

ФЕДЕРАЛЬНОЕ ГОСУДАРСТВЕННОЕ БЮДЖЕТНОЕ УЧРЕЖДЕНИЕ НАУКИ
ЦЕНТРАЛЬНЫЙ ЭКОНОМИКО-МАТЕМАТИЧЕСКИЙ ИНСТИТУТ
РОССИЙСКОЙ АКАДЕМИИ НАУК

«УТВЕРЖДАЮ»
Директор ЦЭМИ РАН,
член-корреспондент РАН, д.э.н. Бахтизин А.Р.

«25» апреля 2019 г.

**ВЫПИСКА ИЗ ПРОТОКОЛА № 10
от 19 апреля 2019 г.**

**заседания научного семинара
«Проблемы моделирования развития производственных систем»**

Председатель: член-корр. РАН Г.Б. Клейнер,

Ученый секретарь: к.э.н., в.н.с. А.А. Никонова.

ПРИСУТСТВОВАЛИ: д.э.н. Бендиков М.А., д.э.н. Афанасьев М.Ю., д.э.н. Чернавский С.Я., д.э.н. Смоляк С.А., Кураева О.А., к.т.н. Цветаева З.Н., к.э.н. Бушанский С.П., к.т.н. Ложкин О.Б., Кашапов Ф.Ф., к.э.н. Точилин О.В., к.э.н. Мызникова М.Н., д.э.н. Денисов В.И., Сорокина Я.С., д.э.н. Хрусталев Е.Ю., к.э.н. Кобылко А.А., к.э.н. Ерзнкян Э.А., д.э.н. Агафонов В.А., к.э.н. Черепанов В.И., д.э.н. Данилин В.И., Береза Т.Н., д.э.н. Афанасьев А.А. и др. – всего 28 человек.

ПОВЕСТКА ДНЯ:

Предварительная экспертиза (предзащита) диссертационной работы Филькина Михаила Евгеньевича на тему «Оценка конкурентности розничного рынка нефтепродуктов в мегаполисе», представленной на соискание ученой степени кандидата экономических наук по специальности 08.00.05 – «Экономика и управление народным хозяйством» (экономика, организация и управление предприятиями, отраслями, комплексами – промышленность), выполненной в Лаборатории экономических проблем энергетики Федерального государственного бюджетного учреждения науки Центральный экономико-математический институт Российской академии наук.

СЛУШАЛИ: доклад Филькина М.Е., в котором изложены актуальность темы исследования, цель и задачи работы, содержание и полученные результаты. Также были освещены теоретическая и практическая значимость результатов,

научная новизна, апробация результатов и список публикаций по теме исследования.

После доклада Филькину М.Е. были заданы следующие вопросы:

Член-корр. РАН Г.Б. Клейнер:

1. В чем состоит новизна вашей работы? Это новый метод, применимый к известному объекту или известный метод, применимый к новому объекту исследования?
2. В определении предполагаемой вариации стоит полная производная по цене. Создается впечатление, что это единственная переменная, от которой зависит уровень конкурентности. Может быть, правильнее было бы поставить частную производную?

Д.э.н. Афанасьев А.А.

1. Линейна ли базовая регрессия по своим независимым переменным, а если это не так, то в чем причина такой нелинейности?

2. Расскажите подробнее о коэффициентах регрессии. Несут ли они какие-либо содержательные функции?

Д.э.н. Хрусталева Е.Ю.

Могли бы Вы подробнее рассказать о методе скрытых марковских цепей? Насколько я понимаю, он не является классическим инструментом для измерения уровня конкурентности?

К.э.н. Кобылко А.А.

Мы знаем, что одной из проблем нефтеперерабатывающего сектора является большие издержки, связанные с существованием коррупционной составляющей. Как этот факт может быть учтен в вашей модели? Можно ли его вообще учесть и как оценить его масштабы?

К.э.н. Никонова А.А.

Актуальны ли выводы и методы, представленные в работе, в настоящее время? Что изменилось с 2006 года на рынке моторных топлив?

На все вопросы Филькин М.Е. дал исчерпывающие, аргументированные ответы, привёл соответствующие обоснования.

С обсуждением диссертации выступили:

Д.э.н. Чернавский С.Я., научный руководитель, отметил актуальность темы исследования в свете необходимости создания в России конкурентной среды, особенно на таких социально значимых рынках, как автомобильное топливо. С.Я. Чернавский подчеркнул, что организация цивилизованных рынков – не только экономическая, но и важная социальная задача, о чем указано в ряде законов и нормативных государственных актов. М.Е. Филькин был охарактеризован как творческий и инициативный научный работник, хорошо подготовленный для решения сложных экономических проблем и обладающий высокими уровнями интеллектуальной активности и компетенции. Отмечено, что исследование является оригинальным научно-исследовательским трудом, выполненным автором самостоятельно на должном научном уровне. Работа

является итогом многолетних усилий, связанных как со сбором, так и с обработкой большого объема эмпирических данных.

С рецензиями на диссертационную работу выступили д.э.н. Брагинский О.Б. и д.э.н. Афанасьев М.Ю.

Д.э.н. Брагинский О.Б. отметил следующие положительные моменты работы. По мнению рецензента, Филькин М. Е. подробно и обстоятельно подошел к вопросу исследования. Осуществлен сбор и глубокий анализ большого числа эмпирических данных. Соискатель использовал большое число российских и зарубежных источников. Отмечена особая значимость работы в связи с ее эмпирическим характером: в настоящее время получение данных о ценах и объемах продаж на реальных рынках связано либо с большими издержками, либо невозможно ввиду коммерческой тайны. Большая удача получить временной ряд таких данных для мегаполиса федерального значения. Д.э.н. О.Б. Брагинский высказал тезис, что обычно конкуренция оценивается как функция измерений и редко как итог моделирования. Рецензент отметил, что работа написана живым языком и интересна для чтения.

В то же время, отмечены два аспекта работы, которые, по мнению рецензента, не являются недостатками, но вызывают огорчение. Во-первых, данные заканчиваются 2006 годом, хотя и понятно, что само по себе их наличие является большой удачей, но было бы хорошо проводить такие исследования не только в историческом контексте, но и на постоянной основе. Во-вторых, поскольку представленный метод использован впервые, разумно было бы сравнить его результаты с другими существующими методами исследования конкуренции на рынке нефтепродуктов.

По мнению д.э.н. Брагинского О.Б., диссертация Филькина М.Е. может быть представлена к защите на соискание ученой степени кандидата экономических наук по специальности 08.00.05 – «Экономика и управление народным хозяйством» (экономика, организация и управление предприятиями, отраслями, комплексами – промышленность) в Диссертационный совет Д 002.013.04 при Федеральном государственном бюджетном учреждении науки Центральный экономико-математический институт Российской академии наук без повторного обсуждения.

Д.э.н. Афанасьев М.Ю. высказался в поддержку выбранной теме исследования и сконцентрировался на математической модели, предложенной автором для анализа конкуренции. Он отметил, что предложенный метод анализа может быть использован для эмпирического анализа многих розничных рынков, если будут иметься соответствующие статистические данные. Использованная модель вполне соответствует целям и задачам работы, а именно исследования структуры реального рынка и выявления случаев неконкурентного ценообразования. Рецензент указал на сложность и масштабность сбора и обработки данных для отдельных автозаправочных станций и положительно оценил аккуратность использования автором имеющейся информации.

В то же время рецензент сделал ряд замечаний. Во-первых, формулировку гипотез и критерии интерпретации результатов следует указывать до момента

обработки данных. Во-вторых, стоит более явно указать достоинства и недостатки метода скрытых марковских цепей, которые обусловили его выбор для оценки уровня конкуренции. Рецензент отметил, что, на его взгляд, некоторые аспекты исследования структуры рынка описаны слишком подробно, однако это можно быть обусловлено стремлением представить более полно логику представления работы.

По мнению д.э.н. Афанасьева М.Ю., диссертация «Оценка конкурентности розничного рынка нефтепродуктов в мегаполисе» Филькина Михаила Евгеньевича после учета соответствующих замечаний может быть представлена к защите на соискание учёной степени кандидата экономических наук по специальности 08.00.05 – «Экономика и управление народным хозяйством» (экономика, организация и управление предприятиями, отраслями, комплексами – промышленность) в Диссертационный совет Д 002.013.04 без повторного обсуждения.

По итогам заслушанных отзывов и рецензий состоялась научная дискуссия по теме рассматриваемой диссертации.

Член-корр. РАН Г.Б. Клейнер сказал, что для защиты диссертации в презентации доклада необходимо часть времени уделить формальным аспектам, выделив для них отдельные слайды, а именно новизну, актуальность, цели и задачи исследования, положения, выносимые на защиту. В то же время Г.Б. Клейнер положительно оценил роль исторического контекста, формирования рынков нефтепродуктов, освещенного в исследовании: «История имеет значение!».

Д.э.н. А.А. Афанасьев сказал, что в целом невысокие уровни детерминации в регрессиях частично могут быть обусловлены многочисленными усреднениями ценовых параметров, использованных в регрессии. По этому поводу, по мнению А.А. Афанасьева, имеет смысл подумать о модификациях форм базовой регрессии.

Д.э.н. М.Ю. Афанасьев возразил, что высокий коэффициент детерминации был бы необходим в случае, если бы целью модели являлось прогнозирование будущих цен или спроса, а в настоящем исследовании такой задачи не стоит.

Д.э.н. С.Я. Чернавский сказал, что базовая регрессия есть классическая линейная функция спроса, различные модификации которой были исследованы для выбора наиболее подходящей формы дифференциации АЗС.

Д.э.н. О.Б. Брагинский отметил, что в эмпирических исследованиях проблемой является наличие качественных данных, что часто обуславливает выбор используемых базовых предположений в моделях. О.Б. Брагинский высказал пожелание сопоставить результаты исследований с выводами, сделанными на основе классических коэффициентов концентрации и конкуренции, которые проводились, в том числе, в ФГБУН Центральном экономико-математическом институте РАН.

Д.э.н. Р.М. Качалов высказал пожелание что, по его мнению, необходимо сократить название диссертации, поскольку «мегаполис» не бывает маленьким, а

то, что речь идет именно о российском розничном рынке, тоже достаточно очевидно.

По результатам обсуждения диссертации Филькина Михаила Евгеньевича на тему: «Оценка конкурентности розничного рынка нефтепродуктов в мегаполисе» принято следующее заключение:

ЗАКЛЮЧЕНИЕ

заседания научного семинара

«Проблемы моделирования развития производственных систем»

по диссертации **Филькина Михаила Евгеньевича** на тему:

«Оценка конкурентности розничного рынка нефтепродуктов в мегаполисе», представленной на соискание учёной степени кандидата экономических наук по специальности 08.00.05 – «Экономика и управление народным хозяйством» (экономика, организация и управление предприятиями, отраслями, комплексами – промышленность).

Диссертационная работа Филькина Михаила Евгеньевича на тему: «Оценка конкурентности розничного рынка нефтепродуктов в мегаполисе» выполнена в Лаборатории экономических проблем энергетики Федерального государственного бюджетного учреждения науки Центральный экономико-математический институт Российской академии наук.

Филькин Михаил Евгеньевич окончил Государственное образовательное учреждение высшего профессионального образования «Московский физико-технический институт (государственный университет)» в 2004 г. по направлению «Прикладная математика и физика», а также Негосударственное образовательное учреждение «Российская Экономическая Школа» (институт) в 2007 г. по направлению «Экономика». В период подготовки диссертации и по настоящий момент Филькин М.Е. работает старшим научным сотрудником Лаборатории экономических проблем энергетики Федерального государственного бюджетного учреждения науки Центральный экономико-математический институт Российской академии наук.

Удостоверение о сдаче кандидатских экзаменов №3445 (иностраный язык) выдано 16 декабря 2010 г. Федеральным государственным бюджетным учреждением науки Центральный экономико-математический институт Российской академии наук на основании подлинных протоколов или удостоверений о сдаче отдельных кандидатских экзаменов, хранящихся в архиве высшего учебного заведения по месту сдачи экзаменов.

Справка о сдаче кандидатских экзаменов №10 (экономика и управление народным хозяйством, история и философия науки) выдано 20 декабря 2017 г. Федеральным государственным бюджетным учреждением науки Центральный экономико-математический институт Российской академии наук на основании подлинных протоколов или удостоверений о сдаче отдельных кандидатских экзаменов, хранящихся в архиве высшего учебного заведения по месту сдачи экзаменов.

Научный руководитель – С.Я. Чернавский, доктор экономических наук, заведующий Лабораторией экономических проблем энергетики Центрального экономико-математического института.

Диссертационная работа Филькина Михаила Евгеньевича является законченной научно-исследовательской работой, посвящённой исследованию конкуренции на розничном рынке нефтепродуктов российского города федерального значения.

Актуальность темы исследования. Актуальной задачей была и остается рыночная диагностика: действительно ли на розничном уровне существует соперничество и отсутствует согласование ценовой политики между продавцами бензина. Особую значимость приобретает разработка инструментария выявления неконкурентного ценообразования на тех рынках, где формально нет доминирующего игрока, обладающего монопольной (или близко к таковой) властью.

Личное участие автора в получении результатов исследования:

- Собраны и обработаны данные о ценах и объемах продаж нефтепродуктов в городе Санкт-Петербург и Ленинградской области за период 1999-2006 гг. на уровне отдельных автозаправочных станций.
- Проанализированы опубликованные российские и зарубежные работы, связанные с моделированием и изучением структуры розничного рынка вообще и рынка нефтепродуктов в частности.
- Выявлены преимущества и ограничения методов исследования рынков с помощью предполагаемых вариаций и теоретико-игровых моделей.
- Методология использования концепции предполагаемых вариаций адаптирована к специфике рынка нефтепродуктов российского мегаполиса.
- Сформулирован и осуществлен план исследования конкурентной ситуации на розничном рынке бензина.
- Рассчитаны коэффициенты Лернера и Херфиндаля-Хиршмана, дающих оценку концентрации продавцов на олигопольном розничном рынке.
- С помощью методов регрессионной оценки и скрытых марковских цепей построены оценки предполагаемых вариаций для различных уровней глубины розничного рынка нефтепродуктов Санкт-Петербурга и Ленинградской области вплоть до отдельных АЗС.
- На основе метода скрытых марковских цепей разработан новый метод оценки предполагаемых вариаций, до сих пор не применявшийся для моделирования структуры рынков.

Степень обоснованности научных положений, выводов и рекомендаций. Выбранные соискателем научные методы обоснования результатов соответствуют объекту и предмету исследования. Достоверность научных положений, а также выводов и результатов исследования базируется на применении в качестве теоретических и методологических оснований фундаментальных научных работ российских и зарубежных ученых, научных публикаций в периодических изданиях, посвященных данной проблематике.

Математические методы, использованные в моделировании строения рынков, применяются для широкого круга исследовательских задач экономики. Обоснованность и границы применимости математического аппарата определены на основе классических теорем и фундаментальных работ в эконометрике и теории вероятностей. Эмпирический характер работы, в свою очередь, определяет верифицируемость всех полученных выводов и результатов. Информационной базой исследования послужили данные Федеральной службы государственной статистики, данные ежегодных отчетов нефтяных компаний, данные специализированных агрегаторов, финансовая статистика агентства Bloomberg.

Научная новизна диссертационного исследования состоит в разработке методики многоуровневого изучения конкурентной среды розничного рынка нефтепродуктов, в формулировании критериев и гипотез для оценивания степени конкурентности этого рынка на основе эконометрических методов анализа эмпирических данных, а также в разработке технологии применения данной методики для диагностики координированности экономического поведения продавцов розничного рынка.

1. Разработана ранее неизвестная многоуровневая процедура выявления признаков неконкурентного поведения продавцов на розничном рынке, включающая этапы вычисления индексов концентрации и монополизации рынка, объемов рыночной доли каждого участника, а также оценку степени предполагаемой ценовой вариации (в том числе и сезонной). Это позволяет, с одной стороны, обратить внимание регулирующих органов на признаки наличия согласованного поведения на рынке бензина, а с другой, позволяет компаниям-продавцам отстаивать добросовестную репутацию в том случае, если рост цен обусловлен введением дополнительных сервисов и не связан с неконкурентным ценообразованием.
2. Разработан модифицированный метод эконометрического анализа, заключающийся в комбинации регрессионного статичного и марковского динамического подходов, который – в отличие от известных – позволяет определить, является ли согласованное поведение продавцов розничного рынка постоянным, сезонным или эпизодическим.
3. Обоснована целесообразность применения для эконометрического анализа розничного рынка нефтепродуктов инструментария расчетов величины предполагаемой ценовой вариации, который – в отличие теоретико-игровых моделей – основывается только на предположениях рациональности и не использует неправомерные и априорно синтетические суждения.
4. Разработана математическая модель выявления признаков неконкурентной кооперации поведения продавцов розничных рынков, которая, в отличие от известных, базируется на скрытых марковских цепях, что позволило обнаружить сезонность появления признаков согласованности в поведении продавцов-участников розничного рынка нефтепродуктов.

Практическая значимость исследования состоит в том, что

– для диагностики рыночной власти на розничном рынке бензина и дизельного топлива крупных мегаполисов использование годовых данных и моделей, не

учитывающих динамику поведения участников рынка в течение года, необходимо использовать более сложные методические инструменты. Наблюдения за поведением в годовом разрезе могут привести дополнительной финансовой нагрузке на покупателей бензина и дизельного топлива;

– диагностику рыночной власти на розничном рынке бензина и дизельного топлива можно провести только с помощью научного подхода без использования трудоемких, дорогостоящих и требующих специальных полномочий методов, использующих подслушивание, выемку документов и других подобных методов, к которым приходится прибегать государству при отсутствии научно обоснованных инструментов. Внедрение результатов, полученных в диссертации, позволит сэкономить большие финансовые ресурсы и добиться большей обоснованности и эффективности усилий государства по совершенствованию розничных рынков, в том числе, бензина и дизельного топлива

Ценность научных работ соискателя состоит в том, что в них поставлена и решена проблема эмпирического анализа уровня конкурентности не только как потенциальной угрозы использования рыночной власти на олигопольном рынке, но и действительной реализации этой угрозы. Разработанный план оценки структуры рынка приложим практически к любому реальному розничному рынку, где есть возможность получения статистических данных о ценах и объемах продаж.

Область исследования соответствует требованиям следующих разделов паспорта специальности ВАК 08.00.05 – «Экономика и управление народным хозяйством» (экономика, организация и управление предприятиями, отраслями, комплексами – промышленность):

1. Экономика, организация и управление предприятиями, отраслями, комплексами

1.1.9. Инструменты функционирования товарных рынков с ограниченной и развитой конкуренцией в условиях глобализации мировой экономики и свободной торговли.

11.16. Монопольное, олигопольное и конкурентное ценообразование.

Апробация результатов исследования.

Полученные научные и практические результаты докладывались автором на 1-ой научно-образовательной конференции ОЭПЭЭ/АЕЕ «Экономика энергетики как направление исследований: передовые рубежи и повседневная реальность» (Москва, 2012), конференции Отделения № 5 ФГБУН ЦЭМИ РАН (Москва, 2018), Международной научной школы-семинара (Нижний Новгород, 2018).

Полнота изложения диссертации в работах, опубликованных автором. Основные положения и результаты исследования опубликованы в 10 печатных работах. Диссертация состоит из трех глав, содержащих различные части исследования. Каждый из трех разделов исследования, соответствующий определенной главе, был опубликован в изданиях, рекомендованных ВАК Минобрнауки РФ:

1. Филькин М.Е. Эмпирический анализ конкуренции на розничном рынке бензина // Экономическая наука современной России. 2010. №3 (50) С.78-92.
2. Филькин М.Е. Региональные розничные рынки нефтепродуктов в России: предпосылки и особенности формирования [Электронный ресурс] // Региональная экономика и управление: электронный научный журнал. ISSN 1999-2645. — №2 (50). Номер статьи: 5006. Дата публикации: 2017-04-12 . URL: <https://eee-region.ru/article/5006/>
3. Филькин М.Е. Метод скрытых марковских цепей для оценки уровня конкурентности // Конкурентоспособность в глобальном мире: экономика, наука, технологии. 2017. №8 (ч. 4), С. 127-132.
4. Филькин М. Е. Российские региональные рынки бензина: влияние концентрации рынков на розничные цены [Электронный ресурс] // Региональная экономика и управление: электронный научный журнал. ISSN 1999-2645. — №1 (57). Номер статьи: 5705. Дата публикации: 2019-02-16 . URL: <https://eee-region.ru/article/5705/>

Общие выводы по диссертации

Диссертация Филькина М.Е. является законченным и самостоятельным научным исследованием, в котором проводится детальный анализ социально значимого розничного рынка и предлагается метод возможного анализа для исследования множества реальных рынков. Диссертация соответствует требованиям, предъявляемым к работам, представляемым на соискание учёной степени кандидата экономических наук по специальности 08.00.05 – «Экономика и управление народным хозяйством» (экономика, организация и управление предприятиями, отраслями, комплексами – промышленность).

Заседание научного семинара «Проблемы моделирования развития производственных систем» рекомендует принять диссертацию Филькина М.Е. к защите на соискание учёной степени кандидата экономических наук по специальности 08.00.05 – «Экономика и управление народным хозяйством» (экономика, организация и управление предприятиями, отраслями, комплексами – промышленность) в Диссертационный совет Д 002.013.04 при Федеральном государственном бюджетном учреждении науки Центральный экономико-математический институт Российской академии наук.

Заслушав и обсудив диссертацию Филькина М.Е. на тему: «Оценка конкурентности розничного рынка нефтепродуктов в мегаполисе», представленную на соискание учёной степени кандидата экономических наук по специальности 08.00.05 – «Экономика и управление народным хозяйством» (экономика, организация и управление предприятиями, отраслями, комплексами – промышленность), а также учитывая отзывы рецензентов-экспертов,
ПОСТАНОВИЛИ:

1. Рекомендовать соискателю учесть замечания.
2. Повторное обсуждение не проводить и поручить д.э.н. Афанасьеву М.Ю. и д.э.н. Брагинскому О.Б. рассмотреть окончательный вариант текста диссертации на предмет учёта замечаний, высказанных в ходе экспертизы и обсуждения, информацию об этом представить в Диссертационный совет Д

002.013.04. при Федеральном государственном бюджетном учреждении науки Центральный экономико-математический институт Российской академии наук.

3. Рекомендовать в качестве официальных оппонентов:

– Лапаева Дмитрия Николаевича, доктора экономических наук, заместителя директора по научной работе Института экономики и управления ФГБОУ ВО «Нижегородский государственный технический университет им. Р.Е. Алексеева»;

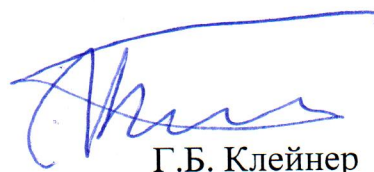
– Анашкина Олега Станиславовича, кандидата экономических наук, доцента Департамента мировой экономики, Факультета мировой экономики и мировой политики ФГАОУ ВО «НИУ «ВШЭ».

4. Рекомендовать в качестве ведущей организации Федеральное государственное бюджетное учреждение науки Институт экономики Российской академии наук.

Заключение принято на заседании научного семинара «Проблемы моделирования развития производственных систем». В голосовании приняли участие 28 человек. Результаты голосования: «за» – 28 человек, «против» – нет, «воздержались» – нет.

Протокол № 10 от 19.04.2019

Председатель заседания семинара
член-корр. РАН,
зам. науч. руководителя ФГБУН ЦЭМИ РАН



Г.Б. Клейнер

Ученый секретарь семинара
к.э.н., в.н.с.



А.А. Никонова