

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 октябре 2019 г. – марте 2020 г.¹, построенные на основе моделей временных рядов, разработанных в результате исследований, проводимых в течение последних нескольких лет в ИЭП им. Е.Т. Гайдара². 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 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 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 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.

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 результатов конъюнктурных опросов ИЭП им. Е.Т. Гайдара. Эмпирические исследования показывают², что использование рядов конъюнктурных опросов в прогностических моделях в качестве

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.

объясняющих 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 октябрь 2019 г. – март 2020 г. были использованы ряды месячных индексов промышленного производства Федеральной службы государственной статистики (Росстата) с января 2002 г. по июль 2019 г. и ряды базисных индексов промышленного производства Научно-исследовательского университета Высшей школы экономики (НИУ ВШЭ)² за период с января 2010 г. по август 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 октябре 2019 г. – марте 2020 г. по сравнению с аналогичным периодом предыдущего года по промышленности в целом составляет 2,3%. Для индекса промышленного производства НИУ ВШЭ данный показатель также составляет 2,3%. По итогам 2019 г. прогнозируемый годовой рост индекса промышленного производства Росстата составит 2,5%, рост индекса промышленного производства НИУ ВШЭ – 2,6%.

Среднемесячное увеличение индекса промышленного производства в добыче полезных ископаемых Росстата и НИУ ВШЭ в октябре 2019 г. – марте 2020 г. составляет 1,1 и 1,2% соответственно.

Средний темп прироста индекса промышленного производства в обрабатывающей промышленности Росстата по сравнению с аналогичным периодом предыдущего года в октябре 2019 г. – марте 2020 г. составляет 2,0%, индекса НИУ ВШЭ – 1,3%. Среднемесячное увеличение индекса промышленного производства в производстве пищевых продуктов Росстата и НИУ ВШЭ составляет соответственно 3,4 и 3,3%. В производстве кокса и нефтепродуктов средний прирост прогнозируется на уровне 2,3 и 1,9% для индексов Росстата и НИУ ВШЭ соответственно. Среднемесячное изменение индексов промышленного производства Росстата и НИУ ВШЭ для металлургического производства в октябре 2019 г. – марте 2020 г. составляет соответственно 2,5 и 3,8%. В производстве машин и оборудования средний рост прогнозируется на уровне -1,2 и -2,9% для индексов Росстата и НИУ ВШЭ соответственно.

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	КО	НИУ ВШЭ	Ростат	НИУ ВШЭ	Ростат	НИУ ВШЭ	Ростат	НИУ ВШЭ	Ростат	НИУ ВШЭ	Ростат		
															НИУ ВШЭ	Ростат
Окт.19	2,8	1,6	2,8	1,6	1,6	0,8	1,3	1,2	5,3	2,3	2,8	-3,1	3,2	-4,3	4,2	
Ноя.19	2,6	0,9	3,1	1,1	1,5	0,8	2,1	1,2	0,3	4,3	0,4	1,2	3,8	2,9	-0,8	
Дек.19	2,8	2,6	2,5	2,6	1,1	0,8	2,1	0,7	-1,3	2,7	0,0	7,9	3,2	2,2	-17,6	
Янв.20	2,6	1,8	2,1	1,9	1,1	1,8	2,9	0,7	-0,6	4,8	1,5	2,6	3,5	3,2	2,8	
Фев.20	1,9	1,6	2,0	1,2	1,0	1,3	1,0	0,7	-0,9	3,0	1,8	-2,1	5,3	-8,8	-10,1	
Мар.20	3,1	3,7	2,9	4,1	1,1	1,3	2,4	3,6	0,9	4,7	1,8	8,7	3,5	-2,2	3,8	
Прогнозируемый прирост к соответствующему месяцу предшествующего года																
Окт.18	3,7	4,7	4,7	5,4	2,7	7,4	2,7	5,7	-3,2	6,9	4,6	1,5	0,3	19,6	6,2	-6,2
Ноя.18	2,4	3,8	3,8	6,0	0,0	7,8	0,0	2,7	2,4	6,6	1,4	0,3	2,9	7,2	2,5	-1,3
Дек.18	2,0	4,8	4,8	5,7	0,0	6,3	0,0	4,2	4,5	-1,8	3,5	0,2	3,5	-8,3	0,2	-6,2
Янв.19	1,1	2,3	2,3	4,3	-1,0	4,8	-1,0	1,2	1,3	2,8	1,2	1,2	1,2	2,3	2,1	-10,6
Фев.19	4,1	3,4	3,4	4,2	4,6	5,1	4,6	4,3	-1,1	7,7	2,5	5,2	3,9	10,3	1,6	24,4
Мар.19	1,2	0,3	0,3	4,1	0,3	4,3	0,3	-0,5	-4,8	3,3	1,1	-0,4	-1,9	-6,4	-0,3	3,3

Справочно: фактический прирост 2018-2019 гг. к соответствующему месяцу 2017-2018 гг.

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.

Средний прирост индекса промышленного производства в обеспечении электрической энергией, газом и паром; кондиционировании воздуха Росстата в октябре 2019 г. – марте 2020 г. по сравнению с тем же периодом предыдущего года составляет 0,1%; аналогичный показатель для индекса НИУ ВШЭ – 0,3%. В среднем (по видам экономической деятельности) рост индексов промышленного производства Росстата в 2019 г. составит 2,1%, рост индексов промышленного производства НИУ ВШЭ – -1,3%.

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 сентябрь 2019 г.

Из табл. 2 следует, что средний прогнозируемый прирост объемов месячного товарооборота в период с октября 2019 г. по март 2020 г. по отношению к соответствующему периоду 2018–2019 гг. составляет около 3,2%. Средний прогнозируемый прирост месячного реального товарооборота составляет 1,6%.

В годовом исчислении прогнозируемое увеличение показателя розничного товарооборота в 2019 г. в номинальном выражении – 4,9%, в реальном – 2,2%.

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 сентябрь 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 октябрь 2019 г. – март 2020 г. по отношению к аналогичному периоду 2018–2019 гг. составит 3,7, 8,5, 6,0 и 6,2% соответственно. Средний прогнозируемый объем сальдо торгового баланса со всеми странами за рассматриваемый период составит 102,1 млрд долл., что соответствует снижению на 1,9% по отношению к тому же периоду 2018–2019 гг.

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

Таблица 2

Результаты расчетов прогнозных значений объема розничного товарооборота и реального розничного товарооборота

Прогнозируемые значения по ARIMA-модели		
	Розничный товарооборот, млрд руб. (в скобках – прирост к соответствующему месяцу предыдущего года, %)	Реальный розничный товарооборот (в % к соответствующему периоду предыдущего года)
Окт.19	2883,9 (5,1)	102,0
Ноя.19	2897,6 (4,9)	102,4
Дек.19	3475,3 (4,9)	102,0
Янв.20	2619,8 (4,7)	101,8
Фев.20	2561,2 (4,6)	100,8
Мар.20	2725,4 (2,1)	100,5
Справочно: фактические значения за аналогичные месяцы 2018–2019 гг.		
Окт.18	2744,9	102,2
Ноя.18	2762,8	103,3
Дек.18	3311,6	102,7
Янв.19	2502,8	102,0
Фев.19	2448,0	102,1
Мар.19	2670,2	107,1

Примечание. Ряды розничного товарооборота и реального розничного товарооборота на интервале с января 1999 г. по сентябрь 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.

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.)		в % от фактических данных за соответствующий месяц шестьющего года		прогнозные значения (млрд долл. в мес.)		в % от фактических данных за соответствующий месяц шестьющего года		прогнозные значения (млрд долл. в мес.)		в % от фактических данных за соответствующий месяц шестьющего года		прогнозные значения (млрд долл. в мес.)		в % от фактических данных за соответствующий месяц шестьющего года	
	ARIMA	SM	ARIMA	SM												
Окт.19	37,2	38,3	90	93	23,4	22,4	109	104	33,3	34,3	93	96	20,6	19,6	107	102
Ноя.19	39,4	40,1	98	100	22,6	23,0	106	108	35,4	36,6	100	103	19,9	20,0	105	105
Дек.19	43,6	42,1	107	103	24,5	22,7	109	101	36,5	39,1	102	109	21,6	21,0	108	105
Янв.20	35,8	36,0	116	117	19,1	18,4	116	112	31,0	32,3	114	119	16,9	15,4	116	106
Фев.20	36,0	37,9	104	109	20,8	20,5	114	112	32,7	33,4	108	110	17,4	17,9	107	110
Мар.20	39,6	40,3	107	109	21,9	22,9	104	109	35,6	36,9	111	115	19,8	18,9	106	101
Справочно: фактические значения за соответствующие месяцы 2018–2019 гг., млрд долл.																
Окт.18	41,3				21,5				35,8				20,6		19,2	
Ноя.18	40,3				21,3				35,5				20,0		19,0	
Дек.18	40,8				22,4				35,8				21,0		20,1	
Янв.19	30,8				16,4				27,2				15,4		14,6	
Фев.19	34,7				18,2				30,3				17,9		16,2	
Мар.19	37,0				21,0				32,2				18,9		18,7	

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

	Индекс потребительских цен (ARIMA)	Индекс потребительских цен (SM)	Индекс потребительских цен (FM)	Индексы цен производителей:										химическое производство	металлургическое производство	производство машин и оборудования	производства автотранспортных средств		
				Индекс промышленных товаров (ARIMA)	Индекс промышленных товаров (КО)	Индекс 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)																			
Окт.19	100,2	100,1	100,6	100,9	101,2	100,5	101,4	100,5	100,6	100,4	100,5	100,5	100,3	100,3	102,9	99,5	101,0	100,2	101,0
Ноя.19	100,3	100,3	100,4	99,7	100,5	100,5	99,2	99,8	99,9	100,1	100,5	100,5	100,2	100,3	102,2	99,1	100,4	100,2	100,4
Дек.19	100,5	100,3	100,5	99,4	99,2	100,7	96,8	99,5	99,9	100,3	100,0	99,8	100,5	100,5	99,5	98,9	100,2	100,3	100,6
Янв.20	101,4	100,3	100,5	100,2	99,9	100,2	100,0	100,1	99,9	100,4	100,4	100,3	100,6	100,6	97,2	100,6	100,7	101,4	100,1
Фев.20	100,7	100,2	100,5	100,6	100,0	100,5	102,1	100,1	101,5	100,1	100,5	100,4	100,4	100,4	102,3	100,7	101,3	100,9	100,2
Мар.20	100,4	100,2	100,5	100,9	100,4	100,7	98,1	100,3	100,5	100,4	100,4	100,3	100,4	100,4	102,1	99,9	99,7	100,3	100,5
Прогнозные значения (в % к декабрю 2018/2019 г.)																			
Окт.19	102,8	102,1	103,9	99,6	99,1	98,1	92,3	100,6	106,0	100,1	102,4	98,8	99,1	99,5	96,9	101,9	102,9	103,8	
Ноя.19	103,1	102,4	104,3	99,3	99,6	98,6	91,6	100,4	105,9	100,2	103,0	99,0	99,4	101,7	96,1	102,3	103,1	104,2	
Дек.19	103,7	102,7	104,8	98,7	98,8	99,3	88,6	99,9	105,8	100,5	103,0	98,9	99,9	101,1	95,0	102,6	103,4	104,8	
Янв.20	101,4	100,3	100,5	100,2	99,9	100,2	100,0	100,1	99,9	100,4	100,4	100,3	100,6	97,2	100,6	100,7	101,4	100,1	
Фев.20	102,0	100,5	101,0	100,8	99,9	100,7	102,1	100,3	101,4	100,5	100,9	100,7	101,0	99,5	101,3	102,0	102,3	100,3	
Мар.20	102,5	100,7	101,5	101,7	99,6	101,4	100,1	100,5	101,9	101,0	101,3	101,0	101,5	101,6	101,2	101,7	102,7	100,8	
Справочно: фактические значения за аналогичные периоды 2018/2019 г. (в % к декабрю 2017/2018 г.)																			
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	
Дек.18		104,4		111,6			121,0	110,5	103,5	107,5	107,0	111,3	115,6	123,4	113,3	108,6	105,5	103,7	
Янв.19		101,0		98,0			95,9	98,6	99,1	100,3	100,5	100,4	101,6	90,9	99,8	98,7	101,2	101,0	
Фев.19		101,4		98,1			97,3	98,0	100,4	100,4	100,5	101,7	101,4	88,4	99,1	97,9	101,6	101,3	
Мар.19		101,7		99,0			101,2	97,6	101,0	99,2	100,4	101,5	101,5	86,9	97,9	98,5	101,9	100,9	

Примечание. На интервале с января 1999 г. по сентябрь 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.

на интервале с января 1999 г. по сентябрь 2019 г.¹. В табл. 4 приведены результаты модельных расчетов прогнозных значений в октябре 2019 г. – марте 2020 г. по ARIMA-моделям, структурным моделям (SM) и моделям, построенным с использованием конъюнктурных опросов (КО).

Прогнозируемый среднемесячный прирост индекса потребительских цен в октябре 2019 г. – марте 2020 г. составит 0,4%. Прирост цен производителей промышленных товаров за указанный период прогнозируется в среднем на уровне 0,3% в месяц. Годовой прирост индекса потребительских цен в среднем по двум моделям составит 3,7%. Аналогичный показатель для индекса цен производителей прогнозируется на уровне -1,1%.

Для индексов цен производителей Росстата с октября 2019 г. по март 2020 г. прогнозируются следующие средние темпы роста в месяц: -0,4% – в добыче полезных ископаемых, 0,1% – в обрабатывающих производствах, 0,4% – в обеспечении электрической энергией, газом и паром, 0,3% – в производстве пищевых продуктов, 0,4% – в производстве текстильных изделий, 0,2% – в обработке древесины и производстве изделий из дерева, 0,4% – в производстве бумаги и бумажных изделий, 1,0% – в производстве кокса и нефтепродуктов, -0,2% – в химическом производстве, 0,6% – в металлургическом производстве, 0,6% – в производстве машин и оборудования и 0,5% – в производстве автотранспортных средств.

Годовой прирост индексов цен производителей по видам экономической деятельности составит в среднем 0,3%. По итогам 2019 г. максимальный годовой прирост прогнозируется в обеспечении электрической энергией, газом и паром (5,8%), минимальный – в добыче полезных ископаемых (-11,4%).

Динамика стоимости минимального набора продуктов питания

В данном разделе представлены результаты расчетов прогнозируемых значений стоимости минимального набора продуктов питания в октябре 2019 г. – марте 2020 г. Прогнозы строились на основе временных рядов по данным Росстата за период с января 2000 г. по сентябрь 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 4138,0 руб. Прогнозируемый рост стоимости минимального набора продуктов питания составляет в среднем около 3,2% по сравнению с уровнем соответствующего периода прошлого года. Годовой прирост стоимости минимального набора продуктов питания в 2019 г. составит 3%.

Индексы транспортных тарифов на грузовые перевозки

В данном разделе представлены расчеты прогнозных значений индексов цен транспортных тарифов на грузовые

Таблица 5

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

Прогнозируемые значения по ARIMA-модели, руб.	
Окт.19	4022,6
Ноя.19	4052,6
Дек.19	4107,7
Янв.20	4167,1
Фев.20	4209,3
Мар.20	4268,8
Справочно: фактические значения за аналогичные месяцы 2018–2019 гг., млрд руб.	
Окт.18	3833,2
Ноя.18	3883,5
Дек.18	3989,2
Янв.19	4065,7
Фев.19	4103,9
Мар.19	4179,8
Прогнозируемый прирост к соответствующему месяцу предыдущего года, %	
Окт.19	4,9
Ноя.19	4,4
Дек.19	3,0
Янв.20	2,5
Фев.20	2,6
Мар.20	2,1

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

¹ Структурные модели оценивались на интервале с октября 1998 г.

перевозки¹, полученные на основе моделей временных рядов, оцененных по данным Росстата на интервале с сентября 1998 г. по август 2019 г. В табл. 6 приведены результаты модельных расчетов прогнозных значений в октябре 2019 г. – марте 2020 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 октябрь 2019 г. – март 2020 г. сводный индекс транспортных тарифов на грузовые перевозки в течение этих шести месяцев будет снижаться со среднемесячным темпом -0,6%. При этом в октябре 2019 г. ожидается сезонное снижение индекса на -4,3 п.п. В результате его годовой прирост в 2019 г. составит 2,1%.

Индекс тарифов на грузовые перевозки автомобильным транспортом в течение данных шести месяцев будет расти со среднемесячным темпом 0,1%. Его годовой прирост в 2019 г. прогнозируется на уровне 1,8%.

Индекс тарифов на трубопроводный транспорт в течение следующих шести месяцев будет расти со среднемесячным темпом 0,1%. В результате его годовое снижение в 2019 г. составит 0,9%.

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 октябре 2019 г. – марте 2020 г., полученные на основе нелинейных моделей временных рядов, оцененных по данным МВФ на интервале с января 2000 г. по август 2019 г.

Средний прогнозируемый уровень цен на нефть составляет около 54,2 долл./барр., что ниже соответствующих показателей прошлого года в среднем на 14,3%. Цены на алюминий прогнозируются на уровне около 1702 долл./т, а их среднее прогнозируемое снижение составляет приблизительно 11% по сравнению с соответствующим уровнем прошлого года. Прогноз цен на золото составляет

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)			
Окт.19	95,7	99,9	97,3
Ноя.19	100,2	99,9	102,0
Дек.19	100,2	99,9	101,5
Янв.20	100,2	101,4	99,3
Фев.20	100,1	99,8	99,5
Мар.20	100,1	99,8	101,2
Прогнозные значения по ARIMA-моделям (в % к декабрю предыдущего года)			
Окт.19	101,8	102,1	99,9
Ноя.19	101,9	101,9	97,2
Дек.19	102,1	101,8	99,1
Янв.20	100,2	101,4	99,3
Фев.20	100,3	101,2	98,7
Мар.20	100,4	101,1	98,2
Справочно: фактические значения за аналогичный период 2018–2019 гг. (в % к предыдущему месяцу)			
Окт.18	94,8	100,1	88,7
Ноя.18	100,7	99,9	100,0
Дек.18	101,0	100,1	102,2
Янв.19	97,6	100,1	90,5
Фев.19	100,3	102,0	99,9
Мар.19	100,0	100,1	99,8

Примечание. На интервале с сентября 1998 г. по август 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 август 2019 г.; для всех рядов использовались фиктивные переменные для учета особых 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

	Нефть марки Brent, долл./ барр.	Алюминий, долл./ т	Золото, долл./ унц.	Медь, долл./ т	Никель, долл./ т
Прогнозные значения по ARIMA-моделям					
Окт.19	57,73	1722	1544	5540	19991
Ноя.19	56,60	1705	1563	5536	20428
Дек.19	54,71	1695	1590	5535	20955
Янв.20	53,38	1702	1610	5548	21278
Фев.20	52,15	1697	1622	5567	21593
Мар.20	50,86	1692	1638	5589	21683
Приросты к соответствующему месяцу предыдущего года, %					
Окт.19	-23,5	-12,0	27,1	-7,6	73,2
Ноя.19	-3,6	-12,9	28,0	-10,7	84,1
Дек.19	1,7	-7,0	27,4	-7,5	96,3
Янв.20	-13,8	-10,5	24,6	-10,0	70,7
Фев.20	-21,0	-10,4	22,8	-14,1	65,3
Мар.20	-25,6	-10,9	25,9	-13,7	66,9
Справочно: фактические значения за аналогичный период 2018–2019 гг.					
Окт.18	75,47	1956	1215	5998	11543
Ноя.18	58,71	1958	1221	6197	11098
Дек.18	53,8	1823	1248	5981	10678
Янв.19	61,89	1901	1292	6165	12468
Фев.19	66,03	1895	1320	6483	13063
Мар.19	68,39	1900	1301	6476	12995

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

около 1594 долл./унц. Средние прогнозируемые цены на медь составляют около 5552 долл./т, а на никель – около 20988 долл./т. Средний прогнозируемый прирост цен на золото составляет около 26%, среднее снижение цен на медь – около 11%, средний прирост цен на никель – 76% по сравнению с соответствующим уровнем прошлого года.

На конец 2019 г. прогнозируемый прирост цен на нефть, золото и никель по сравнению с концом 2018 г. составит 1,7, 27,4 и 96,3% соответственно. Прогнозируемое падение цен на алюминий и никель – 7 и 7,5% соответственно.

ДЕНЕЖНЫЕ ПОКАЗАТЕЛИ

Будущие значения денежной базы (в узком определении – наличные деньги и ФОР) и денежного агрегата M_2 в октябре 2019 г. – марте 2020 г. получены на основе моделей временных рядов соответствующих показателей, рассчитываемых ЦБ РФ¹, на интервале с октября 1998 г. по сентябрь 2019 г. В табл. 8 приводятся результаты расчетов прогнозных значений и фактические значения этих показателей за аналогичный период предыдущего года. Необходимо отметить,

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, %
Окт.19	10556	0,4	47404	-0,4
Ноя.19	10690	1,3	47583	0,4
Дек.19	10691	0,0	48114	1,1
Янв.20	11199	4,8	49005	1,9
Фев.20	10835	-3,3	48838	-0,3
Мар.20	10976	1,3	49001	0,3
Справочно: фактические значения за соответствующие месяцы 2018 г. (прирост к предыдущему месяцу, %)				
Окт.18	0,0		-0,3	
Ноя.18	-0,8		-0,1	
Дек.18	-0,9		1,5	
Янв.19	5,2		4,9	
Фев.19	-5,0		-2,9	
Мар.19	0,3		1,1	

Примечание. Временной ряд значений денежной базы на интервале с октября 1998 г. по сентябрь 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 сентябрь 2019 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.

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 октябре 2019 г. – марте 2020 г. денежная база будет расти со среднемесячным темпом 0,8%. Годовой прирост денежной базы в 2019 г. составит по прогнозам 5,8%. В январе 2020 г. планируется сезонный рост денежной базы на 4,8%.

В рассматриваемый период времени денежный показатель M_2 будет расти со среднемесячным темпом 0,5. Годовой прирост показателя M_2 в 2019 г. прогнозируется на уровне 7,1%. В январе 2020 г. планируется сезонный рост денежного показателя M_2 на 1,9%.

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 октября 1998 г. по сентябрь 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 октябре 2019 г. – марте 2020 г. международные резервы будут расти со среднемесячным темпом 0,6%. В 2019 г. прогнозируется прирост международных резервов на 15,3%.

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

Таблица 9
Прогноз международных резервов

	Прогнозные значения по ARIMA-моделям	
	млрд долл. США	прирост к предыдущему месяцу, %
Окт.19	533,6	0,9
Ноя.19	534,1	0,1
Дек.19	537,6	0,7
Янв.20	541,1	0,6
Фев.20	544,0	0,5
Мар.20	547,0	0,5
Справочно: фактические значения за аналогичный период 2018–2019 гг.		
Окт.18	459,2	-0,3
Ноя.18	459,6	0,1
Дек.18	462,1	0,6
Янв.19	468,5	1,4
Фев.19	475,9	1,6
Мар.19	482,6	1,4

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

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
Окт.19	63,94	63,94	1,12	1,12
Ноя.19	63,43	63,76	1,11	1,10
Дек.19	63,77	64,29	1,11	1,11
Янв.20	63,90	64,69	1,11	1,10
Фев.20	64,10	65,10	1,11	1,10
Мар.20	64,27	65,50	1,11	1,10
Справочно: фактические значения за аналогичный период 2018–2019 гг.				
Окт.18	65,77		1,14	
Ноя.18	66,63		1,14	
Дек.18	69,47		1,15	
Янв.19	66,10		1,15	
Фев.19	65,76		1,14	
Мар.19	64,73		1,12	

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 июль 2019 г. и по курсу доллара США к рублю за период с октября 1998 г. по август 2019 г. Данные по курсу евро к доллару США за август-сентябрь 2019 г. и по курсу доллара США к рублю за сентябрь 2019 г. были взяты с сайта статистики обменных курсов www.oanda.com.

В октябре 2019 г. – марте 2020 г. значение курса доллара США к рублю прогнозируется в среднем по двум моделям равным 64 руб. 22 коп. за доллар США. Прогнозируемое на конец 2019 г. значение показателя составит 64 руб. 03 коп. за доллар США в среднем по двум моделям.

Прогнозируемое значение курса евро к доллару США в среднем на рассматриваемом интервале времени составит 1,11 долл. США за один евро. Значение показателя на конец 2019 г. прогнозируется на уровне 1,11 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 сентябрь 2019 г., а также с I квартала 2014 г. по III квартал 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.

Результаты, представленные в табл. 11, предсказывают рост реальной заработной платы. Ожидается среднемесячное увеличение уровня реальной заработной платы в размере 4,3% по сравнению с аналогичным периодом предшествующего года. По итогам 2019 г. прогнозируемый прирост реальной заработной платы составит 2,6% за 12 месяцев.

Результаты, представленные в табл. 12, прогнозируют среднеквартальное падение реальных располагаемых денежных доходов на 1,4%, а реальных денежных доходов – на 1,3% по сравнению с соответствующим прошлогодним уровнем. По итогам 2019 г. прогнозиру-

Таблица 11
Прогноз уровня реальной заработной платы

Реальная заработная плата	
Прогнозные значения по моделям ARIMA (в % к соответствующему месяцу 2018–2019 гг.)	
Окт.19	103,2
Ноя.19	103,7
Дек.19	104,2
Янв.20	104,6
Фев.20	105,0
Мар.20	105,3
Справочно: фактические значения за соответствующий период 2018–2019 гг. (в % к аналогичному периоду 2017–2018 гг.)	
Окт.18	105,2
Ноя.18	104,2
Дек.18	102,9
Янв.19	101,1
Фев.19	100,0
Мар.19	102,3

Примечание. Для расчетов использовался ряд заработной платы в базисной форме (за базисный период был принят январь 1999 г.). На рассматриваемом интервале с января 1999 г. по август 2019 г. эти ряды были отнесены к классу процессов, являющихся стационарными в разностях, с выраженной сезонной составляющей.

Таблица 12
Прогноз показателей уровня жизни населения

Период	Реальные располагаемые денежные доходы	Реальные денежные доходы
Прогнозные значения по моделям ARIMA (в % к соответствующему кварталу 2018–2019 гг.)		
IV квартал 2019 г.	98,6	98,7
I квартал 2020 г.	98,6	98,7
Справочно: фактические значения за соответствующий период 2018 г. (в % к аналогичному периоду 2017–2018 гг.)		
IV квартал 2018 г.	98,0	99,5
I квартал 2019 г.	97,5	98,6

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.)

емое снижение реальных располагаемых денежных доходов составит 1,4%; снижение реальных денежных доходов – 0,4% за 12 месяцев.

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 июль 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 13

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 человек	прирост к соответствующему месяцу 2018 г., %	млн человек	прирост к соответствующему месяцу 2018 г., %	в % к показателю численности занятого в экономике населению	млн человек	прирост к соответствующему месяцу 2018 г., %	в % к показателю численности занятого в экономике населения
Окт.19	71,8	-1,0	3,5	-4,1	4,8	3,4	-4,7	4,7
Ноя.19	71,6	-1,3	3,6	-3,7	5,0	3,5	-4,6	4,9
Дек.19	71,6	-1,3	3,6	-3,9	5,0	3,5	-4,6	4,9
Янв.20	70,4	-1,1	3,6	-2,4	5,1	3,5	-4,4	5,0
Фев.20	70,6	-1,2	3,6	-2,1	5,1	3,5	-4,4	5,0
Мар.20	70,8	-0,9	3,5	0,7	5,0	3,5	0,0	4,9
Справочно: фактические значения за аналогичный период 2018–2019 гг., млн человек								
Окт.18	72,5					3,6		
Ноя.18	72,6					3,7		
Дек.18	72,6					3,7		
Янв.19	71,2					3,7		
Фев.19	71,5					3,7		
Мар.19	71,5					3,5		

Примечание. На интервале с октября 1998 г. по июль 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. 13), в октябре 2019 г. – марте 2020 г. сокращение численности занятых в экономике в среднем составит 1,1% в месяц по отношению к соответствующему периоду предыдущего года. Прогнозируемое на конец 2019 г. значение показателя численности занятого в экономике населения составляет 71,6 млн человек.

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 июль 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.

Среднее сокращение показателя общей численности безработных прогнозируется на уровне 3,2% в месяц по сравнению с аналогичным периодом прошлого года. Средняя численность безработных в конце 2019 г. прогнозируется на уровне 3,6 млн человек.

ПРИЛОЖЕНИЕ 1

Сводная таблица модельных расчетов краткосрочных прогнозов социально-экономических показателей РФ

	2019						2020		
	июль	авг	сен	окт	ноя	дек	янв	фев	мар
ИПП Росстата (прирост, %)*	2,8	2,0	2,7	2,2	1,8	2,7	2,2	1,8	3,4
ИПП НИУ ВШЭ (прирост, %)*	2,3	2,4	2,7	2,2	2,1	2,6	2,0	1,6	3,5
ИПП в добыче полезных ископаемых Росстата (прирост, %)*	3,0	1,4	1,0	0,8	0,8	0,8	1,8	1,3	1,3
ИПП в добыче полезных ископаемых НИУ ВШЭ (прирост, %)*	0,8	1,2	1,7	1,6	1,5	1,1	1,1	1,0	1,1
ИПП в обрабатывающих производствах Росстата (прирост, %)*	2,8	1,9	2,2	1,3	2,1	2,1	2,9	1,0	2,4
ИПП в обрабатывающих производствах НИУ ВШЭ (прирост, %)*	3,4	3,1	2,3	1,2	1,2	0,7	0,7	0,7	3,6
ИПП в производстве и распределении электроэнергии, газа и воды Росстата (прирост, %)*	1,7	4,1	4,9	3,6	-0,2	-1,9	-0,6	-0,9	0,9
ИПП в производстве и распределении электроэнергии, газа и воды НИУ ВШЭ (прирост, %)*	0,9	1,6	2,3	5,3	0,3	-1,3	-0,4	-1,2	-1,0
ИПП в производстве пищевых продуктов Росстата (прирост, %)*	6,7	2,8	2,7	2,6	2,4	2,7	4,8	3,0	4,7
ИПП в производстве пищевых продуктов НИУ ВШЭ (прирост, %)*	4,6	3,5	4,5	2,3	4,3	4,9	3,9	3,1	1,6
ИПП в производстве кокса и нефтепродуктов Росстата (прирост, %)*	-0,5	0,7	3,4	3,1	2,2	0,9	1,5	4,0	1,8
ИПП в производстве кокса и нефтепродуктов НИУ ВШЭ (прирост, %)*	-0,4	4,9	1,0	2,8	0,4	0,0	1,8	1,8	4,7
ИПП в металлургическом производстве и производстве готовых металлических изделий Росстата (прирост, %)*	-3,8	3,6	6,5	-3,1	1,2	7,9	2,6	-2,1	8,7
ИПП в металлургическом производстве и производстве готовых металлических изделий НИУ ВШЭ (прирост, %)*	0,1	1,8	2,8	3,2	3,8	3,2	3,5	5,3	3,5
ИПП в производстве машин и оборудования Росстата (прирост, %)*	-0,9	-9,2	-11,0	-4,3	2,9	2,2	3,2	-8,8	-2,2
ИПП в производстве машин и оборудования НИУ ВШЭ (прирост, %)*	9,6	2,8	-0,5	4,2	-0,8	-17,6	2,8	-10,1	3,8
Розничный товарооборот, трлн руб.	2,8	2,9	2,9	2,9	2,9	3,5	2,6	2,6	2,7
Реальный розничный товарооборот (прирост, %)*	1,1	0,8	0,7	2,0	2,4	2,0	1,8	0,8	0,5
Экспорт (млрд долл.)	33,0	33,8	35,0	37,8	39,8	42,9	35,9	37,0	40,0
Экспорт в страны, дальнего зарубежья (млрд долл.)	28,4	29,1	30,3	33,8	36,0	37,8	31,7	33,1	36,3
Импорт (млрд долл.)	22,3	21,8	20,9	22,9	22,8	23,6	18,8	20,7	22,4
Импорт из стран дальнего зарубежья (млрд долл.)	19,8	19,5	18,6	20,1	20,0	21,3	16,2	17,7	19,4
ИПЦ (прирост, %)**	0,2	0,0	0,2	0,3	0,3	0,4	0,7	0,5	0,4
ИЦП промышленных товаров (прирост, %)**	-2,7	-0,4	0,6	0,9	0,2	-0,2	0,1	0,4	0,7
ИЦП в добыче полезных ископаемых (прирост, %)**	-10,4	-3,3	1,9	1,4	-0,8	-3,2	0,0	2,1	-1,9
ИЦП в обрабатывающих производствах (прирост, %)**	-0,3	0,4	0,3	0,5	-0,2	-0,5	0,1	0,1	0,3
ИЦП в производстве и распределении электроэнергии, газа и воды (прирост, %)**	1,4	2,5	0,5	0,6	-0,1	-0,1	-0,1	1,5	0,5
ИЦП в производстве пищевых продуктов (прирост, %)**	0,3	0,1	0,4	0,4	0,1	0,3	0,4	0,1	0,4
ИЦП в текстильном и швейном производстве (прирост, %)**	0,3	0,1	0,6	0,5	0,5	0,0	0,4	0,5	0,4
ИЦП в обработке древесины и производстве изделий из дерева (прирост, %)**	-1,0	-0,1	-0,3	0,3	0,2	-0,2	0,3	0,4	0,3
ИЦП в целлюлозно-бумажном производстве (прирост, %)**	-1,4	0,3	0,1	0,3	0,3	0,5	0,6	0,4	0,4
ИЦП в производстве кокса и нефтепродуктов (прирост, %)**	-2,1	2,4	1,8	2,9	2,2	-0,5	-2,8	2,3	2,1

	2019						2020		
	июль	авг	сен	окт	ноя	дек	янв	фев	мар
ИЦП в химическом производстве (прирост, %)**	-1,2	-0,1	0,4	-0,5	-0,9	-1,1	0,6	0,7	-0,1
ИЦП в металлургическом производстве и производстве готовых металлических изделий (прирост, %)**	0,1	-0,7	0,9	1,0	0,4	0,2	0,7	1,3	-0,3
ИЦП в производстве машин и оборудования (прирост, %)**	0,2	0,2	0,2	0,2	0,2	0,3	1,4	0,9	0,3
ИЦП в производстве транспортных средств и оборудования (прирост, %)**	-0,2	-0,3	0,0	1,0	0,4	0,6	0,1	0,2	0,5
Стоимость минимального набора продуктов питания (на одного человека в месяц), тыс. руб.	4,31	4,17	4,06	4,02	4,05	4,11	4,17	4,21	4,27
Индекс тарифов на грузовые перевозки автомобильным транспортом (прирост, %)**	0,0	0,1	-0,1	-0,1	-0,1	-0,1	1,4	-0,2	-0,2
Индекс тарифов на трубопроводный транспорт (прирост, %)**	7,6	0,3	0,6	-2,7	2,0	1,5	-0,7	-0,5	1,2
Сводный индекс транспортных тарифов на грузовые перевозки (прирост, %)**	3,1	0,2	0,2	-4,3	0,2	0,2	0,2	0,1	0,1
Цена на нефть марки Brent (долл./барр.)	65,2	60,4	60,2	57,7	56,6	54,7	53,4	52,1	50,9
Цена на алюминий (тыс. долл./т)	1,78	1,73	1,73	1,72	1,70	1,70	1,70	1,70	1,69
Цена на золото (тыс. долл./унц.)	1,41	1,50	1,52	1,54	1,56	1,59	1,61	1,62	1,64
Цена на медь (тыс. долл./т)	5,94	5,65	5,57	5,54	5,54	5,53	5,55	5,57	5,59
Цена на никель (тыс. долл./т)	14,6	17,9	19,4	20,0	20,4	21,0	21,3	21,6	21,7
Денежная база (трлн руб.)	10,3	10,4	1,1	10,6	10,7	10,7	11,2	10,8	11,0
M ₂ (трлн руб.)	47,3	47,4	47,6	47,4	47,6	48,1	49,0	48,8	49,0
Международные резервы (млрд долл.)	0,52	0,52	0,53	0,53	0,53	0,54	0,54	0,54	0,55
Обменный курс RUR/USD (руб. за долл. США)	63,38	66,49	64,42	63,94	63,60	64,03	64,30	64,60	64,89
Обменный курс USD/EUR (долл. США за евро)	1,11	1,10	1,09	1,12	1,11	1,11	1,11	1,11	1,11
Реальная заработная плата (прирост, %)*	3,0	2,4	2,8	3,3	3,7	4,2	4,6	5,0	5,3
Численность занятого в экономике населения (млн человек)	72,2	72,8	72,4	71,8	71,6	71,6	70,4	70,6	70,8
Общая численность безработных (млн человек)	3,4	3,3	3,3	3,5	3,6	3,6	3,6	3,6	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.

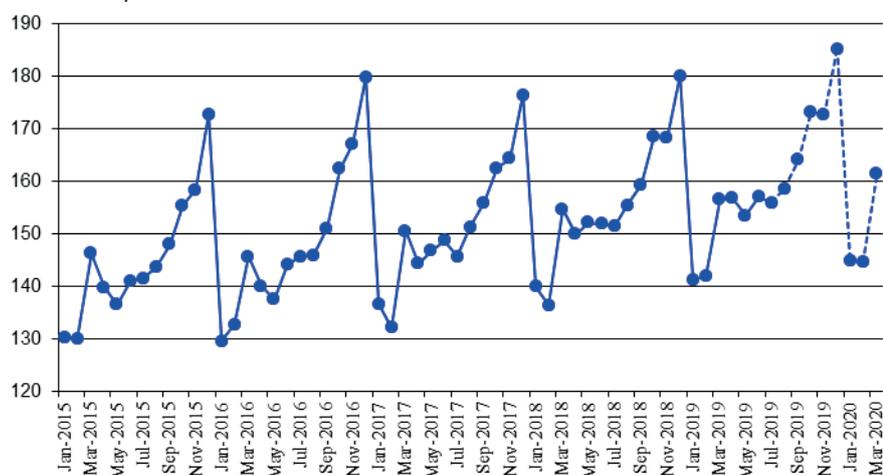


Рис. 16. Индекс промышленного производства НИУ ВШЭ (ARIMA-модель), % к январю 2010 г.

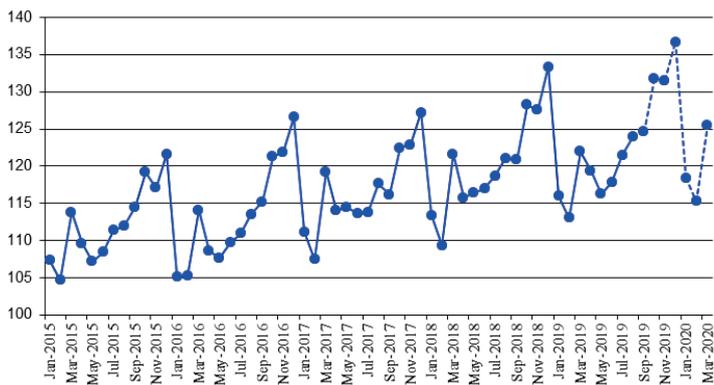


Рис. 2а. ИПП в добыче полезных ископаемых Росстата, % к декабрю 2001 г.

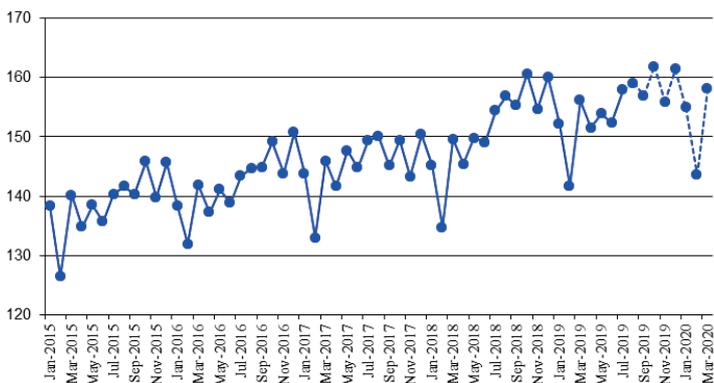


Рис. 2б. ИПП в добыче полезных ископаемых НИУ ВШЭ, % к январю 2010 г.

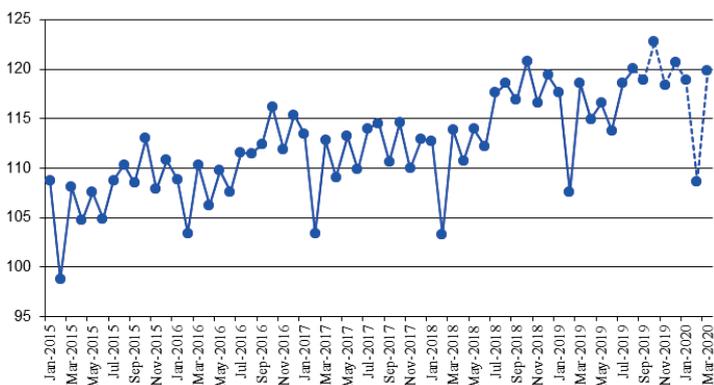


Рис. 3а. ИПП в обрабатывающих производствах Росстата, % к декабрю 2001 г.

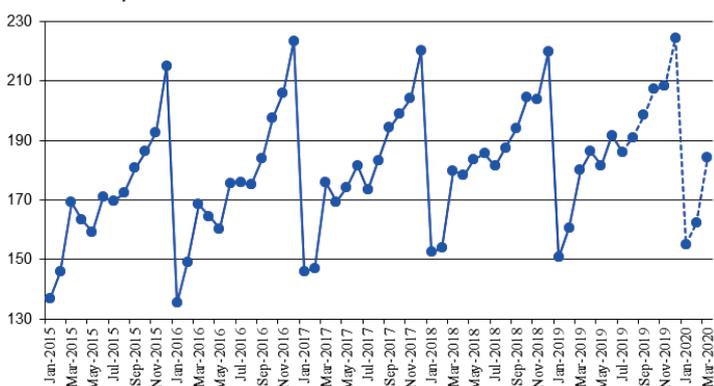


Рис. 3б. ИПП в обрабатывающих производствах НИУ ВШЭ, % к январю 2010 г.

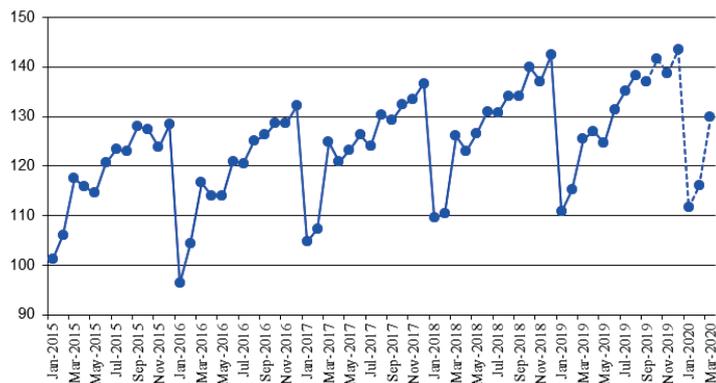


Рис. 4а. ИПП в обеспечении электрической энергией, газом и паром; кондиционировании воздуха Росстата, % к декабрю 2001 г.

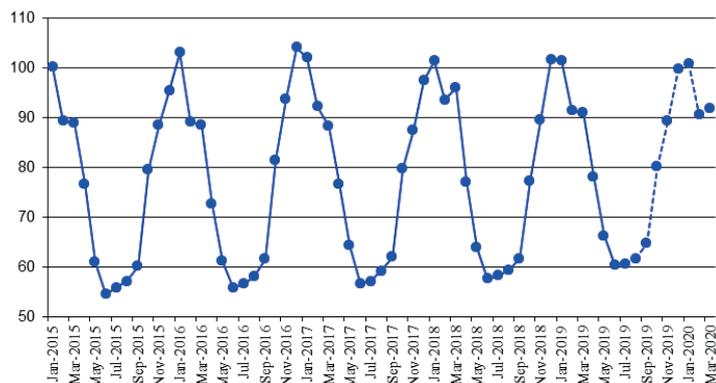


Рис. 4б. ИПП в обеспечении электрической энергией, газом и паром; кондиционировании воздуха НИУ ВШЭ, % к январю 2010 г.

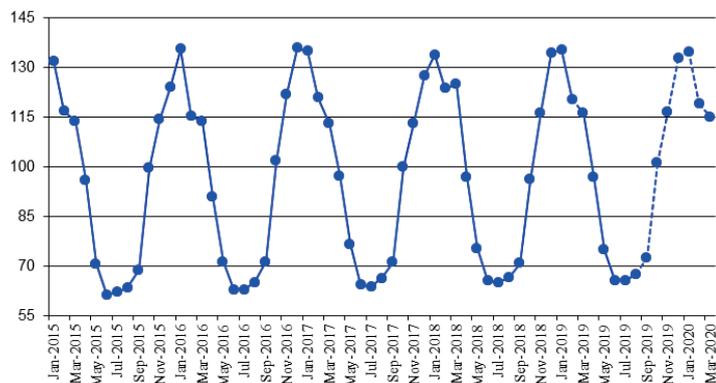


Рис. 5а. ИПП в производстве пищевых продуктов Росстата, % к декабрю 2001 г.

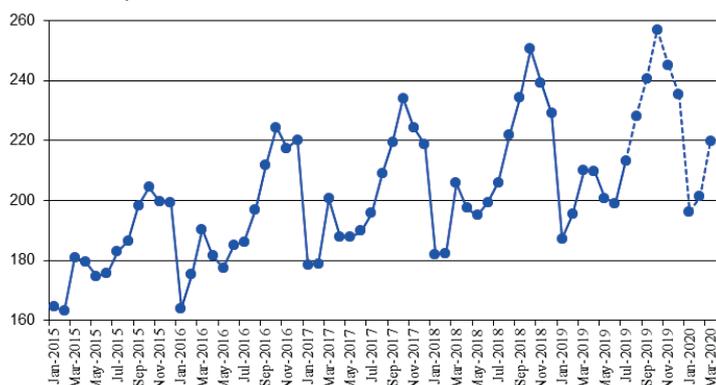


Рис. 5б. ИПП в производстве пищевых продуктов НИУ ВШЭ, % к январю 2010 г.

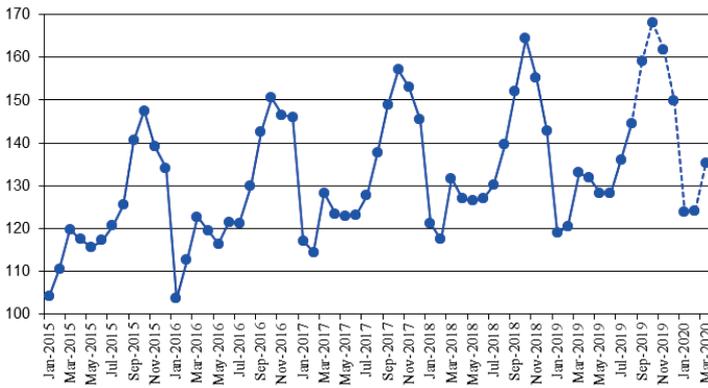


Рис. 6а. ИПП в производстве кокса и нефтепродуктов Росстата, % к декабрю 2001 г.

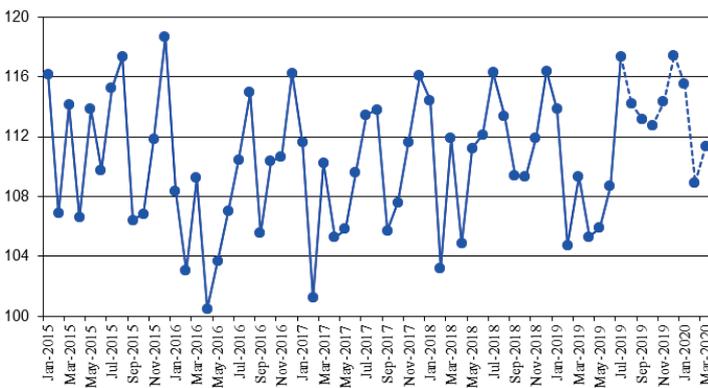


Рис. 6б. ИПП в производстве кокса и нефтепродуктов НИУ ВШЭ, % к январю 2010 г.

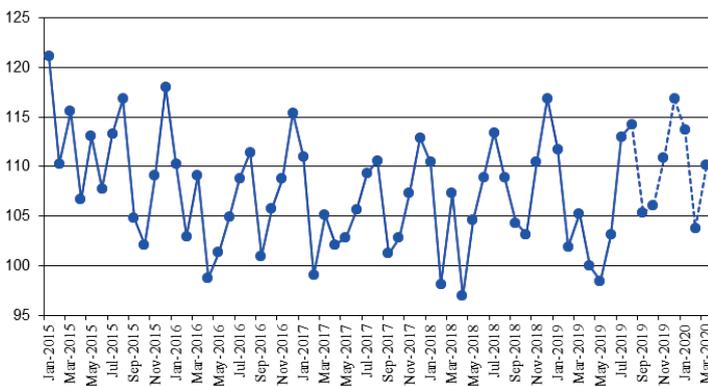


Рис. 7а. ИПП в металлургическом производстве и производстве готовых металлических изделий Росстата, % к декабрю 2001 г.

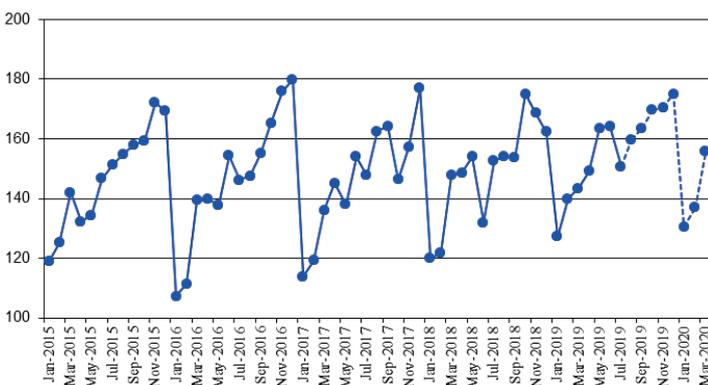


Рис. 7б. ИПП в металлургическом производстве и производстве готовых металлических изделий НИУ ВШЭ, % к январю 2010 г.

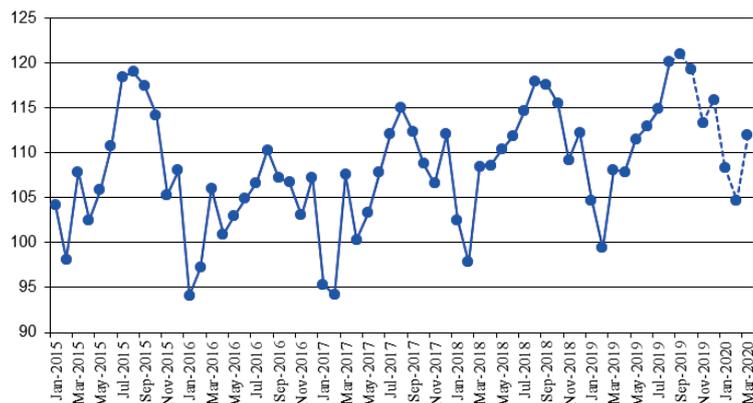


Рис. 8а. ИПП в производстве машин и оборудования Росстата, % к декабрю 2001 г.

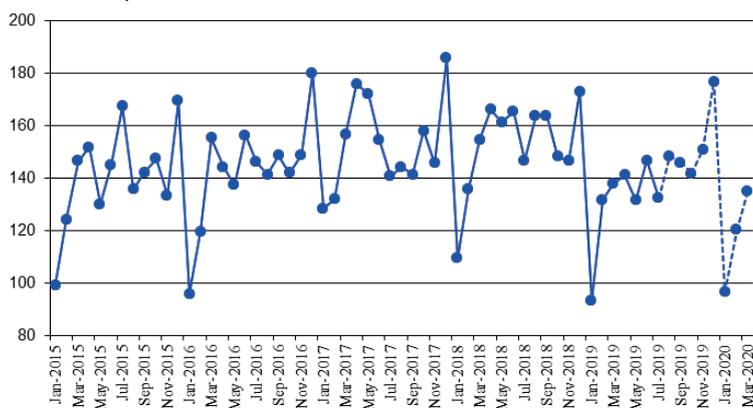


Рис. 8б. ИПП в производстве машин и оборудования НИУ ВШЭ, % к январю 2010 г.

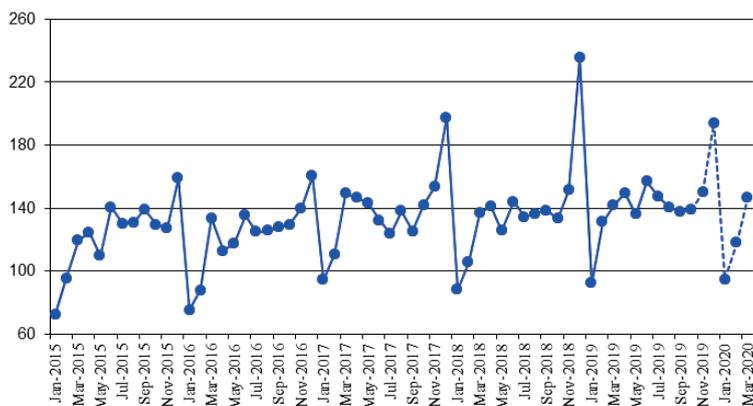


Рис. 9. Оборот розничной торговли, млрд руб.

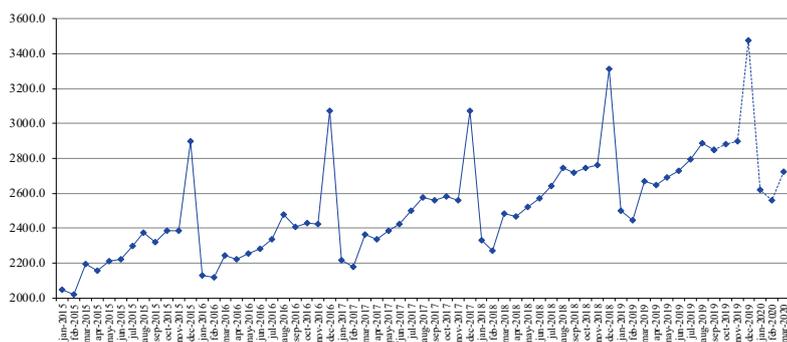


Рис. 9а. Реальный оборот розничной торговли, % к соответствующему периоду прошлого года

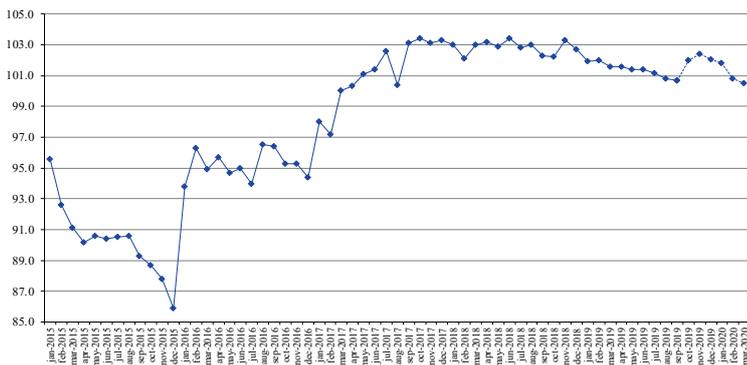


Рис. 10. Экспорт во все страны, млрд долл.

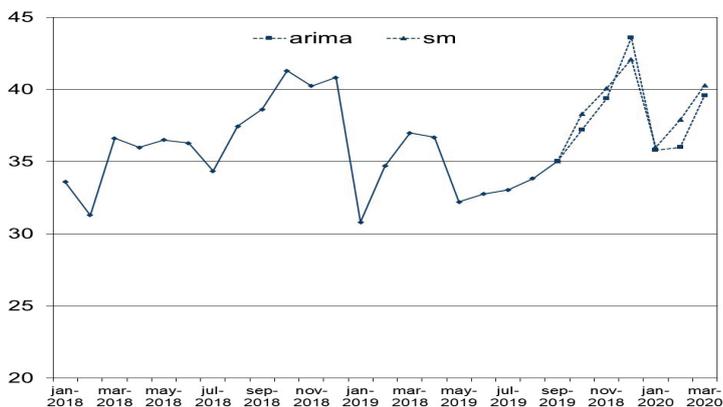


Рис. 11. Экспорт в страны вне СНГ, млрд долл.

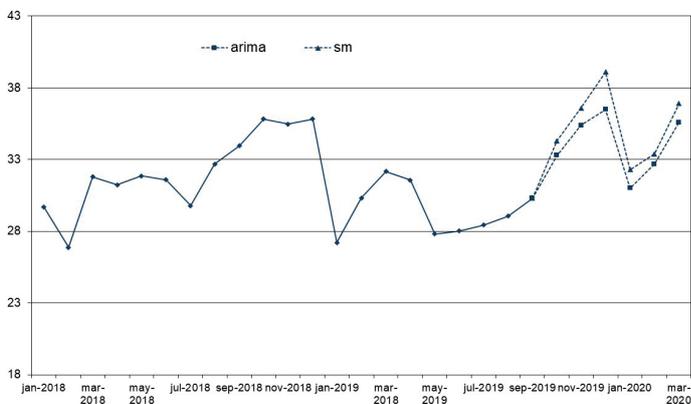


Рис. 12. Импорт из всех стран, млрд долл.

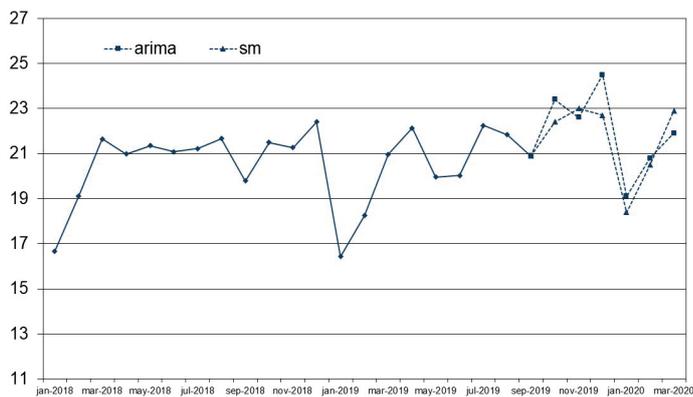


Рис. 13. Импорт из стран вне СНГ, млрд долл.

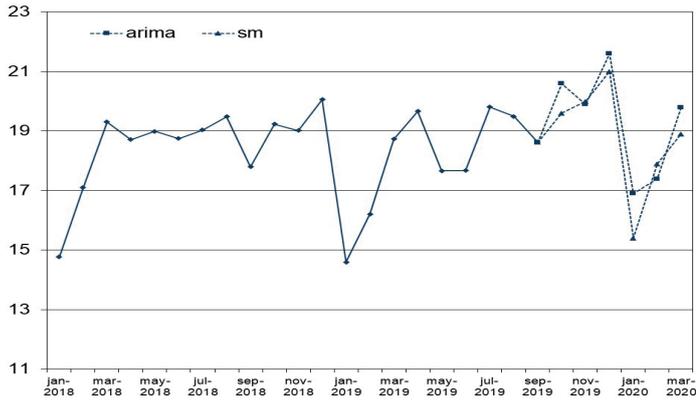


Рис. 14. Индекс потребительских цен, % к декабрю предыдущего года

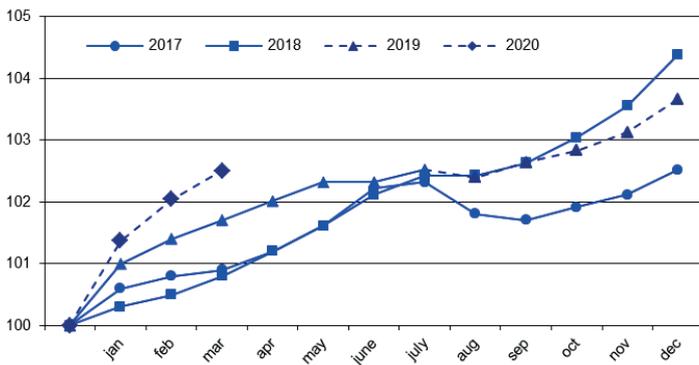


Рис. 14а. Индекс потребительских цен, % к декабрю предыдущего года (SM)

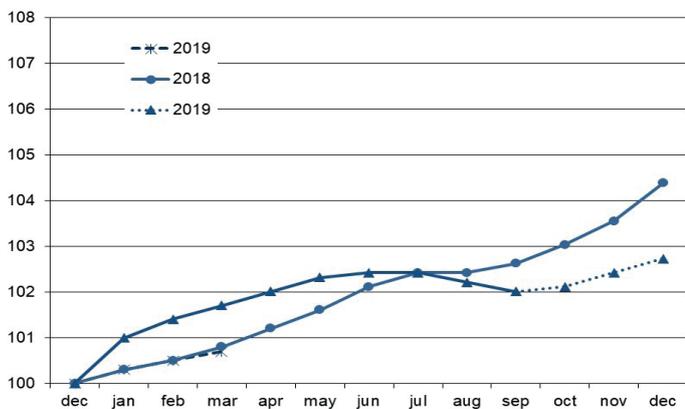


Рис. 15. Индекс цен производителей промышленных товаров, % к декабрю предыдущего года

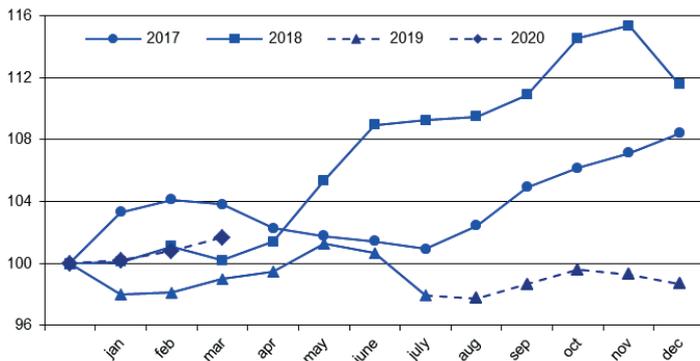


Рис. 16. Индекс цен в добыче полезных ископаемых, % к декабрю предыдущего года

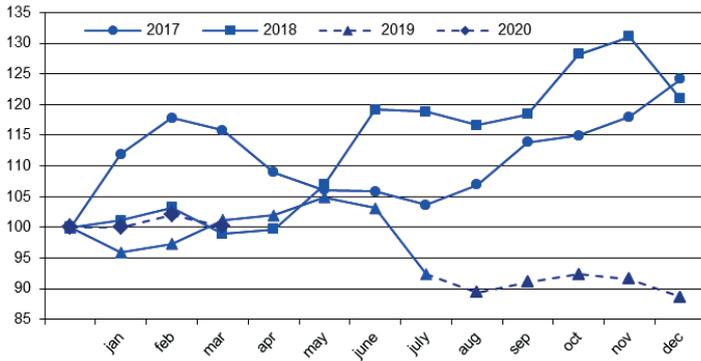


Рис. 17. Индекс цен в обрабатывающих производствах, % к декабрю предыдущего года

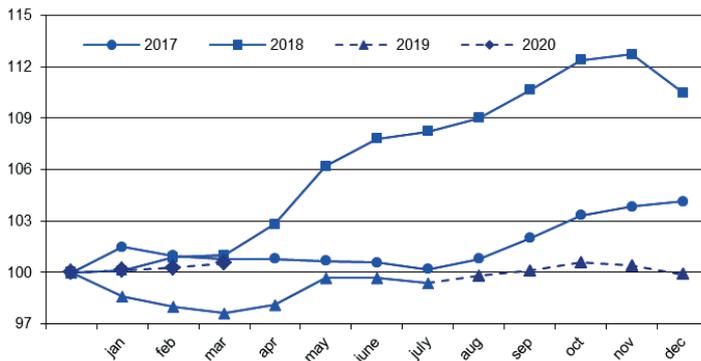


Рис. 18. Индекс цен в обеспечении электрической энергией, газом и паром, % к декабрю предыдущего года

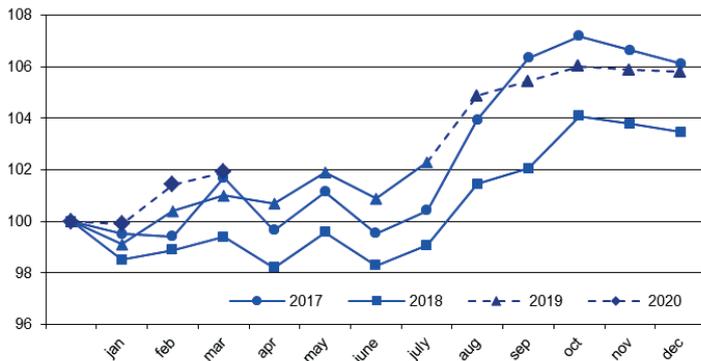


Рис. 19. Индекс цен в производстве пищевых продуктов, % к декабрю предыдущего года

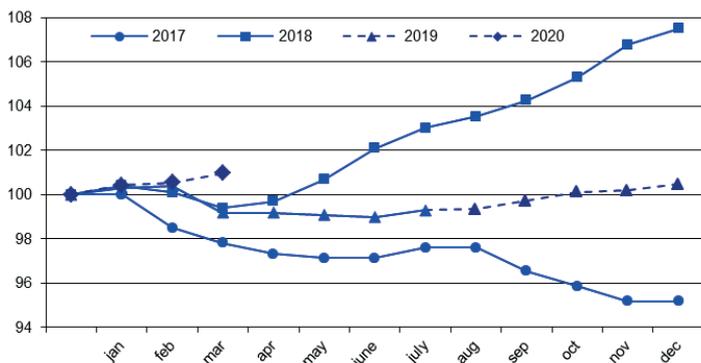


Рис. 20. Индекс цен в производстве текстильных изделий, % к декабрю предыдущего года

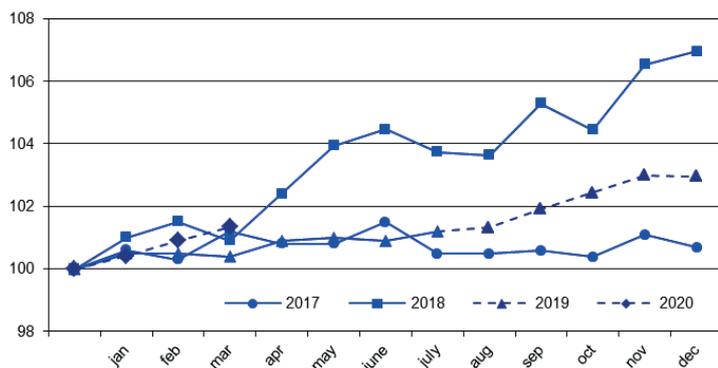


Рис. 21. Индекс цен в обработке древесины и производстве изделий из дерева, % к декабрю предыдущего года

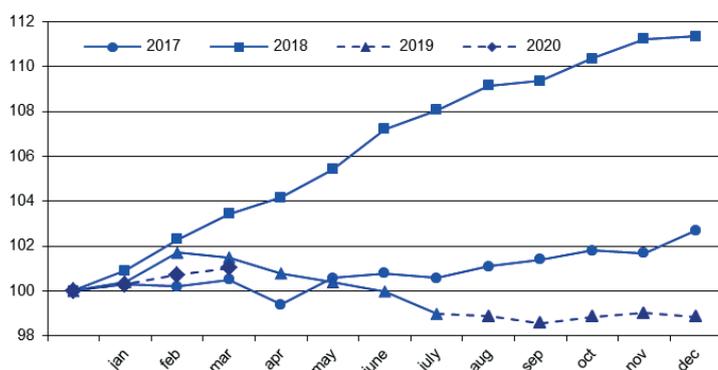


Рис. 22. Индекс цен в производстве бумаги и бумажных изделий, % к декабрю предыдущего года

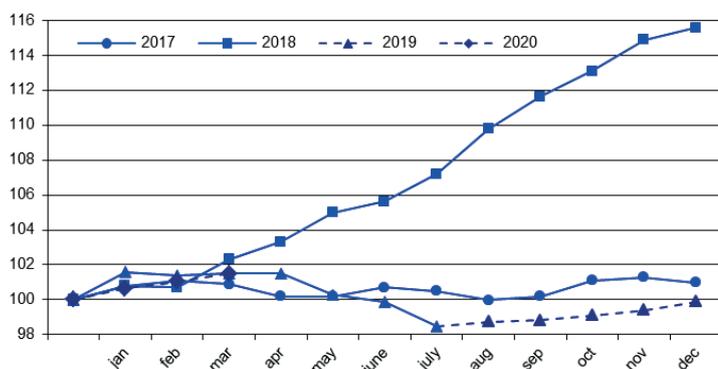


Рис. 23. Индекс цен в производстве кокса и нефтепродуктов, % к декабрю предыдущего года

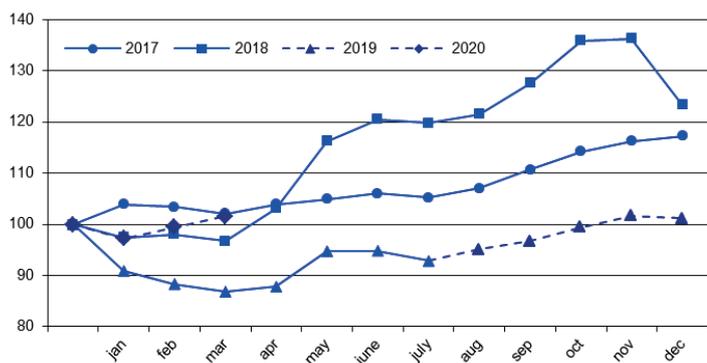


Рис. 24. Индекс цен в химическом производстве, % к декабрю предыдущего года

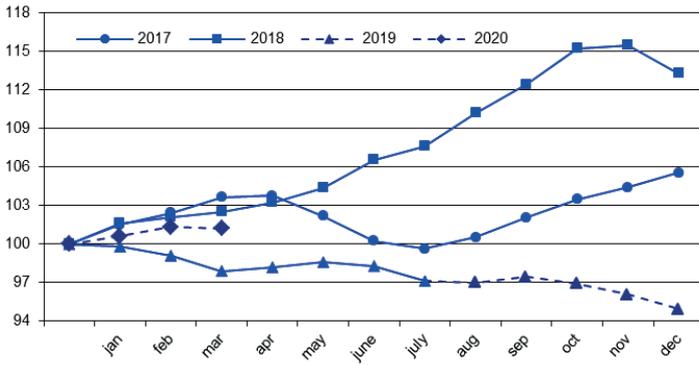


Рис. 25. Индекс цен в металлургическом производстве и производстве готовых металлических изделий, % к декабрю предыдущего года

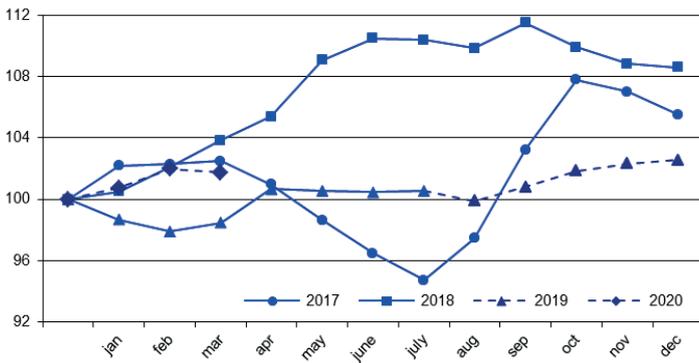


Рис. 26. Индекс цен в производстве машин и оборудования, % к декабрю предыдущего года

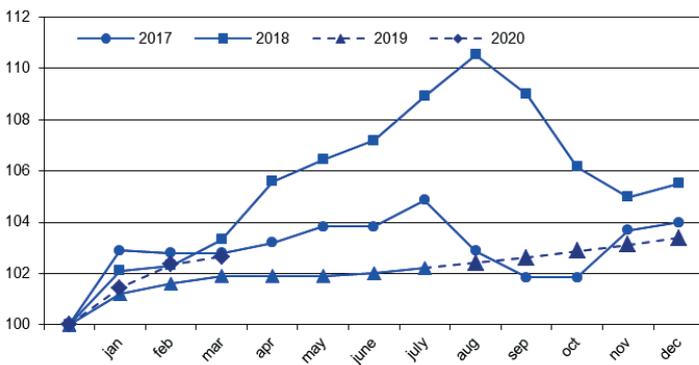


Рис. 27. Индекс цен в производстве автотранспортных средств и оборудования, % к декабрю предыдущего года

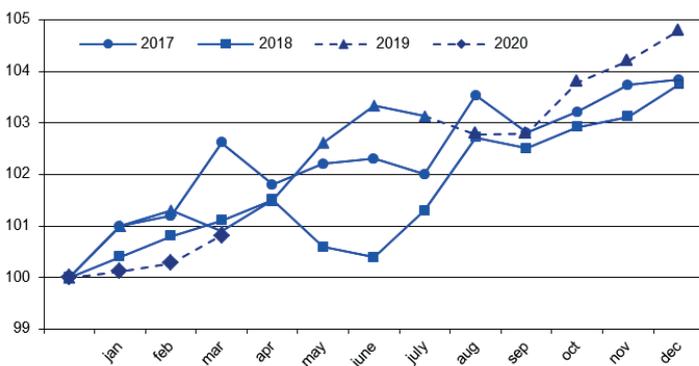


Рис. 28. Стоимость минимального набора продуктов питания на одного человека в месяц, руб.

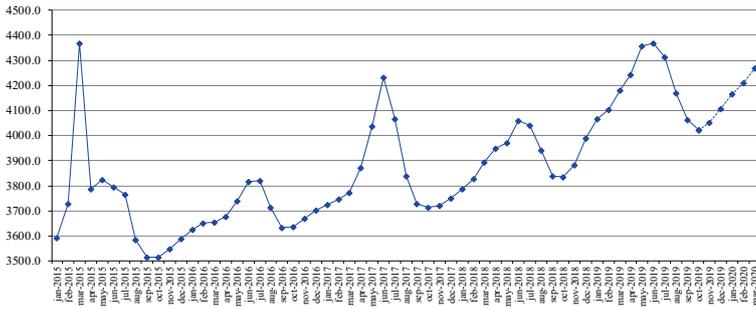


Рис. 29. Сводный индекс транспортных тарифов, для каждого года, % к предыдущему месяцу

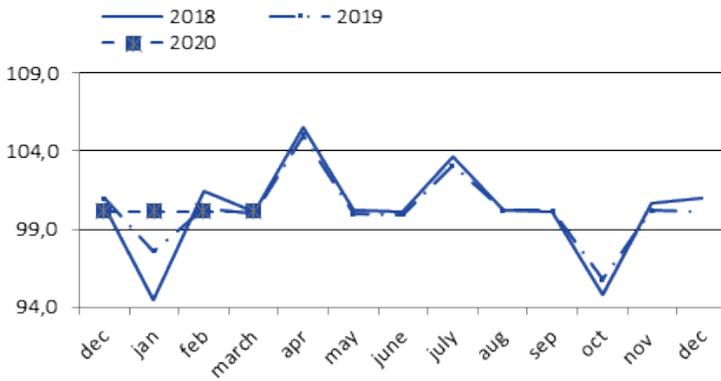


Рис. 30. Индекс тарифов на грузовые перевозки автомобильным транспортом, для каждого года, % к предыдущему месяцу

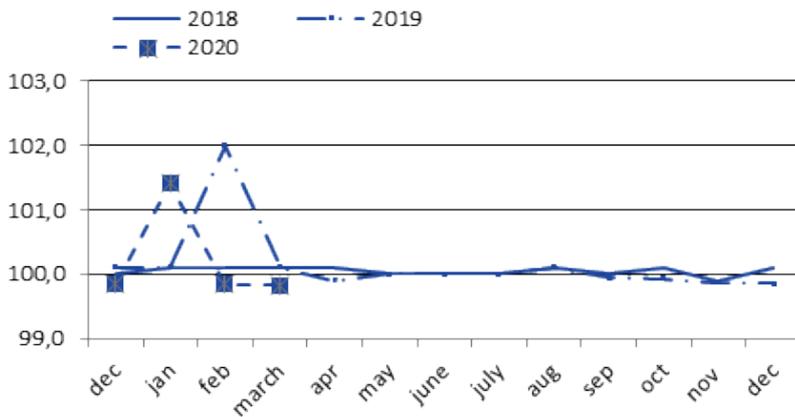


Рис. 31. Индекс тарифов на трубопроводный транспорт, для каждого года, % к предыдущему месяцу

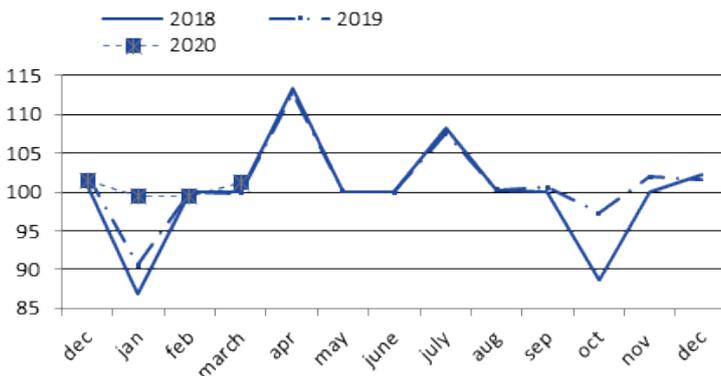


Рис. 32. Цена на нефть марки Brent, долл./барр.

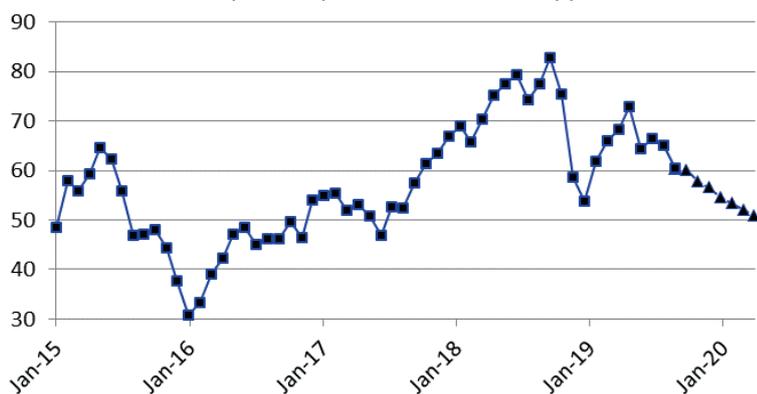


Рис. 33. Цены на алюминий, долл./т

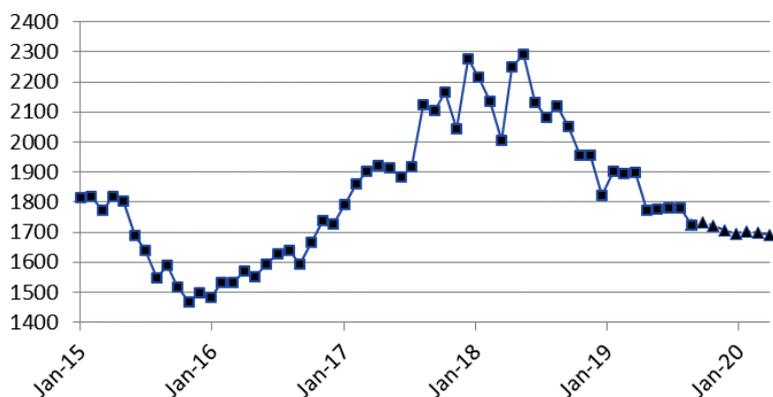


Рис. 34. Цены на золото, долл./унц.

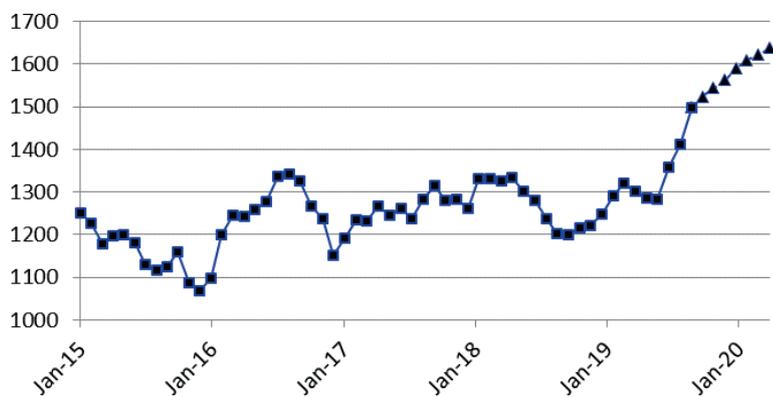


Рис. 35. Цены на никель, долл./т

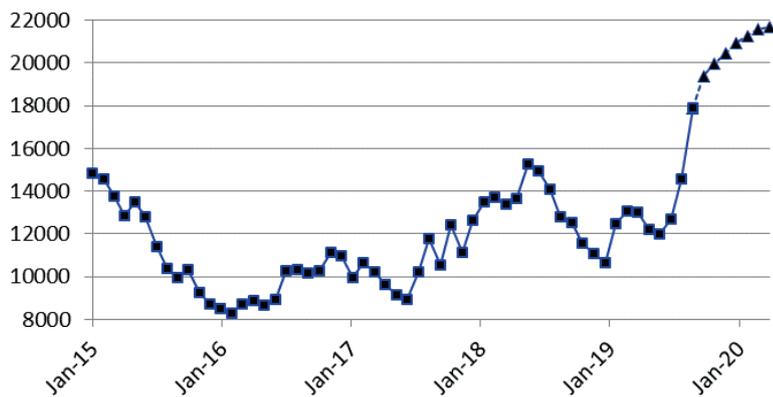


Рис. 36. Цены на медь, долл./т

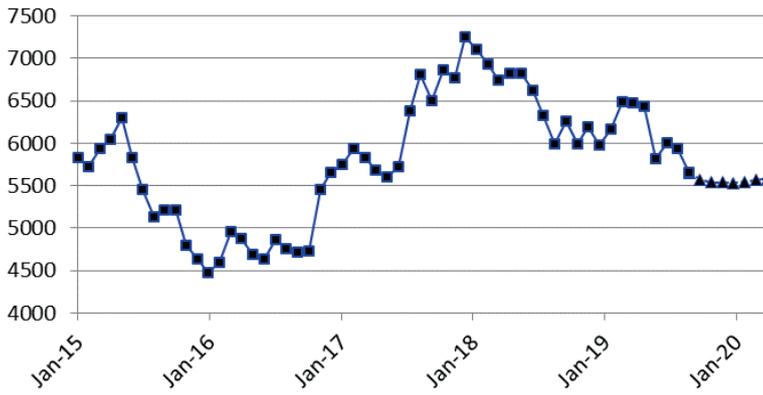


Рис. 37. Денежная база, млрд руб.

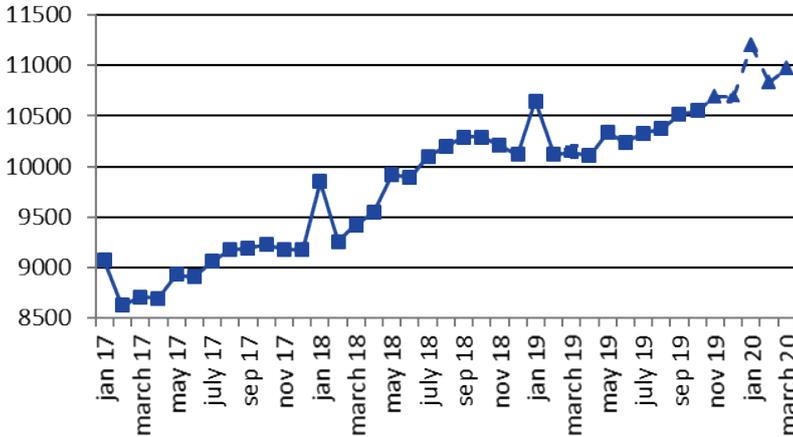


Рис. 38. M_2 млрд руб.

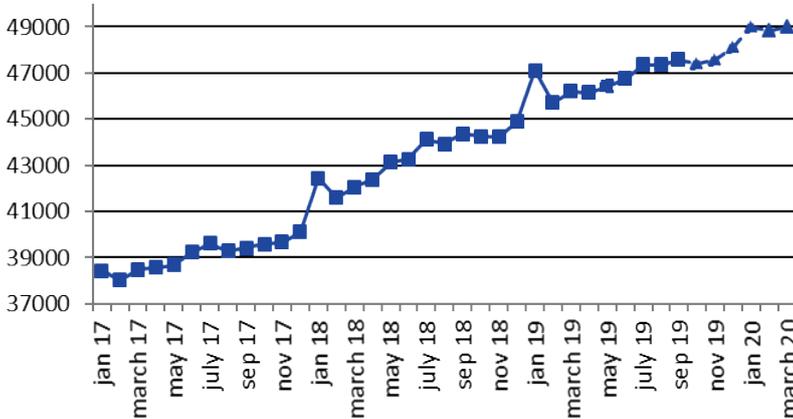


Рис. 39. Международные резервы РФ, млн долл. США

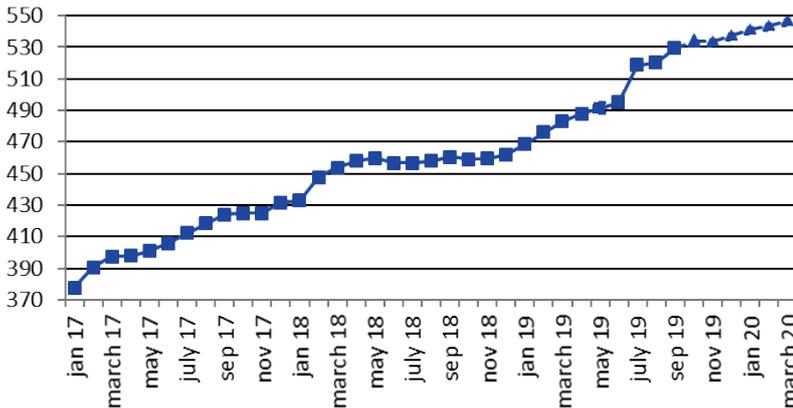


Рис. 40. Курс RUR/USD

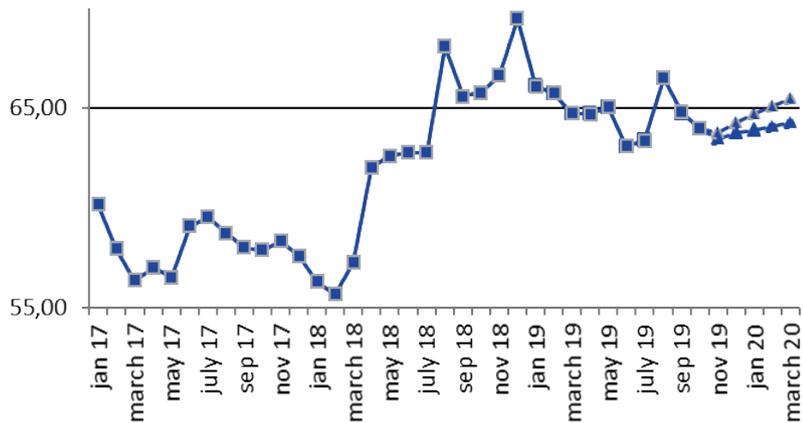


Рис. 41. Курс USD/EUR

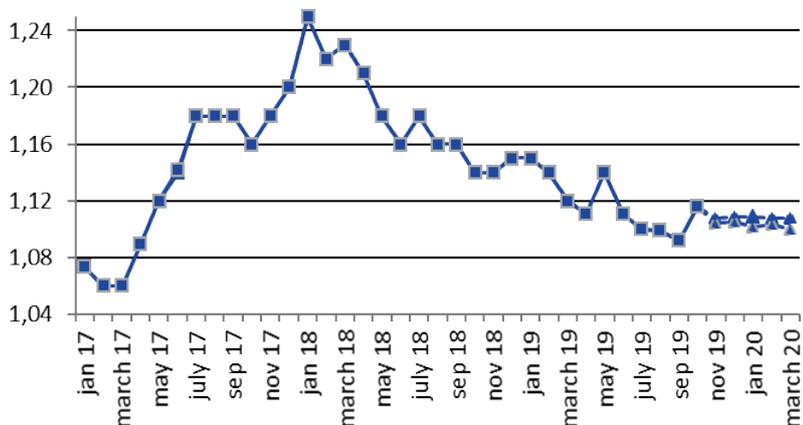


Рис. 42. Реальные располагаемые денежные доходы, % к соответствующему периоду предыдущего года

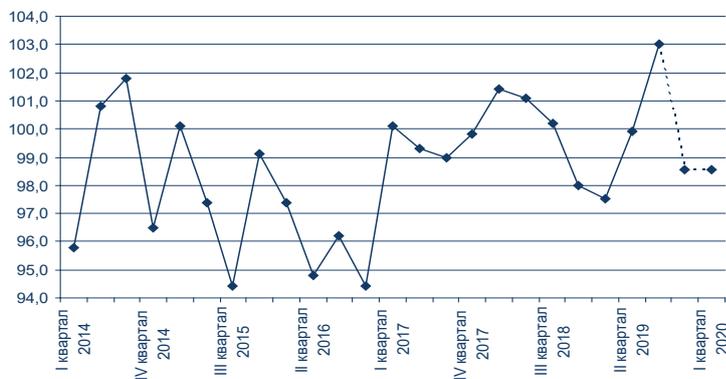


Рис. 43. Реальные денежные доходы, % к соответствующему периоду предыдущего года

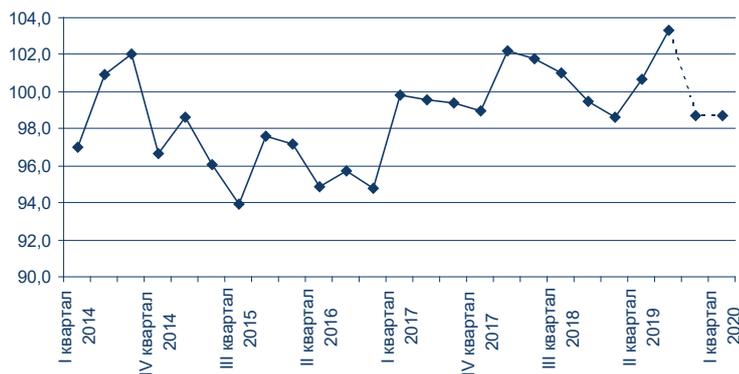


Рис. 44. Реальная начисленная заработная плата, % к соответствующему периоду предыдущего года

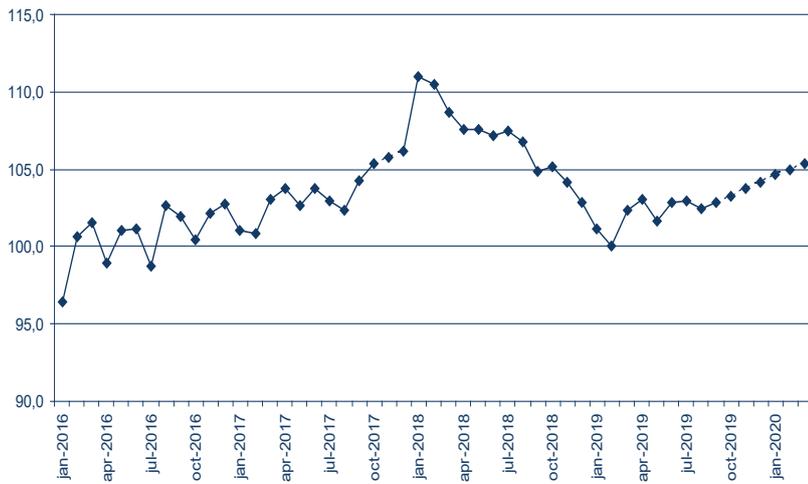


Рис. 45. Численность занятого в экономике населения, млн чел.

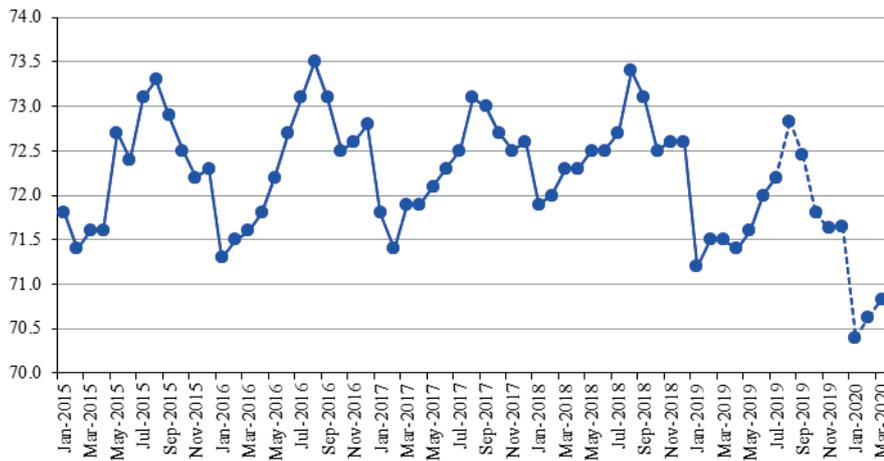


Рис. 46. Общая численность безработных, млн чел.

