

Д.С. МИХАЙЛОВСКАЯ
Новосибирский национальный исследовательский
государственный университет, Новосибирск

АНАЛИЗ РЕЗУЛЬТАТОВ ПОСТРОЕНИЯ СЦЕНАРНОГО ПРОГНОЗА РОССИЙСКОЙ ЭКОНОМИКИ

В статье представлены результаты исследования по сценарному прогнозированию российской экономики, проведенного в 2014—2016 гг. с использованием экспертно-статистического байесовского метода. Проанализирована динамика прогнозных оценок и дана интерпретация причин выявленных изменений.

Ключевые слова: сценарное прогнозирование, сценарий, неопределенность, экспертные оценки, экспертно-статистический байесовский метод.

ANALYSIS OF THE RESULTS OF THE RUSSIAN ECONOMY SCENARIO FORECASTING

This article presents the results of the scenario forecasts of the Russian economy, which were made in 2014-2016, with the use of expert-statistical Bayesian method. The dynamics of the predictive estimates is analyzed and the interpretation to the causes of the observed changes given.

Key words: scenario forecasting, scenario, uncertainty, expert estimation, expert-statistical Bayesian method.

Метод сценарного прогнозирования на основе экспертно-статистического байесовского подхода изначально был использован для анализа развития политической ситуации в России, однако, как указывают его авторы, он применим и для долгосрочного экономического прогнозирования [1].

Прогнозная модель состоит из следующих элементов: сценарии (возможные варианты долгосрочного развития), проблемы (факторы, определяющие развитие), которые могут разрешиться несколькими способами (событиями), априорные вероятности (оцененные экспертами по 100-бальной шкале шансы событий) и апостериорные вероятности (также оцененные шансы событий, которые могут произойти при условии, что реализуется какой-либо определенный сценарий). Полученные оценки агрегируются, а затем используются в качестве исходных данных в математической модели построения

прогноза, основанной на байесовской вероятности. В результате получаем оценки вероятностей реализации базовых сценариев¹.

На всех этапах исследования трудную роль экспертов взяли на себя известные ученые, ряд ведущих сотрудников Института экономики и организации промышленного производства СО РАН, НГУ и НГТУ.

Работы по долгосрочному прогнозированию (с ориентировочным горизонтом 2030 г.) развития экономики России начались в 2014 г. Тогда была построена первая модель, которая включала в себя три сценария и 11 проблем, характеризующаяся пятью исходами (событиями) каждая [2].

В 2015 г. она была расширена до пяти сценариев. Одним из вариантов исхода в 2014 г. («На пути в ОЭСР») было развитие, основанное на европейских ценностях и тесном сотрудничестве с Западом, но, в результате начала так называемой «войны санкций», в прогнозную модель добавились варианты «Лицом к Востоку», ориентированный на сближение с Востоком и использование опыта восточных стран, а также «Свой путь», при котором основной движущей силой роста выступают сильные стороны русского народа и сильном государстве. Список сценариев и их краткое описание представлены работах [2 и 3].

Более того, количество проблем, увеличилось до 18. Были разведены понятия внешней и внутренней экономической политики, введена новая проблема о последствиях ведения «санкционной войны» и исполнения антикризисного плана, рассмотрено влияния неравномерности регионального развития. Такие дополнения были сделаны в связи с быстро меняющейся ситуацией на мировой политической арене и энергетических рынках, а также для создания более полной картины экономической системы России.

Однако увеличение количества проблем повлекло за собой и некоторые сложности в статистическом анализе полученной информации. Одной из математических предпосылок модели является независимость проблем, которую труднее соблюсти при большом количестве факторов ввиду тесной взаимосвязи между экономическими переменными.

¹ Более подробное описание принятого метода и его сравнительный анализ с другими экспертными методами приводится в статье Д.А. Трочинской «Особенности и возможности метода сценарного прогнозирования российской экономики на основе экспертно-статистического байесовского подхода» в данном сборнике.

В модели 2016 г. первая компонента — сценарии — остается почти неизменной (произошла некоторая смена интерпретаций), но принципиально новым становится набор проблем, которых теперь выделяется 13. Внимание акцентируется на преодолении экономического кризиса. Эта «макро-проблема» рассматривается с различных сторон: усвоения уроков кризиса 2008—2009 гг., финансовой стабилизации, антикризисной поддержки регионов и проч.

Необходимо отметить, что построение прогноза в 2016 г. еще не окончено, и представленные в работе результаты являются предварительными

Теперь обратимся к результатам, полученным за три этапа прогнозирования (рис. 1).

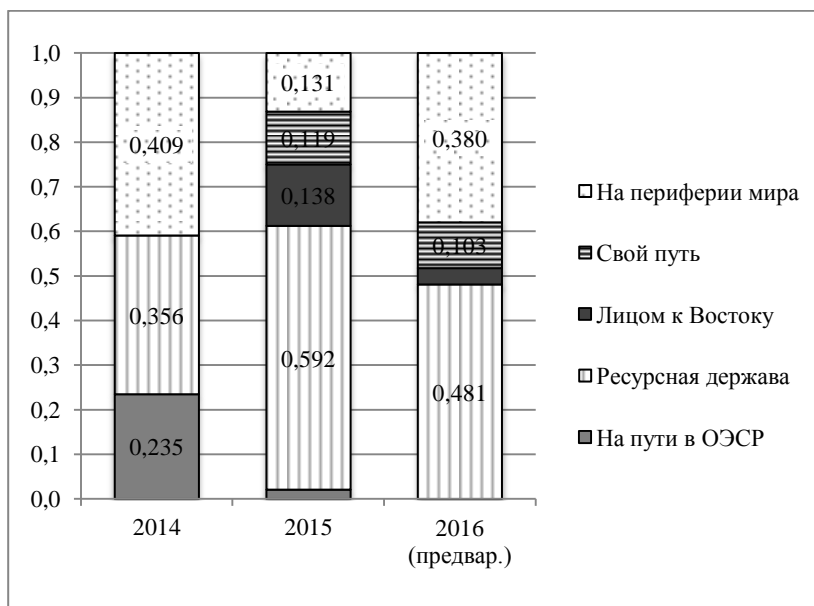


Рис. 1. Динамика прогнозов (оценок вероятностей реализации прогнозных сценариев) за 2014—2016 гг. в долях

В 2014 г. опрошенные эксперты достаточно высоко оценивали риски оказаться на периферии мира, но все сценарии имели значимую вероятность.

В 2015 г. мы видим изменяющуюся вариативность прогноза. Несмотря на значительную долю сценария «Ресурсная держава»,

примерно по 12 и 14% соответственно составляют «Свой путь» и «Лицом к Востоку». Это говорит об ожидании последовательного развития за счет ресурсов нефтегазового сектора, с использованием опыта восточных соседей и собственных преимуществ, тем не менее, риск оказаться на периферии все же присутствует.

Однако по результатам этого года невооруженным взглядом видно, что среди опрашиваемых усиливаются пессимистичные настроения. Сценарий «На периферии мира», в 2016 г. становится почти в три раза вероятнее, нежели по прогнозу 2015 г.

Снижаются шансы сценариев, при которых экономика будет развиваться, основываясь на опыте «заграницы» — будь то Запад или Восток. Интересно отметить, что в 2014 г. эксперты допускали вариант развития по примеру Запада, в 2015 г. шансы такого исхода составили всего 2%, а по итогам 2016 вообще оказались практически нулевыми.

Несмотря на рост пессимизма, возможность разумно использовать собственный потенциал и пойти «своим путем» все-таки имеет место быть (10% в 2016) г., хотя и немного снижается в сравнении с прошлым годом.

По мнению экспертов, основным локомотивом развития экономики России по-прежнему останется нефтегазовый сектор. Причем уверенность в этом возросла, т.к. общая доля «периферии» и «ресурсной державы» повысилась с 72,3 в прошлом году до 86,1% в текущем.

Проследить тенденцию к нарастанию пессимизма можно и в индивидуальных прогнозах. На диаграмме представлены полученные оценки вероятностей реализации сценариев по мнению одного из экспертов, который участвовал в работе на всех тех этапах (рис. 2). Вероятность оказаться «не у дел» с каждым годомкратно растет (в 2015 г. — в 3,2; в 2016 г. — в 1,7 раз).

Другим индикатором нарастания пессимизма является отсутствие вариативности в результатах последнего прогноза. Как мы видим, в отличие от 2015 г., где, хоть и в небольших долях, присутствовали все сценарии, предполагающие изменение акцентов в экономической политике, в прогнозе 2016 г. идет «соствязание» между двумя сценариями — «Ресурсная держава» и «На периферии мира».

Рассмотрим более подробно предварительные результаты последнего исследования по оценкам, полученным от 6-ти экспертов (рис. 3).

Информация, представленная на диаграмме, позволяет разделить экспертов согласно их «настроениям» на три группы.

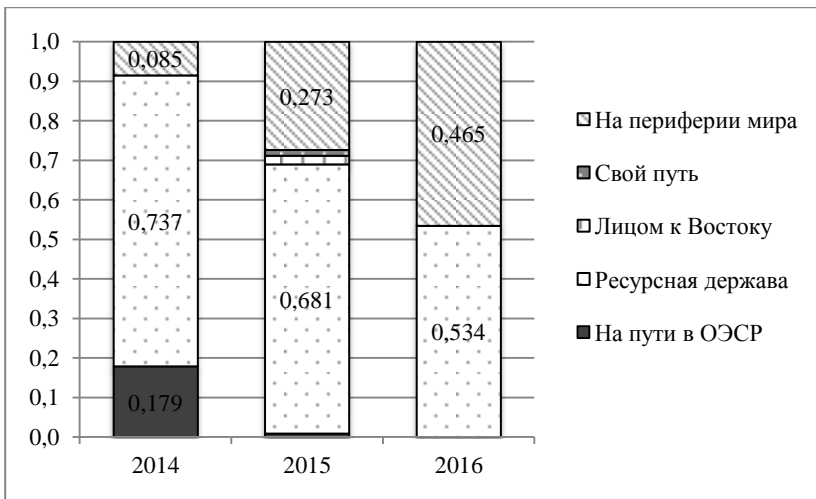


Рис. 2. Динамика прогноза на основе оценок первого эксперта в долях

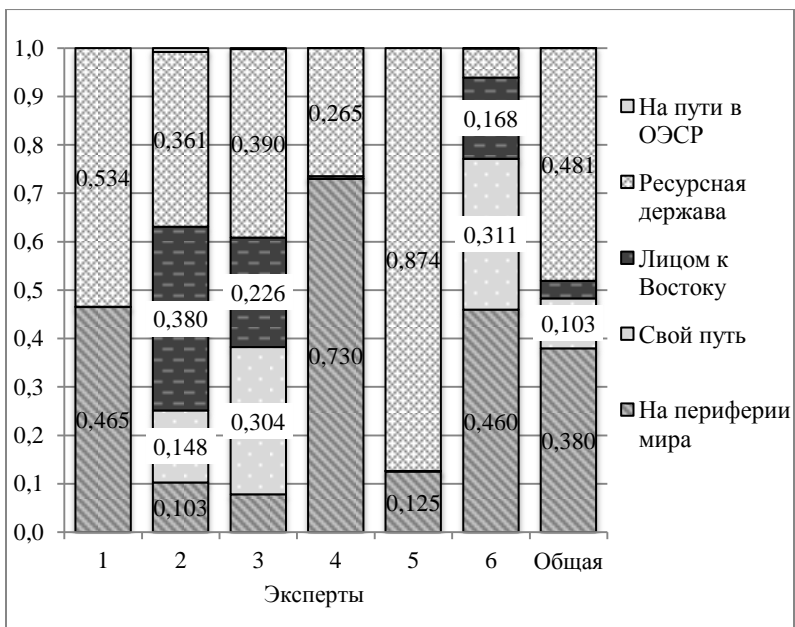


Рис. 3. Индивидуальные прогнозы экспертов и общая оценка по предварительным итогам опроса 2016 г. в долях

1. Пессимисты (1, 4 и 6) высоко оценивают риски оказаться на периферии мира при различном отношении к сценарию «Ресурсной державы». Но данная группа не вполне однородна, шестой эксперт значительно отличается от первого и четвертого по отношению к сценариям «Свой путь» и «Лицом к Востоку», оставляя возможность для трансформирования экономики, основываясь на собственном потенциале и опыте Востока, а также сотрудничестве с ним.

2. «Нейтралы» (2 и 3) допускают сравнительно высокую вероятность реализации нескольких сценариев и низкие риски «периферийного» сценария, практически одинаково оценивая шансы «Ресурсной державы». Тем не менее, представители этой группы расходятся во взглядах на основу возможных структурных изменений: будут это готовые модели восточных стран или же собственные решения.

3. Оптимисты (5) полагают наиболее вероятным сценарий «Ресурсной державы», т.е. возможность успешного продолжения курса, по которому мы двигались в первой декаде 2000-х годов. Однако оптимистом этого эксперта можно назвать лишь с некоторой степенью условности, поскольку будущее экономики он представляет в виде смеси двух сценариев «Ресурсная держава» и «На периферии мира», оба этих варианта не предполагают развитие инновационного и иных секторов в достаточной мере, «локомотивом» по-прежнему остается нефтегазовый сектор, структурных сдвигов не происходит.

По степени «инновационности» экономической политики экспертная группа четко разделилась на две половины. Одни считают, что никаких принципиально новых моделей развития экономики России мы не увидим: ресурсы по-прежнему будут нашими главными «козырями» и основой взаимоотношений с внешним миром, но по-разному относятся к возможности политических ошибок, учитываемых в сценарии «Периферия мира» (эксперты 1, 4 и 5). Остальные эксперты рассматривают шанс на качественно новые подходы к регулированию экономики, однако каждый видит их по-своему: для одних (3,6) это «Свой путь», для других (2) — «путь восточный».

Таким образом можно увидеть, что несмотря на неоднородность экспертной группы по «настроениям», степень пессимизма неуклонно растет. Все меньше шансов опрашиваемые оставляют многостороннему последовательному развитию, ожидая знакомую неизменную модель с нефтегазовым сектором в роли движущей силы. На этом фоне увеличивается вероятность существенных политических ошибок.

В заключение хотелось бы подчеркнуть важность регулярного (ежегодного) составления прогноза по предлагаемой методике. Отслеживание динамики прогнозных представлений, несмотря на то что они ассоциируются с долгосрочным периодом времени, помогают оценить два важных обстоятельства. Во-первых, как изменяется текущая экономическая ситуация. Во-вторых, насколько правильными являются сегодняшние действия в области экономической политики.

Ведь будущее формируется каждый день и зависит от нашего текущего поведения. Такой взгляд полностью вписывается в логику прогнозирования с использованием избранного метода. А полученный пессимистичный результат говорит нам, что уже сейчас (по мнению экспертов, представляющих экономическую науку) мы поступаем неправильно, что наша нынешняя экономическая политика, направленные акценты могут привести к катастрофическим, «периферийным» последствиям. Поэтому наша работа служит неким индикатором «правильности» принятия управленческих решений в масштабах всей страны с точки зрения их влияния на будущее экономики России.

Литература

1. Благовещенский Ю., Кречетова М., Сатаров Г. Сценарное прогнозирование политической ситуации в России. — М.: Фонд «Либеральная миссия», 2012. — 52 с. — URL: http://www.liberal.ru/upload/files/scen_prognoz_ispr_light.pdf (дата обращения 18.08.2016).
2. Карева Д.Е., Шмат В.В. Будущее российской экономики глазами «отцов» и «детей» // ЭКО. — 2014. — № 9. — С. 86—106.
3. Карева Д. Е., Шмат В. В. Будущее российской экономики глазами «отцов» и «детей». Взгляд второй // ЭКО. — 2015. — № 12. — С. 45—66.