



ИНСТИТУТ ЭКОНОМИЧЕСКОЙ ПОЛИТИКИ имени Е.Т. ГАЙДАРА

125 993, Москва, Газетный пер., 5

тел. (495)629-67-36, fax (495)697-88-16

www.iep.ru

09'2012

БЮЛЛЕТЕНЬ МОДЕЛЬНЫХ РАСЧЕТОВ КРАТКОСРОЧНЫХ ПРОГНОЗОВ СОЦИАЛЬНО-ЭКОНОМИЧЕСКИХ ПОКАЗАТЕЛЕЙ РФ

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

ПРЕДИСЛОВИЕ КО ВСЕМ ВЫПУСКАМ	2
ПРОМЫШЛЕННОЕ ПРОИЗВОДСТВО И РОЗНИЧНЫЙ ТОВАРООБОРОТ.....	4
ИНВЕСТИЦИИ В ОСНОВНОЙ КАПИТАЛ.....	6
ВНЕШНЕТОРГОВЫЕ ПОКАЗАТЕЛИ.....	6
ДИНАМИКА ЦЕН	7
ДЕНЕЖНЫЕ ПОКАЗАТЕЛИ	11
МЕЖДУНАРОДНЫЕ РЕЗЕРВЫ	12
ВАЛЮТНЫЕ КУРСЫ	13
ПОКАЗАТЕЛИ УРОВНЯ ЖИЗНИ НАСЕЛЕНИЯ	13
ПОКАЗАТЕЛИ ЧИСЛЕННОСТИ ЗАНЯТОГО В ЭКОНОМИКЕ НАСЕЛЕНИЯ...14 И ОБЩЕЙ ЧИСЛЕННОСТИ БЕЗРАБОТНЫХ.....	14
ПРИЛОЖЕНИЕ	16

«Бюллетень модельных расчетов краткосрочных прогнозов социально-экономических показателей РФ» входит в «Научный вестник ИЭП им. Гайдара.ру», зарегистрированный Федеральной службой по надзору в системе 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.) Электронную версию см. <http://www.iep.ru/ru/ob-izdanii.html>

Редактор: К. Мезенцева
Компьютерный дизайн: Е. Немешаева
Все вопросы и комментарии просьба отправлять по адресу: lopatina@iep.ru
© Институт экономической политики имени Е.Т.Гайдара, 2012
125 993, Москва, Газетный пер., 5
тел. (495)629-67-36
факс (495)697-88-16
www.iep.ru

ПРЕДИСЛОВИЕ КО ВСЕМ ВЫПУСКАМ

В данном бюллетене представлены расчеты значений различных экономических показателей Российской Федерации в октябре 2012 г. – марте 2013 г., построенные на основе моделей временных рядов, разработанных в результате исследований, проводимых в течение последних нескольких лет в ИЭП¹. Используемый метод прогнозирования относится к группе *формальных* или *статистических* методов. Иными словами, полученные значения не являются выражением *мнения* или *экспертной оценки* исследователя, а представляют собой расчеты будущих значений конкретного экономического показателя, выполненные на основе формальных моделей временных рядов ARIMA (p, d, q) с учетом существующего тренда и, в некоторых случаях, его значимых изменений. Представляемые прогнозы имеют инерционный характер, поскольку соответствующие модели учитывают динамику данных до момента построения прогноза и особенно сильно зависят от тенденций, характерных для временного ряда в период непосредственно предшествующий интервалу времени, для которого строится прогноз. Данные оценки будущих значений экономических показателей Российской Федерации могут быть использованы для поддержки принятия решений, касающихся экономической политики, при условии, что общие тенденции, наблюдаемые до момента, в который строится прогноз для каждого конкретного показателя, не изменятся, т.е. в будущем не произойдет серьезных шоков или изменения сложившихся долгосрочных тенденций.

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

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

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

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

2 Там же.

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

ционных критериев Акаике и Шварца, а также свойств остатков моделей (отсутствие автокоррелированности, гомоскедастичность, нормальность) и качества ретропрогнозов, полученных по этим моделям, выбиралась лучшая. Расчеты прогнозных значений проводились по лучшей модели, построенной для каждого экономического показателя.

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

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

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

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

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

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

Все расчеты проводились с использованием эконометрического пакета Eviews. ●

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

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

ПРОМЫШЛЕННОЕ ПРОИЗВОДСТВО И РОЗНИЧНЫЙ ТОВАРООБОРОТ

Промышленное производство

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

Как видно из табл. 1, средний² прирост индекса промышленного производства НИУ ВШЭ в октябре 2012 г. – марте 2013 г. по сравнению с аналогичным периодом предыдущего года по промышленности в целом составляет 2,8%. Для индекса промышленного производства Росстата данный показатель составляет 3,1%. По итогам 2012 г. прогнозируемый годовой прирост индекса промышленного производства Росстата составит 3,2%, индекса промышленного производства НИУ ВШЭ – 3,4%.

Среднемесячные значения индекса промышленного производства в добыче полезных ископаемых Росстата и НИУ ВШЭ в октябре 2012 г. – марте 2013 г. составляют соответственно 0,1% и 0,0%. В производстве кокса и нефтепродуктов средний рост прогнозируется на уровне 0,5% и 4,8% для индексов Росстата и НИУ ВШЭ соответственно.

Средний прирост индекса промышленного производства в обрабатывающей промышленности НИУ ВШЭ в октябре 2012 г. – марте 2013 г. по сравнению с аналогичным периодом предыдущего года составляет 5,9%, индекса Росстата – 5,3%. Среднемесячные значения индекса промышленного производства в производстве пищевых продуктов Росстата и НИУ ВШЭ составляют соответственно 3,2% и 2,6%. Среднемесячные значения индексов промышленного производства Росстата и НИУ ВШЭ для металлургического производства и производства готовых металлических изделий в октябре 2012 г. – марте 2013 г. составляют соответственно 4,8% и 6,8%. В производстве машин и оборудования средний рост прогнозируется на уровне 2,0% и 2,9% для индексов Росстата и НИУ ВШЭ соответственно.

Средний прирост индекса промышленного производства в производстве и распределении электроэнергии, газа и воды Росстата в октябре 2012 г. – марте 2013 г. по сравнению с аналогичным периодом предыдущего года составляет 0,1%; аналогичный показатель для индекса НИУ ВШЭ составляет 0,5%.

Прирост индексов промышленного производства Росстата по видам экономической деятельности в 2012 г. составит в среднем (по видам деятельности) 3,0%, НИУ ВШЭ – 3,9%.

Розничный товарооборот

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

Как следует из результатов, представленных в табл. 2, средний прогнозируемый прирост объемов месячного товарооборота в период с октября 2012 г. по март 2013 г. по отношению к соответствующему периоду 2011–2012 гг. составляет около 11,7%. Средний прогнозируемый

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

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

Таблица 1

РЕЗУЛЬТАТЫ РАСЧЕТОВ ПРОГНОЗНЫХ ЗНАЧЕНИЙ ИНДЕКСОВ ПРОМЫШЛЕННОГО ПРОИЗВОДСТВА¹, (%)

	Индекс промышленного производства				ИПП в добыче полезных ископаемых		ИПП в обрабатывающих производствах		ИПП в производстве и распределении электроэнергии, газа и воды		ИПП в производстве пищевых продуктов		ИПП в производстве кокса и нефтепродуктов		ИПП в металлургическом производстве и производстве готовых металлических изделий		ИПП в производстве машин и оборудования	
	Росстат		НИУ ВШЭ		НИУ ВШЭ		НИУ ВШЭ		Росстат		НИУ ВШЭ		Росстат		НИУ ВШЭ		Росстат	
	ARI-MA	КО	ARI-MA	КО	Росстат	НИУ ВШЭ	Росстат	НИУ ВШЭ	Росстат	НИУ ВШЭ	Росстат	НИУ ВШЭ	Росстат	НИУ ВШЭ	Росстат	НИУ ВШЭ	Росстат	НИУ ВШЭ
Октябрь 12	2,3	2,4	3,1	2,5	2,0	0,8	4,5	5,9	3,9	2,6	3,0	3,5	-1,1	5,1	5,2	6,6	8,1	5,5
Ноябрь 12	5,6	2,9	2,0	2,7	-0,1	0,0	5,1	5,4	0,6	-1,2	3,9	2,3	-0,4	5,7	8,8	8,7	-10,1	-9,9
Декабрь 12	3,6	2,7	4,2	2,6	0,5	0,3	5,0	5,8	2,6	6,6	2,2	2,4	-1,7	5,3	6,1	6,1	6,2	0,9
Январь 13	1,7	3,0	2,8	2,7	-0,2	-0,3	5,7	6,0	0,6	1,3	3,5	2,4	-0,6	4,1	1,3	6,6	-9,7	4,4
Февраль 13	2,6	3,2	1,1	2,8	-2,0	-1,3	5,2	5,0	-5,4	-5,1	3,3	1,1	5,0	2,8	1,6	6,3	9,6	5,9
Март 13	3,8	3,0	4,0	2,8	0,3	0,3	6,3	7,6	-1,9	-1,0	3,4	3,7	1,6	5,6	5,6	6,6	7,8	10,5
Прогнозируемый прирост к соответствующему месяцу предшествующего года																		
Октябрь 11	3,6	2,0	2,0	2,0	-0,3	0,1	5,7	3,8	-2,2	-3,4	1,7	3,8	1,9	-2,2	7,1	3,1	3,0	-3,3
Ноябрь 11	3,9	3,1	3,1	3,1	1,3	1,7	4,9	3,6	3,2	3,7	2,1	5,1	0,5	-0,4	-1,2	-3,2	23,5	18,8
Декабрь 11	2,5	0,6	0,6	0,6	1,8	1,7	3,3	2,0	-5,1	-8,3	3,8	5,8	-1,3	-1,9	2,6	0,0	-15,2	-12,2
Январь 12	3,8	1,9	1,9	1,9	1,4	1,9	4,8	2,5	-0,2	-0,4	5,6	6,8	0,9	-0,6	5,7	-0,4	42,0	9,5
Февраль 12	6,5	6,2	6,2	6,2	3,7	5,1	6,3	6,6	6,7	6,9	7,9	9,2	5,4	6,3	6,1	3,1	14,6	13,6
Март 12	2,0	1,8	1,8	1,8	0,8	1,4	2,4	2,0	1,3	1,5	5,2	5,1	0,6	0,7	3,2	0,0	2,8	6,1

Справочно: фактический прирост 2011/2012 гг. к соответствующему месяцу 2010/2011 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 эндогенным структурными сдвигами. Временные ряды остальных цепных индексов являются стационарными в уровнях.

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

Таблица 2
РЕЗУЛЬТАТЫ РАСЧЕТОВ ПРОГНОЗНЫХ ЗНАЧЕНИЙ
ОБЪЕМА РОЗНИЧНОГО ТОВАРООБОРОТА
И РЕАЛЬНОГО РОЗНИЧНОГО ТОВАРООБОРОТА

Прогнозируемые значения по ARIMA-модели		
	Розничный товарооборот, млрд руб. (в скобках – прирост к соответствующему месяцу предыдущего года, %)	Реальный розничный товарооборот (в % к соответствующему периоду предшествующего года)
Октябрь 2012	1891,0 (11,2)	103,5
Ноябрь 2012	1884,6 (11,3)	103,8
Декабрь 2012	2295,8 (12,3)	103,7
Январь 2013	1698,3 (11,7)	104,0
Февраль 2013	1691,0 (11,5)	104,6
Март 2013	1835,4 (12,4)	104,6
Справочно: фактические значения за аналогичные месяцы 2011/2012 гг.		
Октябрь 2011	1701,3	109,1
Ноябрь 2011	1693,9	108,4
Декабрь 2011	2044,0	109,3
Январь 2012	1520,8	107,4
Февраль 2012	1516,5	107,9
Март 2012	1632,6	107,4

Примечание. Ряды розничного товарооборота и реального розничного товарооборота на интервале с января 1999 г. по июль 2012 г.

Таблица 3
РЕЗУЛЬТАТЫ РАСЧЕТОВ ПРОГНОЗНЫХ ЗНАЧЕНИЙ
ОБЪЕМА ИНВЕСТИЦИЙ В ОСНОВНОЙ КАПИТАЛ И
РЕАЛЬНЫХ ИНВЕСТИЦИЙ В ОСНОВНОЙ КАПИТАЛ

Прогнозируемые значения по ARIMA-модели		
	Инвестиции в основной капитал, млрд руб. (в скобках – прирост к соответствующему месяцу предыдущего года, %)	Реальные инвестиции в основной капитал (в % к соответствующему периоду предшествующего года)
Октябрь 2012	1261,9 (9,8)	99,4
Ноябрь 2012	1290,0 (8,2)	99,4
Декабрь 2012	2320,5 (12,4)	96,3
Январь 2013	423,6 (-4,5)	97,5
Февраль 2013	554,2 (-3,3)	100,7
Март 2013	643,6 (-4,1)	102,4
Справочно: фактические значения за аналогичные месяцы 2011/2012 гг.		
Октябрь 2011	1149,4	113,7
Ноябрь 2011	1192,3	112,8
Декабрь 2011	2064,0	114,0
Январь 2012	443,3	116,4
Февраль 2012	573,3	116,2
Март 2012	670,9	117,0

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

прирост реального месячного товарооборота в период с октября 2012 г. по март 2013 г. по отношению к соответствующему периоду 2011–2012 гг. составляет 4,0%.

В годовом исчислении прогнозируемый прирост номинального показателя розничного товарооборота по итогам 2012 г. составит 12,3%, в реальном – 5,7%.

ИНВЕСТИЦИИ В ОСНОВНОЙ КАПИТАЛ

В табл. 3 представлены результаты расчетов прогнозируемых значений инвестиций в основной капитал в октябре 2012 г. – марте 2013 г. Прогнозы строились на основе моделей временных рядов по данным Росстата за период с января 1999 по июль 2012 г.

Результаты, представленные в табл. 3, показывают, что средний прогнозируемый прирост инвестиций в период с октября 2012 г. по март 2013 г. по отношению к соответствующему периоду 2011–2012 гг. составляет около 3,1%.

Среднее прогнозируемое падение реальных инвестиций в период с октября 2012 г. по март 2013 г. по отношению к соответствующему периоду 2011–2012 гг. составляет 0,7%.

Годовой прирост номинального показателя инвестиций в основной капитал в 2012 г. составит 12,4%. Для показателя реальных инвестиций в основной капитал по итогам 2012 г. прогнозируется падение в размере 6,4%.

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 струк-

турных моделей, оцененных на месячных данных на интервале с сентября 1998 г. по июль 2012 г. по данным ЦБ РФ¹. Результаты расчетов представлены в табл. 4.

Средний прогнозируемый прирост экспорта, импорта, экспорта вне СНГ и импорта из стран вне СНГ за октябрь 2012 г. – март 2013 г. по отношению к аналогичному периоду 2011/2012 гг. составит 0,5%, 4,6%, 0,02% и 8,9% соответственно. Средний прогнозируемый объем сальдо торгового баланса со всеми странами за октябрь 2012 г. – март 2013 г. составит 107,0 млрд долл. США, что соответствует снижению на 5,5% по отношению к аналогичному периоду 2011/2012 гг.

Таблица 4
РЕЗУЛЬТАТЫ РАСЧЕТОВ ПРОГНОЗНЫХ ЗНАЧЕНИЙ ОБЪЕМОВ ВНЕШНЕТОРГОВОГО ОБОРОТА
СО СТРАНАМИ ВНЕ СНГ

Месяц	Экспорт, всего				Импорт, всего				Экспорт в страны вне СНГ				Импорт из стран вне СНГ			
	прогнозные значения (млрд долл. в мес.)		в % от фактических данных за соответствующий месяц предыдущего года		прогнозные значения (млрд долл. в мес.)		в % от фактических данных за соответствующий месяц предыдущего года		прогнозные значения (млрд долл. в мес.)		в % от фактических данных за соответствующий месяц предыдущего года		прогнозные значения (млрд долл. в мес.)		в % от фактических данных за соответствующий месяц предыдущего года	
	ARIMA	SM	ARIMA	SM	ARIMA	SM	ARIMA	SM	ARIMA	SM	ARIMA	SM	ARIMA	SM	ARIMA	SM
Октябрь 2012	39,3	48,1	85	104	26,8	30,3	91	103	34,1	38,6	88	100	24,7	26,9	98	107
Ноябрь 2012	42,0	51,3	89	108	30,3	30,2	100	99	35,8	41,8	90	105	26,4	26,6	101	101
Декабрь 2012	42,1	54,5	82	106	29,9	30,9	97	101	38,5	44,3	90	104	26,1	26,8	100	103
Январь 2013	38,5	51,3	97	129	26,5	25,3	135	129	32,5	43,1	95	126	25,1	22,0	153	134
Февраль 2013	42,0	52,5	93	116	27,1	26,5	109	106	34,7	43,4	92	115	25,9	23,1	121	108
Март 2013	42,9	51,5	92	110	30,8	27,6	108	97	36,1	43,3	91	109	26,7	24,0	110	99
Справочно: фактические значения за соответствующие месяцы 2011/2012 гг. (млрд долл.)																
Октябрь 2011	46,0				29,4				38,7				25,2			
Ноябрь 2011	47,3				30,4				39,9				26,2			
Декабрь 2011	51,3				30,7				42,8				26,1			
Январь 2012	39,8				19,6				34,2				16,4			
Февраль 2012	45,3				25,0				37,9				21,4			
Март 2012	46,9				28,4				39,6				24,3			

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

ДИНАМИКА ЦЕН

Индекс потребительских цен и индексы цен производителей

В данном разделе представлены расчеты прогнозных значений индекса потребительских цен и индексов цен производителей (как в целом по промышленности, так и по некоторым ее видам деятельности по классификации ОКВЭД), полученные на основе моделей временных рядов, оцененных по данным Росстата на интервале с января 1999 г. по июль 2012 г.². В таблице 5 приведены результаты модельных расчетов прогнозных значений в октябре 2012 г. – марте 2013 г. по ARIMA-моделям, структурным моделям (SM) и моделям, построенным с использованием конъюнктурных опросов (КО).

Прогнозируемый среднемесячный прирост индекса потребительских цен в октябре 2012 г. – марте 2013 г. составит 0,6%. Прирост цен производителей промышленных товаров за ука-

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.

занный период прогнозируется в среднем на уровне 0,6% в месяц. Годовой прирост индекса потребительских цен в среднем по двум моделям составит 6,8%. Аналогичный показатель для индекса цен производителей прогнозируется на уровне 0,9%.

Для индексов цен производителей ОКВЭД с октября 2012 г. по март 2013 г. прогнозируются следующие средние темпы роста в месяц: 2,2% – в добыче полезных ископаемых, 0,4% – в обрабатывающих производствах, 1,0% – в производстве и распределении электроэнергии, газа и воды, 0,8% – в производстве пищевых продуктов, 0,4% – в текстильном и швейном производстве, 0,7% – в обработке древесины и производстве изделий из дерева, 0,5% – в целлюлозно-бумажном производстве, 1,8% – в производстве кокса и нефтепродуктов, 1,1% – в химическом производстве, 1,1% – в металлургическом производстве и производстве готовых металлических изделий, 0,5% – в производстве машин и оборудования и 0,8% – в производстве транспортных средств и оборудования.

Годовой прирост индексов цен производителей по видам экономической деятельности составит в среднем 3,8%. Прогнозируется максимальный годовой прирост в производстве кокса и нефтепродуктов – 8,0%. В добыче полезных ископаемых по итогам 2012 г. ожидается падение цен на уровне 3,0%.

Таблица 5

РЕЗУЛЬТАТЫ РАСЧЕТОВ ПРОГНОЗНЫХ ЗНАЧЕНИЙ ИНДЕКСОВ ЦЕН

Месяц	Индексы цен производителей:															
	Индекс потребительских цен (ARIMA)	Индекс потребительских цен (SM)	ИЦП промышленных товаров (ARIMA)	ИЦП промышленных товаров (КО)	добыча полезных ископаемых	обрабатывающие производства	производство электроэнергии, газа и воды	производство пищевых продуктов	текстильное и швейное производство	обработка древесины и производство изделий из дерева	целлюлозно-бумажное производство	производство кокса, нефтепродуктов	химическое производство	металлургическое производство и производство готовых металлических изделий	производство машин и оборудования	производство транспортных средств и оборудования
Прогнозные значения (в % к предыдущему месяцу)																
окт.12	100,8	100,3	100,2	100,2	102,6	100,6	101,3	101,1	100,4	100,6	100,4	101,8	101,6	101,8	100,0	100,8
ноя.12	100,6	100,1	100,5	100,3	101,3	100,6	99,6	101,0	100,5	101,0	100,4	102,4	101,0	101,5	100,2	100,3
дек.12	100,5	100,2	101,1	100,7	101,3	99,7	100,2	100,9	100,0	100,7	100,3	101,6	100,9	100,7	100,5	100,9
янв.13	101,7	100,8	100,5	100,0	102,5	100,2	98,6	100,5	100,6	100,6	101,2	101,3	101,0	101,2	101,0	101,3
фев.13	100,8	100,8	101,0	100,5	103,3	100,8	107,3	100,6	100,4	101,0	100,4	101,6	100,5	100,5	100,8	100,5
мар.13	100,5	100,4	100,7	101,6	102,2	100,5	99,3	100,8	100,4	100,5	100,3	101,8	101,4	100,9	100,3	100,7
Прогнозные значения (в % к декабрю 2011/2012 гг.)																
окт.12	107,1	104,9	99,2	104,70	94,5	103,0	99,4	106,0	100,0	101,5	101,2	103,8	104,5	105,2	103,8	104,4
ноя.12	107,7	105,0	99,7	105,00	95,8	103,6	99,0	107,0	100,4	102,5	101,6	106,2	105,6	106,8	104,0	104,7
дек.12	108,3	105,2	100,8	105,70	97,0	103,3	99,2	107,9	100,5	103,3	101,9	108,0	106,5	107,5	104,5	105,7
янв.13	101,7	100,8	100,5	100,00	102,5	100,2	98,6	100,5	100,6	100,6	101,2	101,3	101,0	101,2	101,0	101,3
фев.13	102,5	101,6	101,5	100,50	105,8	101,0	105,8	101,2	101,0	101,6	101,6	102,9	101,6	101,7	101,8	101,8
мар.13	103,0	102,1	102,2	10210	108,1	101,5	105,0	101,9	101,4	102,1	101,9	104,8	103,0	102,6	102,1	102,5
Справочно: фактические значения за аналогичные периоды 2011/2012 гг. (в % к декабрю 2010/2011 гг.)																
окт.11	105,3		111,1	119,0	109,1	105,0	101,5	113,4	107,6	103,4	118,2	114,5	107,4	105,7	108,5	
ноя.11	105,7		112,2	123,3	109,2	105,0	101,9	113,7	108,5	103,4	119,7	113,7	106,3	105,6	108,4	
дек.11	106,1		112,4	126,5	108,4	105,3	102,0	112,6	108,8	102,9	117,6	110,5	104,7	105,5	109,4	
янв.12	100,5		99,7	101,8	98,9	99,7	99,4	98,7	99,5	100,4	95,7	99,3	99,2	100,3	99,5	
фев.12	100,9		100,8	106,4	98,9	99,4	99,2	98,3	99,9	100,5	94,1	100,4	99,9	100,7	100,8	
мар.12	101,5		102,9	114,7	99,2	99,9	99,7	98,8	100,3	100,3	94,7	100,3	99,4	101,7	101,5	

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

Динамика стоимости минимального набора продуктов питания

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

Как видно из табл. 6, прогнозируется рост стоимости минимального набора продуктов питания по сравнению с соответствующим уровнем прошлого года. При этом средняя прогнозируемая стоимость минимального набора продуктов питания составляет около 2616,9 руб. Прогнозируемый прирост стоимости минимального набора продуктов питания составляет в среднем около 7,7% по сравнению с уровнем соответствующего периода прошлого года. Годовой прирост стоимости минимального набора продуктов питания составит в 2012 г. 7,7%.

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 по июль 2012 г. В табл. 7 приведены результаты модельных расчетов прогнозных значений в октябре 2012 г. – марте 2013 г. Отметим, что некоторые из рассматриваемых показателей (например, индекс тарифов на трубопроводный транспорт) являются регулируемыми, в силу чего их поведение весьма сложно описать моделями временных рядов. В результате, получаемые будущие значения 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 2012 г. – декабрь 2012 г. среднемесячный рост сводного индекса транспортных тарифов на грузовые перевозки будет на уровне 1%. В январе 2013 планируется сезонный рост индекса на 5,3 п.п. Годовой прирост индекса в 2012 г. составит около 15,1%.

Индекс тарифов на грузовые перевозки автомобильным транспортом будет расти со среднемесячным темпом 0,2% вплоть до декабря 2012 г. В результате его годовой прирост в 2012 г. составит 6%. В январе 2013 г. прогнозируется сезонный рост показателя на 1,7 п.п. Индекс тарифов на трубопроводный транспорт будет расти в течение следующих шести месяцев со среднемесячным темпом 2,5%, что приведет к годовому приросту в размере 27,1%.

Таблица 6

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

Прогнозируемые значения по ARIMA-модели (руб.)	
Октябрь 2012	2579,3
Ноябрь 2012	2593,6
Декабрь 2012	2606,4
Январь 2013	2628,2
Февраль 2013	2636,6
Март 2013	2657,4
Справочно: фактические значения за аналогичные месяцы 2011/2012 гг. (млрд руб.)	
Октябрь 2011	2390,8
Ноябрь 2011	2399,6
Декабрь 2011	2419,9
Январь 2012	2437,4
Февраль 2012	2456,0
Март 2012	2472,8
Прогнозируемый прирост к соответствующему месяцу предыдущего года (%)	
Октябрь 2012	7,9
Ноябрь 2012	8,1
Декабрь 2012	7,7
Январь 2013	7,8
Февраль 2013	7,4
Март 2013	7,5

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

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

Таблица 7

РЕЗУЛЬТАТЫ РАСЧЕТОВ ПРОГНОЗНЫХ ЗНАЧЕНИЙ ИНДЕКСОВ ТРАНСПОРТНЫХ ТАРИФОВ

Период	Сводный индекс транспортных тарифов на грузовые перевозки	Индекс тарифов на грузовые перевозки автомобильным транспортом	Индекс тарифов на трубопроводный транспорт
Прогнозные значения по ARIMA-моделям (в % к предшествующему месяцу)			
Октябрь 2012	101,0	100,2	100,0
Ноябрь 2012	101,0	100,2	105,1
Декабрь 2012	101,0	100,2	104,2
Январь 2013	106,3	101,9	99,9
Февраль 2013	101,0	100,1	101,1
Март 2013	100,1	100,1	105,0
Прогнозные значения по ARIMA-моделям (в % к декабрю предыдущего года)			
Октябрь 2012	112,9	105,6	120,9
Ноябрь 2012	114,0	105,8	120,9
Декабрь 2012	115,1	106,0	127,1
Январь 2013	116,2	106,2	132,4
Февраль 2013	106,3	101,9	99,9
Март 2013	107,3	102,0	101,0
Справочно: фактические значения за аналогичный период 2011/2012 г. (в % к предыдущему месяцу)			
Октябрь 2011	92,7	100	85,9
Ноябрь 2011	100,5	100,5	100,9
Декабрь 2011	99	100,3	97,7
Январь 2012	99,1	102,2	93
Февраль 2012	100	101,2	99,9
Март 2012	100	100,6	100

Примечание. На интервале с ноября 2000 г. по июль 2012 г. ряд индекса тарифов на грузовые перевозки автомобильным транспортом был идентифицирован как стационарный ряд; остальные ряды так же были идентифицированы как стационарные ряды на интервале с ноября 1998 г. по июль 2012 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. 8 представлены расчеты среднемесячных значений цен на нефть марки Brent (долл./барр.), алюминий (долл./т), золото (долл./унц.), медь (долл./т) и никель (долл./т) в октябре 2012 г. – марте 2013 г., полученные на основе нелинейных моделей временных рядов, оцененных по данным МВФ на интервале с января 1980 г. по август 2012 г.

Таблица 8

РЕЗУЛЬТАТЫ РАСЧЕТОВ ПРОГНОЗНЫХ ЗНАЧЕНИЙ ЦЕН НА ПРИРОДНЫЕ РЕСУРСЫ

Месяц	Нефть марки Brent (долл./барр.)	Алюминий (долл./т)	Золото (долл./унц.)	Медь (долл./т)	Никель (долл./т)
Прогнозные значения по ARIMA-моделям					
Октябрь 2012	121,54	1807	1643	7407	15688
Ноябрь 2012	120,78	1801	1650	7375	15650
Декабрь 2012	122,27	1787	1658	7344	15630
Январь 2013	125,24	1779	1666	7317	15598
Февраль 2013	128,77	1775	1673	7269	15521
Март 2013	132,48	1766	1681	7216	15422
Приросты к соответствующему месяцу предыдущего года (%)					
Октябрь 2012	11,0	-17,1	-1,3	0,2	-17,6
Ноябрь 2012	9,3	-13,4	-5,1	-2,7	-12,4
Декабрь 2012	13,2	-11,7	1,0	-2,8	-14,3
Январь 2013	12,8	-17,3	0,8	-9,2	-21,7
Февраль 2013	7,6	-19,6	-4,0	-13,9	-23,9
Март 2013	6,0	-19,1	0,4	-14,8	-17,4
Справочно: фактические значения за аналогичный период 2011/2012 гг.					
Октябрь 2011	109,48	2181	1665	7394	19039

Таблица 8, окончание

Месяц	Нефть марки Brent (долл./барр.)	Алюминий (долл./т)	Золото (долл./унц.)	Медь (долл./т)	Никель (долл./т)
Ноябрь 2011	110,51	2080	1738	7581	17873
Декабрь 2011	107,97	2024	1642	7559	18246
Январь 2012	110,99	2151	1652	8062	19909
Февраль 2012	119,70	2208	1743	8441	20394
Март 2012	124,93	2184	1675	8471	18661

Примечание. Ряды цен на нефть, никель, золото, медь и алюминий на интервале с января 1980 г. по август 2012 г. являются рядами типа DS.

Средний прогнозируемый уровень цен на нефть составляет около 125,2 долл./барр., что выше соответствующих показателей прошлого года в среднем на 10,0%. Цены на алюминий прогнозируются на уровне около 1786 долл./т, а их среднее прогнозируемое понижение составляет приблизительно 16% по сравнению с соответствующим уровнем прошлого года. Прогноз цен на золото составляет около 1662 долл./унц. Средние прогнозируемые цены на медь составляют около 7321 долл./т, а на цены никель – около 15584 долл./т. Среднее прогнозируемое падение цен на золото составляет около 1%, среднее понижение цен на медь – около 7%, среднее падение цен на никель – 18% по сравнению с соответствующим уровнем прошлого года.

На конец 2012 г. цена нефти марки Brent прогнозируется на уровне 125,25 долл./барр. (годовое повышение – 12,8%), алюминия – 1779 долл./т (падение – 17,3%), золота – 1666 долл./унц. (повышение – 0,8%), меди – 7317 долл./т (падение – 9,2%), никеля – 15598 тыс. долл./т (падение – 21,7%).

ДЕНЕЖНЫЕ ПОКАЗАТЕЛИ

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

Таблица 9

ПРОГНОЗ ДЕНЕЖНОГО АГРЕГАТА M_2 И ДЕНЕЖНОЙ БАЗЫ

Период	Денежная база		M_2	
	млрд руб.	прирост к предыдущему месяцу, %	млрд руб.	прирост к предыдущему месяцу, %
Октябрь 2012	6235,5	0,8	25363,5	0,9
Ноябрь 2012	6331,0	1,5	25583,3	0,9
Декабрь 2012	9050,8	43,0	25801,6	0,9
Январь 2013	6476,5	-28,4	26018,3	0,8
Февраль 2013	6528,2	0,8	26233,2	0,8
Март 2013	6625,5	1,5	26446,6	0,8
Справочно: фактические значения за соответствующие месяцы 2011 г. (прирост к предыдущему месяцу, %)				
Октябрь 2011		1,5		-0,5
Ноябрь 2011		1,0		2,7

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

Таблица 9, окончание

Период	Денежная база		M ₂	
	млрд руб.	прирост к предыдущему месяцу, %	млрд руб.	прирост к предыдущему месяцу, %
Декабрь 2011		10,7		11,8
Январь 2012		-5,9		-3,5
Февраль 2012		1,3		0,7
Март 2012		-1,4		0,8

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

В октябре-ноябре 2012 г. прогнозируемый среднемесячный прирост денежной базы составит 1.1% в месяц, а в декабре 2012г. планируется сезонный рост денежной базы на 43%. Годовой прирост денежной базы составит по прогнозам 26,6%. Денежный показатель M₂ будет расти со среднемесячным темпом 0,8% на рассматриваемом интервале времени. В результате, годовой прирост показателя M₂ в 2012 г. прогнозируется на уровне 5,4%.

МЕЖДУНАРОДНЫЕ РЕЗЕРВЫ

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

По результатам прогноза в октябре 2012 г. – марте 2013 г. международные резервы будут расти со среднемесячным темпом 1,7%. Годовой прирост международных резервов в 2012 г. прогнозируется на уровне 11,2%.

Таблица 10

ПРОГНОЗ МЕЖДУНАРОДНЫХ РЕЗЕРВОВ

Период	Прогнозные значения по ARIMA-моделям	
	млрд долл. США	прирост к предыдущему месяцу, %
Октябрь 2012	543,5	2,6
Ноябрь 2012	549,6	1,1
Декабрь 2012	554,5	0,9
Январь 2013	564,2	1,7
Февраль 2013	576,1	2,1
Март 2013	585,6	1,6
Справочно: фактические значения за аналогичный период 2011/2012 гг.		
Сентябрь 2011	516,8	-5,2
Октябрь 2011	525,6	1,7
Ноябрь 2011	510,9	-2,8
Декабрь 2011	498,6	-2,4
Январь 2012	505,4	1,3
Февраль 2012	513,9	1,7

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

¹ Данные по объему золотовалютных 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 сентябрь 2012 г. и за период с января 1999 г. по сентябрь 2012 г.¹ соответственно.

По результатам прогноза на основе ARIMA модели на октябрь 2012 г. – март 2013 г. курс доллара США к рублю составит в среднем 31,3 рубля за доллар. Среднее значение обменного курса евро к доллару США составит 1,29 долларов США за евро.

По результатам прогноза на основе SM модели курс доллара США к рублю в ближайшие 6 месяцев составит 31,8 рубля за доллар, а среднее значение обменного курса евро к доллару США составит 1,23 долларов США за евро.

Прогнозируемое на конец 2012 г. среднее значение показателя составит 31,57 рубля за доллар. Прогнозируемое среднее значение обменного курса евро к доллару США на конец 2012 г. по двум моделям составит 1,26 долл. США за евро.

Таблица 11

ПРОГНОЗ КУРСОВ RUR/USD И USD/EUR

Период	Прогнозные значения курса RUR/USD (рублей за доллар США)		Прогнозные значения курса USD/EUR (долларов США за евро)	
	ARIMA	SM	ARIMA	SM
Октябрь 2012	31,22	31,61	1,28	1,23
Ноябрь 2012	31,37	31,69	1,28	1,23
Декабрь 2012	31,39	31,74	1,28	1,23
Январь 2013	31,38	31,82	1,29	1,23
Февраль 2013	31,32	31,87	1,30	1,23
Март 2013	31,26	31,95	1,31	1,23
Справочно: фактические значения за аналогичный период 2011/2012 гг.				
Октябрь 2011	31,23		1,37	
Ноябрь 2011	30,67		1,36	
Декабрь 2011	31,30		1,31	
Январь 2012	31,26		1,29	
Февраль 2012	29,80		1,32	
Март 2012	29,26		1,32	

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

ПОКАЗАТЕЛИ УРОВНЯ ЖИЗНИ НАСЕЛЕНИЯ

В данном разделе (см. табл. 12) представлены результаты расчета прогнозных значений показателей реальной заработной платы, реальных располагаемых денежных доходов и реальных денежных доходов², полученные на основе моделей временных рядов соответствующих показателей, рассчитываемых Росстатом и взятых на интервале с января 1999 г. по август 2012 г. Данные показатели в некоторой степени зависят от централизованных ре-

1 В Бюллетене использованы данные МВФ за период с января 1999 г. по июль 2012 г. Данные за август и сентябрь 2012 г. взяты с сайта статистики обменных курсов www.oanda.com.

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

шений 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. 12, прогнозируют рост реальных располагаемых денежных доходов и реальных денежных доходов по сравнению с уровнем соответствующего периода прошлого года. Так, ожидается среднее увеличение реальных располагаемых денежных доходов около 4,3%; рост реальных денежных доходов составит также порядка 4% по сравнению с соответствующим прошлогодним уровнем. Прогнозируется снижение реальной заработной платы в размере 3,3% по сравнению с аналогичным периодом предшествующего года.

По итогам 2012 г. прогнозируемый прирост показателей уровня жизни населения составит: реальных располагаемых денежных доходов – на 5%, реальных денежных доходов – на 6,2%, реальной заработной платы – на 5,3% за 12 месяцев.

Таблица 12

ПРОГНОЗ ПОКАЗАТЕЛЕЙ УРОВНЯ ЖИЗНИ НАСЕЛЕНИЯ

Период	Реальные располагаемые денежные доходы	Реальные денежные доходы	Реальная начисленная заработная плата
Прогнозные значения по ARIMA-моделям (в % к соответствующему месяцу 2011/2012 гг.)			
Октябрь 2012	106,3	106,0	106,1
Ноябрь 2012	106,1	106,6	106,1
Декабрь 2012	105,0	106,2	105,3
Январь 2013	106,3	106,2	106,3
Февраль 2013	107,8	108,2	105,6
Март 2013	108,6	107,7	105,1
Справочно: фактические значения за соответствующий период 2011/2012 гг. (в % к аналогичному периоду 2010/2011 гг.)			
Октябрь 2011	101,1	100,0	106,2
Ноябрь 2011	100,7	100,8	107,0
Декабрь 2011	106,3	106,9	111,4
Январь 2012	101,0	101,9	110,5
Февраль 2012	103,1	103,8	112,1
Март 2012	102,8	103,2	109,0
Март 2012	102,8	103,2	109,0

Примечание. Для расчетов использовались ряды располагаемых денежных доходов, реальных денежных доходов и реальной заработной платы в базисной форме (за базисный период был принят январь 1999 г.). На рассматриваемом интервале с января 1999 г. по август 2011 г. эти ряды были отнесены к классу процессов, являющихся стационарными в разностях, с выраженной сезонной составляющей.

ПОКАЗАТЕЛИ ЧИСЛЕННОСТИ ЗАНЯТОГО В ЭКОНОМИКЕ НАСЕЛЕНИЯ И ОБЩЕЙ ЧИСЛЕННОСТИ БЕЗРАБОТНЫХ

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

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

результатов конъюнктурных опросов¹. Отметим, что возможные логические расхождения² в прогнозах общей численности занятых и общей численности безработных, которые в сумме должны быть равны показателю экономически активного населения, могут возникать вследствие того, что каждый ряд прогнозируется отдельно, а не как разность между прогнозными значениями экономически активного населения и другого показателя.

Таблица 13

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

Месяц	Численность занятого в экономике населения (ARIMA)		Общая численность безработных (ARIMA)			Общая численность безработных (КО)		
	млн чел.	прирост к соответствующему месяцу 2011/2012 гг. (%)	млн чел.	прирост к соответствующему месяцу 2011/2012 гг. (%)	в (%) к показателю численности занятого в экономике населению	млн чел.	прирост к соответствующему месяцу 2011/2012 гг. (%)	в (%) к показателю численности занятого в экономике населению
Октябрь 2012	71,5	1,0	4,1	-14,5	5,7	4,1	-14,0	5,7
Ноябрь 2012	71,4	0,6	4,2	-12,0	5,9	4,1	-14,0	5,7
Декабрь 2012	71,1	0,3	4,4	-4,3	6,2	4,1	-12,0	5,8
Январь 2013	70,6	0,9	4,6	-5,5	6,6	4,2	-14,3	5,9
Февраль 2013	70,7	1,2	4,7	-1,4	6,7	4,1	-14,0	5,8
Март 2013	70,9	1,5	4,6	-5,7	6,5	4,3	-12,9	6,1
Справочно: фактические значения за аналогичные периоды 2011/2012 гг. (млн чел.)								
Октябрь 2011		70,8					4,8	
Ноябрь 2011		71,0					4,8	
Декабрь 2011		70,9					4,6	
Январь 2012		70,0					4,9	
Февраль 2012		69,9					4,8	
Март 2012		69,8					4,9	

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

Согласно прогнозам по ARIMA-моделям (см. табл. 13), в октябре 2012 г. – марте 2013 г. рост численности занятых в экономике в среднем составит 0,9% в месяц по отношению к соответствующему периоду предыдущего года. Прогнозируемое на конец 2012 г. значение показателя численности занятого в экономике населения составляет 71,1 млн чел. Среднее сокращение показателя общей численности безработных прогнозируется на уровне 10,4% в месяц по сравнению с аналогичным периодом прошлого года. Средняя численность безработных в конце 2012 г. прогнозируется на уровне 4,25 млн чел. ●

1 Модель оценена на интервале с января 1999 г. по июль 2012 г.

2 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

**Графики временных рядов экономических показателей РФ:
фактические и прогнозные значения**

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

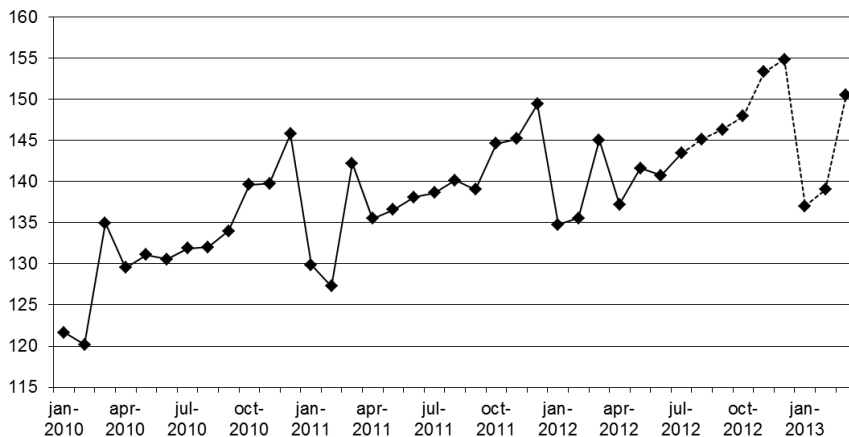


Рис. 1б. Индекс промышленного производства НИУ ВШЭ (ARIMA-модель)
(% к январю 1995 г.)

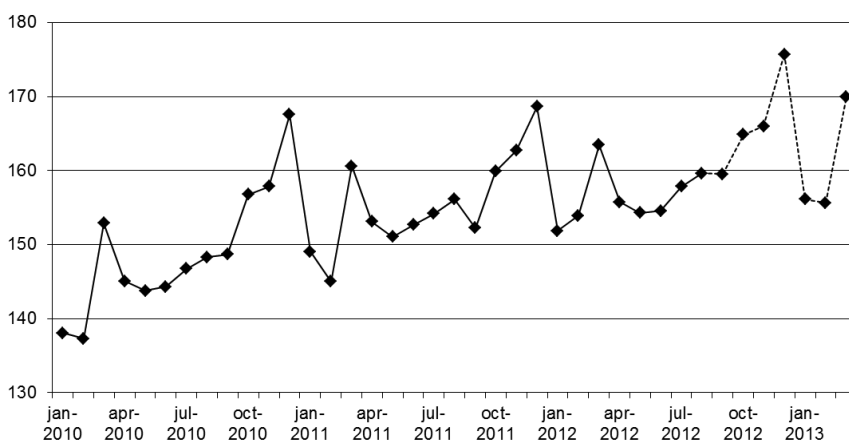


Рис. 2а. ИПП в добыче полезных ископаемых ФСГС
(% к декабрю 2001 г.)

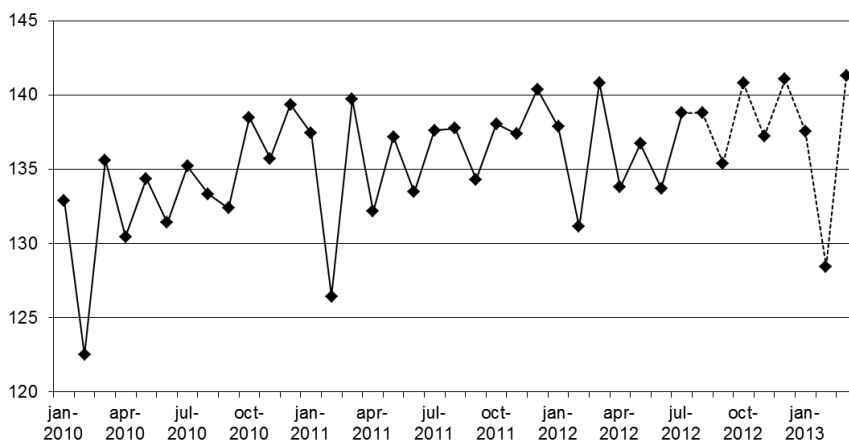


Рис. 2б. ИПП в добыче полезных ископаемых НИУ ВШЭ (% к январю 1995 г.)

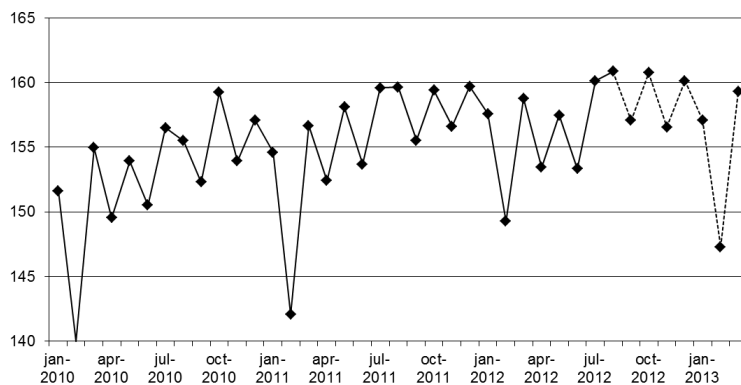


Рис. 3а. ИПП в обрабатывающих производствах ФСГС (% к декабрю 2001 г.)

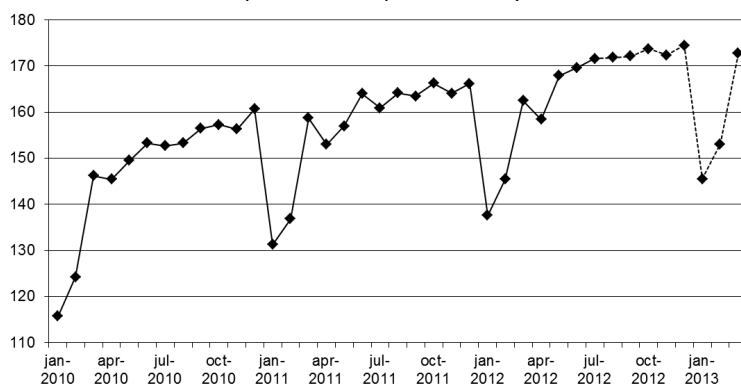


Рис. 3б. ИПП в обрабатывающих производствах НИУ ВШЭ (% к январю 1995 г.)

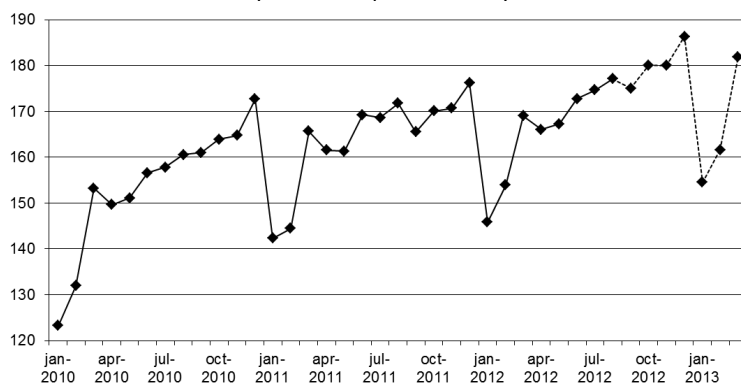


Рис. 4а. ИПП в производстве и распределении электроэнергии, газа и воды ФСГС (% к декабрю 1998 г.)

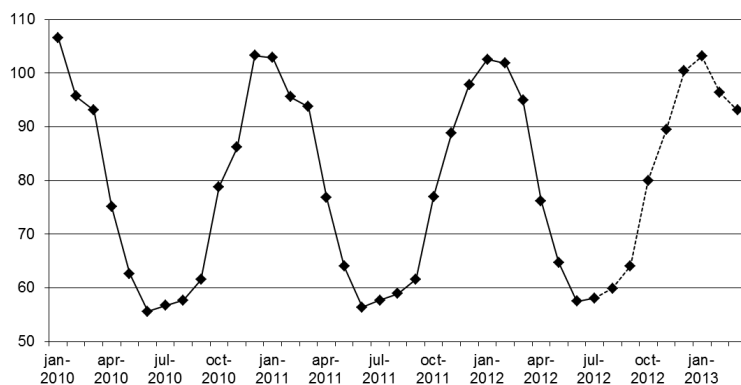


Рис. 4б. ИПП в производстве и распределении электроэнергии, газа и воды НИУ ВШЭ (% к январю 1995 г.)

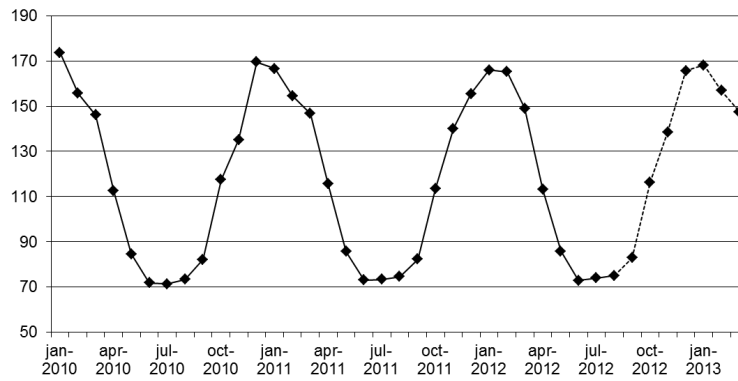


Рис. 5а. ИПП в производстве пищевых продуктов ФСГС (% к декабрю 2001 г.)

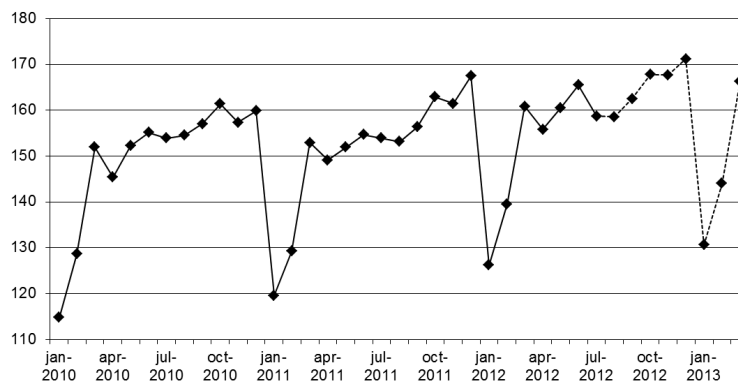


Рис. 5б. ИПП в производстве пищевых продуктов НИУ ВШЭ (% к январю 1995 г.)

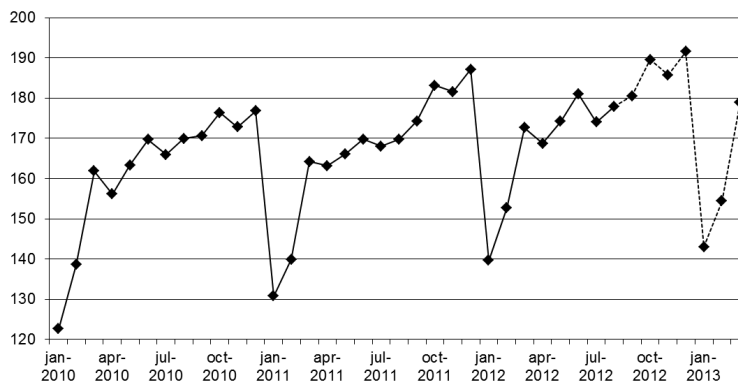


Рис. 6а. ИПП в производстве кокса и нефтепродуктов ФСГС (% к декабрю 2001 г.)

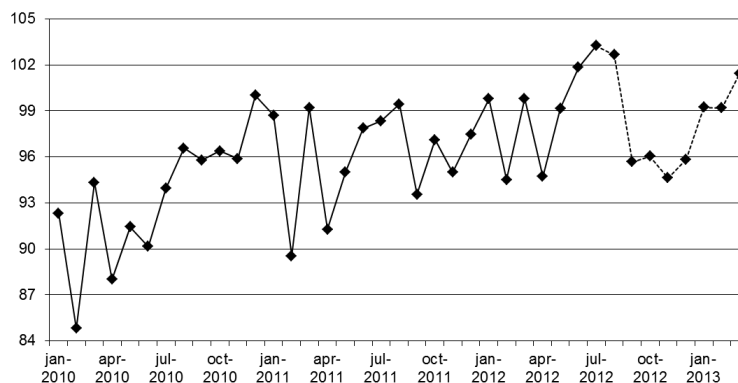


Рис. 6б. ИПП в производстве кокса и нефтепродуктов НИУ ВШЭ (% к январю 1995 г.)

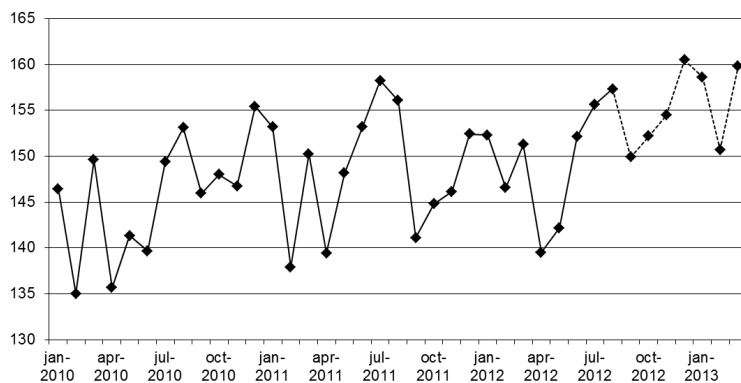


Рис. 7а. ИПП в металлургическом производстве и производстве готовых металлических изделий ФСГС (% к декабрю 1998 г.)

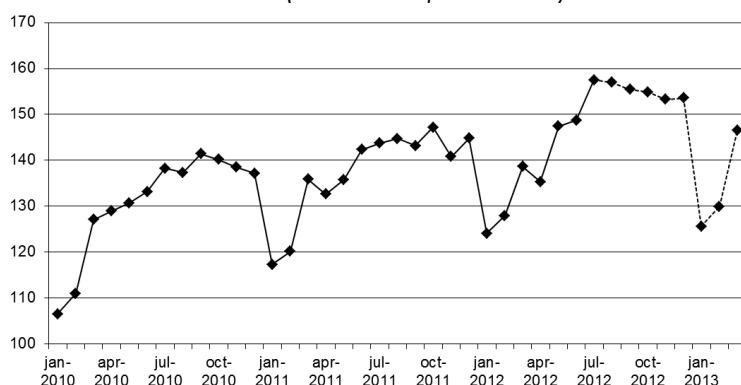


Рис. 7б. ИПП в металлургическом производстве и производстве готовых металлических изделий НИУ ВШЭ (% к январю 1995 г.)

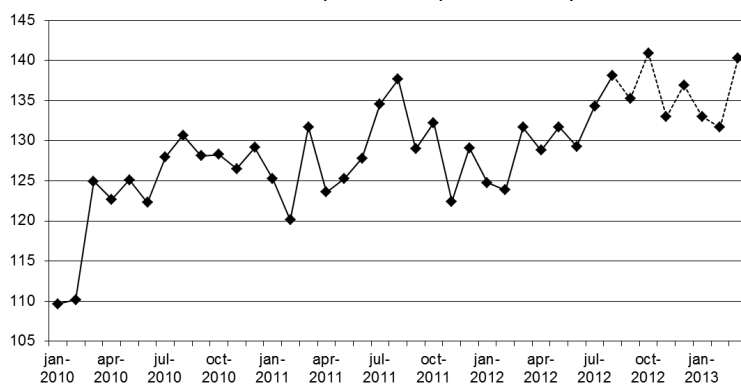


Рис. 8а. ИПП в производстве машин и оборудования ФСГС (% к декабрю 1998 г.)

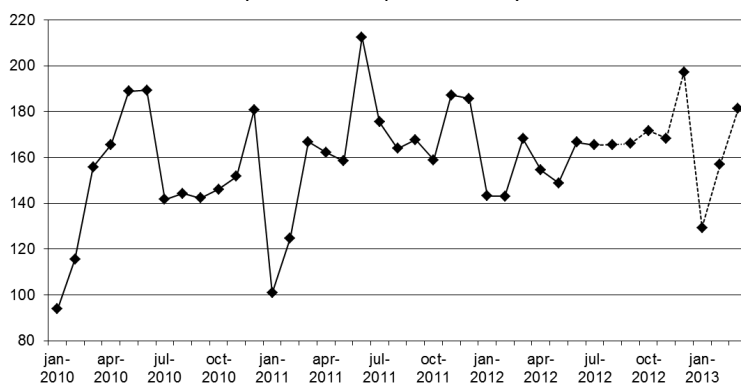


Рис. 8б. ИПП в производстве машин и оборудования НИУ ВШЭ (% к январю 1995 г.)

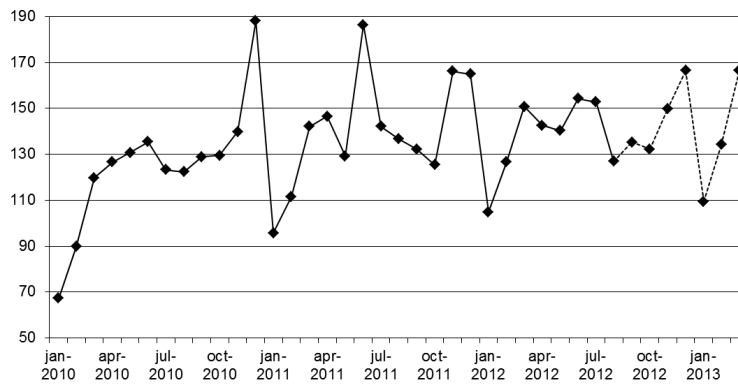


Рис. 9. Оборот розничной торговли (млрд руб.)

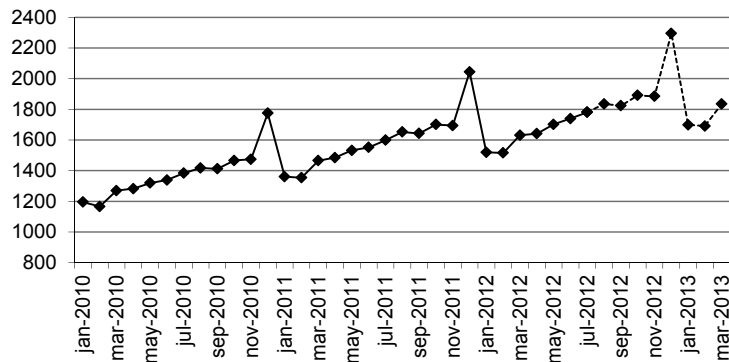


Рис. 9а. Реальный оборот розничной торговли (% к соответствующему периоду прошлого года)

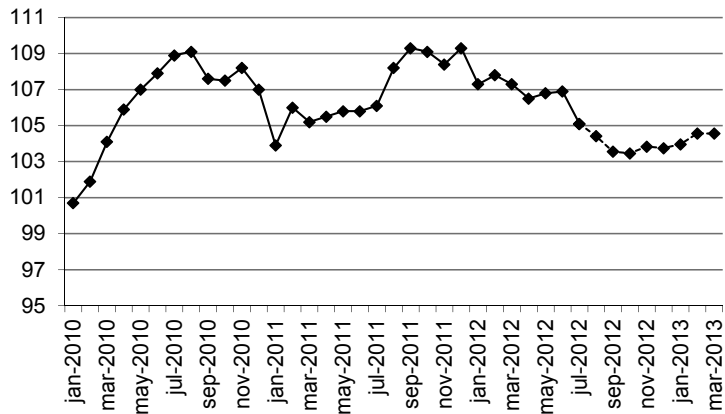


Рис. 10. Инвестиции в основной капитал (млрд руб.)

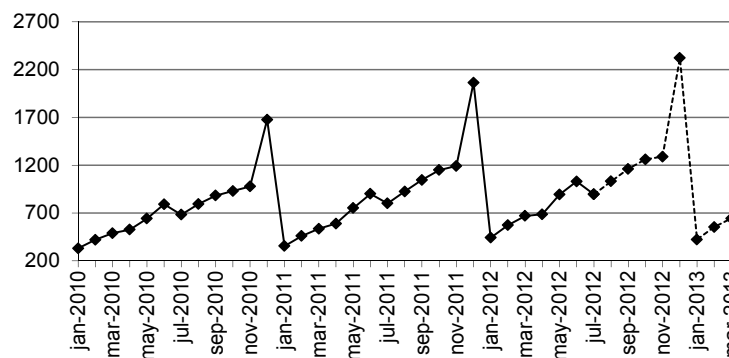


Рис. 10а. Реальные инвестиции в основной капитал (% к соответствующему периоду прошлого года)

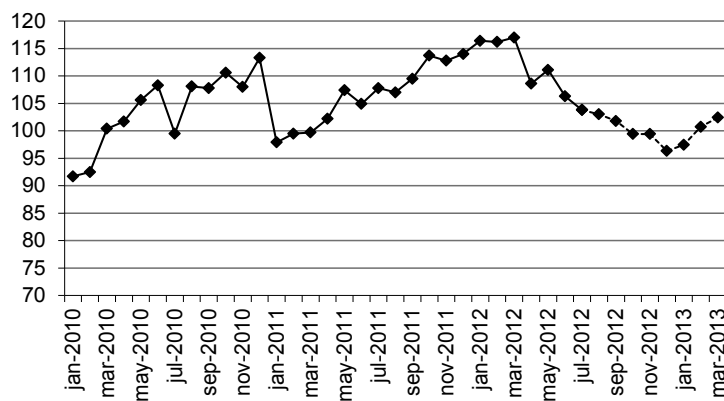


Рис. 11. Экспорт во все страны (млрд долл.)

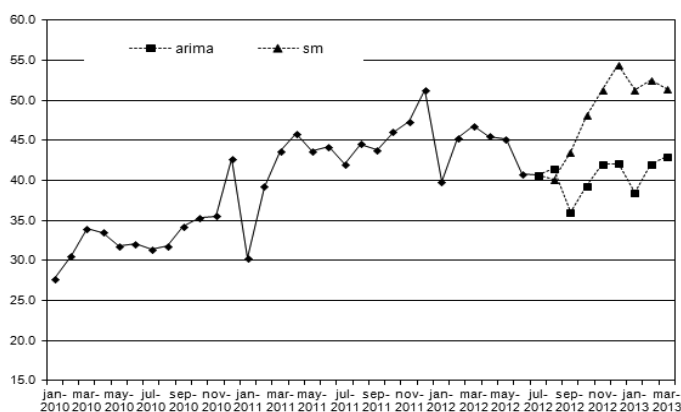


Рис. 12. Экспорт в страны вне СНГ (млрд долл.)

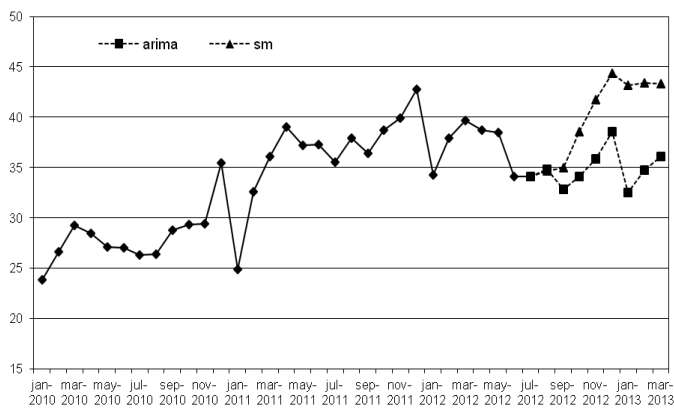


Рис. 13. Импорт из всех стран (млрд долл.)

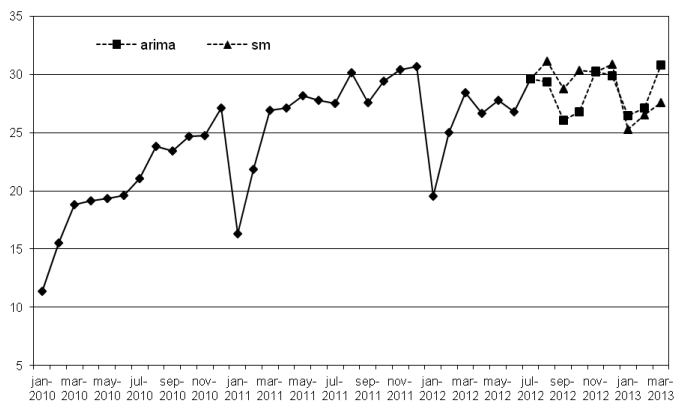


Рис. 14. Импорт из стран вне СНГ (млрд долл.)

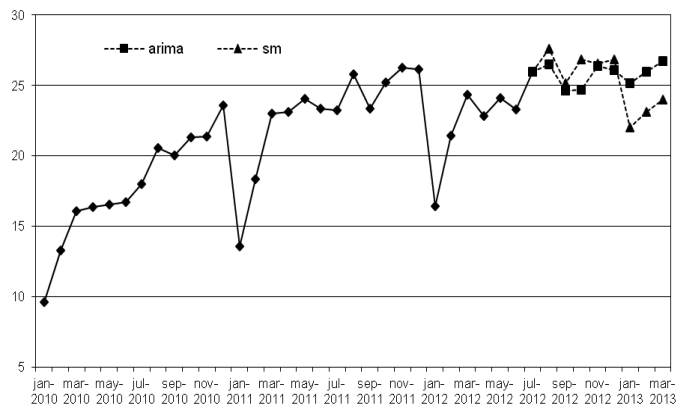


Рис. 15. Индекс потребительских цен в % к декабрю предшествующего года

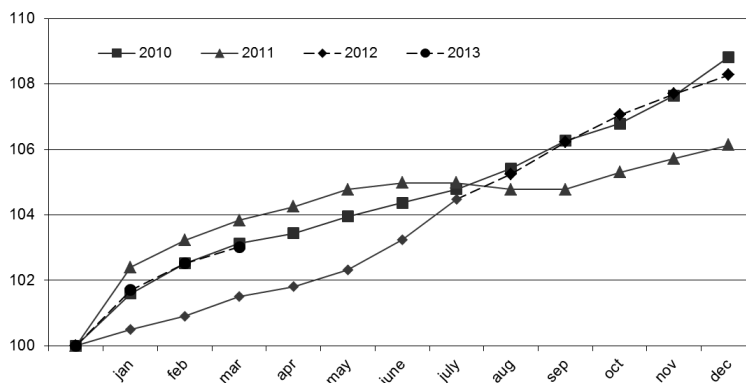


Рис. 15а. Индекс потребительских цен в % к декабрю предшествующего года (SM)

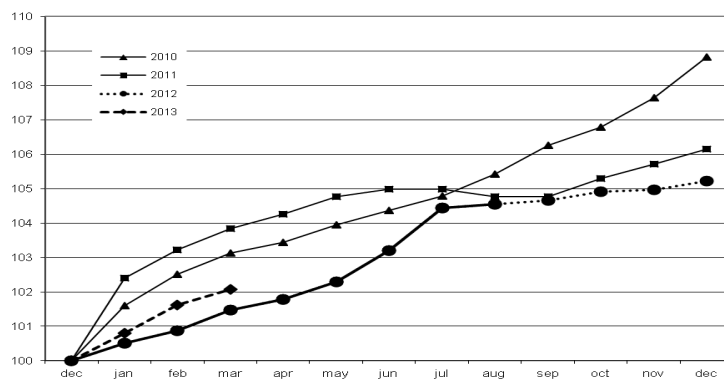


Рис. 16. Индекс цен производителей промышленных товаров в % к декабрю предыдущего года

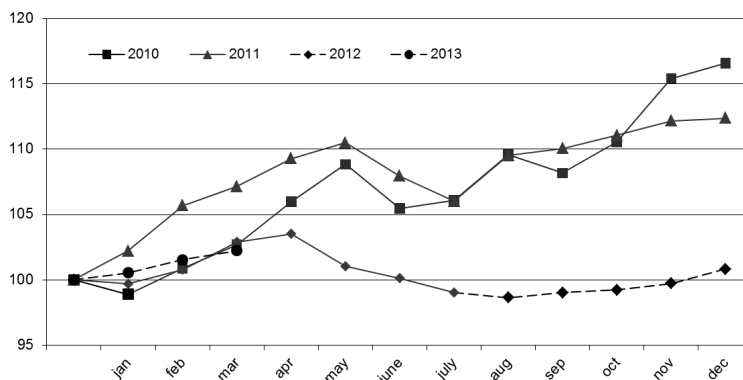


Рис. 17. Индекс цен в добыче полезных ископаемых в % к декабрю предыдущего года

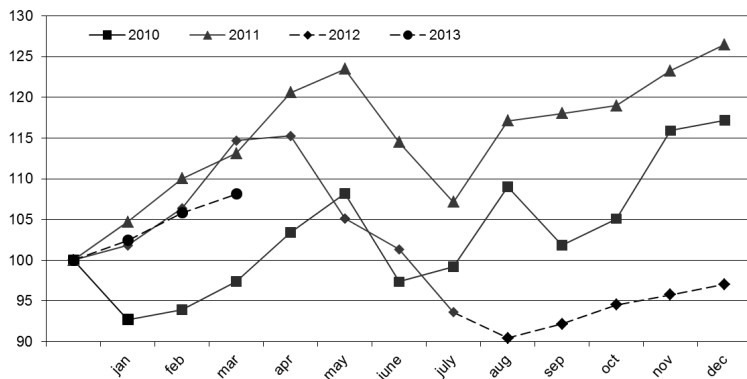


Рис. 18. Индекс цен в обрабатывающих производствах в % к декабрю предыдущего года

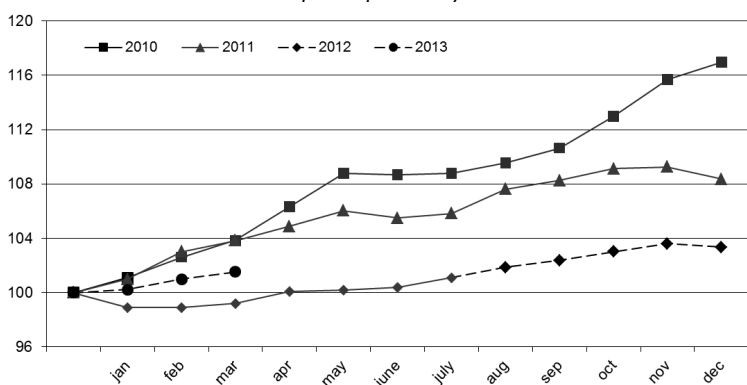


Рис. 19. Индекс цен в производстве и распределении электроэнергии, газа и воды в % к декабрю предыдущего года

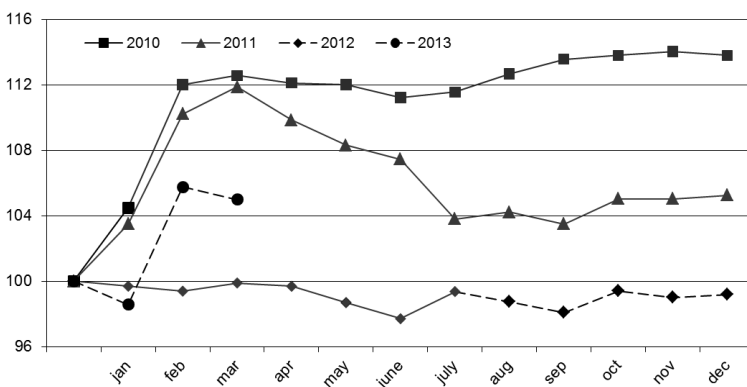


Рис. 20. Индекс цен в производстве пищевых продуктов в % к декабрю предыдущего года

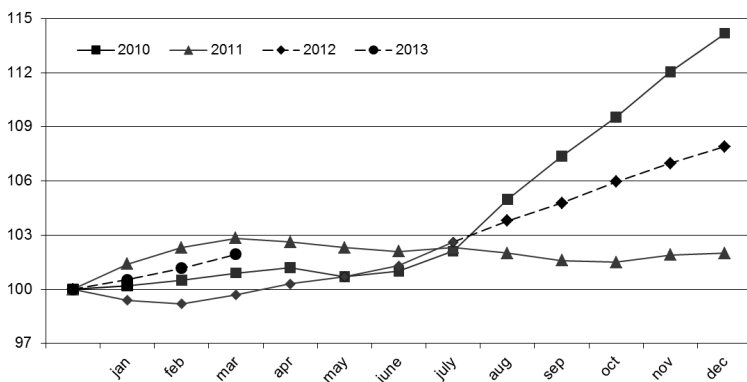


Рис. 21. Индекс цен в текстильном и швейном производстве в % к декабрю предыдущего года

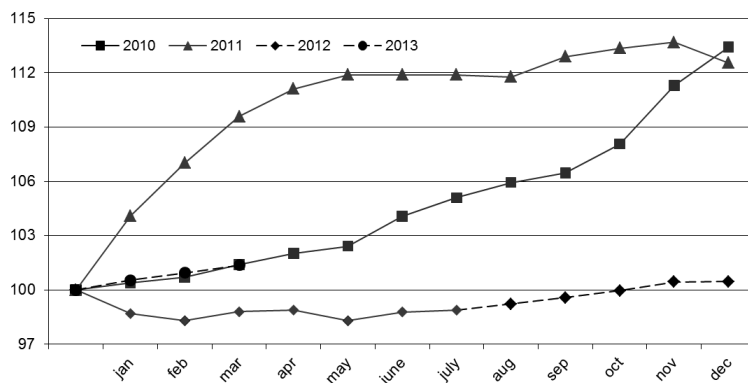


Рис. 22. Индекс цен в обработке древесины и производстве изделий из дерева в % к декабрю предыдущего года

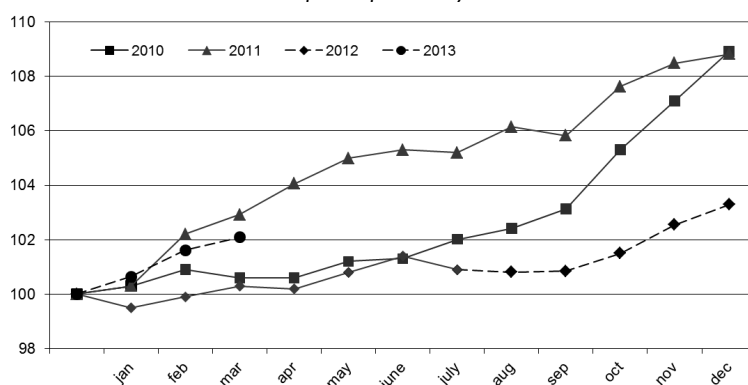


Рис. 23. Индекс цен в целлюлозно-бумажном производстве в % к декабрю предыдущего года

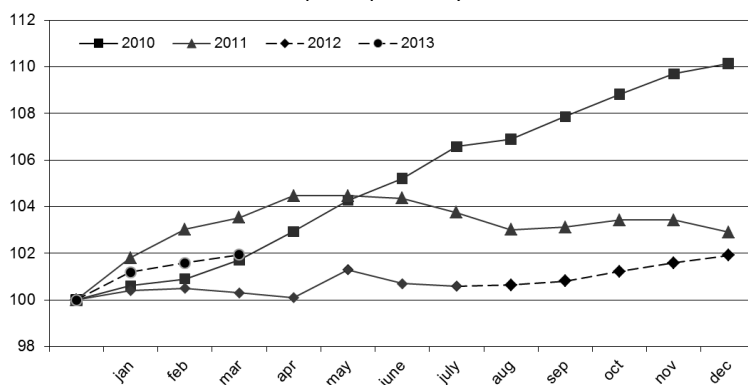


Рис. 24. Индекс цен в производстве кокса и нефтепродуктов в % к декабрю предыдущего года

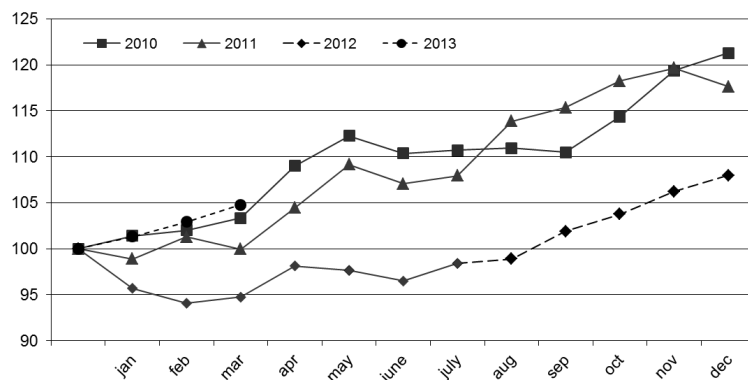


Рис. 25. Индекс цен в химическом производстве в % к декабрю предыдущего года

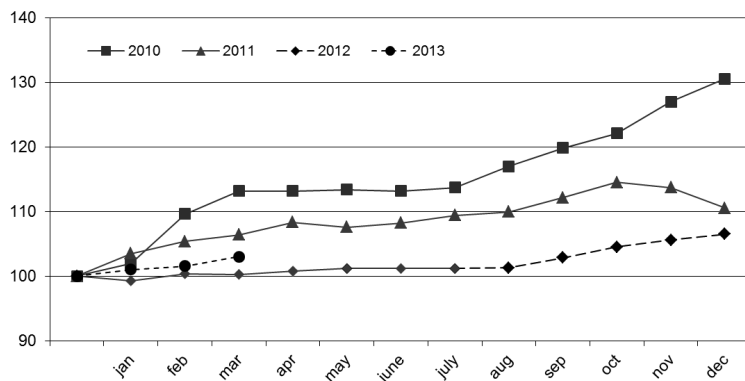


Рис. 26. Индекс цен в металлургическом производстве и производстве готовых металлических изделий в % к декабрю предыдущего года

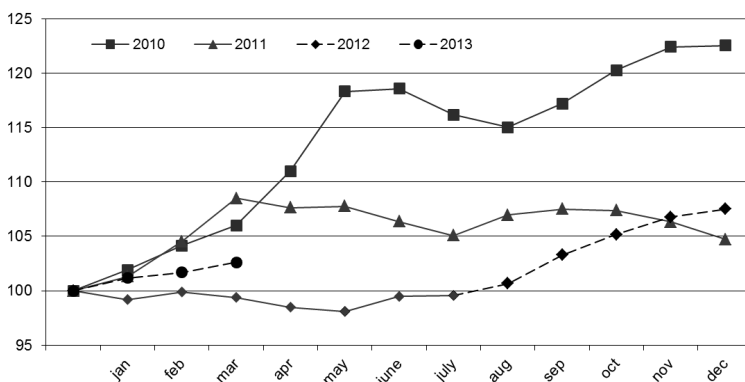


Рис. 27. Индекс цен в производстве машин и оборудования в % к декабрю предыдущего года

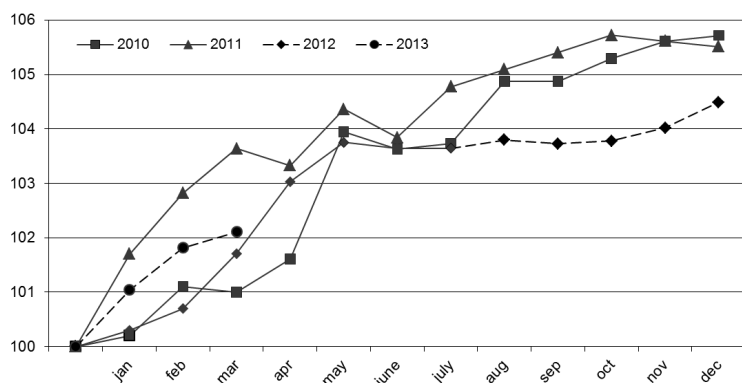


Рис. 28. Индекс цен в производстве транспортных средств и оборудования в % к декабрю предыдущего года

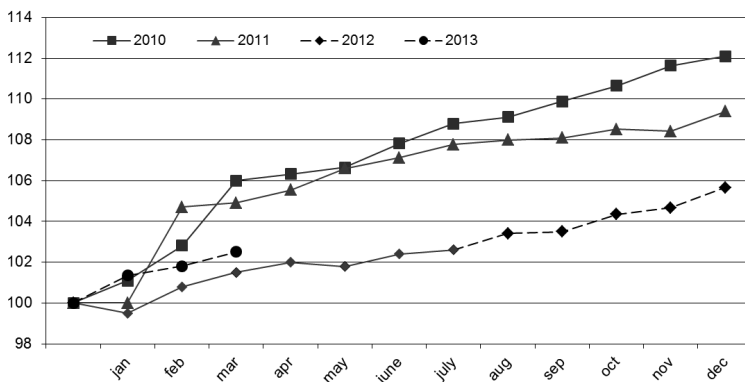


Рис. 29. Стоимость минимального набора продуктов питания на одного человека в месяц (руб.)

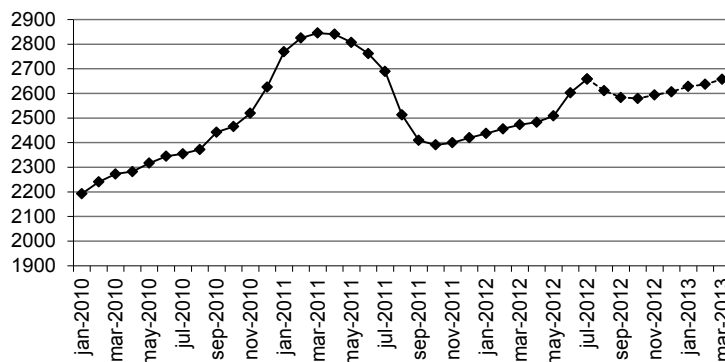


Рис. 30. Сводный индекс транспортных тарифов (для каждого года в % к предшествующему месяцу)

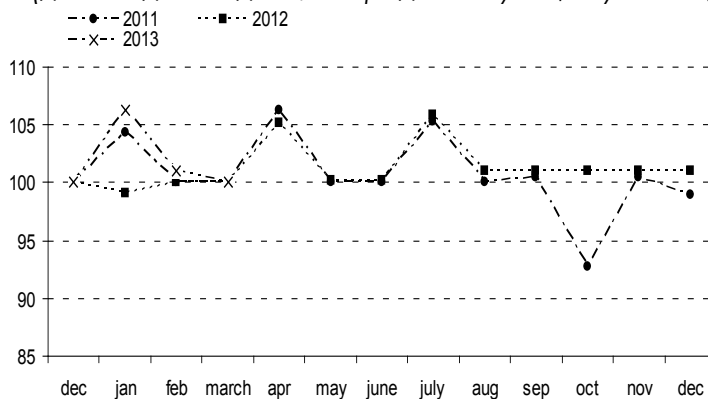


Рис. 31. Индекс тарифов на грузовые перевозки автомобильным транспортом (для каждого года в % к предшествующему месяцу)

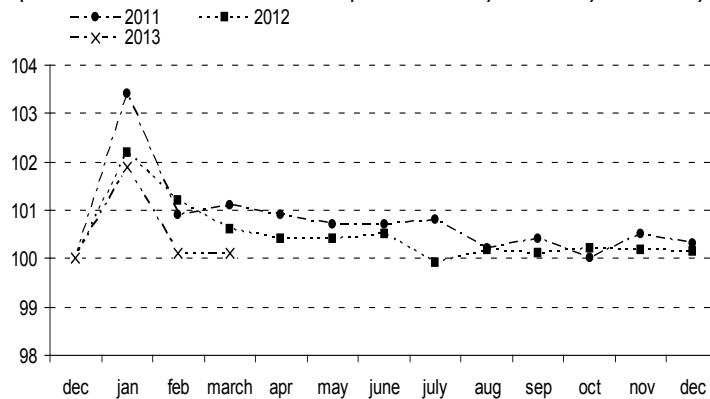


Рис. 32. Индекс тарифов на трубопроводный транспорт (для каждого года в % к предшествующему месяцу)

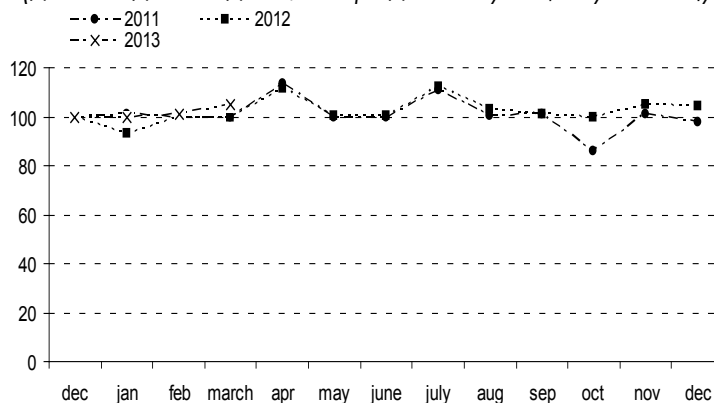


Рис. 33. Цена на нефть марки Brent (долл./барр.)

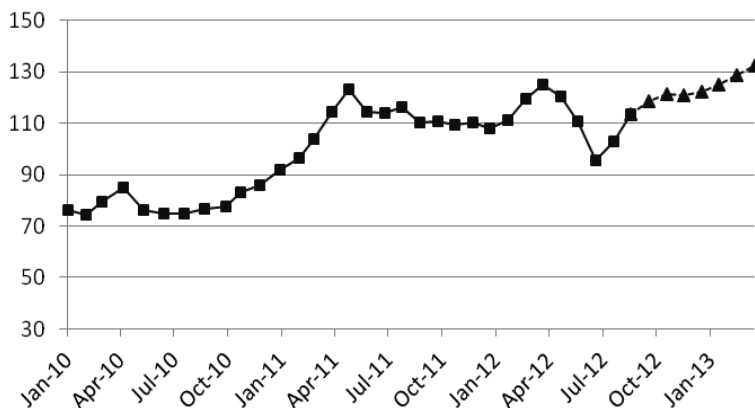


Рис. 34. Цены на алюминий (долл./т)

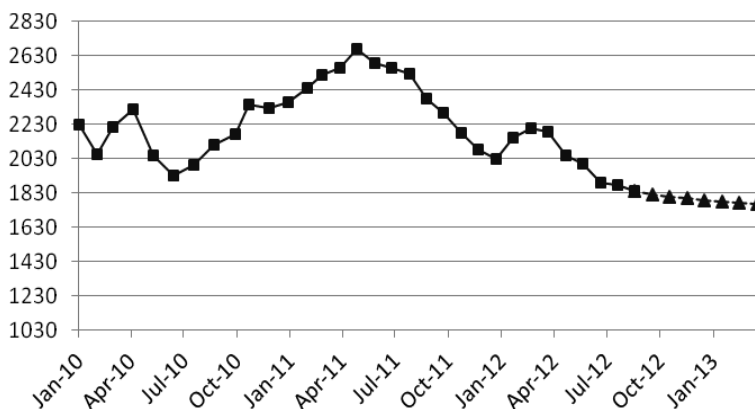


Рис. 35. Цены на золото (долл./унц.)

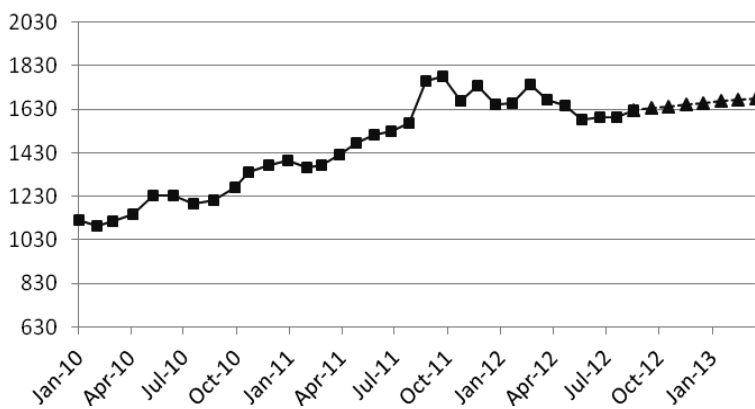


Рис. 36. Цены на никель (долл./т)

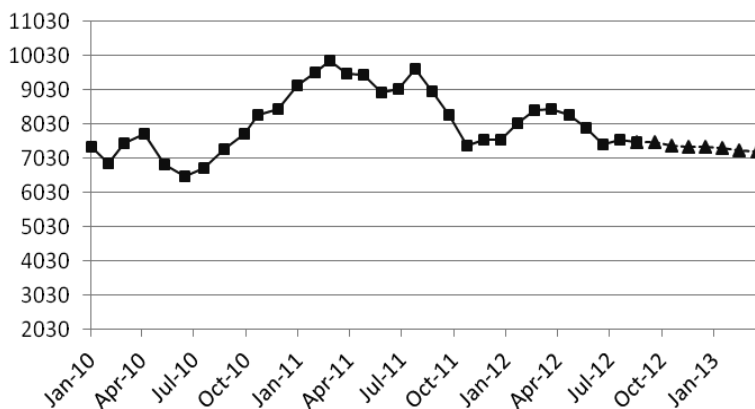


Рис. 37. Цены на медь (долл./т)

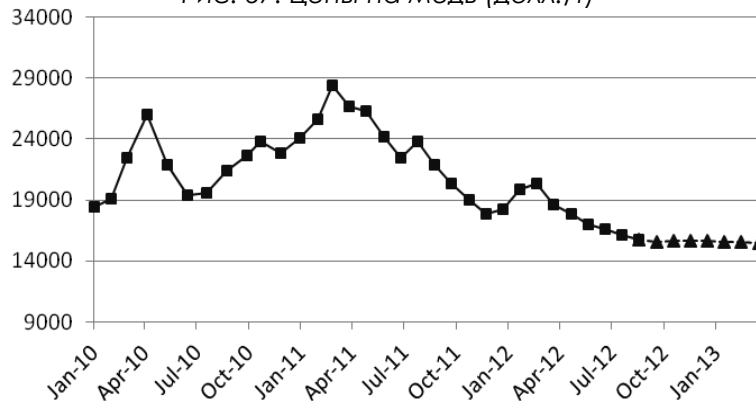


Рис. 38. Денежная база, млн руб.

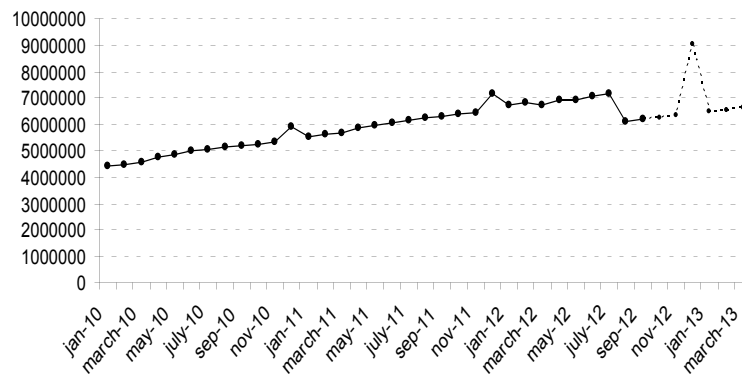


Рис. 39. M_2 , млрд руб.

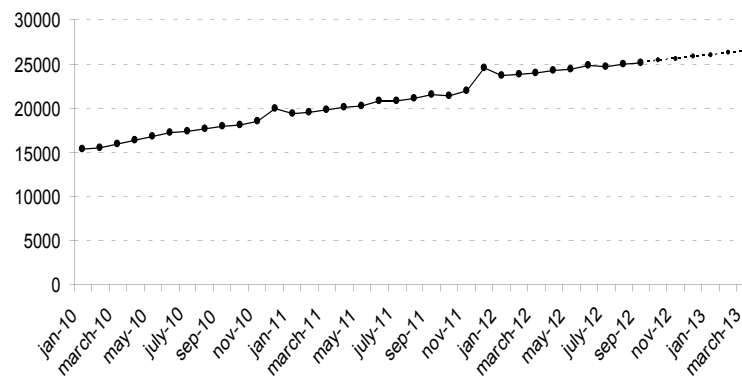


Рис. 40. Международные резервы РФ, млн долл. США

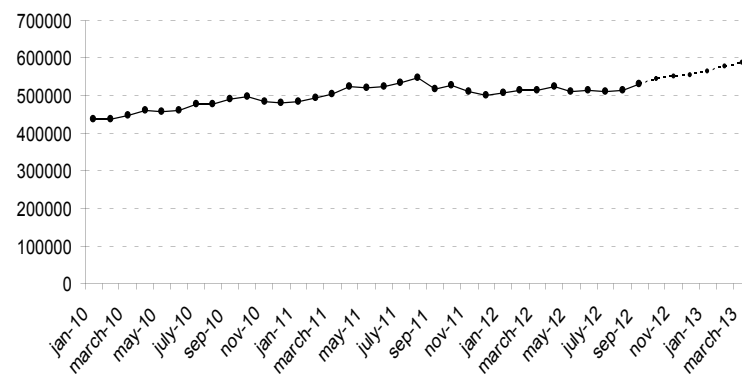


Рис. 41. Курс RUR/USD

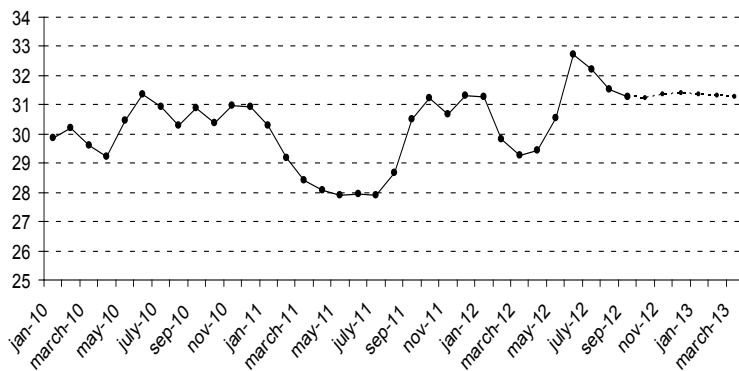


Рис. 41а. Курс RUR/USD (SM)

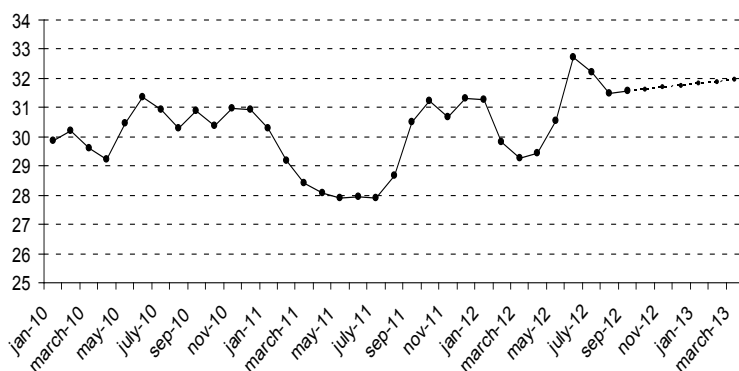


Рис. 42. Курс USD/EUR

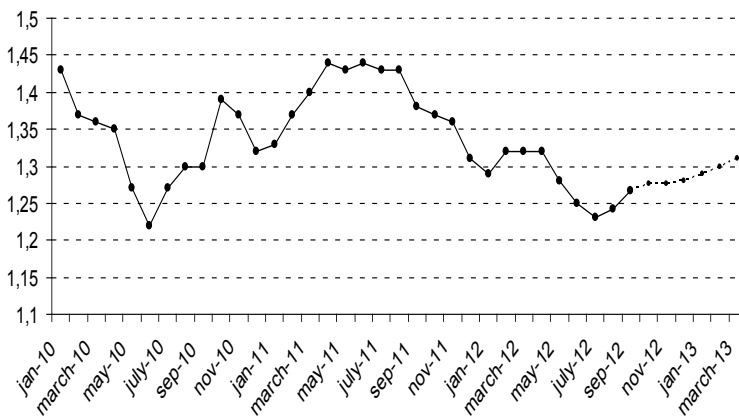


Рис. 42а. Курс USD/EUR (SM)

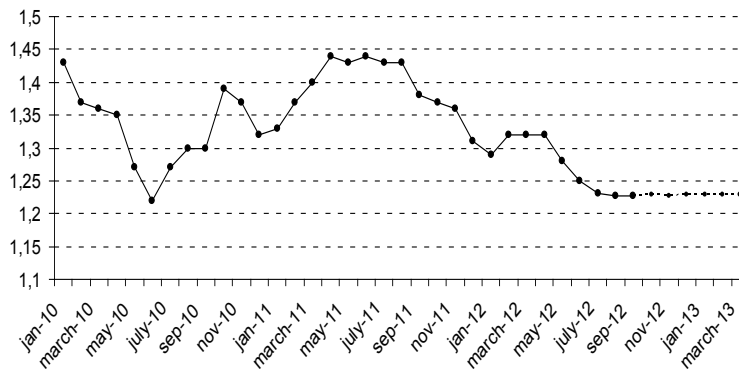


Рис. 43. Реальные располагаемые денежные доходы
(в % к соответствующему периоду предыдущего года)

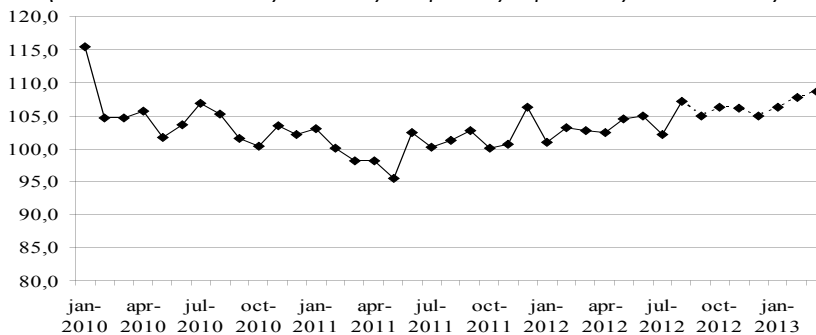


Рис. 44. Реальные денежные доходы
(в % от уровня января 1999 г.)

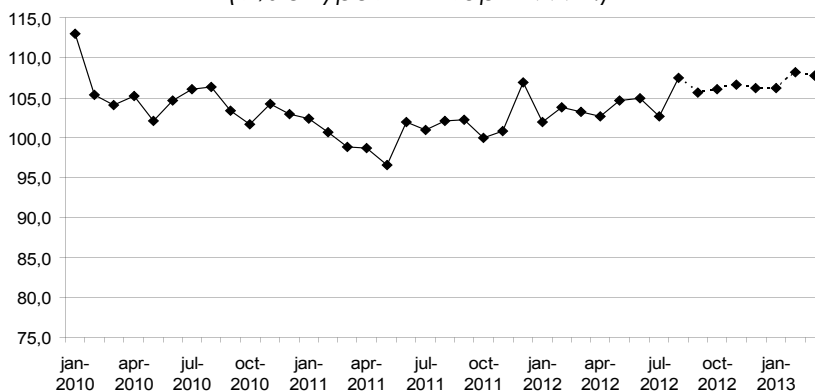


Рис. 45. Реальная начисленная заработная плата
(в % к соответствующему периоду предыдущего года)

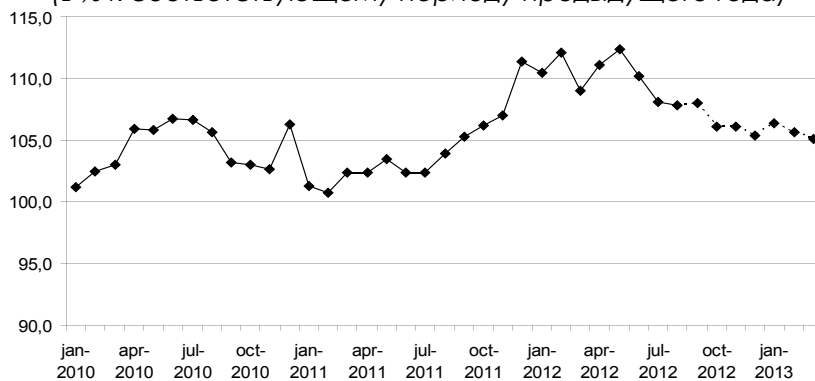


Рис. 46. Численность занятого в экономике населения (млн чел.)

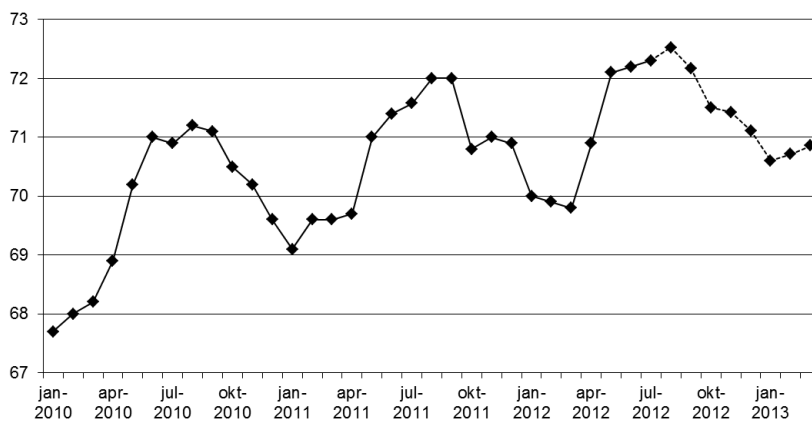


Рис. 47. Общая численность безработных (млн чел.)

