

Промышленность

ДИНАМИКА ПРОМЫШЛЕННОГО ПРОИЗВОДСТВА В ЧЕТВЕРТОМ КВАРТАЛЕ 2022 г.¹

А. С. КАУКИН
Е. М. МИЛЛЕР

Трендовая составляющая индекса промышленного производства в четвертом квартале 2022 г. росла. Это было обеспечено добывающим сектором и производством товаров, замещающих иностранные бренды, ушедшие с российского рынка, а также расширением спроса на промежуточную продукцию для гособоронзаказа.

Ключевые слова: промышленность, сектора экономики, добывающая промышленность, обрабатывающие производства, Росстат, санкции.

JEL: L16, L6, L7, L8, L9.

Для корректной интерпретации имеющихся тенденций в отдельных отраслях необходимо проводить декомпозицию их выпуска на составляющие: календарную, сезонную, нерегулярную и трендовую²; содержательный интерес представляет интерпретация последней. Экспертами Института экономической политики им. Е.Т. Гайдара была осуществлена очистка рядов индексов всех отраслей промышленного производства за 2003–2021 гг. от сезонной и календарной компонент и выделена трендовая составляющая³ на основе актуальной статистики, публикуемой Росстатом по индексам производства в промышленных секторах экономики.

Результаты обработки ряда для индекса промышленного производства в целом представлены на рис. 1. На рис. 2 показан результат для агрегированных индексов добывающего

и обрабатывающего секторов, а также производства и распределения электроэнергии, газа и воды. Для остальных рядов результаты декомпозиции представлены в таблице.

В четвертом квартале 2022 г. трендовая составляющая индекса промышленного производства показала медленный рост, основной вклад в который внесли отрасли по добыче топливно-энергетических ископаемых и обрабатывающие производства. У отрасли «Производство и распределение электроэнергии, газа и воды» были околонулевые темпы роста.

5 декабря 2022 г. вступили в силу эмбарго на морские поставки нефти из России в ЕС, а также «потолок цен» на нефть на уровне 60 долл./барр. По данным МЭА, несмотря на ограничения, объемы добычи и экспорта российской нефти по итогам 2022 г. остались устойчивыми: добыча выросла на 2% — до 535

Каукин Андрей Сергеевич, и.о. руководителя Научного направления «Реальный сектор» Института экономической политики имени Е.Т. Гайдара; заведующий лабораторией системного анализа отраслевых рынков РАНХиГС при Президенте Российской Федерации, канд. экон. наук (Москва), e-mail: kaukin@ranepa.ru; Миллер Евгения Михайловна, старший научный сотрудник РАНХиГС при Президенте Российской Федерации (Москва), e-mail: miller-em@ranepa.ru

¹ Авторы выражают признательность М. Турунцевой и Т. Горшковой за помощь в проведении статистического анализа.

² «Трендовая составляющая» — используемый в литературе устоявшийся термин, однако компонента не является «трендом» в строгом смысле, используемом в эконометрике при анализе временных рядов. В данном случае это именно остаток от выделения из ряда календарной, сезонной и нерегулярной составляющих. «Трендовую составляющую» некорректно использовать для прогнозирования временных рядов. Для большинства индексов промпроизводства она нестационарна на уровнях (и стационарна в разностях), однако она может быть использована для интерпретации краткосрочной динамики и ее сопоставления с имевшими место событиями.

³ Выделение трендовой составляющей было осуществлено при помощи пакета Demetra с использованием процедуры X-12-ARIMA.

млн т, экспорт нефти в страны дальнего зарубежья по трубопроводам и морю увеличился почти на 19% — до 207 млн т. В начале 2023 г. возможно временное снижение объемов добычи (для этого могут быть выведены из оборота скважины с высоким уровнем обводненности) с последующим восстановлением, поскольку для выстраивания альтернативных каналов поставки нефти необходимо время. Дополнительным фактором сокращения объемов добычи нефти в начале 2023 г. станет вступившее в силу 5 февраля эмбарго на экспорт нефтепродуктов.

Добыча газа и его экспорт в дальнее зарубежье в четвертом квартале 2022 г. продолжили снижение по сравнению с аналогичным периодом предыдущего года. Причиной этого в первую очередь стала остановка работы экспортной инфраструктуры: сокращение более чем в два раза транзита газа через Украину после начала СВО; прекращение поставок по «Северному потоку» из-за неисправности оборудования; введение новой схемы оплаты газа (конвертация евро в рубли) для поставок на европейский рынок и приостановка в конце мая 2022 г. экспорта в Болгарию, Польшу, Финляндию, Нидерланды из-за их отказа от оплаты по новой схеме. Еще одним фактором уменьшения объемов экспорта стала догово-

ренность между странами ЕС снизить зависимость от поставок российского газа за счет сокращения спроса на 15%, достичь которого планируется к концу марта 2023 г. Помимо этого в четвертом квартале 2022 г. на объемах экспорта газа из России отрицательно сказался высокий уровень заполненности газовых хранилищ ЕС, который составил 80%.

Расширение спроса на газ со стороны ЕС возможно в конце первого полугодия 2023 г., когда начнется подготовка к следующему отопительному сезону. Положительный эффект от укрепления газового сотрудничества с Турцией, Китаем и Ираном будет заметен за пределами 2023 г. Рост в рассматриваемый период наблюдался в перевалке сжиженного газа в российских портах, что связано с замещением трубопроводного газа, поставляемого в ЕС, сжиженным, так как российский СПГ подпадает только под технологические санкции.

По итогам рассматриваемого периода в угольной промышленности сохранился рост добычи энергетического угля. Объемы добычи и экспорта коксующегося угля продолжали сокращаться из-за инфраструктурных ограничений на линиях железных дорог Дальнего Востока и конкуренции со стороны других грузов, которые были переориентированы на восток после введения санкций.

Рис. 1. Динамика индекса промышленного производства в 2014–2022 гг. (фактические данные и трендовая составляющая, на начало месяца), в % к среднегодовому значению 2016 г.

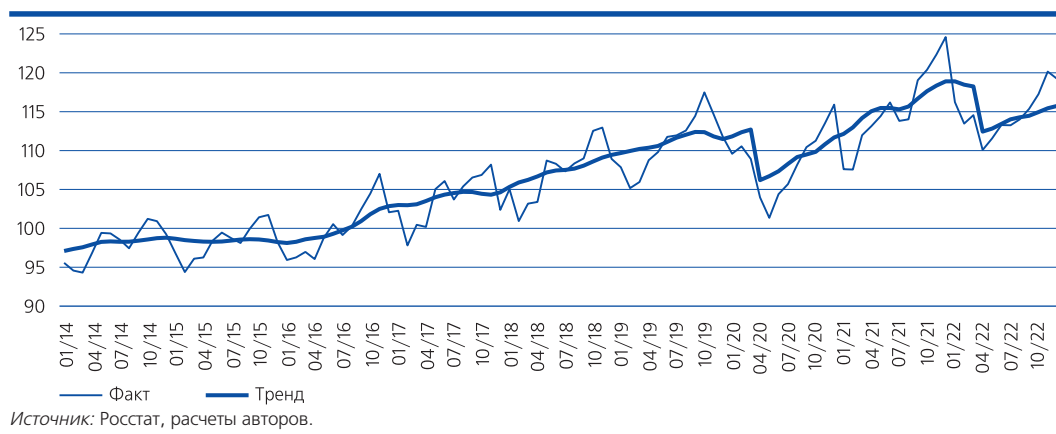
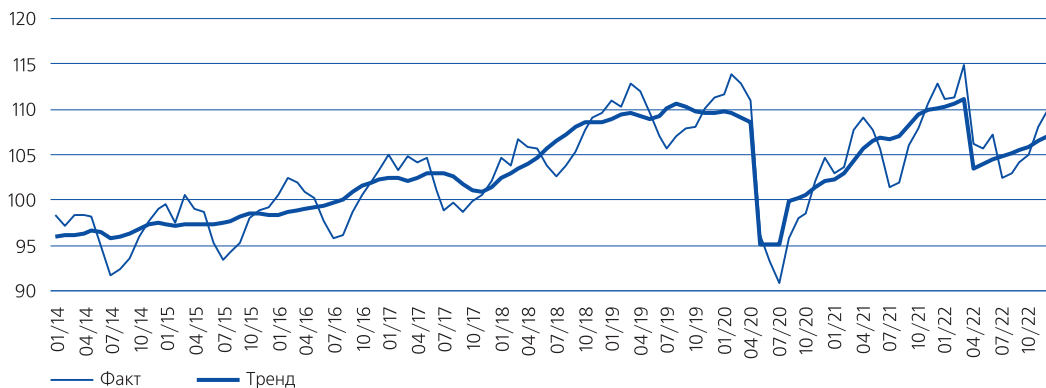
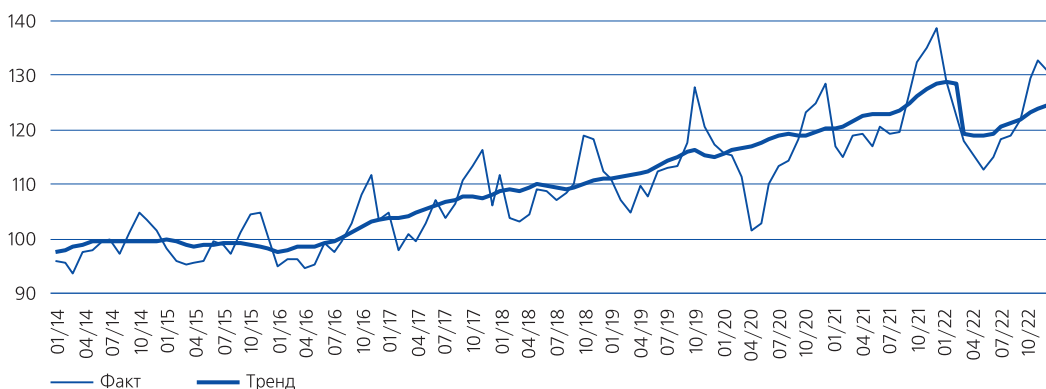


Рис. 2. Динамика индексов производства по отраслям в 2014–2022 гг. (фактические данные и трендовая составляющая, на начало месяца), в % к среднегодовому значению 2016 г.

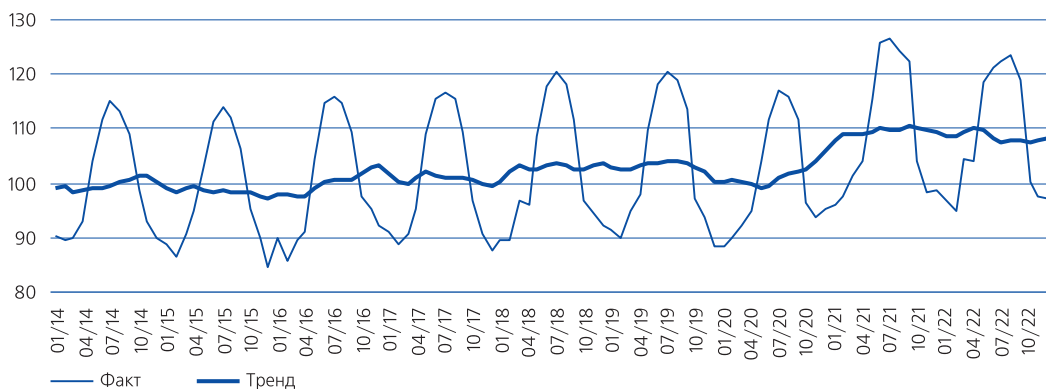
Добыча полезных ископаемых



Обрабатывающая промышленность



Производство и распределение электроэнергии, газа и воды



Источник: Росстат, расчеты авторов.

Трендовая составляющая обрабатывающего сектора по итогам четвертого квартала 2022 г. показала рост. Положительная динамика наблюдалась у отраслей, ориентированных преимущественно на внутренний спрос: в производстве пищевых продуктов, включая напитки, и табака; производстве готовых металлических изделий; производстве машин и обо-

рудования; производстве транспортных средств и оборудования. Сдерживающее влияние на динамику промышленности оказывали экспортно ориентированные отрасли, в частности химическое производство и деревообрабатывающая промышленность. Сложившаяся в этих отраслях динамика обусловлена задержкой производства иностранного произ-

Изменение индекса выпуска по отраслям экономики в декабре 2022 г., в %

Отрасли	Доля в индексе промышленного производства	Декабрь 2022 г. к декабрю 2021 г.	Декабрь 2022 г. к июню 2022 г.	Изменения последних месяцев
Индекс промышленного производства		97,34	102,04	Медленный рост
<i>Добыча полезных ископаемых</i>	<i>34,54</i>	<i>97,19</i>	<i>102,51</i>	<i>Рост</i>
<i>Обрабатывающие производства</i>	<i>54,91</i>	<i>96,86</i>	<i>104,26</i>	<i>Рост</i>
в том числе:				
Производство пищевых продуктов, включая напитки, и табака	16,34	110,71	106,18	Рост
Текстильное и швейное производство	1,14	105,52	107,27	Рост
Производство кожи, изделий из кожи и производство обуви	0,27	96,42	100,47	Медленный рост
Обработка древесины и производство изделий из дерева	2,02	81,29	95,34	Стагнация
Целлюлозно-бумажное производство	3,35	74,25	86,01	Спад
Производство кокса, нефтепродуктов	17,25	101,48	101,53	Медленный рост
Химическое производство	7,56	101,58	100,59	Стагнация
Производство резиновых и пластмассовых изделий	2,14	96,67	104,03	Рост
Производство прочих неметаллических минеральных продуктов	4,02	91,16	93,58	Спад
Металлургическое производство и производство готовых металлических изделий	17,42	114,76	115,83	Рост
Производство машин и оборудования	6,97	96,50	102,54	Рост
Производство электрооборудования, электрического и оптического оборудования	6,27	94,54	98,81	Стагнация
Производство транспортных средств и оборудования	6,75	92,49	111,60	Рост
Прочие производства	2,42	93,95	103,39	Рост
<i>Производство и распределение электроэнергии, газа и воды</i>	<i>13,51</i>	<i>98,85</i>	<i>100,09</i>	<i>Стагнация</i>
<i>Оптовая торговля</i>		<i>82,53</i>	<i>101,27</i>	<i>Медленный рост</i>
<i>Розничная торговля</i>		<i>90,04</i>	<i>101,06</i>	<i>Стагнация</i>
<i>Грузооборот</i>		<i>94,57</i>	<i>97,55</i>	<i>Стагнация</i>
<i>Строительство</i>		<i>106,17</i>	<i>103,51</i>	<i>Рост</i>
<i>Сельское хозяйство</i>		<i>105,43</i>	<i>102,41</i>	<i>Медленный рост</i>
<i>Объем платных услуг населению</i>		<i>101,23</i>	<i>101,55</i>	<i>Медленный спад</i>

Источник: Росстат, расчеты авторов.

водства товарами российских производителей из-за наложенных санкций на технологии, прекращением прямого импорта некоторых товаров, а также ростом спроса на продукцию, которая является промежуточной для выполнения гособоронзаказа.

В исследуемый период сохранился рост в торговле — за счет ухода крупных игроков из непродовольственного сегмента России и проведения распродаж их продукции, а также в строительстве — за счет ремонта и строительства инфраструктуры на присоединенных территориях. Грузооборот падает — по следующим причинам: ограничений на перевалку морскими путями продукции ТЭК; низкой пропускной способности железнодорожных путей в восточном направлении; сокращения экспорта газа по магистральным газопроводам.

Потенциальными вызовами для роста российской промышленности в 2023 г. станут:

- замещение более сложного производства производством относительно простой продукции из-за наложенных санкций на технологии и сокращение численности занятых вследствие проведенной частичной мобилизации и отъезда части специалистов за рубеж;
- снижение уровня конкуренции из-за ухода ряда иностранных производителей с российского рынка и ограничений по доступу на внешние рынки;
- сокращение доходов от экспорта российской нефти и газа в условиях эмбарго и «ценовых потолков»;
- быстрота выстраивания новых логистических цепочек и цепочек поставок, обеспечение их необходимой инфраструктурой. ■

Industrial Production Dynamics in Q4 2022

Andrey S. Kaukin — Acting Head of the Scientific Direction «Real sector» of the Gaidar Institute for Economic Policy; Head of Department for System Analysis of Sectorial Markets of the Russian Presidential Academy of National Economy and Public Administration, Candidate of Economic Sciences (Moscow, Russia). E-mail: kaukin@ranepa.ru

Eugenia M. Miller — Senior Researcher of the Russian Presidential Academy of National Economy and Public Administration (Moscow, Russia). E-mail: miller-em@ranepa.ru

Q4 2022 saw trend component growth in the industrial production index driven by extractive industries and manufacturing of goods substituting foreign brands which left the Russian market, as well as a pickup in demand for intermediate goods for the state defense order.

Key words: industry, sectors of the economy, mining industry, manufacturing industries, Rosstat, sanctions.

JEL-codes: L16, L6, L7, L8, L9.