

МОДЕЛЬНЫЕ РАСЧЕТЫ КРАТКОСРОЧНЫХ ПРОГНОЗОВ СОЦИАЛЬНО-ЭКОНОМИЧЕСКИХ ПОКАЗАТЕЛЕЙ РФ

М. Турунцева, Е. Астафьева, М. Баева, А. Божечкова,
А. Бузаев, Т. Киблицкая, Ю. Пономарев, А. Скроботов

В данном бюллетене представлены расчеты значений различных экономических показателей Российской Федерации *весной-летом 2013 г.*, построенные на основе моделей временных рядов, разработанных в результате исследований, проводимых в течение последних нескольких лет в ИЭП имени Е.Т. Гайдара¹. Используемый метод прогнозирования относится к группе *формальных* или *статистических* методов. Иными словами, полученные значения не являются выражением *мнения* или *экспертной оценки* исследователя, а представляют собой расчеты будущих значений конкретного экономического показателя, выполненные на основе формальных моделей временных рядов ARIMA (p, d, q) с учетом существующего тренда и, в некоторых случаях, его значимых изменений. Представляемые прогнозы имеют инерционный характер, поскольку соответствующие модели учитывают динамику данных до момента построения прогноза и особенно сильно зависят от тенденций, характерных для временного ряда в период непосредственно предшествующий интервалу времени, для которого строится прогноз. Данные оценки будущих значений экономических показателей Российской Федерации могут быть использованы для поддержки принятия решений, касающихся экономической политики, при условии, что общие тенденции, наблюдаемые до момента, в который строится прогноз для каждого конкретного показателя, не изменятся, т.е. в будущем не произойдет серьезных шоков или изменения сложившихся долгосрочных тенденций.

Несмотря на наличие значительного объема данных, относящихся к периоду до кризиса 1998 г., анализ и построение моделей для прогнозирования производилось лишь на временном интервале после августа 1998 г. Это обусловлено результатами предыдущих исследований², одним из основных выводов которых является то, что учет данных докризисного периода в большинстве случаев ухудшает качество прогнозов. К тому же, в данный момент представляется некорректным использование еще более коротких рядов (после кризиса 2008 г.), поскольку статистические характеристики получаемых на таком небольшом интервале времени моделей оказываются очень низкими.

Оценка моделей рассматриваемых экономических показателей проводилась по стандартным методикам анализа временных рядов. На первом шаге анализировались коррелограммы исследуемых рядов и их первых разностей с целью определения максимального количества запаздывающих значений, которые необходимо включать в спецификацию модели. Затем, исходя из результатов анализа коррелограмм, все ряды тестировались на слабую стационарность (или стационарность около тренда) при помощи теста Дики–Фуллера. В некоторых случаях проводилось тестирование рядов на стационарность около сегментированного тренда при помощи тестов на эндогенные структурные сдвиги Перрона или Зивота–Эндрюса³.

После разделения рядов на слабо стационарные, стационарные около тренда, стационарные около тренда со структурным сдвигом либо стационарные в разностях для каждого из

1 См., например, Энтов Р.М., Дробышевский С.М., Носко В.П., Юдин А.Д. *Эконометрический анализ динамических рядов основных макроэкономических показателей*. М., ИЭПП, 2001; Р.М. Энтов, В.П. Носко, А.Д. Юдин, П.А. Кадочников, С.С. Пономаренко. *Проблемы прогнозирования некоторых макроэкономических показателей*. М., ИЭПП, 2002; В. Носко, А. Бузаев, П. Кадочников, С. Пономаренко. *Анализ прогнозных свойств структурных моделей и моделей с включением результатов опросов предприятий*. М., ИЭПП, 2003; Турунцева М.Ю., Киблицкая Т.Р. *Качественные свойства различных подходов к прогнозированию социально-экономических показателей РФ*. М.: ИЭПП, 2010, Научные труды № 135Р.

2 Там же.

3 См.: Perron, P. Further Evidence on Breaking Trend Functions in Macroeconomic Variables, *Journal of Econometrics*, 1997, 80, pp. 355–385; Zivot, E. and D.W.K. Andrews. Further Evidence on the Great Crash, the Oil-Price Shock, and Unit-Root Hypothesis. *Journal of Business and Economic Statistics*, 1992, 10, pp. 251–270.

них были оценены соответствующие его типу модели (в уровнях, а если необходимо, то и с включением тренда либо сегментированного тренда, либо в разностях). На основе информационных критериев Акаике и Шварца, а также свойств остатков моделей (отсутствие автокоррелированности, гомоскедастичность, нормальность) и качества ретропрогнозов, полученных по этим моделям, выбиралась лучшая. Расчеты прогнозных значений проводились по лучшей модели, построенной для каждого экономического показателя.

Кроме того, в *Бюллетене* на основе разработанных в ИЭП имени Е.Т. Гайдара моделей представлены расчеты будущих значений месячных показателей ИПЦ, объемов импорта из всех стран и экспорта во все страны на основе структурных моделей (SM). Прогнозные значения, полученные на основе структурных моделей, в ряде случаев, могут давать лучшие результаты по сравнению с ARIMA-моделями, поскольку при их построении используется дополнительная информация о динамике экзогенных переменных. Помимо этого включение структурных прогнозов в построение усредненных прогнозов (т.е. прогнозов, полученных как среднее значение по нескольким моделям) может способствовать уточнению прогнозных значений.

При моделировании динамики индекса потребительских цен использовались теоретические гипотезы, вытекающие из денежной теории. В качестве объясняющих переменных применялись: предложение денег, объем выпуска, динамика номинального обменного курса рубля к доллару, характеризующая динамику альтернативной стоимости хранения денег. Также в модель для индекса потребительских цен включался индекс цен в электроэнергетике, т.к. этот показатель в значительной степени определяет динамику затрат производителей.

В качестве основного показателя, который может оказывать влияние на величину экспорта и импорта, следует отметить реальный обменный курс, изменение которого приводит к изменению относительной стоимости отечественных и импортных товаров. Однако в эконометрических моделях его влияние оказывается незначимым. Наиболее существенными факторами, определяющими динамику экспорта, являются мировые цены на экспортируемые ресурсы, в особенности цены на нефть: повышение цены приводит к увеличению экспорта товара. В качестве характеристики относительной конкурентоспособности российских товаров используется уровень доходов населения в экономике (стоимость рабочей силы). Для учета сезонных колебаний экспорта введены фиктивные переменные D12 и D01, равные единице в декабре и январе соответственно и нулю в остальные периоды. На динамику импорта оказывают влияние доходы населения и предприятий, увеличение которых вызывает увеличение спроса на все товары, включая импортные. Характеристикой доходов населения являются реальные располагаемые денежные доходы; а показателем доходов предприятий – индекс промышленного производства.

Прогнозные значения показателей курсов валют также строились на основе структурных моделей их зависимости от мировых цен на нефть.

Необходимые для построения прогнозов на основе структурных моделей прогнозные значения объясняющих переменных рассчитывались на основе моделей ARIMA (p, d, q).

В работе также представлены расчеты значений индексов промышленного производства, индекса цен производителей и показателя общей численности безработных, рассчитанные с использованием результатов конъюнктурных опросов ИЭП имени Е.Т. Гайдара. Эмпирические исследования показывают¹, что использование рядов конъюнктурных опросов в прогнозных моделях в качестве объясняющих переменных² в среднем улучшает точность прогноза. Расчеты будущих значений этих показателей проводились на основе ADL-моделей (с добавлением сезонных авторегрессионных запаздываний).

Все расчеты проводились с использованием эконометрического пакета Eviews.

1 См., например: В. Носко, А. Бузаев, П. Кадочников, С. Пономаренко. *Анализ прогнозных свойств структурных моделей и моделей с включением результатов опросов предприятий*. М., ИЭПП, 2003.

2 В качестве объясняющих переменных использованы следующие ряды конъюнктурных опросов: текущие/ожидаемые изменение производства, ожидаемые изменения платежеспособного спроса, текущие/ожидаемые изменения цен и ожидаемое изменение занятости.

ПРОМЫШЛЕННОЕ ПРОИЗВОДСТВО И РОЗНИЧНЫЙ ТОВАРООБОРОТ

Промышленное производство

Для построения прогноза на март–август 2013 г. были использованы ряды месячных данных индексов промышленного производства Федеральной службы государственной статистики (Росстата) с января 2002 г. по декабрь 2012 г. и ряды базисных индексов промышленного производства Научно-исследовательского университета Высшей школы экономики (НИУ ВШЭ)¹ за период с января 1999 г. по январь 2013 г. (значение января 1995 г. принято за 100%). Прогнозные значения рассматриваемых рядов рассчитывались на основе моделей класса ARIMA. Прогнозные значения индексов промышленного производства Росстата и НИУ ВШЭ рассчитываются, кроме того, с использованием результатов конъюнктурных опросов (КО). Полученные результаты представлены в табл. 1.

Как видно из табл. 1, средний² прирост индекса промышленного производства НИУ ВШЭ в марте–августе 2013 г. по сравнению с аналогичным периодом предыдущего года по промышленности в целом достигает 2,6%. Для индекса промышленного производства Росстата данный показатель составляет 1,9%.

Среднемесячные значения индекса промышленного производства в добыче полезных ископаемых Росстата и НИУ ВШЭ в марте–августе 2013 г. составляют соответственно 0% и 0,2%. В производстве кокса и нефтепродуктов средний рост прогнозируется на уровне 5,0% и 5,3% для индексов Росстата и НИУ ВШЭ соответственно.

Средний прирост индекса промышленного производства в обрабатывающей промышленности НИУ ВШЭ в марте–августе 2013 г. по сравнению с аналогичным периодом предыдущего года достигает 4,0%, индекса Росстата – 2,5%. Среднемесячные значения индекса промышленного производства в производстве пищевых продуктов Росстата и НИУ ВШЭ находятся на уровне соответственно 3,7% и 4,9%. Среднемесячные значения индексов промышленного производства Росстата и НИУ ВШЭ для металлургического производства и производства готовых металлических изделий в марте–августе 2013 г. составляют соответственно 2,3% и 0,7%. В производстве машин и оборудования средний рост прогнозируется на уровне 7,9% и 6,0% для индексов Росстата и НИУ ВШЭ соответственно.

Средний прирост индекса промышленного производства в производстве и распределении электроэнергии, газа и воды Росстата в марте–августе 2013 г. по сравнению с аналогичным периодом предыдущего года составляет 2,1%; аналогичный показатель для индекса НИУ ВШЭ – 2,9%.

Розничный товарооборот

В данном разделе (см. табл. 2) представлены прогнозы месячных объемов розничного товарооборота, построенные на основе месячных данных Росстата за период с января 1999 г. по декабрь 2012 г.

Как следует из результатов, представленных в табл. 2, средний прогнозируемый прирост объемов месячного товарооборота в период с марта по август 2013 г. по отношению к соответствующему периоду 2012 г. составляет около 13,0%.

Средний прогнозируемый прирост месячного реального товарооборота весной-летом 2013 г. по отношению к аналогичному периоду 2012 г. составляет 6,2%.

1 Данные индексы рассчитываются Барановым Э.А. и Бессоновым В.А.

2 Под средним приростом индексов промышленного производства мы понимаем среднее значение данных показателей за шесть прогнозируемых месяцев.

Таблица 1

РЕЗУЛЬТАТЫ РАСЧЕТОВ ПРОГНОЗНЫХ ЗНАЧЕНИЙ ИНДЕКСОВ ПРОМЫШЛЕННОГО ПРОИЗВОДСТВА¹, %

	Индекс промышленного производства				ИПП в добыче полезных ископаемых		ИПП в обрабатывающих производствах		ИПП в производстве и распределении электроэнергии, газа и воды		ИПП в производстве пищевых продуктов		ИПП в производстве кокса и нефтепродуктов		ИПП в металлургическом производстве и производстве готовых металлических изделий		ИПП в производстве машин и оборудования	
	Росстат		НИУ ВШЭ		Росстат		НИУ ВШЭ		Росстат		НИУ ВШЭ		Росстат		НИУ ВШЭ		Росстат	
	ARIMA	Ю	ARIMA	Ю	Росстат	НИУ ВШЭ	Росстат	НИУ ВШЭ	Росстат	НИУ ВШЭ	Росстат	НИУ ВШЭ	Росстат	НИУ ВШЭ	Росстат	НИУ ВШЭ	Росстат	НИУ ВШЭ
Прогнозируемый прирост к соответствующему месяцу предшествующего года																		
Март 13	2,1	1,7	2,5	2,3	0,1	-0,4	4,0	4,8	0,6	4,1	3,4	5,9	5,4	3,0	-0,5	-3,6	3,1	
Апрель 13	3,0	1,7	2,1	2,1	1,3	0,2	4,3	4,5	1,1	4,0	4,8	9,8	5,6	3,8	0,4	9,0	5,6	
Май 13	0,7	1,9	2,9	2,3	1,0	0,7	0,2	3,6	2,6	3,8	4,4	6,2	7,9	0,1	0,2	5,5	3,7	
Июнь 13	2,3	1,8	2,9	2,5	0,1	0,6	2,1	3,6	3,1	2,6	3,7	3,2	2,9	2,6	1,7	16,9	10,9	
Июль 13	1,2	2,1	2,7	2,5	-1,3	0,4	2,0	4,2	2,4	4,1	7,1	2,5	5,5	0,9	1,8	1,1	-0,3	
Август 13	2,2	2,2	2,2	2,8	-1,3	-0,1	2,8	3,1	2,8	3,8	5,8	2,4	4,8	3,2	0,8	18,2	12,7	
Справочно: фактический прирост 2012 г. к соответствующему месяцу 2011 г.																		
Март 12	2,0		1,5		0,8	1,4	2,4	1,7	1,3	0,6	5,1	0,6	0,7	3,2	-1,9	2,8	6,1	
Апрель 12	1,3		1,4		1,2	0,8	3,6	2,5	-0,6	4,5	3,4	3,5	0,0	5,0	2,3	-4,8	-2,8	
Май 12	3,7		1,9		-0,3	-0,3	7,0	3,4	1,2	6,4	4,9	1,0	-4,0	12,2	3,2	-7,7	8,6	
Июнь 12	1,9		1,1		0,2	-0,1	3,4	1,9	2,1	8,1	7,1	2,0	-0,7	4,2	-0,7	-19,7	-17,1	
Июль 12	3,4		2,1		0,9	0,5	5,0	3,3	0,8	4,0	3,6	1,7	-1,6	6,2	-2,1	-5,4	7,5	
Август 12	2,1		2,5		0,8	0,9	4,5	3,6	0,2	4,9	4,9	1,7	0,8	4,9	-1,7	-7,3	-6,8	

Примечание. На рассматриваемых интервалах времени ряды цепных индексов промышленного производства по промышленности в целом Росстата и НИУ ВШЭ, а также цепные индексы промышленного производства в производстве машин и оборудования НИУ ВШЭ идентифицированы как процессы, являющиеся стационарными около тренда с эндогенным структурным сдвигом; ряды цепных индексов промышленного производства в обрабатывающих производствах, металлургическом производстве и производстве готовых металлических изделий Росстата и НИУ ВШЭ, а также цепных индексов промышленного производства в добыче полезных ископаемых НИУ ВШЭ и в производстве машин и оборудования Росстата идентифицированы как процессы, являющиеся стационарными около тренда с двумя эндогенными структурными сдвигами. Временные ряды остальных цепных индексов являются стационарными в уровнях.

1 Отметим, что для построения прогнозов использованы так называемые «сырые» индексы (без сезонной и календарной корректировки), поэтому в большинстве моделей учитывается наличие сезонности, и, как следствие, полученные результаты отражают сезонную динамику рядов.

Таблица 2

РЕЗУЛЬТАТЫ РАСЧЕТОВ ПРОГНОЗНЫХ ЗНАЧЕНИЙ
ОБЪЕМА РОЗНИЧНОГО ТОВАРООБОРОТА
И РЕАЛЬНОГО РОЗНИЧНОГО ТОВАРООБОРОТА

Прогнозируемые значения по ARIMA-модели		
	Розничный товарооборот, млрд руб. (в скобках – прирост к соответствующему месяцу предыдущего года, %)	Реальный розничный товарооборот (в % к соответствующему периоду предыдущего года)
Мар 2013	1836,5 (12,5)	105,8
Апр 2013	1857,5 (12,9)	106,0
Май 2013	1927,4 (13,0)	106,1
Июн 2013	1966,3 (12,7)	105,9
Июл 2013	2026,3 (13,3)	106,3
Авг 2013	2090,4 (13,7)	106,9
Справочно: фактические значения за аналогичные месяцы 2012 г.		
Мар 2012	1632,6	107,4
Апр 2012	1645,5	106,8
Май 2012	1706,0	107,1
Июн 2012	1744,1	107,1
Июл 2012	1788,4	105,5
Авг 2012	1838,6	104,4

Примечание. Ряды розничного товарооборота и реального розничного товарооборота на интервале с января 1999 г. по декабрь 2012 г. являются рядами типа DS.

Таблица 3

РЕЗУЛЬТАТЫ РАСЧЕТОВ ПРОГНОЗНЫХ ЗНАЧЕНИЙ
ОБЪЕМА ИНВЕСТИЦИЙ В ОСНОВНОЙ КАПИТАЛ И
РЕАЛЬНЫХ ИНВЕСТИЦИЙ В ОСНОВНОЙ КАПИТАЛ

Прогнозируемые значения по ARIMA-модели		
	Инвестиции в основной капитал, млрд руб. (в скобках – прирост к соответствующему месяцу предыдущего года, %)	Реальные инвестиции в основной капитал (в % к соответствующему периоду предыдущего года)
Мар 2013	747,6 (11,4)	104,5
Апр 2013	753,9 (10,2)	107,3
Май 2013	1004,8 (10,1)	106,2
Июн 2013	1157,5 (9,7)	105,1
Июл 2013	1043,8 (7,8)	103,6
Авг 2013	1187,3 (7,8)	102,8
Справочно: фактические значения за аналогичные месяцы 2012 г.		
Мар 2012	670,9	117,0
Апр 2012	684,4	108,1
Май 2012	912,3	113,4
Июн 2012	1055,0	108,8
Июл 2012	968,0	112,1
Авг 2012	1101,1	111,4

Примечание. Ряды инвестиций в основной капитал на интервале с января 1999 г. по декабрь 2012 г. являются рядами типа DS.

ИНВЕСТИЦИИ В ОСНОВНОЙ КАПИТАЛ

В табл. 3 представлены результаты расчетов прогнозируемых значений инвестиций в основной капитал весной-летом 2013 г. Прогнозы строились на основе моделей временных рядов по данным Росстата за период с января 1999 г. по декабрь 2012 г.

Результаты, представленные в табл. 3, показывают, что средний прогнозируемый прирост инвестиций в период с марта по август 2013 г. по отношению к соответствующему периоду 2012 г. достигают порядка 9,5%.

Средний прогнозируемый прирост реальных инвестиций в период с марта по август 2013 г. по отношению к соответствующему периоду 2012 г. составляет 4,9%.

ВНЕШНЕТОРГОВЫЕ ПОКАЗАТЕЛИ

Модельные расчеты прогнозных значений объемов экспорта, экспорта в страны вне СНГ, импорта и импорта из стран вне СНГ получены на основе моделей временных рядов и структурных моделей, оцененных на месячных данных на интервале с сентября 1998 г. по декабрь 2012 г. по данным ЦБ РФ¹. Результаты расчетов представлены в табл. 4.

Средний прогнозируемый прирост показателей экспорта во все страны, импорта из всех стран, экспорта в страны вне СНГ и импорта из стран вне СНГ за март–август 2013 г. по отношению к аналогичному периоду 2012 г. составит 9,8, 10,6, 10,9 и 6,0% соответственно. Средний прогнозируемый объем сальдо торгового баланса со всеми странами с марта по август 2013 г. достигнет 98,1 млрд долл., что соответствует увеличению на 8,2% по отношению к аналогичному периоду 2012 г.

¹ Данные по внешнеторговому обороту рассчитаны ЦБ РФ в соответствии с методологией составления платежного баланса в ценах страны экспортера (ФОб) в млрд долл. США.

Таблица 4

РЕЗУЛЬТАТЫ РАСЧЕТОВ ПРОГНОЗНЫХ ЗНАЧЕНИЙ ОБЪЕМОВ ВНЕШНЕТОРГОВОГО ОБОРОТА СО СТРАНАМИ ВНЕ СНГ

Месяц	Экспорт, всего						Импорт, всего						Экспорт в страны вне СНГ						Импорт из стран вне СНГ								
	прогнозные значения (млрд долл. в мес.)			% от фактических данных за соответствующий месяц предыдущего года			прогнозные значения (млрд долл. в мес.)			% от фактических данных за соответствующий месяц предыдущего года			прогнозные значения (млрд долл. в мес.)			% от фактических данных за соответствующий месяц предыдущего года			прогнозные значения (млрд долл. в мес.)			% от фактических данных за соответствующий месяц предыдущего года					
	ARIMA	SM	ARIMA	ARIMA	SM	ARIMA	ARIMA	SM	ARIMA	ARIMA	SM	ARIMA	ARIMA	SM	ARIMA	ARIMA	SM	ARIMA	ARIMA	SM	ARIMA	ARIMA	SM				
Март 2013	45,9	47,4	98	101	101	110	31,5	30,1	37,7	42,6	95	107	25,8	24,2	106	99	107	25,8	24,2	106	99	107	25,8	24,2			
Апрель 2013	48,7	48,2	108	107	110	123	33,2	29,6	38,6	41,0	101	107	26,6	25,0	116	109	107	26,6	25,0	116	109	107	26,6	25,0			
Май 2013	47,1	46,6	103	102	101	116	32,8	28,4	39,1	41,6	100	107	27,3	24,4	112	100	107	27,3	24,4	112	100	107	27,3	24,4			
Июнь 2013	47,0	47,4	115	116	117	118	31,9	31,6	39,4	40,4	115	118	26,5	25,6	114	110	118	26,5	25,6	114	110	118	26,5	25,6			
Июль 2013	47,7	49,0	116	119	119	107	31,8	31,7	40,5	41,2	118	120	27,1	25,0	105	97	120	27,1	25,0	105	97	120	27,1	25,0			
Август 2013	48,5	49,8	117	121	121	109	32,6	32,0	41,2	43,8	120	128	27,6	26,1	106	100	128	27,6	26,1	106	100	128	27,6	26,1			
Справочно: фактические значения за соответствующие месяцы 2012 г. (млрд долл.)																											
Март 2012	46,8			28,7			39,7			24,4			39,7			24,4			39,7			24,4			24,4		
Апрель 2012	45,1			26,9			38,2			22,9			38,2			22,9			38,2			22,9			22,9		
Май 2012	45,7			28,2			39,0			24,3			39,0			24,3			39,0			24,3			24,3		
Июнь 2012	40,9			27,0			34,1			23,3			34,1			23,3			34,1			23,3			23,3		
Июль 2012	41,3			29,7			34,4			25,9			34,4			25,9			34,4			25,9			25,9		
Август 2012	41,3			30,0			34,3			26,0			34,3			26,0			34,3			26,0			26,0		

Примечание. На интервале с января 1999 г. по ноябрь 2012 г. ряды экспорта, импорта, экспорта в страны вне СНГ и импорта из стран вне СНГ идентифицированы как ряды стационарные в первых разностях. Во всех случаях в спецификацию моделей были включены сезонные компоненты.

ДИНАМИКА ЦЕН

Индекс потребительских цен и индексы цен производителей

В данном разделе представлены расчеты прогнозных значений индекса потребительских цен и индексов цен производителей (как в целом по промышленности, так и по некоторым ее видам деятельности по классификации ОКВЭД), полученные на основе моделей временных рядов, оцененных по данным Росстата на интервале с января 1999 г. по декабрь 2012 г.¹ В табл. 5 приведены результаты модельных расчетов прогнозных значений в марте–августе 2013 г. по ARIMA-моделям, структурным моделям (SM) и моделям, построенным с использованием конъюнктурных опросов (КО).

Таблица 5

РЕЗУЛЬТАТЫ РАСЧЕТОВ ПРОГНОЗНЫХ ЗНАЧЕНИЙ ИНДЕКСОВ ЦЕН

Месяц	Индекс потребительских цен (ARIMA)	Индекс потребительских цен (SM)	Индексы цен производителей:													
			ИЦП промышленных товаров (ARIMA)	ИЦП промышленных товаров (КО)	добыча полезных ископаемых	обрабатывающие производства	производство электроэнергии, газа и воды	производство пищевых продуктов	текстильное и швейное производство	обработка древесины и производство изделий из дерева	целлюлозно-бумажное производство	производство кокса, нефтепродуктов	химическое производство	металлургическое производство и производство готовых металлических изделий	производство машин и оборудования	производство транспортных средств и оборудования
Прогнозные значения (в % к предыдущему месяцу)																
мар.13	100,5	100,5	100,0	101,8	102,0	100,4	101,7	100,5	100,4	100,3	100,5	102,2	100,9	99,6	100,4	100,5
апр.13	100,6	100,3	99,4	101,1	99,8	101,1	99,7	100,4	100,7	100,0	100,4	102,5	101,2	101,4	100,4	100,3
май.13	100,6	100,3	100,0	97,7	100,2	100,5	99,8	100,6	100,8	100,2	100,6	101,9	100,4	102,9	100,3	100,3
июн.13	100,6	100,4	100,9	99,0	100,6	100,6	100,0	101,2	100,5	100,3	100,4	101,7	100,3	101,8	100,1	100,0
июл.13	100,7	100,2	100,8	99,1	103,2	100,5	99,5	101,6	100,7	100,3	100,4	102,1	100,4	101,0	100,1	100,9
авг.13	100,3	100,2	102,3	104,5	107,6	101,1	100,8	101,3	100,6	100,7	100,7	102,5	100,2	102,4	99,9	100,7
Прогнозные значения (в % к декабрю 2012 г.)																
мар.13	103,0	102,1	100,5	102,9	106,7	101,0	111,2	100,8	101,5	100,7	101,2	103,5	100,7	97,0	101,4	102,2
апр.13	103,6	102,4	99,9	104,0	106,5	102,1	110,9	101,2	102,2	100,7	101,7	106,1	101,8	98,3	101,8	102,5
май.13	104,2	102,7	99,9	101,6	106,7	102,6	110,6	101,8	103,1	100,9	102,3	108,1	102,2	101,2	102,2	102,8
июн.13	104,9	103,1	100,8	100,6	107,3	103,3	110,6	103,0	103,6	101,2	102,7	110,0	102,5	102,9	102,3	102,8
июл.13	105,6	103,3	101,6	99,7	110,8	103,7	110,0	104,7	104,4	101,5	103,2	112,2	102,9	104,0	102,3	103,7
авг.13	105,9	103,6	103,9	104,2	119,2	104,9	110,9	106,1	105,0	102,3	103,9	115,1	103,1	106,5	102,2	104,4
Справочно: фактические значения за аналогичные периоды 2012 г. (в % к декабрю 2011 г.)																
мар.12	101,5	102,9	114,7	99,3	99,9	99,7	98,8	100,3	100,3	94,7	101,7	99,4	101,7	101,5	101,5	101,5
апр.12	101,8	103,5	115,3	100,2	99,7	100,3	98,9	100,2	100,1	98,1	102,9	98,5	103,0	102,0	102,0	102,0
май.12	102,3	101,0	105,1	100,3	98,7	100,7	98,3	100,8	101,3	97,7	103,1	98,1	103,8	101,8	101,8	101,8
июн.12	103,2	100,1	101,3	100,6	97,7	101,3	98,8	101,4	100,7	96,5	103,5	99,5	103,6	102,4	102,4	102,4
июл.12	104,5	99,0	93,6	101,3	99,5	102,6	98,9	100,9	100,6	98,4	103,8	99,6	103,6	102,6	102,6	102,6
авг.12	104,6	104,1	107,3	103,0	105,6	104,3	99,4	100,9	101,9	104,7	104,2	99,7	103,0	102,1	102,1	102,1

Примечание. На интервале с января 1999 г. по декабрь 2012 г. ряд цепного индекса цен производителей промышленных товаров в производстве машин и оборудования идентифицирован как процесс, являющийся стационарным около тренда с двумя эндогенными структурными сдвигами. Ряды остальных цепных индексов цен являются стационарными в уровнях.

Прогнозируемый среднемесячный прирост индекса потребительских цен в марте–августе 2013 г. составит 0,4%. Прирост цен производителей промышленных товаров за указанный период прогнозируется в среднем на уровне 0,5% в месяц.

¹ Структурные модели оценивались на интервале с октября 1998 г.

Для индексов цен производителей ОКВЭД с марта по август 2013 г. прогнозируются следующие средние темпы роста в месяц: 2,2% – в добыче полезных ископаемых, 0,7% – в обрабатывающих производствах, 0,2% – в производстве и распределении электроэнергии, газа и воды, 0,9% – в производстве пищевых продуктов, 0,6% – в текстильном и швейном производстве, 0,3% – в обработке древесины и производстве изделий из дерева, 0,5% – в целлюлозно-бумажном производстве, 2,2% – в производстве кокса и нефтепродуктов, 0,5% – в химическом производстве, 1,5% – в металлургическом производстве и производстве готовых металлических изделий, 0,2% – в производстве машин и оборудования и 0,4% – в производстве транспортных средств и оборудования.

Динамика стоимости минимального набора продуктов питания

В данном разделе представлены результаты расчетов прогнозируемых значений стоимости минимального набора продуктов питания в марте–августе 2013 г. Прогнозы строились на основе временных рядов по данным Росстата за период с января 2000 г. по ноябрь 2012 г. Результаты расчетов представлены в табл. 6.

Как видно из табл. 6, прогнозируется рост стоимости минимального набора продуктов питания по сравнению с соответствующим уровнем прошлого года. При этом средняя прогнозируемая стоимость минимального набора продуктов питания составляет около 2739,8 руб. Прогнозируемый прирост стоимости минимального набора продуктов питания составляет в среднем около 7,3% по сравнению с уровнем соответствующего периода прошлого года.

Таблица 6
ПРОГНОЗ СТОИМОСТИ МИНИМАЛЬНОГО НАБОРА ПРОДУКТОВ ПИТАНИЯ (НА ОДНОГО ЧЕЛОВЕКА В МЕСЯЦ)

Прогнозируемые значения по ARIMA-модели, руб.	
Март 2013	2692,9
Апрель 2013	2702,2
Май 2013	2720,1
Июнь 2013	2764,3
Июль 2013	2793,0
Август 2013	2766,4
Справочно: фактические значения за аналогичные месяцы 2012 г., млрд руб.	
Март 2012	2472,8
Апрель 2012	2482,9
Май 2012	2508,5
Июнь 2012	2602,8
Июль 2012	2658,4
Август 2012	2595,8
Прогнозируемый прирост к соответствующему месяцу предыдущего года, %	
Март 2013	8,9
Апрель 2013	8,8
Май 2013	8,4
Июнь 2013	6,2
Июль 2013	5,1
Август 2013	6,6

Примечание. Ряд стоимости минимального набора продуктов на интервале с января 2000 г. по декабрь 2012 г. является стационарным в первых разностях.

Индексы транспортных тарифов на грузовые перевозки

В данном разделе представлены расчеты прогнозных значений индексов цен транспортных тарифов на грузовые перевозки¹, полученные на основе моделей временных рядов, оцененных по данным Росстата на интервале с сентября 1998 г. по декабрь 2012 г. В табл. 7 приведены результаты модельных расчетов прогнозных значений весной–летом 2013 г. Отметим, что некоторые из рассматриваемых показателей (например, индекс тарифов на трубопроводный транспорт) являются регулируемыми, в силу чего их поведение весьма сложно описать моделями временных рядов. В результате, получаемые будущие значения

1 В Бюллетене рассмотрены сводный индекс транспортных тарифов на грузовые перевозки и индекс транспортных тарифов на грузовые перевозки автомобильным транспортом, а также индекс тарифов на трубопроводный транспорт. Сводный индекс транспортных тарифов на грузовые перевозки рассчитывается на основе индексов тарифов на грузовые перевозки отдельными видами транспорта: железнодорожным, трубопроводным, морским, внутренним водным, автомобильным и воздушным (более подробно см., например: *Цены в России. Официальное издание Госкомстата РФ, 1998*).

могут сильно отличаться от реальных в случаях централизованного увеличения тарифов на интервале прогнозирования или при отсутствии такового на прогнозируемом участке при увеличении накануне.

Таблица 7

РЕЗУЛЬТАТЫ РАСЧЕТОВ ПРОГНОЗНЫХ ЗНАЧЕНИЙ ИНДЕКСОВ ТРАНСПОРТНЫХ ТАРИФОВ

Период	Сводный индекс транспортных тарифов на грузовые перевозки	Индекс тарифов на грузовые перевозки автомобильным транспортом	Индекс тарифов на трубопроводный транспорт
Прогнозные значения по ARIMA-моделям (в % к предшествующему месяцу)			
Март 2013	100,4	100,0	104,3
Апрель 2013	100,4	100,0	102,5
Май 2013	100,4	100,0	100,0
Июнь 2013	100,4	100,0	101,9
Июль 2013	100,4	100,0	104,0
Август 2013	100,3	99,9	101,9
Прогнозные значения по ARIMA-моделям (в % к декабрю предыдущего года)			
Март 2013	100,0	100,6	100,0
Апрель 2013	105,2	100,4	111,6
Май 2013	100,2	100,4	100,1
Июнь 2013	100,2	100,5	100,1
Июль 2013	105,8	99,9	112,4
Август 2013	100,2	100,3	100,3
Справочно: фактические значения за аналогичный период 2012 г. (в % к предыдущему месяцу)			
Март 2012	100,6	100,0	100,0
Апрель 2012	100,4	111,6	105,2
Май 2012	100,4	100,1	100,2
Июнь 2012	100,5	100,1	100,2
Июль 2012	99,9	112,4	105,8
Август 2012	100,3	100,3	100,2

Примечание. На интервале с сентября 1998 г. по декабрь 2012 г. ряд индекса тарифов на грузовые перевозки автомобильным транспортом был идентифицирован как стационарный ряд; остальные ряды так же были идентифицированы как стационарные ряды на интервале с сентября 1998 г. по декабрь 2012 г.; для всех рядов использовались фиктивные переменные для учета особо резких всплесков.

По результатам прогноза на март–август 2013 г. среднемесячный рост сводного индекса транспортных тарифов на грузовые перевозки будет на уровне 0,4%.

По прогнозам на весну–лето 2013 г. индекс тарифов на грузовые перевозки автомобильным транспортом практически не будет изменяться. Индекс тарифов на трубопроводный транспорт будет расти в течение следующих шести месяцев со среднемесячным темпом 2,5%.

Динамика цен на некоторые виды сырья на мировом рынке

В данном разделе в табл. 8 представлены расчеты среднемесячных значений цен на нефть марки Brent (долл./барр.), алюминий (долл./т), золото (долл./унц.), медь (долл./т) и никель (долл./т) в марте–августе 2013 г., полученные на основе нелинейных моделей временных рядов, оцененных по данным МВФ на интервале с января 1980 г. по январь 2013 г.

Средний прогнозируемый уровень цен на нефть составляет около 123,3 долл./барр., что выше соответствующих показателей прошлого года в среднем на 11,8%. Цены на алюминий прогнозируются на уровне около 2037 долл./т, а их среднее прогнозируемое повышение составляет приблизительно 4% по сравнению с соответствующим уровнем прошлого года. Прогноз цен на золото составляет около 1695 долл./унц. Средние прогнозируемые цены на медь составляют около 8030 долл./т, а на цены никель – около 17577 долл./т. Среднее прогнозируемое повы-

шение цен на золото составляет около 5%, на медь – около 2%, на никель – 4% по сравнению с соответствующим уровнем прошлого года.

Таблица 8

РЕЗУЛЬТАТЫ РАСЧЕТОВ ПРОГНОЗНЫХ ЗНАЧЕНИЙ ЦЕН НА ПРИРОДНЫЕ РЕСУРСЫ

Месяц	Нефть марки Brent, долл./ барр.	Алюминий, долл./ т	Золото, долл./ унц.	Медь, долл./ т	Никель, долл./ т
Прогнозные значения по ARIMA-моделям					
Март 2013	119,41	2057	1684	8086	17179
Апрель 2013	121,00	2052	1690	8065	17549
Май 2013	122,22	2026	1693	8046	17479
Июнь 2013	123,65	2035	1697	8032	17658
Июль 2013	125,70	2034	1700	7998	17776
Август 2013	127,84	2019	1704	7954	17824
Приросты к соответствующему месяцу предыдущего года, %					
Март 2013	-4,4	-5,8	0,5	-4,5	-7,9
Апрель 2013	0,3	0,2	2,5	-2,7	-1,9
Май 2013	10,6	1,2	6,8	1,9	3,0
Июнь 2013	29,4	7,9	6,3	8,1	6,3
Июль 2013	21,9	8,4	6,7	5,5	10,2
Август 2013	12,8	9,5	4,8	5,9	13,5
Справочно: фактические значения за аналогичный период 2012 г.					
Март 2012	124,93	2184	1675	8471	18661
Апрель 2012	120,59	2049	1649	8286	17893
Май 2012	110,52	2003	1585	7897	16968
Июнь 2012	95,59	1886	1596	7428	16604
Июль 2012	103,14	1876	1594	7584	16128
Август 2012	113,34	1843	1626	7510	15704

Примечание. Ряды цен на нефть, никель, золото, медь и алюминий на интервале с января 1980 г. по январь 2013 г. являются рядами типа DS.

ДЕНЕЖНЫЕ ПОКАЗАТЕЛИ

Будущие значения денежной базы (в узком определении – наличные деньги и ФОР) и денежного агрегата M_2 в марте–августе 2013 г. получены на основе моделей временных рядов соответствующих показателей, рассчитываемых ЦБ РФ¹, на интервале с октября 1998 г. по декабрь 2012 г. В табл. 9 приводятся результаты расчетов прогнозных значений и фактические значения этих показателей за аналогичный период предшествующего года. Необходимо отметить, что в силу того, что денежная база является одним из инструментов политики ЦБ РФ, ее прогнозы на основе моделей временных рядов в достаточной степени условны, так как будущие значения данного показателя определяются в значительной степени не внутренними свойствами ряда, а решениями ЦБ РФ.

Таблица 9

ПРОГНОЗ ДЕНЕЖНОГО АГРЕГАТА M_2 И ДЕНЕЖНОЙ БАЗЫ

Период	Денежная база		M_2	
	млрд руб.	прирост к предыдущему месяцу, %	млрд руб.	прирост к предыдущему месяцу, %
Март 2013	7533,3	1,2	28364,7	1,4
Апрель 2013	7634,8	1,3	28769,3	1,4
Май 2013	7727,1	1,2	29177,8	1,4
Июнь 2013	7828,6	1,3	29591,2	1,4

¹ Данные за определенный месяц приводятся в соответствии с методологией ЦБ РФ по состоянию на начало следующего месяца.

Таблица 9, окончание

Период	Денежная база		M ₂	
	млрд руб.	прирост к предыдущему месяцу, %	млрд руб.	прирост к предыдущему месяцу, %
Июль 2013	7925,3	1,2	30009,3	1,4
Август 2013	8027,9	1,3	30432,2	1,4
Справочно: фактические значения за соответствующие месяцы 2012 г. (прирост к предыдущему месяцу, %)				
Март 2012		-1,4		0,8
Апрель 2012		2,8		0,8
Май 2012		0,5		0,8
Июнь 2012		2,1		1,3
Июль 2012		1,0		-0,5
Август 2012		-0,9		0,0

Примечание. На интервале с октября 1998 г. по декабрь 2012 г. все временные ряды денежных показателей были отнесены к классу рядов, являющихся стационарными в первых разностях, с выраженной сезонной компонентой.

В марте–августе 2013 г. денежная база будет расти со среднемесячным темпом 1,3% в месяц. Денежный показатель M₂ будет расти со среднемесячным темпом 1,4% на рассматриваемом интервале времени.

МЕЖДУНАРОДНЫЕ РЕЗЕРВЫ

В данном разделе представлены результаты статистической оценки будущих значений международных резервов РФ¹, полученные исходя из оценки модели временного ряда золотовалютных резервов, по данным ЦБ РФ, на интервале с октября 1998 г. по декабрь 2012 г. Данный показатель прогнозируется без учета сокращения резервов за счет погашения внешнего долга, в силу чего значения объемов международных резервов для месяцев, в которые производятся выплаты по внешнему долгу, могут оказаться завышенными (либо, в противном случае, заниженными) по сравнению с фактическими.

По результатам прогноза в марте–августе 2013 г. международные резервы будут расти со среднемесячным темпом 1,1%.

Таблица 10

ПРОГНОЗ МЕЖДУНАРОДНЫХ (ЗОЛОТОВАЛЮТНЫХ) РЕЗЕРВОВ

Период	Прогнозные значения по ARIMA-моделям	
	млрд долл. США	прирост к предыдущему месяцу, %
Март 2013	547,1	1,3
Апрель 2013	548,0	0,2
Май 2013	553,1	0,9
Июнь 2013	562,6	1,7
Июль 2013	570,6	1,4
Август 2013	575,9	0,9
Справочно: фактические значения за аналогичный период 2012 г.		
Март 2012	513,5	-0,1
Апрель 2012	524,4	2,1
Май 2012	510,4	-2,7
Июнь 2012	514,3	0,8
Июль 2012	510,5	-0,7
Август 2012	514,6	0,8

Примечание. На интервале с октября 1998 г. по декабрь 2012 г. ряд международных резервов РФ был идентифицирован как стационарный в разностях ряд.

¹ Данные по объему международных резервов представлены по состоянию на первое число следующего месяца.

ВАЛЮТНЫЕ КУРСЫ

Модельные расчеты будущих значений валютных курсов (рублей за доллар США и долларов США за евро) получены исходя из оценок моделей временных рядов (ARIMA) и структурных моделей (SM) соответствующих показателей, устанавливаемых ЦБ РФ по состоянию на последний день месяца, за период с октября 1998 г. по февраль 2013 г. и за период с января 1999 г. по февраль 2013 г.¹ соответственно.

Значение курса доллара США к рублю на рассматриваемом интервале времени прогнозируется в среднем по двум моделям равным 30 руб. 6 коп. за доллар США. Аналогичное значение для курса евро к доллару США составит 1,33 долл. США за один евро.

Таблица 11

ПРОГНОЗ КУРСОВ RUR/USD И USD/EUR

Период	Прогнозные значения курса RUR/USD (рублей за доллар США)		Прогнозные значения курса USD/EUR (долларов США за евро)	
	ARIMA	SM	ARIMA	SM
Март 2013	30,58	30,48	1,33	1,32
Апрель 2013	30,54	30,71	1,33	1,32
Май 2013	30,53	30,59	1,33	1,32
Июнь 2013	30,50	30,79	1,34	1,32
Июль 2013	30,45	30,69	1,34	1,32
Август 2013	30,39	30,88	1,35	1,33
Справочно: фактические значения за аналогичный период 2012 г.				
Март 2012	29,33		1,34	
Апрель 2012	29,36		1,32	
Май 2012	32,45		1,24	
Июнь 2012	32,82		1,26	
Июль 2012	32,19		1,23	
Август 2012	32,29		1,26	

Примечание. Рассматриваемые ряды на соответствующих интервалах были идентифицированы как интегрированные первого порядка с сезонной составляющей.

ПОКАЗАТЕЛИ УРОВНЯ ЖИЗНИ НАСЕЛЕНИЯ

В данном разделе (см. табл. 12) представлены результаты расчета прогнозных значений показателей реальной заработной платы, реальных располагаемых денежных доходов и реальных денежных доходов², полученные на основе моделей временных рядов соответствующих показателей, рассчитываемых Росстатом и взятых на интервале с января 1999 г. по январь 2013 г. Данные показатели в некоторой степени зависят от централизованных решений о повышении заработной платы работникам бюджетной сферы, а также от решений о повышении пенсий, стипендий и пособий, что вносит некоторые изменения в динамику рассматриваемых показателей. Как следствие, будущие значения показателей реальной заработной платы и реальных располагаемых денежных доходов населения, рассчитанные на основе рядов, последние наблюдения которых существенно выше или ниже предыдущих из-за такого повышения, могут сильно отличаться от реализующихся на практике.

1 В Бюллетене использованы данные МВФ за период с января 1999 г. по декабрь 2012 г. Данные за январь и февраль 2013 г. взяты с сайта статистики обменных курсов www.oanda.com.

2 Реальные денежные доходы – относительный показатель, исчисленный путем деления индекса номинального размера (т.е. фактически сложившегося в отчетном периоде) денежных доходов населения на ИПЦ. Реальные располагаемые денежные доходы – денежные доходы за вычетом обязательных платежей и взносов. (См.: «Российский статистический ежегодник», Москва, Росстат, 2004, стр. 212).

Результаты, представленные в *табл. 12*, показывают рост всех показателей уровня жизни населения по сравнению с уровнем соответствующего периода прошлого года. Так, ожидается среднее увеличение реальных располагаемых денежных доходов около 2,8%, а прирост реальных денежных доходов составит порядка 2,5% по сравнению с соответствующим прошлогодним уровнем. Прогнозируемый прирост реальной начисленной заработной платы достигнет 6,5% по сравнению с аналогичным периодом предшествующего года.

Таблица 12

ПРОГНОЗ ПОКАЗАТЕЛЕЙ УРОВНЯ ЖИЗНИ НАСЕЛЕНИЯ

Период	Реальные располагаемые денежные доходы	Реальные денежные доходы	Реальная начисленная заработная плата
Прогнозные значения по ARIMA-моделям (в % к соответствующему месяцу 2012 г.)			
Март 2013	105,5	105,5	108,6
Апрель 2013	102,6	102,1	105,0
Май 2013	104,8	103,8	104,0
Июнь 2013	101,2	101,4	105,2
Июль 2013	102,6	101,0	106,9
Август 2013	100,2	101,0	109,1
Справочно: фактические значения за соответствующий период 2012 г. (в % к аналогичному периоду 2011 г.)			
Март 2012	102,1	102,6	109,0
Апрель 2012	101,1	102,1	111,1
Май 2012	104,9	106,5	112,4
Июнь 2012	106,4	106,3	110,2
Июль 2012	100,1	102,8	108,1
Август 2012	108,9	107,7	106,0

Примечание. Для расчетов использовались ряды располагаемых денежных доходов, реальных денежных доходов и реальной заработной платы в базисной форме (за базисный период был принят январь 1999 г.). На рассматриваемом интервале с января 1999 г. по январь 2013 г. эти ряды были отнесены к классу процессов, являющихся стационарными в разностях, с выраженной сезонной составляющей.

ПОКАЗАТЕЛИ ЧИСЛЕННОСТИ ЗАНЯТОГО В ЭКОНОМИКЕ НАСЕЛЕНИЯ И ОБЩЕЙ ЧИСЛЕННОСТИ БЕЗРАБОТНЫХ

Для расчета будущих значений показателей численности занятого в экономике населения и общей численности безработных были использованы модели временных рядов, оцененные на интервале с октября 1998 г. по декабрь 2012 г. по месячным данным Росстата¹. Показатель общей численности безработных рассчитывается также на основе моделей с использованием результатов конъюнктурных опросов².

Отметим, что возможные логические расхождения³ в прогнозах общей численности занятых и общей численности безработных, которые в сумме должны быть равны показателю экономически активного населения, могут возникать вследствие того, что каждый ряд прогнозируется отдельно, а не как разность между прогнозными значениями экономически активного населения и другого показателя.

1 Показатель рассчитан в соответствии с методологией Международной организации труда (МОТ) и приводится по состоянию на конец месяца.

2 Модель оценена на интервале с января 1999 г. по декабрь 2012 г.

3 Например, таким расхождением можно считать одновременное уменьшение численности занятого в экономике населения и общей численности безработных. Хотя отметим, что в принципе такая ситуация возможна при условии одновременного уменьшения численности экономически активного населения.

Согласно прогнозам по моделям ARIMA (см. табл. 13), в марте–августе 2013 г. рост численности занятых в экономике в среднем составит 1,0% в месяц по отношению к соответствующему периоду предыдущего года.

Среднее сокращение показателя общей численности безработных прогнозируется на уровне 7,5% в месяц по сравнению с аналогичным периодом прошлого года.

Таблица 13

РЕЗУЛЬТАТЫ РАСЧЕТОВ ПРОГНОЗНЫХ ЗНАЧЕНИЙ ПОКАЗАТЕЛЕЙ ЧИСЛЕННОСТИ ЗАНЯТОГО В ЭКОНОМИКЕ НАСЕЛЕНИЯ И ОБЩЕЙ ЧИСЛЕННОСТИ БЕЗРАБОТНЫХ

Месяц	Численность занятого в экономике населения (ARIMA)		Общая численность безработных (ARIMA)			Общая численность безработных (КО)		
	млн чел.	прирост к соответствующему месяцу 2011/2012 гг., %	млн чел.	прирост к соответствующему месяцу 2011/2012 гг., %	в % к показателю численности занятого в экономике населения	млн чел.	прирост к соответствующему месяцу 2011/2012 гг., %	в % к показателю численности занятого в экономике населения
Март 2013	70,9	1,6	4,2	-14,9	5,9	4,3	-9,1	6,1
Апрель 2013	71,5	0,9	3,9	-11,3	5,5	4,0	-5,7	5,6
Май 2013	72,5	0,6	3,7	-9,1	5,1	3,8	-5,5	5,2
Июнь 2013	72,7	0,7	3,8	-8,4	5,2	3,8	-5,0	5,2
Июль 2013	73,0	0,9	3,7	-9,0	5,1	3,9	-3,2	5,3
Август 2013	73,3	1,1	3,7	-7,7	5,0	3,8	-1,3	5,2
Справочно: фактические значения за аналогичные периоды 2012 г., млн чел.								
Март 2012	69,8					4,9		
Апрель 2012	70,9					4,4		
Май 2012	72,1					4,1		
Июнь 2012	72,2					4,1		
Июль 2012	72,3					4,1		
Август 2012	72,5					4,0		

Примечание. На интервале с октября 1998 г. по декабрь 2012 г. ряд показателя численности занятого в экономике населения является случайным процессом, стационарным около тренда. Ряд показателя общей численности безработных является случайным процессом, интегрированным первого порядка. Оба показателя содержат сезонную компоненту.

ПРИЛОЖЕНИЕ 1

СВОДНАЯ ТАБЛИЦА МОДЕЛЬНЫХ РАСЧЕТОВ КРАТКОСРОЧНЫХ ПРОГНОЗОВ СОЦИАЛЬНО-ЭКОНОМИЧЕСКИХ ПОКАЗАТЕЛЕЙ РФ

Показатель	декабрь 2012	январь 2013	февраль 2013	март 2013	апрель 2013	май 2013	июнь 2013	июль 2013	август 2013
ИПП Ростата (прирост, %)*	1,4	2,5	1,1	1,9	2,4	1,3	2,1	1,7	2,2
ИПП НИУ ВШЭ (прирост, %)*	0,6	1,7	1,0	2,4	2,1	2,6	2,7	2,6	2,5
ИПП в добыче полезных ископаемых Росстата (прирост, %)*	0,2	0,2	-1,7	0,1	1,3	1,0	0,1	-1,3	-1,3
ИПП в добыче полезных ископаемых НИУ ВШЭ (прирост, %)*	0,4	-1,2	-2,3	-0,4	0,2	0,7	0,6	0,4	-0,1
ИПП в обрабатывающих производствах Росстата (прирост, %)*	1,5	2,3	2,7	4,0	4,3	0,2	2,1	2,0	2,8
ИПП в обрабатывающих производствах НИУ ВШЭ (прирост, %)*	-0,7	3,1	0,5	4,8	4,5	3,6	3,6	4,2	3,1
ИПП в производстве и распределении электроэнергии, газа и воды Росстата (прирост, %)*	4,7	1,6	-3,1	0,5	1,1	2,6	3,1	2,4	2,8
ИПП в производстве и распределении электроэнергии, газа и воды НИУ ВШЭ (прирост, %)*	8,4	2,6	-4,2	0,6	5,2	4,9	3,4	1,7	1,3
ИПП в производстве пищевых продуктов Росстата (прирост, %)*	1,8	3,4	3,2	4,1	4,0	3,8	2,6	4,1	3,8
ИПП в производстве пищевых продуктов НИУ ВШЭ (прирост, %)*	-0,2	2,2	1,2	3,4	4,8	4,4	3,7	7,1	5,8
ИПП в производстве кокса и нефтепродуктов Росстата (прирост, %)*	4,0	5,4	10,3	5,9	9,8	6,2	3,2	2,5	2,4
ИПП в производстве кокса и нефтепродуктов НИУ ВШЭ (прирост, %)*	6,3	6,2	3,3	5,4	5,6	7,9	2,9	5,5	4,8
ИПП в металлургическом производстве и производстве готовых металлических изделий Росстата (прирост, %)*	2,0	0,7	0,2	3,0	3,8	0,1	2,6	0,9	3,2
ИПП в металлургическом производстве и производстве готовых металлических изделий НИУ ВШЭ (прирост, %)*	-1,6	-0,8	-1,5	-0,5	0,4	0,2	1,7	1,8	0,8
ИПП в производстве машин и оборудования Росстата (прирост, %)*	-0,8	-24,9	-5,4	-3,6	9,0	5,5	16,9	1,1	18,2
ИПП в производстве машин и оборудования НИУ ВШЭ (прирост, %)*	-10,0	-8,6	1,2	3,1	5,6	3,7	10,9	-0,3	12,7
Розничный товароборот, трлн руб.	2,30	1,70	1,69	1,84	1,86	1,93	1,97	2,03	2,09
Реальный розничный товароборот (прирост, %)*	5,00	5,23	5,83	5,83	5,96	6,06	5,91	6,27	6,93
Инвестиции в основной капитал, трлн руб.	2,19	0,45	0,64	0,75	0,75	1,00	1,16	1,04	1,19
Реальные инвестиции в основной капитал (прирост, %)*	-0,70	1,15	2,97	4,45	7,29	6,21	5,12	3,56	2,80
Экспорт (млрд долл.)	48,6	37,9	45,8	46,7	48,5	46,9	47,2	48,4	49,2
Экспорт в страны, дал. зарубежья (млрд долл.)	41,1	35,3	40,3	40,2	39,8	40,4	39,9	40,9	42,5
Импорт (млрд долл.)	31,4	22,8	26,8	30,8	31,4	30,6	31,8	31,8	32,3
Импорт из стран дал. зарубежья (млрд долл.)	27,3	20,4	26,0	25,0	25,8	25,9	26,1	26,1	26,9
ИИЦ (прирост, %)**	0,5	1,0	0,6	0,5	0,5	0,5	0,5	0,5	0,3
ИИЦ промышленных товаров (прирост, %)**	-1,1	-0,7	1,2	0,9	0,2	-1,2	0,0	0,0	3,4
ИИЦ в добыче полезных ископаемых (прирост, %)**	-1,5	1,4	3,2	2,0	-0,2	0,2	0,6	3,2	7,6
ИИЦ в обрабатывающих производствах (прирост, %)**	-1,1	0,0	0,6	0,4	1,1	0,5	0,6	0,5	1,1
ИИЦ в производстве и распределении электроэнергии, газа и воды (прирост, %)**	-0,4	2,9	6,3	1,7	-0,3	-0,2	0,0	-0,5	0,8
ИИЦ в производстве пищевых продуктов (прирост, %)**	0,3	0,2	0,1	0,5	0,4	0,6	1,2	1,6	1,3

Показатель	декабрь 2012	январь 2013	февраль 2013	март 2013	апрель 2013	май 2013	июнь 2013	июль 2013	август 2013
ИЦП в текстильном и швейном производстве (прирост, %)**	0,1	0,6	0,4	0,4	0,7	0,8	0,5	0,7	0,6
ИЦП в обработке древесины и производстве изделий из дерева (прирост, %)**	-0,1	-0,2	0,5	0,3	0,0	0,2	0,3	0,3	0,7
ИЦП в целлюлозно-бумажном производстве (прирост, %)**	0,4	0,4	0,4	0,5	0,4	0,6	0,4	0,4	0,7
ИЦП в производстве кокса и нефтепродуктов (прирост, %)**	-3,8	0,5	0,7	2,2	2,5	1,9	1,7	2,1	2,5
ИЦП в химическом производстве (прирост, %)**	-1,6	-0,5	0,3	0,9	1,2	0,4	0,3	0,4	0,2
ИЦП в металлургическом производстве и производстве готовых металлических изделий (прирост, %)**	-1,4	-1,1	-1,5	-0,4	1,4	2,9	1,8	1,0	2,4
ИЦП в производстве машин и оборудования (прирост, %)**	0,0	0,7	0,3	0,4	0,4	0,3	0,1	0,1	-0,1
ИЦП в производстве транспортных средств и оборудования (прирост, %)**	0,1	1,5	0,1	0,5	0,3	0,3	0,0	0,9	0,7
Стоимость минимального набора продуктов питания (на одного человека в месяц), тыс руб.	2,61	2,65	2,67	2,69	2,70	2,72	2,76	2,79	2,77
Индекс тарифов на грузовые перевозки автомобильным транспортом (прирост, %)**	0,1	1,8	0,1	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	-0,1
Индекс тарифов на трубопроводный транспорт (прирост, %)**	0,0	0,8	1,0	4,3	2,5	0,0	1,9	4,0	1,9
Сводный индекс транспортных тарифов на грузовые перевозки (прирост, %)**	0,0	0,8	1,0	4,3	2,5	0,0	1,9	4,0	1,9
Цена на нефть марки Brent (\$ за баррель)	109,6	112,9	116,9	119,4	121,0	122,2	123,6	125,7	127,8
Цена на алюминий (тыс \$ за тонну)	2,09	2,04	2,04	2,06	2,05	2,03	2,04	2,03	2,02
Цена на золото (тыс \$ за унцию)	1,69	1,67	1,68	1,68	1,69	1,69	1,70	1,70	1,70
Цена на медь (тыс \$ за тонну)	7,97	8,05	8,13	8,09	8,07	8,05	8,03	8,00	7,95
Цена на никель (тыс \$ за тонну)	17,4	17,5	17,2	17,2	17,5	17,5	17,7	17,8	17,8
Денежная база (трлн руб.)	7,46	7,34	7,45	7,53	7,63	7,73	7,83	7,93	8,03
M2 (трлн руб.)	27,4	27,5	28,0	28,4	28,8	29,2	29,6	30,0	30,4
Золотовалютные резервы (млрд долл.)	0,54	0,53	0,54	0,55	0,55	0,55	0,56	0,57	0,58
Обменный курс RUR/USD (руб. за доллар США)	30,4	30,0	30,6	30,5	30,6	30,6	30,6	30,6	30,6
Обменный курс USD/EUR (долл. США за евро)	1,3	1,4	1,3	1,3	1,3	1,3	1,3	1,3	1,3
Реальные располагаемые денежные доходы (прирост, %)*	5,6	0,7	5,8	5,5	2,6	4,8	1,2	2,6	0,2
Реальные денежные доходы (прирост, %)*	5,2	0,8	5,0	5,5	2,1	3,8	1,4	1,0	1,0
Реальная заработная плата (прирост, %)*	5,0	8,0	7,2	8,6	5,0	4,0	5,2	6,9	9,1
Численность занятого в экономике населения (млн чел.)	71,3	70,7	70,8	70,9	71,5	72,5	72,7	73,0	73,3
Общая численность безработных (млн чел.)	4,0	4,1	4,2	4,3	4,0	3,8	3,8	3,8	3,8

Примечания: жирным шрифтом выделены фактические значения

* - % к соответствующему месяцу предыдущего года

** - % к предыдущему месяцу

ПРИЛОЖЕНИЕ

Графики временных рядов экономических показателей РФ: фактические и прогнозные значения

Рис. 1а. Индекс промышленного производства Росстата (ARIMA-модель)
(% к декабрю 2001 г.)

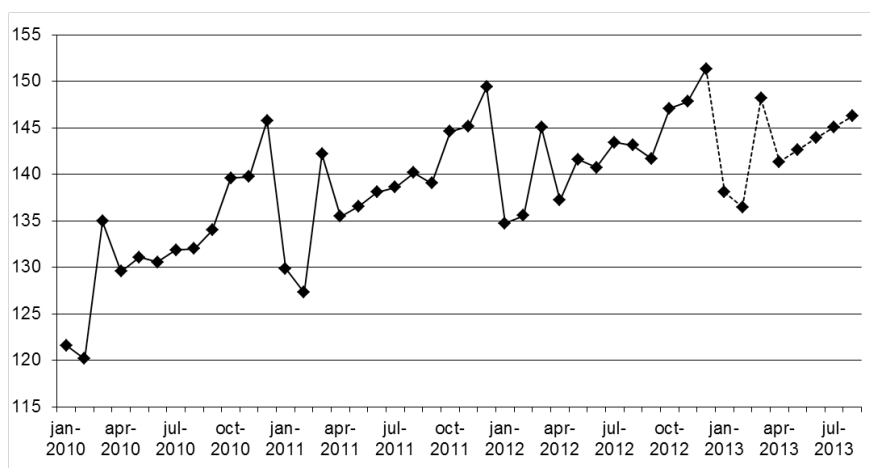


Рис. 1б. Индекс промышленного производства НИУ ВШЭ (ARIMA-модель)
(% к январю 1995 г.)

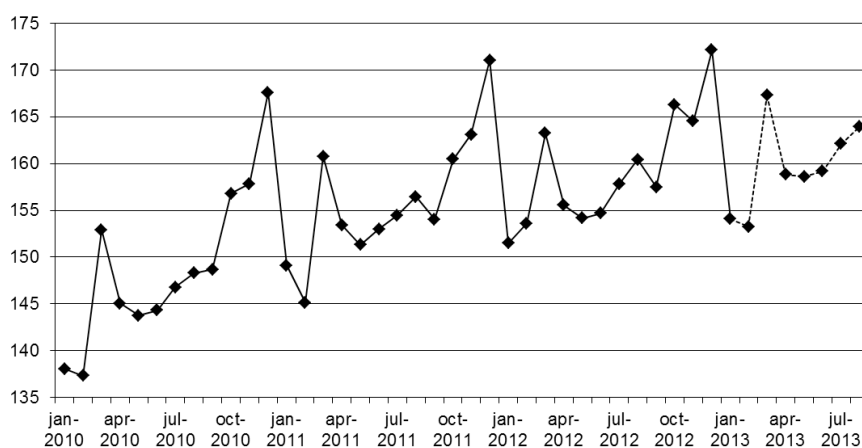


Рис. 2а. ИПП в добыче полезных ископаемых Росстата (% к декабрю 2001 г.)

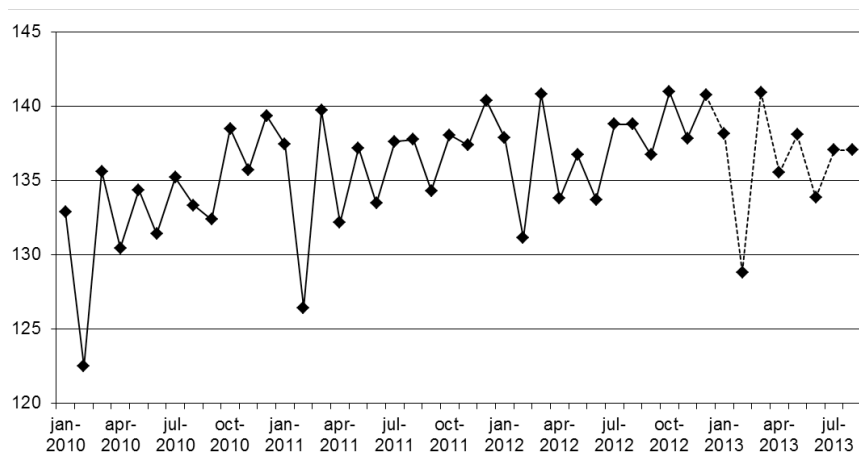


Рис. 2б. ИПП в добыче полезных ископаемых НИУ ВШЭ (% к январю 1995 г.)

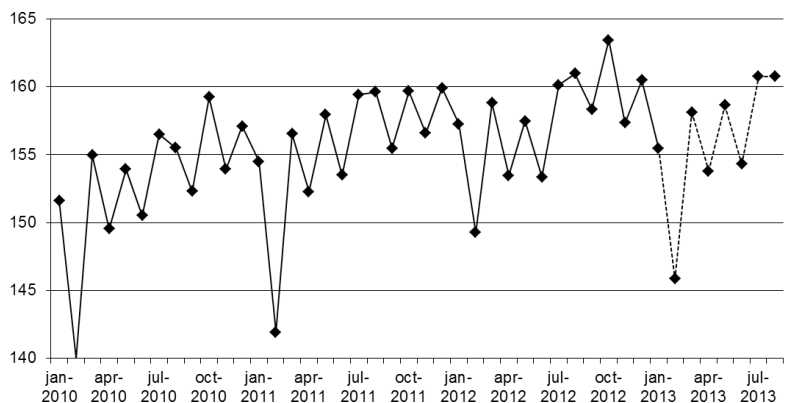


Рис. 3а. ИПП в обрабатывающих производствах Росстата (% к декабрю 2001 г.)

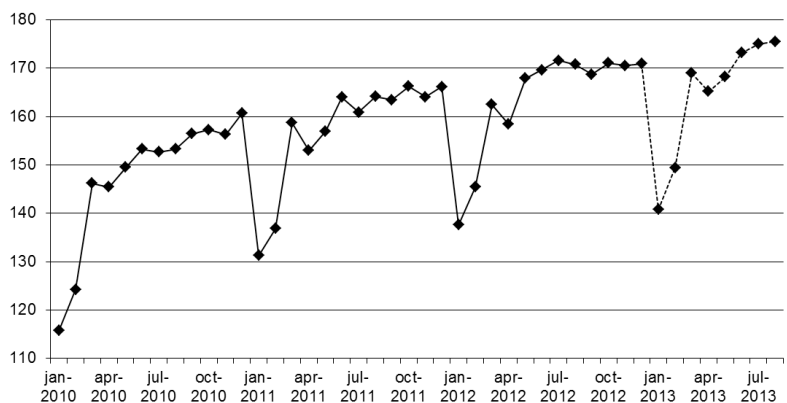


Рис. 3б. ИПП в обрабатывающих производствах НИУ ВШЭ (% к январю 1995 г.)

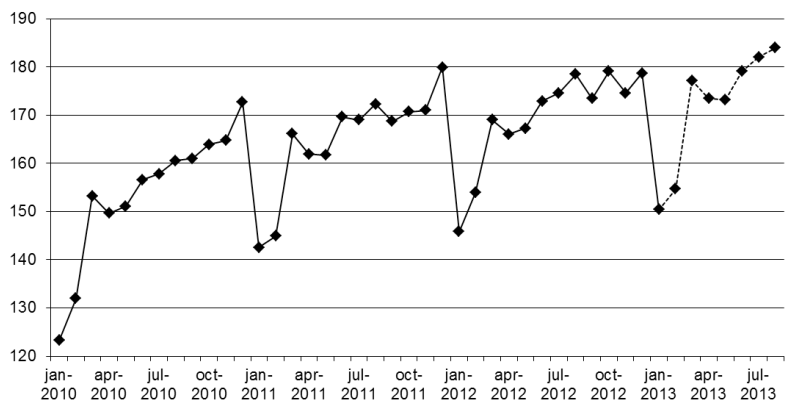


Рис. 4а. ИПП в производстве и распределении электроэнергии, газа и воды Росстата (% к декабрю 1998 г.)

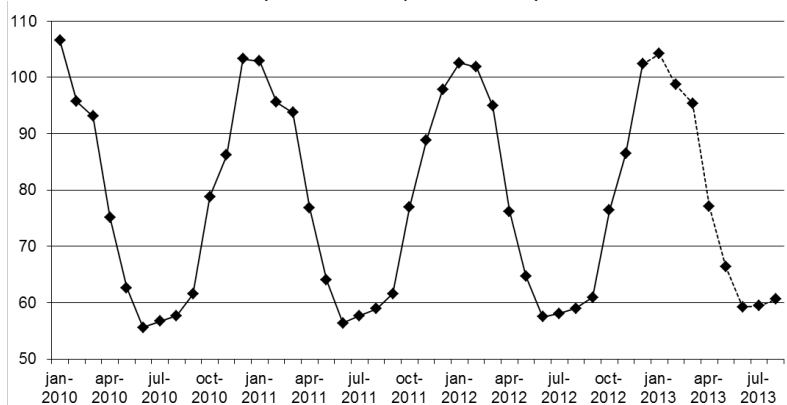


Рис. 4б. ИПП в производстве и распределении электроэнергии, газа и воды НИУ ВШЭ (% к январю 1995 г.)

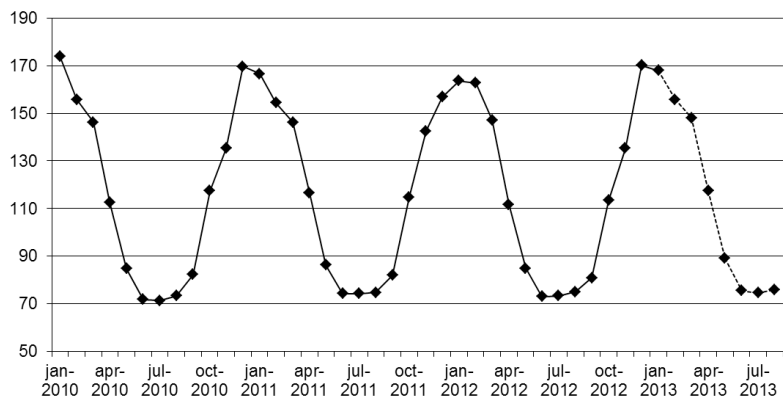


Рис. 5а. ИПП в производстве пищевых продуктов Росстата (% к декабрю 2001 г.)

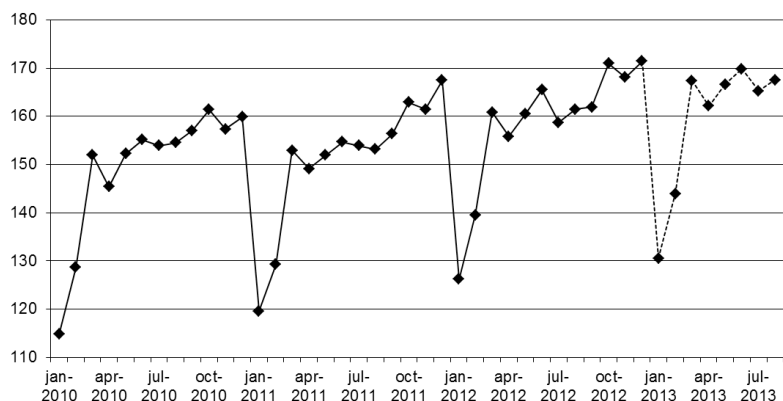


Рис. 5б. ИПП в производстве пищевых продуктов НИУ ВШЭ (% к январю 1995 г.)

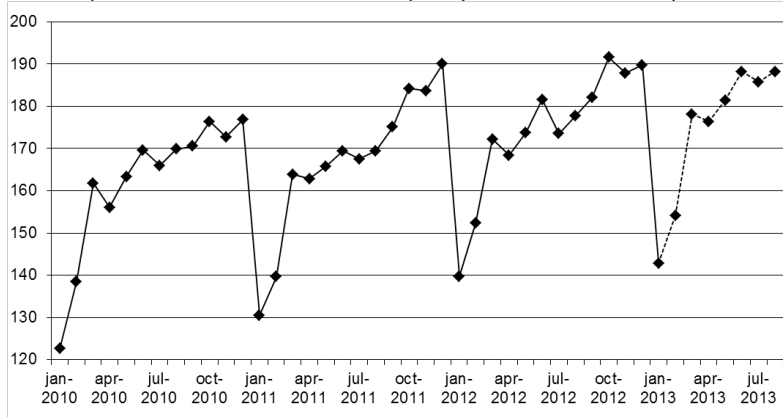


Рис. 6а. ИПП в производстве кокса и нефтепродуктов Росстата (% к декабрю 2001 г.)

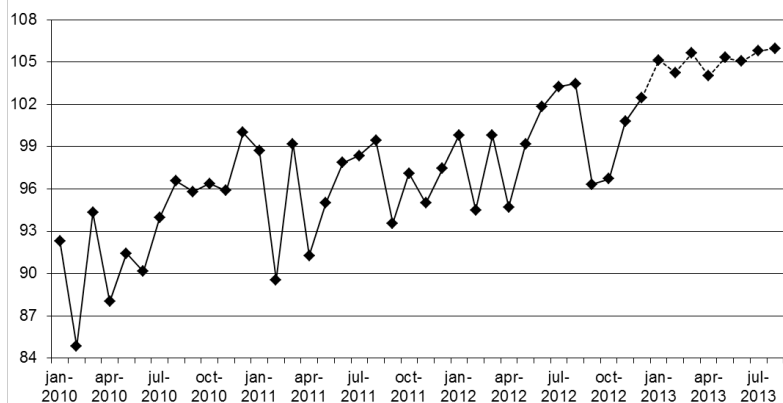


Рис. 6б. ИПП в производстве кокса и нефтепродуктов НИУ ВШЭ (% к январю 1995 г.)

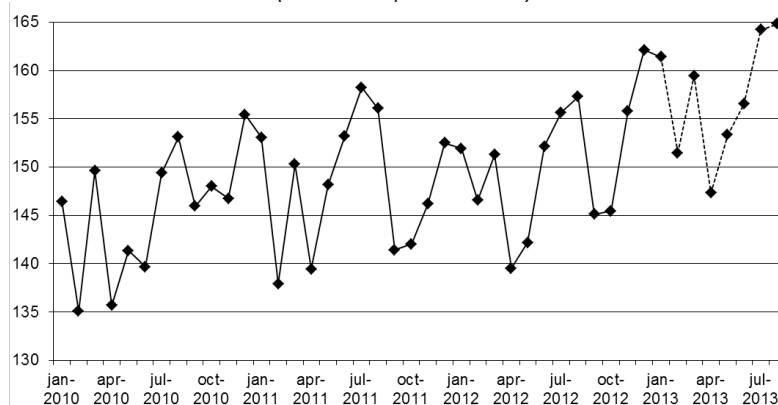


Рис. 7а. ИПП в металлургическом производстве и производстве готовых металлических изделий Росстата (% к декабрю 1998 г.)

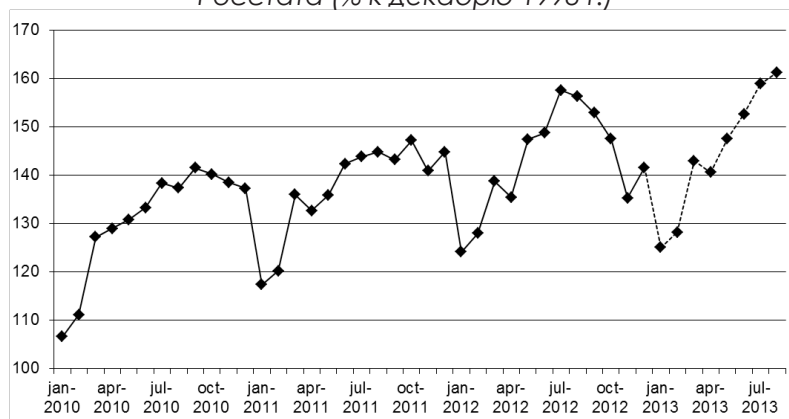


Рис. 7б. ИПП в металлургическом производстве и производстве готовых металлических изделий НИУ ВШЭ (% к январю 1995 г.)

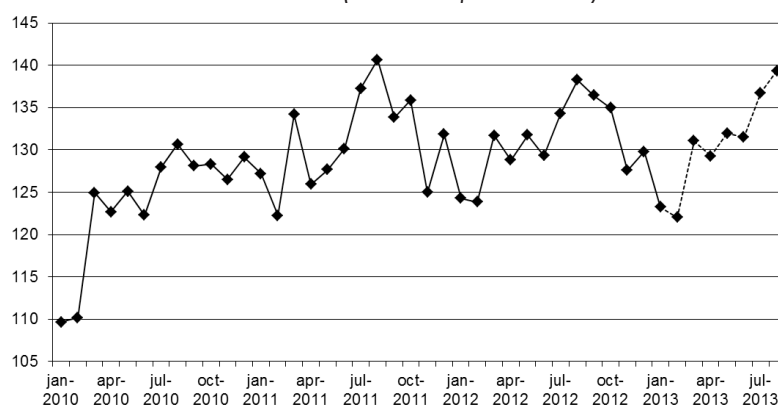


Рис. 8а. ИПП в производстве машин и оборудования Росстата (% к декабрю 1998 г.)

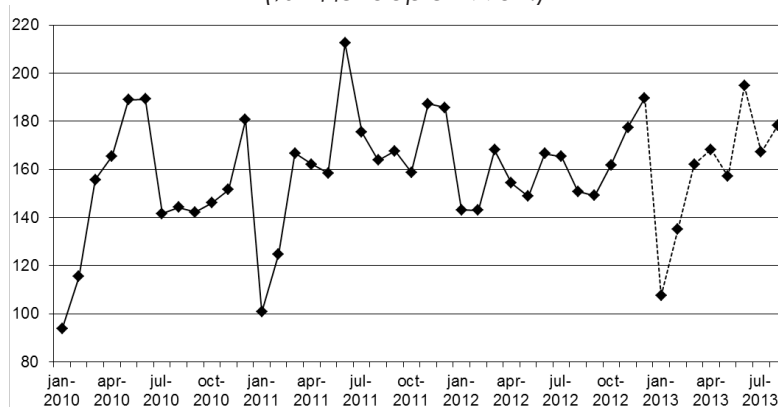


Рис. 8б. ИПП в производстве машин и оборудования НИУ ВШЭ (% к январю 1995 г.)

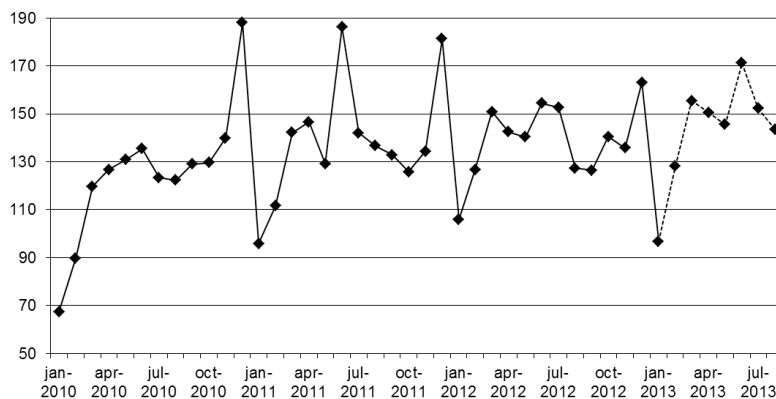


Рис. 9. Оборот розничной торговли (млрд руб.)

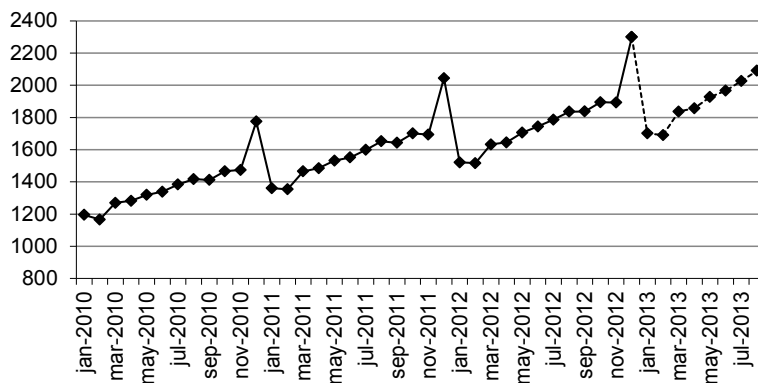


Рис. 9а. Реальный оборот розничной торговли (% к соответствующему периоду прошлого года)

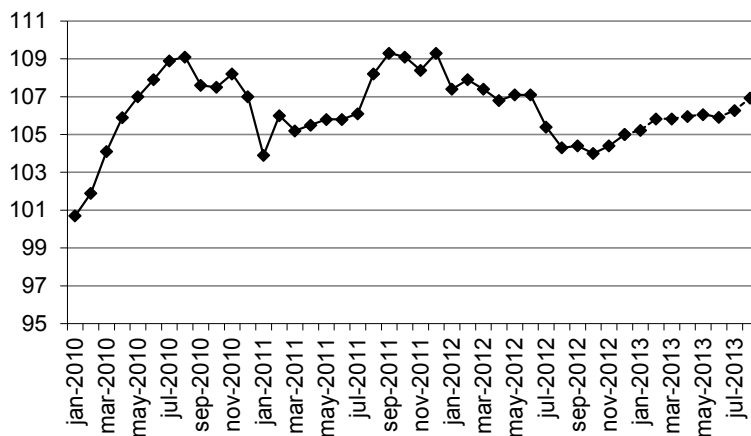


Рис. 10. Инвестиции в основной капитал (млрд руб.)

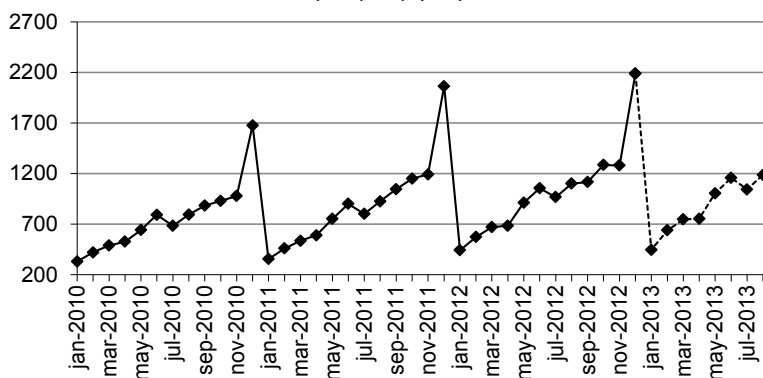


Рис. 10а. Реальные инвестиции в основной капитал (% к соответствующему периоду прошлого года)

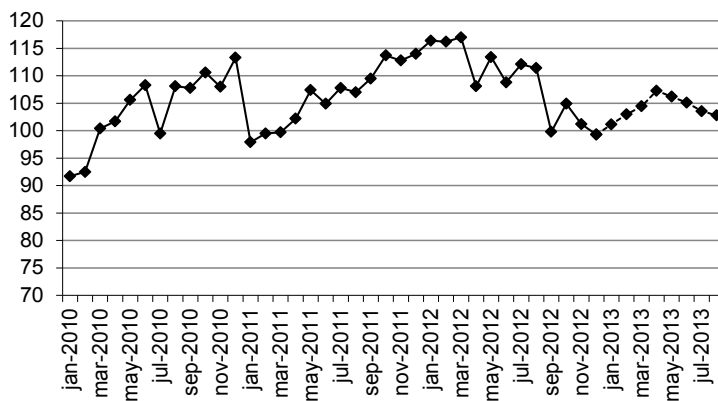


Рис. 11. Экспорт во все страны (млрд долл.)

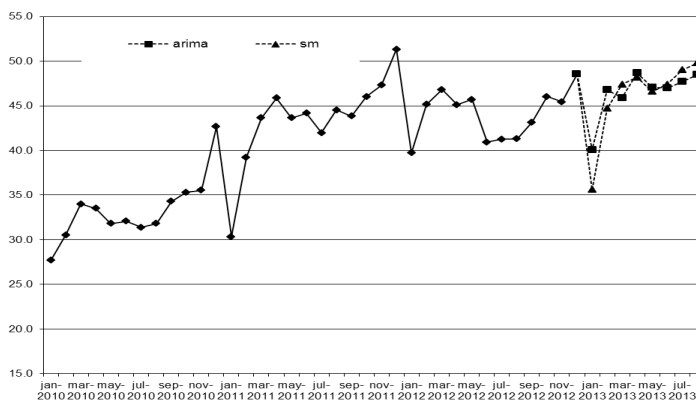


Рис. 12. Экспорт в страны вне СНГ (млрд долл.)

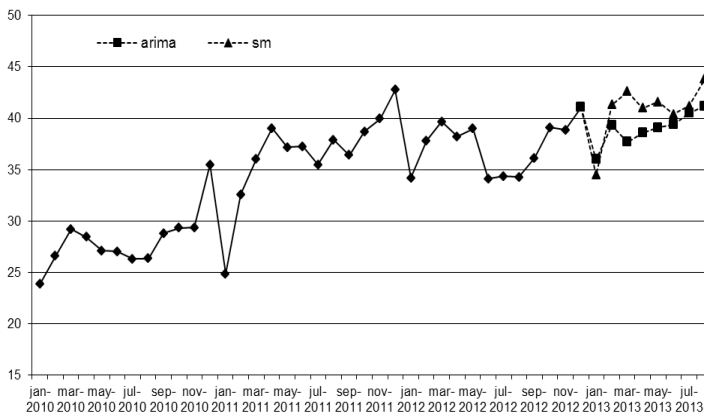


Рис. 13. Импорт из всех стран (млрд долл.)

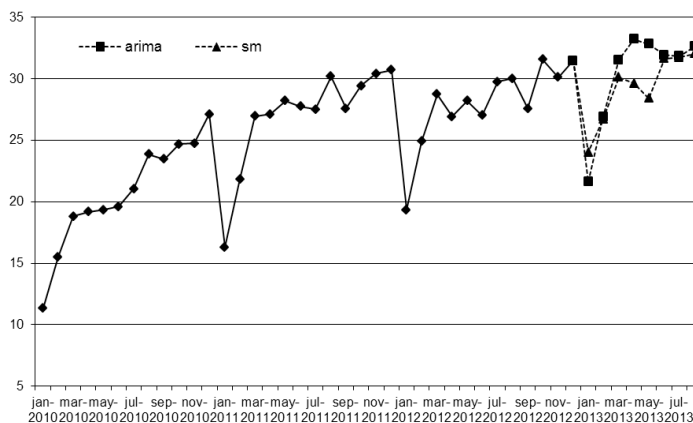


Рис. 14. Импорт из стран вне СНГ (млрд долл.)

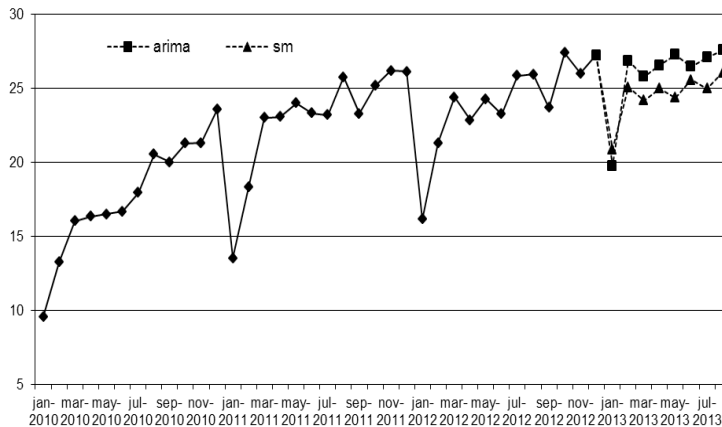


Рис. 15. Индекс потребительских цен в % к декабрю предшествующего года

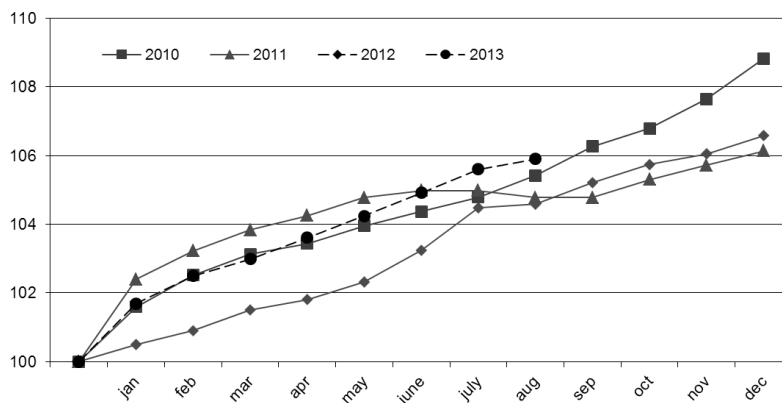


Рис. 15а. Индекс потребительских цен в % к декабрю предшествующего года (SM)

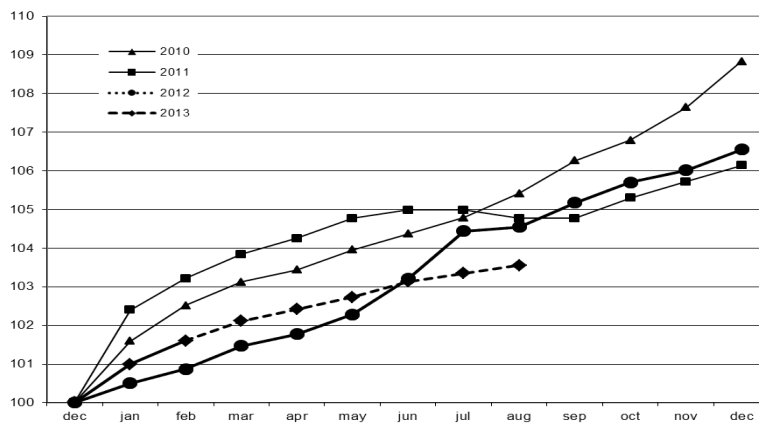


Рис. 16. Индекс цен производителей промышленных товаров в % к декабрю предыдущего года

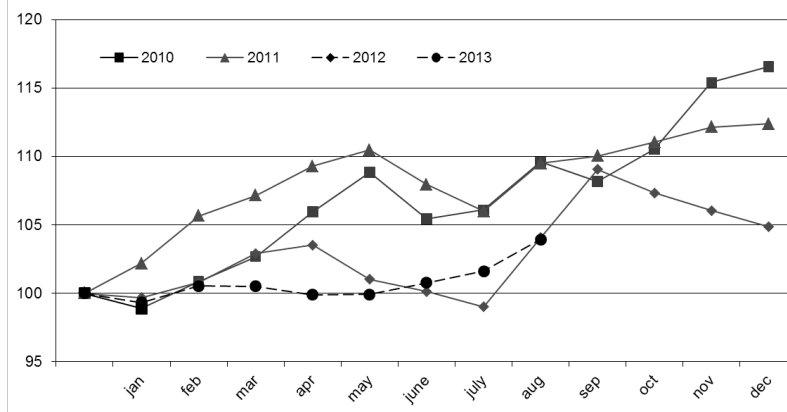


Рис. 17. Индекс цен в добыче полезных ископаемых в % к декабрю предыдущего года

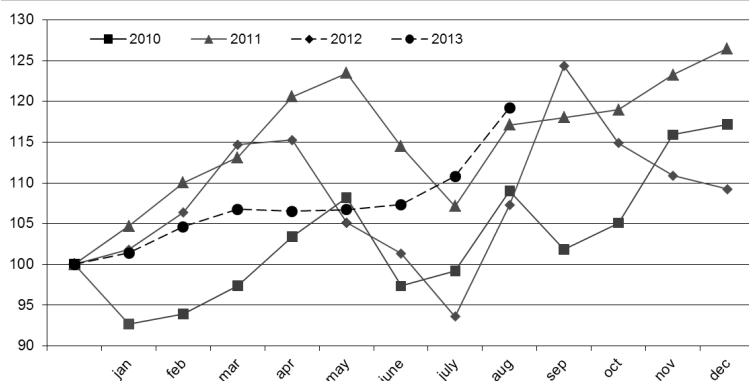


Рис. 18. Индекс цен в обрабатывающих производствах в % к декабрю предыдущего года

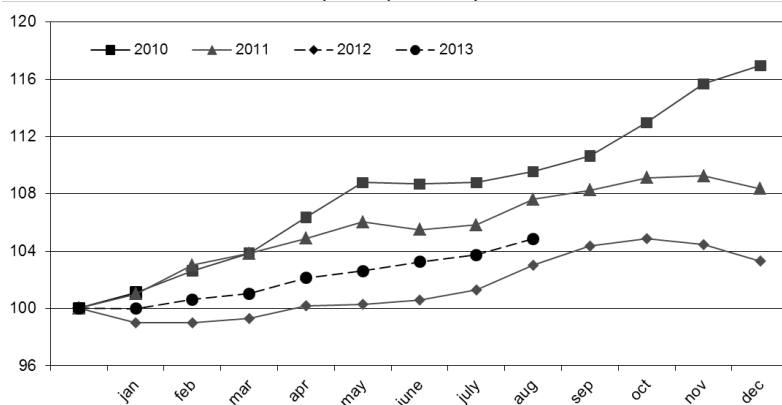


Рис. 19. Индекс цен в производстве и распределении электроэнергии, газа и воды в % к декабрю предыдущего года

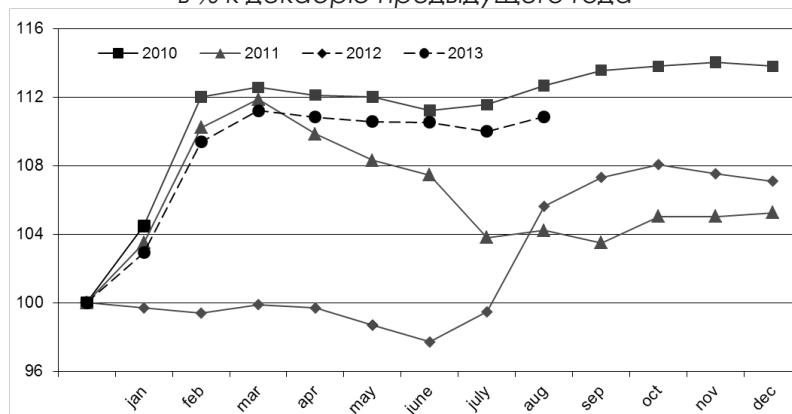


Рис. 20. Индекс цен в производстве пищевых продуктов в % к декабрю предыдущего года

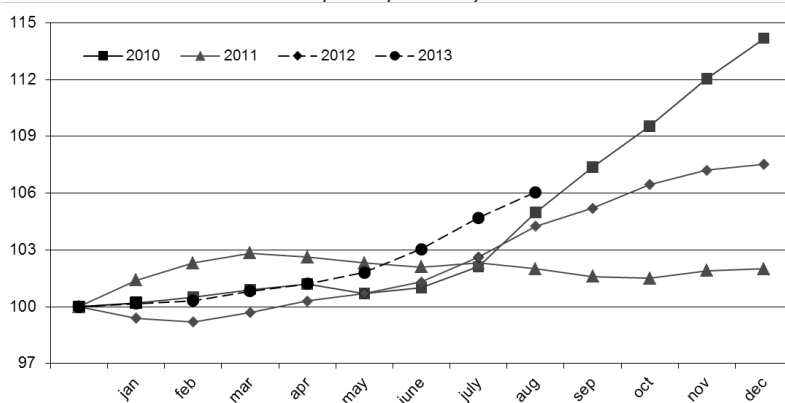


Рис. 21. Индекс цен в текстильном и швейном производстве в % к декабрю предыдущего года

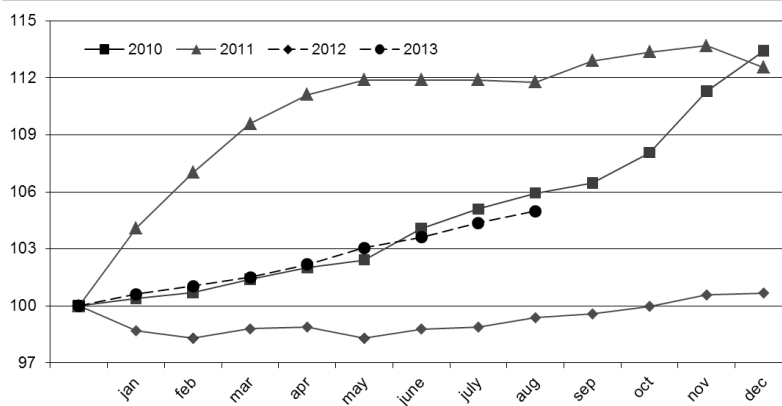


Рис. 22. Индекс цен в обработке древесины и производстве изделий из дерева в % к декабрю предыдущего года

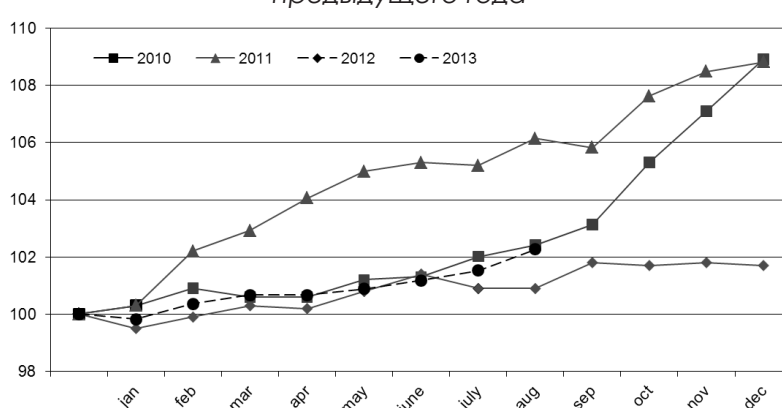


Рис. 23. Индекс цен в целлюлозно-бумажном производстве в % к декабрю предыдущего года

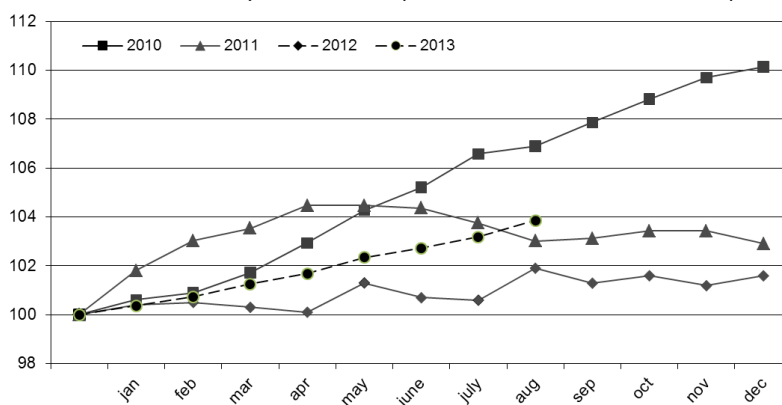


Рис. 24. Индекс цен в производстве кокса и нефтепродуктов в % к декабрю предыдущего года

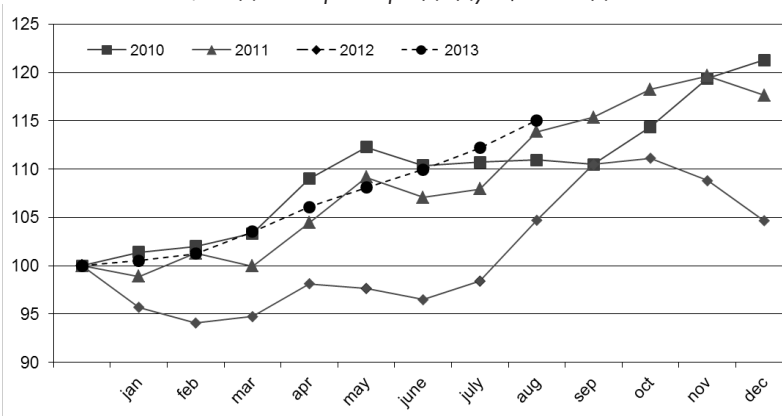


Рис. 25. Индекс цен в химическом производстве в % к декабрю предыдущего года

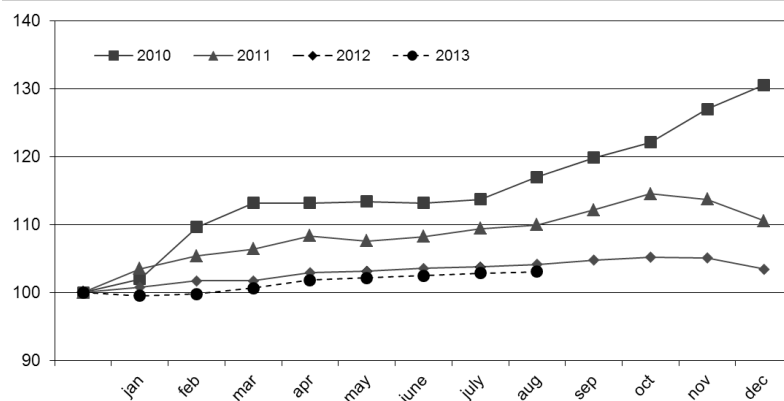


Рис. 26. Индекс цен в металлургическом производстве и производстве готовых металлических изделий в % к декабрю предыдущего года

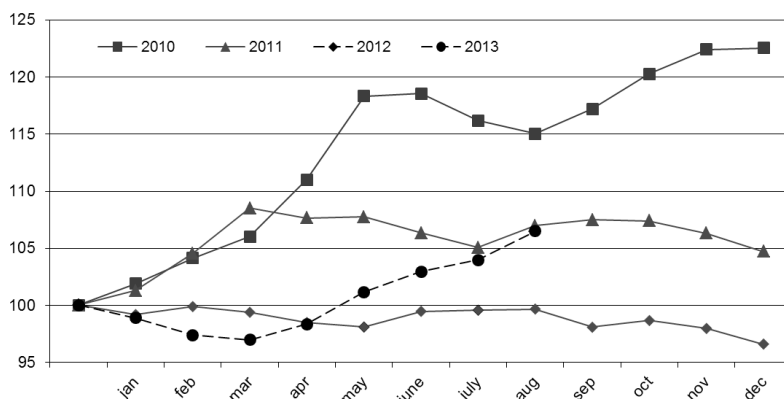


Рис. 27. Индекс цен в производстве машин и оборудования в % к декабрю предыдущего года

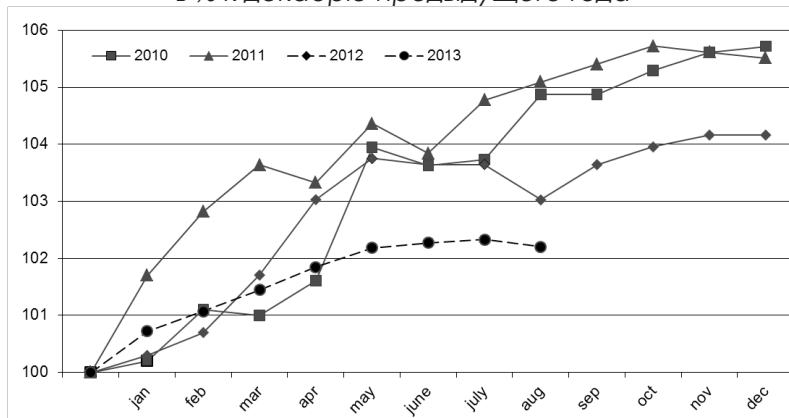


Рис. 28. Индекс цен в производстве транспортных средств и оборудования в % к декабрю предыдущего года

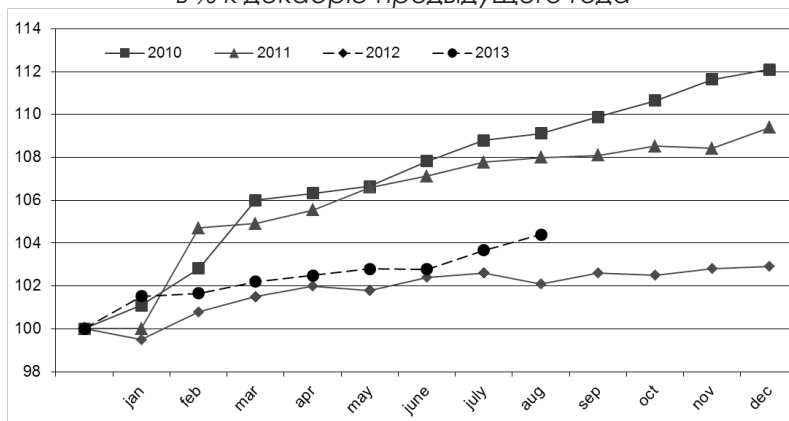


Рис. 29. Стоимость минимального набора продуктов питания на одного человека в месяц (руб.)

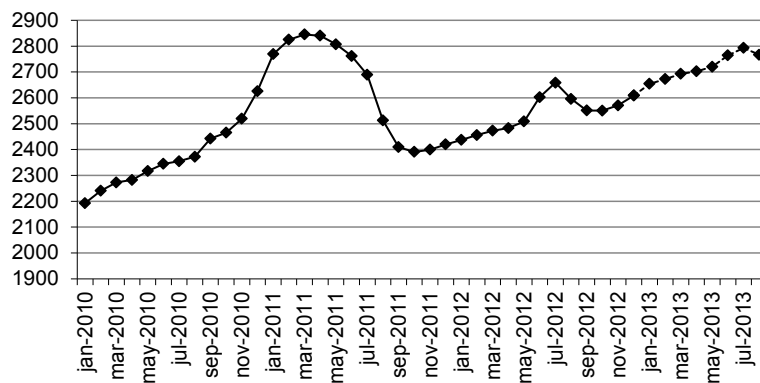


Рис. 30. Сводный индекс транспортных тарифов (для каждого года в % к предшествующему месяцу)

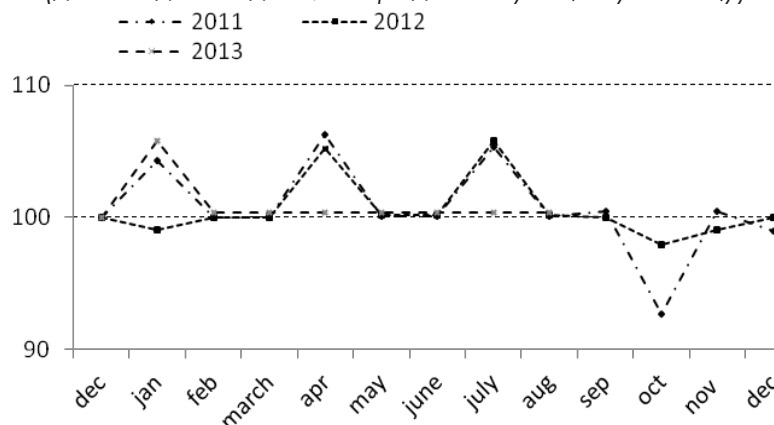


Рис. 31. Индекс тарифов на грузовые перевозки автомобильным транспортом (для каждого года в % к предшествующему месяцу)

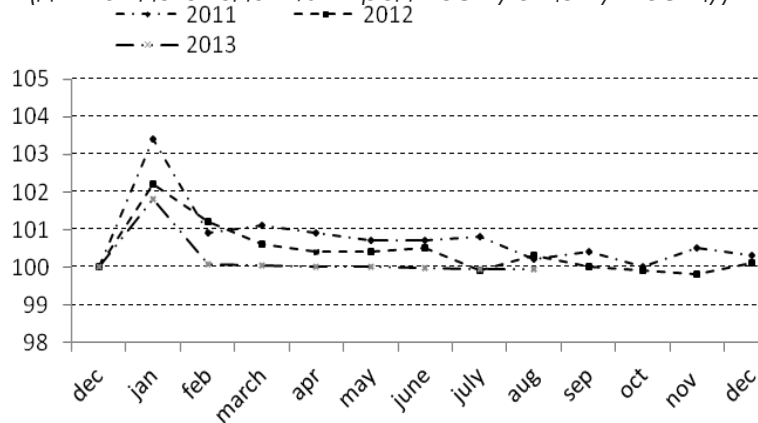
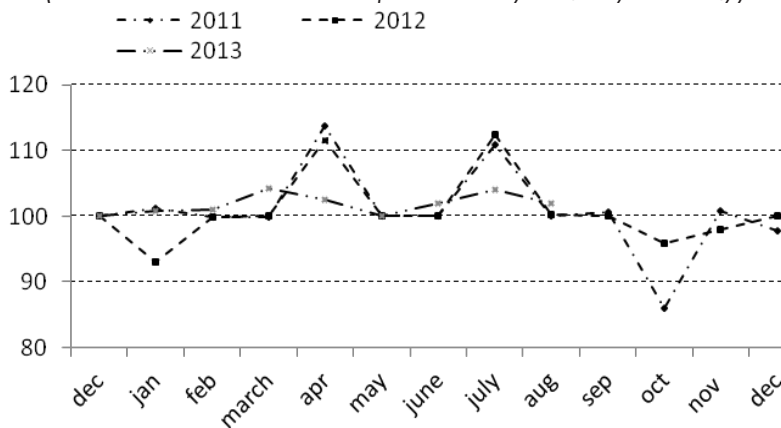


Рис. 32. Индекс тарифов на трубопроводный транспорт (для каждого года в % к предшествующему месяцу)



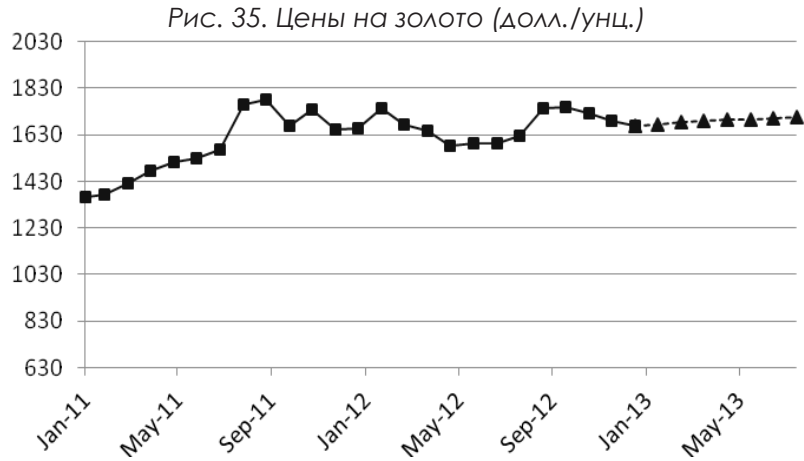
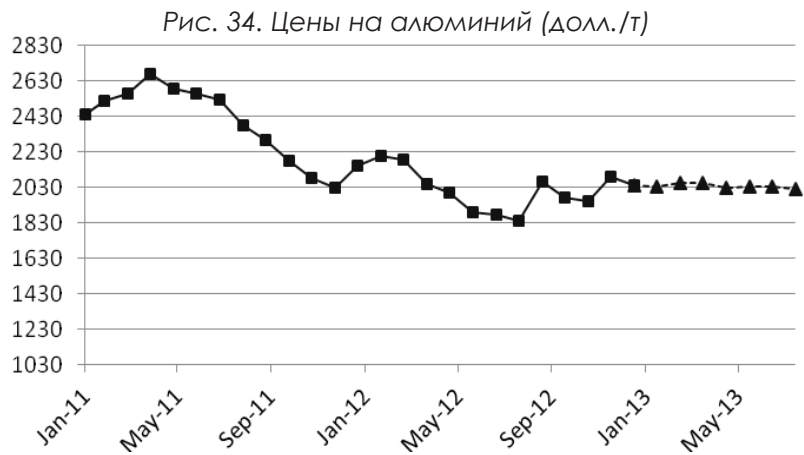
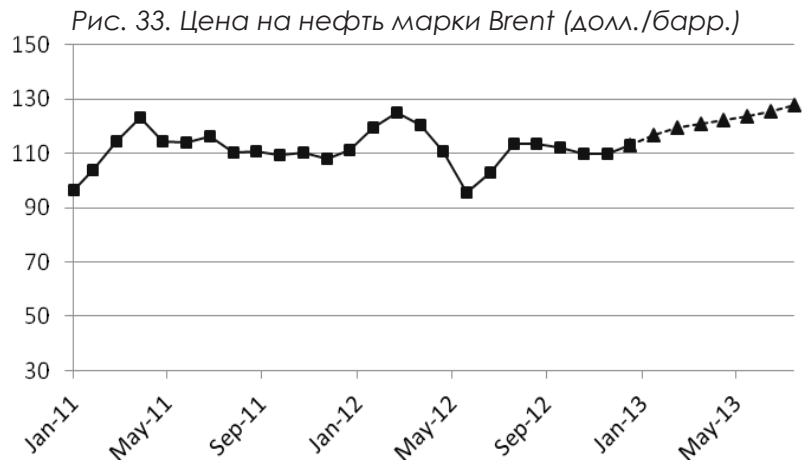


Рис. 37. Цены на медь (долл./т)

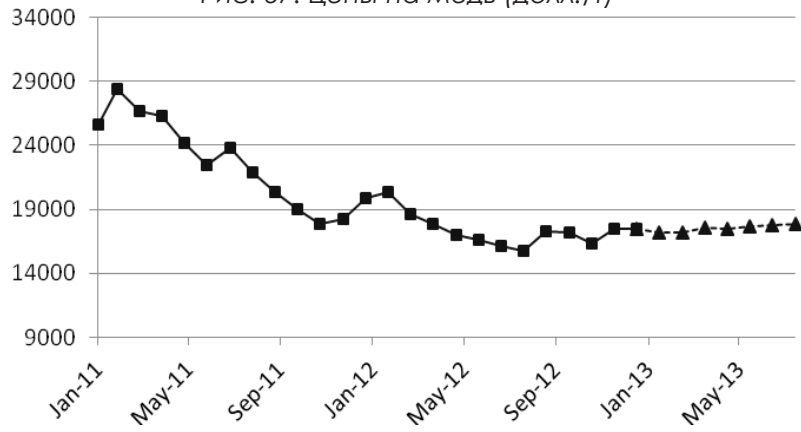


Рис. 38. Денежная база, млн руб.

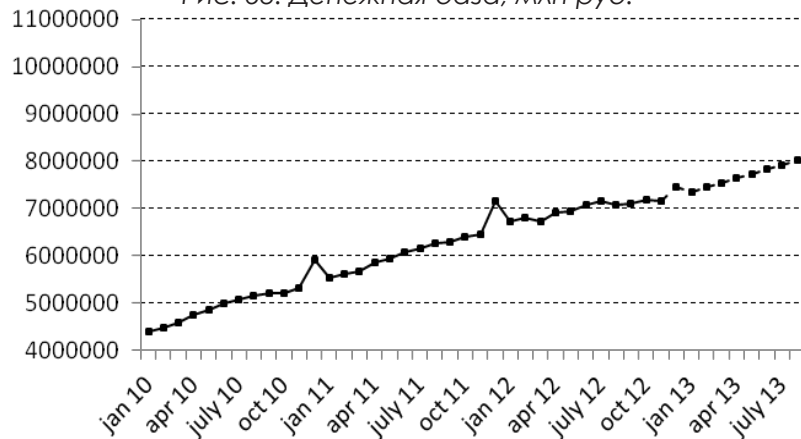


Рис. 39. M_2 , млрд руб.

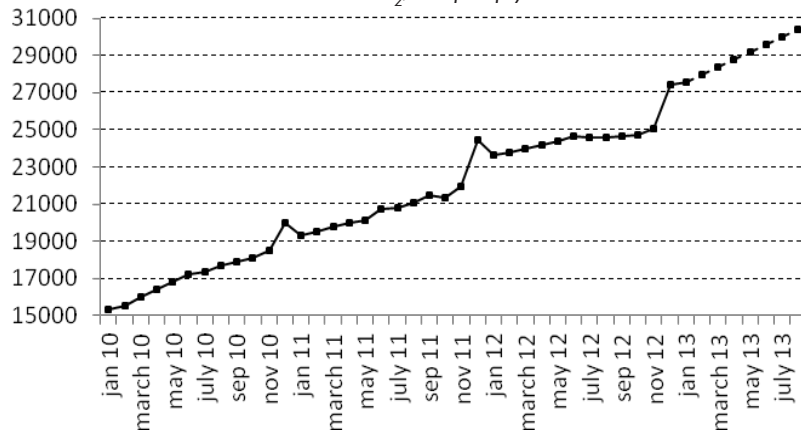


Рис. 40. Международные резервы РФ, млн долл. США

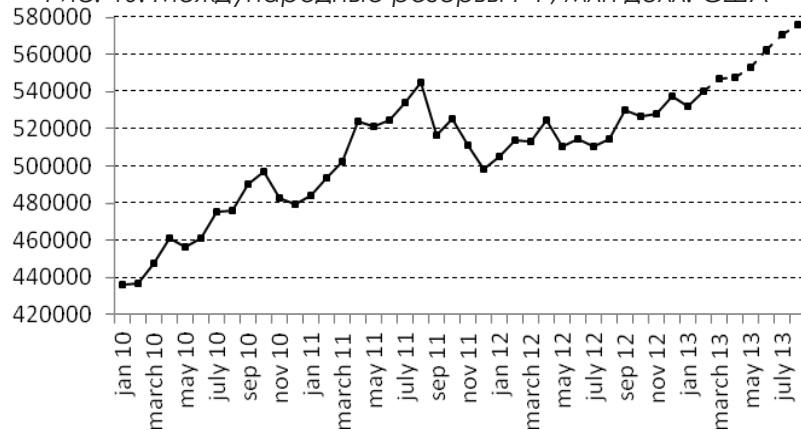


Рис. 41. Курс RUR/USD

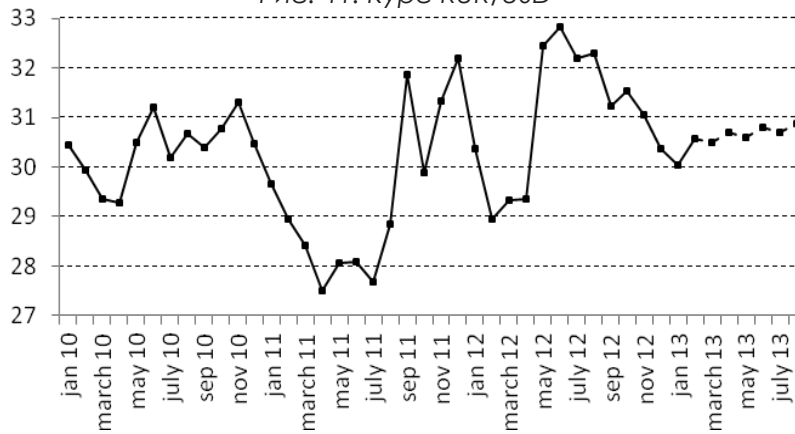


Рис. 41а. Курс RUR/USD (SM)

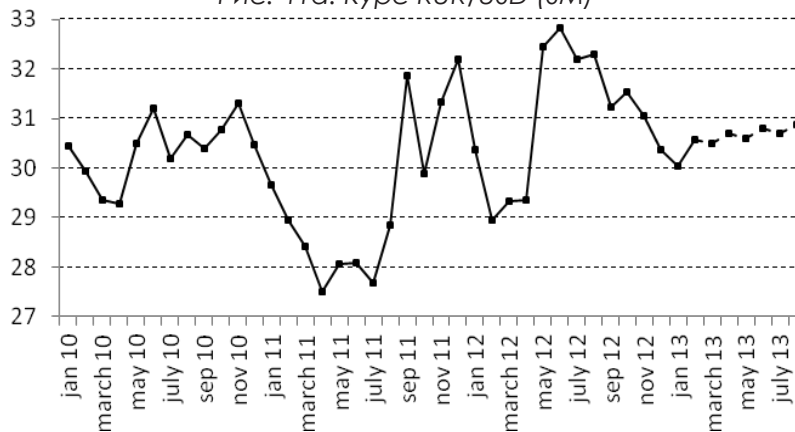


Рис. 42. Курс USD/EUR

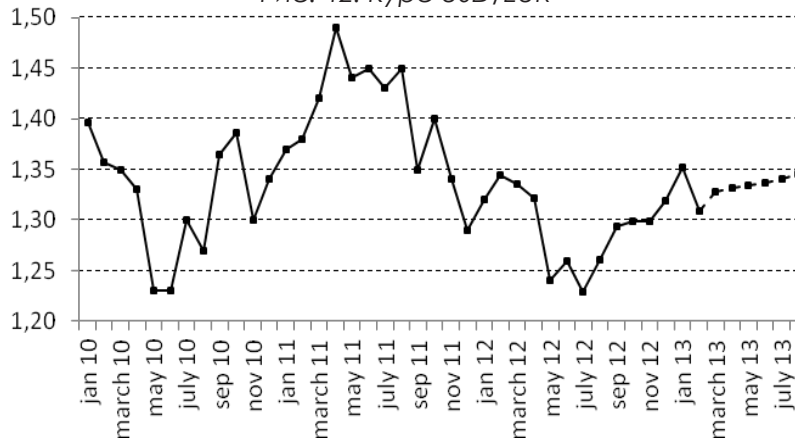


Рис. 42а. Курс USD/EUR (SM)

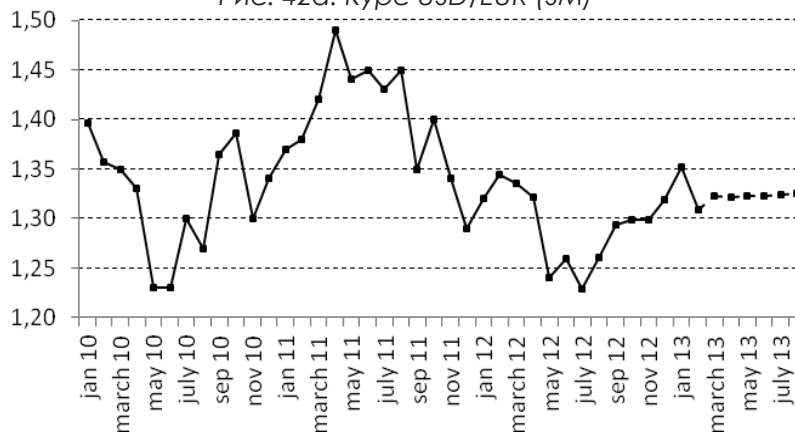


Рис. 43. Реальные располагаемые денежные доходы (в % к соответствующему периоду предыдущего года)

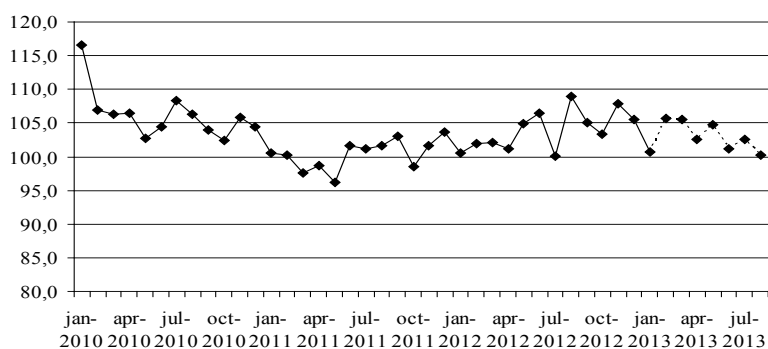


Рис. 44. Реальные денежные доходы (в % от уровня января 1999 г.)

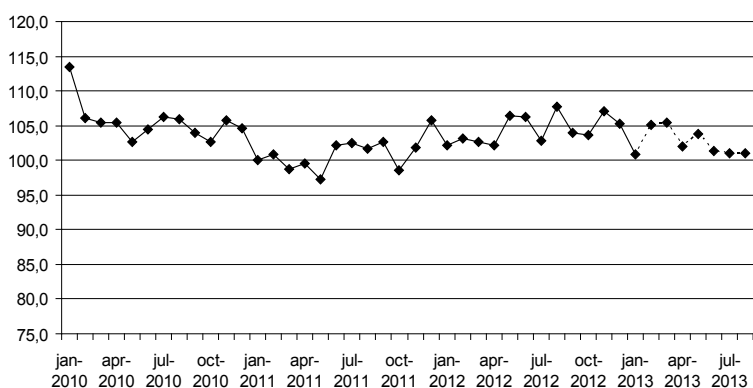


Рис. 45. Реальная начисленная заработная плата (в % к соответствующему периоду предыдущего года)

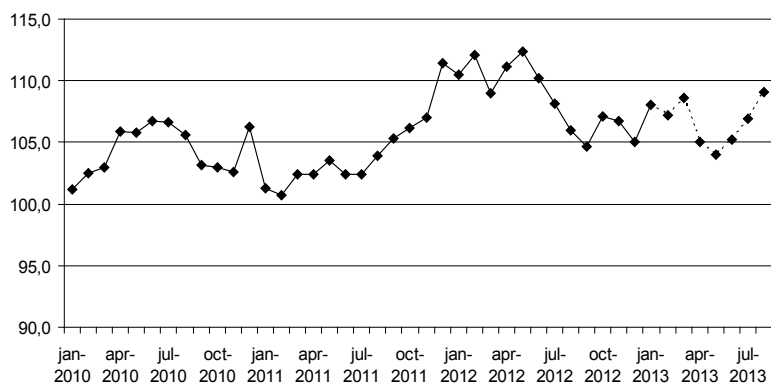


Рис. 46. Численность занятого в экономике населения (млн чел.)

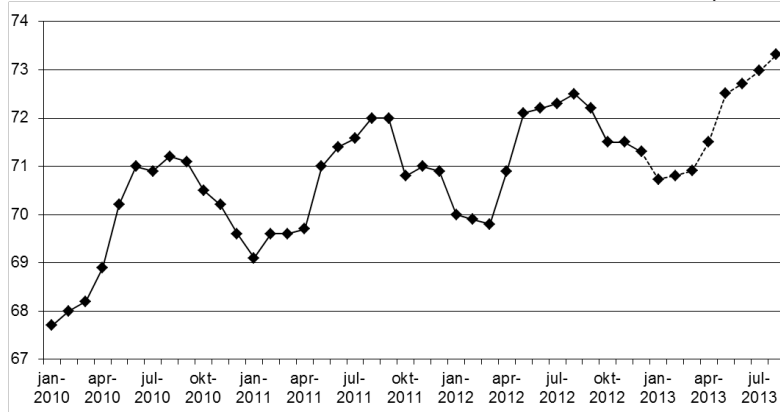


Рис. 47. Общая численность безработных (млн чел.)

