



ИНСТИТУТ
ЭКОНОМИЧЕСКОЙ
ПОЛИТИКИ
ИМЕНИ Е. Т. ГАЙДАРА

НАУЧНЫЙ ВЕСТНИК ИЭП ИМ. ГАЙДАРА.РУ

12/2021

МОДЕЛЬНЫЕ РАСЧЕТЫ КРАТКОСРОЧНЫХ ПРОГНОЗОВ
СОЦИАЛЬНО-ЭКОНОМИЧЕСКИХ ПОКАЗАТЕЛЕЙ РФ
(январь-июнь 2022 г.)

М. Турунцева, Е. Астафьева, М. Баева, А. Божечкова, А. Бузаев,
Т. Киблицкая, Ю. Пономарев, А. Скроботов..... 3

ОЦЕНКА КАЧЕСТВА КРАТКОСРОЧНЫХ ПРОГНОЗОВ НЕКОТОРЫХ
РОССИЙСКИХ ЭКОНОМИЧЕСКИХ ПОКАЗАТЕЛЕЙ

(апрель 2009 г. – октябрь 2021 г.)
Е. Астафьева, М. Турунцева..... 32

АННОТАЦИИ И КЛЮЧЕВЫЕ СЛОВА К СТАТЬЯМ №12/2021

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

МОДЕЛЬНЫЕ РАСЧЕТЫ КРАТКОСРОЧНЫХ ПРОГНОЗОВ СОЦИАЛЬНО-ЭКОНОМИЧЕСКИХ ПОКАЗАТЕЛЕЙ РФ

(январь-июнь 2022 г.)

В статье представлены расчеты прогнозных значений различных экономических показателей Российской Федерации в январе-июне 2022 г., построенные на основе моделей временных рядов, структурных эконометрических уравнений и моделей, оцененных с использованием результатов конъюнктурных опросов.

Ключевые слова: прогнозирование, социально-экономические показатели РФ, временные ряды.

Е. Астафьева, М. Турунцева

ОЦЕНКА КАЧЕСТВА КРАТКОСРОЧНЫХ ПРОГНОЗОВ ИНДЕКСОВ ПРОМЫШЛЕННОГО ПРОИЗВОДСТВА РОССТАТА

(апрель 2009 г. – октябрь 2021 г.)

В статье приведены результаты анализа качества прогнозов ИЭП индекса потребительских цен (ИПЦ), показателей уровня жизни населения, стоимости минимального набора продуктов питания, розничного товарооборота, численности занятых и общей численности безработных с апреля 2009 г. по сентябрь 2020 г. Показано, что для всех показателей прогнозы ИЭП превосходят простейшие альтернативные методы прогнозирования по своему качеству, и во всех случаях (за исключением реальной начисленной заработной платы) эти различия оказываются значимыми.

Ключевые слова: прогнозирование, ИПП, промышленное производство.

МОДЕЛЬНЫЕ РАСЧЕТЫ КРАТКОСРОЧНЫХ ПРОГНОЗОВ СОЦИАЛЬНО-ЭКОНОМИЧЕСКИХ ПОКАЗАТЕЛЕЙ РФ (ЯНВАРЬ-ИЮНЬ 2022 Г.)

М. Турунцева, зав. лабораторией, ИЭП им. Е.Т. Гайдара и РАНХиГС,
Е. Астафьева, с.н.с., РАНХиГС,
М. Баева, н.с., РАНХиГС,
А. Божечкова, с.н.с., РАНХиГС,
А. Бузаев, ст. эксперт, Банк Москвы,
Т. Киблицкая, н.с., РАНХиГС,
Ю. Пономарев, с.н.с., ИЭП им. Е.Т. Гайдара, РАНХиГС,
А. Скроботов, н.с., РАНХиГС

В статье представлены расчеты прогнозных значений различных экономических показателей Российской Федерации в январе-июне 2022 г.¹, построенные на основе моделей временных рядов, разработанных в результате исследований, проводимых в течение последних нескольких лет в ИЭП им. Е.Т. Гайдара².

Использованный 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 исследований³, 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

¹ В связи с тем, что с начала 2019 г. Росстат перестал публиковать месячные данные по показателям реальных располагаемых денежных доходов и реальных денежных доходов населения, с № 8 за 2019 г. мы публикуем прогнозы в квартальном разрезе на 2 квартала вперед.

² 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.

³ Там же.

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–Эндрюса¹.

После разделения рядов на слабо стационарные, стационарные около тренда, стационарные около тренда со структурным сдвигом либо стационарные в разностях для каждого из 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 статье на основе разработанных в ИЭП им. 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, так как 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 статье также представлены расчеты значений индексов промышленного производства, индекса цен производителей и показателя общей численности безработных, рассчитанные с использованием

¹ 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.

результатов конъюнктурных опросов ИЭП им. Е.Т. Гайдара. Эмпирические исследования показывают¹, что использование рядов конъюнктурных опросов в прогностических 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).

Индекс потребительских цен и индекс цен производителей также прогнозируются при помощи больших массивов данных (факторных моделей – FM). В основе построения факторных моделей лежит оценка главных компонент большого массива социально-экономических показателей (в нашем случае 112 показателей). Лаги этих главных компонент и лаги объясняемой переменной используются в качестве объясняющих переменных в таких моделях. На основе анализа качества прогнозов, полученных для различных конфигураций факторных моделей, для ИПЦ была выбрана модель, включающая 8-й лаг двух главных компонент, а также 1-й лаг самой переменной, для ИЦП – модель, включающая 12-й лаг первой главной компоненты и 1-й лаг самой переменной.

Все расчеты проводились с использованием эконометрического пакета Eviews. В приложении 1 представлена сводная таблица прогнозов, в приложении 2 – графики временных рядов всех прогнозируемых показателей и их прогнозов на рассматриваемом интервале времени.

ПРОМЫШЛЕННОЕ ПРОИЗВОДСТВО И РОЗНИЧНЫЙ ТОВАРООБОРОТ

Промышленное производство

Для построения прогноза на январь-июнь 2022 г. были использованы ряды месячных индексов промышленного производства Федеральной службы государственной статистики (Росстата) с января 2002 г. по октябрь 2021 г. и ряды базисных индексов промышленного производства Научно-исследовательского университета «Высшая школа экономики» (НИУ ВШЭ)³ за период с января 2013 г. по ноябрь 2021 г. (скорректированное значение января 2013 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, средний⁴ прирост индекса промышленного производства Росстата в январе-июне 2022 г. по сравнению с аналогичным периодом предыдущего года по промышленности в целом составляет 4,3%. Для индекса промышленного производства НИУ ВШЭ данный показатель также составляет 4,1%.

Среднемесячное увеличение индекса промышленного производства в добыче полезных ископаемых Росстата и НИУ ВШЭ в январе-июне 2022 г. составляет 9,4 и 7,7% соответственно.

Средний темп прироста индекса промышленного производства в обрабатывающей промышленности Росстата по сравнению с аналогичным периодом предыдущего года в январе-июне 2022 г. достигает 4,3%, индекса НИУ ВШЭ – 3,7%. Среднемесячное увеличение индекса промышленного производства в производстве пищевых продуктов Росстата и НИУ ВШЭ составляет соответственно 2,3 и 2,6%. В производстве кокса и нефтепродуктов средний прирост прогнозируется на уровне 4,6 и 6,5% для индексов Росстата и НИУ ВШЭ соответственно. Среднемесячное

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.

³ Данные индексы рассчитываются Барановым Э.Ф. и Бессоновым В.А.

⁴ 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 обеспечении электрической энергией, газом и паром		ИПП в производстве пищевых продуктов		ИПП в производстве кокса и нефтепродуктов		ИПП в металлургическом производстве		ИПП в производстве машин и оборудования	
	Росстат	НИУ ВШЭ	Росстат	НИУ ВШЭ	Росстат	НИУ ВШЭ	Росстат	НИУ ВШЭ	Росстат	НИУ ВШЭ	Росстат	НИУ ВШЭ	Росстат	НИУ ВШЭ	Росстат	НИУ ВШЭ
Янв.22	5,0	7,8	5,7	7,5	11,8	11,4	5,7	3,6	-0,9	-2,2	3,9	7,9	2,7	1,3	23,6	11,3
Фев.22	5,0	6,5	2,8	6,2	12,4	12,6	5,5	2,7	-4,0	-4,9	3,0	7,4	3,4	2,6	10,2	3,5
Мар.22	1,7	5,7	0,5	6,3	9,4	9,9	2,5	1,8	-4,4	-3,7	1,5	2,5	2,8	0,6	5,5	0,6
Апр.22	0,6	5,6	1,1	4,9	8,0	8,6	3,4	4,4	-3,2	-1,2	1,6	0,0	2,7	3,2	4,1	4,0
Май.22	1,0	5,4	1,2	5,1	7,6	1,9	4,2	6,0	-3,2	-1,8	1,7	3,7	2,6	1,1	9,7	15,5
Июн.22	1,2	6,5	1,0	7,0	7,1	1,6	4,1	3,5	-2,9	-1,2	2,3	5,9	1,9	-1,7	3,0	3,0
Прогнозируемый прирост к соответствующему месяцу предшествующего года																
Янв.21	-2,2	-1,3	5,7	7,5	-7,4	-7,9	-0,3	1,7	7,4	11,2	-2,6	-8,1	-2,4	-1,8	-8,8	3,1
Фев.21	-3,6	-2,9	2,8	6,2	-9,2	-9,5	-1,9	-0,8	8,0	12,7	-3,3	-9,5	-3,2	-3,3	5,0	5,9
Мар.21	1,6	1,4	0,5	6,3	-4,6	-5,0	4,6	4,8	9,3	11,8	1,0	-3,7	-1,7	-0,9	9,7	7,2
Апр.21	7,2	6,6	1,1	4,9	-1,8	-2,3	14,3	15,1	5,3	4,4	2,4	4,8	2,2	1,6	27,0	21,1
Май.21	11,9	11,6	1,2	5,1	12,1	12,1	11,8	11,2	8,1	7,6	2,3	9,8	3,2	3,4	15,9	5,5
Июн.21	10,2	10,8	1,0	7,0	13,7	13,5	7,6	8,3	8,1	6,3	0,5	9,8	2,0	2,4	7,8	5,3
Справочно: фактический прирост 2021 г. к соответствующему месяцу 2020 г.																
Янв.21	-2,2	-1,3	5,7	7,5	-7,4	-7,9	-0,3	1,7	7,4	11,2	-2,6	-8,1	-2,4	-1,8	-8,8	3,1
Фев.21	-3,6	-2,9	2,8	6,2	-9,2	-9,5	-1,9	-0,8	8,0	12,7	-3,3	-9,5	-3,2	-3,3	5,0	5,9
Мар.21	1,6	1,4	0,5	6,3	-4,6	-5,0	4,6	4,8	9,3	11,8	1,0	-3,7	-1,7	-0,9	9,7	7,2
Апр.21	7,2	6,6	1,1	4,9	-1,8	-2,3	14,3	15,1	5,3	4,4	2,4	4,8	2,2	1,6	27,0	21,1
Май.21	11,9	11,6	1,2	5,1	12,1	12,1	11,8	11,2	8,1	7,6	2,3	9,8	3,2	3,4	15,9	5,5
Июн.21	10,2	10,8	1,0	7,0	13,7	13,5	7,6	8,3	8,1	6,3	0,5	9,8	2,0	2,4	7,8	5,3

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.

изменение индексов промышленного производства Росстата и НИУ ВШЭ для металлургического производства в январе-июне 2022 г. достигает соответственно 2,7 и 1,2%. В производстве машин и оборудования средний рост прогнозируется на уровне 9,3 и 6,3% для индексов Росстата и НИУ ВШЭ соответственно.

Среднее прогнозируемое падение индекса промышленного производства в обеспечении электрической энергией, газом и паром; кондиционировании воздуха Росстата в январе-июне 2022 г. по сравнению с тем же периодом предыдущего года составляет 3,1%; аналогичный показатель для индекса НИУ ВШЭ – 2,5%.

Розничный товароборот

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 2021 г.

Из табл. 2 следует, что средний прогнозируемый прирост объемов месячного товарооборота в период с января по июнь 2022 г. отношению к соответствующему периоду 2021 г. составляет около 9,9%.

Средний прогнозируемый прирост месячного реального товарооборота в период с января по июнь 2022 г. по отношению к соответствующему периоду 2021 г. составляет 1,8%.

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 (% к соответствующему периоду предыдущего года)
Январь 2022	3207,0 (12,8)	98,3
Февраль 2022	3168,8 (13,3)	101,7
Март 2022	3453,4 (12,0)	103,9
Апрель 2022	3300,4 (5,8)	102,6
Май 2022	3387,7 (6,9)	101,9
Июнь 2022	3485,1 (8,7)	102,1
Справочно: фактические значения за аналогичные месяцы 2021 г.		
Январь 2021	2842,1	101,1
Февраль 2021	2797,0	99,3
Март 2021	3084,6	97,5
Апрель 2021	3118,0	136,3
Май 2021	3169,4	128,0
Июнь 2021	3206,5	111,5

Примечание. Ряды розничного товарооборота и реального розничного товарооборота на интервале с января 1999 г. по декабрь 2021 г. являются рядами типа DS.

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 октябрь 2021 г. по данным ЦБ РФ¹. Результаты расчетов представлены в табл. 3.

Средний прогнозируемый прирост экспорта, импорта, экспорта вне СНГ и импорта из стран вне СНГ за январь-июнь 2022 г. по отношению к январю-июню 2021 г. составит 36,1, 9,4, 42,0 и 17,1% соответственно. Средний прогнозируемый объем сальдо торгового баланса со всеми странами за январь-июнь 2022 г. составит 129,4 млрд долл. США, что соответствует увеличению в 1,9 раз по отношению к январю-июню 2022 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 3

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.)		в процентах от фактических данных за соответствующий месяц предшествующего года		прогнозные значения (млрд долл. в мес.)		в процентах от фактических данных за соответствующий месяц предшествующего года		прогнозные значения (млрд долл. в мес.)		в процентах от фактических данных за соответствующий месяц предшествующего года		прогнозные значения (млрд долл. в мес.)		в процентах от фактических данных за соответствующий месяц предшествующего года	
	ARIMA	SM	ARIMA	SM	ARIMA	SM	ARIMA	SM	ARIMA	SM	ARIMA	SM	ARIMA	SM	ARIMA	SM
Январь 2022	39,0	43,1	146	162	20,2	21,4	114	121	35,1	37,1	152	161	21,3	22,9	135	145
Февраль 2022	45,7	47,7	151	157	24,3	25,8	115	123	39,8	42,9	153	165	24,2	24,8	128	131
Март 2022	49,8	51,4	137	142	26,5	28,9	103	112	44,2	46,5	143	150	25,7	25,7	111	111
Апрель 2022	48,2	50,4	131	137	25,1	28,8	95	110	44,4	45,2	142	144	25,3	24,9	107	105
Май 2022	46,5	49,8	133	143	26,6	27,1	109	111	41,3	44,3	138	148	24,0	24,2	110	111
Июнь 2022	46,6	48,2	108	111	25,4	27,5	100	109	43,7	44,4	115	117	26,2	25,4	117	114
Справочно: фактические значения за соответствующие месяцы 2021 г. (млрд долл.)																
Январь 2021	26,7				17,7				23,0				15,8			
Февраль 2021	30,3				21,1				25,9				18,9			
Март 2021	36,3				25,8				31,0				23,3			
Апрель 2021	36,7				26,3				31,4				23,7			
Май 2021	34,9				24,4				30,0				21,8			
Июнь 2021	43,3				25,3				37,9				22,3			

Примечание. На интервале с января 1999 г. по октябрь 2021 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.

Таблица 4
Результаты расчетов прогнозных значений индексов цен

Месяц	Индексы цен производителей:																	
	Индекс потребительских цен (ARIMA)	Индекс потребительских цен (SM)	Индекс потребительских цен (FM)	ИЦП промышленных товаров (ARIMA)	ИЦП промышленных товаров (КО)	ИЦП промышленных товаров (FM)	добыча полезных ископаемых	обрабатывающие производства	производство электроэнергии, газа и воды	производство пищевых продуктов	производство текстильных изделий	обработка древесины и производство изделий из дерева	производство бумаги и бумажных изделий	производство кокса, нефтепродуктов	химическое производство	металлургическое производство	производство машин и оборудования	производство автотранспортных средств
	Прогнозные значения (в % к предыдущему месяцу)																	
Янв.22	101,3	100,8	100,6	102,5	100,4	100,5	102,3	101,7	100,6	101,5	101,4	102,3	101,8	98,2	102,6	98,9	102,1	101,4
Фев.22	100,9	100,7	100,5	102,4	101,2	100,6	101,1	102,0	101,5	101,6	101,5	102,9	102,2	102,3	102,1	99,6	101,0	101,0
Мар.22	100,9	100,6	100,5	101,9	101,6	100,7	101,7	101,5	101,7	101,5	101,4	102,5	102,4	102,4	101,7	101,6	101,0	101,4
Апр.22	100,8	100,5	100,5	102,2	101,1	100,7	100,4	100,9	99,5	101,4	101,6	102,8	103,1	102,4	101,4	101,7	100,9	101,1
Май.22	100,9	100,5	100,5	102,3	101,3	100,6	101,1	101,2	101,0	101,4	101,8	102,7	103,4	102,4	101,0	101,9	100,9	101,0
Июн.22	100,9	100,4	100,4	102,3	100,9	100,6	99,9	101,3	98,6	101,3	101,6	102,5	102,7	102,4	100,8	101,1	100,8	101,5
	Прогнозные значения (в % к декабрю 2021 г.)																	
Янв.22	101,3	100,8	100,6	102,5	100,4	100,5	102,3	101,7	100,6	101,5	101,4	102,3	101,8	98,2	102,6	98,9	102,1	101,4
Фев.22	102,2	101,5	101,1	104,9	101,6	101,1	103,4	103,7	102,1	103,1	103,0	105,3	104,0	100,5	104,8	98,6	103,1	102,4
Мар.22	103,1	102,1	101,6	107,0	103,2	101,8	105,2	105,3	103,8	104,6	104,4	108,0	106,4	102,9	106,6	100,2	104,2	103,8
Апр.22	103,9	102,6	102,1	109,3	104,3	102,5	105,5	106,3	103,2	106,0	106,0	111,0	109,7	105,4	108,1	101,8	105,1	104,9
Май.22	104,8	103,1	102,6	111,9	105,7	103,1	106,7	107,6	104,3	107,5	107,9	114,0	113,4	107,9	109,2	103,7	106,0	105,9
Июн.22	105,7	103,6	103,0	114,4	106,6	103,8	106,6	108,9	102,8	108,8	109,6	116,9	116,4	110,4	110,1	104,9	106,9	107,4
	Справочно: фактические значения за аналогичные периоды 2021 г. (в % к декабрю 2020 г.)																	
Янв.21		100,7			103,4		109,4	102,2	100,0	101,5	100,9	102,1	102,1	104,8	103,3	106,4	101,2	101,8
Фев.21		101,5			107,0		116,8	105,1	101,9	103,1	102,6	105,1	105,4	109,9	107,7	114,0	101,2	102,3
Мар.21		102,2			110,9		125,1	108,1	102,6	105,0	103,3	107,4	109,3	119,2	113,7	116,1	102,2	104,0
Апр.21		102,8			113,9		130,9	110,9	102,0	106,7	105,2	110,8	115,6	125,0	122,2	118,4	102,9	104,5
Май.21		103,5			116,5		132,7	114,4	102,0	108,0	106,9	116,0	123,3	125,9	130,6	132,1	104,0	104,5
Июн.21		104,3			119,9		137,8	118,1	100,4	108,9	107,8	122,3	129,0	130,9	133,4	144,9	104,6	106,1

Примечание. На интервале с января 1999 г. по октябрь 2021 г. ряд цепного индекса цен производителей промышленных товаров в производстве машин и оборудования идентифицирован как процесс, являющийся стационарным около тренда с двумя эндогенным структурными сдвигами. Ряды остальных цепных индексов цен являются стационарными в уровнях.

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 октябрь 2021 г.¹. В табл. 4 приведены результаты модельных расчетов прогнозных значений в январе-июне 2022 г. по ARIMA-моделям, структурным моделям (SM) и моделям, построенным с использованием конъюнктурных опросов (КО).

Прогнозируемый среднемесячный прирост индекса потребительских цен в январе-июне 2022 г. составит 0,7%. Прирост цен производителей промышленных товаров за указанный период прогнозируется в среднем на уровне 1,3% в месяц.

Для индексов цен производителей Росстата с января по июнь 2022 г. прогнозируются следующие средние темпы роста в месяц: 1,1% – в добыче полезных ископаемых, 1,4% – в обрабатывающих производствах, 0,5% – в обеспечении электрической энергией, газом и паром, 1,4% – в производстве пищевых продуктов, 1,5% – в производстве текстильных изделий, 2,6% – в обработке древесины и производстве изделий из дерева, 2,6% – в производстве бумаги и бумажных изделий, 1,7% – в производстве кокса и нефтепродуктов, 1,6% – в химическом производстве, 0,8% – в металлургическом производстве, 1,1% – в производстве машин и оборудования и 1,2% – в производстве автотранспортных средств.

Динамика стоимости минимального набора продуктов питания

В данном разделе представлены результаты расчетов прогнозируемых значений стоимости минимального набора продуктов питания в январе-июне 2022 г. Прогнозы строились на основе временных рядов по данным Росстата за период с января 2000 по декабрь 2021 г. Результаты расчетов представлены в табл. 5.

Как видно из табл. 5, 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 5473,9 руб. Прогнозируемый прирост стоимости минимального набора продуктов питания составляет в среднем около 14,4% по сравнению с уровнем соответствующего периода прошлого года.

Таблица 5

Прогноз стоимости минимального набора продуктов питания (на одного человека в месяц)

Прогнозируемые значения по ARIMA-модели (руб.)	
Январь 2022	5365,7
Февраль 2022	5385,8
Март 2022	5433,0
Апрель 2022	5463,8
Май 2022	5587,9
Июнь 2022	5607,5
Справочно: фактические значения за аналогичные месяцы 2021 г. (руб.)	
Январь 2021	4507,4
Февраль 2021	4583,2
Март 2021	4712,0
Апрель 2021	4800,2
Май 2021	4953,1
Июнь 2021	5183,9
Прогнозируемый прирост к соответствующему месяцу предыдущего года (%)	
Январь 2022	19,0
Февраль 2022	17,5
Март 2022	15,3
Апрель 2022	13,8
Май 2022	12,8
Июнь 2022	8,2

Примечание. Ряд стоимости минимального набора продуктов на интервале с января 2000 г. по декабрь 2021 г. является стационарным в первых разностях.

¹ Структурные модели оценивались на интервале с октября 1998 г.

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 октябрь 2021 г. В табл. 6 приведены результаты модельных расчетов прогнозных значений в январе-июне 2022 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 могут сильно отличаться от реальных в случаях централизованного увеличения тарифов на интервале прогнозирования или при отсутствии такового на прогнозируемом участке при увеличении накануне.

По результатам прогноза на январь-июнь 2022 г. сводный индекс транспортных тарифов на грузовые перевозки в течение данных шести месяцев будет расти со среднемесячным темпом 0,6%. В апреле 2022 г. ожидается сезонный рост индекса на 3,7 п.п.

Индекс тарифов на грузовые перевозки автомобильным транспортом в течение данных шести месяцев будет расти со среднемесячным темпом 0,1%. Индекс тарифов на трубопроводный транспорт будет расти со среднемесячным темпом 0,9%. В апреле 2022 г. прогнозируется сезонный прирост индекса на 2,7 п.п.

Динамика цен на некоторые виды сырья на мировом рынке

В данном разделе в табл. 7 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 январе-июне 2022 г., полученные на основе нелинейных моделей временных рядов, оцененных по данным МВФ на интервале с января 2000 г. по октябрь 2021 г.

Таблица 6

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)			
Январь 2022	100,0	101,4	99,2
Февраль 2022	100,0	99,9	98,9
Март 2022	100,0	99,9	99,0
Апрель 2022	103,7	99,9	102,7
Май 2022	99,9	99,9	102,7
Июнь 2022	99,9	99,8	102,7
Прогнозные значения по ARIMA-моделям (в % к декабрю предыдущего года)			
Январь 2022	100,0	101,4	99,2
Февраль 2022	99,9	101,3	98,1
Март 2022	99,9	101,1	97,2
Апрель 2022	103,5	101,0	99,8
Май 2022	103,5	100,8	102,6
Июнь 2022	103,4	100,7	105,3
Справочно: фактические значения за аналогичный период 2021 г. (в % к предыдущему месяцу)			
Январь 2021	103,1	100,9	103,3
Февраль 2021	100,0	100,3	100,0
Март 2021	100,0	99,8	100,0
Апрель 2021	103,5	100,5	103,5
Май 2021	99,9	99,8	99,9
Июнь 2021	100,0	100,1	100,0

Примечание. На интервале с сентября 1998 г. по октябрь 2021 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 октябрь 2021 г.; для всех рядов использовались фиктивные переменные для учета особо резких всплесков.

¹ В статье 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*).

Таблица 7

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 нелинейным моделям					
Январь 2022	68,36	2596	1844	9478	19210
Февраль 2022	65,51	2510	1846	9481	19732
Март 2022	65,89	2514	1860	9402	19906
Апрель 2022	64,35	2542	1880	9377	20162
Май 2022	64,53	2514	1890	9357	20193
Июнь 2022	64,25	2510	1904	9441	20177
Приросты к соответствующему месяцу предыдущего года (%)					
Январь 2022	22,3	31,6	-1,2	21,3	8,7
Февраль 2022	-0,9	16,0	2,1	5,4	6,3
Март 2022	3,7	14,6	5,6	6,7	23,4
Апрель 2022	-4,3	6,3	6,7	-4,4	14,7
Май 2022	-6,9	1,9	2,0	-8,9	11,0
Июнь 2022	-14,5	-0,4	3,8	0,6	10,7
Справочно: фактические значения за аналогичный период 2021 г.					
Январь 2021	55,88	1973	1867	7813	17675
Февраль 2021	66,13	2163	1808	8993	18563
Март 2021	63,54	2194	1762	8809	16128
Апрель 2021	67,25	2391	1762	9809	17585
Май 2021	69,32	2467	1853	10275	18188
Июнь 2021	75,13	2520	1835	9388	18225

Примечание. Ряды цен на нефть, никель, золото, медь и алюминий на интервале с января 1980 г. по октябрь 2021 г. являются рядами типа DS.

Средний прогнозируемый уровень цен на нефть составляет около 65,5 долл./барр., что ниже соответствующих показателей прошлого года в среднем на 0,1%. Цены на алюминий прогнозируются на уровне около 2531 долл./т, а их среднее прогнозируемое повышение составляет приблизительно 12% по сравнению с соответствующим уровнем прошлого года. Прогноз цен на золото – около 1871 долл./унц. Средние прогнозируемые цены на медь составляют около 9923 долл./т, а на никель – около 19897 долл./т. Среднее прогнозируемое повышение цен на золото составляет около 3%, на медь – около 3%, на никель – 12% по сравнению с соответствующим уровнем прошлого года.

ДЕНЕЖНЫЕ ПОКАЗАТЕЛИ

Будущие значения денежной базы (в узком определении – наличные деньги и ФОР) и денежного агрегата M_2 в январе-июне 2022 г. получены на основе моделей временных рядов соответствующих показателей, рассчитываемых ЦБ РФ¹, на интервале с октября 1998 г. по декабрь 2021 г. для денежной базы и по ноябрь 2021 г. для денежного агрегата M_2 . В табл. 8

Таблица 8

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, %
Январь 2022	14707	3,6	62399	2,0
Февраль 2022	14404	-2,1	62203	-0,3
Март 2022	14556	1,1	62399	0,3
Апрель 2022	14632	0,5	62203	-0,3
Май 2022	14784	1,0	62399	0,3
Июнь 2022	14863	0,5	62203	-0,3
Справочно: фактические значения за соответствующие месяцы 2021 г. (прирост к предыдущему месяцу, %)				
Январь 2021		3,8		4,5
Февраль 2021		-1,7		-1,8
Март 2021		1,0		1,0
Апрель 2021		0,0		0,1
Май 2021		2,9		1,6
Июнь 2021		-1,3		0,0

Примечание. Временной ряд значений денежной базы на интервале с октября 1998 г. по декабрь 2021 г. был отнесен к классу рядов, являющихся стационарными в первых разностях, с выраженной сезонной компонентой, а временной ряд денежного агрегата M_2 на интервале с октября 1998 г. по ноябрь 2021 г. был идентифицирован как стационарный ряд с выраженной сезонной компонентой.

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

приводятся результаты расчетов прогнозных значений и фактические значения этих показателей за аналогичный период предыдущего 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.

В январе-июне 2022 г. денежная база будет расти на рассматриваемом интервале времени со среднемесячным темпом 0,8%. В январе 2022 г. прогнозируется сезонный рост денежной базы на 3,6 п.п.

В рассматриваемый период времени денежный показатель M_2 будет меняться со среднемесячным темпом 0,3%. В январе 2022 г. прогнозируется сезонный рост показателя на 2,0 п.п.

МЕЖДУНАРОДНЫЕ РЕЗЕРВЫ

В данном разделе представлены результаты статистической оценки будущих значений международных резервов РФ¹, полученные исходя из оценки модели временного ряда международных резервов, по данным ЦБ РФ, на интервале с ноября 1998 г. по декабрь 2021 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 январе-июне 2022 г. международные резервы будут расти со среднемесячным темпом 0,4%.

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 декабрь 2021 г. и за период с января 1999 г. по декабрь 2021 г.² соответственно.

Таблица 9
Прогноз международных резервов

Период	Прогнозные значения по ARIMA-моделям	
	млрд долл.	прирост к предыдущему месяцу, %
Янв. 2022	621,4	-0,2
Фев. 2022	624,1	0,4
Мар. 2022	626,7	0,4
Апр. 2022	630,3	0,6
Май 2022	633,8	0,6
Июн. 2022	637,2	0,5
Справочно: фактические значения за аналогичный период 2021 г.		
Янв. 2021	595,8	2,2
Фев. 2021	590,7	-0,9
Мар. 2021	586,3	-0,7
Апр. 2021	573,3	-2,2
Май 2021	590,5	3,0
Июн. 2021	605,2	2,5

Примечание. На интервале с октября 1998 г. по декабрь 2021 г. ряд международных резервов РФ был идентифицирован как стационарный в разностях ряд.

Таблица 10
Прогноз курсов USD/RUR и EUR/USD

Период	Прогнозные значения курса USD/RUR (рублей за доллар США)		Прогнозные значения курса EUR/USD (долларов США за евро)	
	ARIMA	SM	ARIMA	SM
Янв. 2022	77,52	77,52	1,12	1,12
Фев. 2022	77,80	78,12	1,12	1,12
Мар. 2022	78,57	78,83	1,12	1,12
Апр. 2022	78,52	79,12	1,12	1,12
Май 2022	79,05	79,68	1,12	1,12
Июн. 2022	79,18	79,91	1,12	1,12
Справочно: фактические значения за аналогичный период 2021 г.				
Янв. 2021	76,25		1,22	
Фев. 2021	74,44		1,20	
Мар. 2021	75,70		1,18	
Апр. 2021	74,38		1,21	
Май 2021	73,59		1,22	
Июн. 2021	72,37		1,19	

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

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

² В Бюллетене использованы данные МВФ по курсу евро к доллару США за период с января 1999 г. по ноябрь 2021 г. и по курсу доллара США к рублю за период с октября 1998 г. по ноябрь 2021 г. Данные за декабрь 2021 г. были взяты с сайта статистики обменных курсов www.oanda.com.

В январе-июне 2022 г. значение курса доллара США к рублю прогнозируется в среднем по двум моделям равным 78 руб. 65 коп. за доллар США.

США в среднем на рассматриваемом интервале времени составит 1,12 долл. США за один евро. Значение показателя на конец 2021 г. прогнозируется на уровне 1,12 долл. США за один евро в среднем по двум моделям.

ПОКАЗАТЕЛИ УРОВНЯ ЖИЗНИ НАСЕЛЕНИЯ

В данном разделе (см. табл. 11) представлены результаты расчета ежемесячных прогнозных значений показателя реальной заработной платы, а также ежеквартальных прогнозных значений показателей реальных располагаемых денежных доходов и реальных денежных доходов¹, полученные на основе моделей временных рядов соответствующих показателей, рассчитываемых Росстатом и взятых на интервале с января 1999 г. по ноябрь 2021 г., а также с I квартала 2014 г. по IV квартал 2021 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.

Результаты, представленные в табл. 11, прогнозируют прирост реальной заработной платы. Ожидается средний прирост реальной заработной платы в размере 5,3% по сравнению с аналогичным периодом предшествующего года.

Результаты, представленные в табл. 12, прогнозируют прирост реальных располагаемых денежных доходов порядка 0,4%. Также прогнозируется средний прирост реальных денежных доходов в размере 1,9% по сравнению с соответствующим прошлым уровнем.

Таблица 11
Прогноз уровня реальной заработной платы

Период	Реальная заработная плата
Прогнозные значения по моделям ARIMA (в % к соответствующему месяцу 2021 г.)	
Январь 2022	104,5
Февраль 2022	104,8
Март 2022	105,2
Апрель 2022	105,5
Май 2022	105,7
Июнь 2022	105,9
Справочно: фактические значения за соответствующий период 2021 г. (в % к аналогичному периоду 2020 г.)	
Январь 2021	100,1
Февраль 2021	102,0
Март 2021	101,8
Апрель 2021	107,8
Май 2021	103,3
Июнь 2021	104,9

Примечание. Для расчетов использовался ряд реальной заработной платы в базисной форме (за базисный период был принят январь 1999 г.). На рассматриваемом интервале с января 1999 г. по ноябрь 2021 г. этот ряд был отнесен к классу процессов, являющихся стационарными в разностях.

Таблица 12
Прогноз показателей уровня жизни населения

Период	Реальные располагаемые денежные доходы	Реальные денежные доходы
Прогнозные значения по моделям ARIMA (в % к соответствующему кварталу 2021 г.)		
I квартал 2022	100,4	102,4
II квартал 2022	100,4	101,4
Справочно: фактические значения за соответствующий период 2021 г. (в % к аналогичному периоду 2020 г.)		
I квартал 2021	96,1	96,3
II квартал 2021	106,8	107,9

¹ 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.)

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 января 1999 г. по октябрь 2021 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 другим показателем.

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 человек	прирост к соответствующему месяцу 2021 г., %	млн человек	прирост к соответствующему месяцу 2021 г., %	в % к показателю численности занятого в экономике населения	млн человек	прирост к соответствующему месяцу 2021 г., %	в % к показателю численности занятого в экономике населения
Январь 2022	72,5	2,5	3,2	-24,9	4,5	3,2	-26,4	4,4
Февраль 2022	72,8	2,8	3,2	-24,1	4,4	3,2	-24,9	4,4
Март 2022	72,8	2,5	3,2	-22,8	4,3	3,1	-23,3	4,3
Апрель 2022	73,2	2,8	3,1	-19,9	4,3	3,2	-18,4	4,4
Май 2022	73,4	2,5	3,1	-17,3	4,2	3,2	-14,3	4,4
Июнь 2022	73,7	2,8	3,0	-15,8	4,1	3,2	-12,1	4,3
Справочно: фактические значения за аналогичный период 2021 г., млн человек								
Январь 2021	70,7					4,3		
Февраль 2021	70,8					4,2		
Март 2021	71					4,1		
Апрель 2021	71,2					3,9		
Май 2021	71,6					3,7		
Июнь 2021	71,7					3,6		

Примечание. На интервале с января 1999 г. по октябрь 2021 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.

Согласно прогнозам по ARIMA моделям (см. табл. 13), в январе-июне 2022 г. рост численности занятых в экономике в среднем составит 2,7% в месяц по отношению к соответствующему периоду предыдущего года.

Среднее сокращение показателя общей численности безработных прогнозируется на уровне 20,4% в месяц по сравнению с аналогичным периодом прошлого года.

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 октябрь 2021 г.

³ Например, таким расхождением можно считать одновременное уменьшение и 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.

ПРИЛОЖЕНИЕ 1

Сводная таблица модельных расчетов краткосрочных прогнозов социально-экономических показателей РФ

	2021			2022					
	Октябрь	Ноябрь	Декабрь	Январь	Февраль	Март	Апрель	Май	Июнь
ИПП Росстата (прирост, %)*	7,1	5,7	1,7	6,4	5,8	3,7	3,1	3,2	3,9
ИПП НИУ ВШЭ (прирост, %)*	7,0	7,4	6,4	6,6	4,5	3,4	3,0	3,2	4,0
ИПП в добыче полезных ископаемых Росстата (прирост, %)*	10,9	11,7	10,1	11,8	12,4	9,4	8,0	7,6	7,1
ИПП в добыче полезных ископаемых НИУ ВШЭ (прирост, %)*	10,5	9,6	9,2	11,4	12,6	9,9	8,6	1,9	1,6
ИПП в обрабатывающих производствах Росстата (прирост, %)*	4,5	3,3	0,1	5,7	5,5	2,5	3,4	4,2	4,1
ИПП в обрабатывающих производствах НИУ ВШЭ (прирост, %)*	4,0	6,5	2,6	3,6	2,7	1,8	4,4	6,0	3,5
ИПП в производстве и распределении электроэнергии, газа и воды Росстата (прирост, %)*	8,0	5,4	-0,8	-0,9	-4,0	-4,4	-3,2	-3,2	-2,9
ИПП в производстве и распределении электроэнергии, газа и воды НИУ ВШЭ (прирост, %)*	7,9	2,2	-1,0	-2,2	-4,9	-3,7	-1,2	-1,8	-1,2
ИПП в производстве пищевых продуктов Росстата (прирост, %)*	2,0	3,0	2,4	3,6	3,0	1,5	1,6	1,7	2,3
ИПП в производстве пищевых продуктов НИУ ВШЭ (прирост, %)*	1,0	6,2	4,5	3,9	3,6	1,6	0,9	2,1	3,3
ИПП в производстве кокса и нефтепродуктов Росстата (прирост, %)*	11,9	7,6	6,5	7,9	7,4	2,5	0,0	3,7	5,9
ИПП в производстве кокса и нефтепродуктов НИУ ВШЭ (прирост, %)*	17,2	8,8	10,3	9,5	7,9	4,4	3,5	5,4	8,2
ИПП в металлургическом производстве и производстве готовых металлических изделий Росстата (прирост, %)*	0,0	2,5	3,0	2,7	3,4	2,8	2,7	2,6	1,9
ИПП в металлургическом производстве и производстве готовых металлических изделий НИУ ВШЭ (прирост, %)*	0,0	7,2	4,3	1,3	2,6	0,6	3,2	1,1	-1,7
ИПП в производстве машин и оборудования Росстата (прирост, %)*	17,2	7,2	1,3	23,6	10,2	5,5	4,1	9,7	3,0
ИПП в производстве машин и оборудования НИУ ВШЭ (прирост, %)*	8,8	-8,5	0,3	11,3	3,5	0,6	4,0	15,5	3,0
Розничный товарооборот, трлн руб.	3,39	3,46	4,18	3,21	3,17	3,45	3,30	3,39	3,49
Реальный розничный товарооборот (прирост, %)*	5,6	4,1	5,6	-1,7	1,7	3,9	2,6	1,9	2,1
Экспорт (млрд долл.)	46,8	48,3	54,4	41,1	46,7	50,6	49,3	48,2	47,4
Экспорт в страны, дальнего зарубежья (млрд долл.)	40,5	42,5	46,4	36,1	41,4	45,4	44,8	42,8	44,1
Импорт (млрд долл.)	26,9	27,8	30,6	20,8	25,1	27,7	27,0	26,9	26,5
Импорт из стран дальнего зарубежья (млрд долл.)	24,0	24,3	27,0	22,1	24,5	25,7	25,1	24,1	25,8
ИПЦ (прирост, %)**	1,1	0,9	0,8	0,9	0,7	0,7	0,6	0,6	0,6
ИЦП промышленных товаров (прирост, %)**	0,4	1,4	1,5	1,1	1,4	1,4	1,3	1,4	1,3
ИЦП в добыче полезных ископаемых (прирост, %)**	1,4	3,1	-0,7	2,3	1,1	1,7	0,4	1,1	-0,1
ИЦП в обрабатывающих производствах (прирост, %)**	0,2	0,4	1,1	1,7	2,0	1,5	0,9	1,2	1,3
ИЦП в производстве и распределении электроэнергии, газа и воды (прирост, %)**	0,0	-1,2	0,4	0,6	1,5	1,7	-0,5	1,0	-1,4
ИЦП в производстве пищевых продуктов (прирост, %)**	1,7	1,6	1,5	1,5	1,6	1,5	1,4	1,4	1,3
ИЦП в текстильном и швейном производстве (прирост, %)**	2,3	1,1	1,6	1,4	1,5	1,4	1,6	1,8	1,6
ИЦП в обработке древесины и производстве изделий из дерева (прирост, %)**	2,8	2,6	2,4	2,3	2,9	2,5	2,8	2,7	2,5
ИЦП в целлюлозно-бумажном производстве (прирост, %)**	-1,1	0,9	1,6	1,8	2,2	2,4	3,1	3,4	2,7
ИЦП в производстве кокса и нефтепродуктов (прирост, %)**	2,7	3,1	-1,6	-1,8	2,3	2,4	2,4	2,4	2,4

ИЦП в химическом производстве (прирост, %)**	1,7	2,0	1,5	2,6	2,1	1,7	1,4	1,0	0,8
ИЦП в металлургическом производстве и производстве готовых металлических изделий (прирост, %)**	-6,8	-3,5	-1,1	-1,1	-0,4	1,6	1,7	1,9	1,1
ИЦП в производстве машин и оборудования (прирост, %)**	1,5	0,9	1,0	2,1	1,0	1,0	0,9	0,9	0,8
ИЦП в производстве транспортных средств и оборудования (прирост, %)**	0,6	0,3	1,1	1,4	1,0	1,4	1,1	1,0	1,5
Стоимость минимального набора продуктов питания (на одного человека в месяц), тыс. руб.	4,89	5,03	5,37	5,39	5,43	5,46	5,59	5,61	5,62
Индекс тарифов на грузовые перевозки автомобильным транспортом (прирост, %)**	0,2	0	-0,1	1,4	-0,1	-0,1	-0,1	-0,1	-0,2
Индекс тарифов на трубопроводный транспорт (прирост, %)**	-2,1	-0,9	-1	-0,8	-1,1	-1	2,7	2,7	2,7
Сводный индекс транспортных тарифов на грузовые перевозки (прирост, %)**	-1,6	0	0	0	0	0	3,7	-0,1	-0,1
Цена на нефть марки Brent (долл./барр.)	84,4	70,6	71,7	68,4	65,5	65,9	64,4	64,5	64,2
Цена на алюминий (тыс. долл./т)	2,72	2,63	2,64	2,60	2,51	2,51	2,54	2,51	2,51
Цена на золото (тыс. долл./унц.)	1,78	1,82	1,83	1,84	1,85	1,86	1,88	1,89	1,90
Цена на медь (тыс. долл./т)	9,50	9,44	9,51	9,48	9,48	9,40	9,38	9,36	9,44
Цена на никель (тыс. долл./т)	19,4	19,9	19,6	19,2	19,7	19,9	20,2	20,2	20,2
Денежная база (трлн руб.)	14,3	14,3	14,2	14,7	14,4	14,6	14,6	14,8	14,9
M ₂ (трлн руб.)	60,6	60,8	61,2	62,4	62,2	62,4	62,2	62,4	62,2
Международные резервы (млрд долл.)	0,61	0,62	0,62	0,62	0,62	0,63	0,63	0,63	0,64
Обменный курс RUR/USD (руб. за доллар США)	70,52	74,44	74,84	77,52	77,80	78,57	78,52	79,05	79,18
Обменный курс USD/EUR (долл. США за евро)	1,16	1,13	1,13	1,12	1,12	1,12	1,12	1,12	1,12
Реальная заработная плата (прирост, %)*	0,6	3,4	3,9	4,5	4,8	5,2	5,5	5,7	5,9
Численность занятого в экономике населения (млн человек)	72,3	72,5	72,8	72,5	72,8	72,8	73,2	73,4	73,7
Общая численность безработных (млн человек)	3,3	3,3	3,2	3,2	3,2	3,2	3,2	3,2	3,1

Примечание. Жирным шрифтом выделены фактические значения показателей; * % к соответствующему месяцу предыдущего года; ** % к предыдущему месяцу.

ПРИЛОЖЕНИЕ 2

Графики временных рядов экономических показателей РФ: фактические и прогнозные значения

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

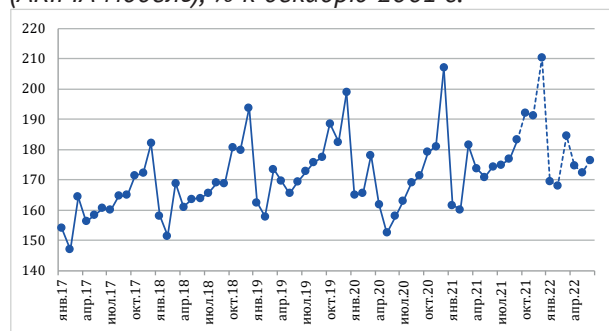


Рис. 1б. Индекс промышленного производства НИУ ВШЭ (ARIMA-модель), % к январю 2010 г.

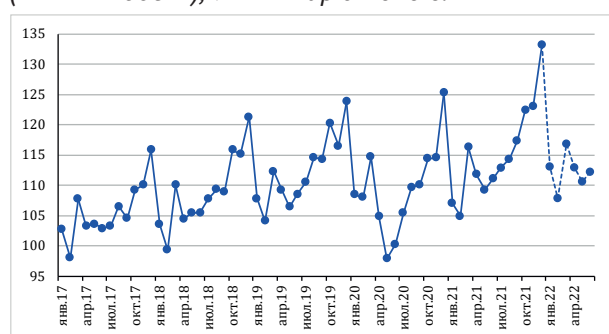


Рис. 2а. ИПП в добыче полезных ископаемых Росстата, % к декабрю 2001 г.

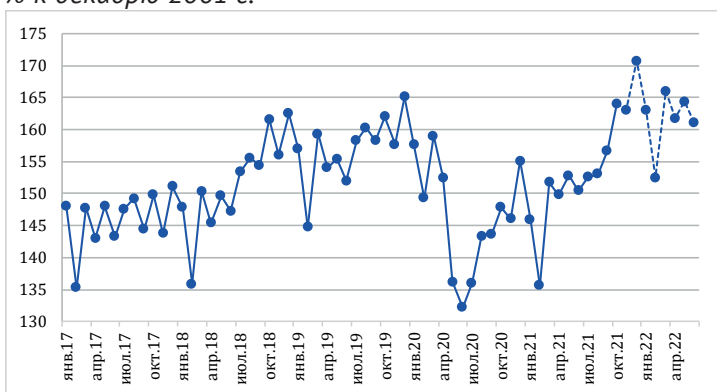


Рис. 2б. ИПП в добыче полезных ископаемых НИУ ВШЭ, % к январю 2010 г.

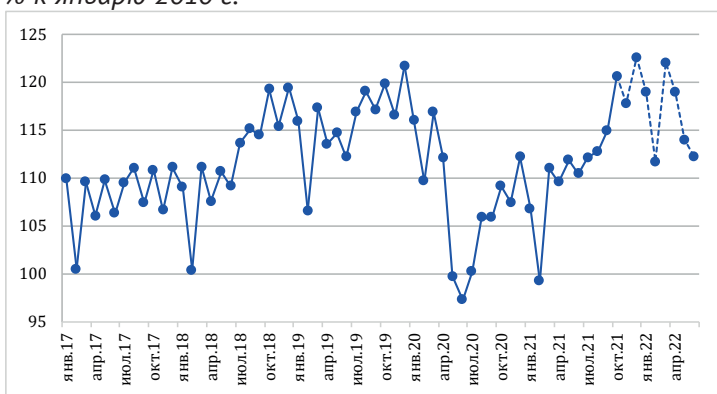


Рис. 3а. ИПП в обрабатывающих производствах Росстата, % к декабрю 2001 г.

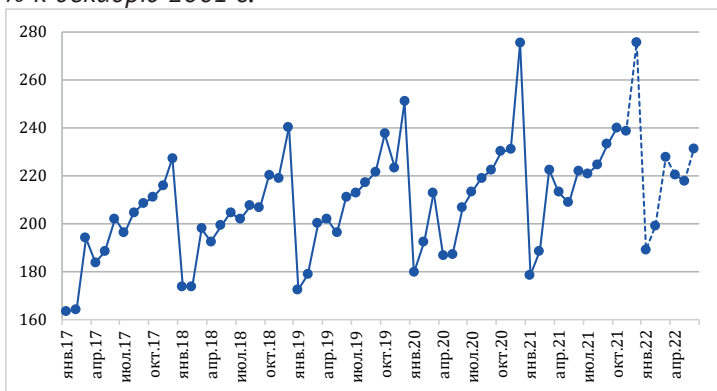


Рис. 3б. ИПП в обрабатывающих производствах НИУ ВШЭ, % к январю 2010 г.

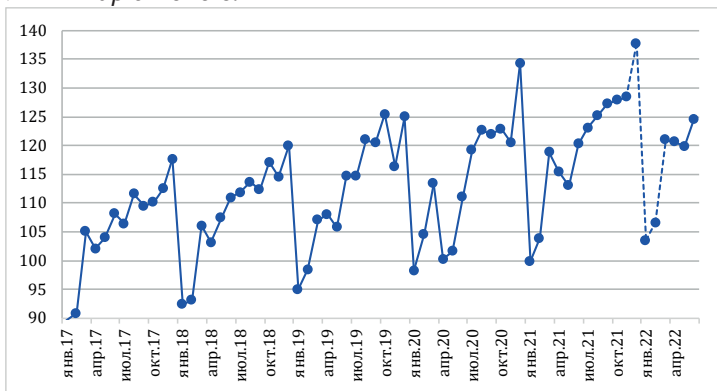


Рис. 4а. ИПП в обеспечении электрической энергией, газом и паром; кондиционировании воздуха Росстата, % к декабрю 2001 г.

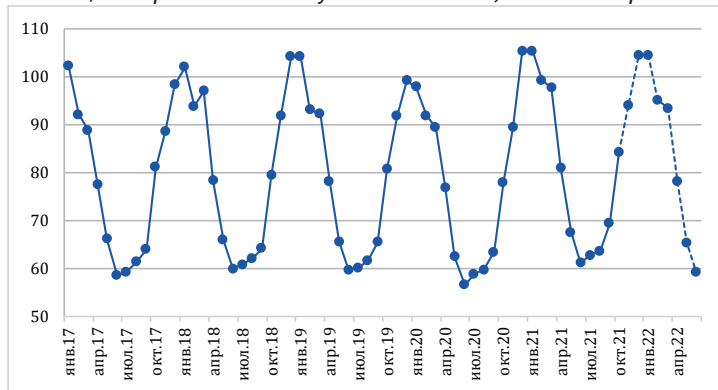


Рис. 4б. ИПП в обеспечении электрической энергией, газом и паром; кондиционировании воздуха НИУ ВШЭ, % к январю 2010 г.

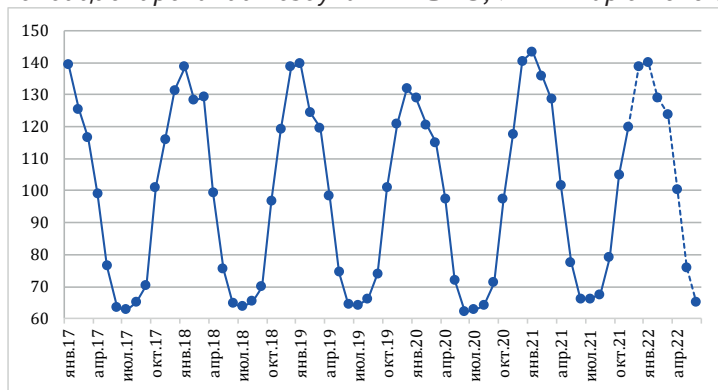


Рис. 5а. ИПП в производстве пищевых продуктов Росстата, % к декабрю 2001 г.

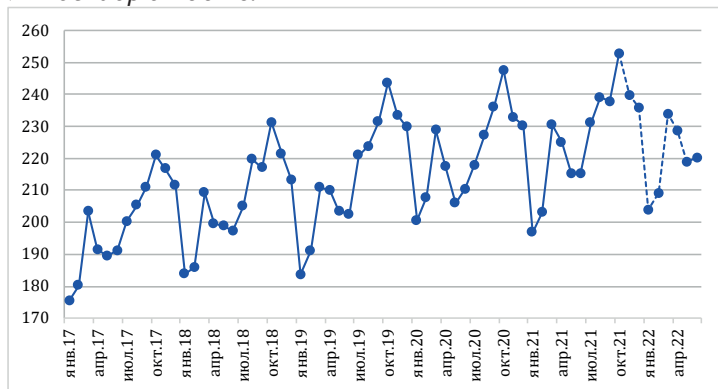


Рис. 5б. ИПП в производстве пищевых продуктов НИУ ВШЭ, % к январю 2010 г.

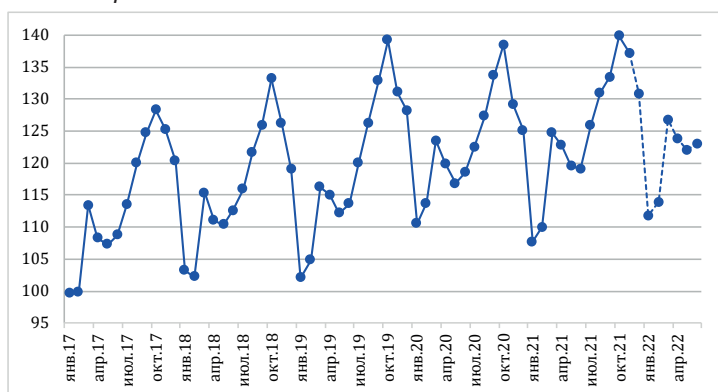


Рис. 6а. ИПП в производстве кокса и нефтепродуктов Росстата, % к декабрю 2001 г.

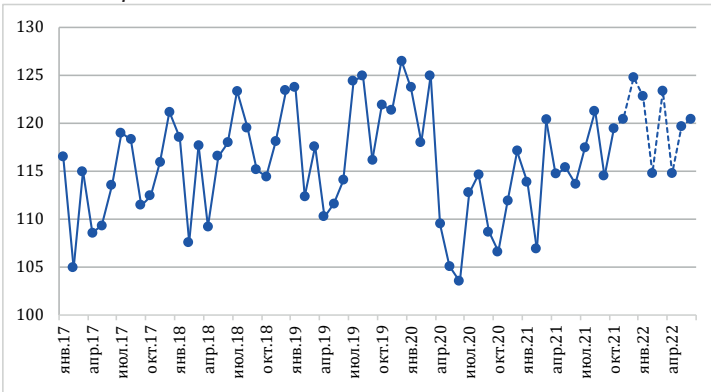


Рис. 6б. ИПП в производстве кокса и нефтепродуктов НИУ ВШЭ, % к январю 2010 г.

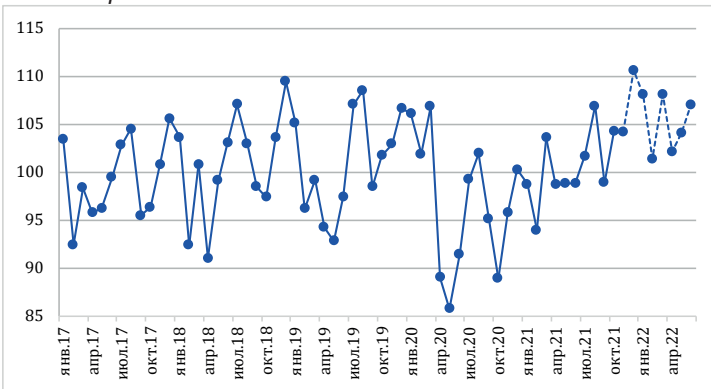


Рис. 7а. ИПП в металлургическом производстве и производстве готовых металлических изделий Росстата, % к декабрю 2001 г.

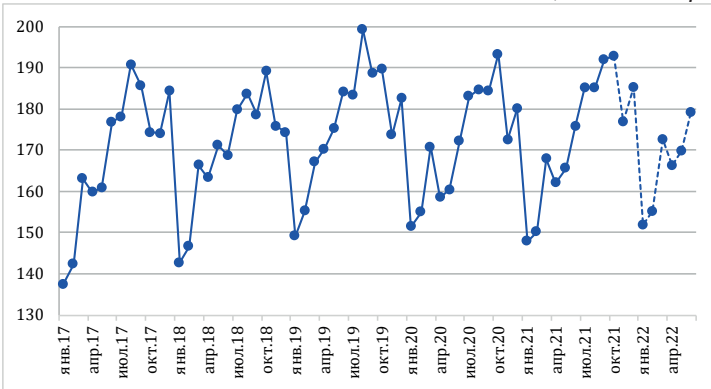


Рис. 7б. ИПП в металлургическом производстве и производстве готовых металлических изделий НИУ ВШЭ, % к январю 2010 г.

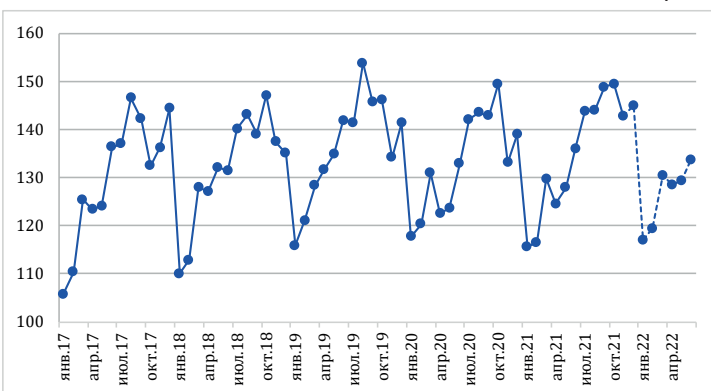


Рис. 8а. ИПП в производстве машин и оборудования Росстата, % к декабрю 2001 г.

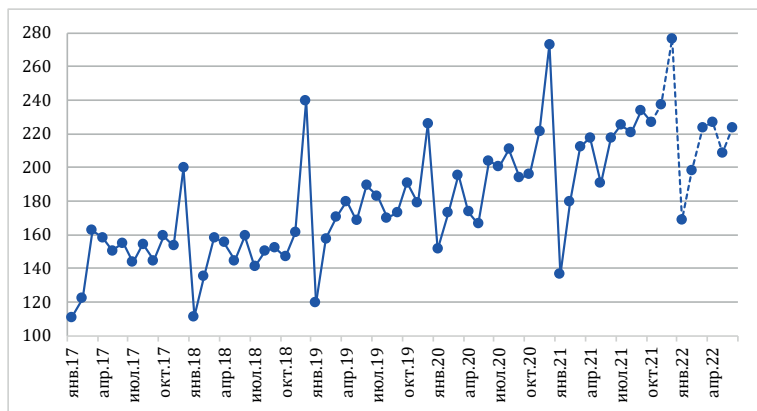


Рис. 8б. ИПП в производстве машин и оборудования НИУ ВШЭ, % к январю 2010 г.

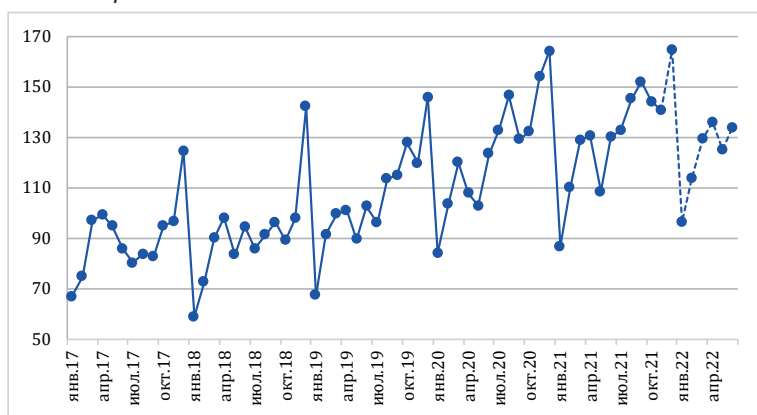


Рис. 9. Оборот розничной торговли, млрд руб.

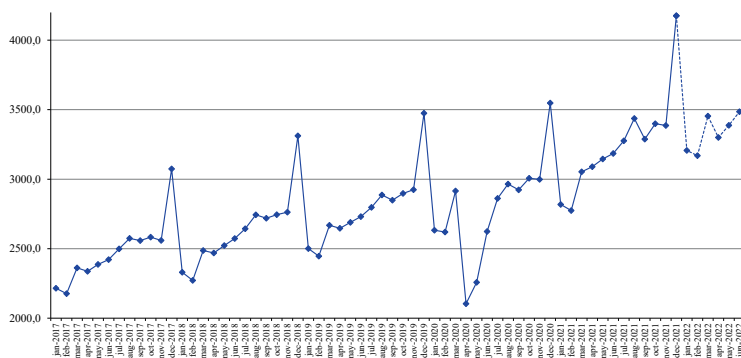


Рис. 9а. Реальный оборот розничной торговли, % к соответствующему периоду прошлого года

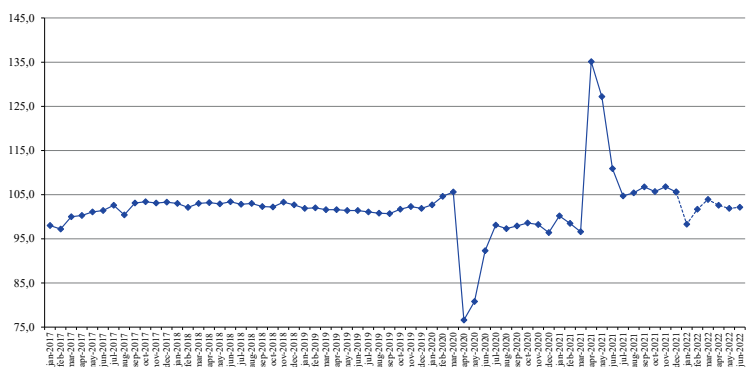


Рис. 10. Экспорт во все страны, млрд долл.

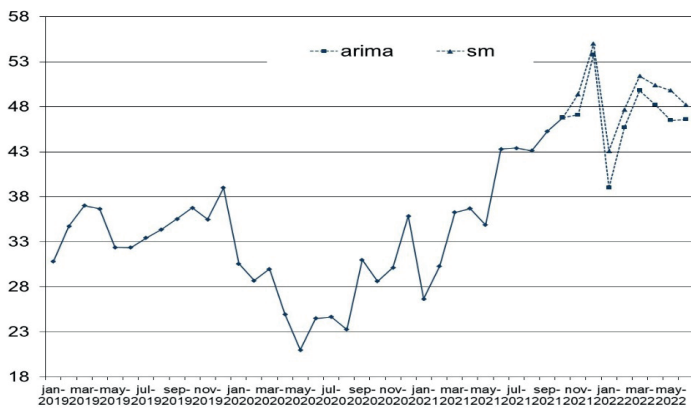


Рис. 11. Экспорт в страны вне СНГ, млрд долл.

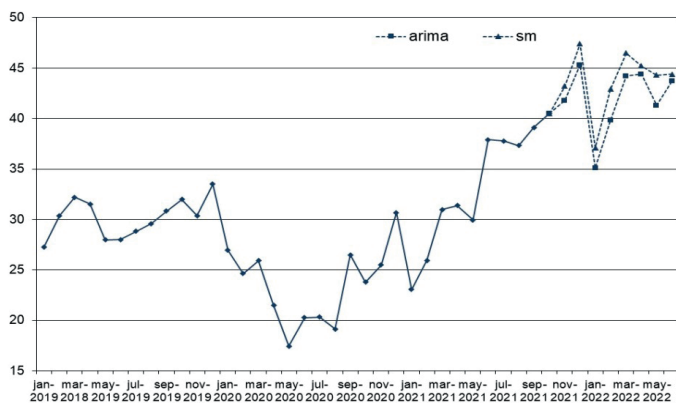


Рис. 12. Импорт из всех стран, млрд долл.

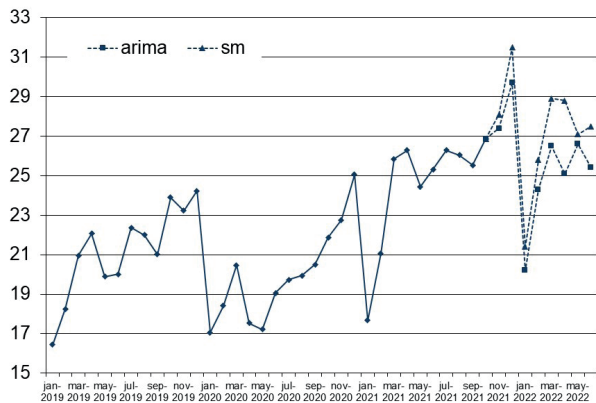


Рис. 13. Импорт из стран вне СНГ, млрд долл.

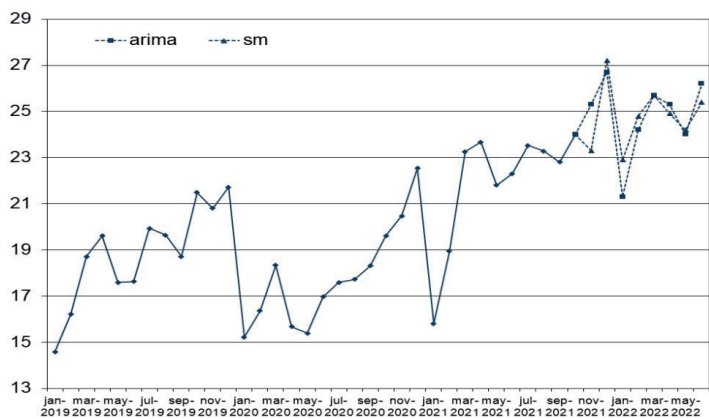


Рис. 14. Индекс потребительских цен, % к декабрю предыдущего года

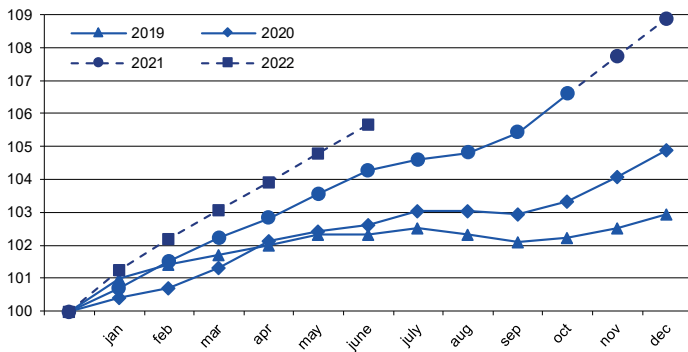


Рис. 14а. Индекс потребительских цен, % к декабрю предыдущего года (SM)

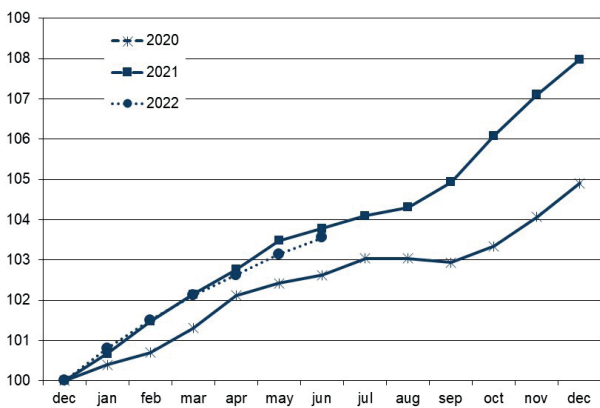


Рис. 15. Индекс цен производителей промышленных товаров, % к декабрю предыдущего года

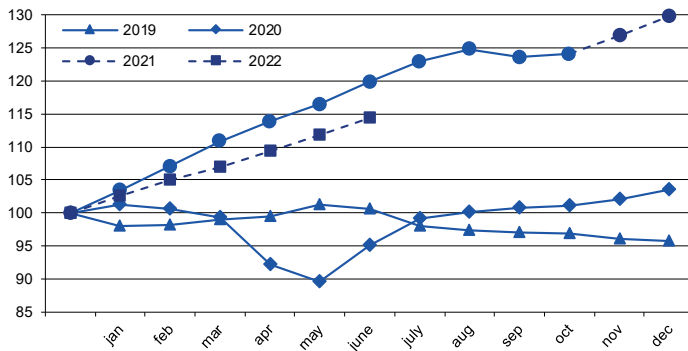


Рис. 16. Индекс цен в добыче полезных ископаемых, % к декабрю предыдущего года

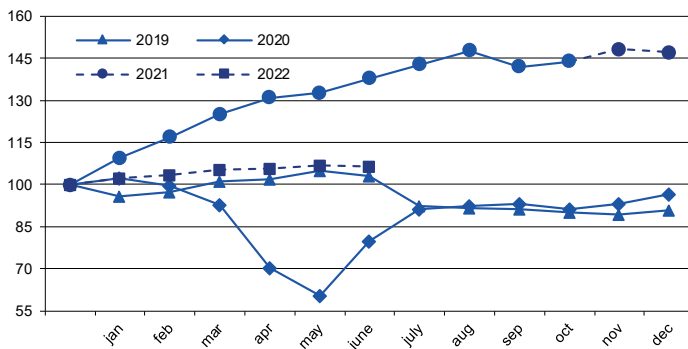


Рис. 17. Индекс цен в обрабатывающих производствах, % к декабрю предыдущего года

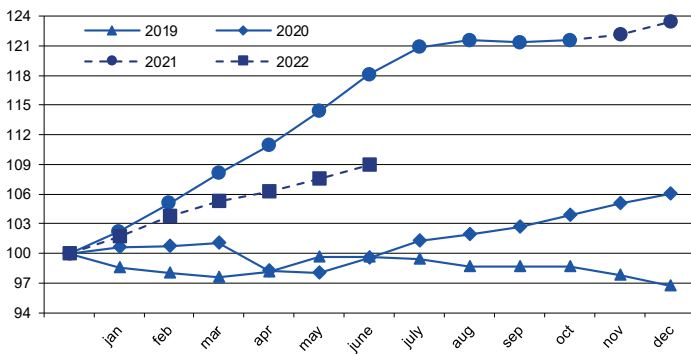


Рис. 18. Индекс цен в обеспечении электрической энергией, газом и паром, % к декабрю предыдущего года

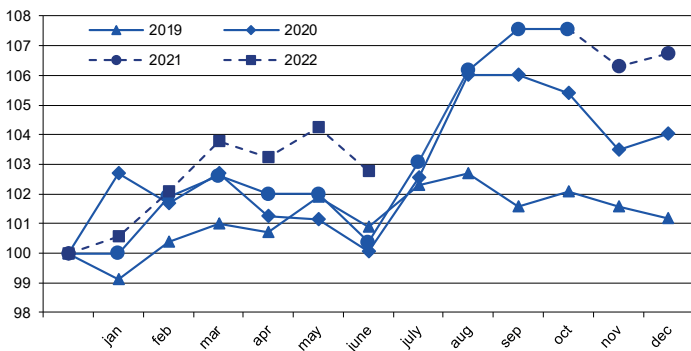


Рис. 19. Индекс цен в производстве пищевых продуктов, % к декабрю предыдущего года

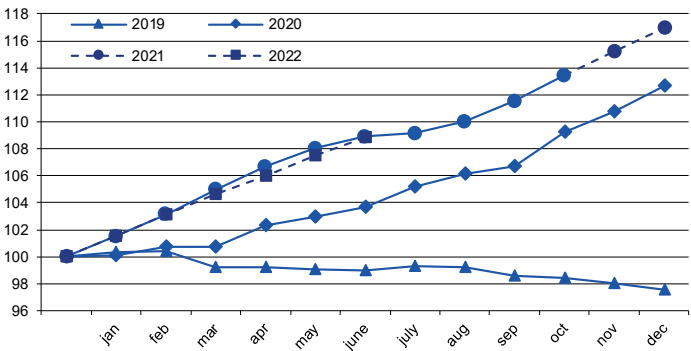


Рис. 20. Индекс цен в производстве текстильных изделий, % к декабрю предыдущего года

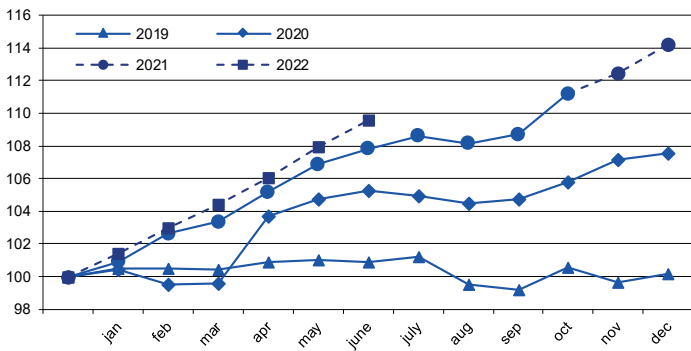


Рис. 21. Индекс цен в обработке древесины и производстве изделий из дерева, % к декабрю предыдущего года

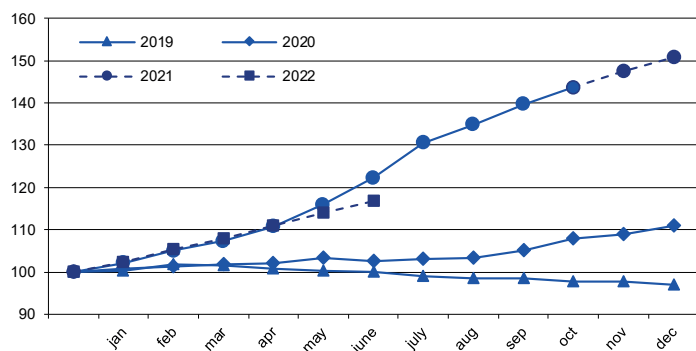


Рис. 22. Индекс цен в производстве бумаги и бумажных изделий, % к декабрю предыдущего года

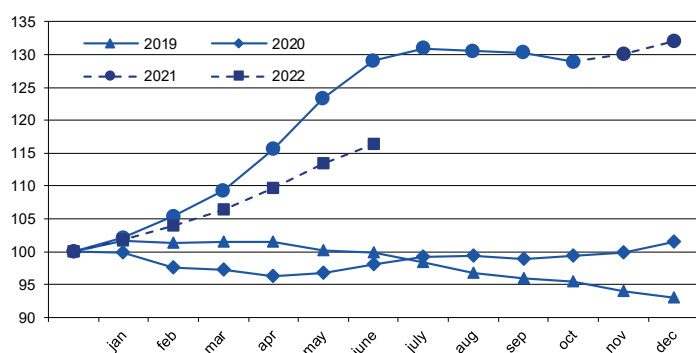


Рис. 23. Индекс цен в производстве кокса и нефтепродуктов, % к декабрю предыдущего года

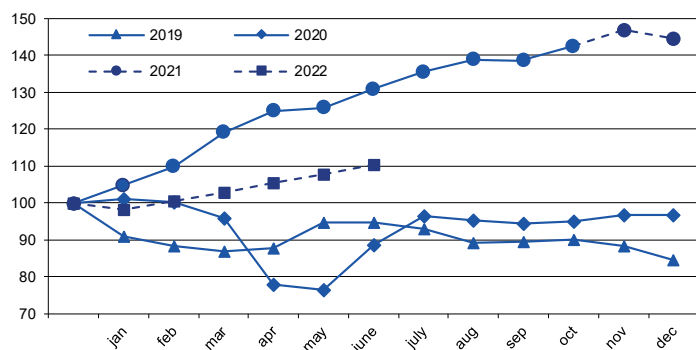


Рис. 24. Индекс цен в химическом производстве, % к декабрю предыдущего года

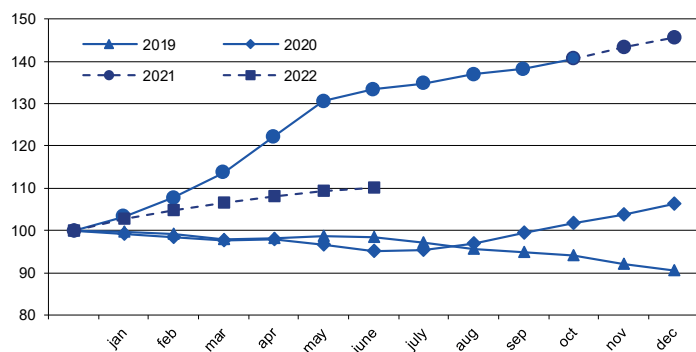


Рис. 25. Индекс цен в металлургическом производстве и производстве готовых металлических изделий, % к декабрю предыдущего года

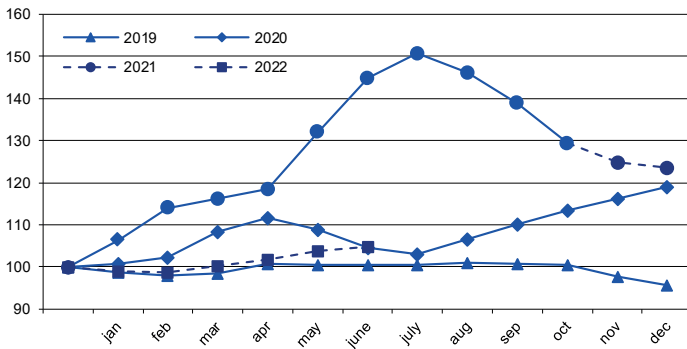


Рис. 26. Индекс цен в производстве машин и оборудования, % к декабрю предыдущего года

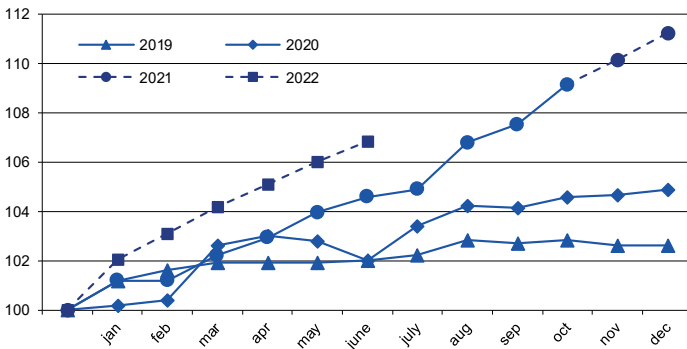


Рис. 27. Индекс цен в производстве автотранспортных средств и оборудования, % к декабрю предыдущего года

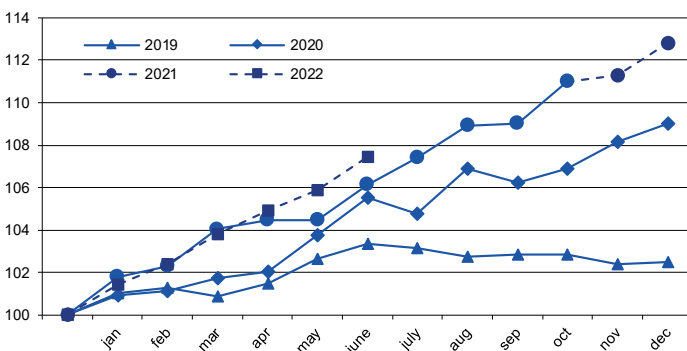


Рис. 28. Стоимость минимального набора продуктов питания на одного человека в месяц, руб.

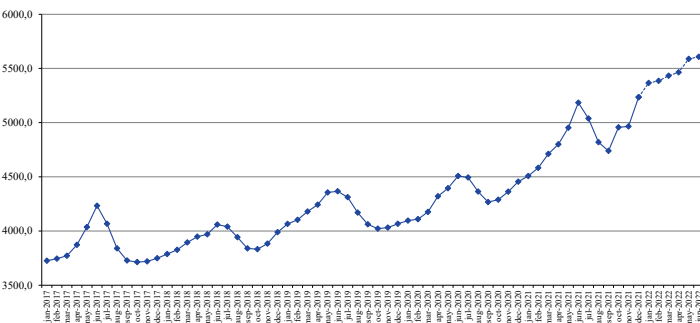


Рис. 29. Сводный индекс транспортных тарифов, для каждого года, % к предыдущему месяцу

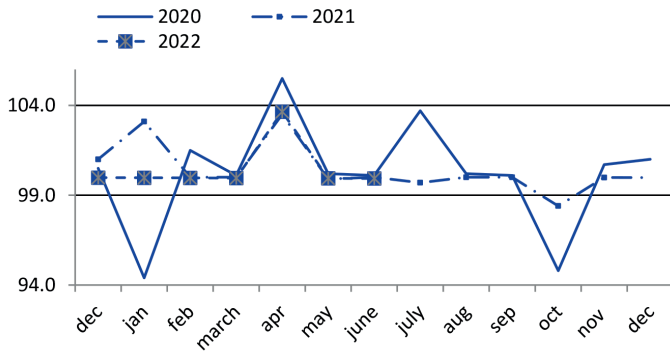


Рис. 30. Индекс тарифов на грузовые перевозки автомобильным транспортом, для каждого года, % к предыдущему месяцу

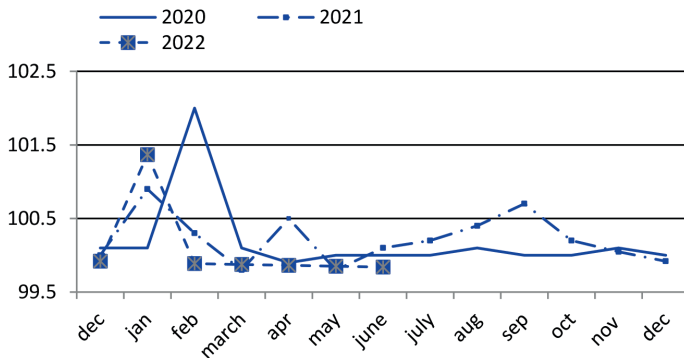


Рис. 31. Индекс тарифов на трубопроводный транспорт, для каждого года, % к предыдущему месяцу

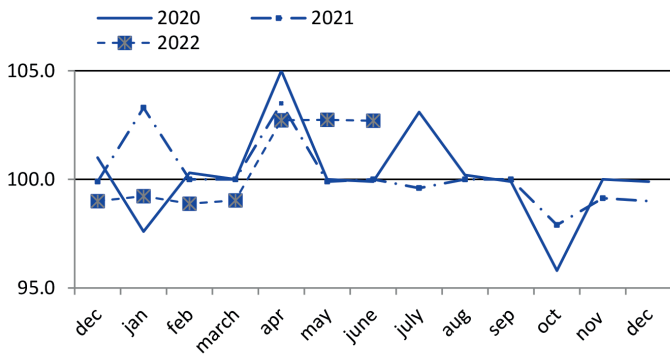


Рис. 32. Цена на нефть марки Brent, долл./барр.

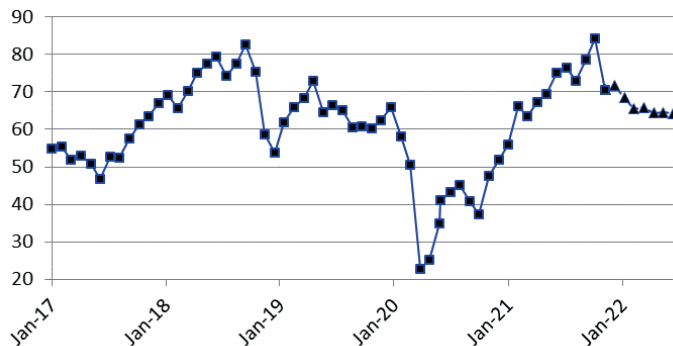


Рис. 33. Цены на алюминий, долл./т

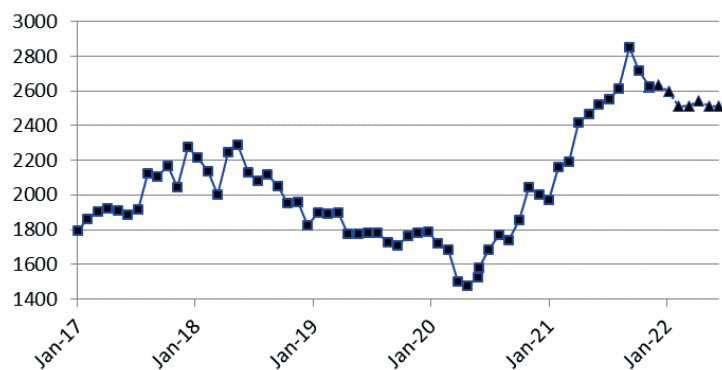


Рис. 34. Цены на золото, долл./унц.

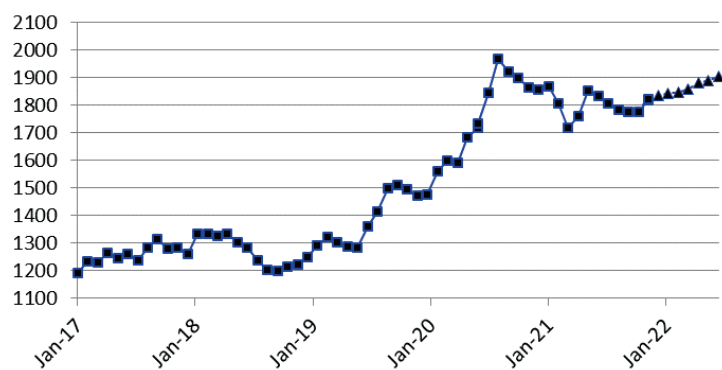


Рис. 35. Цены на никель, долл./т

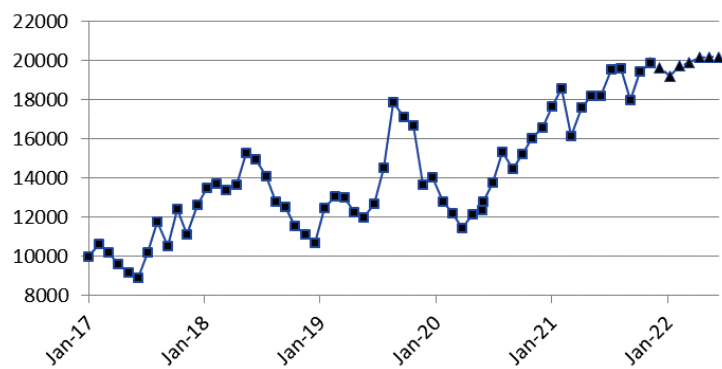


Рис. 36. Цены на медь, долл./т

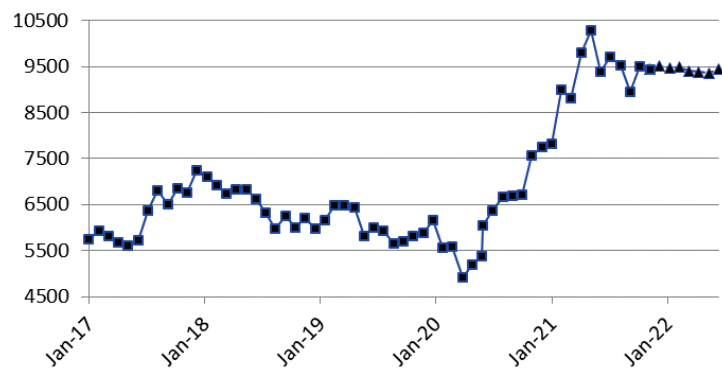


Рис. 37. Денежная база, млрд руб.

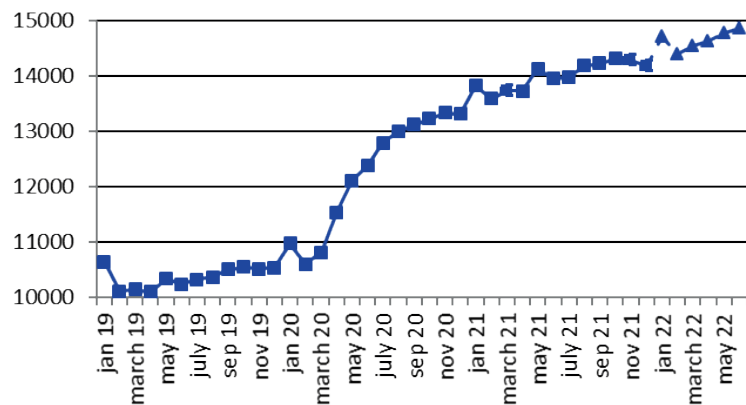


Рис. 38. M_2 , млрд руб.

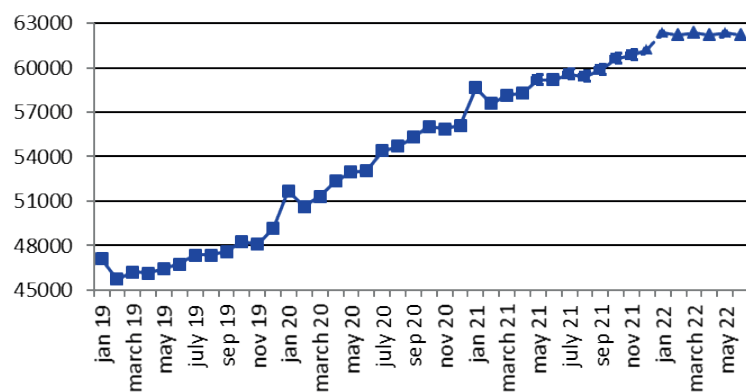


Рис. 39. Международные резервы РФ, млн долл.

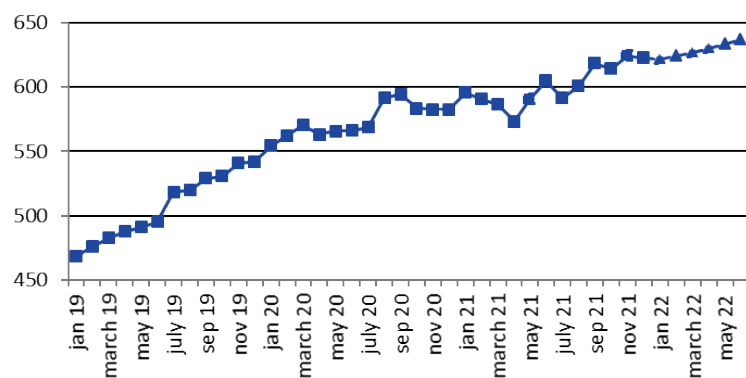


Рис. 40. Курс RUR/USD

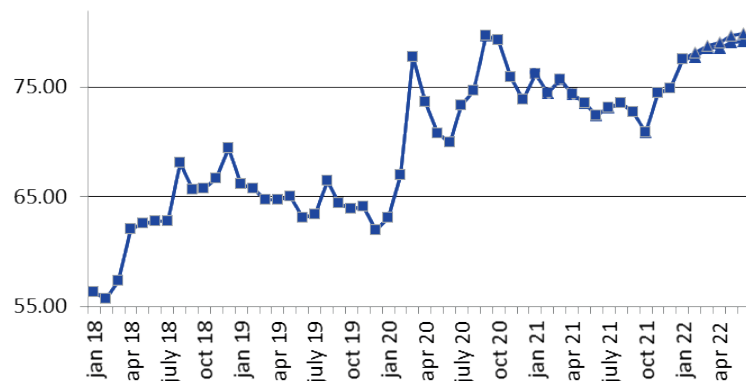


Рис. 41. Курс USD/EUR

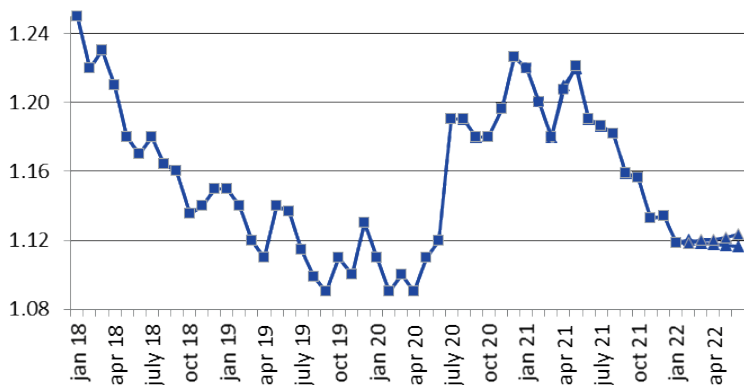


Рис. 42. Реальная начисленная заработная плата, % к соответствующему периоду предыдущего года

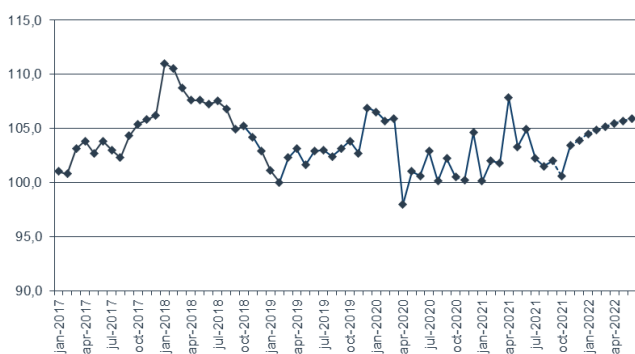


Рис. 43. Реальные располагаемые денежные доходы, % к соответствующему периоду предыдущего года

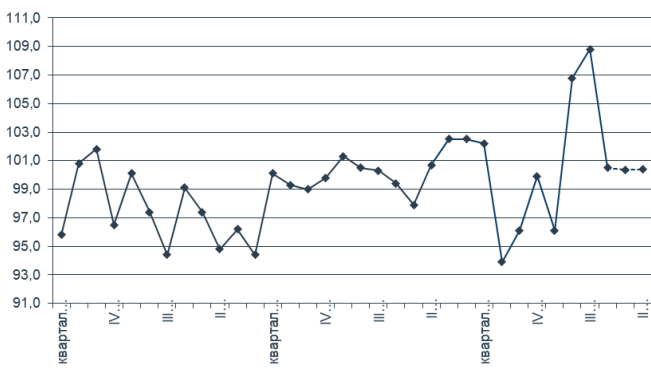


Рис. 44. Реальные денежные доходы, % к соответствующему периоду предыдущего года

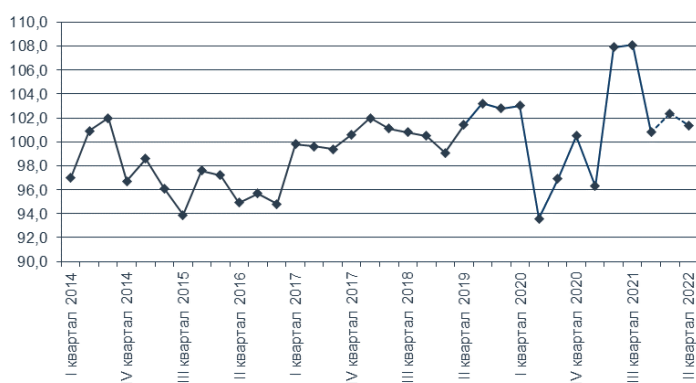


Рис. 45. Численность занятого в экономике населения, млн человек

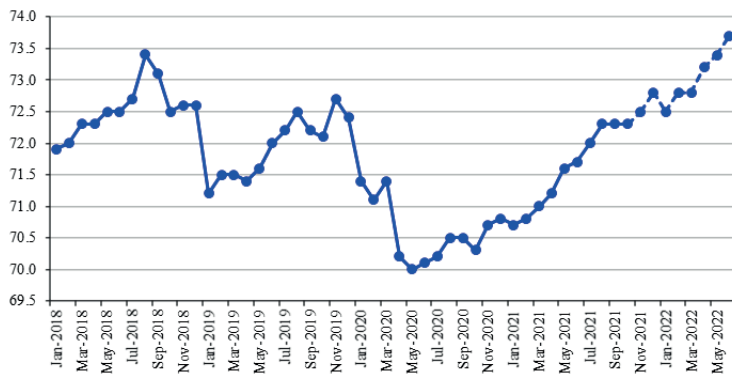
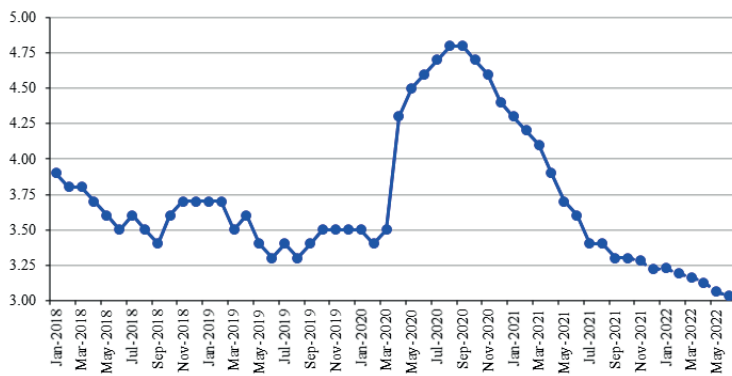


Рис. 46. Общая численность безработных, млн человек



ОЦЕНКА КАЧЕСТВА КРАТКОСРОЧНЫХ ПРОГНОЗОВ ИНДЕКСОВ ПРОМЫШЛЕННОГО ПРОИЗВОДСТВА РОССТАТА (АПРЕЛЬ 2009 Г. – ОКТЯБРЬ 2021 Г.)

Е. Астафьева, с.н. с., РАНХиГС,

М. Турунцева, зав. лабораторией, ИЭП им. Е.Т. Гайдара, РАНХиГС

В статье приводятся результаты анализа качественных свойств прогнозов индексов промышленного производства (ИПП) Росстата, ежемесячно публикуемых Институтом экономической политики имени Е.Т. Гайдара в «Научном вестнике ИЭП им. Гайдара.ру»¹ (далее – «прогнозы ИЭП»). Мы рассматриваем простейшие статистики (MAPE, MAE, RMSE) как прогнозов ИЭП, так и альтернативных прогнозов (наивных; наивных сезонных и прогнозов, построенных с использованием скользящего среднего). Помимо сравнительного анализа на основе простейших статистик качества мы также исследуем отсутствие значимых отличий между прогнозами ИЭП и альтернативными прогнозами на основе теста знаков².

Оценки качества прогнозов рассматриваемых показателей построены для массива данных, который охватывает период с апреля 2009 г. по октябрь 2021 г. Поскольку официальная статистика предоставляется с 2-месячным запаздыванием, публикуемые прогнозы представляют собой ожидаемые в соответствии с моделями значения показателей на 3–8 месяцев (а не 1–6 месяцев) вперед. В общей сложности массив прогнозов состоит из 906 точек (151 прогнозного месяца; по 6 прогнозов для каждого месяца). Результаты анализа представлены в *табл. 1*.

Средняя абсолютная процентная ошибка ARIMA-прогнозирования индекса промышленного производства Росстата составляет 2,6% (см. *табл. 1*). В рассматриваемом периоде прогнозы ИЭП, полученные по моделям временных рядов, превосходят по качественным характеристикам все простейшие прогнозы, и на основании теста знаков во всех случаях гипотеза об отсутствии значимых различий отвергается.

Для прогнозов по моделям, оцененным с использованием результатов конъюнктурных опросов (КО-прогнозов), ошибка составляет 2,3%. На основании теста знаков КО-прогнозы ИПП также лучше всех простейших прогнозов. При сравнении прогнозов ИЭП (ARIMA и КО) значение соответствующей тестовой статистики составляет (4,65), так что гипотеза об отсутствии значимых различий между ними отвергается.

В соответствии с оценками качественных характеристик прогнозов индекса промышленного производства Росстата по месяцам, начиная с ноября 2010 г. по март 2020 г. (см. *рис. 1*), расхождения между прогнозами ИЭП и истинными значениями данного показателя в абсолютном процентном выражении не превосходят 5%. В мае-октябре 2021 г. среднемесячная абсолютная процентная ошибка прогнозирования по ARIMA-моделям составляет в среднем 2,4%, по КО-моделям – 1,5%. В эти полгода средняя абсолютная процентная ошибка наивных прогнозов составляет 7,5%, наивных сезонных прогнозов – 12,8%, скользящего среднего – 9,5%. В связи с этим и в последние 6 месяцев лучшими следует признать прогнозы, полученные с использованием результатов конъюнктурных опросов.

¹ См.: http://www.iep.ru/index.php?option=com_bibiet&Itemid=124&catid=123&lang=ru&task=showallbib. С ноября 2003 г. по июль 2012 г. – «Бюллетень модельных расчетов краткосрочных прогнозов социально-экономических показателей РФ»; с августа по декабрь 2012 г. – Бюллетень «Модельные расчеты краткосрочных прогнозов социально-экономических показателей РФ»; с января 2013 г. – регулярный раздел «Научного вестника ИЭП им. Гайдара.ру»: <http://www.iep.ru/ru/ob-izdanii.html>

² Методика анализа сравнительного качества прогнозов подробно описана в работе: Турунцева М.Ю., Киблицкая Т.Р. Качественные свойства различных подходов к прогнозированию социально-экономических показателей РФ. Научные труды № 135Р. М.: ИЭПП, 2010.

Таблица 1

Простейшие статистики качества прогнозов и результаты теста знаков

		Индекс промышленного производства	Индекс промышленного производства (КО)	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
Прогнозы ИЭП	MAPE	2.62%	2.26%	2.56%	3.76%	3.22%	2.53%	3.41%	5.68%	12.19%
	MAE	2.64	2.28	2.56	3.82	3.24	2.63	3.45	5.80	12.31
	RMSE	3.59	3.27	3.71	5.13	4.11	3.27	4.37	7.98	16.38
Наивные прогнозы	MAPE	3.62%	3.62%	2.97%	4.98%	4.10%	3.20%	4.06%	7.19%	12.20%
	MAE	3.69	3.69	3.00	5.13	4.15	3.31	4.12	7.42	12.31
	RMSE	5.65	5.65	4.89	7.62	5.50	4.14	5.55	10.42	16.52
	Z	-4.19	-9.77	-0.73	-4.32	-4.39	-6.05	-3.06	-6.05	-0.93
		отв	отв	не отв	отв	отв	отв	отв	отв	не отв
Наивные сезонные прогнозы	MAPE	5.40%	5.40%	4.05%	7.16%	5.25%	3.60%	5.31%	9.37%	15.70%
	MAE	5.47	5.47	4.11	7.26	5.30	3.71	5.38	9.65	15.19
	RMSE	8.23	8.23	6.42	10.97	6.94	4.73	6.83	14.01	21.77
	Z	-10.56	-13.36	-9.44	-11.36	-8.77	-8.11	-9.63	-9.77	-1.79
		отв	отв	отв	отв	отв	отв	отв	отв	не отв
Скользящее среднее	MAPE	4.29%	4.29%	3.20%	5.73%	3.69%	2.74%	4.03%	6.51%	12.04%
	MAE	4.36	4.36	3.23	5.84	3.74	2.83	4.08	6.72	11.79
	RMSE	6.53	6.53	5.26	8.77	4.86	3.55	5.34	10.41	16.35
	Z	-6.51	-11.43	-2.13	-6.38	-2.99	-3.32	-2.19	-1.06	-3.92
		отв	отв	отв	отв	отв	отв	отв	не отв	отв

Прогнозы ИЭП большинства рассматриваемых ИПП по видам деятельности характеризуются более низким уровнем ошибок в сравнении с простейшими методами прогнозирования (исключение составляет ИПП в производстве машин и оборудования).

В соответствии с оценками качественных характеристик у пяти индексов промышленного производства средняя абсолютная процентная ошибка прогнозирования в рассматриваемом периоде не превышает 5%: *в производстве пищевых продуктов – 2,5%, в добыче полезных ископаемых – 2,6%, в обеспечении электрической энергией, газом и паром – 3,2%, в производстве кокса и нефтепродуктов – 3,4% и в обрабатывающих производствах – 3,8%.*

При этом на основании теста знаков ARIMA-прогнозы ИПП в обрабатывающих производствах, ИПП в обеспечении электрической энергией, газом и паром, ИПП в производстве кокса и нефтепродуктов и ИПП в производстве пищевых продуктов значимо лучше всех простейших прогнозов. В случае ИПП в добыче полезных ископаемых гипотеза об отсутствии значимых различий отвергается при сравнении прогнозов ИЭП с наивными сезонными прогнозами и скользящим средним.

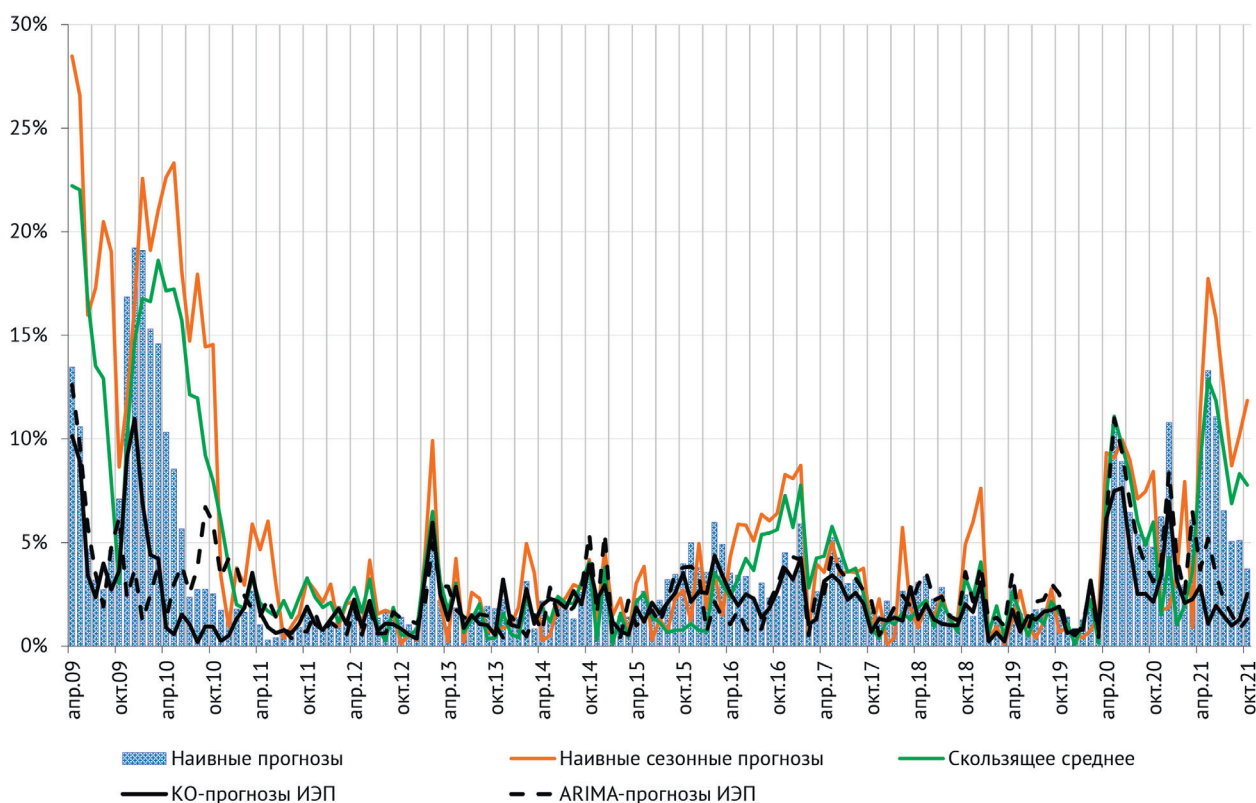


Рис. 1. Средняя абсолютная процентная ошибка прогнозирования индекса промышленного производства Росстата по месяцам

ИПП данной группы видов экономической деятельности демонстрируют достаточно высокие качественные характеристики прогнозов и по отдельным месяцам. В последние полгода рассматриваемого периода среднемесячная абсолютная процентная ошибка прогнозирования индексов промышленного производства четырех видов экономической деятельности данной группы уменьшилась и составила 1,3% в производстве пищевых продуктов, 3,0% – в производстве кокса и нефтепродуктов, 1,5% – в обрабатывающих производствах, 2,8% – в обеспечении электрической энергией, газом и паром. При этом во всех четырех случаях ARIMA-прогнозы ИПП превосходят по качеству все альтернативные методы.

ARIMA-прогнозы ИПП в добыче полезных ископаемых в последние полгода рассматриваемого периода демонстрируют увеличение среднемесячной абсолютной процентной ошибки до 5,2%. Но, несмотря на ухудшение качественных характеристик, прогнозы данного показателя, полученные по моделям временных рядов, и в мае-октябре 2021 г. остаются предпочтительнее прогнозов, полученных альтернативными методами,

В рассматриваемом периоде для ИПП в металлургическом производстве расхождения между прогнозами ИЭП и истинными значениями показателя в абсолютном процентном выражении составляют 5,7%. ARIMA-прогнозы данного индекса демонстрируют лучшие качественные характеристики в сравнении со всеми простейшими методами прогнозирования, причем на основании теста знаков в случае наивных прогнозов и наивных сезонных прогнозов гипотеза об отсутствии значимых различий отвергается.

В мае-октябре 2021 г. среднемесячная абсолютная процентная ошибка ARIMA-прогнозов ИПП в металлургическом производстве демонстрирует сокращение до уровня 2,6%. В эти полгода средняя абсолютная процентная ошибка наивных прогнозов составляет 3,1%, наивных сезонных прогнозов – 6,0%, скользящего среднего – 4,1%. Поэтому и в последние 6 месяцев рассматриваемого периода для данного показателя лучшими следует признать прогнозы ИЭП.

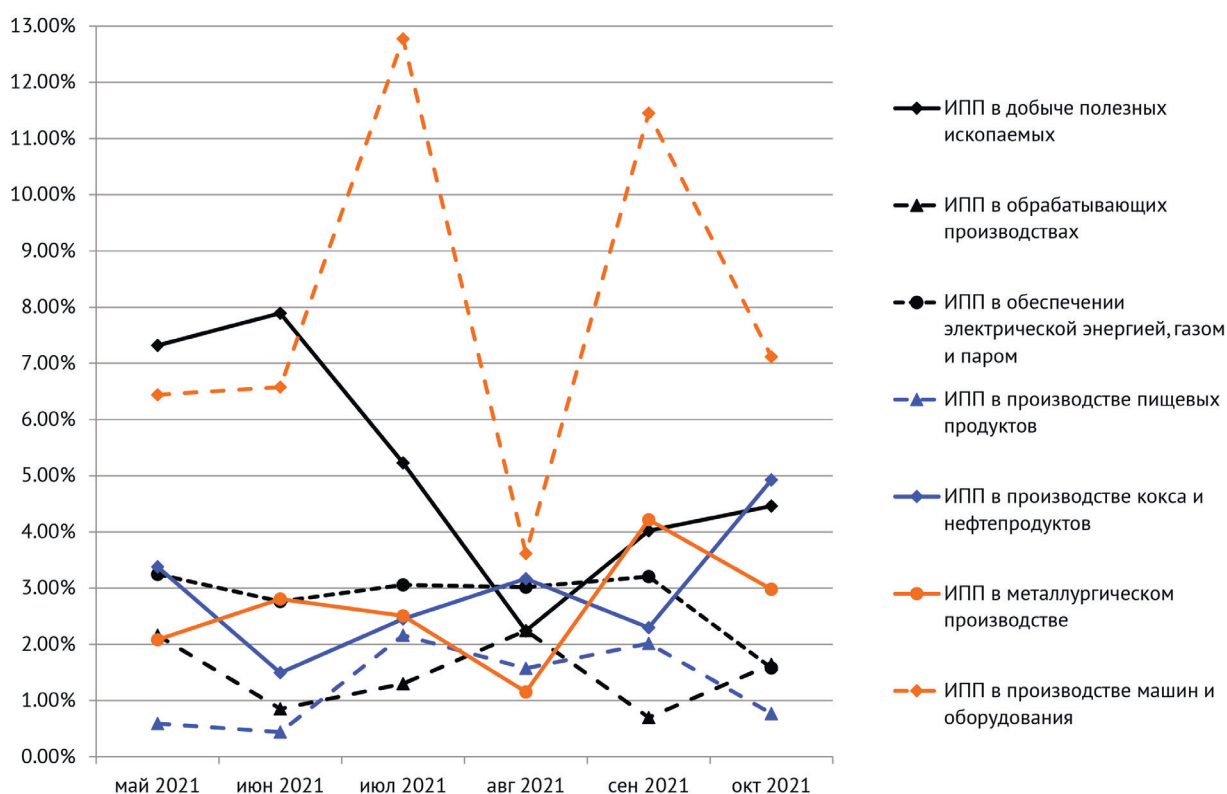


Рис. 2. Средняя абсолютная процентная ошибка прогнозирования индексов промышленного производства Росстата по видам экономической деятельности в мае-октябре 2021 г.

Самые низкие качественные характеристики прогнозов среди ИПП Росстата демонстрирует ИПП в производстве машин и оборудования. Средняя абсолютная процентная ошибка прогнозирования ИПП данного вида экономической деятельности составляет 12,2%. Несмотря на достаточно высокий уровень ошибки, следует отметить, что ARIMA-прогнозы показателя характеризуются более низким уровнем ошибки в сравнении с наивными прогнозами и наивными сезонными прогнозами. Однако минимальными расхождениями с истинными значениями ИПП в производстве машин и оборудования характеризуются прогнозы, построенные на основе скользящего среднего, причем в соответствии с тестом знаков преимущества данного метода прогнозирования значимы.

Оценки по месяцам свидетельствуют о том, что средняя абсолютная процентная ошибка ARIMA-прогнозов ИПП в производстве машин и оборудования в мае-октябре 2021 г. уменьшилась, составив в последние полгода рассматриваемого периода 8,0%. Прогнозы, полученные альтернативными методами, также демонстрируют улучшение качественных характеристик в эти 6 месяцев: средняя абсолютная процентная ошибка наивных прогнозов составляет 9,0%, наивных сезонных прогнозов – 10,0%, скользящего среднего – 6,2%. Так что и в мае-октябре 2021 г. прогнозы данного показателя по моделям временных рядов уступают по качеству скользящему среднему.

* * *

Таким образом, на основе проведенного анализа можно говорить о том, что прогнозы ИЭП индексов промышленного производства Росстата обладают лучшим качеством по сравнению с простейшими альтернативными методами прогнозирования (исключение составляет ИПП в производстве машин и оборудования). В течение анализируемого периода времени (апрель 2009 г. – октябрь 2021 г.) MAPE шести из восьми показателей не превосходит 5%. Лишь один показатель имеет MAPE выше 10%. Также следует отметить, что в последние полгода рассматриваемого периода (май-октябрь 2021 г.) семь из восьми показателей демонстрируют улучшение качественных характеристик. ▀

«Научный вестник ИЭП им. Гайдара.ру» зарегистрирован
Федеральной службой по надзору в сфере связи,
информационных технологий и массовых коммуникаций (Роскомнадзор)
как электронное информационно-аналитическое,
научное периодическое издание
(Свидетельство о регистрации средства массовой информации
Эл № ФС77-42586 от 12 ноября 2010 г.).

ГЛАВНЫЙ РЕДАКТОР

М.Ю. Турунцева, зав. лабораторией краткосрочного прогнозирования

РЕДАКЦИОННАЯ КОЛЛЕГИЯ

А.С. Каукин, и.о. руководителя научного направления «Реальный сектор»,
П.В. Трунин, руководитель научного направления «Макроэкономика и финансы»,
М.В. Казакова, ведущий научный сотрудник
научного направления «Макроэкономика и финансы»,
А.Ю. Кнобель, зав. лабораторией международной торговли

Выпускающий редактор – Е.Ю. Лопатина, РИО

Корректор – К.Ю. Мезенцева, РИО