



ИНСТИТУТ
ЭКОНОМИЧЕСКОЙ
ПОЛИТИКИ
ИМЕНИ Е. Т. ГАЙДАРА

НАУЧНЫЙ ВЕСТНИК ИЭП ИМ. ГАЙДАРА.РУ 05/2019

МОДЕЛЬНЫЕ РАСЧЕТЫ КРАТКОСРОЧНЫХ ПРОГНОЗОВ
СОЦИАЛЬНО-ЭКОНОМИЧЕСКИХ ПОКАЗАТЕЛЕЙ РФ
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
Е. Астафьева, М. Турунцева31

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

МОДЕЛЬНЫЕ РАСЧЕТЫ КРАТКОСРОЧНЫХ ПРОГНОЗОВ СОЦИАЛЬНО-ЭКОНОМИЧЕСКИХ ПОКАЗАТЕЛЕЙ РФ

В статье представлены расчеты прогнозных значений различных экономических показателей Российской Федерации в июне–ноябре 2019 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 НЕКОТОРЫХ РОССИЙСКИХ ЭКОНОМИЧЕСКИХ ПОКАЗАТЕЛЕЙ

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 март 2019 г. Показано, что прогнозы практически всех рассматриваемых показателей обладают хорошим качеством и превосходят по качеству альтернативные методы прогнозирования. Исключение составляет лишь группа показателей доходов населения.

Ключевые слова: прогнозирование, ИПЦ, доходы населения, рынок труда.

МОДЕЛЬНЫЕ РАСЧЕТЫ КРАТКОСРОЧНЫХ ПРОГНОЗОВ СОЦИАЛЬНО-ЭКОНОМИЧЕСКИХ ПОКАЗАТЕЛЕЙ РФ

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, 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 июне-ноябре 2019 г., построенные на основе моделей временных рядов, разработанных в результате исследований, проводимых в течение последних нескольких лет в ИЭП им. 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 не корректным 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

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.

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, 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 статье также представлены расчеты значений индексов промышленного производства, индекса цен производителей и показателя общей численности безработных, рассчитанные с использованием результатов конъюнктурных опросов ИЭП им. Е.Т. Гайдара. Эмпирические исследования показывают², что использование рядов конъюнктурных опросов в прогностических моделях в качестве объясняю-

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.

² 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.

щих переменных¹ 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 июнь-ноябрь 2019 г. были использованы ряды месячных индексов промышленного производства Федеральной службы государственной статистики (Росстата) с января 2002 г. по март 2019 г. и ряды базисных индексов промышленного производства Научно-исследовательского университета Высшей школы экономики (НИУ ВШЭ)² за период с января 2010 г. по апрель 2019 г. (скорректированное значение января 2010 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, средний³ прирост индекса промышленного производства Росстата в июне-ноябре 2019 г. по сравнению с аналогичным периодом предыдущего года по промышленности в целом составляет 2,5%. Для индекса промышленного производства НИУ ВШЭ данный показатель достигает также 2,5%.

Среднемесячный прирост индекса промышленного производства в добыче полезных ископаемых Росстата и НИУ ВШЭ в июне-ноябре 2019 г. составляет 3,5 и 2,7% соответственно. Средний прирост индекса промышленного производства в обрабатывающей промышленности Росстата по сравнению с аналогичным периодом предыдущего года в июне-ноябре 2019 г. составляет 1,4%, индекса НИУ ВШЭ – 1,8%. Среднемесячное увеличение индекса промышленного производства в производстве пищевых продуктов Росстата и НИУ ВШЭ составляет соответственно 2,6 и 2,4%. В производстве кокса и нефтепродуктов средний прирост прогнозируется на уровне -1,6% и для индексов Росстата, и для НИУ ВШЭ соответственно. Среднемесячное изменение индексов промышленного производства Росстата и НИУ ВШЭ для металлургического производства в июне-ноябре 2019 г. находится на уровне 0,8 и -0,2% соответственно. В производстве машин и оборудования средний рост прогнозируется на уровне -4,8 и -3,0% для индексов Росстата и НИУ ВШЭ соответственно.

Средний прирост индекса промышленного производства в обеспечении электрической энергией, газом и паром; кондиционировании воздуха Росстата в июне-ноябре 2019 г. по сравнению с аналогичным периодом предыдущего года составляет 1,9%; аналогичный показатель для индекса НИУ ВШЭ – 1,2%.

¹ 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.

² Данные индексы рассчитываются Барановым Э.А. и Бессоновым В.А.

³ 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 и производстве готовых металлических изделий		ИПП в производстве машин и оборудования		
	ARIMA	КО	ARIMA	НИУ ВШЭ	Росстат	НИУ ВШЭ	Росстат	НИУ ВШЭ	Росстат	НИУ ВШЭ	Росстат	НИУ ВШЭ	Росстат	НИУ ВШЭ	Росстат	НИУ ВШЭ	Росстат	НИУ ВШЭ	
																			2,1
Июн.19	2,1	2,1	2,0	1,8	3,9	3,2	0,2	1,3	2,0	1,9	3,0	3,6	-1,9	-2,0	12,6	0,7	-11,9	6,6	
Июл.19	2,0	3,6	2,4	3,3	4,3	3,1	1,9	3,0	0,6	1,2	3,3	3,0	-2,5	-3,8	-0,7	-1,2	-4,3	3,5	
Авг.19	1,9	2,3	2,1	1,9	3,5	2,8	1,3	1,3	0,5	0,4	2,8	2,1	0,1	0,8	0,3	-0,9	-6,9	-6,6	
Сен.19	2,3	3,8	3,0	3,2	3,2	2,2	0,6	3,4	3,5	2,0	3,1	2,1	-2,8	-1,7	0,9	-0,2	-8,3	-4,3	
Окт.19	2,3	3,3	2,4	2,8	3,0	2,8	1,6	0,7	4,3	2,8	1,8	0,1	-1,7	0,0	-8,5	-0,1	-2,1	-4,3	
Ноя.19	2,4	2,4	2,7	2,1	3,0	2,2	3,0	1,3	0,6	-1,1	1,5	3,4	-0,8	-2,9	0,0	0,6	4,9	-12,8	
Прогнозируемый прирост к соответствующему месяцу предшествующего года																			
Июн.18	2,2	3,2	2,2	2,2	2,8	2,2	2,2	3,9	1,7	2,0	5,0	3,1	2,5	3,1	-14,2	3,3	7,0	5,7	
Июл.18	3,9	4,8	4,8	2,8	3,2	2,8	4,6	6,3	1,8	2,2	5,2	2,2	2,6	3,7	3,3	3,1	4,2	6,7	
Авг.18	2,7	2,9	2,9	3,4	4,5	3,4	2,2	2,9	0,1	0,4	6,1	1,2	-0,4	-1,5	-5,2	3,2	13,3	-1,5	
Сен.18	2,1	4,0	4,0	5,6	6,9	5,6	-0,1	3,7	-0,4	-0,3	6,7	2,5	3,5	3,0	-6,5	5,6	15,7	7,9	
Окт.18	3,7	4,7	4,7	7,4	7,4	5,4	2,7	5,6	-3,2	-3,9	6,9	4,6	1,5	0,3	19,6	6,2	-9,3	-6,2	
Ноя.18	2,4	3,8	3,8	6,0	7,8	6,0	0,0	2,7	2,4	2,7	6,6	1,4	0,3	2,9	7,2	2,5	-5,6	-1,3	
Справочно: фактический прирост 2018 г. к соответствующему месяцу 2017 г.																			

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.

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 май 2019 г.

Из табл. 2 следует, что средний прогнозируемый прирост объемов месячного товарооборота в период с июня по ноябрь 2019 г. по отношению к соответствующему периоду 2018 г. составляет около 6,2%. Средний прогнозируемый прирост месячного реального товарооборота в период с июня по ноябрь 2019 г. по отношению к соответствующему периоду 2018 г. находится на уровне 1,7%.

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. апрель 2019 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 июнь-ноябрь 2019 г. по отношению к аналогичному периоду 2018 г. составит 10,9, 8,5, 12,3 и 9,1% соответственно. Средний прогнозируемый объем сальдо торгового баланса со всеми странами за июнь-ноябрь 2019 г. составит 116,0 млрд долл., что соответствует росту на 14,0% по отношению к аналогичному периоду 2018 г.

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 март 2019 г.² В табл. 4 приведены результаты модельных расчетов прогнозных значений в июне-ноябре 2019 г. по ARIMA-моделям, структурным моделям (SM) и моделям, построенным с использованием конъюнктурных опросов (КО).

Прогнозируемый среднемесячный прирост индекса потребительских цен в июне-ноябре 2019 г. составит 0,3%. Прирост цен производителей промышленных товаров за указанный период прогнозируется в среднем на уровне 0,7% в месяц. Для индексов цен производителей Росстата с июня по ноябрь 2019 г. прогнозируются следующие средние темпы роста в месяц: 1,5% – в добыче полезных ис-

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 предшествующего года)
Июн.19	2739,9 (6,5)	101,7
Июл.19	2813,2 (6,4)	101,0
Авг.19	2915,3 (6,2)	101,5
Сен.19	2886,9 (6,2)	101,6
Окт.19	2913,7 (6,2)	102,5
Ноя.19	2922,2 (5,8)	102,2
Справочно: фактические значения за аналогичные месяцы 2018 г.		
Июн.18	2573,3	103,4
Июл.18	2643,9	102,8
Авг.18	2744,0	103,0
Сен.18	2719,1	102,3
Окт.18	2744,9	102,2
Ноя.18	2762,8	103,3

Примечание. Ряды розничного товарооборота и реального розничного товарооборота на интервале с января 1999 г. по май 2019 г. являются рядами типа DS.

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

² Структурные модели оценивались на интервале с октября 1998 г.

Таблица 3

Результаты расчетов прогнозных значений объемов внешнеторгового оборота со странами вне СНГ

	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	SM	ARIMA	SM	ARIMA	SM	ARIMA	SM	ARIMA	SM	ARIMA	SM	ARIMA	SM
Июн.19	42,6	39,5	117	109	23,4	23,2	111	110	36,2	34,9	115	110	20,9	21,1	111	113
Июл.19	39,6	40,1	115	117	23,1	22,4	109	106	34,6	36,1	116	121	20,5	20,5	108	108
Авг.19	43,9	41,8	117	112	23,2	22,6	107	104	37,5	36,5	115	112	21,3	20,8	109	107
Сен.19	44,4	41,5	115	107	22,6	22,1	114	112	39,4	37,3	116	110	20,3	19,8	114	111
Окт.19	44,2	42,2	107	102	23,3	22,5	108	105	38,9	38,5	109	107	20,5	20,1	107	104
Ноя.19	43,6	43,1	108	107	23,2	22,9	109	108	39,4	38,3	111	108	20,8	20,6	109	108
Справочно: фактические значения за соответствующие месяцы 2018 г., млрд долл.																
Июн.18	36,3				21,1				31,6				20,9		18,8	
Июл.18	34,3				21,2				29,8				20,5		19,0	
Авг.18	37,5				21,7				32,7				21,3		19,5	
Сен.18	38,6				19,8				33,9				20,3		17,8	
Окт.18	41,3				21,5				35,8				20,5		19,2	
Ноя.18	40,3				21,3				35,5				20,8		19,0	

Примечание. На интервале с января 1999 г. по апрель 2019 г. ряды экспорта, экспорта в страны вне СНГ, импорта 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

	Индексы цен производителей:											химическое производство	металлургическое производство	производство машин и оборудования	производство автотранспортных средств			
	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
	Прогнозные значения (в % к предыдущему месяцу)																	
Июнь.19	100,5	100,1	100,4	101,0	100,4	100,6	102,4	100,7	99,4	99,8	100,4	100,5	100,2	102,3	100,5	99,6	100,3	101,0
Июль.19	100,6	100,1	100,5	100,5	100,2	100,6	100,4	100,1	100,7	100,5	100,3	100,8	100,5	102,4	100,9	100,8	100,3	100,5
Авг.19	100,1	100,0	100,3	100,8	100,6	100,6	100,1	100,2	102,2	100,2	100,7	100,8	100,4	102,6	100,7	100,1	100,3	99,8
Сен.19	100,4	100,2	100,6	101,6	101,1	100,6	103,0	100,5	100,5	100,5	100,3	100,4	100,5	102,6	100,7	101,0	100,2	100,3
Окт.19	100,3	100,2	100,6	101,3	101,1	100,7	102,1	100,6	100,6	100,5	100,7	100,8	100,3	102,5	100,7	101,0	100,2	101,0
Ноя.19	100,3	100,3	100,4	99,9	100,6	100,6	101,3	100,6	99,9	100,2	100,5	100,5	100,3	102,4	101,2	100,5	100,3	100,4
	Прогнозные значения (в % к декабрю 2018 г.)																	
Июнь.19	102,7	102,4	103,0	103,7	101,8	100,9	106,7	100,2	100,0	97,9	101,4	102,3	103,4	91,4	98,4	98,4	102,8	103,7
Июль.19	103,3	102,5	103,6	104,2	102,0	101,5	107,2	100,3	100,7	98,4	101,8	103,0	104,0	93,7	99,3	99,1	103,2	104,3
Авг.19	103,4	102,5	103,9	105,1	102,6	102,1	107,3	100,5	103,0	98,5	102,5	103,9	104,3	96,1	100,1	99,2	103,5	104,1
Сен.19	103,8	102,7	104,5	106,8	103,7	102,7	110,5	100,9	103,5	99,0	102,7	104,3	104,8	98,6	100,7	100,1	103,7	104,4
Окт.19	104,1	102,9	105,1	108,2	104,8	103,4	112,8	101,6	104,1	99,5	103,4	105,0	105,1	101,0	101,5	101,2	103,9	105,4
Ноя.19	104,4	103,2	105,5	108,1	105,4	104,0	114,3	102,2	104,0	99,7	104,0	105,5	105,4	103,4	102,7	101,6	104,2	105,9
	Справочно: фактические значения за аналогичные периоды 2018 г. (в % к декабрю 2017 г.)																	
Июнь.18		102,1		108,9			119,1	107,8	98,3	102,1	104,5	107,2	105,6	120,5	106,6	110,5	107,2	100,4
Июль.18		102,4		109,3			118,8	108,2	99,1	103,0	103,7	108,1	107,2	119,8	107,6	110,4	108,9	101,3
Авг.18		102,4		109,5			116,7	109,0	101,4	103,5	103,6	109,1	109,8	121,5	110,2	109,8	110,5	102,7
Сен.18		102,6		110,9			118,4	110,6	102,0	104,3	105,3	109,4	111,6	127,6	112,4	111,5	109,0	102,5
Окт.18		103,0		114,6			128,2	112,4	104,1	105,3	104,4	110,3	113,1	135,9	115,2	109,9	106,2	102,9
Ноя.18		103,6		115,4			131,1	112,7	103,8	106,8	106,5	111,2	114,9	136,3	115,5	108,8	105,0	103,1

Примечание. На интервале с января 1999 г. по март 2019 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.

копаемых, 0,5% – в обрабатывающих производствах, 0,5% – в обеспечении электрической энергией, газом и паром, 0,3% – в производстве пищевых продуктов, 0,5% – в производстве текстильных изделий, 0,6% – в обработке древесины и производстве изделий из дерева, 0,4% – в производстве бумаги и бумажных изделий, 2,5% – в производстве кокса и нефтепродуктов, 0,8% – в химическом производстве, 0,5% – в металлургическом производстве, 0,3% – в производстве машин и оборудования и 0,5% – в производстве автотранспортных средств.

Динамика стоимости минимального набора продуктов питания

В данном разделе представлены результаты расчетов прогнозируемых значений стоимости минимального набора продуктов питания в июне-ноябре 2019 г. Прогнозы строились на основе временных рядов по данным Росстата за период с января 2000 г. по май 2019 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 4347,2 руб. Прогнозируемый рост стоимости минимального набора продуктов питания составляет в среднем около 10,5% по сравнению с уровнем соответствующего периода прошлого года.

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 март 2019 г. В табл. 6 приведены результаты модельных расчетов прогнозных значений в июне-ноябре 2019 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 июнь-ноябрь 2019 г. сводный индекс транспортных тарифов на грузовые перевозки будет расти со среднемесячным темпом 0,1%. В июле 2019 г. прогнозируется сезонный рост данного показателя на 3,6 п.п.

Индекс тарифов на грузовые перевозки автомобильным транспортом в течение данных шести месяцев будет снижаться со среднемесячным темпом 0,1%, а индекс тарифов на трубопроводный транспорт – на 0,2%.

Таблица 5

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

Прогнозируемые значения по ARIMA-модели, руб.	
Июн.19	4463,3
Июл.19	4417,3
Авг.19	4353,1
Сен.19	4289,6
Окт.19	4273,3
Ноя.19	4286,2
Справочно: фактические значения за аналогичные месяцы 2018 г., млрд руб.	
Июн.18	4060,3
Июл.18	4040,9
Авг.18	3943,3
Сен.18	3840,2
Окт.18	3833,2
Ноя.18	3883,5
Прогнозируемый прирост к соответствующему месяцу предыдущего года, %	
Июн.19	9,9
Июл.19	9,3
Авг.19	10,4
Сен.19	11,7
Окт.19	11,5
Ноя.19	10,4

Примечание. Ряд стоимости минимального набора продуктов на интервале с января 2000 г. по май 2019 г. является стационарным в первых разностях.

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 6

Результаты расчетов прогнозных значений индексов транспортных тарифов

	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)			
Июн.19	100,3	99,9	100,4
Июл.19	103,6	99,9	101,6
Авг.19	100,3	99,9	101,5
Сен.19	100,2	99,9	96,8
Окт.19	95,8	99,9	97,1
Ноя.19	100,2	99,9	101,4
Прогнозные значения по ARIMA-моделям (в % к декабрю предыдущего года)			
Июн.19	102,4	102,4	97,0
Июл.19	106,1	102,3	98,5
Авг.19	106,3	102,2	100,0
Сен.19	106,6	102,1	96,7
Окт.19	102,1	102,0	93,9
Ноя.19	102,3	101,8	95,3
Справочно: фактические значения за аналогичный период 2018 г. (в % к предыдущему месяцу)			
Июн.18	100,1	100,0	100,1
Июл.18	103,7	100,0	108,2
Авг.18	100,2	100,1	100,3
Сен.18	100,1	100,0	99,9
Окт.18	94,8	100,1	88,7
Ноя.18	100,7	99,9	100,0

Примечание. На интервале с сентября 1998 г. по март 2019 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 февраль 2019 г.; для всех рядов использовались фиктивные переменные для учета особо резких всплесков.

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 июне-ноябре 2019 г., полученные на основе нелинейных моделей временных рядов, оцененных по данным МВФ на интервале с января 2000 г. по апрель 2019 г.

Средний прогнозируемый уровень цен на нефть составляет около 64,1 долл./барр., что ниже соответствующих показателей прошлого года в среднем на 0,7%. Цены на алюминий прогнозируются на уровне 1711 долл./т, а их среднее прогнозируемое снижение составляет приблизительно 7% по сравнению с соответствующим уровнем прошлого года. Прогноз цен на золото составляет около 1327 долл./унц. Средние прогнозируемые цены на медь составляют около 6553 долл./т, а на цены никель – около 12165 долл./т. Средний прогнозируемый прирост цен на золото составляет около 3%, цен на медь – около 4%, а среднее снижение цен на никель – 0,3% по сравнению с соответствующим уровнем прошлого года.

Таблица 7

Результаты расчетов прогнозных значений цен на природные ресурсы

	Нефть марки Brent, долл./барр.	Алюминий, долл./т	Золото, долл./унц.	Медь, долл./т	Никель, долл./т
Прогнозные значения по ARIMA-моделям					
Июн.19	70,80	1755	1313	6485	12182
Июл.19	68,71	1718	1317	6511	12203
Авг.19	66,26	1699	1314	6535	12142
Сен.19	63,55	1712	1323	6564	12152
Окт.19	59,58	1697	1342	6595	12131
Ноя.19	55,93	1688	1353	6628	12178
Приросты к соответствующему месяцу предыдущего года, %					
Июн.19	31,6	-3,7	5,2	8,4	14,1
Июл.19	11,0	-9,6	1,9	5,6	-2,1
Авг.19	0,4	-10,3	-0,5	0,8	-7,0
Сен.19	-7,1	-9,9	1,7	1,4	-6,5
Окт.19	-18,2	-4,3	4,3	2,5	-0,8
Ноя.19	-21,6	-5,6	4,5	2,7	0,4
Справочно: фактические значения за аналогичный период 2018 г.					
Июн.18	53,8	1823	1248	5981	10678
Июл.18	61,89	1901	1292	6165	12468
Авг.18	66,03	1895	1320	6483	13063
Сен.18	68,39	1900	1301	6476	12995
Окт.18	72,8	1773	1286	6433	12235
Ноя.18	71,37	1788	1295	6454	12134

Примечание. Ряды цен на нефть, никель, золото, медь и алюминий на интервале с января 1980 г. по апрель 2019 г. являются рядами типа DS.

ДЕНЕЖНЫЕ ПОКАЗАТЕЛИ

Будущие значения денежной базы (в узком определении – наличные деньги и ФОР) и денежного агрегата M_2 в июне-ноябре 2019 г. получены на основе моделей временных рядов соответствующих показателей, рассчитываемых ЦБ РФ¹, на интервале с октября 1998 г. по май 2019 г. для денежной базы и с октября 1998 г. по апрель 2019 г. для денежного агрегата M_2 . В табл. 8 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 июне-ноябре 2019 г. денежная база будет расти на рассматриваемом интервале времени со среднемесячным темпом 0,6%.

В рассматриваемый период времени денежный показатель M_2 меняться почти не будет.

МЕЖДУНАРОДНЫЕ РЕЗЕРВЫ

В данном разделе представлены результаты статистической оценки будущих значений международных резервов РФ², полученные исходя из оценки модели временного ряда международных резервов, по данным ЦБ РФ, на интервале с октября 1998 г. по март 2019 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 июне-ноябре 2019 г. международные резервы будут расти со среднемесячным темпом 0,5%.

Таблица 8

Прогноз денежного агрегата M_2 и денежной базы

	Денежная база		M_2	
	млрд руб.	прирост к предыдущему месяцу, %	млрд руб.	прирост к предыдущему месяцу, %
Июн.19	10313	-0,2	46144	-0,7
Июл.19	10461	1,4	46476	0,7
Авг.19	10454	-0,1	46144	-0,7
Сен.19	10601	1,4	46476	0,7
Окт.19	10595	-0,1	46144	-0,7
Ноя.19	10743	1,4	46476	0,7
Справочно: фактические значения за соответствующие месяцы 2018 г. (прирост к предыдущему месяцу, %)				
Июн.18		-0,3		0,3
Июл.18		2,1		2,0
Авг.18		1,0		-0,5
Сен.18		1,0		1,0
Окт.18		0,0		-0,3
Ноя.18		-0,8		-0,1

Примечание. Временной ряд значений денежной базы на интервале с октября 1998 г. по май 2019 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 апрель 2019 г. был идентифицирован как стационарный ряд с выраженной сезонной компонентой.

Таблица 9

Прогноз международных резервов

	Прогнозные значения по ARIMA-моделям	
	млрд долл. США	прирост к предыдущему месяцу, %
Июн.19	492,7	0,5
Июл.19	495,1	0,5
Авг.19	497,7	0,5
Сен.19	500,3	0,5
Окт.19	502,9	0,5
Ноя.19	505,5	0,5
Справочно: фактические значения за аналогичный период 2018 г.		
Июн.18	456,6	-0,7
Июл.18	456,7	0,0
Авг.18	458,0	0,3
Сен.18	460,6	0,6
Окт.18	459,2	-0,3
Ноя.18	459,6	0,1

Примечание. На интервале с октября 1998 г. по март 2019 г. ряд международных резервов РФ был идентифицирован как стационарный в разностях ряд.

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

² 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 май 2019 г. и за период с января 1999 г. по май 2019 г.¹ соответственно.

В июне-ноябре 2019 г. значение курса доллара США к рублю прогнозируется в среднем по двум моделям равным 66 руб. 98 коп. за доллар США. Прогнозируемое значение курса евро к доллару США в среднем на рассматриваемом интервале времени составит 1,11 долл. США за один евро.

ПОКАЗАТЕЛИ УРОВНЯ ЖИЗНИ НАСЕЛЕНИЯ

В данном разделе (см. табл. 11) 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 2019 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.

Согласно результатам, представленным в табл. 11, прогнозируемый среднемесячный прирост реальных располагаемых денежных доходов по сравне-

Таблица 10

Прогноз курсов USD/RUR и EUR/USD

	Прогнозные значения курса USD/RUR (рублей за доллар США)		Прогнозные значения курса EUR/USD (долларов США за евро)	
	ARIMA	SM	ARIMA	SM
Июн.19	65,73	65,92	1,11	1,12
Июл.19	66,07	66,49	1,11	1,12
Авг.19	66,25	67,15	1,11	1,11
Сен.19	66,49	67,83	1,11	1,11
Окт.19	66,70	68,70	1,11	1,10
Ноя.19	66,93	69,53	1,11	1,10
Справочно: фактические значения за аналогичный период 2018 г.				
Июн.18	62,76		1,17	
Июл.18	62,78		1,18	
Авг.18	68,08		1,16	
Сен.18	65,59		1,16	
Окт.18	65,77		1,14	
Ноя.18	66,63		1,14	

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

Таблица 11

Прогноз показателей уровня жизни населения

	Реальные располагаемые денежные доходы	Реальные денежные доходы	Реальная начисленная заработная плата
Прогнозные значения по ARIMA-моделям (в % к соответствующему месяцу 2018 г.)			
Июн.19	99,0	99,4	101,9
Июл.19	99,9	100,2	102,6
Авг.19	101,6	101,3	103,1
Сен.19	101,8	101,1	103,7
Окт.19	100,6	100,2	104,2
Ноя.19	103,2	102,5	104,6
Справочно: фактические значения за соответствующий период 2018 г. (в % к аналогичному периоду 2017 г.)			
Июн.18	99,8	100,6	107,2
Июл.18	101,5	102,1	107,5
Авг.18	97,7	98,9	106,8
Сен.18	95,9	97,5	104,9
Окт.18	100,0	101,8	105,2
Ноя.18	95,7	98,1	104,2

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 2019 г. эти ряды были отнесены к классу процессов, являющихся стационарными в разностях, с выраженной сезонной составляющей.

¹ В Бюллетене использованы данные МВФ по курсу евро к доллару США за период с января 1999 г. по март 2019 г. и по курсу доллара США к рублю за период с октября 1998 г. по апрель 2019 г. Данные по курсу евро к доллару США за апрель-май 2019 г. и по курсу доллара США к рублю за май 2019 были 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).

нию с предыдущим годом составит 1%; реальных денежных доходов – 0,8%; реальной начисленной заработной платы – 3,4%.

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 март 2019 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 12

Результаты расчетов прогнозных значений показателей численности занятого в экономике населения и общей численности безработных

	Численность занятого в экономике населения (ARIMA)		Общая численность безработных (ARIMA)			Общая численность безработных (КО)		
	млн чел.	прирост к соответствующему месяцу 2018 г., %	млн чел.	прирост к соответствующему месяцу 2018 г., %	в % к показателю численности занятого в экономике населению	млн чел.	прирост к соответствующему месяцу 2018 г., %	в % к показателю численности занятого в экономике населения
Июн.19	72,6	0,1	3,2	-7,2	4,5	3,4	-2,4	4,7
Июл.19	73,0	0,4	3,3	-8,0	4,5	3,5	-3,1	4,8
Авг.19	73,4	0,1	3,3	-7,1	4,4	3,4	-2,7	4,6
Сен.19	73,1	0,0	3,2	-4,4	4,4	3,4	0,3	4,7
Окт.19	72,6	0,1	3,4	-5,5	4,7	3,5	-4,1	4,8
Ноя.19	72,5	-0,2	3,5	-4,9	4,9	3,5	-6,6	4,8
Справочно: фактические значения за аналогичный период 2018 г., млн чел.								
Июн.18	72,5					3,5		
Июл.18	72,7					3,6		
Авг.18	73,4					3,5		
Сен.18	73,1					3,4		
Окт.18	72,5					3,6		
Ноя.18	72,6					3,7		

Примечание. На интервале с октября 1998 г. по март 2019 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. 12), в июне-ноябре 2019 г. рост численности занятых в экономике в среднем составит 0,1% в месяц по отношению к соответствующему периоду предыдущего года.

Среднее сокращение показателя общей численности безработных прогнозируется на уровне 1,5% 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 март 2019 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

Показатель	2019								
	март	апрель	май	июнь	июль	август	сентябрь	октябрь	ноябрь
ИПП Росстата (прирост, %)*	1,2	1,7	1,6	2,1	2,8	2,1	3,1	2,8	2,4
ИПП НИУ ВШЭ (прирост, %)*	0,4	3,0	1,0	1,9	2,9	2,0	3,1	2,6	2,4
ИПП в добыче полезных ископаемых Росстата (прирост, %)*	4,3	4,1	4,4	3,9	4,3	3,5	3,2	3,0	3,0
ИПП в добыче полезных ископаемых НИУ ВШЭ (прирост, %)*	4,6	3,6	4,1	3,2	3,1	2,8	2,2	2,8	2,2
ИПП в обрабатывающих производствах Росстата (прирост, %)*	0,3	0,5	-0,4	0,2	1,9	1,3	0,6	1,6	3,0
ИПП в обрабатывающих производствах НИУ ВШЭ (прирост, %)*	-0,5	3,0	-0,5	1,3	3,0	1,3	3,4	0,7	1,3
ИПП в производстве и распределении электроэнергии, газа и воды Росстата (прирост, %)*	-4,8	-1,3	0,6	2,0	0,6	0,5	3,5	4,3	0,6
ИПП в производстве и распределении электроэнергии, газа и воды НИУ ВШЭ (прирост, %)*	-7,0	0,2	0,9	1,9	1,2	0,4	2,0	2,8	-1,1
ИПП в производстве пищевых продуктов Росстата (прирост, %)*	3,3	3,3	3,7	3,0	3,3	2,8	3,1	1,8	1,5
ИПП в производстве пищевых продуктов НИУ ВШЭ (прирост, %)*	1,1	3,4	2,3	3,6	3,0	2,1	2,1	0,1	3,4
ИПП в производстве кокса и нефтепродуктов Росстата (прирост, %)*	-0,4	-0,5	-1,8	-1,9	-2,5	0,1	-2,8	-1,7	-0,8
ИПП в производстве кокса и нефтепродуктов НИУ ВШЭ (прирост, %)*	-1,9	3,0	0,2	-2,0	-3,8	0,8	-1,7	0,0	-2,9
ИПП в металлургическом производстве и производстве готовых металлических изделий Росстата (прирост, %)*	-6,4	-3,8	-5,8	12,6	-0,7	0,3	0,9	-8,5	0,0
ИПП в металлургическом производстве и производстве готовых металлических изделий НИУ ВШЭ (прирост, %)*	-0,4	-0,1	1,0	0,7	-1,2	-0,9	-0,2	-0,1	0,6
ИПП в производстве машин и оборудования Росстата (прирост, %)*	3,3	-15,2	-21,6	-11,9	-4,3	-6,9	-8,3	-2,1	4,9
ИПП в производстве машин и оборудования НИУ ВШЭ (прирост, %)*	3,5	1,2	4,1	6,6	3,5	-6,6	-4,3	-4,3	-12,8
Розничный товарооборот, трлн руб.	2,67	2,65	2,69	2,74	2,81	2,92	2,89	2,91	2,92
Реальный розничный товарооборот (прирост, %)*	1,6	1,6	1,4	1,7	1,0	1,5	1,6	2,5	2,2
Экспорт (млрд долл.)	36,8	35,7	40,8	41,1	39,9	42,9	43,0	43,2	43,4
Экспорт в страны, дальнего зарубежья (млрд долл.)	32,0	30,6	36,5	35,6	35,4	37,0	38,4	38,7	38,9
Импорт (млрд долл.)	20,9	22,0	22,2	23,3	22,8	22,9	22,4	22,9	23,1
Импорт из стран дальнего зарубежья (млрд долл.)	18,7	19,6	20,6	21,0	20,5	21,1	20,1	20,3	20,7
ИЦП (прирост, %)**	0,3	0,3	0,4	0,3	0,4	0,1	0,4	0,4	0,3
ИЦП промышленных товаров (прирост, %)**	0,9	1,2	1,3	0,7	0,4	0,7	1,1	1,0	0,4
ИЦП в добыче полезных ископаемых (прирост, %)**	4,0	2,2	0,8	2,4	0,4	0,1	3,0	2,1	1,3
ИЦП в обрабатывающих производствах (прирост, %)**	-0,4	0,6	1,3	0,7	0,1	0,2	0,5	0,6	0,6
ИЦП в производстве и распределении электроэнергии, газа и воды (прирост, %)**	0,6	-0,6	0,3	-0,6	0,7	2,2	0,5	0,6	-0,1
ИЦП в производстве пищевых продуктов (прирост, %)**	-1,2	-0,7	-0,4	-0,2	0,5	0,2	0,5	0,5	0,2
ИЦП в текстильном и швейном производстве (прирост, %)**	-0,1	0,3	0,3	0,4	0,3	0,7	0,3	0,7	0,5
ИЦП в обработке древесины и производстве изделий из дерева (прирост, %)**	-0,2	0,2	0,1	0,5	0,8	0,8	0,4	0,8	0,5
ИЦП в целлюлозно-бумажном производстве (прирост, %)**	0,1	1,5	0,1	0,2	0,5	0,4	0,5	0,3	0,3
ИЦП в производстве кокса и нефтепродуктов (прирост, %)**	-1,7	0,9	2,0	2,3	2,4	2,6	2,6	2,5	2,4

Показатель	2019								
	март	апрель	май	июнь	июль	август	сентябрь	октябрь	ноябрь
ИЦП в химическом производстве (прирост, %)**	-1,2	-0,4	0,4	0,5	0,9	0,7	0,7	0,7	1,2
ИЦП в металлургическом производстве и производстве готовых металлических изделий (прирост, %)**	0,6	0,3	0,0	-0,4	0,8	0,1	1,0	1,0	0,5
ИЦП в производстве машин и оборудования (прирост, %)**	0,3	0,3	0,3	0,3	0,3	0,3	0,2	0,2	0,3
ИЦП в производстве транспортных средств и оборудования (прирост, %)**	-0,4	0,8	1,0	1,0	0,5	-0,2	0,3	1,0	0,4
Стоимость минимального набора продуктов питания (на одного человека в месяц), тыс. руб.	4,18	4,24	4,36	4,46	4,42	4,35	4,29	4,27	4,29
Индекс тарифов на грузовые перевозки автомобильным транспортом (прирост, %)**	0,1	0,4	-0,1	-0,1	-0,1	-0,1	-0,1	-0,1	-0,1
Индекс тарифов на трубопроводный транспорт (прирост, %)**	-0,2	6,8	0,2	0,4	1,6	1,5	-3,2	-2,9	1,4
Сводный индекс транспортных тарифов на грузовые перевозки (прирост, %)**	0,0	4,0	0,3	0,3	3,6	0,3	0,2	-4,2	0,2
Цена на нефть марки Brent (долл./барр.)	68,4	72,8	71,4	70,8	68,7	66,3	63,5	59,6	55,9
Цена на алюминий (тыс. долл./т)	1,90	1,77	1,79	1,75	1,72	1,70	1,71	1,70	1,69
Цена на золото (тыс. долл./унц.)	1,30	1,29	1,30	1,31	1,32	1,31	1,32	1,34	1,35
Цена на медь (тыс. долл./т)	6,48	6,43	6,45	6,49	6,51	6,54	6,56	6,60	6,63
Цена на никель (тыс. долл./т)	13,0	12,2	12,1	12,2	12,2	12,1	12,2	12,1	12,2
Денежная база (трлн руб.)	10,1	10,1	10,3	10,3	10,5	10,5	10,6	10,6	10,7
M ₂ (трлн руб.)	46,2	46,1	46,5	46,1	46,5	46,1	46,5	46,1	46,5
Международные резервы (млрд долл.)	0,48	0,49	0,49	0,49	0,50	0,50	0,50	0,50	0,51
Обменный курс RUR/USD (руб. за доллар США)	64,73	64,69	65,35	65,83	66,28	66,70	67,16	67,70	68,23
Обменный курс USD/EUR (долл. США за евро)	1,12	1,12	1,12	1,12	1,12	1,11	1,11	1,11	1,11
Реальные располагаемые денежные доходы (прирост, %)*	-3,5	-1,5	-0,8	-1,0	-0,1	1,6	1,8	0,6	3,2
Реальные денежные доходы (прирост, %)*	-2,7	-0,8	-0,6	-0,6	0,2	1,3	1,1	0,2	2,5
Реальная заработная плата (прирост, %)*	0,0	0,5	1,2	1,9	2,6	3,1	3,7	4,2	4,6
Численность занятого в экономике населения (млн чел.)	71,5	71,8	72,3	72,6	73,0	73,4	73,1	72,6	72,5
Общая численность безработных (млн чел.)	3,5	3,4	3,4	3,3	3,4	3,4	3,3	3,5	3,5

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.

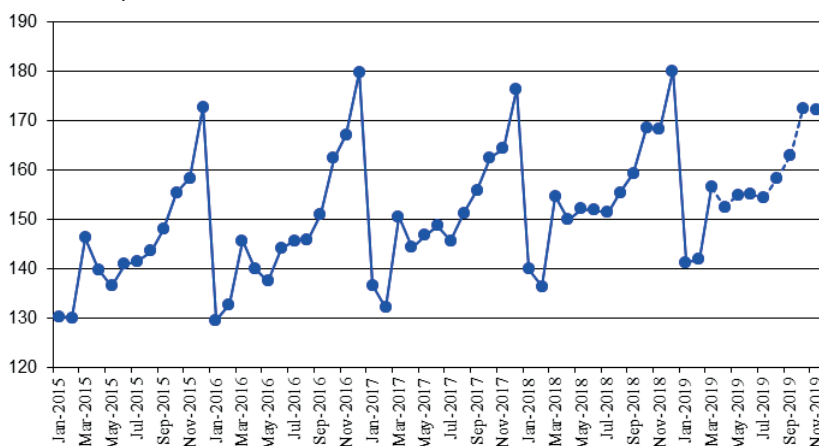


Рис. 1б. Индекс промышленного производства НИУ ВШЭ (ARIMA-модель), % к январю 2010 г.

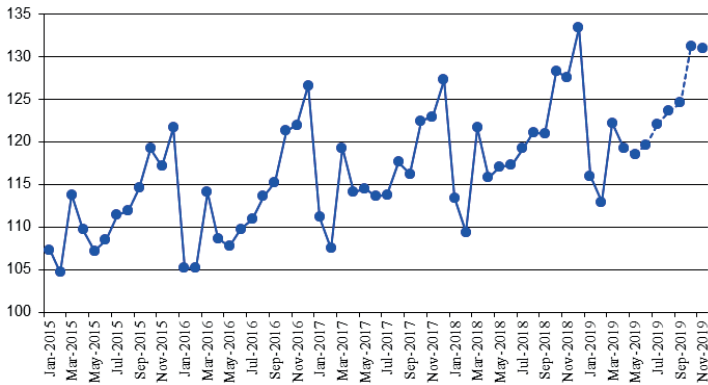


Рис. 2а. ИПП в добыче полезных ископаемых Росстата, % к декабрю 2001 г.

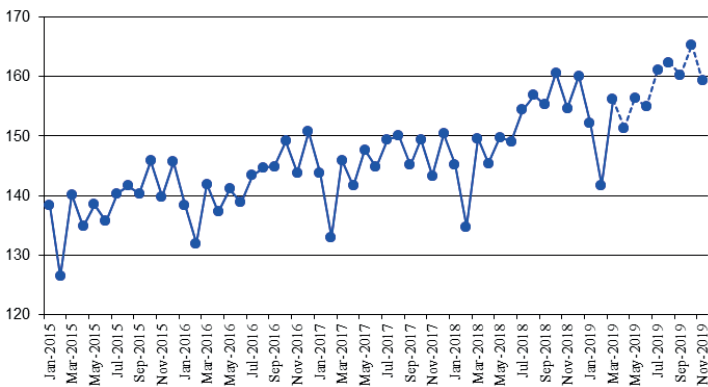


Рис. 2б. ИПП в добыче полезных ископаемых НИУ ВШЭ, % к январю 2010 г.

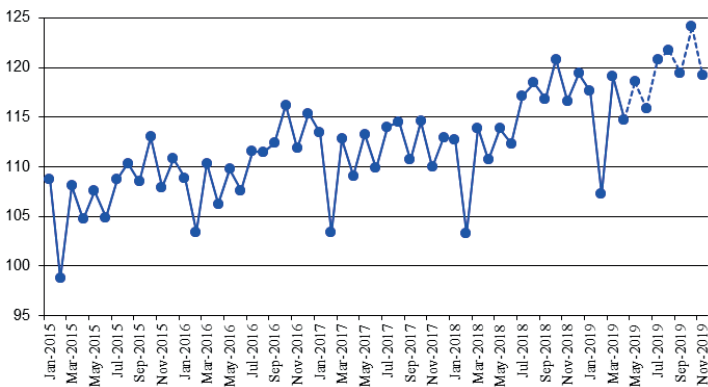


Рис. 3а. ИПП в обрабатывающих производствах Росстата, % к декабрю 2001 г.

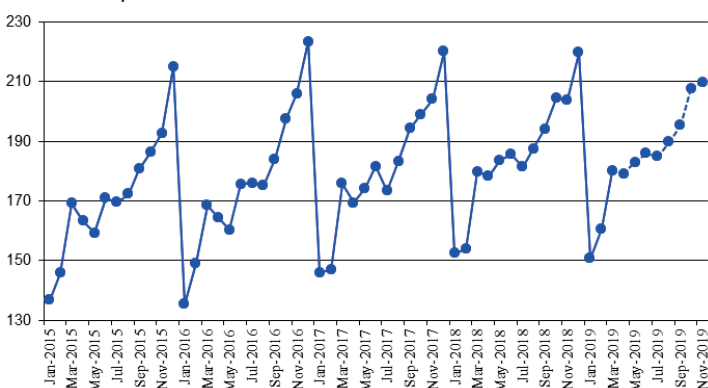


Рис. 3б. ИПП в обрабатывающих производствах НИУ ВШЭ, % к январю 2010 г.

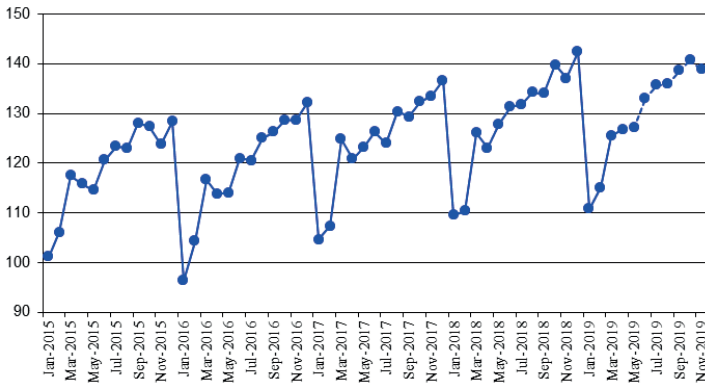


Рис. 4а. ИПП в обеспечении электрической энергией, газом и паром; кондиционировании воздуха Росстата, % к декабрю 2001 г.

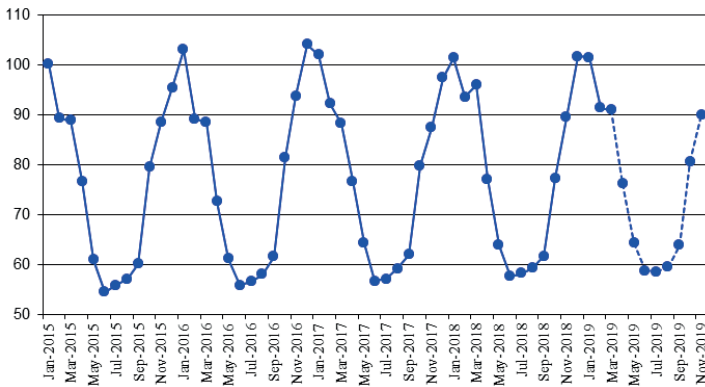


Рис. 4б. ИПП в обеспечении электрической энергией, газом и паром; кондиционировании воздуха НИУ ВШЭ, % к январю 2010 г.

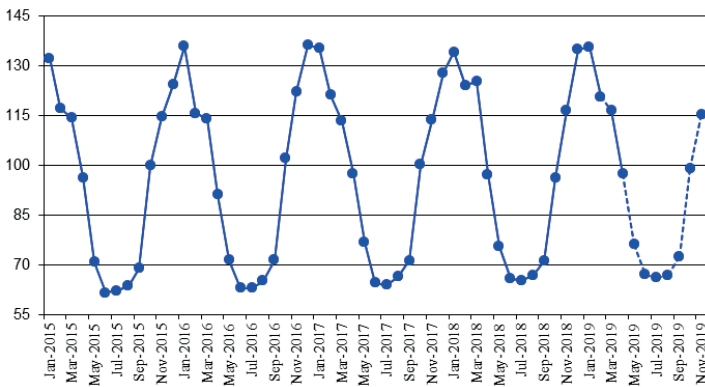


Рис. 5а. ИПП в производстве пищевых продуктов Росстата, % к декабрю 2001 г.

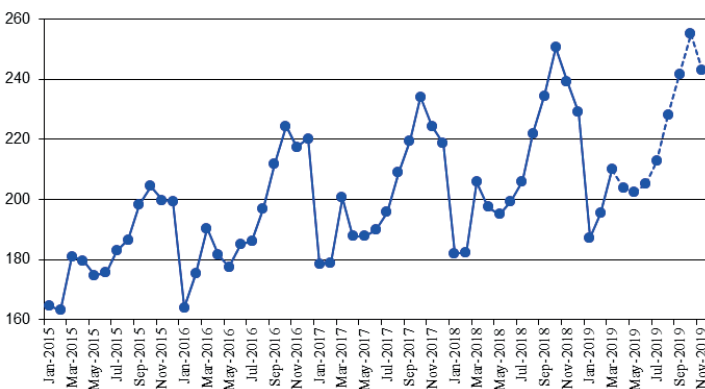


Рис. 5б. ИПП в производстве пищевых продуктов НИУ ВШЭ, % к январю 2010 г.

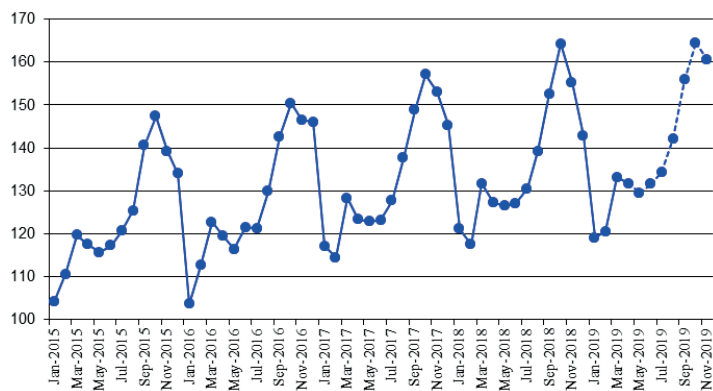


Рис. 6а. ИПП в производстве кокса и нефтепродуктов Росстата, % к декабрю 2001 г.

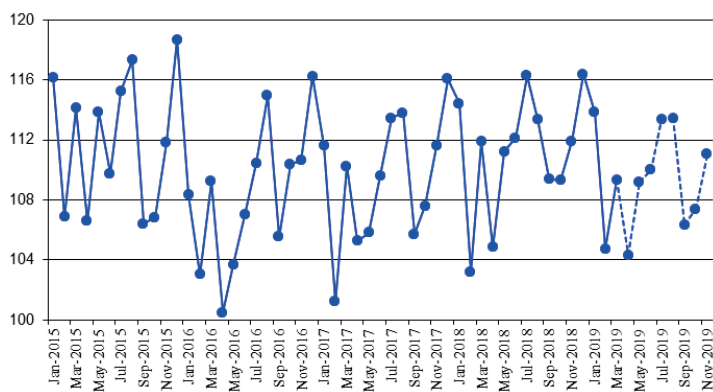


Рис. 6б. ИПП в производстве кокса и нефтепродуктов НИУ ВШЭ, % к январю 2010 г.

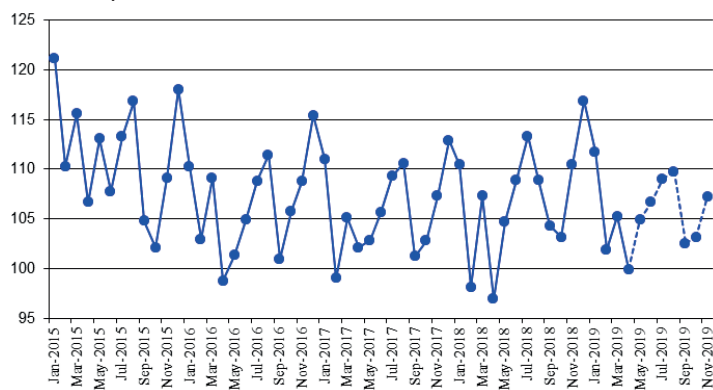


Рис. 7а. ИПП в металлургическом производстве и производстве готовых металлических изделий Росстата, % к декабрю 2001 г.

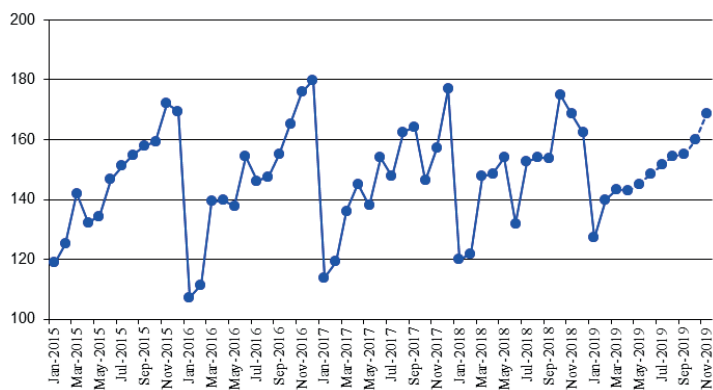


Рис. 7б. ИПП в металлургическом производстве и производстве готовых металлических изделий НИУ ВШЭ, % к январю 2010 г.

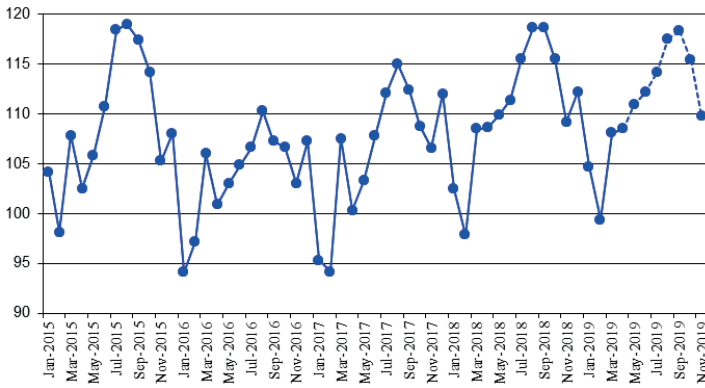


Рис. 8а. ИПП в производстве машин и оборудования Росстата, % к декабрю 2001 г.

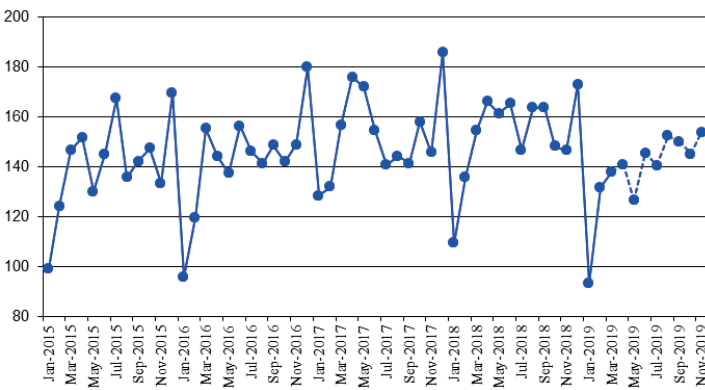


Рис. 8б. ИПП в производстве машин и оборудования НИУ ВШЭ, % к январю 2010 г.

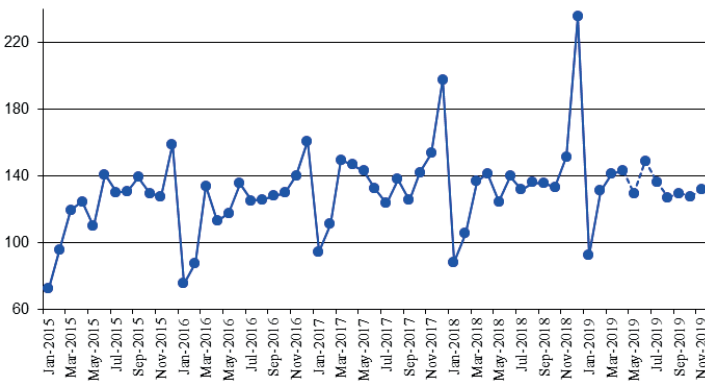


Рис. 9. Оборот розничной торговли, млрд руб.

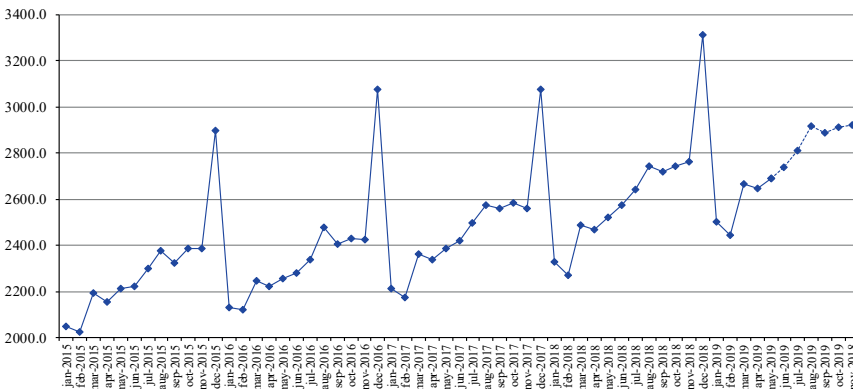


Рис. 9а. Реальный оборот розничной торговли, % к соответствующему периоду прошлого года

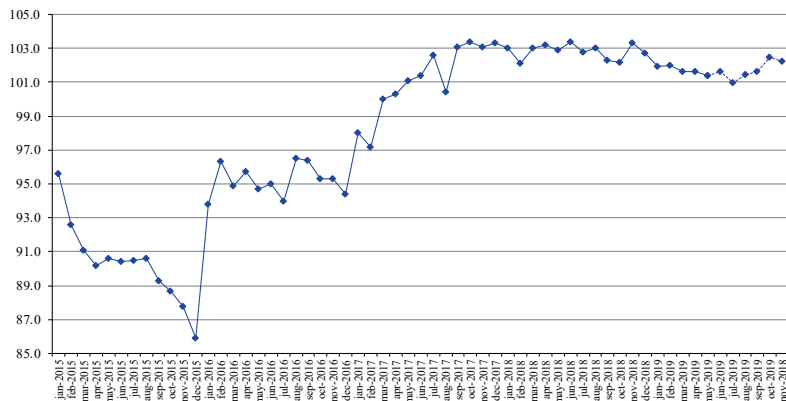


Рис. 10. Экспорт во все страны, млрд долл.

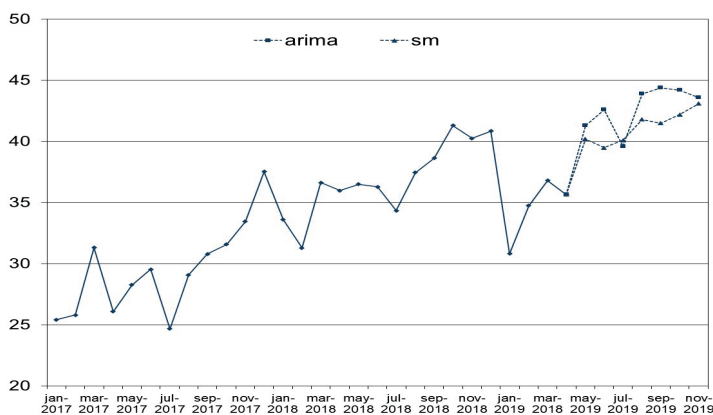


Рис. 11. Экспорт в страны вне СНГ, млрд долл.

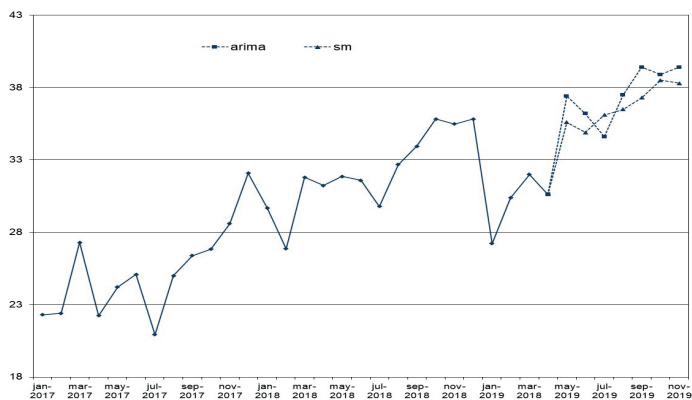


Рис. 12. Импорт из всех стран, млрд долл.

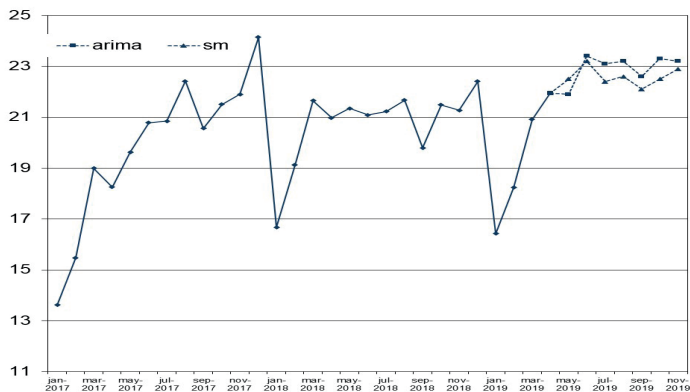


Рис. 13. Импорт из стран вне СНГ, млрд долл.

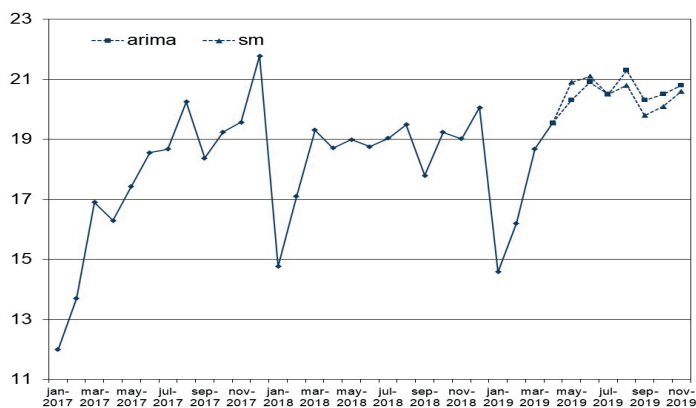


Рис. 14. Индекс потребительских цен, % к декабрю предыдущего года

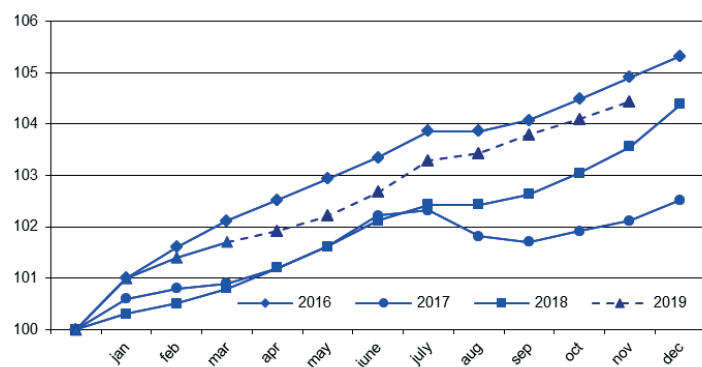


Рис. 14а. Индекс потребительских цен, % к декабрю предыдущего года (SM)

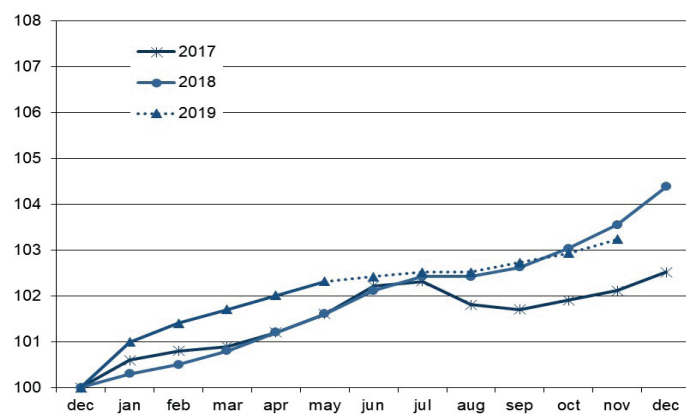


Рис. 15. Индекс цен производителей промышленных товаров, % к декабрю предыдущего года

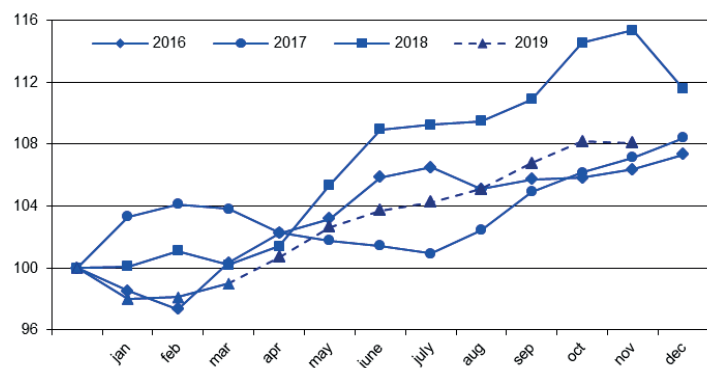


Рис. 16. Индекс цен в добыче полезных ископаемых, % к декабрю предыдущего года

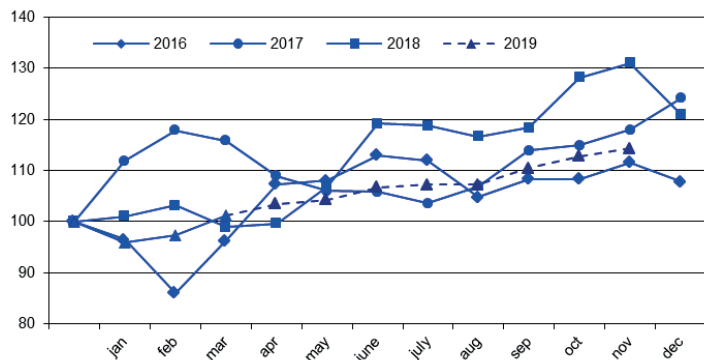


Рис. 17. Индекс цен в обрабатывающих производствах, % к декабрю предыдущего года

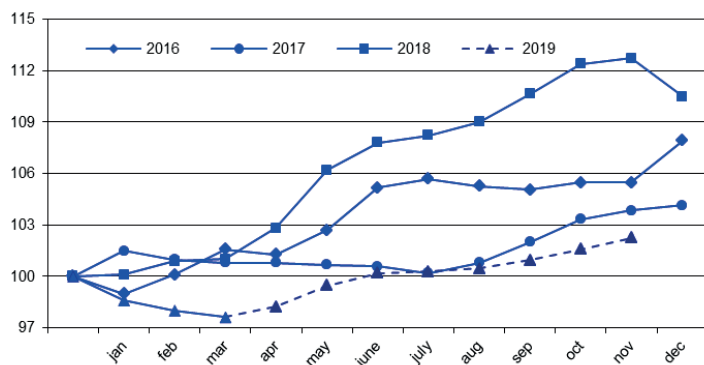


Рис. 18. Базисный индекс цен в обеспечении электрической энергией, газом и паром, % к декабрю предыдущего года

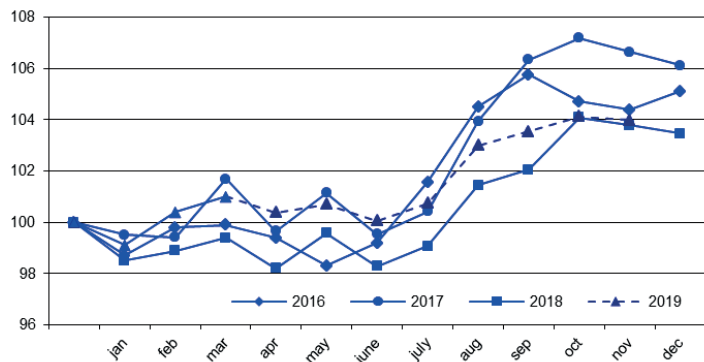


Рис. 19. Индекс цен в производстве пищевых продуктов, % к декабрю предыдущего года

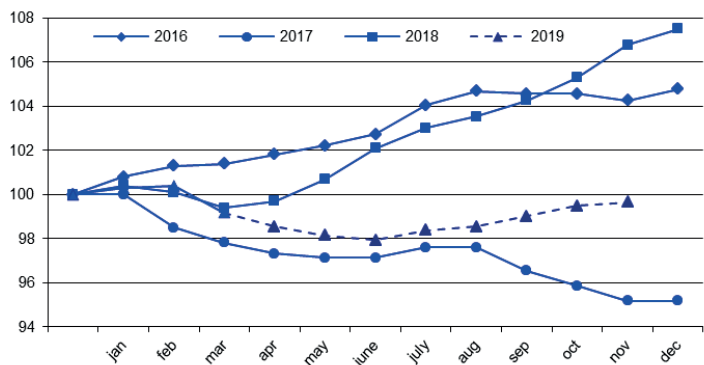


Рис. 20. Индекс цен в производстве текстильных изделий, % к декабрю предыдущего года

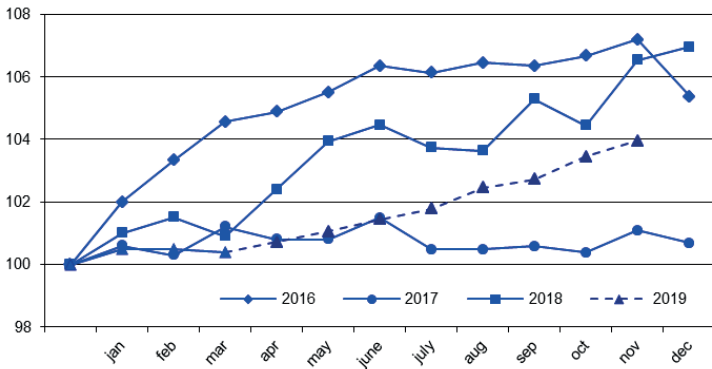


Рис. 21. Индекс цен в обработке древесины и производстве изделий из дерева, % к декабрю предыдущего года

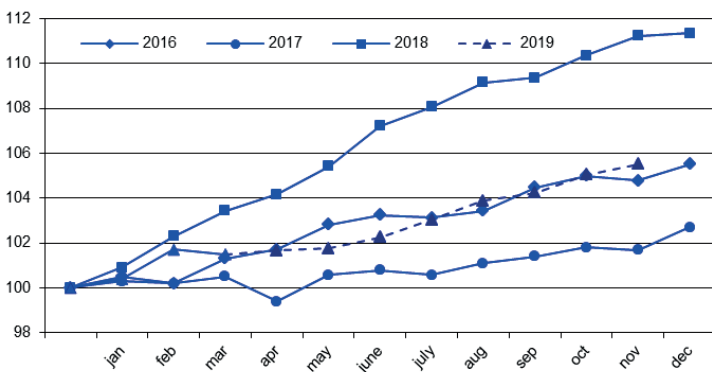


Рис. 22. Индекс цен в производстве бумаги и бумажных изделий, % к декабрю предыдущего года

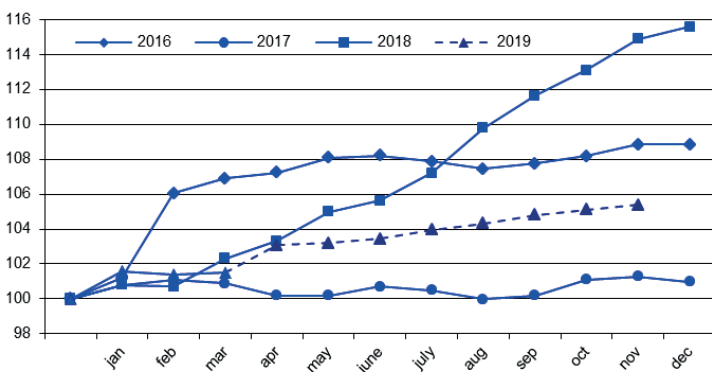


Рис. 23. Индекс цен в производстве кокса и нефтепродуктов, % к декабрю предыдущего года

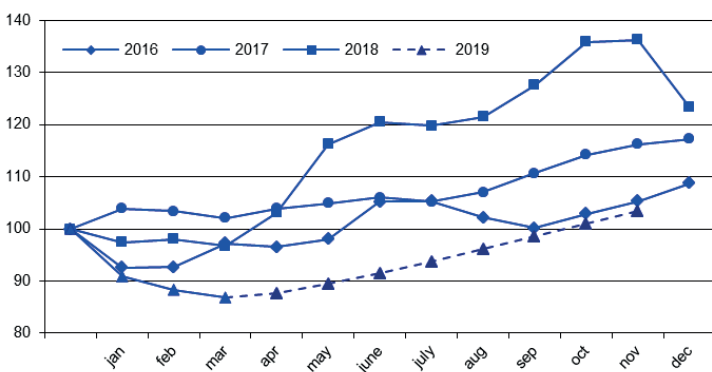


Рис. 24. Индекс цен в химическом производстве, % к декабрю предыдущего года

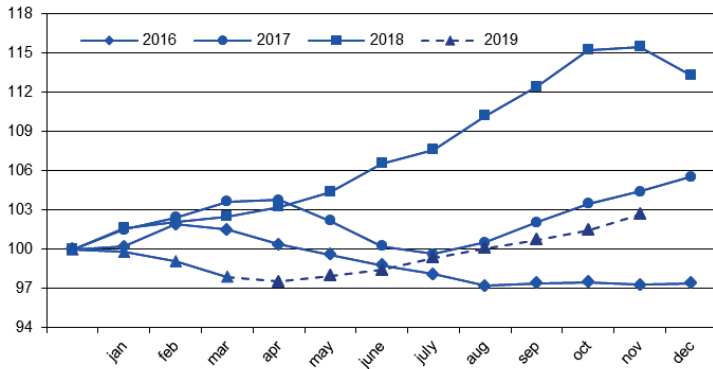


Рис. 25. Индекс цен в металлургическом производстве и производстве готовых металлических изделий, % к декабрю предыдущего года

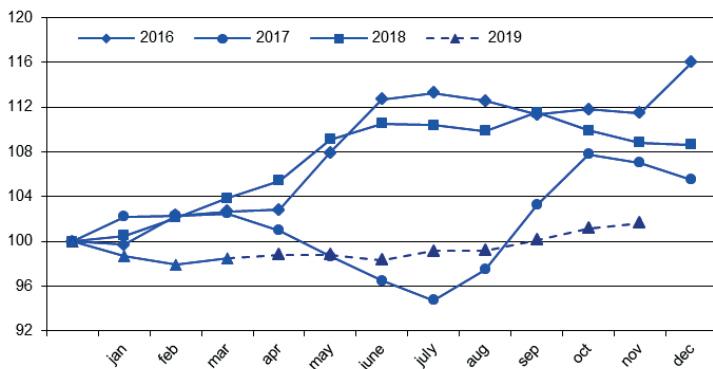


Рис. 26. Индекс цен в производстве машин и оборудования, % к декабрю предыдущего года

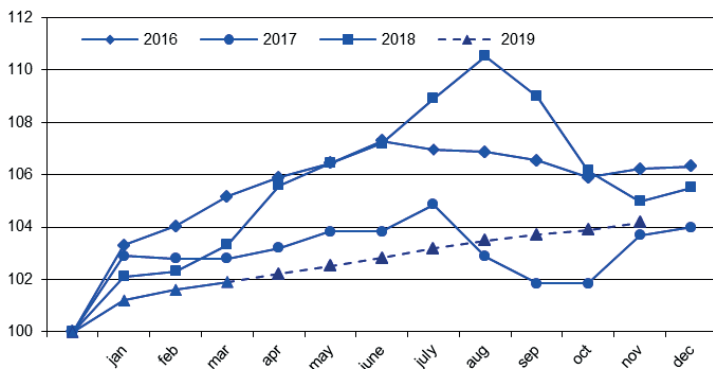


Рис. 27. Индекс цен в производстве автотранспортных средств и оборудования, % к декабрю предыдущего года

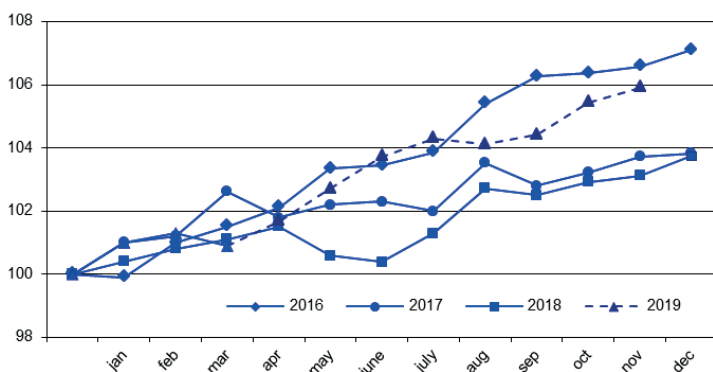


Рис. 28. Стоимость минимального набора продуктов питания на одного человека в месяц, руб.

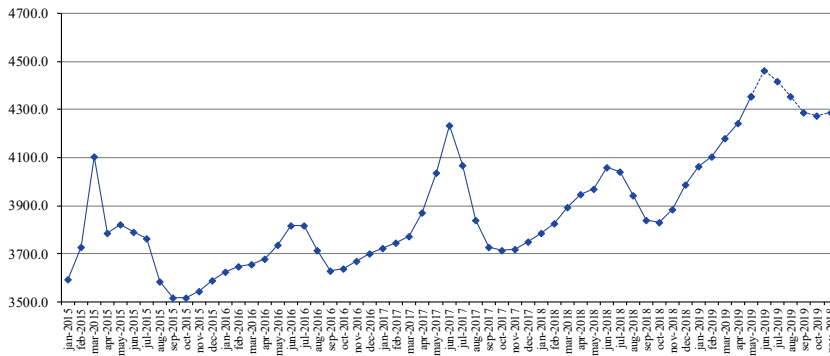


Рис. 29. Сводный индекс транспортных тарифов, для каждого года, % к предыдущему месяцу

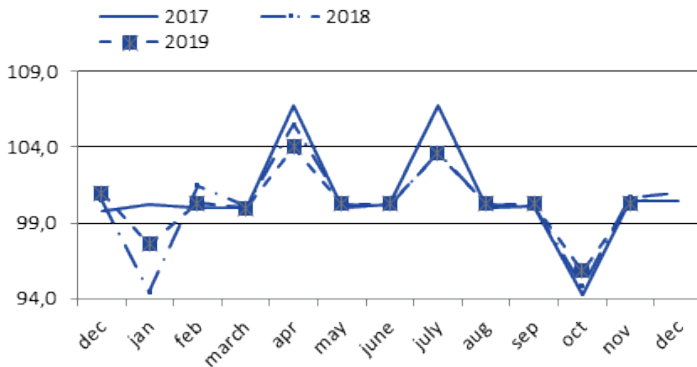


Рис. 30. Индекс тарифов на грузовые перевозки автомобильным транспортом, для каждого года, % к предыдущему месяцу

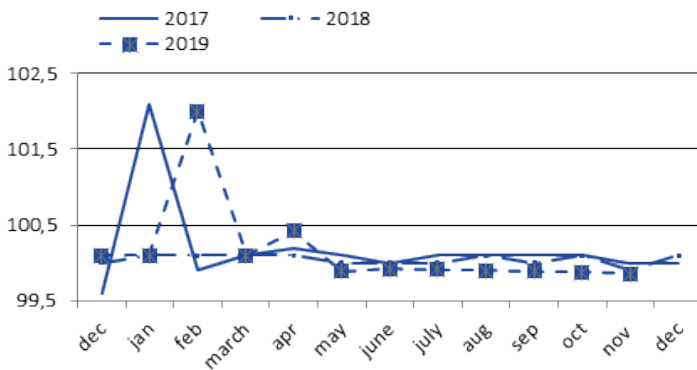


Рис. 31. Индекс тарифов на трубопроводный транспорт, для каждого года, % к предыдущему месяцу

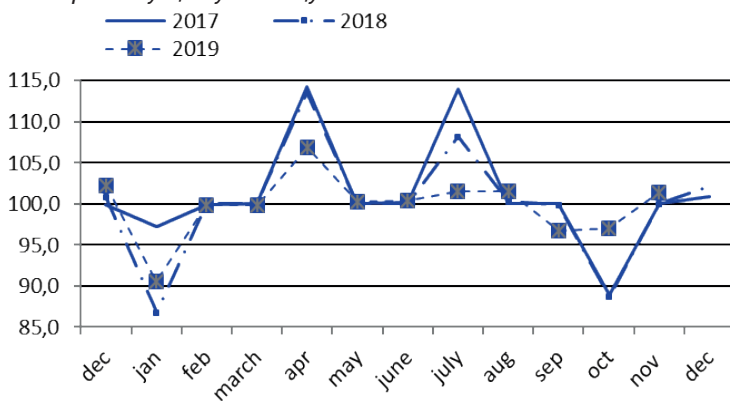


Рис. 32. Цена на нефть марки Brent, долл./барр.

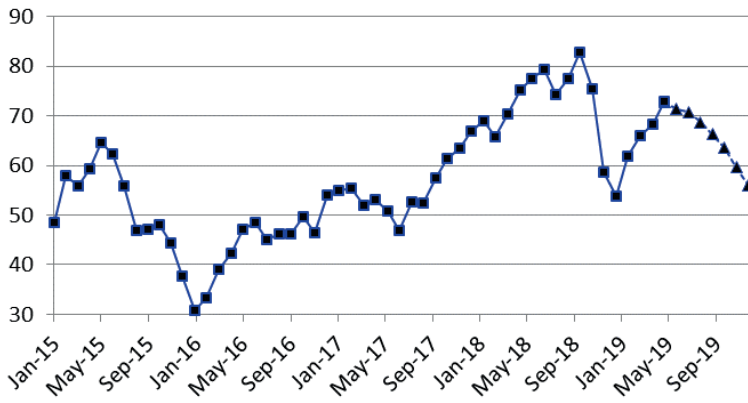


Рис. 33. Цены на алюминий, долл./т

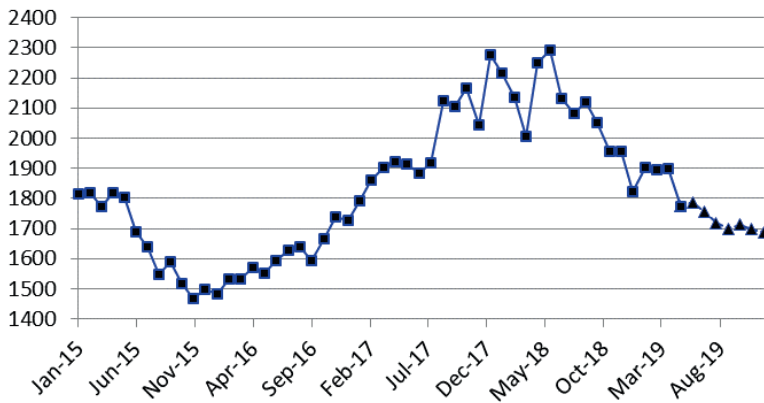


Рис. 34. Цены на золото, долл./унц.

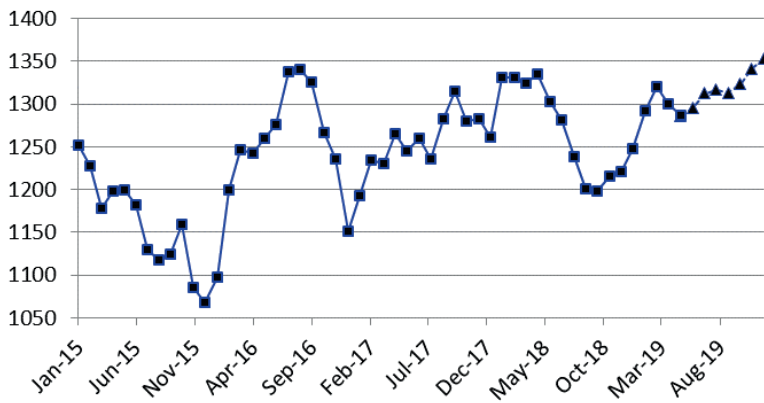


Рис. 35. Цены на никель, долл./т

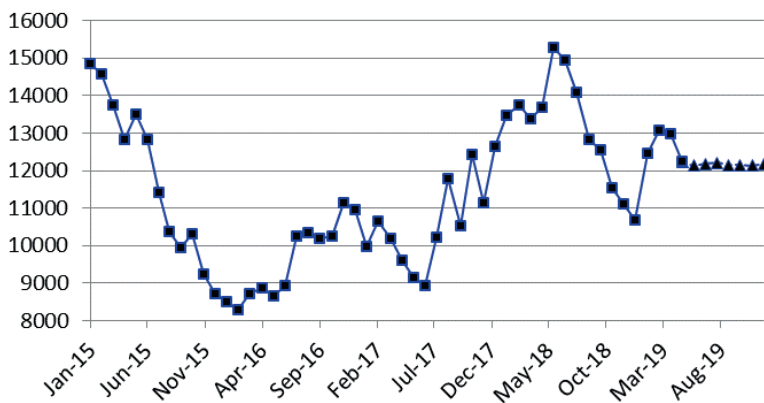


Рис. 36. Цены на медь, долл./т

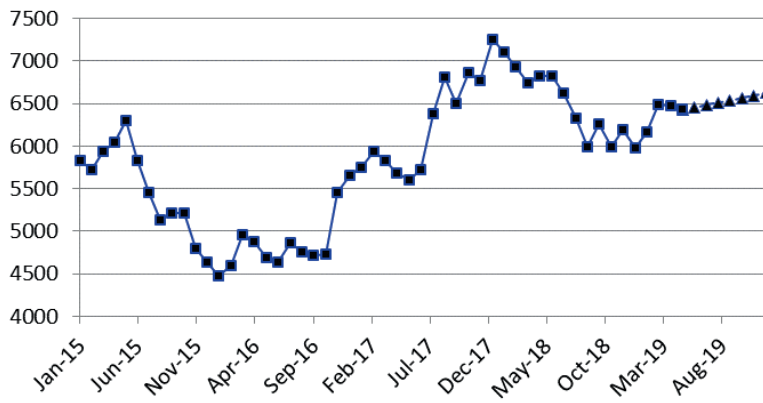


Рис. 37. Денежная база, млрд руб.

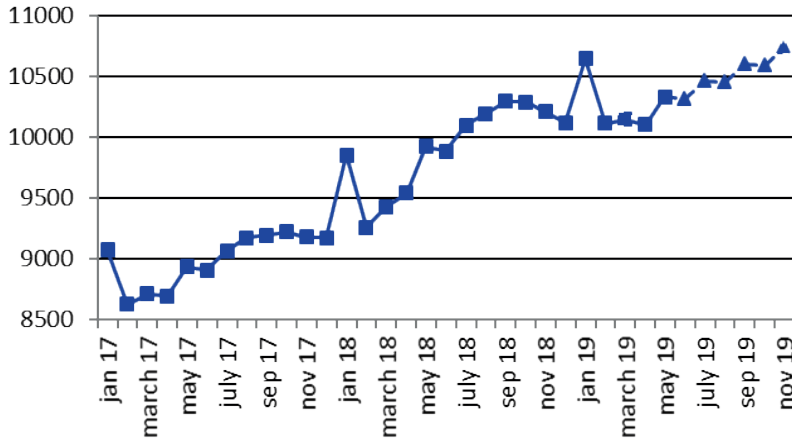


Рис. 38. M_2 , млрд руб.

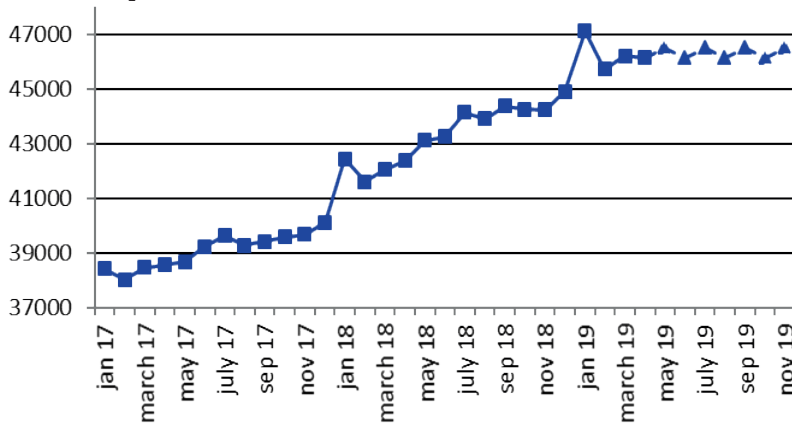


Рис. 39. Международные резервы РФ, млн долл. США

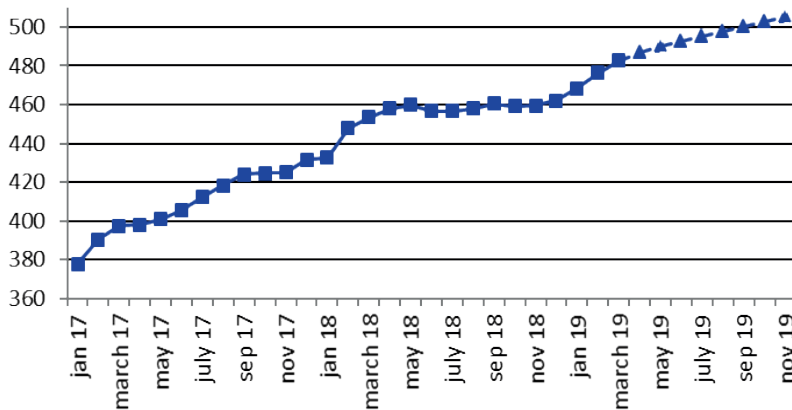


Рис. 40. Курс RUR/USD

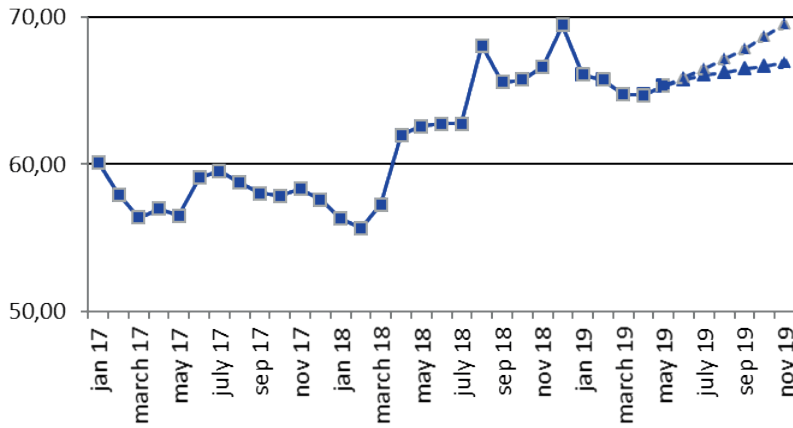


Рис. 41. Курс USD/EUR

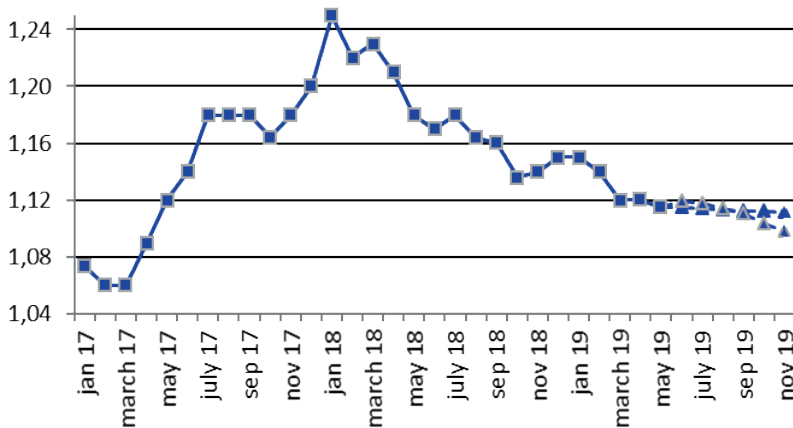


Рис. 42. Реальные располагаемые денежные доходы, % к соответствующему периоду предыдущего года

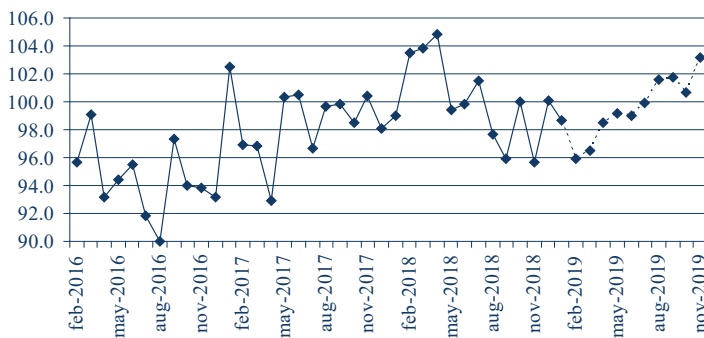


Рис. 43. Реальные денежные доходы, % к соответствующему периоду предыдущего года

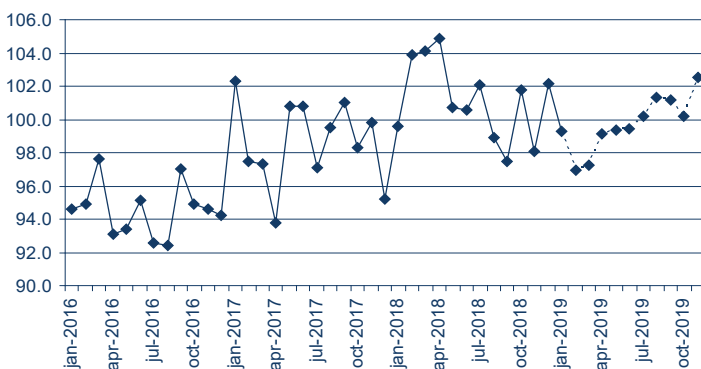


Рис. 44. Реальная начисленная заработная плата, % к соответствующему периоду предыдущего года

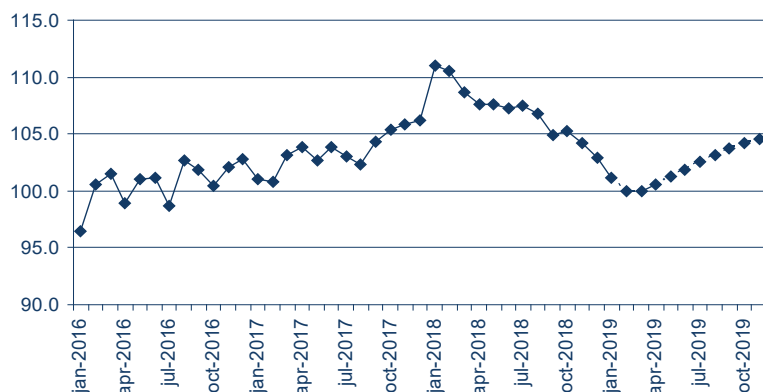


Рис. 45. Численность занятого в экономике населения, млн чел.



Рис. 46. Общая численность безработных, млн чел.



ОЦЕНКА КАЧЕСТВА КРАТКОСРОЧНЫХ ПРОГНОЗОВ НЕКОТОРЫХ РОССИЙСКИХ ЭКОНОМИЧЕСКИХ ПОКАЗАТЕЛЕЙ

Е. Астафьева, с.н.с., РАНХиГС,
М. Турунцева, зав. лабораторией, ИЭП им. Е.Т. Гайдара и РАНХиГС

В данной статье описываются результаты анализа качественных характеристик прогнозов индекса потребительских цен (ИПЦ), показателей реальной заработной платы, стоимости минимального набора продуктов питания, розничного товарооборота, численности занятых и общей численности безработных, ежемесячно публикуемых ениИнститутом экономической политики им. Е.Т. Гайдара¹ (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 март 2019 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 720 точек (120 прогнозных месяцев; по 6 прогнозов для каждого месяца). Результаты анализа представлены в *табл. 1*.

ИНДЕКС ПОТРЕБИТЕЛЬСКИХ ЦЕН

Средняя абсолютная процентная ошибка прогнозирования *индекса потребительских цен* на основе ARIMA-моделей составляет 0,4%. В соответствии с оценками качественных характеристик, прогнозы ИЭП предпочтительнее простейших прогнозов, причем результаты теста знаков (*табл. 1*) свидетельствуют о значимости преимуществ ARIMA-прогнозов в сравнении со всеми альтернативными методами.

Средняя абсолютная процентная ошибка прогнозирования индекса потребительских цен на основе структурных моделей также составляет 0,4%. По качественным характеристикам SM-прогнозы ИЭП также не уступают прогнозам, построенным альтернативными методами. Результаты теста знаков свидетельствуют о значимости различий SM-прогнозов и простейших прогнозов. Гипотеза об отсутствии значимых различий между SM-прогнозами и ARIMA-прогнозами не отвергается (значение статистики составило -0,37).

¹ См.: http://www.iep.ru/index.php?option=com_bibiet&Itemid=124&catid=123&lang=ru&task=showallbib. 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.

В соответствии с оценками, полученными по месяцам, ошибки прогнозирования данного показателя демонстрируют достаточно равномерную динамику. В последние 6 месяцев рассматриваемого периода прогнозы ИПЦ и по моделям временных рядов, и на основе структурных моделей характеризуются сокращением среднемесячной абсолютной процентной ошибки до уровня 0,2%. Средняя абсолютная процентная ошибка наивных прогнозов, наивных сезонных прогнозов, прогнозов, построенных на основе скользящего среднего, в эти полгода составляет 0,3%. Так что в октябре 2018 г. – марте 2019 г. лучшими по качественным характеристикам следует признать прогнозы ИЭП.

Таблица 1

ПРОСТЕЙШИЕ СТАТИСТИКИ КАЧЕСТВА ПРОГНОЗОВ И РЕЗУЛЬТАТЫ ТЕСТА ЗНАКОВ

		Индекс потребительских цен		Реальная заработная плата	Стоимость минимального набора продуктов питания	Розничный товарооборот	Численность занятого в экономике населения	Общая численность безработных	
		ARIMA	SM					ARIMA	KO
Прогнозы ИЭП	MAPE	0.36%	0.35%	3.87%	5.23%	3.63%	0.76%	7.51%	6.56%
	MAE	0.37	0.35	3.90	0.16	0.06	0.54	0.36	0.30
	RMSE	0.53	0.53	4.94	0.21	0.09	0.73	0.60	0.43
Наивные прогнозы	MAPE	0.49%		3.86%	6.07%	10.08%	1.52%	8.40%	
	MAE	0.49		3.92	0.19	0.21	1.08	0.39	
	RMSE	0.78		5.08	0.24	0.27	1.37	0.55	
	Z	-3.06	-8.42	-0.15	-6.26	-17.14	-12.82	-4.47	-10.58
		отв	отв	не отв	отв	отв	отв	отв	отв
Наивные сезонные прогнозы	MAPE	0.44%		6.40%	7.69%	7.90%	0.87%	10.90%	
	MAE	0.45		6.43	0.24	0.15	0.62	0.51	
	RMSE	0.68		7.82	0.29	0.17	0.77	0.69	
	Z	-4.92	-6.48	-10.58	-12.67	-16.85	-4.02	-12.37	-14.46
		отв	отв	отв	отв	отв	отв	отв	отв
Скользящее среднее	MAPE	0.40%		5.30%	6.71%	7.99%	0.99%	9.78%	
	MAE	0.41		5.32	0.21	0.17	0.71	0.45	
	RMSE	0.60		6.50	0.27	0.23	0.91	0.60	
	Z	-2.98	-2.68	-8.65	-7.98	-13.49	-5.52	-7.01	-11.33
		отв	отв	отв	отв	отв	отв	отв	отв

ИНДЕКС РЕАЛЬНОЙ ЗАРАБОТНОЙ ПЛАТЫ

В соответствии с качественными характеристиками прогнозов в рассматриваемом периоде средняя абсолютная процентная ошибка прогнозирования *индекса реальной заработной платы* составляет 3,9%. Результаты оценок свидетельствуют о том, что прогнозы ИЭП данного показателя уступают только наивным прогнозам, однако на основании теста знаков гипотеза о несущественности различий не отвергается, так что преимущества наивных прогнозов незначимы.

К концу рассматриваемого периода средние по месяцам ошибки прогнозов ИЭП *индекса реальной заработной платы* демонстрируют сокращение: средняя абсолютная процентная ошибка ARIMA-прогнозов в октябре 2018 г. – марте 2019 г. составляет 2,5%. В случае альтернативных методов прогнозирования расхождения между ожидаемыми и истинными значениями показателя в этот период составляют: 4,5% – для наивных прогнозов, 5,7% – для наивных сезонных прогнозов, 4,4% – для прогнозов, полученных на основе скользящего среднего. Так что в последние полгода лучшие качественные характеристики демонстрируют прогнозы ИЭП.

ДИНАМИКА СТОИМОСТИ МИНИМАЛЬНОГО НАБОРА ПРОДУКТОВ ПИТАНИЯ

Средняя абсолютная процентная ошибка прогнозирования *стоимости минимального набора продуктов питания* составляет 5,2%. Несмотря на достаточно высокий уровень расхождений между ожидаемыми и истинными значениями показателя, прогнозы ИЭП стоимости минимального набора продуктов питания превосходят по качественным характеристикам все альтернативные методы, и на основании теста знаков преимущества прогнозов, полученных по моделям временных рядов, значимы.

В последние полгода рассматриваемого периода среднемесячная абсолютная процентная ошибка ARIMA-прогнозов стоимости минимального набора продуктов питания демонстрирует снижение до уровня 3,3%. Средняя абсолютная процентная ошибка наивных прогнозов в этот период составляет 3,4%, наивных сезонных прогнозов – 5,6%, скользящего среднего – 3,7%. Так что наименьшие расхождения между ожидаемыми и истинными значениями показателя в октябре 2018 г. – марте 2019 г. демонстрируют прогнозы, полученные по моделям временных рядов.

РОЗНИЧНЫЙ ТОВАРООБОРОТ

В соответствии с оценками качественных характеристик средняя абсолютная процентная ошибка прогнозирования *объема розничного товарооборота* составляет 3,6%. Прогнозы ИЭП данного показателя существенно превосходят по качеству альтернативные методы. По результатам теста знаков при сравнении ARIMA-прогнозов и простейших прогнозов гипотеза об отсутствии значимых отличий отвергается, так что преимущества прогнозов ИЭП значимы.

Оценки, полученные по месяцам, свидетельствуют об улучшении качественных характеристик прогнозов ИЭП объема розничного товарооборота в последние полгода рассматриваемого периода. Среднемесячная абсолютная процентная ошибка ARIMA-прогнозов данного показателя в октябре 2018 г. – марте 2019 г. составляет 2,4%. Большинство простейших прогнозов в эти полгода, напротив, характеризуются увеличением расхождений между ожидаемыми и истинными значениями показателя: средняя абсолютная процентная ошибка наивных прогнозов в этот период составляет 10,5%, для наивных сезонных прогнозов – 6,8%, для прогнозов, полученных на основе скользящего среднего – 8,4%. Так что и в последние полгода лучшие качественные характеристики демонстрируют прогнозы ИЭП.

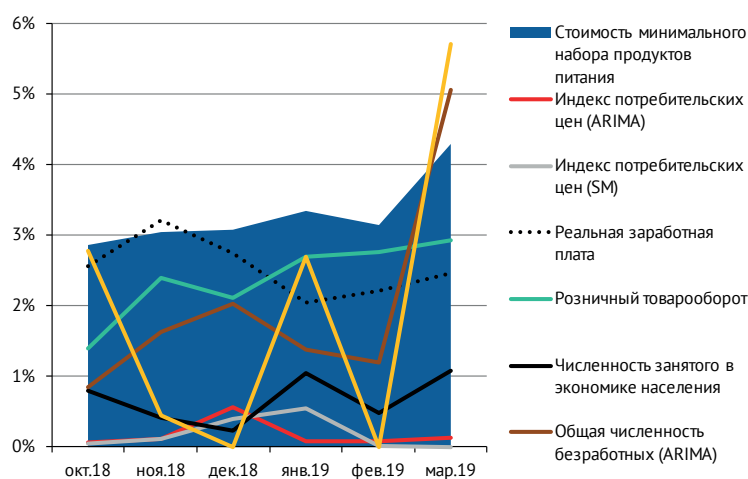


Рис. 1. Средняя абсолютная процентная ошибка прогнозов в октябре 2018 г. – марте 2019 г.

ПОКАЗАТЕЛИ ЧИСЛЕННОСТИ ЗАНЯТОГО В ЭКОНОМИКЕ НАСЕЛЕНИЯ ОБЩЕЙ ЧИСЛЕННОСТИ БЕЗРАБОТНЫХ

Средняя абсолютная процентная ошибка прогнозирования *численности занятого в экономике населения* составляет 0,8%. В рассматриваемом периоде прогнозы ИЭП для данного показателя демонстрируют лучшие качественные характеристики в сравнении с альтернативными методами прогно-

зирования. Результаты теста знаков свидетельствуют о значимых преимуществах ARIMA-прогнозов в сравнении со всеми простейшими прогнозами.

К концу рассматриваемого периода динамика средних по месяцам ошибок прогнозирования численности занятого в экономике населения демонстрирует снижение. В последние 6 месяцев среднемесячная абсолютная процентная ошибка ARIMA-прогнозов данного показателя уменьшилась до уровня 0,6%. В октябре 2018 г. – марте 2019 г. средняя за полгода абсолютная процентная ошибка наивных прогнозов численности занятых составляет 1,2%, наивных сезонных прогнозов – 0,5%, скользящего среднего – 0,9%. Так что в эти полгода ARIMA-прогнозы уступают по качественным характеристикам наивным сезонным прогнозам.

Существенно хуже качество ARIMA-прогнозов *общей численности безработных*, для которых абсолютная процентная ошибка прогнозирования составляет 7,5%. Но хотя значение ошибки достаточно велико, для данного показателя прогнозы ИЭП демонстрируют лучшие качественные характеристики в сравнении с простейшими методами, причем по результатам теста знаков преимущества ARIMA-прогнозов по отношению ко всем альтернативным методам значимы.

Средняя абсолютная процентная ошибка прогнозирования численности безработных на основе конъюнктурных опросов ниже и составляет 6,6%. По качественным характеристикам КО-прогнозы ИЭП также не уступают простейшим прогнозам. Результаты теста знаков свидетельствуют о значимых преимуществах КО-прогнозов в сравнении со всеми альтернативными методами прогнозирования. Гипотеза об отсутствии значимых различий между ARIMA-прогнозами и КО-прогнозами также отвергается (значение статистики составило -2,61), так что можно считать КО-прогнозы значимо лучшими.

В октябре 2018 г. – марте 2019 г. среднемесячная абсолютная процентная ошибка прогнозов ИЭП общей численности безработных снизились, составив для прогнозов на основе моделей временных рядов 2,0%, прогнозов на основе конъюнктурных опросов – 1,9%. Альтернативные методы в эти полгода также демонстрируют улучшение качественных характеристик: средняя абсолютная процентная ошибка наивных прогнозов составляет 3,7%, наивных сезонных прогнозов – 6,0%, скользящего среднего – 3,4%. Так что, в октябре 2018 г. – марте 2019 г. наименьшие расхождения между ожидаемыми и истинными значениями показателя демонстрируют прогнозы ИЭП.

В целом, можно говорить о том, что прогнозы ИЭП обладают хорошим качеством: у трех из восьми прогнозов MAPE не превышает 1%, у двух – не превышает 5%, у остальных – не превышает 10%. За исключением индекса реальной заработной платы прогнозы ИЭП превосходят простейшие альтернативные методы прогнозирования по своему качеству, и во всех случаях эти различия оказываются значимыми. В последние полгода рассматриваемого интервала (октябрь 2018 г. – март 2019 г.) прогнозы ИЭП всех показателей демонстрируют улучшение качества.

«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

Г.И. Идрисов, руководитель 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