

# ХРОНИКА НАУЧНОЙ ЖИЗНИ

## МЕЖДУНАРОДНАЯ ЮБИЛЕЙНАЯ СЕССИЯ НАУЧНОГО СЕМИНАРА «МНОГОМЕРНЫЙ СТАТИСТИЧЕСКИЙ АНАЛИЗ И ВЕРОЯТНОСТНОЕ МОДЕЛИРОВАНИЕ РЕАЛЬНЫХ ПРОЦЕССОВ»

В пансионате «Звенигородский» Московской области — месте проведения многих научных мероприятий — 21–25 июня 2009 г. состоялась юбилейная сессия научного семинара «Многомерный статистический анализ и вероятностное моделирование реальных процессов», на котором отмечалось его 40-летие. Уникальность события состоит не только в долголетию семинара, но прежде всего в том, что все 40 лет работой семинара руководит Сергей Артемьевич Айвазян — докт. физ.-мат. наук, профессор, заслуженный деятель науки РФ, руководитель отделения «Прикладная статистика и эконометрика» и заместитель директора Центрального экономико-математического института РАН — ученый, чьи исследования известны научному миру далеко за пределами России и стран СНГ.

Сразу скажем, что семинар проходил в духе лучших гуманистических традиций, которые сохранились в основном у представителей естественных наук, когда свободное общение равных, дискуссии создают атмосферу приближения к Истине. Не будем пересказывать содержание всех многочисленных докладов, тем более что с ними можно ознакомиться по изданному сборнику трудов семинара (М.: ЦЭМИ РАН, 2009). Остановимся на самых запомнившихся. Прежде всего это, конечно, доклад С. А. Айвазяна «Многомерный статистический анализ и вероятностное моделирование реальных процессов: направления исследований, тенденции, проблемы (опыт 1969—2009 гг.), который открыл работу семинара, обозначив цель и задачи его проведения. С. А. Айвазян осветил историю возникновения семинара, подчеркнув, что инициатива его создания была поддержана А. Н. Колмогоровым и Ю. В. Прохоровым и «стимулировалась объективно назревшей потребностью активизации исследований отечественных специалистов в области *прикладной статистики*». География семинара охватывает почти весь мир, за исключением стран Азии и Африки. Среди направлений работы семинара в докладе были выделены:

- становление и развитие понимаемого в широком смысле «анализа данных»;
- разработка новых подходов к построению устойчивых статистических процедур;
- развитие теории и методологии статистических методов классификации многомерных наблюдений;
- статистические выводы в условиях растущей размерности наблюдений;
- совершенствование структуры, содержания и интеллектуальной составляющей пакетов программ по прикладной статистике и эконометрике;
- внедрение методов МСА и эконометрики в учебные планы и практику преподавания высшей школы.

Был сделан краткий обзор работы семинара и инициированных им конференций, а также издательской деятельности.

Множество вопросов поставил перед участниками заседания докт. физ.-мат. наук Ю. Н. Благовещенский в своем докладе «Прикладная статистика: взгляд в будущее». Прежде всего выступающий остановился на проблеме: что такое

статистические и нестатистические данные, подчеркнув, что занятия прикладной статистикой предполагают наличие ответа на этот вопрос. Далее он обосновал происходящий в настоящее время процесс ветвления прикладной статистики на *классическую, компьютерную и корпоративную*, остановившись на опасности так называемой кнопочной статистики (т. е. владении пакетами прикладных программ без должной степени понимания сущности применяемых методов, их возможностей) и показав все расширяющееся поле корпоративной статистики «с ее встроенностью в гораздо более широкий круг задач».

Участником юбилейной сессии был приехавший из США, Е. З. Демиденко, который представил новое направление — статистику изображений (*image statistics*). И. И. Елисеева и О. Ю. Бороздина осветили возможности факторного анализа в координатах «объект—признак—время». Э. Б. Ершов рассмотрел проблемы построения индексов цен и количеств, подробно остановившись на собственном опыте поиска периодов во временных рядах, для которых правомерна гипотеза стабильных цен, и решения проблемы аксиоматического определения совместной динамики цен и количеств товаров. Докладчик подчеркнул многоступенчатость и сложность агрегирования данных при построении национальных индексов потребительских цен. Р. Рудзкис (Литва) представил результаты коллективного исследования по проблеме кластеризации выборки и целенаправленного проецирования при непараметрическом оценивании плотности распределения. Итальянский исследователь Д. Фантаццини, работающий последние годы в МГУ, доложил результаты анализа рисков российского банковского сектора, выполненного совместно с А. Злотником и А. Кудровым, выделив следующие «страновые» факторы риска: зависимость российской экономики от относительно небольшого числа секторов промышленности, наличие у российских компаний значительных сумм долговых обязательств перед зарубежными кредиторами, исключительная рискованность инвестиционной политики, отсутствие практики управления рисками. Математическая модель циклов в страховании, предназначенная для целей адаптивного управления, была представлена в докладе В. К. Малиновского. Модель позволяет определить условия выживания в нисходящей фазе страхового цикла и сохранения позиции страховой компании на рынке страховых услуг. Сравнительная эффективность банков России и Казахстана была проанализирована А. А. Пересецким и доказано, что в обеих странах банки еще не достигли своего оптимального размера.

Повышенный интерес участников вызвал доклад Г. А. Сатарова «Пандемическая коррупция как индикатор аномальной экономики». Результаты эконометрического анализа межрегиональной дифференциации денежных доходов населения Российской Федерации в период 1995—2006 гг. были представлены И. А. Герасимовой. Доклад В. Л. Ушковой и Е. Д. Ильменской был посвящен актуальной проблеме оценки результативности научной деятельности. Докладчики представили разработанную и внедренную в ЦЭМИ РАН автоматизированную систему «Научные результаты», позволяющую осуществлять мониторинг научных результатов сотрудников института.

Важно отметить то, что доклады маститых ученых перемежались с докладами совсем молодых исследователей, среди которых несомненный интерес вызвал доклад Е. Ю. Борисовой «Интегральные индикаторы уровня инновационного развития стран и их применение в анализе экономического благосостояния». Каждое выступление вызывало заинтересованную реакцию слушателей, представляющих научные центры и университеты не только России, но и США, Литвы, Армении, Беларуси.

В заключительный день юбилейной сессии академик В. Л. Макаров, директор ЦЭМИ РАН, представил имитационную модель распространения знания,

а член-корреспондент Г. Б. Клейнер, зам. директора ЦЭМИ, остановился на проблемах прикладного статистического анализа деятельности фирмы (на примере нефинансового сектора экономики). Собравшиеся тепло поздравили С. А. Айвазяна с 75-летием, празднование которого органично вписалось в научное мероприятие.

Юбилейная сессия еще раз продемонстрировала интернациональный характер науки, а также показала научную преемственность, наличие сложившейся и развивающейся школы прикладного статистического анализа. Интеллектуальное общение дополнялось возможностью любоваться прекрасными видами Подмосковья близ Николиной горы.

*И. И. Елисеева,*  
член-корр. РАН,  
Санкт-Петербургский государственный университет  
экономики и финансов