

РЕЦЕНЗИЯ

за придобиване на образователната и научна степен "доктор" по докторантска програма "Статистика и демография"

Рецензент: ПРОФ. Д-Р ВЕСЕЛКА ХРИСТОВА ПАВЛОВА - АРАБАДЖИЕВА – катедра "Статистика и иконометрия" при УНСС – София, назначена със заповед № 321, Свищов 22.04.2019 г. на Ректора на Стопанска академия "Д. А. Ценов" – Свищов доц. д-р Иван Марчевски

Автор на дисертационния труд: ас. ЕВГЕНИ ЯШКОВ ОВЧИННИКОВ

Тема на дисертационния труд: „ПРОБЛЕМИ ПРИ СТАТИСТИЧЕСКИ АНАЛИЗ НА ДИНАМИЧНИ ЗАВИСИМОСТИ“

I. Общо представяне на дисертационния труд

Дисертационният труд е посветен на актуална и значима тема. Явленията и процесите от икономическата действителност са сложни и многообразни. Често те са и взаимно обвързани. Иконометрията дава възможност да се изучат закономерностите, които се проявяват в динамиката на тези взаимносвързани явления и процеси. Със съвременните предизвикателства, проблеми и специфични практически постановки на тези статистически анализи се е заел докторантът Евгени Яшков Овчинников. Пресечната точка на анализите на развитието и анализите на причинно-следствените зависимости е една съвременна област на статистическия анализ, която се развива усилено през последните тридесет години.

Обектът на изследване, предметът, целите и задачите на дисертационния труд са представени ясно и точно от докторантката. **Обект** на разработката е статистическият анализ на динамични зависимости в съчленето между класическия анализ на зависимости и анализа на динамични редове. **Предмет** на изследване са познавателната същност, специфичните изисквания и проблемите, които съпътстват приложението на конкретните модели за статистическия анализ на динамични зависимости. **Целта** на дисертационния труд е да се характеризират моделите за изучаване на динамични зависимости с оглед идентифициране на специфичните проблеми, свързани с използването им при емпиричните изследвания, както и да се разкрият възможностите им за разширяване и задълбочаване на статистическия анализ. За постигането на целта успешно са решени пет изследователски задачи:

- Представени са концептуалните основи на статистическия анализ на зависимости и анализа на динамика;
- Изяснени са специфичните особености на статистическия анализ на динамични зависимости като своеобразен синтез на класическия анализ на зависимости и анализа на развитие;

- Обосновани са мястото и ролята на предварителния анализ за предотвратяване на потенциалните проблеми при статистическия анализ на динамични зависимости;
- Представени са теоретичните основи на моделирането на динамични зависимости чрез извеждане на предимствата и ограниченията на прилаганите модели.
- Успешно са апробирани реални модели на динамични зависимости на базата на емпирични данни за конкретни показатели, характеризиращи социално-икономическото развитие на България за периода 2000-2017 г.

Изследователската теза на докторанта е, че при спазване на изискванията за коректното им приложение, статистическите модели на динамични зависимости предоставят възможности за разширяване и задълбочаване на статистическия анализ по отношение на времевата синхронизация, посоката на причинната обусловеност, разпределението на факторното влияние във времето и разграничаването между дългосрочни и краткосрочни зависимости.

Дисертационният труд е написан на 208 страници. В структурно отношение той включва въведение, изложение в две основни глави, заключение, списък с използвана литература – 148 источника (39 на кирилица и 109 на латиница), 4 приложения и декларация за оригиналност. В текста са включени 8 таблици и 16 фигури.

Ас. Евгени Яшков Овчинников има 5 публикации по темата на дисертационния си труд. Едната представлява студия в съавторство с научния му ръководител доц. д-р Любомир Иванов. Представил е 2 самостоятелни статии и два доклада (единият от които в съавторство). Всичките му публикации са отпечатани в научни трудове на Стопанска академия „Димитър Ал. Ценов“ – Свищов.

Докторантът е посочил реализирането на две мобилности по програма „Еразъм+“ в Букурещкия университет. Едната е с цел обучение, а другата – с цел практика. Считам, че те също са допринесли за разработването на дисертационния труд.

II. Преценка на формата и съдържанието на дисертационния труд

Структурата и съдържанието на разработката изцяло съответстват на целите и задачите й. Стилът е ясен и професионално издържан.

1. Разработваният от докторанта научен проблем се отличава с висока степен на актуалност. Предметът и обектът на изследването са ясно разграничени. Изследователските цели и задачи съответстват напълно на защитаваната от докторанта теза. Умело изведените теоретико-методологически проблеми при моделирането на динамични редове въз основа на стационарни и нестационарни редове и сполучливите опити да се обосноват решенията им, дават възможност да се аргументират получените от изследването значими резултати от анализа на динамичната зависимост между инфляцията и безработицата в България и на динамичната зависимост между доходите и разходите на домакинствата в България..

2. Изследваната проблематика, свързана със статистически анализ на динамични зависимости, е сравнително добре застъпена в специализираната литература. Заслугата на автора е, че той е успял на базата на голямото многообразие от теоретически постановки и практически приложения да изведе неговото обосновано становище и така да обоснове и обвърже много сполучливо съдържанието на втора и трета глава от дисертационния труд. Това дава възможност на докторанта да представи ясно и точно своето отношение по третираната актуална тема.

3. Обемът и структурата на дисертационния труд са напълно достатъчни и добре балансириани за попълване на съдържанието и реализиране на предварително набелязаните цели и задачи.

4. Темата на дисертационния труд е свързана със статистически анализ, поради което естествено и в самата разработка и в приложението има достатъчен брой съдържателни и добре оформени статистически таблици и графики.

5. Научният апарат, използван от докторанта е коректен. Стилът на изложението е ясен и професионално издържан. Съдържанието и съответните обеми на главите и съставните им части са много добре балансириани.

6. Темата на рецензираната дисертация е „Проблеми при статистически анализ на динамични зависимости“. Тя предполага и задълбочен анализ на емпирични данни, какъвто умело е осъществен от ас. Овчинников при анализа на динамичните зависимости между инфлацията и безработицата в България и между доходите и разходите на домакинствата в България. Много добрата статистическа подготовка на докторанта е позволила тези анализи да бъдат задълбочени, изчерпателни и научно издържани. Използваният инструментариум вкл. специализиран статистически софтуер е приложен напълно коректно.

7. Считам, че докторантът е спазил правилата на научната етика. Основание за това твърдение ми дава и декларацията за оригиналност, подписана от него. В разработката са представени резултати от проведени от автора научни изследвания. Тезите, заимствани от други учени, са надлежно описани. Цитиранията са също коректно направени.

8. Авторефератът отразява напълно точно и коректно представеният за рецензиране дисертационен труд на тема „Проблеми при статистически анализ на динамични зависимости“.

III. Научни и научно-приложни приноси

По мое мнение изведените от докторанта основни приноси са формулирани коректно. Както вече беше посочено, изследваната проблематика е актуална и поне на мен не ми е известно да има систематизирана разработка по отношение на всеобхватен статистически анализ на динамични зависимости у нас в такъв обем и с такава степен на задълбоченост. Поради това предлаганите научни идеи са оригинални и много добре практически реализирани. Това е дало възможност на г-н Евгени Овчинников да формулира значими за практиката изводи и препоръки.

Бих желала да акцентирам върху три основни, по мое мнение, приноса:

1. Направен е опит (според мен успешен) да се представи същността на статистическия анализ на динамични зависимости като своеобразен синтез на класическия анализ на зависимости и анализа на динамиката. Изведени проблемите, трудностите и ограниченията на различните етапи на статистическия анализ, които са резултат от този своеобразен синтез.

2. Аналитичният процес е разделен на две много важни части - диагностика и моделиране. На етапа на предварителния анализ е изведена необходимостта от разкриване на вътрешно присъщите закономерности на динамичния ред на базата на изследване на автокорелационната функция и определяне характера на тенденцията на развитие, предварителна оценка на лаговата структура на зависимостта въз основа на кроскорелационния анализ. Авторът обосновава приложението на моделите на трансферни функции при оценяване на единични зависимости при стационарни редове, симултантните модели и векторната авторегресия – за анализ на множествените зависимости при стационарни редове, а моделите на коинтеграция и корекция на грешката – при нестационарни редове.

3. В научното изследване на докторанта са предложени решения за коригиране наличието на сезонност в динамиката на показателите и отдалечени значения в остатъчните елементи. За целта е препоръчано коригиране на моделите с добавяне на достатъчно лагове на сезонните честоти и чрез въвеждането на изкуствени сезонни променливи. Това е илюстрирано на базата на анализа на две двойки важни зависимости в нашата икономика - „инфляция – безработица“ и „доходи – разходи на домакинствата“ периода 2000-2017 г. За характеризиране на зависимостта „инфляция – безработица“ е апробиран модел на трансферна функция, чрез който са оценени нейната сила и посока, както и разпределението на факторното влияние във времето. Дългосрочната зависимост „доходи – разходи на домакинствата“ е представена с модел на коинтеграция, а краткосрочната – с модел на корекция на грешката.

IV. Критични бележки и препоръки по дисертационния труд

Формулираните бележки и препоръки не омаловажават стойността на представения дисертационен труд. Те по-скоро имат препоръчителен характер за бъдещата работа на г-н Евгени Овчинников. В хода на защитата, той може да отговори и на поставените въпроси.:

- В първа глава много коректно и систематизирано са представени „основните“ принципи на статистическия анализ на зависимости, на основните характеристики на динамичните редове както и на синтетичния анализ на динамични зависимости. На места текстът има по-скоро характер на учебник и не е отразено становището на докторанта (стр. 28, 38-40 и др.).
- На стр.67-68 докторантът въвежда определение на „стационарност на динамичен ред“. От по-пълно изясняване, според мен, се нуждаят проблемите, свързани с наличието на автоковариация, както и

- филтрирането чрез последователните разлики. Каква е целта на последното и при какви видове редове е приложимо?
- Счита ли докторанта, че някой/някои от посочените на стр. 93 методи за оценка на параметрите на симултантните уравнения е по-адекватен при наличието на автокорелация и защо?
 - Кои от приложените методи в практическата част на разработката докторантът счита като статистически и кои като иконометрични? Какъв критерии би обосновал той за разграничаването им?

V. Обобщено заключение и становище

В заключение считам, че представената ми за рецензиране разработка притежава всички необходими качества за присъждането на образователната и научна степен „доктор“ на г-н Евгени Яшков Овчинников. Безспорни са достойнствата на разработката, свързани със способността на автора ѝ правилно да формулира целта и задачите и след това да ги реализира на много добро научно равнище. Понятийният и научният апарат са също на високо ниво. Не на последно място, разработката има конкретни практико-приложни приноси в областта на прилагането статистическия анализ при динамични зависимости.

Изложеното ми дава основание на дам положителна оценка на дисертационния труд на тема „Проблеми при статистически анализ на динамични зависимости“. С пълна убеденост предлагам на уважаемото научно жури да гласува „за“ присъждането на образователната и научна степен “доктор“ по научна специалност “Статистика и демография” на г-н Евгени Яшков Овчинников.

София, 21.05.2019 г.

Рецензент:

/проф. д-р Веселка Павлова/
