



ИНСТИТУТ
ЭКОНОМИЧЕСКОЙ
ПОЛИТИКИ
ИМЕНИ Е. Т. ГАЙДАРА

НАУЧНЫЙ ВЕСТНИК ИЭП ИМ. ГАЙДАРА.РУ

09/2022

МОДЕЛЬНЫЕ РАСЧЕТЫ КРАТКОСРОЧНЫХ ПРОГНОЗОВ СОЦИАЛЬНО-ЭКОНОМИЧЕСКИХ ПОКАЗАТЕЛЕЙ РФ

(октябрь 2022 г. – март 2023 г.)

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

ОЦЕНКА КАЧЕСТВА КРАТКОСРОЧНЫХ ПРОГНОЗОВ ИНДЕКСОВ ПРОМЫШЛЕННОГО ПРОИЗВОДСТВА НИУ ВШЭ

(апрель 2009 г. – июль 2022 г.)

Е. Астафьева, М. Турунцева 32

АННОТАЦИИ И КЛЮЧЕВЫЕ СЛОВА К СТАТЬЯМ №09/2022

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

МОДЕЛЬНЫЕ РАСЧЕТЫ КРАТКОСРОЧНЫХ ПРОГНОЗОВ СОЦИАЛЬНО-ЭКОНОМИЧЕСКИХ ПОКАЗАТЕЛЕЙ РФ

(октябрь 2022 г. – март 2023 г.)

В статье представлены расчеты прогнозных значений различных экономических показателей Российской Федерации в октябре 2022 г. – марте 2023 г., построенные на основе моделей временных рядов, структурных эконометрических уравнений и моделей, оцененных с использованием результатов конъюнктурных опросов.

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

Е. Астафьева, М. Турунцева

ОЦЕНКА КАЧЕСТВА КРАТКОСРОЧНЫХ ПРОГНОЗОВ ИНДЕКСОВ ПРОМЫШЛЕННОГО ПРОИЗВОДСТВА НИУ ВШЭ

(апрель 2009 г. – июль 2022 г.)

В статье приведены результаты анализа качества прогнозов ИЭП им. Е.Т. Гайдара в апреле 2009 г. – августе 2022 г. Показано, что прогнозы ИЭП индексов промышленного производства НИУ ВШЭ в целом демонстрируют довольно высокое качество, как сами по себе, так и по сравнению с альтернативными методами прогнозирования: лишь для одного показателя простейшие прогнозы оказываются качественно предпочтительнее. В течение анализируемого периода времени MAPE шести из восьми показателей не превосходит 5%. Лишь один показатель имеет MAPE выше 10%. Однако, в последние полгода рассматриваемого интервала (март-август 2022 г.) качество прогнозов ИЭП пяти из восьми индексов ухудшается.

Ключевые слова: прогнозирование, качество прогнозов, индексы промышленного производства.

МОДЕЛЬНЫЕ РАСЧЕТЫ КРАТКОСРОЧНЫХ ПРОГНОЗОВ СОЦИАЛЬНО-ЭКОНОМИЧЕСКИХ ПОКАЗАТЕЛЕЙ РФ (октябрь 2022 г. – март 2023 г.)

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

В статье представлены расчеты прогнозных значений различных экономических показателей Российской Федерации в октябре 2022 г. – марте 2023 г.¹, построенные на основе моделей временных рядов, разработанных в результате исследований, проводимых в течение последних нескольких лет в ИЭП им. Е.Т. Гайдара².

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

Несмотря на наличие значительного объема данных, относящихся к периоду до кризиса 1998 г., анализ и построение моделей для прогнозирования производилось лишь на временном интервале после августа 1998 г. Это обусловлено результатами предыдущих исследований³, одним из основных выводов которых является то, что учет данных докризисного периода в большинстве случаев ухудшает качество прогнозов. К тому же, в данный момент представляется не корректным использование еще более коротких рядов (после кризиса 2008 г.), поскольку статистические характеристики получаемых на таком небольшом интервале времени моделей оказываются очень низкими.

Оценка моделей рассматриваемых экономических показателей проводилась по стандартным методикам анализа временных рядов. На первом шаге анализировались коррелограммы исследуемых рядов и их первых разностей с целью определения максимального количества запаздывающих

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

² См., например, *Энтов Р.М., Дробышевский С.М., Носко В.П., Юдин А.Д.* Эконометрический анализ динамических рядов основных макроэкономических показателей. М., ИЭПП, 2001; *Р.М. Энтов, В.П. Носко, А.Д. Юдин, П.А. Кадочников, С.С. Пономаренко.* Проблемы прогнозирования некоторых макроэкономических показателей. М., ИЭПП, 2002; *В. Носко, А. Бузаев, П. Кадочников, С. Пономаренко.* Анализ прогнозных свойств структурных моделей и моделей с включением результатов опросов предприятий. М., ИЭПП, 2003; *Турунцева М.Ю., Киблицкая Т.Р.* Качественные свойства различных подходов к прогнозированию социально-экономических показателей РФ. М.: ИЭПП, 2010. Научные труды № 135Р.

³ Там же.

значений, которые необходимо включать в спецификацию модели. Затем, исходя из результатов анализа коррелограмм, все ряды тестировались на слабую стационарность (или стационарность около тренда) при помощи теста Дики–Фуллера. В некоторых случаях проводилось тестирование рядов на стационарность около сегментированного тренда при помощи тестов на эндогенные структурные сдвиги Перрона или Зивота–Эндрюса¹.

После разделения рядов на слабо стационарные, стационарные около тренда, стационарные около тренда со структурным сдвигом либо стационарные в разностях для каждого из них были оценены соответствующие его типу модели (в уровнях, а если необходимо, то и с включением тренда либо сегментированного тренда, либо в разностях). На основе информационных критериев Акаике и Шварца, а также свойств остатков моделей (отсутствие автокоррелированности, гомоскедастичность, нормальность) и качества ретропрогнозов, полученных по этим моделям, выбиралась лучшая. Расчеты прогнозных значений проводились по лучшей модели, построенной для каждого экономического показателя.

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

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

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

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

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

В статье также представлены расчеты значений индексов промышленного производства, индекса цен производителей и показателя общей численности безработных, рассчитанные с использованием

¹ См.: Perron, P. Further Evidence on Breaking Trend Functions in Macroeconomic Variables, *Journal of Econometrics*, 1997, 80, pp. 355–385; Zivot, E. and D.W.K. Andrews. Further Evidence on the Great Crash, the Oil-Price Shock, and Unit-Root Hypothesis. *Journal of Business and Economic Statistics*, 1992, 10, pp. 251–270.

результатов конъюнктурных опросов ИЭП им. Е.Т. Гайдара. Эмпирические исследования показывают¹, что использование рядов конъюнктурных опросов в прогностических моделях в качестве объясняющих переменных² в среднем улучшает точность прогноза. Расчеты будущих значений этих показателей проводились на основе ADL-моделей (с добавлением сезонных авторегрессионных запаздываний).

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

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

ПРОМЫШЛЕННОЕ ПРОИЗВОДСТВО И РОЗНИЧНЫЙ ТОВАРООБОРОТ

Промышленное производство

Для построения прогноза на октябрь 2022 г. – март 2023 г. были использованы ряды месячных индексов промышленного производства Федеральной службы государственной статистики (Росстата) с января 2002 г. по июль 2022 г. и ряды базисных индексов промышленного производства Научно-исследовательского университета «Высшая школа экономики» (НИУ ВШЭ)³ за период с января 2013 г. по август 2022 г. (скорректированное значение января 2013 г. принято за 100%). Прогнозные значения рассматриваемых рядов рассчитывались на основе моделей класса ARIMA. Прогнозные значения индексов промышленного производства Росстата и НИУ ВШЭ рассчитываются, кроме того, с использованием результатов конъюнктурных опросов (КО). Полученные результаты представлены в табл. 1.

Как видно из табл. 1, среднее⁴ падение индекса промышленного производства Росстата в октябре 2022 г. – марте 2023 г. по сравнению с аналогичным периодом предыдущего года по промышленности в целом составляет 2,4%. Для индекса промышленного производства НИУ ВШЭ данный показатель также составляет 2,5%. По итогам 2022 г. прогнозируемое годовое сокращение индекса промышленного производства Росстата составит 1,3%, сокращение индекса промышленного производства НИУ ВШЭ – 2,1%.

Среднемесячное сокращение индекса промышленного производства в добыче полезных ископаемых Росстата и НИУ ВШЭ в октябре 2022 г. – марте 2023 г. составляет 1,4 и 0,9% соответственно.

Средний прирост индекса промышленного производства в обрабатывающей промышленности Росстата по сравнению с аналогичным периодом предыдущего года в октябре 2022 г. – марте 2023 г. составляет -2,1%, индекса НИУ ВШЭ – -2%. Среднемесячное сокращение индекса промышленного производства в производстве пищевых продуктов Росстата и НИУ ВШЭ достигает соответственно 2,1 и 1,5%. В производстве кокса и нефтепродуктов среднее падение прогнозируется на уровне 0,9 и 0,6% для индексов Росстата и НИУ ВШЭ соответственно. Среднемесячное изменение индексов

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

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

³ Данные индексы рассчитываются Бессоновым В.А.

⁴ Под средним приростом индексов промышленного производства мы понимаем среднее значение данных показателей за шесть прогнозируемых месяцев.

Таблица 1

Результаты расчетов прогнозных значений индексов промышленного производства¹, %

Месяц	Индекс промышленного производства			ИПП в добыче полезных ископаемых		ИПП в обрабатывающих производствах		ИПП в обеспечении электрической энергией, газом и паром		ИПП в производстве пищевых продуктов		ИПП в производстве кокса и нефтепродуктов		ИПП в металлургическом производстве		ИПП в производстве машин и оборудования	
	Росстат	НИУ ВШЭ		Росстат	НИУ ВШЭ	Росстат	НИУ ВШЭ	Росстат	НИУ ВШЭ	Росстат	НИУ ВШЭ	Росстат	НИУ ВШЭ	Росстат	НИУ ВШЭ	Росстат	НИУ ВШЭ
		ARIMA	КО														
Прогнозируемый прирост к соответствующему месяцу предшествующего года																	
Октябрь 2022	-2,5	-2,9	-0,9	-2,6	-1,4	-1,9	-1,1	-2,6	-0,8	-2,5	0,1	-2,9	-4,7	0,4	1,5	-8,9	-7,4
Ноябрь 2022	-2,2	-2,7	-1,7	-2,7	-0,8	-3,0	-2,6	-0,7	0,4	-2,1	-1,8	-1,6	-0,5	-1,3	-0,9	-4,3	-4,9
Декабрь 2022	-5,4	-4,0	-3,7	-4,0	-1,4	-5,6	-3,1	-2,8	-2,7	-2,7	-3,1	-1,7	-0,3	-1,8	-1,0	-17,3	-16,9
Январь 2023	-2,6	-2,3	-2,7	-2,6	-0,6	-2,3	-2,4	-1,4	-1,3	-2,0	-1,9	-2,8	-1,5	2,4	1,2	-12,6	-15,0
Февраль 2023	-0,8	-2,3	-1,7	-2,7	-0,3	-0,8	-2,0	1,6	2,5	-1,4	-1,3	-0,9	-0,2	2,8	0,4	-10,7	-14,1
Март 2023	-0,4	-1,2	-2,0	-2,6	-0,9	0,8	-1,0	-2,2	-3,8	-1,7	-0,9	4,3	3,5	3,0	-0,7	-10,5	-10,6
Справочно: фактический прирост 2021/2022 г. к соответствующему месяцу 2020/2021 г.																	
Октябрь 2021	8,3		6,4	6,4	8,7	7,3	4,2	8,9	8,0	3,8	1,0	12,1	17,2	0,1	0,0	23,1	10,6
Ноябрь 2021	7,9		6,7	6,7	7,4	7,9	6,9	4,4	2,3	7,7	6,3	7,6	8,8	7,6	7,0	5,6	-4,0
Декабрь 2021	7,5		5,8	5,8	8,3	7,6	4,9	2,9	0,3	8,5	7,4	6,7	8,0	7,9	6,6	28,2	22,7
Январь 2022	8,0		6,4	6,4	7,8	10,0	7,2	1,1	0,1	5,3	3,8	8,9	9,6	4,0	1,8	26,5	25,4
Февраль 2022	5,4		4,9	4,9	7,4	6,2	6,1	-4,8	-7,9	4,2	2,8	5,5	4,7	3,9	2,5	19,1	22,7
Март 2022	2,3		3,2	3,2	6,7	-0,7	0,7	1,4	0,4	1,3	0,6	-5,1	-3,4	1,9	1,3	13,8	14,5

Примечание. На рассматриваемых интервалах времени ряды цепных индексов промышленного производства по промышленности в целом Росстата и НИУ ВШЭ, а также цепные индексы промышленного производства в производстве машин и оборудования НИУ ВШЭ идентифицированы как процессы, являющиеся стационарными около тренда с эндогенным структурным сдвигом; ряды цепных индексов промышленного производства в обрабатывающих производствах, металлургическом производстве и производстве готовых металлических изделий Росстата и НИУ ВШЭ, а также цепных индексов промышленного производства в добыче полезных ископаемых НИУ ВШЭ и в производстве машин и оборудования Росстата идентифицированы как процессы, являющиеся стационарными около тренда с двумя эндогенными структурными сдвигами. Временные ряды остальных цепных индексов являются стационарными в уровнях.

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

промышленного производства Росстата и НИУ ВШЭ для металлургического производства в октябре 2022 г. – марте 2023 г. составляет соответственно 0,9 и 0,1%. В производстве машин и оборудования среднее сокращение прогнозируется на уровне 10,7 и 11,5% для индексов Росстата и НИУ ВШЭ соответственно.

Среднее падение индекса промышленного производства в обеспечении электрической энергией, газом и паром; кондиционировании воздуха Росстата в октябре 2022 г. – марте 2023 г. по сравнению с аналогичным периодом предыдущего года составляет 1,3%; аналогичный показатель для индекса НИУ ВШЭ – 0,9%.

В среднем (по видам экономической деятельности) сокращение индексов промышленного производства Росстата в 2022 г. составит 4,8%, сокращение индексов промышленного производства НИУ ВШЭ – 4,1%.

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 август 2022 г.

Из табл. 2 следует, что средний прогнозируемый прирост объемов месячного товарооборота в период с октября 2022 г. по март 2023 г. по отношению к соответствующему периоду 2021–2022 гг. составляет около 4,3%.

Среднее прогнозируемое падение месячного реального товарооборота в период с октября 2022 г. по март 2023 г. по отношению к соответствующему периоду 2021–2022 гг. составляет 7%.

По итогам 2002 г. прогнозируемый прирост розничного товарооборота в номинальном выражении составит 5,8%; падение реального товарооборота прогнозируется в размере 5,2%.

ВНЕШНЕТОРГОВЫЕ ПОКАЗАТЕЛИ

Модельные расчеты прогнозных значений объемов экспорта, экспорта в страны вне СНГ, импорта и импорта из стран вне СНГ получены на основе моделей временных рядов и структурных моделей, оцененных на месячных данных на интервале с сентября 1998 г. по январь 2022 г. по данным ЦБ РФ¹. Результаты расчетов представлены в табл. 3.

Средний прогнозируемый объем сальдо торгового баланса со всеми странами за октябрь 2022 г. – март 2023 г. составит 148,6 млрд долл. По итогам 2022 г. средний прогнозируемый объем сальдо торгового баланса со всеми странами составит 301,8 млрд долл., что на 37,1% выше, чем в 2021 г.

Таблица 2

Результаты расчетов прогнозных значений объема розничного товарооборота и реального розничного товарооборота

Месяц	Прогнозируемые значения по ARIMA-модели	
	Розничный товарооборот, млрд руб. (в скобках – прирост к соответствующему месяцу предыдущего года, %)	Реальный розничный товарооборот (% к соответствующему периоду предыдущего года)
Октябрь 2022	3676,7 (5,5)	92,7
Ноябрь 2022	3662,6 (6,7)	94,0
Декабрь 2022	4418,1 (5,8)	93,1
Январь 2023	3375,4 (4,8)	92,8
Февраль 2023	3353,7 (3,0)	91,4
Март 2023	3738,8 (-0,3)	93,7
Справочно: фактические значения за аналогичные месяцы 2021–2022 гг.		
Октябрь 2021	3483,7	104,6
Ноябрь 2021	3433,1	103,6
Декабрь 2021	4176,2	105,6
Январь 2022	3221,6	103,1
Февраль 2022	3255,7	105,5
Март 2022	3749,6	102,0

Примечание. Ряды розничного товарооборота и реального розничного товарооборота на интервале с января 1999 г. по август 2022 г. являются рядами типа DS.

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

Таблица 3

Результаты расчетов прогнозных значений объемов внешнеторгового оборота со странами вне СНГ

Месяц	Экспорт, всего				Импорт, всего				Экспорт в страны вне СНГ				Импорт из стран вне СНГ			
	прогнозные значения (млрд долл. в мес.)		в процентах от фактических данных за соответствующий месяц предшествующего года		прогнозные значения (млрд долл. в мес.)		в процентах от фактических данных за соответствующий месяц предшествующего года		прогнозные значения (млрд долл. в мес.)		в процентах от фактических данных за соответствующий месяц предшествующего года		прогнозные значения (млрд долл. в мес.)		в процентах от фактических данных за соответствующий месяц предшествующего года	
	ARIMA	SM	ARIMA	SM												
Октябрь 2022	50,8	45,5	108	97	22,8	20,2	85	75	45,3	39,1	112	97	20,7	18,1	86	75
Ноябрь 2022	47,1	45,1	96	92	23,9	20,6	86	74	41,0	39,4	98	94	21,8	18,5	88	75
Декабрь 2022	59,8	52,1	103	90	26,2	25,4	85	83	53,2	46,4	105	92	24,1	23,3	88	85
Январь 2023	42,1	40,8	92	89	21,5	19,1	87	77	36,1	35,0	88	86	19,4	17,0	87	77
Февраль 2023	45,1	45,3	- ¹	-	23,4	21,6	-	-	39,2	38,4	-	-	21,3	19,5	-	-
Март 2023	47,9	47,2	-	-	24,4	22,5	-	-	41,2	40,4	-	-	22,4	20,4	-	-
Справочно: фактические значения за соответствующие месяцы 2021–2022 гг. (млрд долл.)																
Октябрь 2021	46,8				26,9				39,1					24,0		
Ноябрь 2021	49,0				27,9				40,5					24,8		
Декабрь 2021	58,1				30,8				41,8					27,5		
Январь 2022	45,9				24,8				50,5					22,2		
Февраль 2022	-				-				-					-		
Март 2022	-				-				-					-		

Примечание. На интервале с января 1999 г. по январь 2022 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.

¹ Так как с февраля 2022 г. публикация официальной статистики внешнеторгового оборота в месячном измерении приостановлена, посчитать данные значения не представляется возможным.

Таблица 4
Результаты расчетов прогнозных значений индексов цен

Месяц	Индексы цен производителей:																	
	Индекс потребительских цен (ARIMA)	Индекс потребительских цен (SM)	Индекс потребительских цен (FM)	ИЦП промышленных товаров (ARIMA)	ИЦП промышленных товаров (КО)	ИЦП промышленных товаров (FM)	добыча полезных ископаемых	обрабатывающие производства	производство электроэнергии, газа и воды	производство пищевых продуктов	производство текстильных изделий	обработка древесины и производство изделий из дерева	производство бумаги и бумажных изделий	производство кокса, нефтепродуктов	химическое производство	металлургическое производство	производство машин и оборудования	производство автотранспортных средств
	Прогнозные значения (в % к предыдущему месяцу)																	
Октябрь 2022	100,8	100,5	100,5	100,5	100,2	100,5	102,4	99,8	100,5	99,2	100,5	95,6	99,5	100,9	98,2	100,0	100,2	101,7
Ноябрь 2022	100,8	100,5	100,5	100,2	100,3	100,5	101,7	100,0	98,8	99,3	99,8	95,9	100,6	99,2	99,6	97,4	100,4	100,0
Декабрь 2022	100,7	100,6	100,5	100,0	100,2	100,8	102,3	99,3	100,1	99,5	100,5	96,4	100,9	96,9	99,3	99,3	100,5	100,4
Январь 2023	101,2	100,7	100,5	100,5	100,8	100,3	99,4	99,7	100,1	99,4	100,1	97,8	102,1	98,3	100,7	100,8	101,4	100,9
Февраль 2023	100,9	100,6	100,5	101,4	101,4	100,5	102,8	99,6	101,4	99,5	100,7	98,7	101,1	100,5	100,4	99,5	101,0	100,2
Март 2023	100,9	100,4	100,5	101,7	101,3	100,7	102,3	100,2	101,8	99,4	100,8	99,1	100,2	100,4	100,5	98,3	100,5	101,4
	Прогнозные значения (в % к декабрю 2021/2022 г.)																	
Октябрь 2022	112,1	111,4	112,3	103,0	100,1	102,7	98,1	102,0	104,1	106,0	112,7	81,8	99,8	94,5	93,7	86,2	115,7	127,0
Ноябрь 2022	112,9	112,0	112,9	103,2	100,4	103,3	99,8	102,0	102,9	105,3	112,5	78,4	100,4	93,8	93,3	84,0	116,1	127,0
Декабрь 2022	113,7	112,6	113,4	103,2	100,6	104,1	102,1	101,3	103,0	104,7	113,1	75,6	101,3	90,9	92,7	83,5	116,7	127,6
Январь 2023	101,2	100,7	100,5	100,5	101,4	100,3	99,4	99,7	100,1	99,4	100,1	97,8	102,1	98,3	100,7	100,8	101,4	100,9
Февраль 2023	102,2	101,3	101,0	101,9	102,8	100,8	102,2	99,3	101,5	98,9	100,8	96,5	103,2	98,8	101,1	100,3	102,4	101,1
Март 2023	103,1	101,7	101,5	103,7	104,1	101,5	104,6	99,4	103,3	98,3	101,6	95,6	103,5	99,2	101,6	98,6	103,0	102,5
	Справочно: фактические значения за аналогичные периоды 2021/2022 г. (в % к декабрю 2020/2021 г.)																	
Октябрь 2021	105,4	105,4	105,4	124,1	124,1	143,9	121,6	107,5	113,4	111,2	143,7	128,9	142,5	140,6	129,4	109,1	111,0	111,0
Ноябрь 2021	106,6	106,6	106,6	127,4	127,4	156,9	122,9	105,9	113,9	111,0	144,3	130,3	146,1	146,6	128,8	109,9	111,5	111,5
Декабрь 2021	107,7	107,7	107,7	128,4	128,4	159,1	123,8	106,0	114,5	112,5	144,0	131,6	143,0	150,9	133,8	112,1	112,1	112,1
Январь 2022	108,5	108,5	108,5	100,0	100,0	95,9	101,5	99,5	100,6	100,5	100,8	101,2	101,0	104,8	99,4	102,3	103,2	103,2
Февраль 2022	101,0	101,0	101,0	104,0	104,0	109,6	102,6	100,6	101,4	103,0	100,1	103,2	101,6	105,6	101,6	104,6	103,0	103,0
Март 2022	102,2	102,2	102,2	110,2	110,2	123,3	106,9	102,6	105,5	110,0	102,5	105,5	101,9	109,9	108,9	110,0	111,1	111,1

Примечание. На интервале с января 1999 г. по август 2022 г. ряд цепного индекса цен производителей промышленных товаров в производстве машин и оборудования идентифицирован как процесс, являющийся стационарным около тренда с двумя эндогенным структурными сдвигами. Ряды остальных цепных индексов цен являются стационарными в уровнях.

ДИНАМИКА ЦЕН

Индекс потребительских цен и индексы цен производителей

В данном разделе представлены расчеты прогнозных значений индекса потребительских цен и индексов цен производителей (как в целом по промышленности, так и по некоторым ее видам деятельности по классификации ОКВЭД), полученные на основе моделей временных рядов, оцененных по данным Росстата на интервале с января 1999 г. по август 2022 г.¹. В табл. 4 приведены результаты модельных расчетов прогнозных значений в октябре 2022 г. – марте 2023 г. по ARIMA-моделям, структурным моделям (SM) и моделям, построенным с использованием конъюнктурных опросов (КО).

Прогнозируемый среднемесячный прирост индекса потребительских цен в октябре 2022 г. – марте 2023 г. составит 0,6%. Прирост цен производителей промышленных товаров за указанный период прогнозируется в среднем на уровне 0,7% в месяц. Годовой прирост индекса потребительских цен в среднем по трем моделям составит 13,2%. Аналогичный показатель для индекса цен производителей прогнозируется на уровне 2,6%.

Для индексов цен производителей Росстата с октября 2022 г. по март 2023 г. прогнозируются следующие средние темпы роста в месяц: 1,8% – в добыче полезных ископаемых, -0,3% – в обрабатывающих производствах, 0,5% – в обеспечении электрической энергией, газом и паром, -0,6% – в производстве пищевых продуктов, 0,4% – в производстве текстильных изделий, -2,8% – в обработке древесины и производстве изделий из дерева, 0,7% – в производстве бумаги и бумажных изделий, -0,6% – в производстве кокса и нефтепродуктов, -0,2% – в химическом производстве, -0,8% – в металлургическом производстве, 0,7% – в производстве машин и оборудования и 0,8% – в производстве автотранспортных средств.

Годовой прирост индексов цен производителей по видам экономической деятельности составит в среднем 3,2%. По итогам 2022 г. максимальный годовой прирост прогнозируется в производстве автотранспортных средств – 27,6%, минимальный в обработке древесины и производстве изделий из дерева – падение на 24,4%.

Динамика стоимости минимального набора продуктов питания

В данном разделе представлены результаты расчетов прогнозируемых значений стоимости минимального набора продуктов питания в сентябре 2022 г. – феврале 2023 г. Прогнозы строились на основе временных рядов по данным Росстата за период с января 2000 г. по сентябрь 2022 г. Результаты расчетов представлены в табл. 5.

Как видно из табл. 5, с октября по февраль прогнозируется рост стоимости минимального набора продуктов питания по сравнению с соответствующим уровнем прошлого года, и только в марте ожидается снижение. При этом средняя прогнозируемая стоимость минимального набора продуктов питания составляет около 5621 руб. Прогнозируемый рост стоимости минимального набора продуктов питания составляет в среднем около 4,5% по сравнению с уровнем соответствующего периода прошлого года. Годовой прирост стоимости минимального набора продуктов питания в 2022 г. составит 6,6%.

Таблица 5

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

Прогнозируемые значения по ARIMA-модели (руб.)	
Октябрь 2022	5488,6
Ноябрь 2022	5520,0
Декабрь 2022	5579,1
Январь 2023	5676,2
Февраль 2023	5715,1
Март 2023	5744,1
Справочно: фактические значения за аналогичные месяцы 2021–2022 гг. (руб.)	
Октябрь 2021	5033,6
Ноябрь 2021	5133,3
Декабрь 2021	5234,8
Январь 2022	5427,2
Февраль 2022	5512,2
Март 2022	6013,3
Прогнозируемый прирост к соответствующему месяцу предыдущего года (%)	
Октябрь 2022	9,0
Ноябрь 2022	7,5
Декабрь 2022	6,6
Январь 2023	4,6
Февраль 2023	3,7
Март 2023	-4,5

Примечание. Ряд стоимости минимального набора продуктов на интервале с января 2000 г. по сентябрь 2022 г. является стационарным в первых разностях.

¹ Структурные модели оценивались на интервале с октября 1998 г.

Индексы транспортных тарифов на грузовые перевозки

В данном разделе представлены расчеты прогнозных значений индексов цен транспортных тарифов на грузовые перевозки¹, полученные на основе моделей временных рядов, оцененных по данным Росстата на интервале с сентября 1998 г. по июль 2022 г. В табл. 6 приведены результаты модельных расчетов прогнозных значений в октябре 2022 г. – марте 2023 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 2022 г. – март 2023 г. сводный индекс транспортных тарифов на грузовые перевозки в течение данных шести месяцев будет снижаться со среднемесячным темпом 0,5%. В июле 2022 г. наблюдается рост индекса на 17,8 п.п. В октябре 2022 г. прогнозируется сезонное снижение индекса на -4,1 п.п. В результате его годовой прирост в 2022 г. составит 24,9%.

Индекс тарифов на грузовые перевозки автомобильным транспортом в течение данных шести месяцев будет расти со среднемесячным темпом 0,7%. Его годовой прирост в 2022 г. прогнозируется на уровне 14,9%.

Индекс тарифов на трубопроводный транспорт в течение следующих шести месяцев будет снижаться со среднемесячным темпом 0,3%. В июле 2022 г. наблюдается рост индекса на 42,9 п.п. Его годовой прирост в 2022 г. составит 31,4%.

Динамика цен на некоторые виды сырья на мировом рынке

В данном разделе в табл. 7 представлены расчеты среднемесячных значений цен на нефть марки Brent (долл./барр.), алюминий (долл./т), золото (долл./унц.), медь (долл./т) и никель (долл./т) в октябре 2022 г. – марте 2023 г., полученные на основе нелинейных моделей временных рядов, оцененных по данным МВФ на интервале с января 2000 г. по август 2022 г.

Таблица 6
Результаты расчетов прогнозных значений индексов транспортных тарифов

Месяц	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 2022	95,9	100,5	94,9
Ноябрь 2022	100,3	100,4	104,7
Декабрь 2022	100,3	100,4	102,9
Январь 2023	100,3	102,2	94,9
Февраль 2023	100,2	100,4	96,4
Март 2023	100,2	100,4	104,4
Прогнозные значения по ARIMA-моделям (в % к декабрю предыдущего года)			
Октябрь 2022	124,3	113,9	122,0
Ноябрь 2022	124,6	114,4	127,8
Декабрь 2022	124,9	114,9	131,4
Январь 2023	100,3	102,2	94,9
Февраль 2023	100,5	102,6	91,5
Март 2023	100,7	103,0	95,5
Справочно: фактические значения за аналогичный период 2021–2022 гг. (в % к предыдущему месяцу)			
Октябрь 2021	98,4	100,2	97,9
Ноябрь 2021	100,1	100,3	100,0
Декабрь 2021	100,0	100,3	100,0
Январь 2022	102,9	109,2	98,4
Февраль 2022	100,1	100,9	100,0
Март 2022	103,4	102,5	106,4

Примечание. На интервале с сентября 1998 г. по июль 2022 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 июль 2022 г.; для всех рядов использовались фиктивные переменные для учета особо резких всплесков.

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

Таблица 7

Результаты расчетов прогнозных значений цен на природные ресурсы

Месяц	Нефть марки Brent (долл./барр.)	Алюминий (долл./т)	Золото (долл./унц.)	Медь (долл./т)	Никель (долл./т)
Прогнозные значения по нелинейным моделям					
Октябрь 2022	96,18	2283	1795	7833	17493
Ноябрь 2022	98,98	2290	1792	7892	16939
Декабрь 2022	101,48	2274	1801	7951	14978
Январь 2023	100,79	2263	1811	8005	13592
Февраль 2023	100,26	2266	1830	8051	12429
Март 2023	101,14	2264	1838	8094	10906
Приросты к соответствующему месяцу предыдущего года (%)					
Октябрь 2022	14,0	-15,9	1,0	-17,5	-10,1
Ноябрь 2022	40,3	-12,7	-1,5	-16,4	-14,9
Декабрь 2022	30,5	-19,0	0,8	-18,2	-27,8
Январь 2023	10,5	-25,1	-0,3	-15,8	-39,1
Февраль 2023	-0,7	-32,7	-1,4	-18,5	-48,8
Март 2023	-6,3	-35,1	-5,6	-22,0	-66,0
Справочно: фактические значения за аналогичный период 2021–2022 гг.					
Октябрь 2021	84,38	2717	1777	9496	19448
Ноябрь 2021	70,57	2625	1820	9443	19897
Декабрь 2021	77,78	2808	1787	9721	20757
Январь 2022	91,21	3021	1817	9506	22328
Февраль 2022	100,99	3369	1856	9884	24282
Март 2022	107,91	3491	1948	10375	32107

Примечание. Ряды цен на нефть, никель, золото, медь и алюминий на интервале с января 1980 г. по август 2022 г. являются рядами типа DS.

Средний прогнозируемый уровень цен на нефть составляет около 99,8 долл./барр., что выше соответствующих показателей прошлого года в среднем на 14,7%. Цены на алюминий прогнозируются на уровне около 2273 долл./т, а их среднее прогнозируемое снижение составляет приблизительно 23% по сравнению с соответствующим уровнем прошлого года. Прогноз цен на золото составляет около 1811 долл./унц. Средние прогнозируемые цены на медь составляют около 7971 долл./т, а на никель – около 14389 долл./т. Среднее прогнозируемое снижение цен на золото составляет около 1%, цен на медь – около 18%, цен на никель – 34% по сравнению с соответствующим уровнем прошлого года.

На конец 2022 г. по сравнению с концом 2021 г. прогнозируемый прирост цен на нефть, золото составит 30,5 и 0,8% соответственно, прогнозируемое падение цен на алюминий, медь и никель – 19, 18,2 и 27,8%.

ДЕНЕЖНЫЕ ПОКАЗАТЕЛИ

Будущие значения денежной базы (в узком определении – наличные деньги и ФОР) и денежного агрегата M_2 в октябре 2022 г. – марте 2023 г. получены на основе моделей временных рядов соответствующих показателей, рассчитываемых

Таблица 8

Прогноз денежного агрегата M_2 и денежной базы

Месяц	Денежная база		M_2	
	млрд руб.	прирост к предыдущему месяцу, %	млрд руб.	прирост к предыдущему месяцу, %
Октябрь 2022	14321	-0,1	70955	0,1
Ноябрь 2022	14556	1,6	71008	0,1
Декабрь 2022	14528	-0,2	71397	0,5
Январь 2023	15097	3,9	72821	2,0
Февраль 2023	14728	-2,4	72849	0,0
Март 2023	14956	1,6	72871	0,0
Справочно: фактические значения за соответствующие месяцы 2021–2022 гг. (прирост к предыдущему месяцу, %)				
Октябрь 2021		0,7		1,3
Ноябрь 2021		-0,2		0,3
Декабрь 2021		-0,7		2,5
Январь 2022		2,6		6,3
Февраль 2022		-1,9		-1,4
Март 2022		14,3		2,1

Примечание. Временной ряд значений денежной базы на интервале с октября 1998 г. по сентябрь 2022 г. был отнесен к классу рядов, являющихся стационарными в первых разностях, с выраженной сезонной компонентой, а временной ряд денежного агрегата M_2 на интервале с октября 1998 г. по август 2022 г. был идентифицирован как стационарный ряд с выраженной сезонной компонентой.

ЦБ РФ¹, на интервале с октября 1998 г. по сентябрь 2022 г. для денежной базы и по август 2022 г. для денежного агрегата M_2 . В табл. 8 приводятся результаты расчетов прогнозных значений и фактические значения этих показателей за аналогичный период предыдущего года. Необходимо отметить, что в силу того, что денежная база является одним из инструментов политики ЦБ РФ, ее прогнозы на основе моделей временных рядов в достаточной степени условны, так как будущие значения данного показателя определяются в значительной степени не внутренними свойствами ряда, а решениями ЦБ РФ.

В октябре 2022 г. – марте 2023 г. денежная база будет расти со среднемесячным темпом 0,7%. Годовой прирост денежной базы в 2022 г. составит по прогнозам 3,8%.

В рассматриваемый период времени денежный показатель M_2 будет расти со среднемесячным темпом 0,5%. В январе 2023 г. прогнозируется сезонный рост индекса на 2,0 п.п. В январе 2022 г. наблюдается сезонный рост индекса на 6,3 п.п. Годовой прирост показателя M_2 прогнозируется на уровне 13,9%.

МЕЖДУНАРОДНЫЕ РЕЗЕРВЫ

В данном разделе представлены результаты статистической оценки будущих значений международных резервов РФ², полученные исходя из оценки модели временного ряда международных резервов, по данным ЦБ РФ, на интервале с ноября 1998 г. по сентябрь 2022 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 2022 г. – марте 2023 г. международные резервы будут снижаться со среднемесячным темпом -0,1%. В 2022 г. прогнозируется снижение международных резервов на 10,2%.

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 на последний день месяца, за период с октября 1998 г. по сентябрь 2022 г. и за период с января 1999 г. по сентябрь 2022 г.³ соответственно.

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

² Данные по объему международных резервов представлены по состоянию на первое число следующего месяца.

³ В Бюллетене использованы данные МВФ по курсу евро к доллару США за период с января 1999 г. по июль 2022 г. и по курсу доллара США к рублю за период с октября 1998 г. по август 2022 г. Данные за сентябрь 2022 г. были взяты с сайта статистики обменных курсов www.oanda.com.

Таблица 9

Прогноз международных резервов

Месяц	Прогнозные значения по ARIMA-моделям	
	млрд долл.	прирост к предыдущему месяцу, %
Октябрь 2022	561,6	-0,7
Ноябрь 2022	559,3	-0,4
Декабрь 2022	558,7	-0,1
Январь 2023	559,6	0,2
Февраль 2023	561,2	0,3
Март 2023	563,3	0,4
Справочно: фактические значения за аналогичный период 2021–2022 гг.		
Октябрь 2021	614,1	-0,7
Ноябрь 2021	624,2	1,6
Декабрь 2021	622,5	-0,3
Январь 2022	630,6	1,3
Февраль 2022	630,2	-0,1
Март 2022	617,1	-2,1

Примечание. На интервале с октября 1998 г. по сентябрь 2022 г. ряд международных резервов РФ был идентифицирован как стационарный в разностях ряд.

Таблица 10

Прогноз курсов USD/RUR и EUR/USD

Месяц	Прогнозные значения курса USD/RUR (рублей за доллар США)		Прогнозные значения курса EUR/USD (долларов США за евро)	
	ARIMA	SM	ARIMA	SM
	Октябрь 2022	61,55	61,51	1,01
Ноябрь 2022	61,74	61,34	1,01	1,03
Декабрь 2022	61,75	60,84	1,01	1,03
Январь 2023	61,89	61,27	1,01	1,04
Февраль 2023	61,95	61,52	1,01	1,04
Март 2023	62,06	61,59	1,01	1,04
Справочно: фактические значения за аналогичный период 2021–2022 гг.				
Октябрь 2021	70,52		1,16	
Ноябрь 2021	74,98		1,13	
Декабрь 2021	74,29		1,13	
Январь 2022	77,82		1,11	
Февраль 2022	83,55		1,12	
Март 2022	72,30		1,11	

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

В октябре 2022 г. – марте 2023 г. значение курса доллара США к рублю прогнозируется в среднем по двум моделям равным 61 руб. 58 коп. за доллар США. Прогнозируемое на конец 2022 г. значение показателя составит 61 руб. 29 коп. за доллар США в среднем по двум моделям.

Прогнозируемое значение курса евро к доллару США в среднем на рассматриваемом интервале времени составит 1,02 долл. США за один евро. Значение показателя на конец 2022 г. прогнозируется на уровне 1,02 долл. США за один евро в среднем по двум моделям.

ПОКАЗАТЕЛИ УРОВНЯ ЖИЗНИ НАСЕЛЕНИЯ

В данном разделе (см. табл. 11) представлены результаты расчета ежемесячных прогнозных значений показателя реальной заработной платы, а также ежеквартальных прогнозных значений показателей реальных располагаемых денежных доходов и реальных денежных доходов¹, полученные на основе моделей временных рядов соответствующих показателей, рассчитываемых Росстатом и взятых на интервале с января 1999 г. по август 2022 г., а также с I квартала 2014 г. по II квартал 2022 г. Данные показатели в некоторой степени зависят от централизованных решений о повышении заработной платы работникам бюджетной сферы, а также от решений о повышении пенсий, стипендий и пособий, что вносит некоторые изменения в динамику рассматриваемых показателей. Как следствие, будущие значения показателей реальной заработной платы и реальных располагаемых денежных доходов населения, рассчитанные на основе рядов, последние наблюдения которых существенно выше или ниже предыдущих из-за такого повышения, могут сильно отличаться от реализующихся на практике.

Результаты, представленные в табл. 11, прогнозируют небольшой рост реальной заработной платы. Ожидается средний прирост показателя реальной заработной платы в размере 1,5% по сравнению с аналогичным периодом предшествующего года.

По итогам 2022 г. прогнозируется падение уровня реальной заработной платы на 1% за 12 месяцев.

Результаты, представленные в табл. 12, прогнозируют уменьшение реальных располагаемых денежных доходов порядка 0,1%. Также, прогнозируется среднее снижение реальных денежных доходов около 0,3% по сравнению с соответствующим прошлогодним уровнем.

По итогам 2022 г. прогнозируемое снижение реальных располагаемых денежных доходов составит 1,1%; падение реальных денежных доходов – 2,7% за 12 месяцев.

Таблица 11

Прогноз уровня реальной начисленной заработной платы

Месяц	Реальная заработная плата
Прогнозные значения по моделям ARIMA (в % к соответствующему месяцу 2021 г.)	
Октябрь 2022	100,2
Ноябрь 2022	100,8
Декабрь 2022	101,3
Январь 2023	101,9
Февраль 2023	102,3
Март 2023	102,8
Справочно: фактические значения за соответствующий период 2021–2022 гг. (в % к аналогичному периоду 2020–2021 гг.)	
Октябрь 2021	100,6
Ноябрь 2021	103,4
Декабрь 2021	103,6
Январь 2022	101,9
Февраль 2022	102,6
Март 2022	103,6

Примечание. Для расчетов использовался ряд реальной заработной платы в базисной форме (за базисный период был принят январь 1999 г.). На рассматриваемом интервале с января 1999 г. по август 2022 г. этот ряд был отнесен к классу процессов, являющихся стационарными в разностях.

Таблица 12

Прогноз показателей уровня жизни населения

Период	Реальные располагаемые денежные доходы	Реальные денежные доходы
Прогнозные значения по моделям ARIMA (в % к соответствующему кварталу 2021–2022 гг.)		
IV квартал 2022	99,3	99,2
I квартал 2023	99,2	99,2
Справочно: фактические значения за соответствующий период 2021–2022 гг. (в % к аналогичному периоду 2020–2021 гг.)		
IV квартал 2021	100,0	100,0
I квартал 2022	98,8	99,0

¹ Реальные денежные доходы – относительный показатель, исчисленный путем деления индекса номинального размера (т.е. фактически сложившегося в отчетном периоде) денежных доходов населения на ИПЦ. Реальные располагаемые денежные доходы – денежные доходы за вычетом обязательных платежей и взносов. (См.: «Российский статистический ежегодник», Москва, Росстат, 2004, стр. 212).

ПОКАЗАТЕЛИ ЧИСЛЕННОСТИ ЗАНЯТОГО В ЭКОНОМИКЕ НАСЕЛЕНИЯ И ОБЩЕЙ ЧИСЛЕННОСТИ БЕЗРАБОТНЫХ

Для расчета будущих значений показателей численности занятого в экономике населения и общей численности безработных были использованы модели временных рядов, оцененные на интервале с января 1999 г. по июль 2022 г. по месячным данным Росстата¹. Показатель общей численности безработных рассчитывается также на основе моделей с использованием результатов конъюнктурных опросов².

Отметим, что возможные логические расхождения³ в прогнозах общей численности занятых и общей численности безработных, которые в сумме должны быть равны показателю экономически активного населения, могут возникать вследствие того, что каждый ряд прогнозируется отдельно, а не как разность между прогнозными значениями экономически активного населения и другим показателем.

Таблица 13

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

Месяц	Численность занятого в экономике населения (ARIMA)		Общая численность безработных (ARIMA)			Общая численность безработных (КО)		
	млн человек	прирост к соответствующему месяцу 2021 г., %	млн человек	прирост к соответствующему месяцу 2021 г., %	в % к показателю численности занятого в экономике населения	млн человек	прирост к соответствующему месяцу 2021 г., %	в % к показателю численности занятого в экономике населения
Октябрь 2022	72,2	-0,1	2,9	-12,4	4,0	3,1	-5,4	4,3
Ноябрь 2022	72,2	0,0	2,9	-10,2	4,0	3,1	-2,5	4,3
Декабрь 2022	72,5	0,0	2,8	-11,2	3,9	3,1	-2,5	4,3
Январь 2023	71,6	0,2	2,9	-12,8	4,0	3,1	-5,5	4,3
Февраль 2023	71,8	0,2	2,8	-9,5	3,9	3,0	-3,8	4,2
Март 2023	71,7	0,5	2,8	-9,9	3,9	3,1	0,5	4,3
Справочно: фактические значения за аналогичный период 2021–2022 гг., млн человек								
Октябрь 2021	72,3					3,3		
Ноябрь 2021	72,2					3,2		
Декабрь 2021	72,5					3,2		
Январь 2022	71,5					3,3		
Февраль 2022	71,7					3,1		
Март 2022	71,4					3,1		

Примечание. На интервале с января 1999 г. по июль 2022 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 2022 г. – марте 2023 г. рост численности занятых в экономике в среднем составит 0,1% в месяц по отношению к соответствующему периоду предыдущего года. Прогнозируемое на конец 2021 г. значение показателя численности занятого в экономике населения составляет 72,5 млн человек.

Среднее сокращение показателя общей численности безработных прогнозируется на уровне 7,1% в месяц по сравнению с аналогичным периодом прошлого года. Средняя численность безработных в конце 2021 г. прогнозируется на уровне 3 млн человек.

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

² Модель оценена на интервале с января 1999 г. по июль 2022 г.

³ Например, таким расхождением можно считать одновременное уменьшение и численности занятого в экономике населения и общей численности безработных. Хотя отметим, что в принципе такая ситуация возможна при условии одновременного уменьшения численности экономически активного населения.

ПРИЛОЖЕНИЕ 1

Сводная таблица модельных расчетов краткосрочных прогнозов социально-экономических показателей РФ

	2022						2023		
	Июль	Август	Сентябрь	Октябрь	Ноябрь	Декабрь	Январь	Февраль	Март
ИПП Росстата (прирост, %)*	-0,5	0,4	-1,4	-2,7	-2,5	-4,7	-2,5	-1,8	-0,8
ИПП НИУ ВШЭ (прирост, %)*	-1,2	-0,2	-0,9	-1,8	-2,2	-3,9	-2,7	-2,2	-2,3
ИПП в добыче полезных ископаемых Росстата (прирост, %)*	0,9	0,8	-0,5	-1,3	-1,4	-2,1	-1,1	-0,9	-1,8
ИПП в добыче полезных ископаемых НИУ ВШЭ (прирост, %)*	1,1	1,0	0,0	-1,4	-0,8	-1,4	-0,6	-0,3	-0,9
ИПП в обрабатывающих производствах Росстата (прирост, %)*	-1,1	-1,1	-2,6	-1,9	-3,0	-5,6	-2,3	-0,8	0,8
ИПП в обрабатывающих производствах НИУ ВШЭ (прирост, %)*	-2,6	-1,0	-1,5	-1,1	-2,6	-3,1	-2,4	-2,0	-1,0
ИПП в производстве и распределении электроэнергии, газа и воды Росстата (прирост, %)*	-0,5	0,7	-3,6	-2,6	-0,7	-2,8	-1,4	1,6	-2,2
ИПП в производстве и распределении электроэнергии, газа и воды НИУ ВШЭ (прирост, %)*	-0,4	0,8	-4,6	-0,8	0,4	-2,7	-1,3	2,5	-3,8
ИПП в производстве пищевых продуктов Росстата (прирост, %)*	-3,6	-2,1	-1,0	-2,5	-2,1	-2,7	-2,0	-1,4	-1,7
ИПП в производстве пищевых продуктов НИУ ВШЭ (прирост, %)*	-1,6	0,5	-0,2	0,1	-1,8	-3,1	-1,9	-1,3	-0,9
ИПП в производстве кокса и нефтепродуктов Росстата (прирост, %)*	3,6	0,7	-0,7	-2,9	-1,6	-1,7	-2,8	-0,9	4,3
ИПП в производстве кокса и нефтепродуктов НИУ ВШЭ (прирост, %)*	9,3	1,4	0,9	-4,7	-0,5	-0,3	-1,5	-0,2	3,5
ИПП в металлургическом производстве и производстве готовых металлических изделий Росстата (прирост, %)*	-1,3	2,4	-1,6	0,4	-1,3	-1,8	2,4	2,8	3,0
ИПП в металлургическом производстве и производстве готовых металлических изделий НИУ ВШЭ (прирост, %)*	-1,6	3,6	3,0	1,5	-0,9	-1,0	1,2	0,4	-0,7
ИПП в производстве машин и оборудования Росстата (прирост, %)*	-12,7	-8,3	-13,3	-8,9	-4,3	-17,3	-12,6	-10,7	-10,5
ИПП в производстве машин и оборудования НИУ ВШЭ (прирост, %)*	-10,0	-10,1	-12,2	-7,4	-4,9	-16,9	-15,0	-14,1	-10,6
Розничный товарооборот, трлн руб.	3,54	3,64	3,60	3,68	3,66	4,42	3,38	3,35	3,74
Реальный розничный товарооборот (прирост, %)*	-8,7	-8,8	-8,2	-7,3	-6,0	-6,9	-7,2	-8,6	-6,3
Экспорт (млрд долл.)	48,8	46,1	46,7	48,2	46,1	56,0	41,5	45,2	47,6
Экспорт в страны, дальнего зарубежья (млрд долл.)	43,3	40,5	41,2	42,2	39,4	49,8	36,1	38,8	40,8
Импорт (млрд долл.)	23,0	21,0	22,0	21,5	22,3	25,8	20,3	22,5	23,5
Импорт из стран дальнего зарубежья (млрд долл.)	21,8	20,4	19,9	19,4	20,2	23,7	19,4	20,4	21,4
ИЦП (прирост, %)**	-0,4	-0,2	0,4	0,6	0,6	0,6	0,8	0,7	0,6
ИЦП промышленных товаров (прирост, %)**	-2,2	-0,3	0,2	0,4	0,3	0,3	0,5	1,1	1,2
ИЦП в добыче полезных ископаемых (прирост, %)**	-1,9	-2,2	1,1	2,4	1,7	2,3	-0,6	2,8	2,3
ИЦП в обрабатывающих производствах (прирост, %)**	-2,9	-1,2	-0,8	-0,2	0,0	-0,7	-0,3	-0,4	0,2
ИЦП в производстве и распределении электроэнергии, газа и воды (прирост, %)**	1,8	2,5	-0,2	0,5	-1,2	0,1	0,1	1,4	1,8
ИЦП в производстве пищевых продуктов (прирост, %)**	-1,6	-1,5	-1,1	-0,8	-0,7	-0,5	-0,6	-0,5	-0,6
ИЦП в текстильном и швейном производстве (прирост, %)**	-1,9	0,2	-0,1	0,5	-0,2	0,5	0,1	0,7	0,8
ИЦП в обработке древесины и производстве изделий из дерева (прирост, %)**	-5,9	-5,1	-4,7	-4,4	-4,1	-3,6	-2,2	-1,3	-0,9

Модельные расчеты краткосрочных прогнозов

	2022						2023		
	Июль	Август	Сентябрь	Октябрь	Ноябрь	Декабрь	Январь	Февраль	Март
ИЦП в целлюлозно-бумажном производстве (прирост, %)**	-4,0	-1,7	-1,2	-0,5	0,6	0,9	2,1	1,1	0,2
ИЦП в производстве кокса и нефтепродуктов (прирост, %)**	-3,5	-0,6	0,8	0,9	-0,8	-3,1	-1,7	0,5	0,4
ИЦП в химическом производстве (прирост, %)**	-7,3	-5,9	-3,7	-1,8	-0,4	-0,7	0,7	0,4	0,5
ИЦП в металлургическом производстве и производстве готовых металлических изделий (прирост, %)**	-8,8	-3,6	1,0	0,0	-2,6	-0,7	0,8	-0,5	-1,7
ИЦП в производстве машин и оборудования (прирост, %)**	0,6	0,4	0,4	0,2	0,4	0,5	1,4	1,0	0,5
ИЦП в производстве транспортных средств и оборудования (прирост, %)**	-0,4	1,4	-0,3	1,7	0,0	0,4	0,9	0,2	1,4
Стоимость минимального набора продуктов питания (на одного человека в месяц), тыс. руб.	5,86	5,64	5,50	5,49	5,52	5,58	5,68	5,72	5,74
Индекс тарифов на грузовые перевозки автомобильным транспортом (прирост, %)**	0,2	0,4	0,5	0,5	0,4	0,4	2,2	0,4	0,4
Индекс тарифов на трубопроводный транспорт (прирост, %)**	42,9	-8,6	-1,4	-5,1	4,7	2,9	-5,1	-3,6	4,4
Сводный индекс транспортных тарифов на грузовые перевозки (прирост, %)**	17,8	0,3	0,3	-4,1	0,3	0,3	0,3	0,2	0,2
Цена на нефть марки Brent (долл./барр.)	110,0	95,6	93,1	96,2	99,0	101,5	100,8	100,3	101,1
Цена на алюминий (тыс. долл./т)	2,45	2,36	2,31	2,28	2,29	2,27	2,26	2,27	2,26
Цена на золото (тыс. долл./унц.)	1,74	1,77	1,78	1,80	1,79	1,80	1,81	1,83	1,84
Цена на медь (тыс. долл./т)	7,91	7,80	7,77	7,83	7,89	7,95	8,00	8,05	8,09
Цена на никель (тыс. долл./т)	23,9	21,4	19,1	17,5	16,9	15,0	13,6	12,4	10,9
Денежная база (трлн руб.)	14,1	14,2	14,3	14,3	14,6	14,5	15,1	14,7	15,0
M2 (трлн руб.)	69,6	70,8	70,9	71,0	71,0	71,4	72,8	72,8	72,9
Международные резервы (млрд долл.)	0,58	0,58	0,57	0,56	0,56	0,56	0,56	0,56	0,56
Обменный курс RUR/USD (руб. за доллар США)	61,31	60,37	57,41	61,53	61,54	61,30	61,58	61,74	61,83
Обменный курс USD/EUR (долл. США за евро)	1,02	1,00	1,03	1,01	1,02	1,02	1,03	1,03	1,03
Реальная заработная плата (прирост, %)*	-1,2	-1,4	-0,5	0,2	0,8	1,3	1,9	2,3	2,8
Численность занятого в экономике населения (млн человек)	72,1	72,6	72,3	72,2	72,2	72,5	71,6	71,8	71,7
Общая численность безработных (млн человек)	2,9	2,9	2,9	3,0	3,0	3,0	3,0	2,9	3,0

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

ПРИЛОЖЕНИЕ 2

Графики временных рядов экономических показателей РФ: фактические и прогнозные значения

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

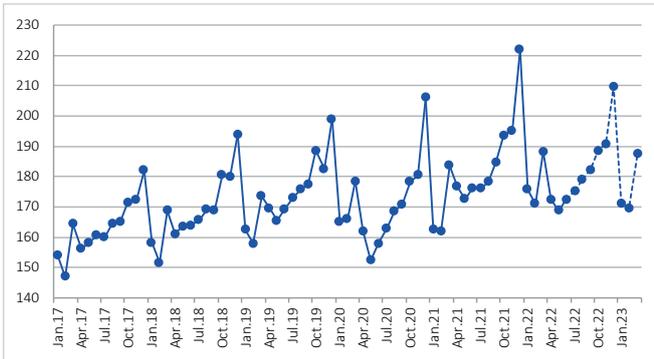


Рис. 1б. Индекс промышленного производства НИУ ВШЭ (ARIMA-модель), % к январю 2010 г.

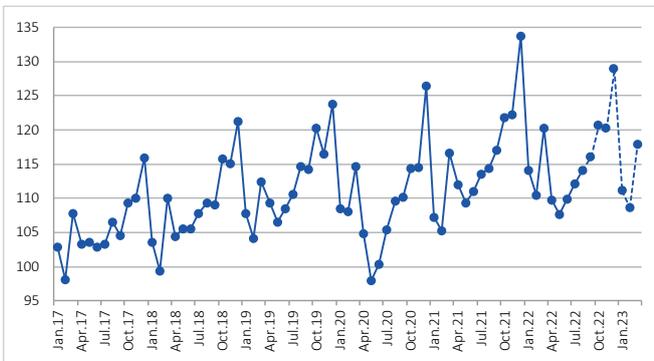


Рис. 2а. ИПП в добыче полезных ископаемых Росстата, % к декабрю 2001 г.

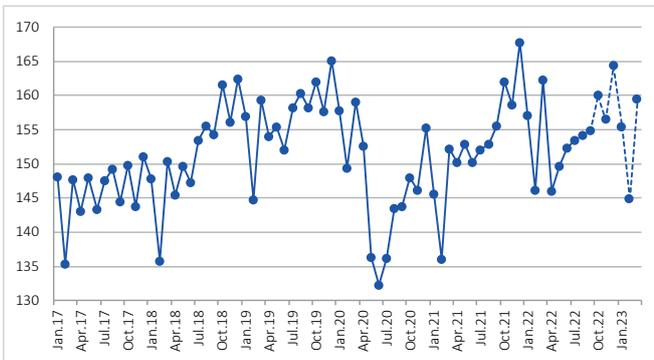


Рис. 2б. ИПП в добыче полезных ископаемых НИУ ВШЭ, % к январю 2010 г.

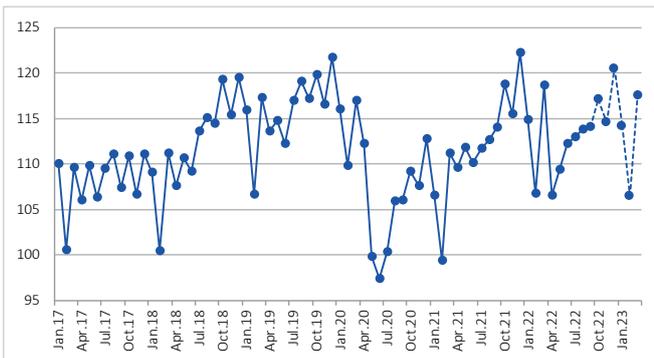


Рис. 3а. ИПП в обрабатывающих производствах Росстата, % к декабрю 2001 г.

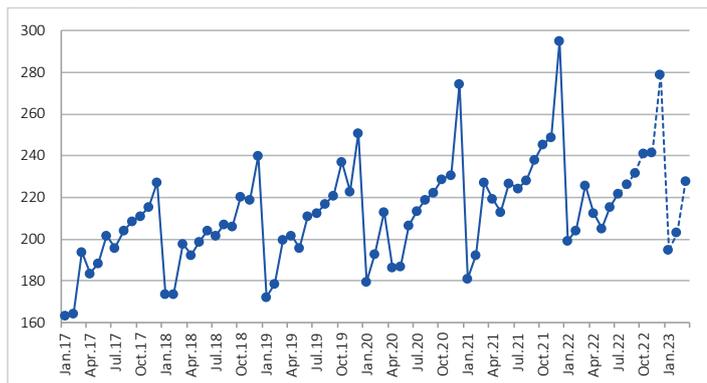


Рис. 3б. ИПП в обрабатывающих производствах НИУ ВШЭ, % к январю 2010 г.

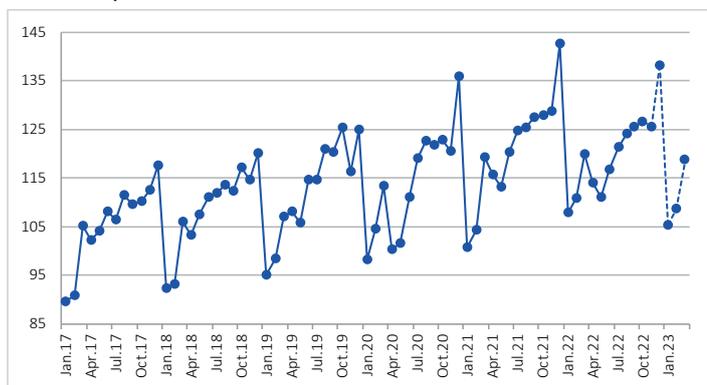


Рис. 4а. ИПП в обеспечении электрической энергией, газом и паром; кондиционировании воздуха Росстата, % к декабрю 2001 г.

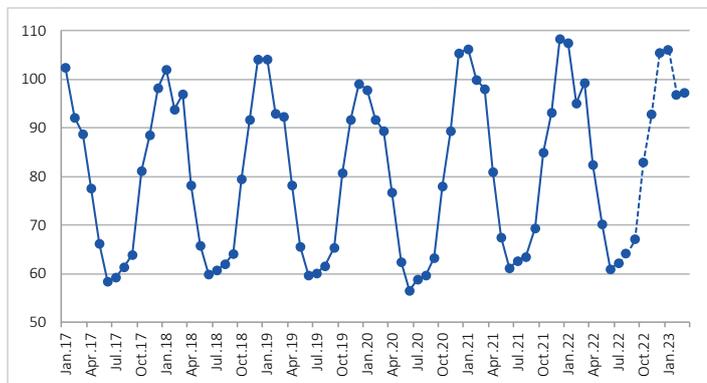


Рис. 4б. ИПП в обеспечении электрической энергией, газом и паром; кондиционировании воздуха НИУ ВШЭ, % к январю 2010 г.

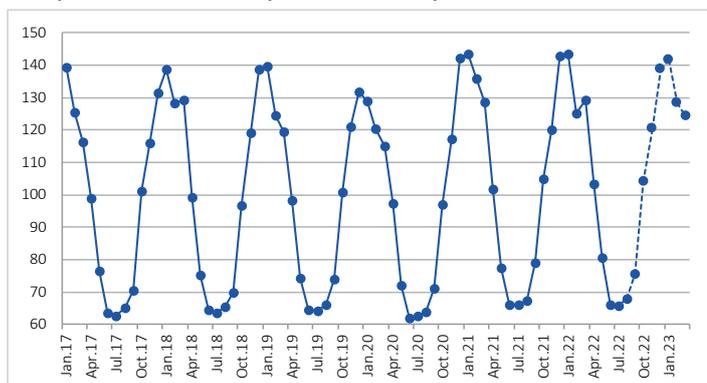


Рис. 5а. ИПП в производстве пищевых продуктов Росстата, % к декабрю 2001 г.

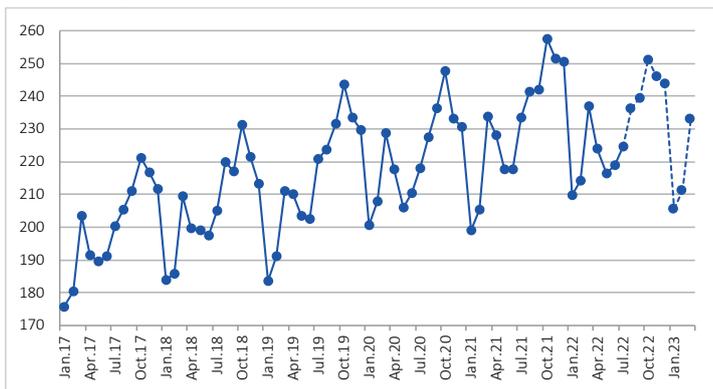


Рис. 5б. ИПП в производстве пищевых продуктов НИУ ВШЭ, % к январю 2010 г.

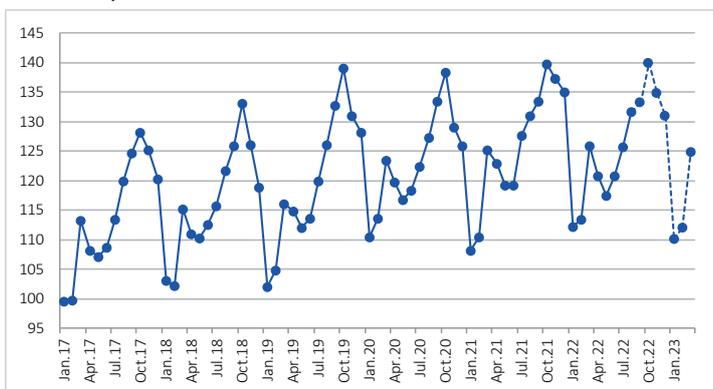


Рис. 6а. ИПП в производстве кокса и нефтепродуктов Росстата, % к декабрю 2001 г.

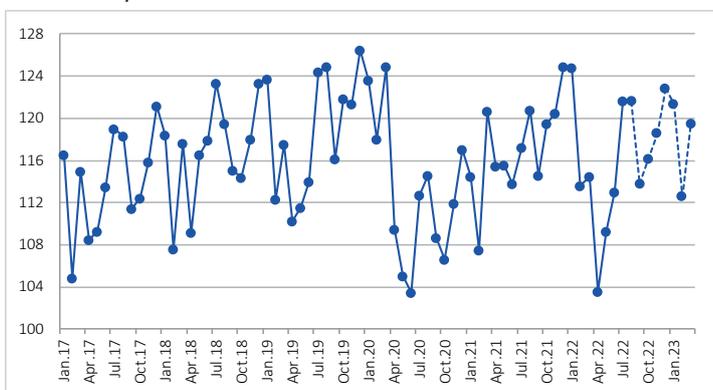


Рис. 6б. ИПП в производстве кокса и нефтепродуктов НИУ ВШЭ, % к январю 2010 г.

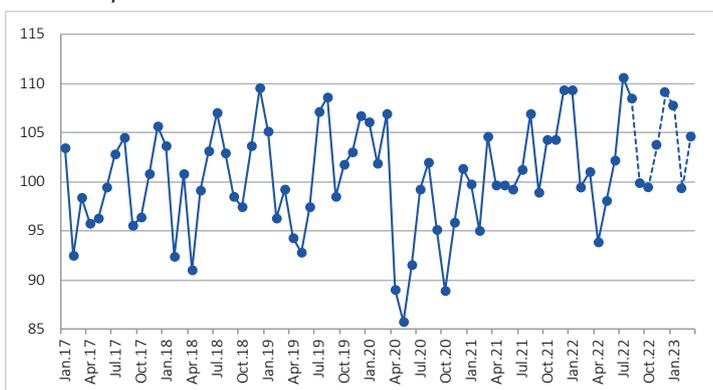


Рис. 7а. ИПП в металлургическом производстве и производстве готовых металлических изделий Росстата, % к декабрю 2001 г.

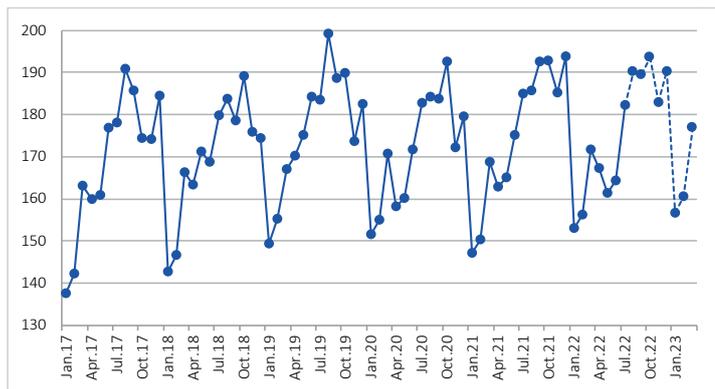


Рис. 7б. ИПП в металлургическом производстве и производстве готовых металлических изделий НИУ ВШЭ, % к январю 2010 г.

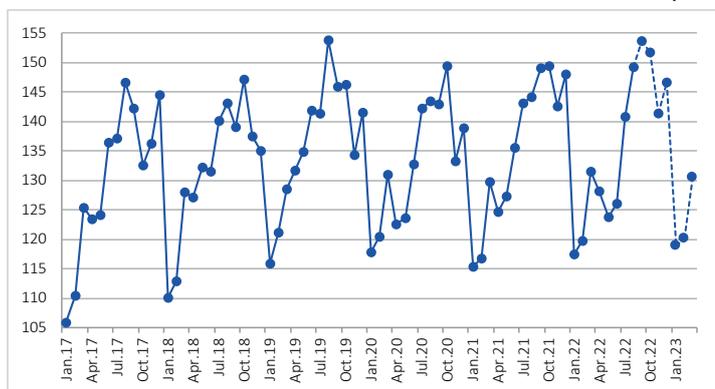


Рис. 8а. ИПП в производстве машин и оборудования Росстата, % к декабрю 2001 г.

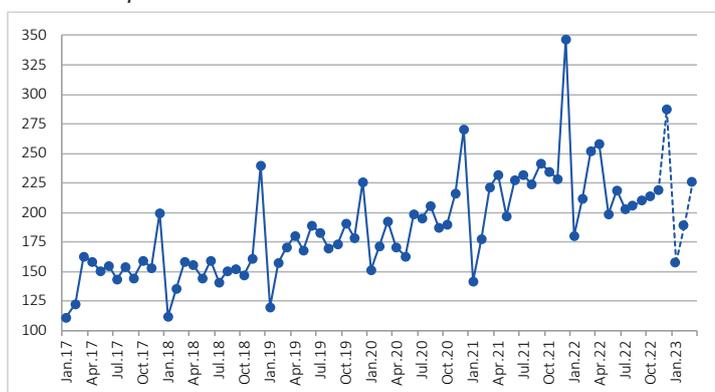


Рис. 8б. ИПП в производстве машин и оборудования НИУ ВШЭ, % к январю 2010 г.

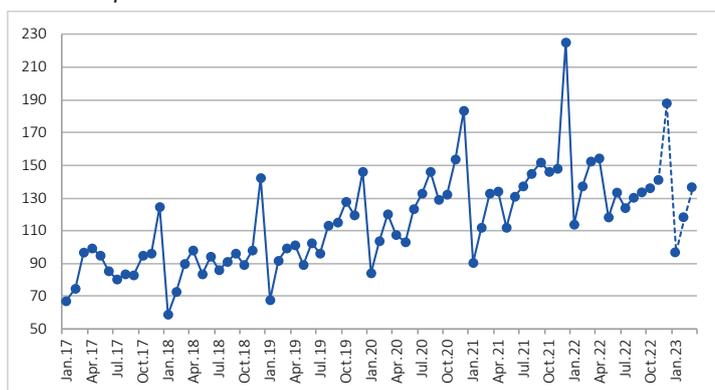


Рис. 9. Оборот розничной торговли, млрд руб.

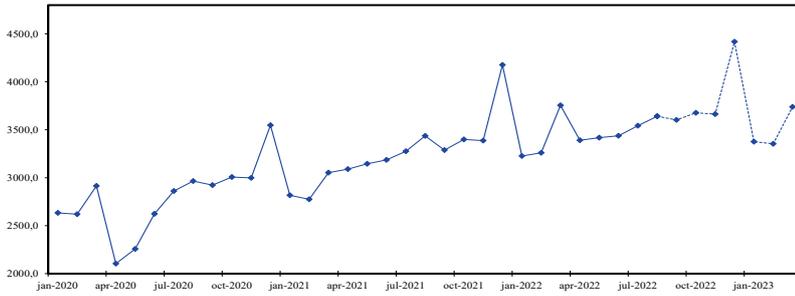


Рис. 9а. Реальный оборот розничной торговли, % к соответствующему периоду прошлого года

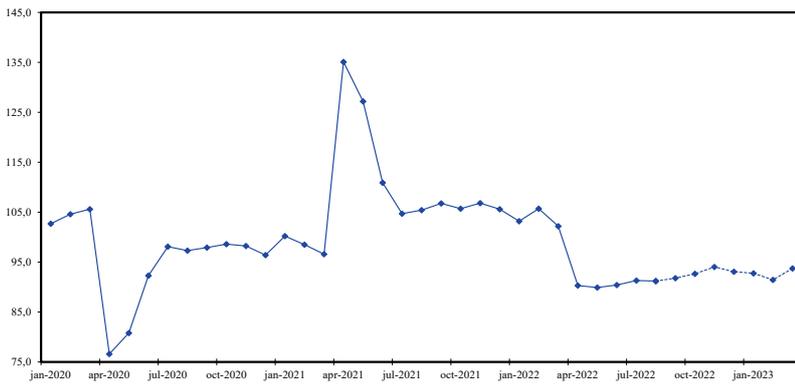


Рис. 10. Экспорт во все страны, млрд долл.

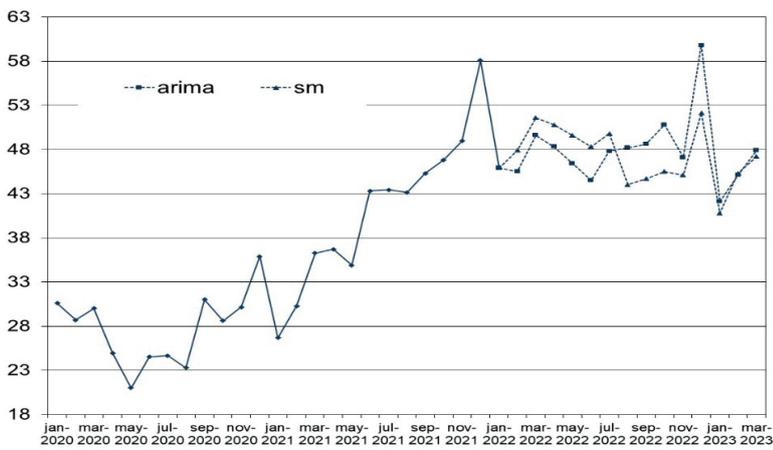


Рис. 11. Экспорт в страны вне СНГ, млрд долл.

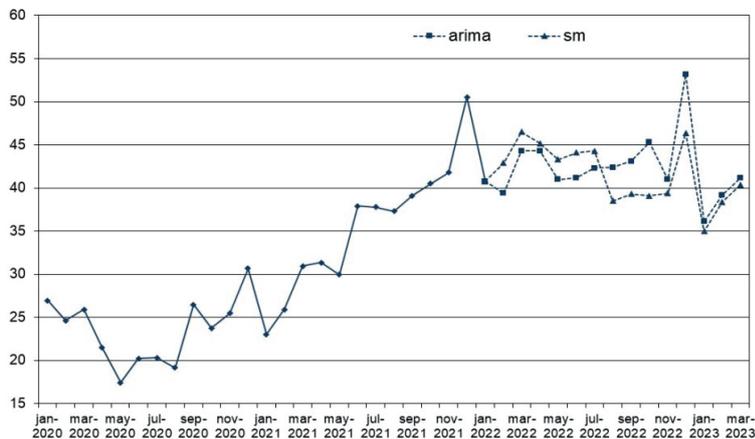


Рис. 12. Импорт из всех стран, млрд долл.

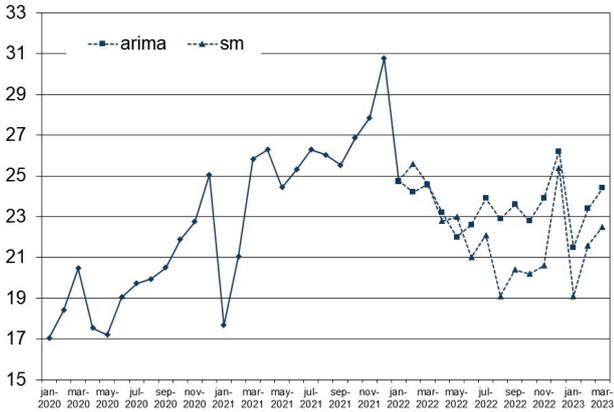


Рис. 13. Импорт из стран вне СНГ, млрд долл.

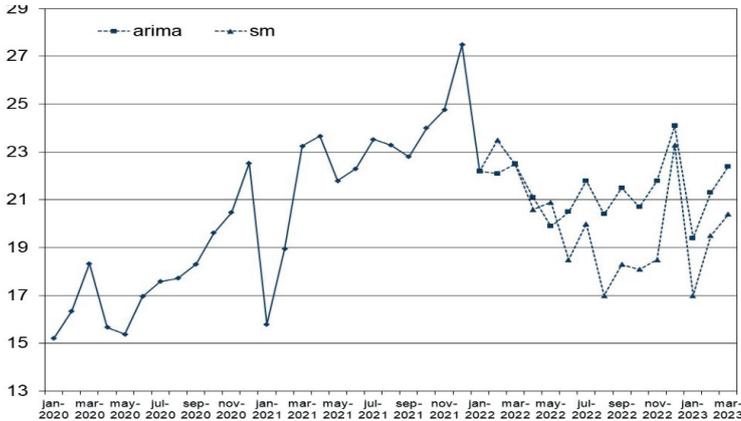


Рис. 14. Индекс потребительских цен, % к декабрю предыдущего года

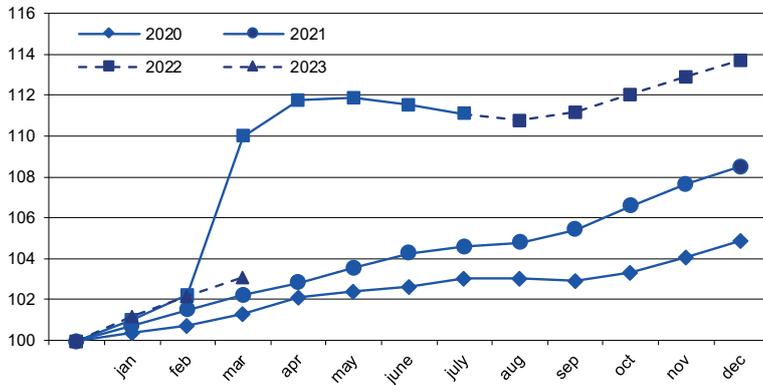


Рис. 14а. Индекс потребительских цен, % к декабрю предыдущего года (SM)

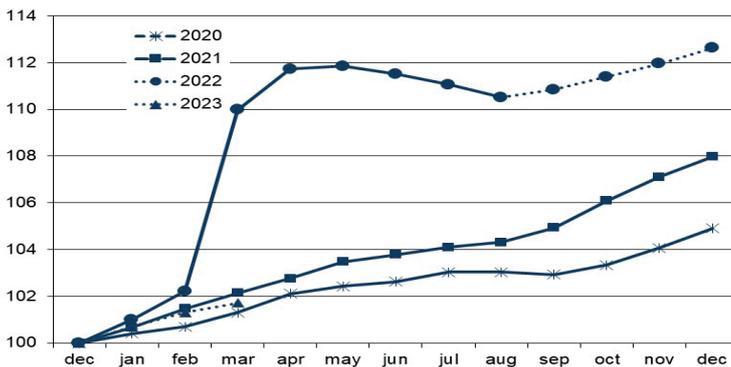


Рис. 15. Индекс цен производителей промышленных товаров, % к декабрю предыдущего года

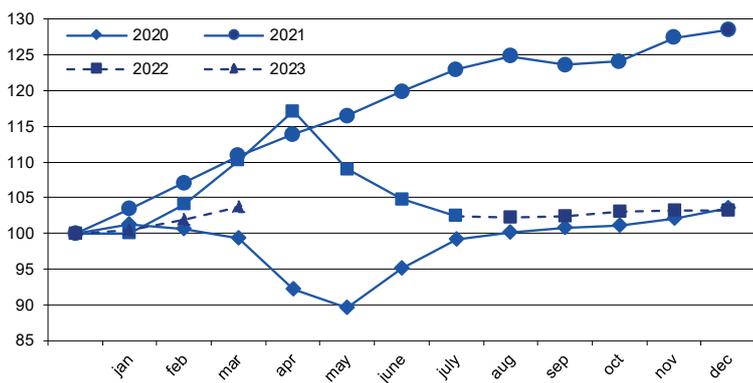


Рис. 16. Индекс цен в добыче полезных ископаемых, % к декабрю предыдущего года

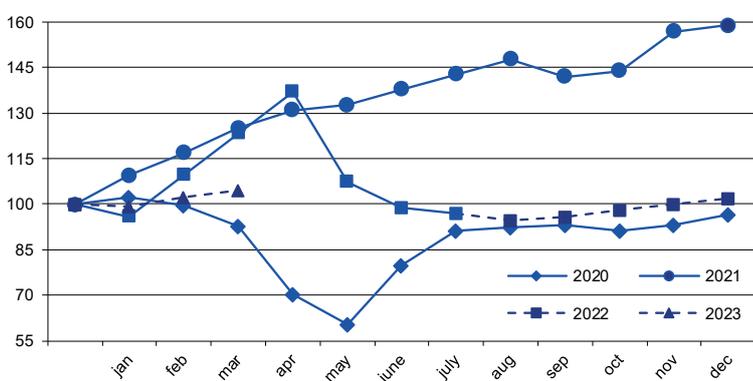


Рис. 17. Индекс цен в обрабатывающих производствах, % к декабрю предыдущего года

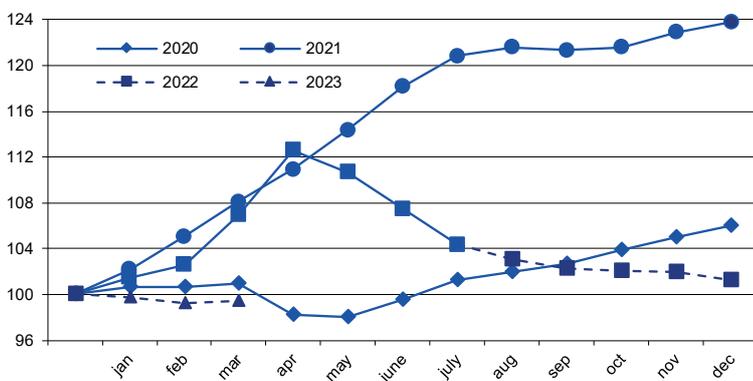


Рис. 18. Индекс цен в обеспечении электрической энергией, газом и паром, % к декабрю предыдущего года

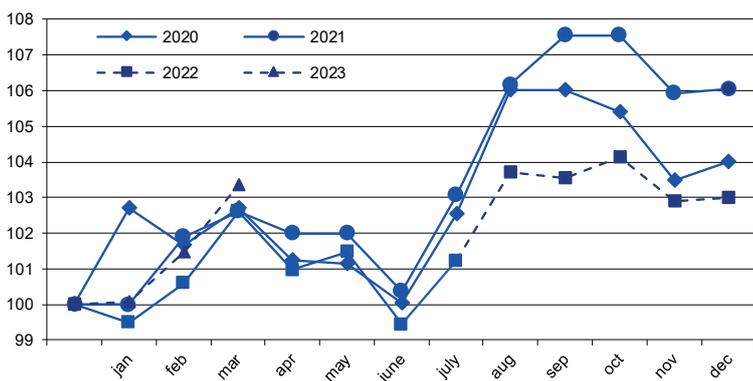


Рис. 19. Индекс цен в производстве пищевых продуктов, % к декабрю предыдущего года

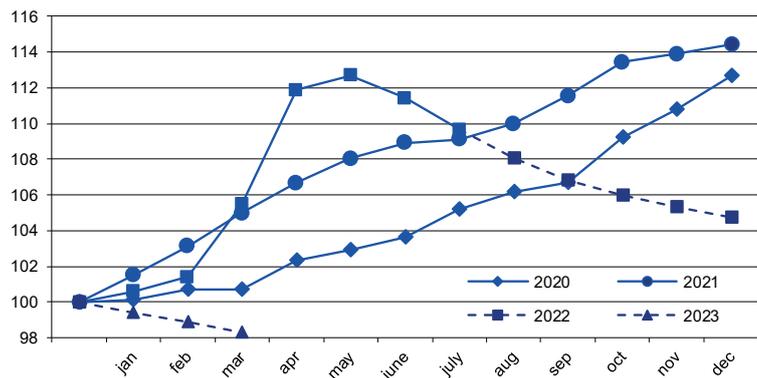


Рис. 20. Индекс цен в производстве текстильных изделий, % к декабрю предыдущего года

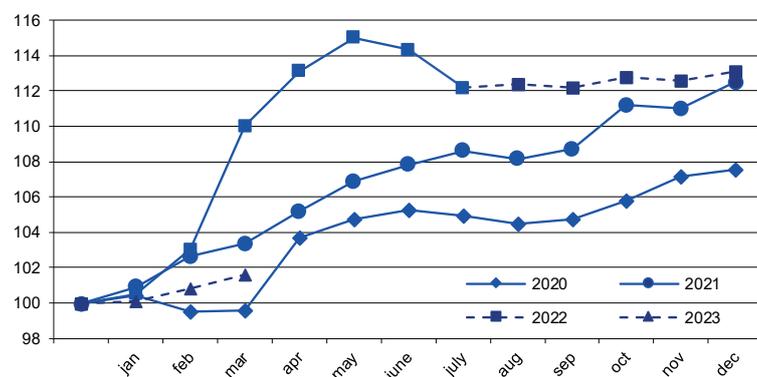


Рис. 21. Индекс цен в обработке древесины и производстве изделий из дерева, % к декабрю предыдущего года

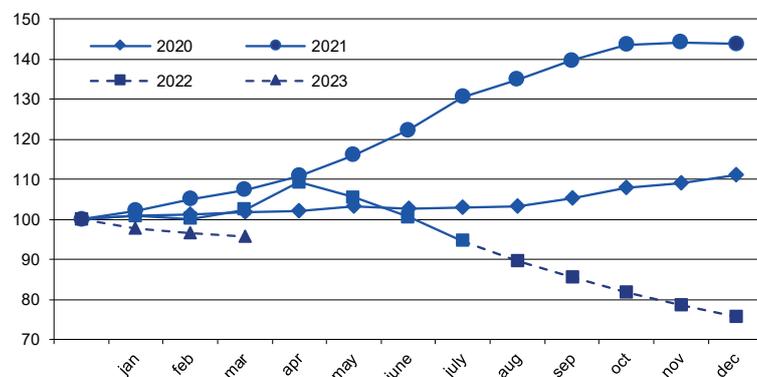


Рис. 22. Индекс цен в производстве бумаги и бумажных изделий, % к декабрю предыдущего года

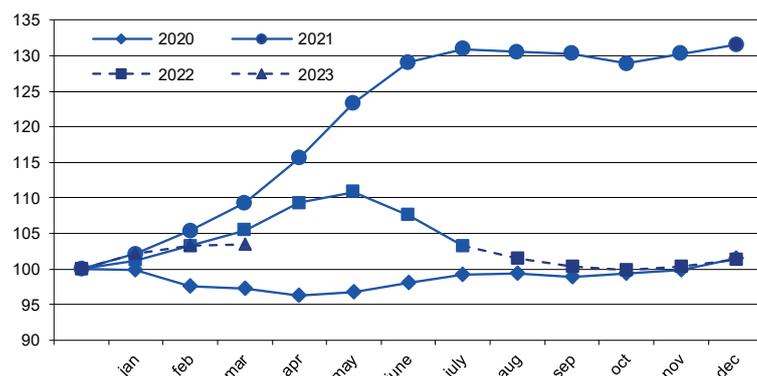


Рис. 23. Индекс цен в производстве кокса и нефтепродуктов, % к декабрю предыдущего года

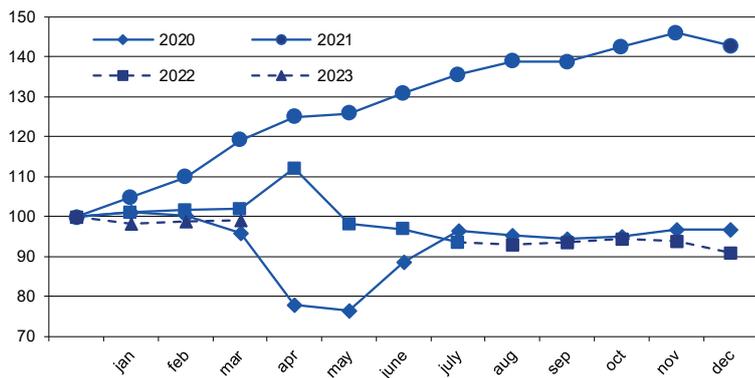


Рис. 24. Индекс цен в химическом производстве, % к декабрю предыдущего года

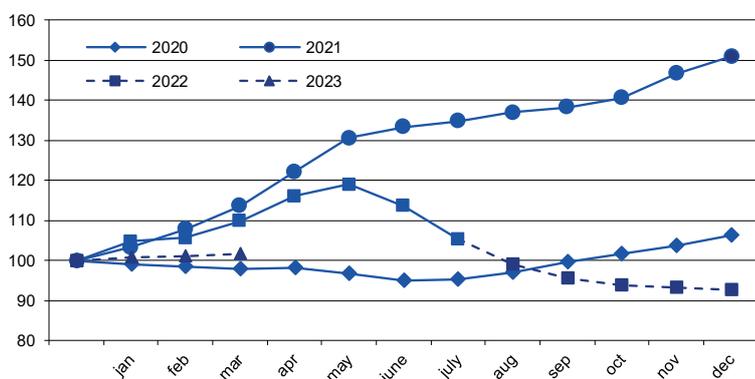


Рис. 25. Индекс цен в металлургическом производстве и производстве готовых металлических изделий, % к декабрю предыдущего года

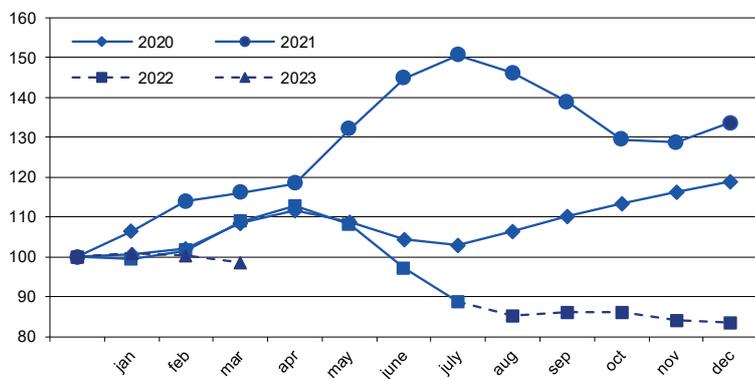


Рис. 26. Индекс цен в производстве машин и оборудования, % к декабрю предыдущего года

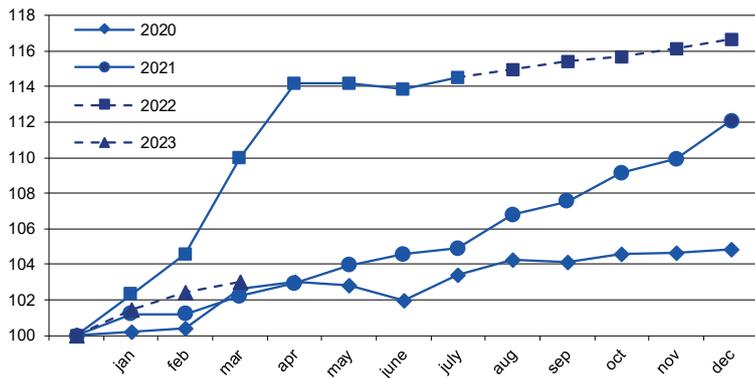


Рис. 27. Индекс цен в производстве автотранспортных средств и оборудования, % к декабрю предыдущего года

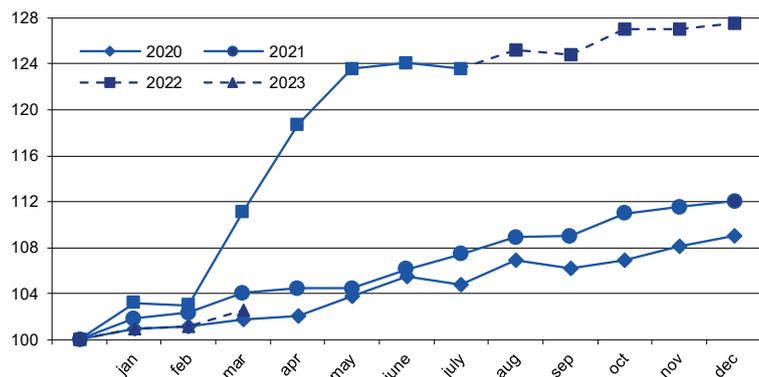


Рис. 28. Стоимость минимального набора продуктов питания на одного человека в месяц, руб.

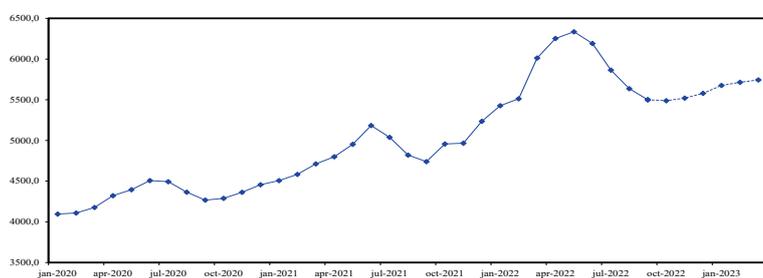


Рис. 29. Сводный индекс транспортных тарифов, для каждого года, % к предыдущему месяцу

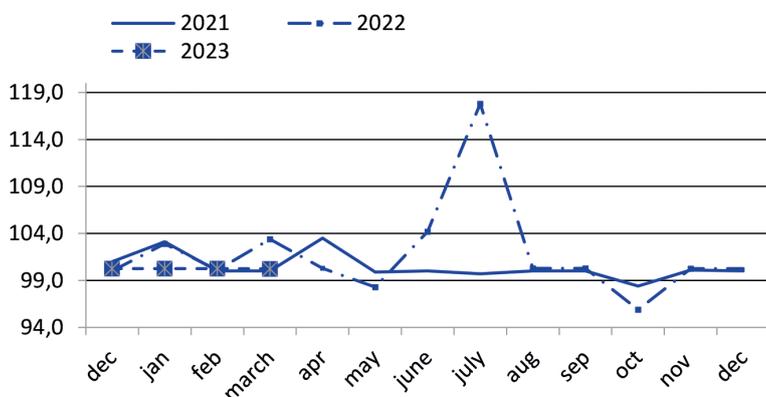


Рис. 30. Индекс тарифов на грузовые перевозки автомобильным транспортом, для каждого года, % к предыдущему месяцу

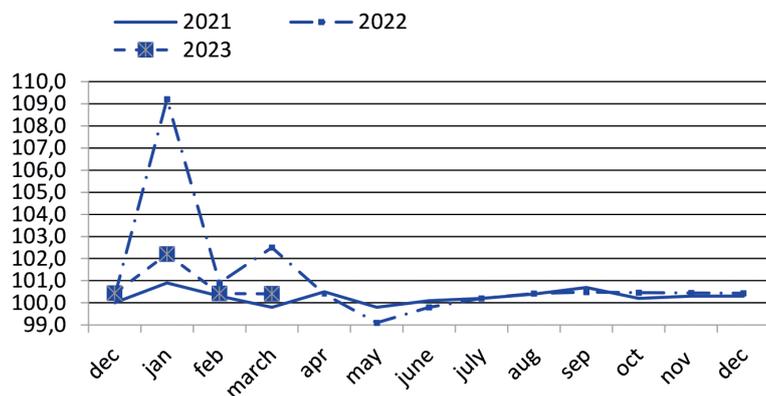


Рис. 31. Индекс тарифов на трубопроводный транспорт, для каждого года, % к предыдущему месяцу

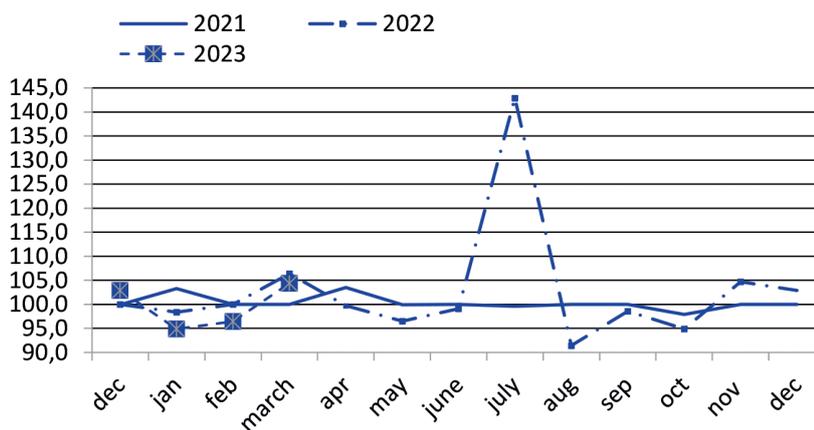


Рис. 32. Цена на нефть марки Brent, долл./барр.

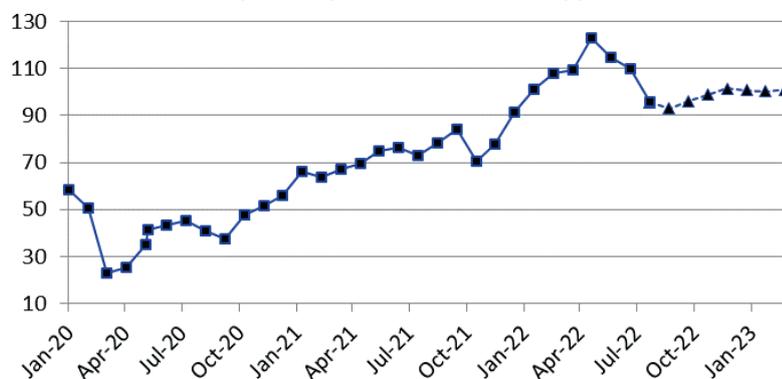


Рис. 33. Цены на алюминий, долл./т

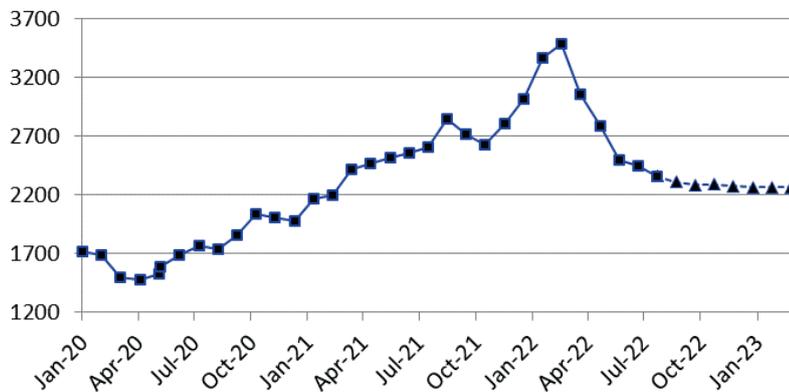


Рис. 34. Цены на золото, долл./унц.



Рис. 35. Цены на никель, долл./т

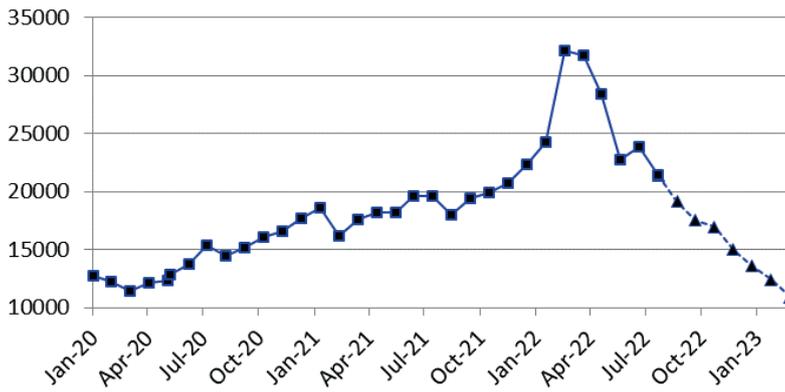


Рис. 36. Цены на медь, долл./т

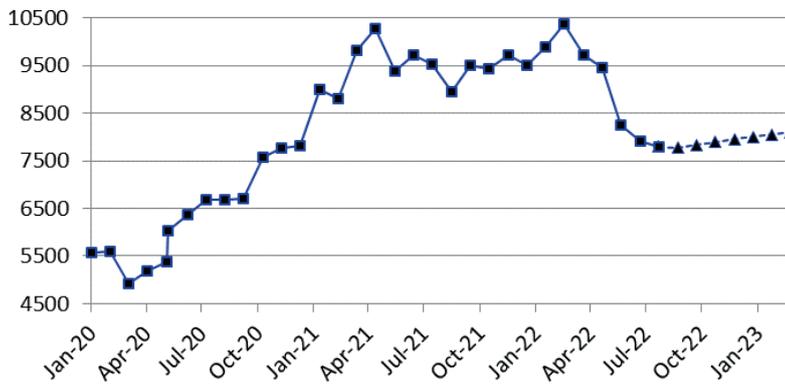


Рис. 37. Денежная база, млрд руб.

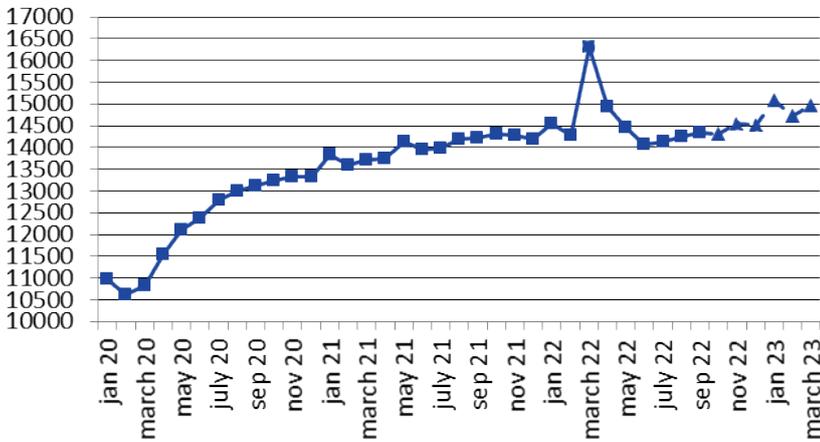


Рис. 38. M_2 млрд руб.

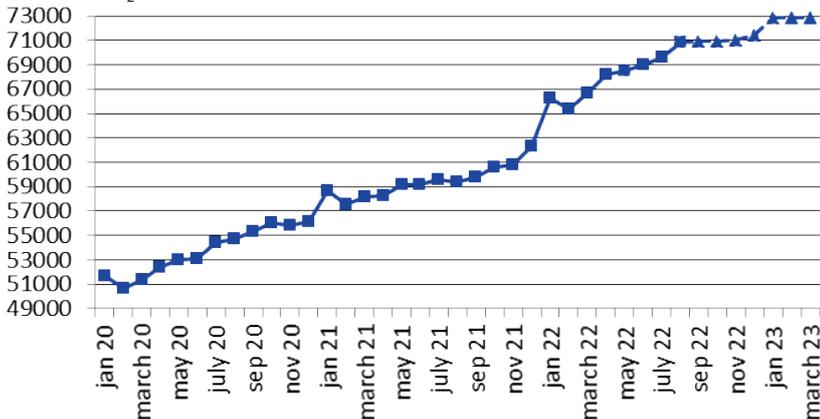


Рис. 39. Международные резервы РФ, млн долл.

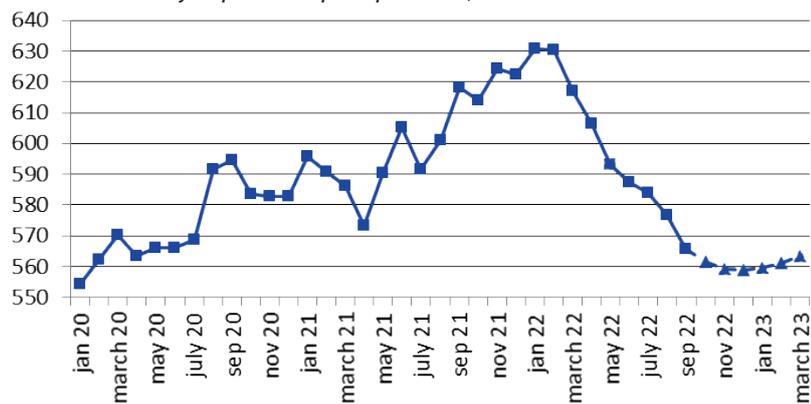


Рис. 40. Курс RUR/USD

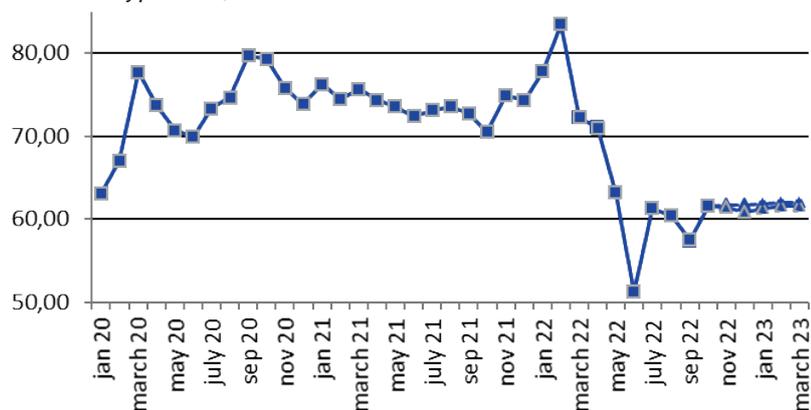


Рис. 41. Курс USD/EUR

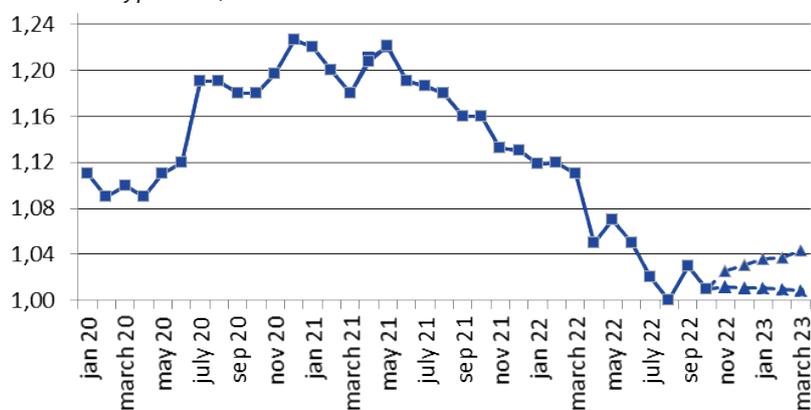


Рис. 42. Реальная начисленная заработная плата, % к соответствующему периоду предыдущего года

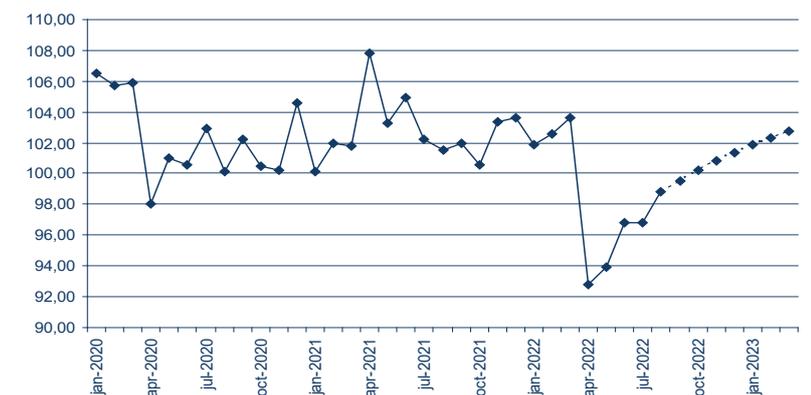


Рис. 43. Реальные располагаемые денежные доходы, % к соответствующему периоду предыдущего года

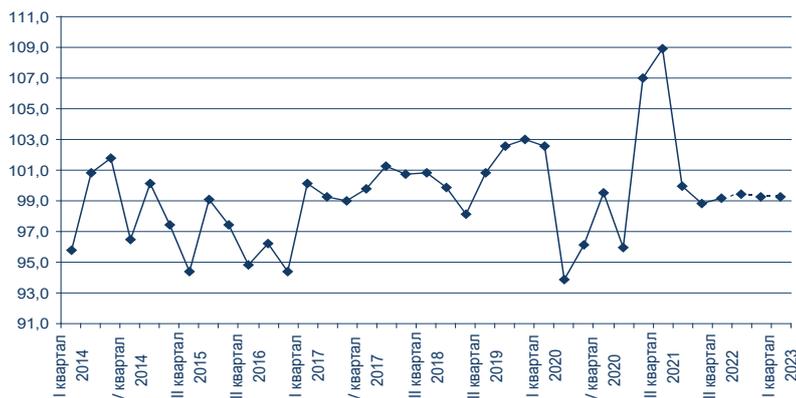


Рис. 44. Реальные денежные доходы, % к соответствующему периоду предыдущего года

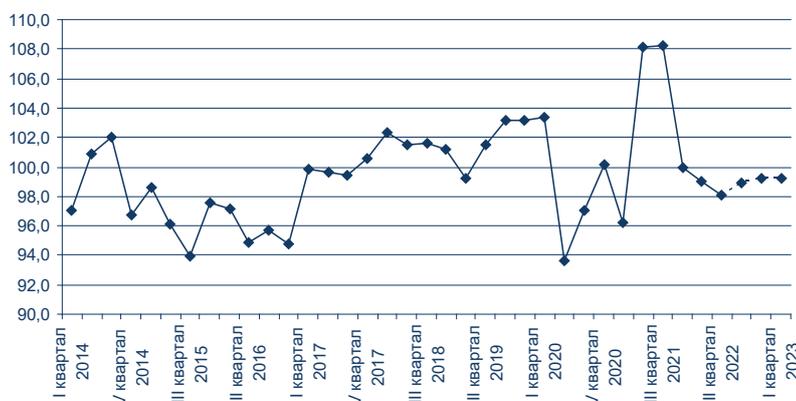


Рис. 45. Численность занятого в экономике населения, млн человек

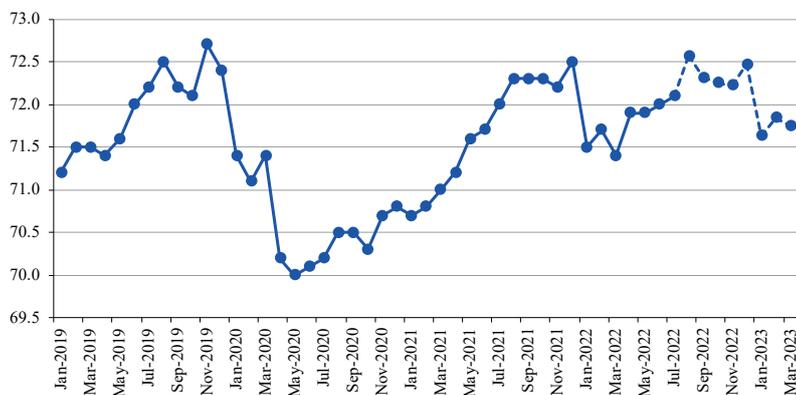
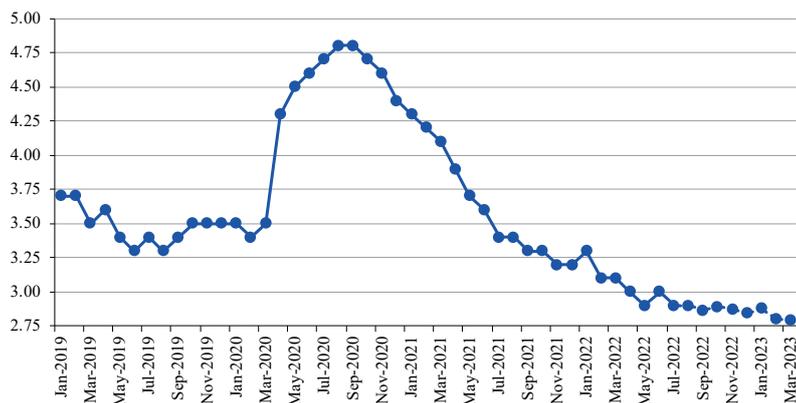


Рис. 46. Общая численность безработных, млн человек



ОЦЕНКА КАЧЕСТВА КРАТКОСРОЧНЫХ ПРОГНОЗОВ ИНДЕКСОВ ПРОМЫШЛЕННОГО ПРОИЗВОДСТВА НИУ ВШЭ (апрель 2009 г. – июль 2022 г.)

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

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

Оценки качества прогнозов данных показателей построены для массива данных, охватывающих период с апреля 2009 г. по август 2022 г. Статистика показателей ИПП НИУ ВШЭ предоставляется с месячным запаздыванием, в результате полугодовые прогнозы представляют собой ожидаемые в соответствии с моделями значения показателей на 2–7 месяцев (а не 1–6 месяцев) вперед. В общей сложности массив прогнозов состоит из 966 точек (161 прогнозируемый месяц, по 6 прогнозов для каждого месяца). В статье также представлены результаты проверки гипотезы об отсутствии значимых различий между прогнозами ИЭП и прочими прогнозами при помощи теста знаков. Результаты анализа представлены в табл. 1.

В рассматриваемом периоде средняя абсолютная процентная ошибка ARIMA-прогнозирования индекса промышленного производства НИУ ВШЭ составляет 2,6%. Прогнозы ИЭП, полученные по моделям временных рядов, превосходят по качественным характеристикам все альтернативные методы построения прогнозов, и применение теста знаков свидетельствует о значимости преимуществ прогнозов ИЭП перед всеми простейшими прогнозами.

Для моделей, оцененных с использованием результатов конъюнктурных опросов (КО-прогнозов), ошибка несколько ниже и составляет 2,3%. На основании теста знаков КО-прогнозы индекса промышленного производства также не уступают по качеству всем простейшим методам, и применение теста знаков свидетельствует о значимости преимуществ прогнозов ИЭП перед всеми простейшими прогнозами. При сравнении КО-прогнозов с ARIMA-прогнозами гипотеза об отсутствии значимых различий отвергается (значение статистики составило -3,09). Таким образом, в рассматриваемом периоде для индекса промышленного производства НИУ ВШЭ лучшие результаты (значимо лучшие) демонстрируют прогнозы, полученные с использованием результатов конъюнктурных опросов.

Оценки, построенные для каждого отдельного месяца, свидетельствуют о том, что в последние полгода рассматриваемого периода средняя абсолютная процентная ошибка ARIMA-прогнозирования ИПП НИУ ВШЭ в 1,2 раза превышает среднее за весь период значение, составляя 3,2%, ошибка КО-прогнозов показателя также растет в сравнении со средним за весь период и достигает 3,8%. Качество альтернативных методов прогнозирования в последние 6 месяцев во всех случаях ухудшается: средняя абсолютная процентная ошибка наивных прогнозов в марте-августе 2022 г. составляет 5,7%, наивных сезонных прогнозов – 8,1%, скользящего среднего – 6,2%. Так что в эти полгода для

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

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

ИПП НИУ ВШЭ лучшими с точки зрения качественных характеристик являются прогнозы, построенные на основе моделей временных рядов.

Таблица 1

Простейшие статистики качества прогнозов и результаты теста знаков

		Индекс промышленного производства (ARIMA)	Индекс промышленного производства (КО)	ИПП в добыче полезных ископаемых	ИПП в обрабатывающих производствах	ИПП в обеспечении электрической энергией, газом и паром	ИПП в производстве пищевых продуктов	ИПП в производстве кокса и нефтепродуктов	ИПП в металлургическом производстве	ИПП в производстве машин и оборудования
Прогнозы ИЭП	MAPE	2,60%	2,32%	2,45%	3,61%	3,35%	2,47%	2,99%	5,42%	11,97%
	MAE	2,61	2,34	2,45	3,69	3,37	2,53	3,01	5,52	12,19
	RMSE	3,72	3,41	3,63	5,39	4,28	3,19	3,83	9,29	15,84
Наивные прогнозы	MAPE	3,36%	3,36%	3,07%	4,27%	4,72%	2,84%	4,18%	5,13%	13,63%
	MAE	3,42	3,42	3,11	4,37	4,76	2,92	4,26	5,25	14,14
	RMSE	5,39	5,39	4,83	6,99	6,28	3,66	5,75	7,77	18,53
	Z	-3,28	-6,89	-5,92	-1,61	-7,14	-3,86	-7,79	0,00	-2,96
		отв	отв	отв	не отв	отв	отв	отв	не отв	отв
Наивные сезонные прогнозы	MAPE	5,39%	5,39%	4,65%	6,70%	6,19%	3,52%	5,57%	8,08%	20,58%
	MAE	5,55	5,55	4,74	6,96	6,24	3,61	5,67	8,31	19,23
	RMSE	8,68	8,68	7,17	11,71	8,19	4,61	7,34	13,50	27,61
	Z	-10,23	-13,45	-11,90	-7,79	-10,62	-8,82	-13,19	-8,11	-5,92
			отв	отв	отв	отв	отв	отв	отв	отв
Скользящее среднее	MAPE	3,96%	3,96%	3,39%	4,96%	4,24%	2,68%	3,90%	5,48%	15,91%
	MAE	4,09	4,09	3,45	5,18	4,29	2,75	3,97	5,66	15,17
	RMSE	6,53	6,53	5,50	8,78	5,69	3,55	5,28	9,36	21,65
	Z	-4,18	-9,14	-3,35	-1,99	-5,41	-2,12	-5,47	-0,90	-0,97
			отв	отв	отв	отв	отв	отв	не отв	не отв

В соответствии с качественными характеристиками прогнозов в рассматриваемом периоде у пяти ИПП НИУ ВШЭ средняя абсолютная процентная ошибка прогнозирования не превышает 5%: это ИПП в добыче полезных ископаемых (2,4%), ИПП в обрабатывающих производствах (3,6%), ИПП в обеспечении электрической энергией, газом и паром (3,4%), ИПП в производстве пищевых продуктов (2,5%) и ИПП в производстве кокса и нефтепродуктов (3%).

Прогнозы данных показателей на основе моделей временных рядов демонстрируют более низкий уровень ошибок в сравнении со всеми простейшими методами прогнозирования. При этом на основании теста знаков ARIMA-прогнозы ИПП в добыче полезных ископаемых, ИПП в обеспечении электрической энергией, газом и паром, ИПП в производстве пищевых продуктов и ИПП в производстве кокса и нефтепродуктов значимо лучше всех прогнозов, построенных альтернативными методами. В случае ИПП в обрабатывающих производствах на основании того же теста прогнозы ИЭП значимо лучше наивных сезонных прогнозов и скользящего среднего.

Вместе с тем прогнозы индексов промышленного производства данных видов экономической деятельности демонстрируют различия в динамике качественных характеристик в последние месяцы рассматриваемого периода (рис. 2) и относительном качестве (в сравнении с простейшими методами прогнозирования).

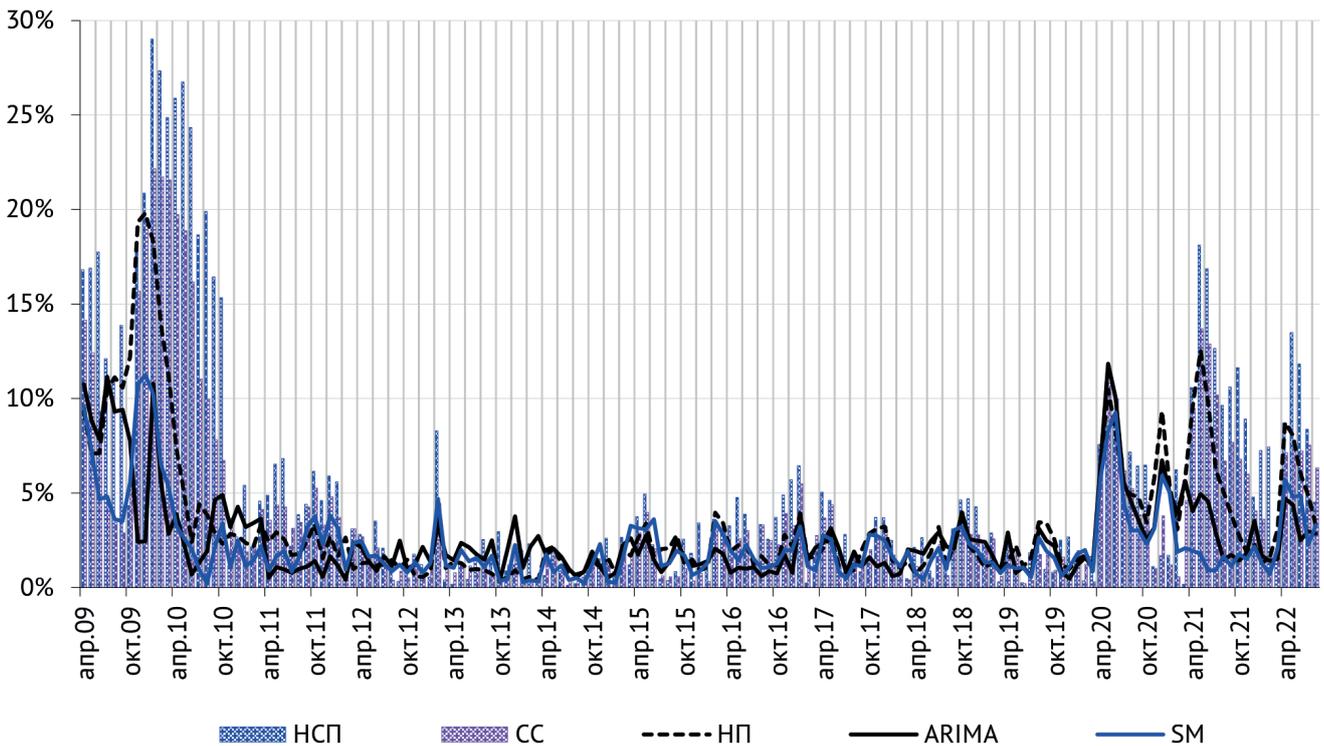


Рис. 1. Средняя абсолютная процентная ошибка прогнозов ИПП НИУ ВШЭ по месяцам

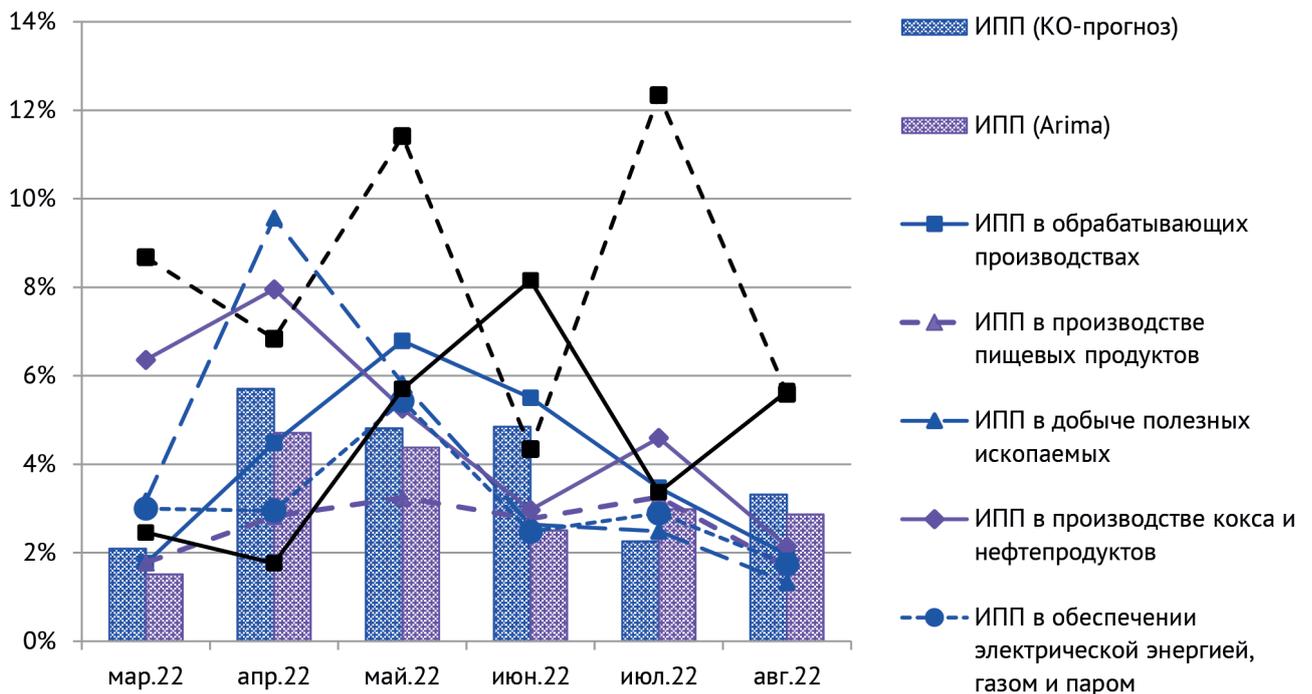


Рис. 2. Средняя абсолютная процентная ошибка прогнозов ИПП НИУ ВШЭ в марте-августе 2022 г.

Среднемесячная абсолютная процентная ошибка ARIMA-прогнозов четырех ИПП данной группы в марте-августе 2022 г. демонстрирует увеличение в сравнении со средним значением за весь рассматриваемый период. Для ИПП в добыче полезных ископаемых ошибка составляет 4,2%, ИПП в обрабатывающих производствах – 4%, ИПП в производстве пищевых продуктов – 2,6%, ИПП в производстве кокса и нефтепродуктов – 4,9%. Но, несмотря на увеличение расхождений между

истинными и прогнозируемыми значениями показателя, прогнозы ИЭП ИПП в добыче полезных ископаемых, ИПП в обрабатывающих производствах, ИПП в производстве кокса и нефтепродуктов, в последние 6 месяцев оказываются качественно предпочтительнее всех альтернативных методов. Для ИПП в производстве пищевых продуктов минимальную среднемесячную абсолютную процентную ошибку, равную 2,3%, демонстрируют прогнозы, построенные на основе скользящего среднего.

Ошибка ARIMA-прогнозов оставшегося в данной группе ИПП в обеспечении электрической энергией, газом и паром в последние полгода, напротив, характеризуется уменьшением в сравнении со средним значением за весь период, составив 3,1%. Для ИПП данного вида экономической деятельности в эти 6 месяцев качество простейших прогнозов в большинстве случаев также улучшается, но прогнозы ИЭП демонстрируют наименьшие расхождения с реальными значениями показателя.

Как и ранее, худшие качественные характеристики прогнозов среди ИПП НИУ ВШЭ демонстрируют показатели в металлургическом производстве и в производстве машин и оборудования. Средние абсолютные процентные ошибки прогнозирования ИПП данных видов экономической деятельности составляют 5,4% и 12% соответственно.

В соответствии с качественными характеристиками и результатами теста знаков ARIMA-прогнозы ИПП в металлургическом производстве превосходят наивные сезонные прогнозы и прогнозы, построенные на основе скользящего среднего, но эти преимущества значимы только в сравнении с наивными сезонными прогнозами. Полученные оценки качества свидетельствуют о том, что для ИПП в металлургическом производстве лучшим методом следует признать наивный прогноз, средняя абсолютная процентная ошибка которого в рассматриваемом периоде составляет 5,1%, хотя тест знаков и не выявил значимости этих преимуществ.

ARIMA-прогнозы ИПП в производстве машин и оборудования превосходят по качественным характеристикам все альтернативные методы построения прогнозов, и применение теста знаков свидетельствует о значимости преимуществ прогнозов ИЭП перед наивными прогнозами и наивными сезонными прогнозами.

В марте-августе 2022 г. среднемесячная абсолютная процентная ошибка ARIMA-прогнозов обоих показателей группы снижается, составляя в среднем 4,5% для ИПП в металлургическом производстве, 8,2% для ИПП в производстве машин и оборудования. Однако в эти полгода для ИПП в металлургическом производстве минимальную среднемесячную абсолютную процентную ошибку, равную 3,5%, демонстрируют прогнозы, построенные на основе скользящего среднего. Для ИПП в производстве машин и оборудования минимальную среднемесячную абсолютную процентную ошибку, равную 6,1%, демонстрируют наивные сезонные прогнозы.

* * *

По результатам проведенного анализа можно говорить о том, что прогнозы ИЭП индексов промышленного производства НИУ ВШЭ в целом демонстрируют довольно высокое качество как сами по себе, так и по сравнению с альтернативными методами прогнозирования: лишь для одного показателя простейшие прогнозы оказываются качественно предпочтительнее. В течение анализируемого периода времени MAPE шести из восьми показателей не превосходит 5%. Лишь один показатель имеет MAPE выше 10%. Однако, в последние полгода рассматриваемого интервала (март-август 2022 г.) качество прогнозов ИЭП пяти из восьми индексов ухудшается.

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

ГЛАВНЫЙ РЕДАКТОР

М.Ю. Турунцева, зав. лабораторией краткосрочного прогнозирования

РЕДАКЦИОННАЯ КОЛЛЕГИЯ

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

Выпускающий редактор – Е.Ю. Лопатина, РИО

Корректор – К.Ю. Мезенцева, РИО