



МЕТОДОЛОГИЧЕСКИЕ АСПЕКТЫ ДОЛГОСРОЧНОГО ЭКОНОМИЧЕСКОГО ПРОГНОЗА

д.-р М.КАЙЗЕР, руководитель проекта

Обучение группы ОПШ, работающей в рамках проекта ТАСИС, направлено на освоение методологии качественного макроэкономического и экономического анализа, а также создание приемлемой макроэконометрической долгосрочной модели для подготовки экономических прогнозов, предоставления рекомендаций по экономической политике.

Различают четыре вида экономических прогнозов:

- *экстраполяции тенденций*: линейные и нелинейные функции прошлых изменений определяются и формулируются в математических моделях и используются для прогнозирования будущих тенденций, из которых можно получить варианты выбора политики. С точки зрения политики, эти прогнозы имеют смысл, если можно предположить стабильные тенденции, что трудно проверить, так как мы располагаем только короткими временными рядами;

- *регрессионные методологии*: включают в себя две или более изменяющихся переменных (например, налоговые поступления и ВВП или обменные курсы и международная торговля), которые взаимосвязаны математическими уравнениями. Одна переменная является некаузальной или эндогенной, а другая (другие) переменная (переменные) - каузальными или экзогенными. Влияние экзогенных переменных на эндогенные может определяться и оцениваться с помощью регрессионного анализа и полученные данные могут использоваться для последующих тенденций экономической политики;

- *перекрестные анализы*: выводы делаются из анализа двух разных исследований при сходных обстоятельствах (например, предполагается, что производительность труда в одной сфере может быть в той же мере достигнута в другой сфере). Данная методология широко распространена и

популярна; она используется для осуществления междунa-родных сравнений в целях определения дефицита, целей и задач.

- *системные анализы*: предпринимаются попытки определения связей между различными экономическими показателями в виде системы расчетов. Это делается в форме матрицы – подобно национальным счетам – или даже в более сложных формах, но при этом менее строго.

Все эти методы показывают, что эконометрические модели, прогнозы и моделирование в большинстве случаев основываются на более или менее хороших базах данных. Помимо этого следует иметь в виду, что информация по экономике, наборам данных и классификациям (например, по секторам и регионам) часто оказывается неполной: уч-реждения, занимающиеся планированием, страдают от недостатка и отсутствия информации и, конечно, стратегические решения и нестабильные тренды, характерные для трансформационных процессов, не могут быть спрогнозированы. Поэтому следует обращать большое внимание на требования к данным по экономическим процессам.

Модель, используемая в Кыргызской Республике, должна не только соответствовать обычным эконометрическим стандартам, она должна также учитывать стратегические цели и направления экономической политики республики. Таким образом, метод моделирования для Кыргызской Республики должен принимать во внимание следующие предпосылки и требования:

- период новой истории (со времени обретения независимости в 1991 г.) очень короток, поэтому основные временные ряды состоят из четырех-шести лет, в то время как горизонт прогнозирования для долгосрочных моделей должен быть от 7 до 20 лет;

- модели, которые использовались для планирования экономики, не учитывают новые изменения в экономике и обществе и, следовательно, являются устаревшими;
- следует создавать новые наборы данных; статистические данные страдают от разного рода неполноты и непоследовательности;
- модель должна полностью отражать особенности экономики Кыргызстана;
- основными направлениями модели должны быть ВВП, тенденции секторального роста и/или переменные экономического роста;
- модель должна давать возможность пользователю анализировать и моделировать важные варианты стратегических направлений национальной экономической политики, воздействие внешних шоков (например, российский кризис и кризис, имевший место в Юго-Восточной Азии), а также влияние новых стратегий и/или вариантов выбора политики;
- в случае необходимости, в модель следует ввести социальный сектор (распределение национального дохода, стратегии преодоления бедности, системы социальной защиты);
- модель должна быть жизнеспособной: основываться на коротких временных рядах и не очень надежных данных;
- моделирование должно начинаться с индивидуальных секторальных модулей (например, международной торговли), которые будут поэтапно вводиться в общую (зонтичную) модель.

Каждый экономический прогноз или эконометрическая модель имеют три характерные черты, взаимоотношения между которыми определяют их информационное пространство, обоснованность и надежность; прогнозируемый период или горизонт прогнозирования; степень специализации или разукрупнения и степень вероятности, базирующаяся на анализе осуществимости. Чем

отдаленнее прогнозируемое будущее и/или значительнее разукрупнение, тем ниже вероятность надежности и обоснованности. И, наоборот, если необходим более вероятный или реалистичный экономический прогноз, легче описать ближайшее будущее, но здесь следует принимать во внимание более значительную ограниченность такого прогноза. Эти формальные и логические связи обозначают пределы, представляющие важность для использования экономического прогноза и эконометрических моделей.

Разработка аналитических рамок для предоставления рекомендаций по экономической политике.

Количественные аналитические рамки являются инструментом, позволяющим абстрактно и упрощенно представлять макроэкономические результаты, преобладающие в рыночной экономике, и ограничения, связанные с этими результатами. Взаимозависимость основных экономических переменных может быть представлена посредством ограниченного количества базовых уравнений и тождеств. Такой инструмент дает возможность готовить сценарии экономической политики и оценивать глобальное влияние альтернатив политики. Необходимо обеспечить группу ОПП аналитическим инструментом, который можно оперативно использовать для моделирования политики.

Данная модель должна быть способной оценивать результаты, готовить прогнозы, сценарии и отвечать на вопросы, касающиеся, например, влияния внешних шоков (экономический подъем Китайской Народной Республики, кризис американского доллара, нефтяные кризисы) на ВВП и/или экономический рост, влияния альтернативных внешнеторговых стратегий (использование предписания ВТО или возврат к блоку СНГ), экономических и социальных эффектов альтернативных сценариев, имеющих отношение к населению и миграции, влияния различных стратегий индустриализации на

благополучие, социальные изменения и государственный бюджет, долгосрочного экономического и социального воздействия различных стратегий, связанных с государственным бюджетом, а также жизнеспособности различных изменений и инвестиционных стратегий.

Все упомянутые выше требования и обозначенные прогнозные методы используются рабочей группой в рамках макроэкономической модели типа HERMIN.

Модели типа HERMIN были разработаны для периферийных европейских стран и применялись в Португалии, Ирландии, Греции и Испании (Bradley, Modesto, Sosvilla-Rivero, 1995 г.).

Хотя модели для отдельных стран отличаются друг от друга, они основываются на общей философии:

- приемлемы для периферийных государств;
- относительно небольшие и легко управляемые;
- подходят для небольших, открытых миру и бедных государств;
- имеют возможность анализировать и моделировать результаты стратегических направлений и внешних шоков.

Секторальное разукрупнение, применительно к модели, должно быть сконцентрировано на международной торговле (сектор, ориентированный на внешний рынок, сектор, не имеющий отношения к торговле (включая услуги, транспорт, самостоятельную занятость, малые и средние предприятия (МСП), малые фермерские хозяйства) и домашних хозяйствах. Сельскохозяйственный сектор и сектор переработки пищевых продуктов играют возрастающую роль в Кыргызской Республике и должны быть охвачены сами по себе. И последнее, но не менее важное – государственный сектор необходимо рассматривать как отдельный, самостоятельный элемент модели.

Каждая макроэкономическая модель (не только предназначенная для Кыргызстана) сталкивается с опасностью того, что после значительных вложений может утратить соответствие общим и необходимым эконометрическим стандартам. Этому могут быть две причины: модель не отражает реалий страны из-за неподходящей конструкции или ошибок в уравнениях или имеет место недостаток необходимой информации.

Что касается использования метода HERMIN в условиях Кыргызстана, риск неудачи не настолько значителен, так как данный метод был проверен в реальных условиях и успешно использовался в ряде стран. Ограниченность данных является намного более серьезной проблемой и подвергает опасности макроэконометрическую модель.

Нельзя гарантировать, что неполные модели или подмодели смогут быть подогнаны друг к другу и объединены или интегрированы на более поздних этапах в полноценную и эконометрически достаточную макро-модель. В целях избежания несоответствий между отдельными подмоделями и макро-моделью следует спроектировать структуру макро-модели, а подмодели должны вписаться в нее.

В качестве положительного момента можно отметить, что если макро-модель в целом не срабатывает, могут задействоваться подмодели и есть вероятность получения важной для сектора информации и результатов. Помимо этого модель должна постоянно обновляться, интегрируя внутренние и внешние изменения.

Деятельность проекта ТАСИС сопровождается подготовкой квалифицированного персонала, способного заниматься макроэкономическим анализом и долгосрочным прогнозированием с помощью эконометрической модели, которая в настоящее время отрабатывается для условий Кыргызстана.

Перевод В.Тюменцева