

МОНИТОРИНГ ЭКОНОМИЧЕСКОЙ СИТУАЦИИ В РОССИИ

Тенденции и вызовы социально-экономического развития

2021. № 6(138). Март

2. ДИНАМИКА ПРОМЫШЛЕННОГО ПРОИЗВОДСТВА В ЯНВАРЕ-ФЕВРАЛЕ 2021 ГОДА¹

Каукин А.С., к.э.н., заведующий лабораторией отраслевых рынков и инфраструктуры Института Гайдара; заведующий лабораторией системного анализа отраслевых рынков ИОРИ РАНХиГС;

Миллер Е.М., с.н.с. лаборатории системного анализа отраслевых рынков ИОРИ РАНХиГС

Соглашение ОПЕК+ и пандемия коронавируса остаются ключевыми факторами, оказывающими влияние на состояние обрабатывающей и добывающей промышленности. Некоторое смягчение условий по сделке ОПЕК+ в 2021 г. для России и возможности по сдерживанию пандемии за счет массовой вакцинации позволяют говорить о наличии потенциала роста в краткосрочном периоде. Тем не менее по итогам первых двух месяцев 2021 г. обрабатывающее производство в целом продолжает демонстрировать оклонулевые темпы роста.

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 Гайдара была осуществлена очистка рядов индексов всех отраслей промышленного производства за 2014–2021 гг. от сезонной и календарной компоненты 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 сектора, обрабатывающего сектора

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

2 «Трендовая составляющая» – используемый в литературе устоявшийся термин, однако следует отметить, что данная 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 в уровнях и стационарна в разностях), однако она может быть использована для интерпретации краткосрочной динамики и ее сопоставления с имеющимися место событиями.

3 Выделение трендовой составляющей было осуществлено при помощи пакета Demetra с использованием процедуры X12-ARIMA.

2. Динамика промышленного производства в январе-феврале 2021 года

и производства и распределения электроэнергии, газа и воды. Для остальных рядов результаты декомпозиции представлены в табл. 1.

Ранее¹ нами было отмечено, что спад в российской промышленности в результате введения мер по противодействию распространению коронавирусной инфекции был относительно небольшим, положительную роль сыграла структура собственности отраслеобразующих предприятий², слабая вовлеченность российских отраслей промышленности в глобальные цепочки создания добавленной стоимости и существенная доля промпроизводства в экономике.

В январе-феврале 2021 г. на динамику трендовой составляющей добывающего сектора продолжил оказывать влияние фактор, связанный с выполнением условий сделки ОПЕК+ по сокращению суточной добычи нефти. 3 декабря 2020 г. в ходе встречи стран – членов ОПЕК+ было принято решение о постепенном смягчении ограничений по добыче нефти в 2021 г., что позволяло России нарастить добычу примерно на 125 тыс. барр./сут. Кроме того 5 января 2021 г. для России было дополнительно согласовано смягчение этих условий до конца марта 2021 г. включительно, что позволяет нарастить добычу еще на 65 тыс. барр./сут.

Положительное влияние на динамику трендовой составляющей добывающего сектора продолжил оказывать внешний спрос на российский уголь со стороны стран Европы и Китая: во-первых, из-за действующего запрета, введенного Китаем в ноябре 2020 г., на импорт угля из Австралии; во-вторых, из-за резкого роста цен на природный газ и сокращения собственной добычи в Европе. Дополнительное влияние оказала холодная зима, этот фактор способствовал увеличению экспорта природного газа в январе-феврале 2021 г.

Анализ трендовых составляющих в обрабатывающем секторе показал, что ряд отраслей по итогам первых двух месяцев 2021 г. обнаружил небольшую положительную динамику (притом что обрабатывающее производство в целом продолжает стагнировать):

- 1 Каукин А.С., Миллер Е.М. Динамика промышленного производства в четвертом квартале 2020 г. // Экономическое развитие России. 2021. № 2 (28). С. 23–27.
- 2 Значительная часть крупных системообразующих и стратегически важных предприятий связаны с государством либо через систему госзаказа, либо в силу структуры собственности, вследствие чего проблема снижения потребительского спроса для таких предприятий является менее острой, чем для частного малого и среднего бизнеса.

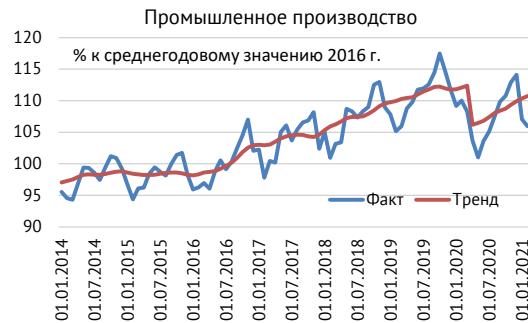


Рис. 1. Динамика индекса промышленного производства в 2014–2020 гг. (фактические данные и трендовая составляющая), % к среднегодовому значению 2016 г.

Источник: Росстат, расчеты авторов.

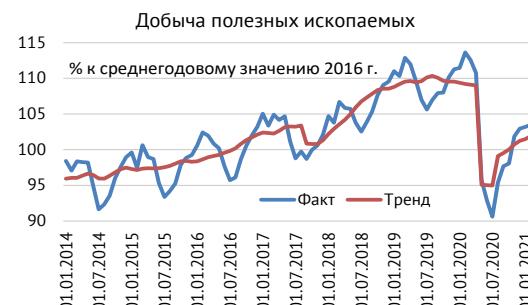


Рис. 2. Динамика индексов производства по отраслям в 2014–2020 гг. (фактические данные и трендовая составляющая), % к среднегодовому значению 2016 г.



Рис. 2. Динамика индексов производства по отраслям в 2014–2020 гг. (фактические данные и трендовая составляющая), % к среднегодовому значению 2016 г.



Рис. 2. Динамика индексов производства по отраслям в 2014–2020 гг. (фактические данные и трендовая составляющая), % к среднегодовому значению 2016 г.

Источник: Росстат, расчеты авторов.

Таблица 1

Изменение индекса выпуска по отраслям экономики, %

Название отраслей	Доля в индексе промышленного производства, %	Февраль 2021 г. к декабрю 2020 г.	Февраль 2021 г. к февралю 2020 г.	Изменения последних месяцев
Индекс промышленного производства		100,76	98,80	медленный рост
Добыча полезных ископаемых	34,54	100,67	93,32	медленный рост
Обрабатывающие производства, в том числе:	54,91	100,14	100,94	стагнация
производство пищевых продуктов, включая напитки, и табака	16,34	101,87	110,75	рост
текстильное и швейное производство	1,14	100,37	115,61	рост
производство кожи, изделий из кожи и производство обуви	0,27	99,13	94,81	медленный спад
обработка древесины и производство изделий из дерева	2,02	99,05	104,55	стагнация
целлюлозно-бумажное производство	3,35	96,79	79,45	спад
производство кокса, нефтепродуктов	17,25	100,39	92,52	медленный рост
химическое производство	7,56	102,18	114,93	рост
производство резиновых и пластмассовых изделий	2,14	98,97	108,91	стагнация
производство прочих неметаллических минеральных продуктов	4,02	95,76	97,60	спад
металлургическое производство и производство готовых металлических изделий	17,42	101,78	115,50	рост
производство машин и оборудования	6,97	101,05	108,26	медленный рост
производство электрооборудования, электронного и оптического оборудования	6,27	101,22	111,65	рост
производство транспортных средств и оборудования	6,75	102,81	128,98	рост
прочие производства	2,42	101,19	116,26	медленный рост
Электроэнергия газ и вода	13,51	101,23	105,61	рост
Оптовая торговля		100,08	102,05	медленный рост
Розничная торговля		100,60	101,86	медленный рост
Грузооборот		99,08	98,39	медленный спад
Строительство		100,08	100,44	стагнация
Объемы платных услуг населению		99,88	92,19	медленный спад

Источник: Росстат, расчеты авторов.

- легкая промышленность за счет замещения импортной продукции, в том числе вследствие смещения спроса потребителей в более низкий ценовой сегмент;
- химическая промышленность за счет сохранения роста производства лекарственных средств и санитарных материалов в условиях второй волны распространения коронавирусной инфекции, а также благодаря увеличению спроса на химические и минеральные удобрения на внутреннем и внешнем рынках;
- машиностроение, в том числе за счет производства легковых автомобилей, спрос на которые начал расти.

Из-за падения реальных располагаемых доходов населения сохранилась отрицательная динамика в сегменте платных услуг населению. Динамика трендовой составляющей грузооборота продолжала демонстрировать небольшой спад, несмотря на рост экспорта топливно-энергетических полезных ископаемых и удобрений. Оптовая и розничная торговля медленно росли по итогам двух первых месяцев 2021 г. в основном за счет роста продажи лекарств, химических удобрений, автотранспорта. 