министерстве образования и науки Российской Федерации.

Диссертационная работа имеет традиционную структуру и состоит из введения, трёх глав, заключения, списка использованной литературы и приложений.

По устоявшемуся порядку во введении раскрыты актуальность, цели и задачи диссертационного исследования, научная новизна, определены предмет и объект исследования, а также теоретическая и практическая значимость работы.

Первая глава обосновывает исследовательскую задачу. Рассмотрена специфика сбора данных в странах ЭКОВАС и различные методологии измерения инфляции. Описаны современные эконометрические методы, применяемые для обработки панельных данных и временных рядов. В конце главы сформулированы несколько гипотез, проверка которых будет проводиться в последующих главах.

Во второй главе проведен статистический анализ возможности введения единой валюты в ЭКОВАС. Для проверки закона паритета покупательной способности предложена методика, комбинирующая предварительную кластеризацию и полностью модифицированный метод наименьших квадратов. Гипотеза закона единой цены была проверена для Бенина, ЗАЭС (Экономическом и валютном союзе западноафриканских государств) и ЭКОВАС тремя разными методами. Был выявлен импортный характер инфляции в странах сообщества ЭКОВАС.

В третьей главе двумя методами проверяется и подтверждается гипотеза о том, что индекс потребительских цен ЭКОВАС не полностью отражает общий рост цен. Предложена и реализована методология расчёта ИПЦ

ЭКОВАС, включающая в себя как взвешивание показателей, так и использование стержневой инфляции. Для получения прогнозов методика Бокса-Дженкинса была применена к индексам цен всех стран ЭКОВАС.

С помощью модели панельной регрессии с плавным переходом был определен инфляционный порог. Также было показано, что изменчивость относительных цен реагирует по-разному на разные сценарии инфляции в ЭКОВАС.

Радует тот факт, что предложенная методика не осталась висеть в воздухе, но была имплементирована в разработанный информационный инструментарий для сбора информации, расчёта инфляции и визуализации данных об ЭКОВАС.

Значимость полученных автором диссертации результатов и их научная новизна.

Перечислим наиболее важные результаты исследования, обладающие научной новизной.

1. Развитие непараметрического метода анализа динамики инфляционных процессов в странах ЭКОВАС.
2. Разработка и апробация методики проверки гипотезы паритета покупательной способности в странах ЭКОВАС на трёх уровнях агрегирования.
3. Оценка влияния международной торговли на инфляцию ЭКОВАС на панельных данных.
4. Проверка гипотезы о корректности отражения инфляции на основе индекса потребительских цен в ЭКОВАС.

5. Применение непараметрического метода для проверки наличия долгосрочного равновесия динамики ИПЦ в странах ЭКОВАС и ЗАЭС.
6. Разработка инструментария для сбора и представления данных об инфляции в ЭКОВАС.

Замечания и недостатки.

- 1) Не всегда при проведении статистических и эконометрических тестов в явном виде указано количество наблюдений.
- 2) Для проверки стационарности временных рядов использовался тест Дики -Фуллера, имеющий малую мощность. Было бы интересно узнать, использовались ли другие тесты, и если да, то каковы результаты?
- 3) Одним из способов проверки коинтеграции двух переменных был выбран тест Йохансена. Отметим, что порядок VAR не был прокомментирован или хотя бы упомянут. Сам тест требует выполнения некоторых условий для корректного применения. Проверялись ли эти условия, и если да, то каковы результаты? Известно, что для проверки наличия одного долгосрочного соотношения (рассматриваемый случай) лучше использовать тест Ингла-Грейнджера, который робастен ко многим отклонениям. Было бы интересно узнать, использовался ли этот тест, и если да, то каковы результаты?
- 4) На стр.114 утверждается, что «... достоинством непараметрического метода является то, что его решение не зависит от уровня достоверности». Хотелось бы получить разъяснение этой фразы, так как обычно в непараметрических тестах речь идёт о независимости от распределения.
- 5) Была ли учтена случайная ошибка при переходе от формулы (3.13) к формуле (3.14)?

Данные замечания не снижают научной и практической значимости работы.

Заключение о соответствии диссертации критериям, установленным Положением о присуждении учёных степеней.

Представленная диссертация является законченной научно-квалификационной работой. По актуальности, научной новизне и практической значимости диссертация Вику Коджови Нельсона Крепина полностью соответствует критериям, предъявляемым к диссертациям на соискание учёной степени кандидата экономических наук. Автореферат и опубликованные работы достаточно полно отражают содержание представленной диссертации. Все восемь поставленных задачи были решены, цель исследования была достигнута.

Содержание диссертации Вику Коджови Нельсона Крепина полностью соответствует заявленной теме и пунктам научной специальности 5.2.2 – Математические, статистические и инструментальные методы в экономике:

- п. 3. «Разработка и развитие математических и эконометрических моделей анализа экономических процессов (в т.ч. в исторической перспективе) и их прогнозирования»;
- п. 14. «Эконометрические и статистические методы анализа данных, формирования и тестирования гипотез в экономических исследованиях. Эконометрическое и экономико-статистическое моделирование».

Таким образом, диссертационная работа, выполненная Вику Коджови Нельсоном Крепином, на тему «Методы измерения и перспективная оценка инфляции в Экономическом сообществе западноафриканских государств ЭКОВАС», соответствует критериям, установленным «Положением о присуждении учёных степеней», утвержденным Постановлением

Правительства Российской Федерации от 24 сентября 2013 г. № 842 (с изм. и доп.), а её автор заслуживает присуждения учёной степени кандидата экономических наук по специальности 5.2.2. «Математические, статистические и инструментальные методы в экономике».

Официальный оппонент

Кандидат физико-математических наук, доцент

доцент кафедры экономической кибернетики

Федерального государственного бюджетного

образовательного учреждения высшего образования

«Санкт-Петербургский государственный университет»,

кандидат физико-математических наук по специальности

01.01.05 – Теория вероятностей и математическая статистика

Подкорытова Ольга Анатольевна

08 ноября 2024

199034, Санкт-Петербург, Университетская наб., д. 7–9,

телефон: +7 (812) 328-20-20,

E-mail: spbu@spbu.ru

*Лично в поруче О. А. Подкорытовой
уточняю*



**ЗАМЕСТИТЕЛЬ НАЧАЛЬНИКА
УПРАВЛЕНИЯ КАДРОВ
И. П. ХОМУТСКАЯ
08.11.2024**