



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

12'2012

МОДЕЛЬНЫЕ РАСЧЕТЫ 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	12
ПОКАЗАТЕЛИ УРОВНЯ ЖИЗНИ НАСЕЛЕНИЯ	13
ПОКАЗАТЕЛИ ЧИСЛЕННОСТИ ЗАНЯТОГО В ЭКОНОМИКЕ НАСЕЛЕНИЯ 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: loratina@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 январе–июне 2013 г., построенные на основе моделей временных рядов, разработанных в результате исследований, проводимых в течение последних нескольких лет в ИЭП имени Е.Т. Гайдара¹. Используемый метод прогнозирования относится к группе *формальных* или *статистических* методов. Иными словами, полученные значения не являются выражением *мнения* или *экспертной оценки* исследователя, а представляют собой расчеты будущих значений конкретного экономического показателя, выполненные на основе формальных моделей временных рядов ARIMA (p, d, q) с учетом существующего тренда и, в некоторых случаях, его значимых изменений. Представляемые прогнозы имеют инерционный характер, поскольку соответствующие модели учитывают динамику данных до момента построения прогноза и особенно сильно зависят от тенденций, характерных для временного ряда в период непосредственно предшествующий интервалу времени, для которого строится прогноз. Данные оценки будущих значений экономических показателей Российской Федерации могут быть использованы для поддержки принятия решений, касающихся экономической политики, при условии, что общие тенденции, наблюдаемые до момента, в который строится прогноз для каждого конкретного показателя, не изменятся, т.е. в будущем не произойдет серьезных шоков или изменения сложившихся долгосрочных тенденций.

Несмотря на наличие значительного объема данных, относящихся к периоду до кризиса 1998 г., анализ и построение моделей для прогнозирования производилось лишь на временном интервале после августа 1998 г. Это обусловлено результатами предыдущих исследований², одним из основных выводов которых является то, что учет данных докризисного периода в большинстве случаев ухудшает качество прогнозов. К тому же, в данный момент представляется 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., ИЭПП, 2001; Р.М. Энтов, В.П. Носко, А.Д. Юдин, П.А. Кадочников, С.С. Пономаренко. *Проблемы прогнозирования некоторых макроэкономических показателей*. М., ИЭПП, 2002; В. Носко, А. Бузаев, П. Кадочников, С. Пономаренко. *Анализ прогнозных свойств структурных моделей и моделей с включением результатов опросов предприятий*. М., ИЭПП, 2003; Турунцева М.Ю., Киблицкая Т.Р. *Качественные свойства различных подходов к прогнозированию социально-экономических показателей РФ*. М.: ИЭПП, 2010, Научные труды № 135Р.

2 Там же.

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

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

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

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

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

В 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 1-е полугодие 2013 г. были использованы ряды месячных данных индексов промышленного производства Федеральной службы государственной статистики (Росстата) с января 2002 г. по октябрь 2012 г. и ряды базисных индексов промышленного производства Научно-исследовательского университета Высшей школы экономики (НИУ ВШЭ)¹ за период с января 1999 г. по ноябрь 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 1-м полугодии 2013 г. по сравнению с аналогичным периодом предыдущего года по промышленности в целом составляет 2,5%. Для индекса промышленного производства Росстата данный показатель составляет 2,1%.

Среднемесячные значения индекса промышленного производства в добыче полезных ископаемых Росстата и НИУ ВШЭ в январе–июне 2013 г. составляют соответственно 1,6% и 1,2%. В производстве кокса и нефтепродуктов средний рост прогнозируется на уровне 2,7% и 4,4% для индексов Росстата и НИУ ВШЭ соответственно.

Средний прирост индекса промышленного производства в обрабатывающей промышленности НИУ ВШЭ в 1-м полугодии 2013 г. по сравнению с аналогичным периодом предыдущего года составляет 4,0%, индекса Росстата – 4,2%. Среднемесячные значения индекса промышленного производства в производстве пищевых продуктов Росстата и НИУ ВШЭ составляют 3,9% каждый. Среднемесячные значения индексов промышленного производства Росстата и НИУ ВШЭ для металлургического производства и производства готовых металлических изделий в январе–июне 2013 г. составляют соответственно (-1,9%) и 2,8%. В производстве машин и оборудования средний рост прогнозируется на уровне 7,3% и (-4,3%) для индексов Росстата и НИУ ВШЭ соответственно.

Средний прирост индекса промышленного производства в производстве и распределении электроэнергии, газа и воды Росстата в январе–июне 2013 г. по сравнению с тем же периодом предыдущего года составляет 0,5%; аналогичный показатель для индекса НИУ ВШЭ составляет (-1,2%).

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 октябрь 2012 г.

Как следует из результатов, представленных в табл. 2, средний прогнозируемый прирост объемов месячного товарооборота в 1-м полугодии 2013 г. по отношению к соответствующему периоду 2012 г. составляет около 12,5%.

Средний прогнозируемый прирост месячного реального товарооборота в период с января по июнь 2013 г. по отношению к соответствующему периоду 2012 г. составляет 4,9%.

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 энергии, 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		
	ARIMA	ARIMA	НИУ ВШЭ	Ростат		Ростат		Ростат		Ростат		Ростат		Ростат		Ростат		
				НИУ ВШЭ	КО	НИУ ВШЭ	КО	НИУ ВШЭ	КО	НИУ ВШЭ	КО	НИУ ВШЭ	КО	НИУ ВШЭ	КО	НИУ ВШЭ	КО	НИУ ВШЭ
Прогнозируемый прирост к соответствующему месяцу предшествующего года																		
Январь 2013	0,4	2,2	2,5	1,9	0,5	0,7	5,7	3,4	0,1	-1,3	3,9	3,1	-0,4	3,9	-4,0	1,9	-14,8	-12,7
Февраль 2013	0,8	2,2	0,5	2,1	-0,8	-0,6	4,8	1,2	-5,2	-7,5	3,0	1,5	5,0	2,7	-3,8	2,1	4,9	-5,6
Март 2013	2,1	2,1	3,5	2,3	1,1	1,1	7,3	5,4	-1,6	-3,5	3,9	4,1	1,6	4,5	0,2	1,4	3,9	-7,2
Апрель 2013	4,0	2,5	3,0	2,3	2,0	1,8	4,9	4,7	1,1	1,7	4,6	5,3	6,0	5,6	0,8	3,2	14,4	-3,1
Май 2013	1,1	2,2	3,8	1,8	3,2	2,3	0,7	4,5	3,6	2,3	4,5	4,7	3,1	7,6	-4,1	3,2	17,1	-1,5
Июнь 2013	2,9	2,2	3,9	2,0	3,4	2,2	1,9	4,7	5,0	1,1	3,5	4,4	1,0	2,3	-0,5	4,9	18,3	4,2
Справочно: фактический прирост 2011/2012 гг. к соответствующему месяцу 2011 г.																		
Январь 2012	3,8		2,0		1,4	2,0	4,8	2,6	-0,2	-0,4	5,6	6,7	0,9	-0,5	5,7	-0,3	42,0	9,4
Февраль 2012	6,5		6,2		3,7	5,1	6,3	6,6	6,7	6,9	7,9	9,2	5,4	6,3	6,1	3,2	14,6	13,6
Март 2012	2,0		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
Апрель 2012	1,3		1,7		1,2	0,7	3,6	2,8	-0,6	-2,5	4,5	3,4	3,5	0,0	5,0	4,3	-4,8	-2,8
Май 2012	3,7		2,1		-0,3	-0,3	7,0	3,7	1,2	-0,7	6,4	4,9	1,0	-4,0	12,2	5,2	-7,7	8,6
Июнь 2012	1,9		1,3		0,2	-0,1	3,4	2,1	2,1	-0,2	8,1	6,6	2,0	-0,7	4,2	1,2	-19,7	-17,2

Примечание. На рассматриваемых интервалах времени ряды ценных индексов промышленного производства по промышленности в целом Росстата и НИУ ВШЭ, а также ценные индексы промышленного производства в производстве машин и оборудования НИУ ВШЭ идентифицированы как процессы, являющиеся стационарными около тренда с эндогенным структурным сдвигом; ряды ценных индексов промышленного производства в обрабатывающих производствах, металлургическом производстве и производстве готовых металлических изделий Росстата и НИУ ВШЭ, а также ценных 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 ценных 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)
Январь 2013	1700,4 (11,8)	104,3
Февраль 2013	1693,2 (11,7)	104,9
Март 2013	1837,5 (12,6)	104,9
Апрель 2013	1858,9 (13,0)	105,0
Май 2013	1930,5 (13,2)	105,1
Июнь 2013	1971,7 (13,1)	105,0
Справочно: фактические значения за аналогичные месяцы 2012 г.		
Январь 2012	1520,8	107,4
Февраль 2012	1516,5	107,9
Март 2012	1632,6	107,4
Апрель 2012	1645,5	106,8
Май 2012	1706,0	107,1
Июнь 2012	1744,1	107,1

Примечание. Ряды розничного товарооборота и реального розничного товарооборота на интервале с января 1999 г. по октябрь 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)
Январь 2013	465,6 (5,0)	98,3
Февраль 2013	600,7 (4,8)	96,9
Март 2013	705,9 (5,2)	98,4
Апрель 2013	741,3 (8,3)	100,0
Май 2013	959,0 (5,1)	99,3
Июнь 2013	1111,9 (5,4)	100,5
Справочно: фактические значения за аналогичные месяцы 2012 г.		
Январь 2012	443,3	116,4
Февраль 2012	573,3	116,2
Март 2012	670,9	117,0
Апрель 2012	684,4	108,1
Май 2012	912,3	113,4
Июнь 2012	1055,0	108,8

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

ИНВЕСТИЦИИ В ОСНОВНОЙ КАПИТАЛ

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

Результаты, представленные в табл. 3, показывают, что средний прогнозируемый прирост номинальных инвестиций в период с января по июнь 2013 г. по отношению к тому же периоду 2012 г. составляет около 5,6%.

Среднее прогнозируемое падение реальных инвестиций в 1-м полугодии 2013 г. по отношению к аналогичному периоду 2012 г. составляет 1,1%.

ВНЕШНЕТОРГОВЫЕ ПОКАЗАТЕЛИ

Модельные расчеты прогнозных значений объемов экспорта, экспорта в страны вне СНГ, импорта и импорта из стран вне СНГ получены на основе моделей временных рядов и структурных моделей, оцененных на месячных данных на интервале с сентября 1998 г. по октябрь 2012 г. по данным ЦБ РФ¹. Результаты расчетов представлены в табл. 4.

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

Средний прогнозируемый прирост экспорта, импорта, экспорта вне СНГ и импорта из стран вне СНГ за 1-е полугодие 2013 г. по отношению к аналогичному периоду 2012 г. составит 3,1%, 11,6%, 9,5% и 13,3% соответственно. Средний прогнозируемый объем сальдо торгового баланса со всеми странами за январь–июнь 2013 г. составит 99,7 млрд долл. США, что соответствует снижению на 8,8% по отношению к аналогичному периоду 2012 г.

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
Янв. 2013	41,1	38,8	103	98	21,9	24,2	114	126	36,3	38,4	106	112	20,5	21,1	128	131
Фев. 2013	45,2	46,7	100	103	26,4	26,7	106	108	38,9	43,8	103	116	26,3	24,8	124	117
Мар. 2013	44,5	47,5	95	101	31,3	29,9	110	105	37,9	43,4	96	109	26,5	24,0	109	99
Апр. 2013	46,2	48,4	102	107	32,0	29,5	119	110	38,4	44,8	100	117	27,1	25,2	119	111
Май 2013	45,1	46,1	98	101	32,5	28,6	115	102	37,8	44,3	97	113	26,9	24,8	111	102
Июн. 2013	46,8	47,5	114	116	31,8	29,8	118	111	39,5	44,9	116	132	26,1	25,3	113	109
Справочно: фактические значения за соответствующие месяцы 2012 г. (млрд долл.)																
Янв. 2012	39,7				19,2				34,2				16,1			
Фев. 2012	45,2				24,8				37,8				21,2			
Мар. 2012	46,9				28,6				39,7				24,3			
Апр. 2012	45,1				26,8				38,2				22,8			
Май 2012	45,8				28,1				39,1				24,3			
Июн. 2012	41,0				26,9				34,1				23,2			

Примечание. На интервале с января 1999 г. по октябрь 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 октябрь 2012 г.¹. В табл. 5 приведены результаты модельных расчетов прогнозных значений в I–II кварталах 2013 г. по ARIMA-моделям, структурным моделям (SM) и моделям, построенным с использованием конъюнктурных опросов (КО).

Прогнозируемый среднемесячный прирост индекса потребительских цен в январе–июне 2013 г. составит 0,6%. Прирост цен производителей промышленных товаров за указанный период прогнозируется в среднем также на уровне 0,6% в месяц.

Для индексов цен производителей ОКВЭД с января по июнь 2013 г. прогнозируются следующие средние темпы роста в месяц: 1,8% – в добыче полезных ископаемых, 0,7% – в обрабатывающих производствах, 1,7% – в производстве и распределении электроэнергии, газа и воды,

¹ Структурные модели оценивались на интервале с октября 1998 г.

Таблица 5

РЕЗУЛЬТАТЫ РАСЧЕТОВ ПРОГНОЗНЫХ ЗНАЧЕНИЙ ИНДЕКСОВ ЦЕН

Месяц	Индекс потребительских цен (ARIMA)	Индекс потребительских цен (SM)	Индексы цен производителей:																								
			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)																											
январь.13	101,6	100,6	101,2	101,0	106,4	100,3	102,9	100,6	100,5	100,3	101,1	101,1	100,7	100,5	101,1	101,1	100,7	100,5	101,1	101,1	100,7	100,5	101,1	101,1	101,7		
февраль.13	100,7	100,5	101,6	101,2	102,0	100,8	106,3	100,6	100,4	101,0	100,4	101,2	100,4	100,4	101,0	100,4	100,4	100,4	100,4	101,2	101,2	100,4	99,1	100,8	100,2	100,2	
март.13	100,4	100,3	100,2	101,1	100,2	100,5	101,7	100,8	100,4	100,7	100,4	101,6	101,5	100,4	100,7	100,4	101,6	101,5	100,4	101,6	101,6	101,5	99,7	100,3	100,6	100,6	
апрель.13	100,6	100,3	99,7	101,1	100,3	101,1	99,7	100,6	100,6	100,3	100,4	101,9	102,1	100,4	100,3	100,4	101,9	102,1	100,4	101,9	101,9	102,1	101,9	101,9	100,2	100,3	100,3
май.13	100,7	100,1	100,5	98,8	101,2	100,5	99,8	100,7	100,8	100,5	100,5	101,4	100,0	100,5	100,5	100,5	101,4	100,0	100,5	101,4	101,4	100,0	103,9	100,4	100,3	100,3	100,3
июнь.13	100,7	100,2	101,3	99,3	100,6	100,8	100,0	101,3	100,5	100,5	100,0	101,3	100,4	100,0	100,5	100,0	101,3	100,4	100,0	101,3	101,3	100,4	103,1	100,3	100,3	100,0	100,0
Прогнозные значения (в % к декабрю 2012 г.)																											
январь.13	101,6	100,6	101,2	101,0	106,4	100,3	102,9	100,6	100,5	100,3	101,1	101,1	100,7	100,5	101,1	101,1	100,7	100,5	101,1	101,1	100,7	100,5	101,1	101,1	101,7	101,7	101,7
февраль.13	102,4	101,1	102,8	102,2	108,6	101,1	109,4	101,2	100,9	101,4	101,6	102,3	101,1	100,9	101,4	101,6	101,1	99,6	101,1	102,3	102,3	101,1	99,6	101,9	101,9	101,9	101,9
март.13	102,8	101,4	103,0	103,3	108,8	101,6	111,3	102,0	101,3	102,1	102,0	103,9	102,6	101,3	102,1	102,0	102,6	99,3	102,2	103,9	103,9	102,6	99,3	102,2	102,5	102,5	102,5
апрель.13	103,5	101,7	102,7	104,4	109,1	102,7	110,9	102,6	102,0	102,4	102,4	105,9	104,8	102,0	102,4	102,4	104,8	101,2	102,4	105,9	105,9	104,8	101,2	102,4	102,8	102,8	102,8
май.13	104,2	101,8	103,2	103,1	110,4	103,2	110,7	103,4	102,8	103,0	103,0	107,4	104,8	102,8	103,0	103,0	104,8	105,1	102,8	107,4	107,4	104,8	105,1	102,8	103,1	103,1	103,1
июнь.13	104,9	102,0	104,5	102,4	111,1	104,1	110,7	104,7	103,4	103,4	103,0	108,7	105,2	103,4	103,0	108,7	105,2	108,3	103,1	108,7	108,7	105,2	108,3	103,1	103,1	103,1	103,1
Справочно: фактические значения за аналогичные периоды 2012 г. (в % к декабрю 2011 г.)																											
январь.12	100,5	99,7	101,8	99,0	101,8	99,0	99,7	99,4	98,7	99,5	100,4	95,7	100,8	99,2	100,4	95,7	100,8	99,2	100,3	95,7	100,8	99,2	100,3	100,3	99,5	99,5	99,5
февраль.12	100,9	100,8	106,4	100,8	106,4	99,0	99,4	99,2	98,3	99,9	100,5	94,1	101,7	99,9	100,5	94,1	101,7	99,9	100,7	94,1	101,7	99,9	100,7	100,7	100,8	100,8	100,8
март.12	101,5	102,9	114,7	102,9	114,7	99,3	99,9	99,7	98,8	100,3	100,3	98,7	101,7	99,4	100,3	98,7	101,7	99,4	101,7	98,7	101,7	99,4	101,7	101,7	101,5	101,5	101,5
апрель.12	101,8	103,5	115,3	103,5	115,3	100,2	99,7	100,3	98,9	100,2	100,1	98,1	102,9	98,5	100,1	98,1	102,9	98,5	103,0	98,1	102,9	98,5	103,0	103,0	102,0	102,0	102,0
май.12	102,3	101,0	105,1	101,0	105,1	100,3	98,7	100,7	98,3	100,8	101,3	97,7	103,1	98,1	101,3	97,7	103,1	98,1	103,8	97,7	103,1	98,1	103,1	103,8	101,8	101,8	101,8
июнь.12	103,2	100,1	101,3	100,1	101,3	100,6	97,7	101,3	98,8	101,4	100,7	96,5	103,5	99,5	100,7	96,5	103,5	99,5	103,6	96,5	103,5	99,5	103,6	103,6	102,4	102,4	102,4

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

0,8% – в производстве пищевых продуктов, 0,6% – в текстильном и швейном производстве, 0,6% – в обработке древесины и производстве изделий из дерева, 0,5% – в целлюлозно-бумажном производстве, 1,4% – в производстве кокса и нефтепродуктов, 0,9% – в химическом производстве, 1,4% – в металлургическом производстве и производстве готовых металлических изделий, 0,5% – в производстве машин и оборудования и 0,5% – в производстве транспортных средств и оборудования.

Динамика стоимости минимального набора продуктов питания

В данном разделе представлены результаты расчетов прогнозируемых значений стоимости минимального набора продуктов питания в январе–июне 2013 г. Прогнозы строились на основе временных рядов по данным Росстата за период с января 2000 г. по октябрь 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: средняя прогнозируемая стоимость минимального набора продуктов питания составляет около 2649,7 руб. Прогнозируемый прирост стоимости минимального набора продуктов питания составляет в среднем около 6,3% по сравнению с уровнем аналогичного периода прошлого года.

Индексы транспортных тарифов на грузовые перевозки

В данном разделе представлены расчеты прогнозных значений индексов цен транспортных тарифов на грузовые перевозки¹, полученные на основе моделей временных рядов, оцененных по данным Росстата на интервале с сентября 1998 г. по октябрь 2012 г. В табл. 7 приведены результаты модельных расчетов прогнозных значений в 1-м полугодии 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.

Таблица 6

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

Прогнозируемые значения по ARIMA-модели (руб.)	
Январь 2013	2611,2
Февраль 2013	2621,9
Март 2013	2639,9
Апрель 2013	2648,9
Май 2013	2665,3
Июнь 2013	2710,9
Справочно: фактические значения за аналогичные месяцы 2012 г. (млрд руб.)	
Январь 2012	2437,4
Февраль 2012	2456,0
Март 2012	2472,8
Апрель 2012	2482,9
Май 2012	2508,5
Июнь 2012	2602,8
Прогнозируемый прирост к соответствующему месяцу предыдущего года (%)	
Январь 2013	7,1
Февраль 2013	6,8
Март 2013	6,8
Апрель 2013	6,7
Май 2013	6,3
Июнь 2013	4,2

Примечание. Ряд стоимости минимального набора продуктов на интервале с января 2000 г. по октябрь 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*).

По результатам прогноза на 1-е полугодие 2013 г. среднемесячный рост сводного индекса транспортных тарифов на грузовые перевозки будет на уровне 1,6%. В январе 2013 г. планируется сезонный рост индекса на 6,1 п.п.

По прогнозам на январь–июнь 2013 г. индекс тарифов на грузовые перевозки автомобильным транспортом будет расти со среднемесячным темпом 0,3%. В январе 2013 г. прогнозируется сезонный рост показателя на 1,9 п.п. Индекс тарифов на трубопроводный транспорт будет расти в течение следующих шести месяцев со среднемесячным темпом 1,8%.

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)			
Январь 2013	106,1	101,8	100,3
Февраль 2013	100,7	100,1	100,2
Март 2013	100,7	100,1	104,2
Апрель 2013	100,7	100,0	103,6
Май 2013	100,7	100,0	100,1
Июнь 2013	100,7	100,0	101,1
Прогнозные значения по ARIMA-моделям (в % к декабрю предыдущего года)			
Январь 2013	106,1	101,8	100,3
Февраль 2013	106,8	101,9	100,6
Март 2013	107,5	102,0	104,8
Апрель 2013	108,2	102,0	108,6
Май 2013	109,0	102,0	108,7
Июнь 2013	109,7	102,0	109,8
Справочно: фактические значения за аналогичный период 2012 г. (в % к предыдущему месяцу)			
Январь 2012	99,1	102,2	93
Февраль 2012	100	101,2	99,9
Март 2012	100	100,6	100
Апрель 2012	105,2	100,4	111,6
Май 2012	100,2	100,4	100,1
Июнь 2012	100,2	100,5	100,1

Примечание. На интервале с сентября 1998 г. по октябрь 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 сентября 1998 г. по октябрь 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 I–II кварталах 2013 г., полученные на основе нелинейных моделей временных рядов, оцененных по данным МВФ на интервале с января 1980 г. по ноябрь 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					
Январь 2013	115,29	1934	1753	7451	16278
Февраль 2013	117,41	1889	1767	7467	16191
Март 2013	118,79	1896	1781	7455	16254
Апрель 2013	119,23	1894	1797	7410	16233
Май 2013	120,10	1874	1814	7358	16140
Июнь 2013	121,64	1876	1828	7314	16054

Таблица 8, окончание

Месяц	Нефть марки Brent (долл./ барр.)	Алюминий (долл./ т)	Золото (долл./ унц.)	Медь (долл./ т)	Никель (долл./ т)
Приросты к соответствующему месяцу предыдущего года (%)					
Январь 2013	3,9	-10,1	6,1	-7,6	-18,2
Февраль 2013	-1,9	-14,5	1,4	-11,5	-20,6
Март 2013	-4,9	-13,2	6,3	-12,0	-12,9
Апрель 2013	-1,1	-7,6	9,0	-10,6	-9,3
Май 2013	8,7	-6,4	14,4	-6,8	-4,9
Июнь 2013	27,3	-0,5	14,6	-1,5	-3,3
Справочно: фактические значения за аналогичный период 2012 г.					
Январь 2012	110,99	2151	1652	8062	19909
Февраль 2012	119,70	2208	1743	8441	20394
Март 2012	124,93	2184	1675	8471	18661
Апрель 2012	120,59	2049	1649	8286	17893
Май 2012	110,52	2003	1585	7897	16968
Июнь 2012	95,59	1886	1596	7428	16604

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

Средний прогнозируемый уровень цен на нефть составляет около 118,7 долл./барр., что выше соответствующих показателей прошлого года в среднем на 5,3%. Цены на алюминий прогнозируются на уровне около 1894 долл./т, а их среднее прогнозируемое понижение составляет приблизительно 9% по сравнению с аналогичным уровнем прошлого года. Прогноз цен на золото составляет около 1790 долл./унц. Средние прогнозируемые цены на медь составляют около 7409 долл./т, а на цены никель – около 16192 долл./т. Среднее прогнозируемое повышение цен на золото составляет около 9%, среднее падение цен на медь – около 8%, среднее снижение цен на никель – 12% по сравнению с соответствующим уровнем прошлого года.

ДЕНЕЖНЫЕ ПОКАЗАТЕЛИ

Будущие значения денежной базы (в узком определении – наличные деньги и ФОР) и денежного агрегата M_2 в январе–июне 2013 г. получены на основе моделей временных рядов соответствующих показателей, рассчитываемых ЦБ РФ¹, на интервале с октября 1998 г. по октябрь 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, %
Январь 2013	7704	-23,9	25648	1,2
Февраль 2013	7678	-0,3	25948	1,2
Март 2013	7933	3,3	26251	1,2
Апрель 2013	7912	-0,3	26557	1,2
Май 2013	8169	3,2	26866	1,2
Июнь 2013	8154	-0,2	27177	1,2

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, %
Справочно: фактические значения за соответствующие месяцы 2012 г. (прирост к предыдущему месяцу, %)				
Январь 2012		-5,9		-3,5
Февраль 2012		1,3		0,7
Март 2012		-1,4		0,8
Апрель 2012		2,8		0,8
Май 2012		0,5		0,8
Июнь 2012		2,1		1,3

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

В I–II кварталах 2013 г. денежная база будет снижаться со среднемесячным темпом 3,0% в месяц. Денежный показатель M₂ будет расти со среднемесячным темпом 1,2% на рассматриваемом интервале времени.

МЕЖДУНАРОДНЫЕ РЕЗЕРВЫ

Таблица 10

ПРОГНОЗ МЕЖДУНАРОДНЫХ (ЗОЛОТОВАЛЮТНЫХ) РЕЗЕРВОВ

Период	Прогнозные значения по ARIMA-моделям	
	млрд долл. США	прирост к предыдущему месяцу, %
Январь 2013	530,3	0,7
Февраль 2013	541,6	2,1
Март 2013	551,1	1,7
Апрель 2013	555,3	0,8
Май 2013	559,5	0,7
Июнь 2013	566,8	1,3
Справочно: фактические значения за аналогичный период 2012 г.		
Январь 2012	505,4	1,4
Февраль 2012	513,9	1,7
Март 2012	513,5	-0,1
Апрель 2012	524,4	2,1
Май 2012	510,4	-2,7
Июнь 2012	514,3	0,8

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

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 октябрь 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 январе–июне 2013 г. международные резервы будут расти со среднемесячным темпом 1,2%.

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

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

на последний день месяца, за период с октября 1998 г. по декабрь 2012 г. и за период с января 1999 г. по декабрь 2012 г.¹ соответственно.

Значение курса доллара США к рублю на рассматриваемом интервале времени прогнозируется в среднем по двум моделям равным 30 руб. 20 коп. за доллар США. Аналогичное значение для курса евро к доллару США составит 1,33 долл. США за один 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
Январь 2013	30,04	30,15	1,32	1,32
Февраль 2013	30,02	30,17	1,33	1,32
Март 2013	30,04	30,22	1,33	1,32
Апрель 2013	30,10	30,26	1,33	1,33
Май 2013	30,14	30,31	1,34	1,33
Июнь 2013	30,15	30,35	1,34	1,33
Справочно: фактические значения за аналогичный период 2012 г.				
Январь 2012	30,36		1,32	
Февраль 2012	28,95		1,34	
Март 2012	29,33		1,33	
Апрель 2012	29,36		1,32	
Май 2012	32,45		1,24	
Июнь 2012	32,82		1,26	

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 ноябрь 2012 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. 12, показывают рост показателей уровня жизни населения по сравнению с соответствующим периодом прошлого года. Так, ожидаемое среднее увеличение реальных располагаемых денежных доходов составит около 8,2% в годовом исчис-

1 В Бюллетене использованы данные МВФ за период с января 1999 г. по октябрь 2012 г. Данные за ноябрь и декабрь 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).

лении, рост реальных денежных доходов – 7,5% по сравнению с соответствующим прошлогодним уровнем. Прогнозируемый прирост реальной заработной платы составит 3,5% в годовом исчислении по сравнению с аналогичным периодом предшествующего года.

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.)		
Январь 2013	106,4	106,0	105,5
Февраль 2013	107,7	106,7	104,0
Март 2013	109,3	108,8	105,8
Апрель 2013	109,7	108,8	102,1
Май 2013	109,5	108,2	101,2
Июнь 2013	107,1	106,5	102,5
Справочно: фактические значения за соответствующий период 2012 г. (в % к аналогичному периоду 2011 г.)			
Январь 2012	100,6	102,2	110,5
Февраль 2012	101,9	103,1	112,1
Март 2012	102,1	102,6	109,0
Апрель 2012	101,1	102,1	111,1
Май 2012	104,9	106,5	112,4
Июнь 2012	106,4	106,3	110,2

Примечание. Для расчетов использовались ряды располагаемых денежных доходов, реальных денежных доходов и реальной заработной платы в базисной форме (за базисный период был принят январь 1999 г.). На рассматриваемом интервале с января 1999 г. по ноябрь 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 октябрь 2012 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 другого показателя.

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

2 Модель оценена на интервале с января 1999 г. по октябрь 2012 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.

Согласно прогнозам по моделям ARIMA (см. табл. 13), в 1-м полугодии 2013 г. рост численности занятых в экономике в среднем составит 0,9% в месяц по отношению к соответствующему периоду предыдущего года.

Среднее сокращение показателя общей численности безработных прогнозируется на уровне 4,2% в месяц по сравнению с аналогичным периодом прошлого года.

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 населения	млн чел.	прирост к соответствующему месяцу 2011/2012 гг. (%)	в (%) к показателю численности занятого в экономике населения
Январь 2013	70,6	0,8	4,5	-8,3	6,4	4,2	-14,5	5,9
Февраль 2013	70,7	1,1	4,6	-4,1	6,5	4,2	-13,1	5,9
Март 2013	70,8	1,5	4,5	-9,1	6,3	4,2	-13,9	5,9
Апрель 2013	71,4	0,8	4,2	-4,7	5,9	4,1	-6,4	5,7
Май 2013	72,4	0,5	4,0	-3,5	5,5	4,1	1,5	5,7
Июнь 2013	72,6	0,6	3,9	-5,6	5,3	4,1	0,0	5,6
Справочно: фактические значения за аналогичные периоды 2012 г. (млн чел.)								
Январь 2012	70,0					4,9		
Февраль 2012	69,9					4,8		
Март 2012	69,8					4,9		
Апрель 2012	70,9					4,4		
Май 2012	72,1					4,1		
Июнь 2012	72,2					4,1		

Примечание. На интервале с октября 1998 г. по октябрь 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. ●

ПРИЛОЖЕНИЕ

Графики временных рядов экономических показателей РФ: фактические и прогнозные значения

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

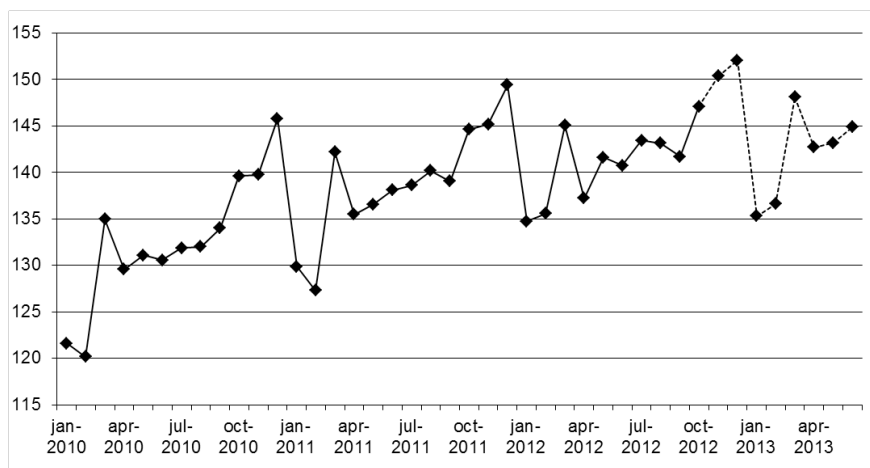


Рис. 1б. Индекс промышленного производства НИУ ВШЭ (ARIMA-модель) (% к январю 1995 г.)

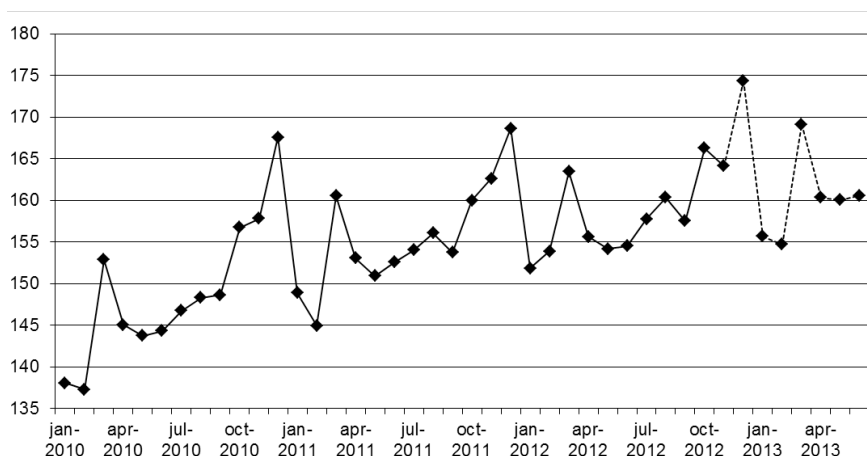


Рис. 2а. ИПП в добыче полезных ископаемых ФСГС (% к декабрю 2001 г.)

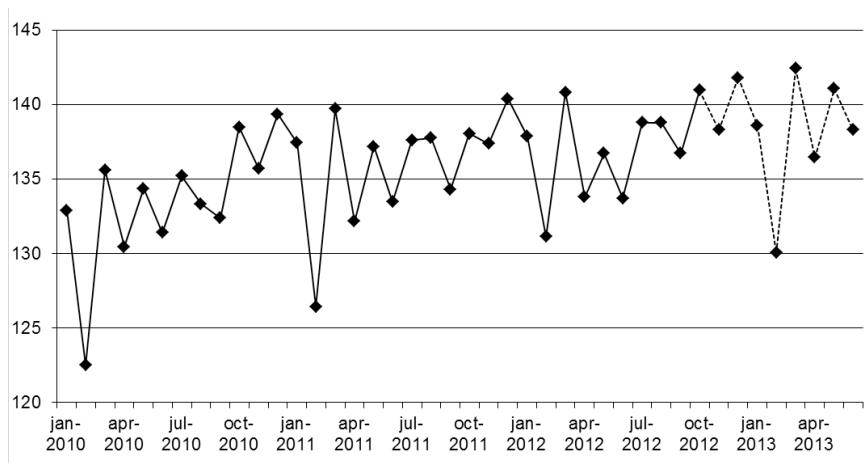


Рис. 2б. ИПП в добыче полезных ископаемых НИУ ВШЭ (% к январю 1995 г.)

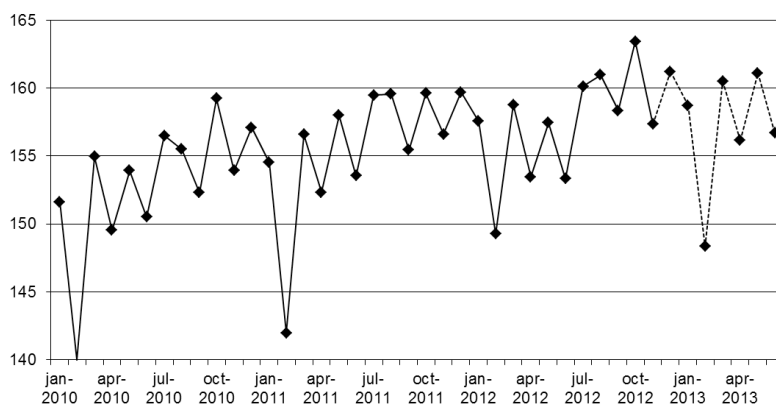


Рис. 3а. ИПП в обрабатывающих производствах ФСГС (% к декабрю 2001 г.)

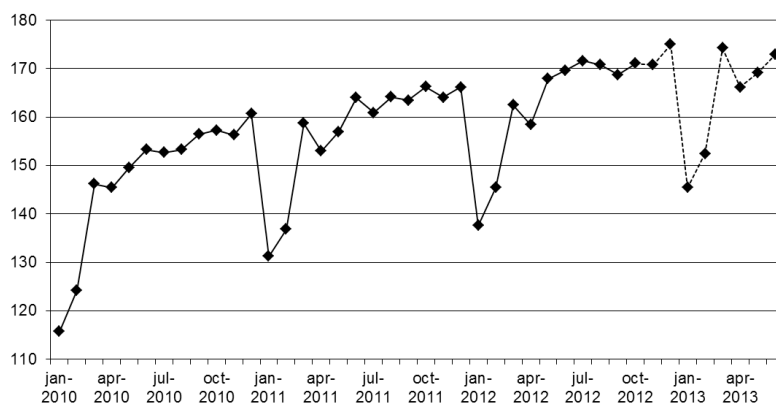


Рис. 3б. ИПП в обрабатывающих производствах НИУ ВШЭ (% к январю 1995 г.)

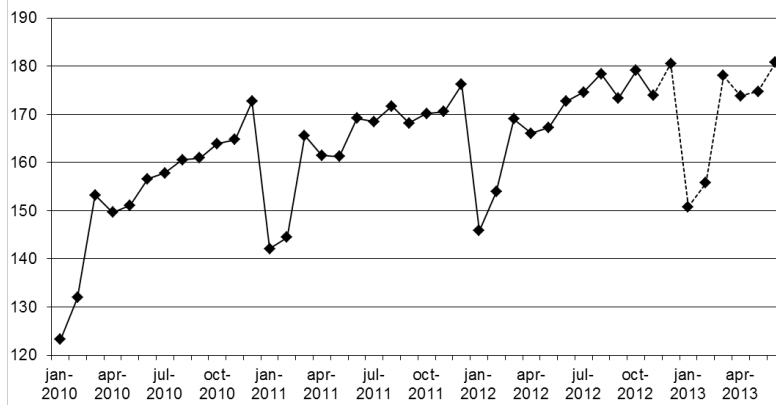


Рис. 4а. ИПП в производстве и распределении электроэнергии, газа и воды ФСГС (% к декабрю 1998 г.)

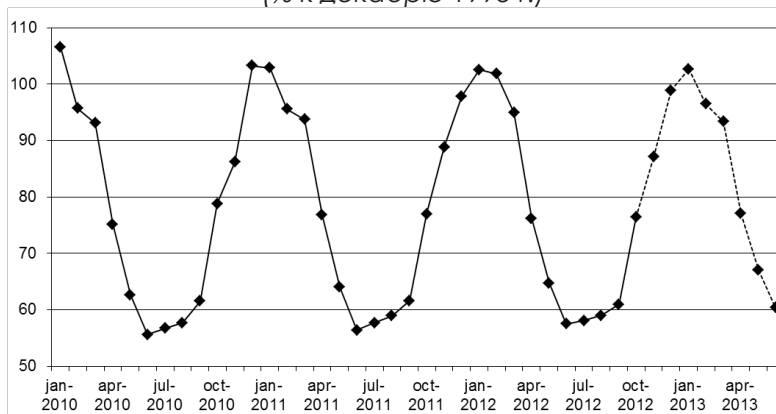


Рис. 4б. ИПП в производстве и распределении электроэнергии, газа и воды НИУ ВШЭ (% к январю 1995 г.)

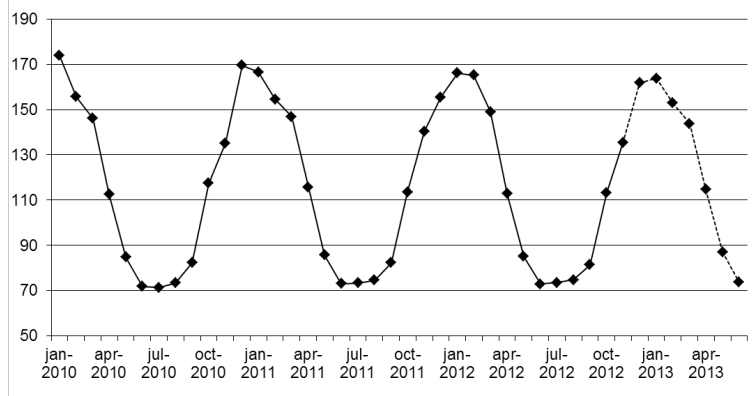


Рис. 5а. ИПП в производстве пищевых продуктов ФСГС (% к декабрю 2001 г.)

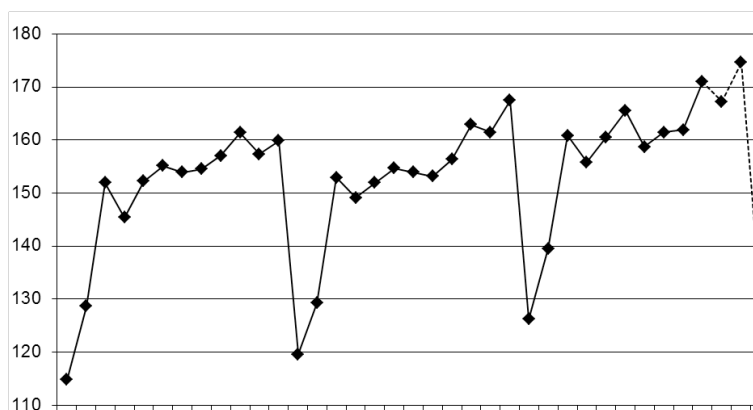


Рис. 5б. ИПП в производстве пищевых продуктов НИУ ВШЭ (% к январю 1995 г.)

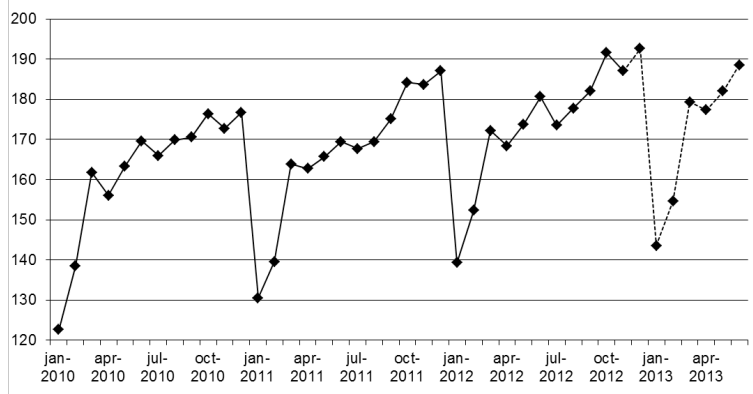


Рис. 6а. ИПП в производстве кокса и нефтепродуктов ФСГС (% к декабрю 2001 г.)

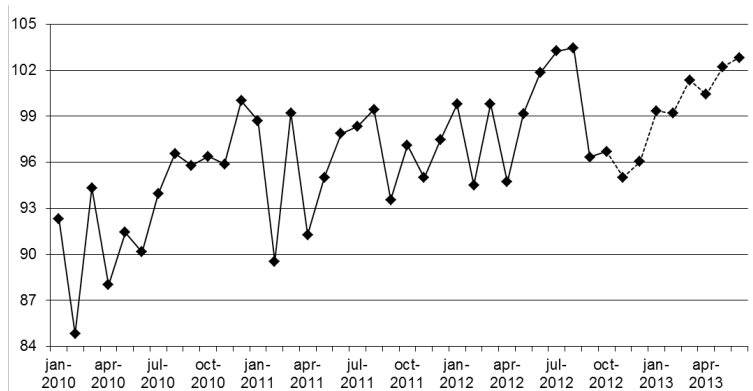


Рис. 6б. ИПП в производстве кокса и нефтепродуктов НИУ ВШЭ (% к январю 1995 г.)

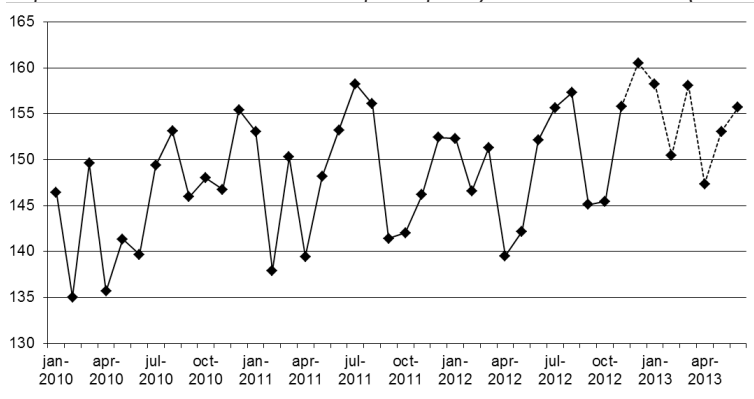


Рис. 7а. ИПП в металлургическом производстве и производстве готовых металлических изделий ФСГС (% к декабрю 1998 г.)

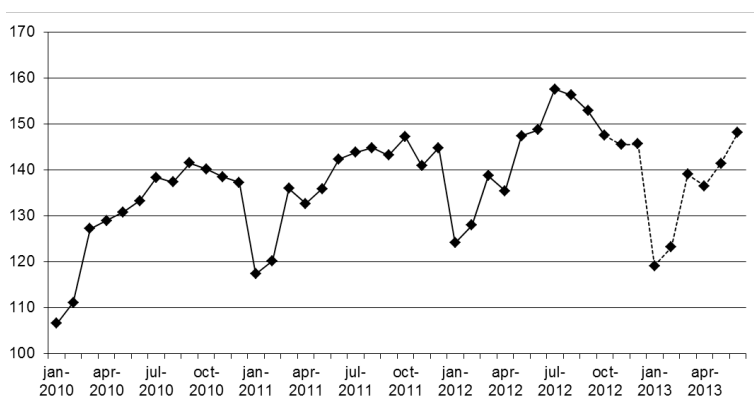


Рис. 7б. ИПП в металлургическом производстве и производстве готовых металлических изделий НИУ ВШЭ (% к январю 1995 г.)

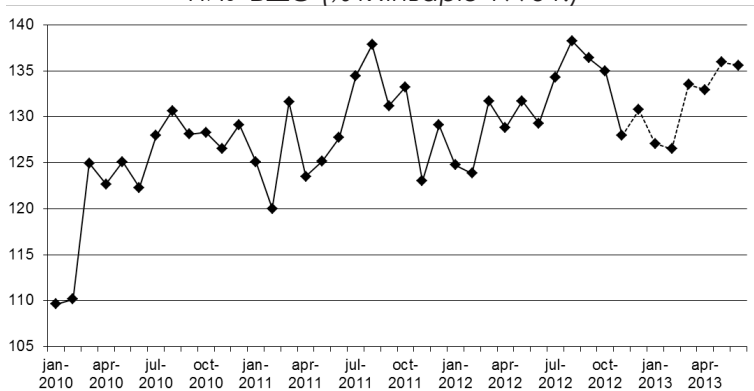


Рис. 8а. ИПП в производстве машин и оборудования ФСГС (% к декабрю 1998 г.)

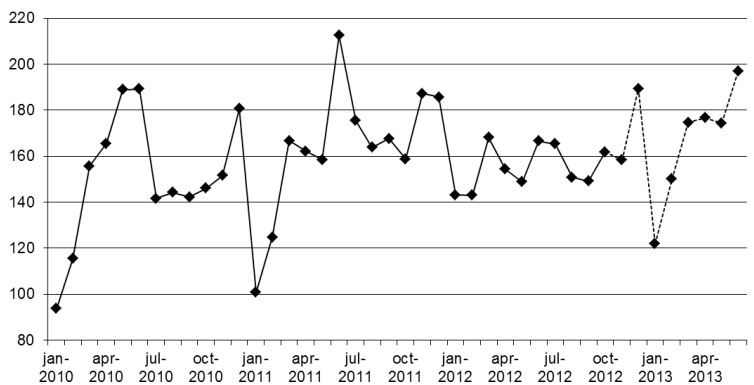


Рис. 8б. ИПП в производстве машин и оборудования НИУ ВШЭ (% к январю 1995 г.)

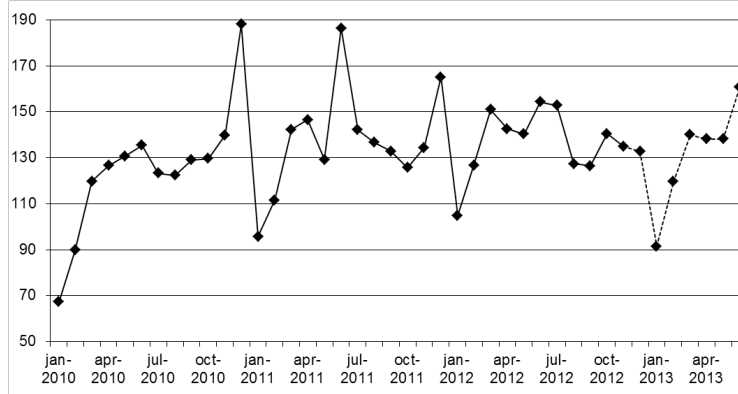


Рис. 9. Оборот розничной торговли (млрд руб.)

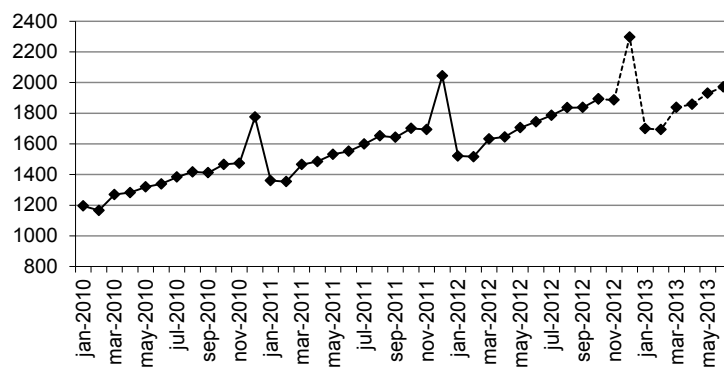


Рис. 9а. Реальный оборот розничной торговли (% к соответствующему периоду прошлого года)

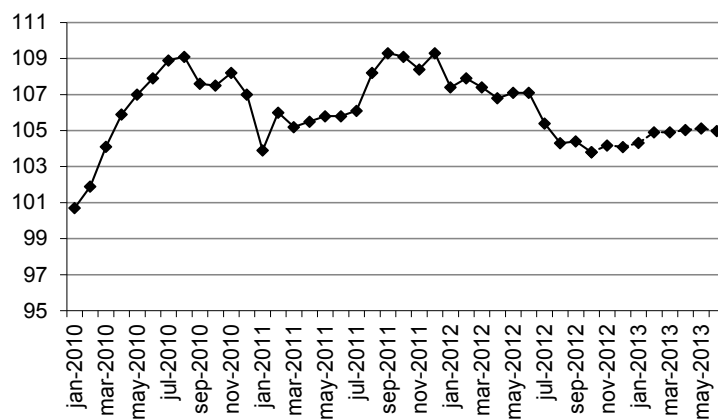


Рис. 10. Инвестиции в основной капитал (млрд руб.)

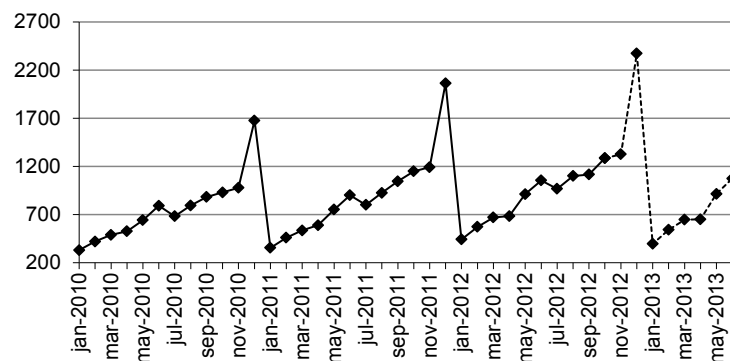


Рис. 10а. Реальные инвестиции в основной капитал (% к соответствующему периоду прошлого года)

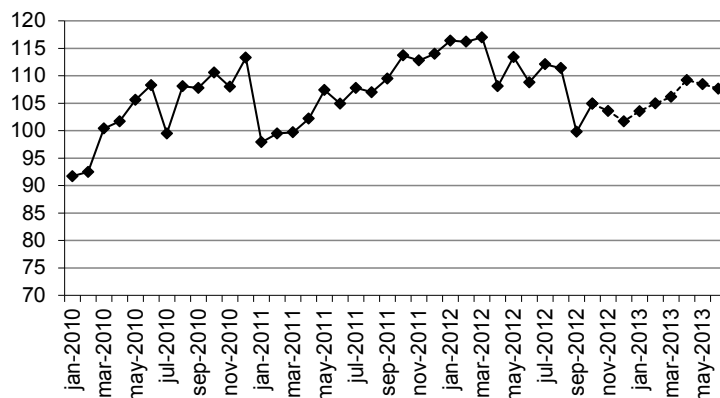


Рис. 11. Экспорт во все страны (млрд долл.)

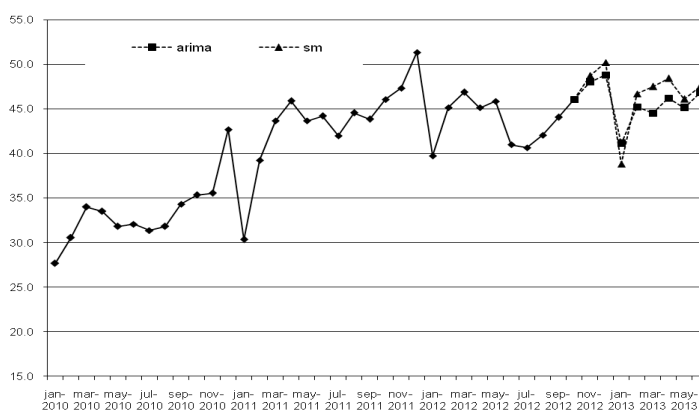


Рис. 12. Экспорт в страны вне СНГ (млрд долл.)

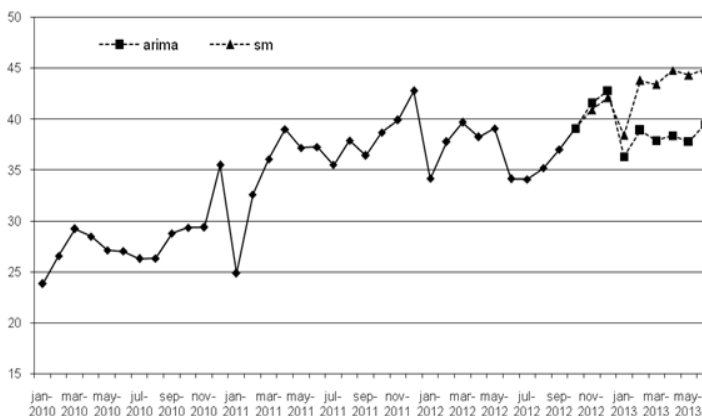


Рис. 13. Импорт из всех стран (млрд долл.)

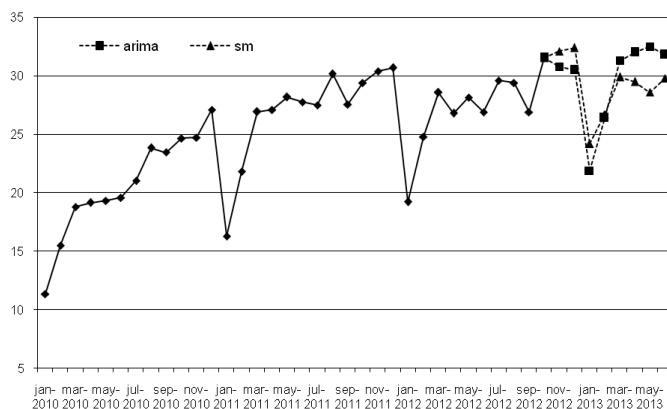


Рис. 14. Импорт из стран вне СНГ (млрд долл.)

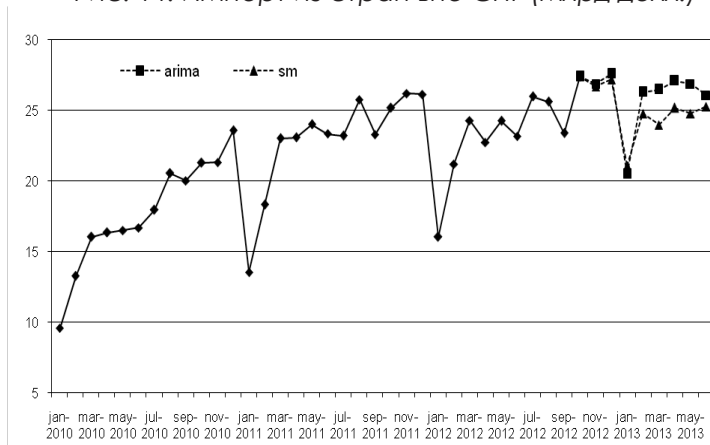


Рис. 15. Индекс потребительских цен в % к декабрю предшествующего года

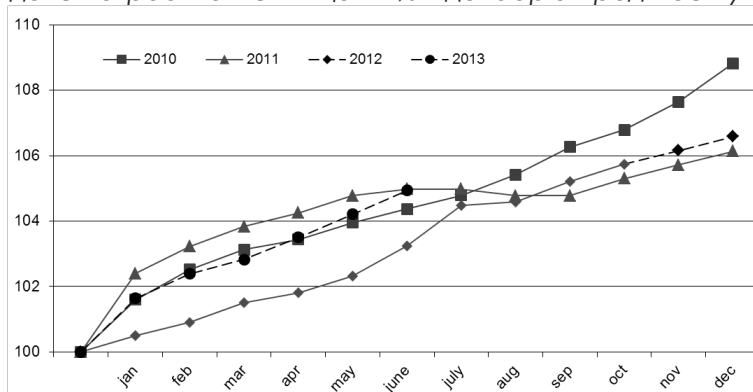


Рис. 15а. Индекс потребительских цен в % к декабрю предшествующего года (SM)

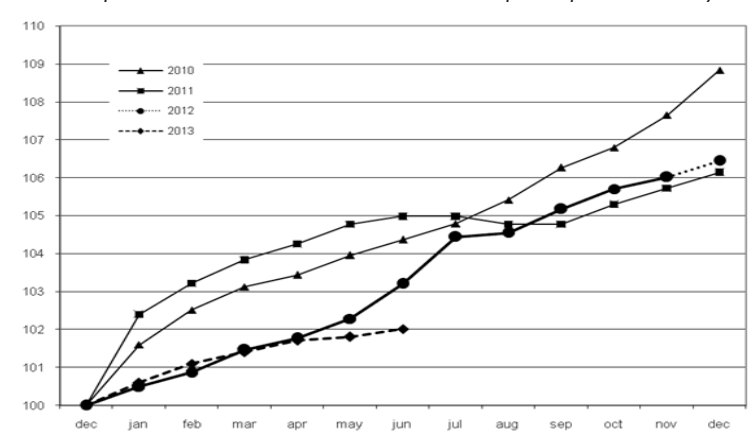


Рис. 16. Индекс цен производителей промышленных товаров в % к декабрю предыдущего года

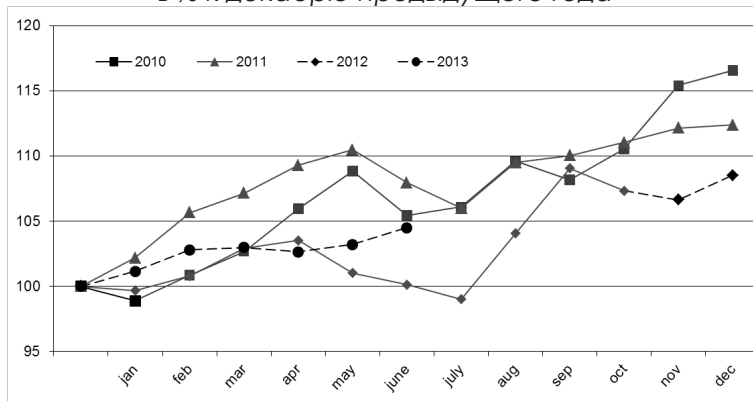


Рис. 17. Индекс цен в добыче полезных ископаемых в % к декабрю предыдущего года

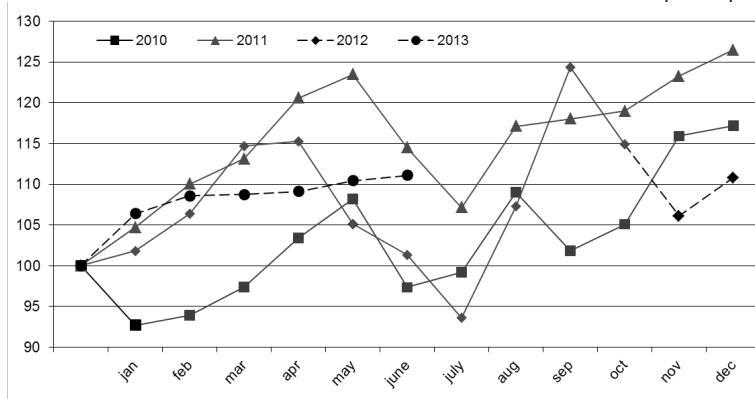


Рис. 18. Индекс цен в обрабатывающих производствах в % к декабрю предыдущего года

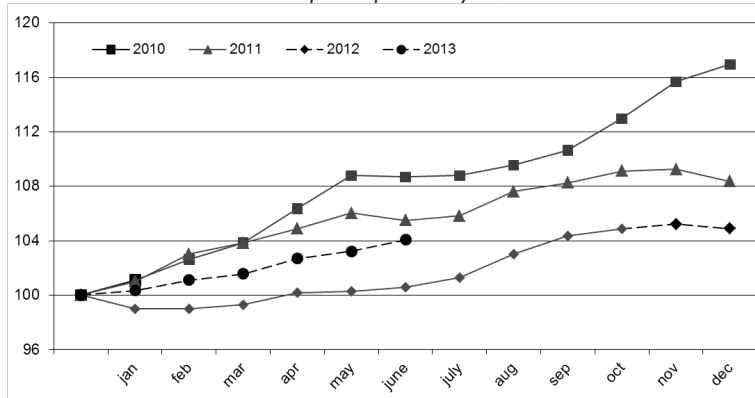


Рис. 19. Индекс цен в производстве и распределении электроэнергии, газа и воды в % к декабрю предыдущего года

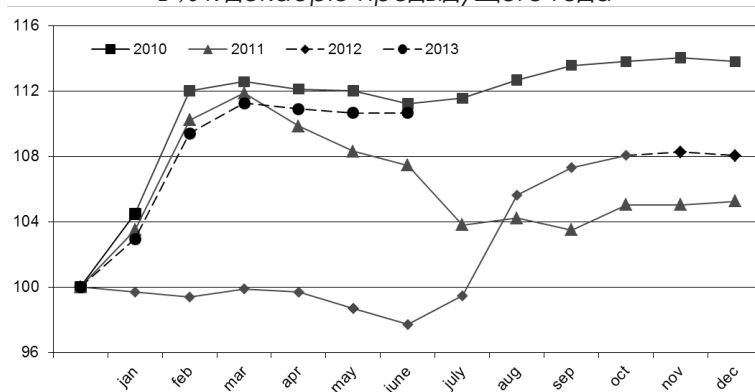


Рис. 20. Индекс цен в производстве пищевых продуктов в % к декабрю предыдущего года

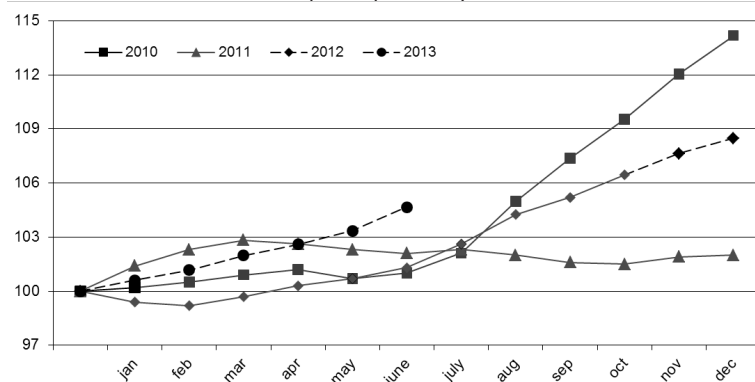


Рис. 21. Индекс цен в текстильном и швейном производстве в % к декабрю предыдущего года

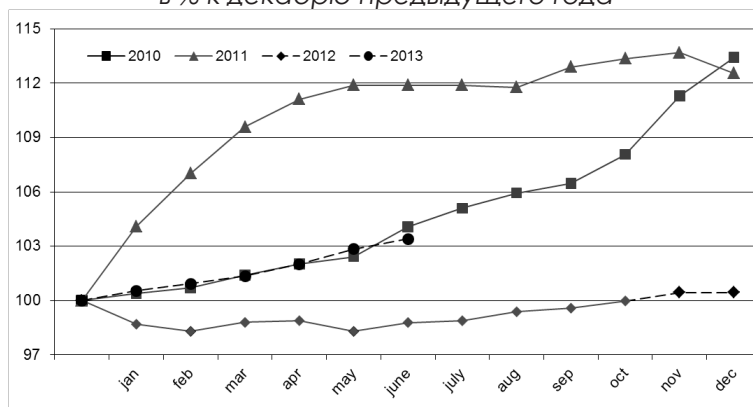


Рис. 22. Индекс цен в обработке древесины и производстве изделий из дерева в % к декабрю предыдущего года

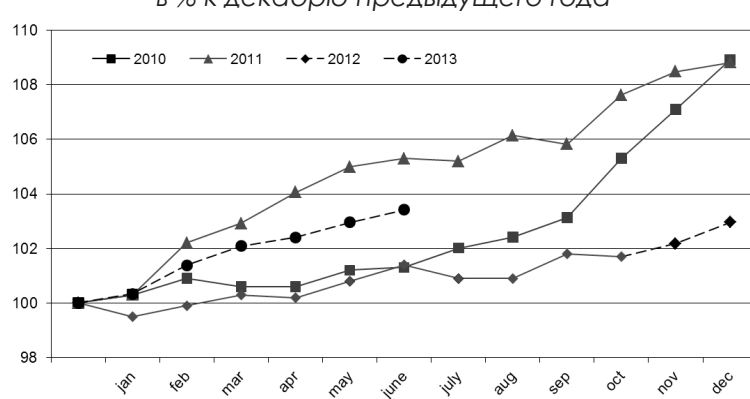


Рис. 23. Индекс цен в целлюлозно-бумажном производстве в % к декабрю предыдущего года

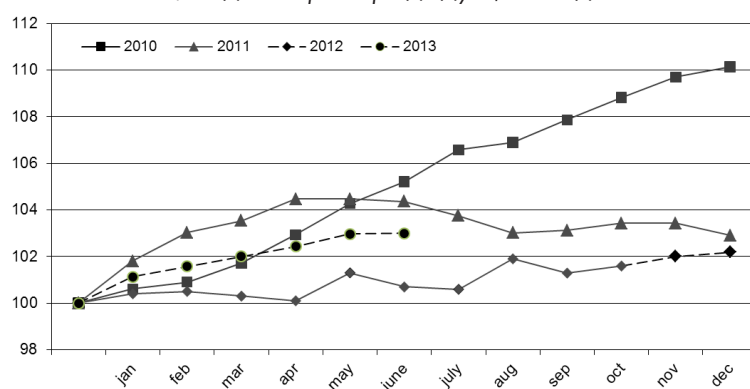


Рис. 24. Индекс цен в производстве кокса и нефтепродуктов в % к декабрю предыдущего года

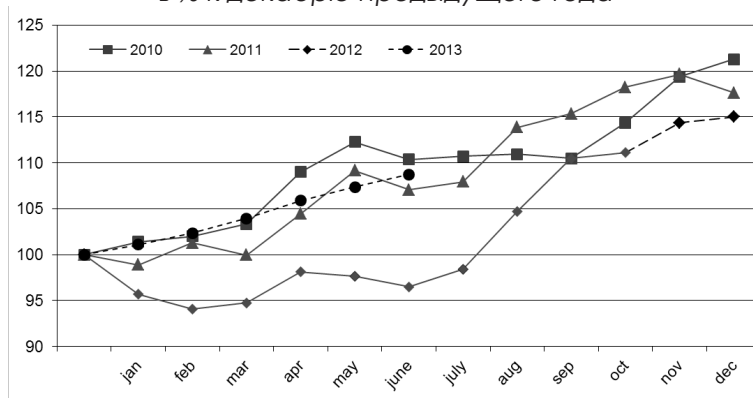


Рис. 25. Индекс цен в химическом производстве в % к декабрю предыдущего года

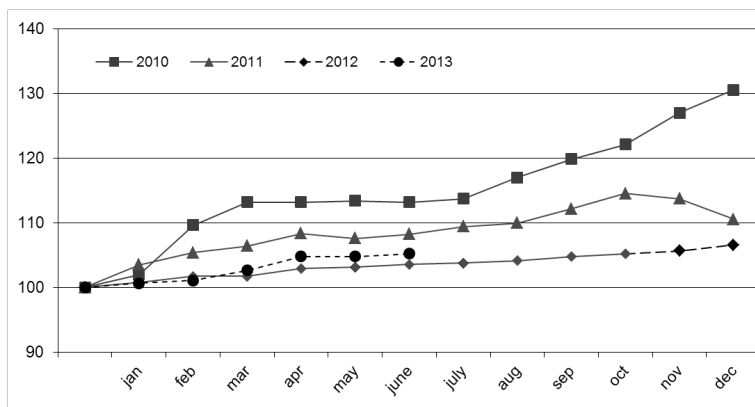


Рис. 26. Индекс цен в металлургическом производстве и производстве готовых металлических изделий в % к декабрю предыдущего года

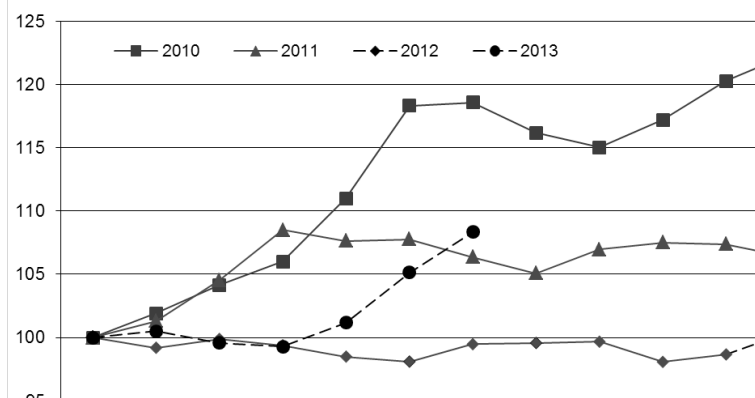


Рис. 27. Индекс цен в производстве машин и оборудования в % к декабрю предыдущего года

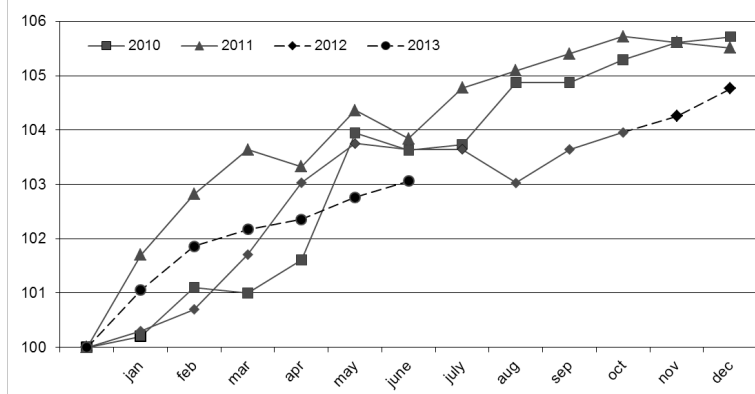


Рис. 28. Индекс цен в производстве транспортных средств и оборудования в % к декабрю предыдущего года

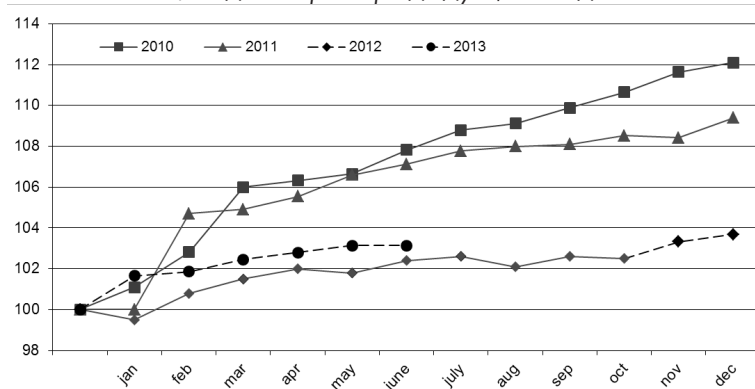


Рис. 29. Стоимость минимального набора продуктов питания на одного человека в месяц (руб.)

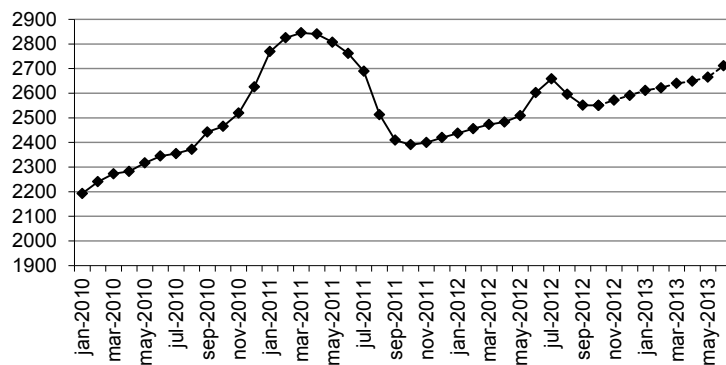


Рис. 30. Сводный индекс транспортных тарифов (для каждого года в % к предшествующему месяцу)

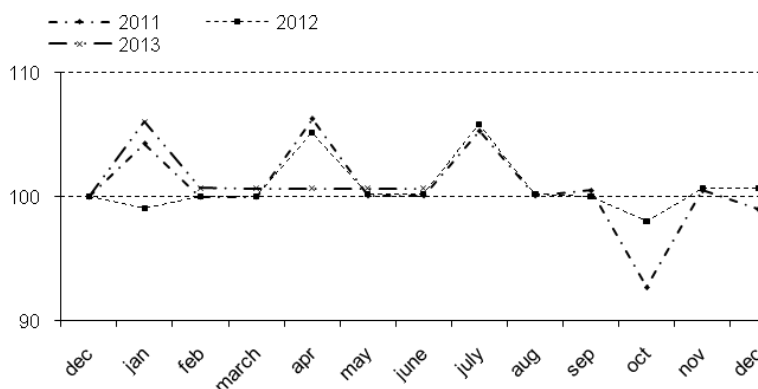


Рис. 31. Индекс тарифов на грузовые перевозки автомобильным транспортом (для каждого года в % к предшествующему месяцу)

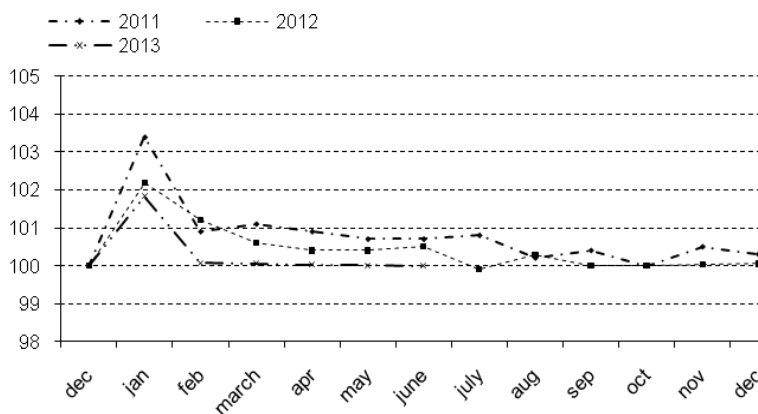


Рис. 32. Индекс тарифов на трубопроводный транспорт (для каждого года в % к предшествующему месяцу)

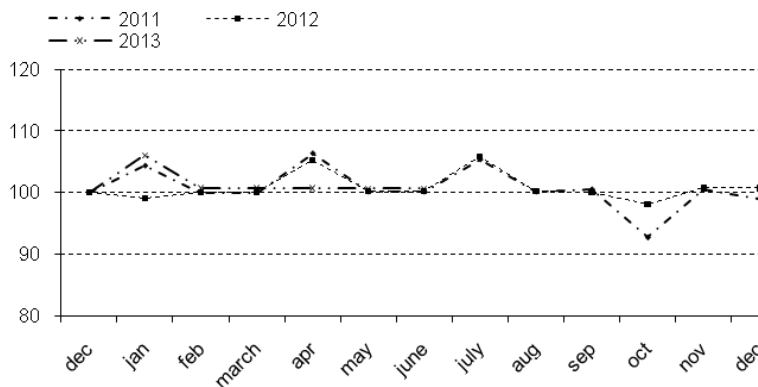


Рис. 33. Цена на нефть марки Brent (долл./барр.)

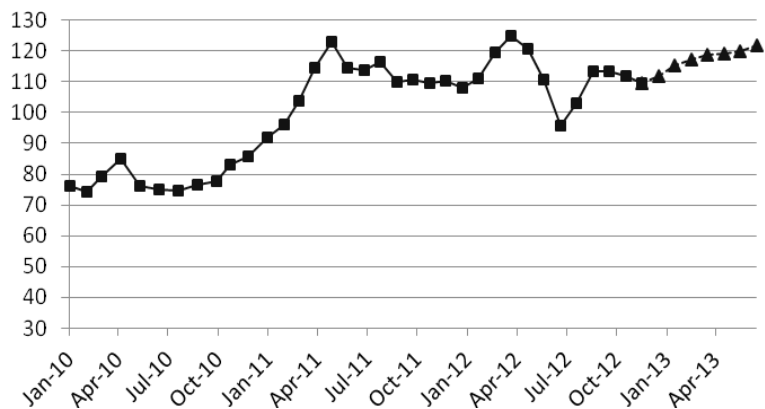


Рис. 34. Цены на алюминий (долл./т)

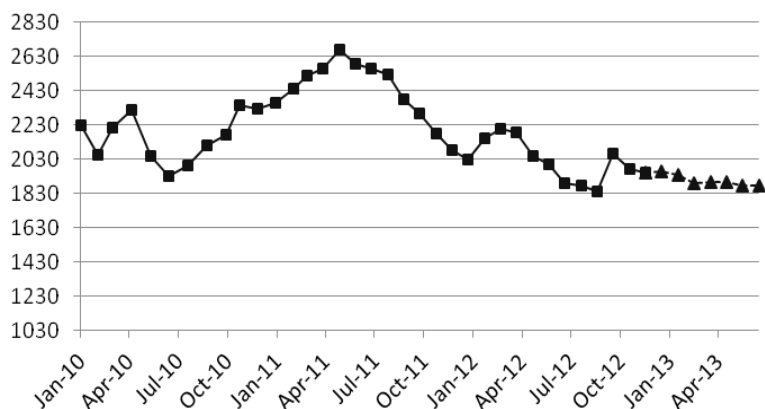


Рис. 35. Цены на золото (долл./унц.)

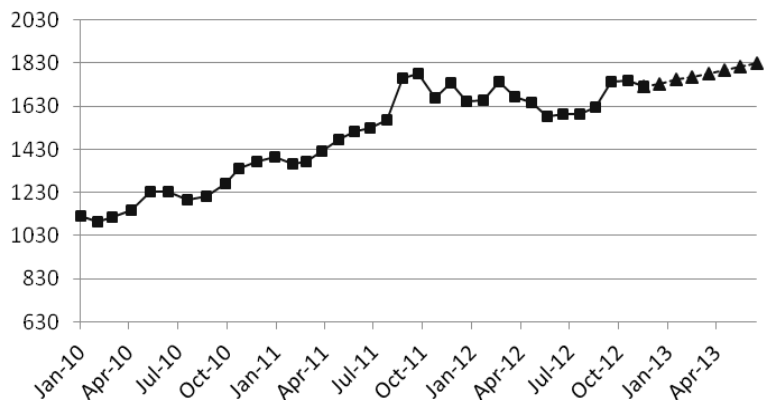


Рис. 36. Цены на никель (долл./т)

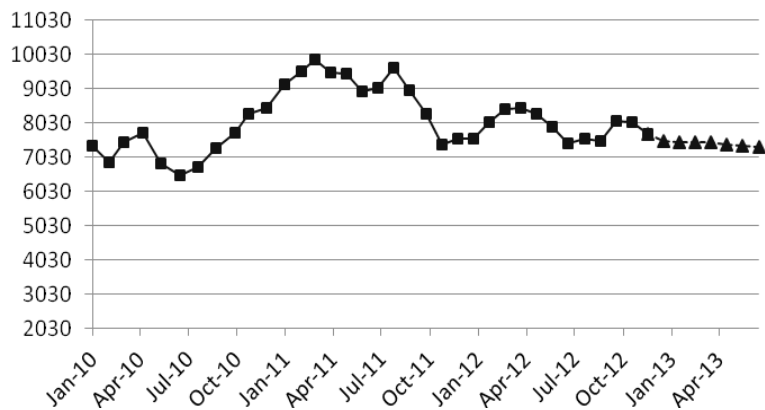


Рис. 37. Цены на медь (долл./т)

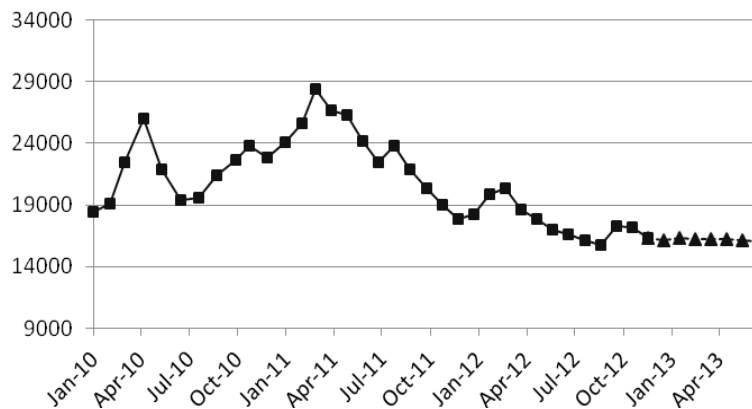


Рис. 38. Денежная база, млн руб.

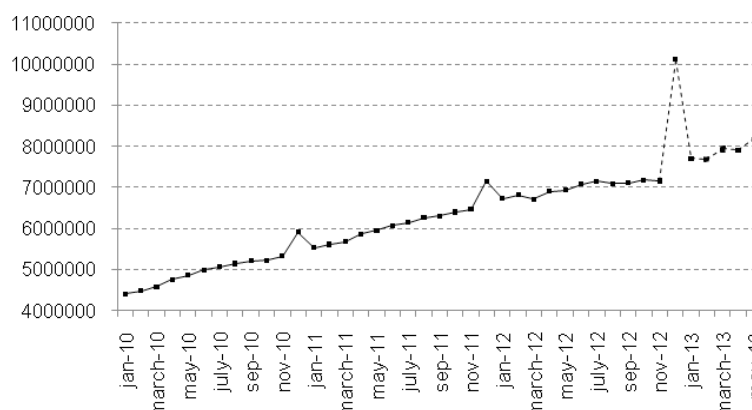


Рис. 39. M_2 , млрд руб.

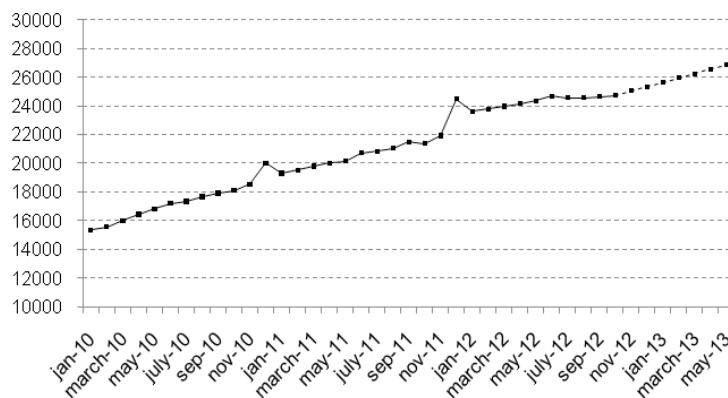


Рис. 40. Международные резервы РФ, млн долл. США

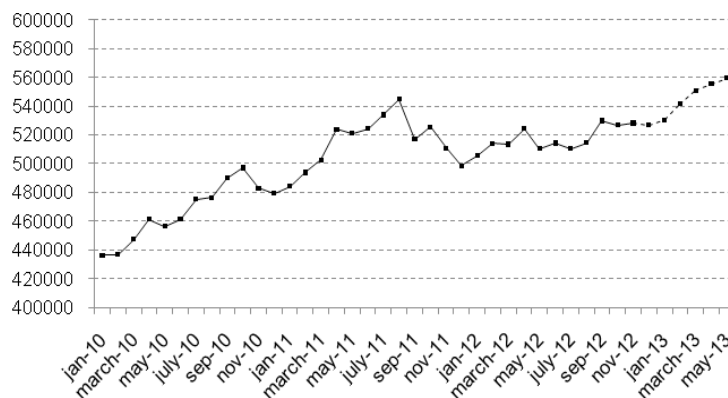


Рис. 41. Курс RUR/USD

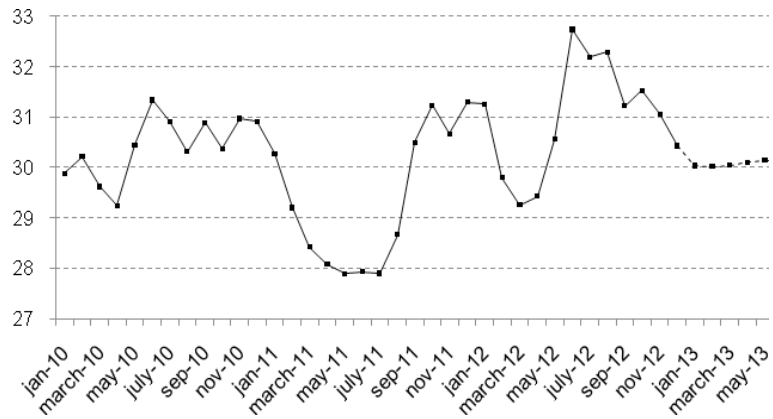


Рис. 41а. Курс RUR/USD (SM)

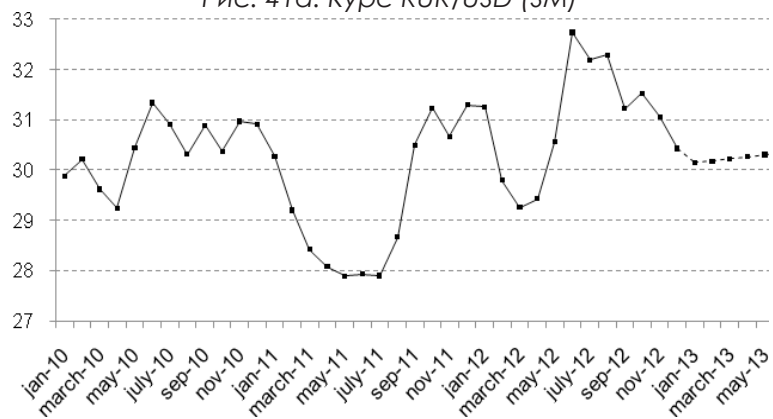


Рис. 42. Курс USD/EUR

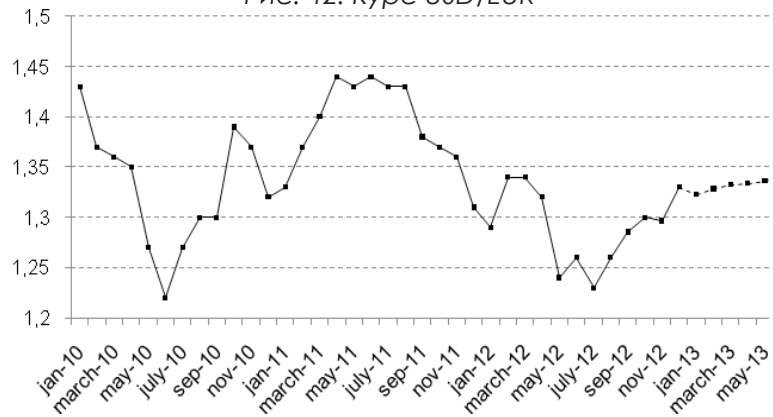


Рис. 42а. Курс USD/EUR (SM)

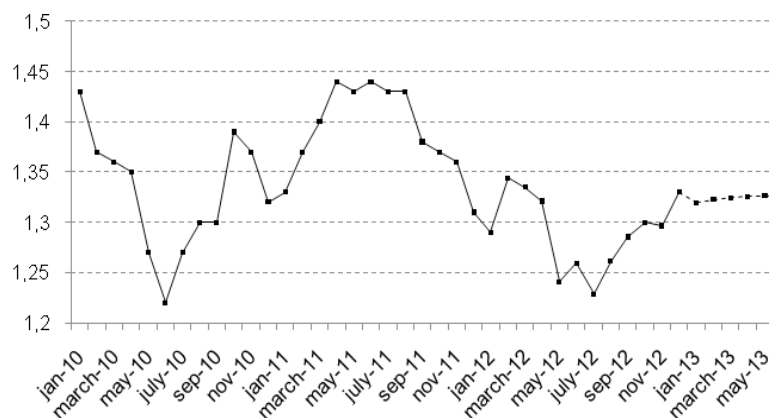


Рис. 43. Реальные располагаемые денежные доходы (в % к соответствующему периоду предыдущего года)

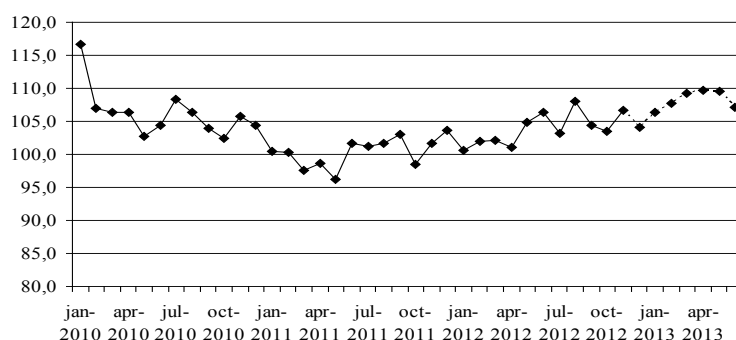


Рис. 44. Реальные денежные доходы (в % от уровня января 1999 г.)

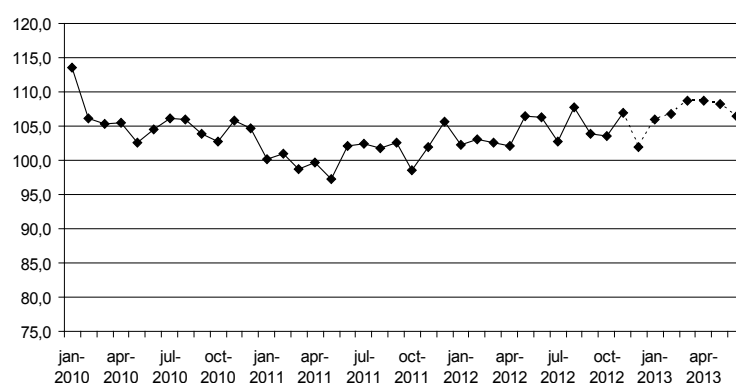


Рис. 45. Реальная начисленная заработная плата (в % к соответствующему периоду предыдущего года)

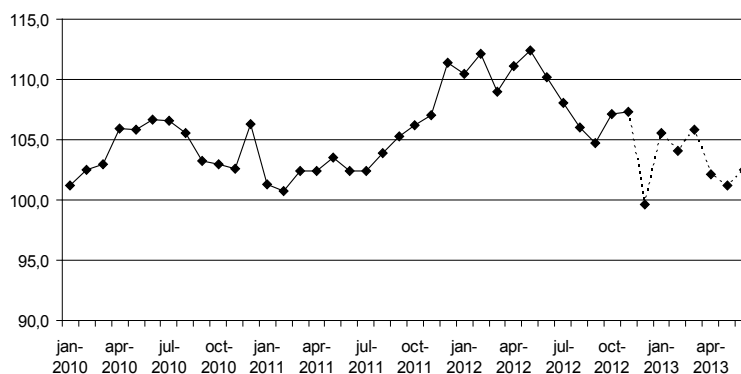


Рис. 46. Численность занятого в экономике населения (млн чел.)

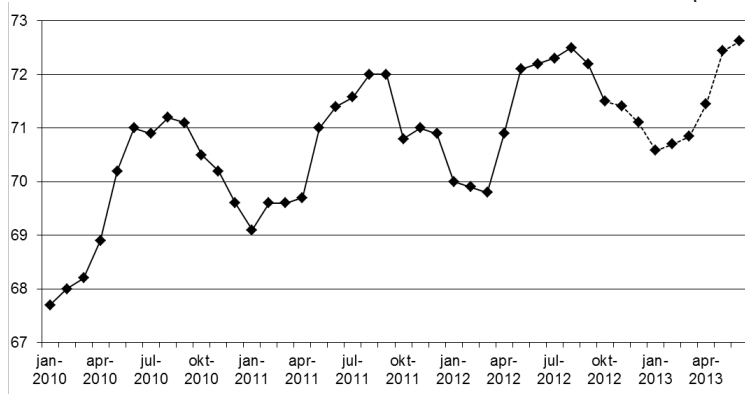


Рис. 47. Общая численность безработных (млн чел.)

