

Макроэкономическое прогнозирование ОЭСР для эффективной внешнеэкономической деятельности

*А.Д. Левашенко,
А.Н. Соколянская*

УДК 330.101.541
ББК 65.012.2
Л-345

В современном мире в условиях процесса укрепления и углубления интеграции между странами крайне важным становится развитие межстрановой кооперации в исследованиях факторов экономического роста и анализа возможных путей повышения эффективности национальных экономик. Экстремальные изменения в мировой экономике во время финансового кризиса выявили необходимость повышения точности прогнозирования и улучшения методов моделирования социально-экономического развития. Ошибки прогнозирования могут привести к просчетам в формировании и планировании фискальной политики и нарушению баланса финансовой системы, в составлении национальных и региональных программ и стратегических планов развития экономики и внешнеэкономической деятельности, к снижению инвестиционной привлекательности страны.

В условиях нестабильной экономики улучшение точности и совершенствование методов прогнозирования на макроуровне позволяет определять наиболее эффективные пути развития экономики, включая систему мер поддержки финансово-бюджетной, кредитно-денежной и внешнеэкономической политики.

Учитывая, что основная цель государственного прогнозирования в сфере внешнеэкономических отношений – защита национальной экономики, национальных производителей и потребителей, повышение международной конкурентоспособности, точность и международная сопоставимость макроэкономических прогнозов играет первичную роль для реализации соответствующей задачи.

Макроэкономические прогнозы дают возможность сформировать эффективные параметры экономических регуляторов: установление правил экспорта-импорта товаров и услуг, налоговых ставок (что влияет на международную налоговую конкуренцию), объемов государственных инвестиций, заключение межправительственных соглашений, регулирование цен в отраслях промышленности и др. Развитие выше обозначенных параметров оказывает позитивное влияние на внешнеэкономическую деятельность страны в целом. Эффективное макроэкономическое прогнозирование позволяет планировать внешнеэкономическую деятельность в рамках различных форм

интеграционных объединений (таможенный союз, общий рынок, экономический союз, зоны свободной торговли), с которыми у государства установлены соответствующие отношения¹.

Развитие международной торговли, процессы глобализации, динамичный рост взаимных инвестиционных потоков, технический прогресс и повышение вовлеченности стран в глобальные цепочки создания стоимости привели к фундаментальным изменениям в структуре производства товаров и услуг и мировой торговле, и соответственно к необходимости более тесного международного сотрудничества по координации, оценке и прогнозированию последствий интеграции.

Сохранение макроэкономической стабильности является приоритетным направлением работы международных организаций (ОЭСР, G20). На сегодняшний день специалисты признают необходимость совершенствования методов прогнозирования, большинство из которых основано на неоклассической теории (в отличие от ОЭСР, где используется новая кейнсианская теория)².

В ОЭСР особое внимание уделяется именно проведению исследовательской и статистической работы по анализу экономической ситуации, рынков и значительного числа социальных показателей стран-членов ОЭСР, членов евро-зоны и ряда стран, не являющихся членами ОЭСР. Важные функции в данной сфере возложены на Директорат ОЭСР по вопросам экономики, в частности вопросами прогнозирования занимаются Рабочая группа по краткосрочным экономическим прогнозам и Рабочая группа по макроэкономическому анализу и структурной политике Комитета по экономической политике (OECD Economic Policy Committee). Особое внимание в работе этих органов ОЭСР уделяется вопросам, связанным с текущей экономической ситуацией с упором на анализ дифференцированного влияния краткосрочных экономических сценариев национальных экономик отдельных стран.

Для макроэкономической оценки в рамках обзора Economic Outlook ОЭСР применяет модель британского Национального института экономических и социальных исследований – NiGEM³, которая основана на положениях новой кейнси-

¹ Примечание авторов – В сентябре 2014 года на семинаре в Республике Армения по теме «Разработка и проведение денежно-кредитной политики при режиме инфляционного таргетирования» эксперты Евразийской экономической комиссии представили инструменты макроэкономического анализа и мультистрановую модель среднесрочного прогнозирования экономического развития стран ТС и ЕЭП, а также методы оценки взаимного влияния экономик в целях повышения устойчивости экономического развития. См. Евразийская экономическая комиссия, ЕЭК // <http://www.eurasiancommission.org/ru/nae/news/Pages/24-09-2014-1.aspx> (Eurasian Economic Commission, EEC)

² Покровский В.Н. Метод прогнозирования и сценарии развития России до 2060 г. // <http://ukros.ru/wp-content/uploads/2013/01/%D0%9F%D0%BE%D0%BA%D1%80%D0%BE%D0%B2%D1%81%D0%BA%D0%B8%D0%B9.doc> (Pokrovskiy V.N. Metod prognozirovaniya i scenarii razvitija Rossii do 2060 goda)

³ OECD Forecasting Methods // <http://www.oecd.org/eco/outlook/forecastingmethodsand-analyticaltools.htm>



анской теории⁴. В целом для прогнозирования ОЭСР совмещает метод экономического анализа и модели статистических показателей: при формировании прогнозов рассчитываются показатели по отдельной стране, при этом оценивается и учитывается влияние прогнозов мировой экономики. Научно-исследовательская работа ОЭСР лежит в очень широком диапазоне, поэтому использование статистических показателей и аналитических исследований, проведенных ОЭСР в различных сферах социально-экономической деятельности, позволяет создавать более точные прогнозы. Кроме того, процесс прогнозирования в ОЭСР значительно упрощается за счет специально созданной системы – Forecast Entry System⁵, которая централизует процесс управления данными прогнозирования и позволяет специалистам из различных стран просматривать последние обновления.

Также одной из ведущих организаций в области макроэкономического прогнозирования является Международный Валютный Фонд (МВФ). В отличие от МВФ прогнозы ОЭСР, как правило, более оптимистичны, что в определенных случаях позволяет повысить приток инвестиций, стимулирует экономику к более высоким показателям роста, то есть ориентированы на стимулирование внешнеэкономической деятельности страны, в то время как прогнозы МВФ в большей степени способствуют точному планированию фискальной политики.

Серьезные ошибки в прогнозировании в период перед финансовым кризисом – на 2008 год, а также на 2013 год, показали недостатки в методологии прогнозирования, как национальных прогнозов, так и прогнозов международных организаций. Активная работа ОЭСР в сотрудничестве с другими организациями по выработке наиболее точных методологических способов прогнозирования подтверждает необходимость кооперации стран в данной работе с целью обмена опытом, выработки, перенесения и применения лучших практик, в том числе для улучшения учета внешних факторов влияния во внешнеэкономической деятельности.

Для сравнения результатов, ниже на графиках представлены данные краткосрочных прогнозов роста ОЭСР и МВФ по ключевым экономикам⁶. Важно отме-

⁴ Примечание авторов – Основное отличие от классической кейнсианской модели заключается в том, что здесь имеют место допущения о гибкости зарплаты и цен. См.: The Concise Encyclopedia of Economics. N. Gregory Mankiw. New Keynesian Economics. 2008 // <http://www.econlib.org/library/Enc/NewKeynesianEconomics.html>

⁵ OECD Forecasting Methods // <http://www.oecd.org/eco/outlook/forecastingmethodsand-analyticaltools.htm>

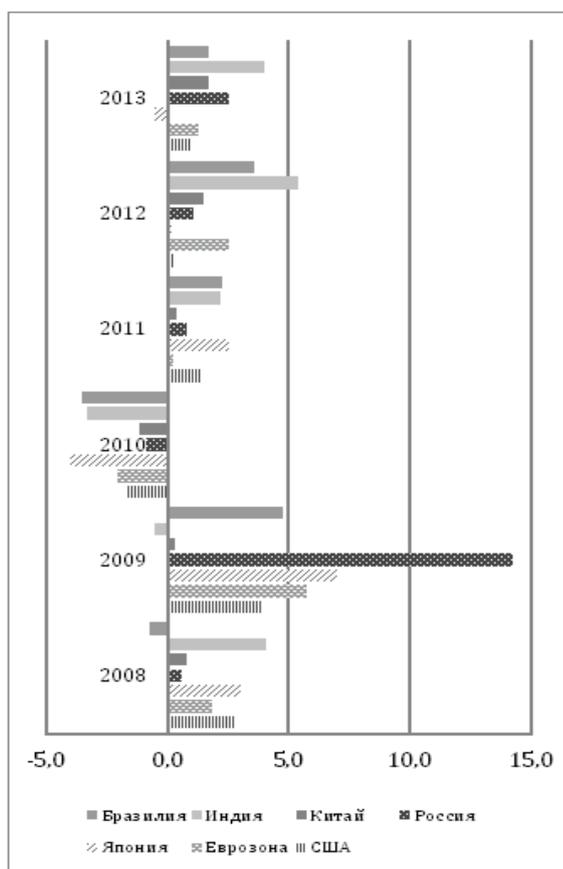
⁶ Примечание авторов – Для сравнения экономических прогнозов в данном исследовании были выбраны показатели двух международных организаций ОЭСР и МВФ, поскольку последовательность и периодичность прогнозов в них схожа. Аналитическая база OECD Economic Outlook включает в себя оценку и прогнозирование экономического роста стран ОЭСР, а также некоторых других стран (страны БРИКС - Бразилия, Россия, Индия, Индонезия, Китай и ЮАР). Доклады OECD Economic Outlook выходят два раза в год в июне и в декабре (прогнозы обновляются в мае и ноябре соответствующего года). Краткосрочные прогнозы МВФ публикуются в докладе IMF World Economic Outlook также два раза в год (в апреле и сентябре/октябре).

титель, что традиционно прогнозы проводятся два раза в год: весной и осенью. При этом «весенние» прогнозы более интересны для данного анализа, поскольку они рассчитываются в начале года на текущий и последующий год и, соответственно позволяют оценить качество прогнозов организации за более продолжительный промежуток времени.

В проведенном анализе прогнозов оценка точности основана на показателе разницы между прогнозом и реальным значением уровня ВВП (погрешности прогнозов) за период с 2008 по 2013 гг. Выбранный промежуток времени позволяет отследить точность докризисных прогнозов.

Рисунок 1

**Погрешности в весеннем прогнозе ОЭСР предшествующего года
(апрель предшествующего года)**

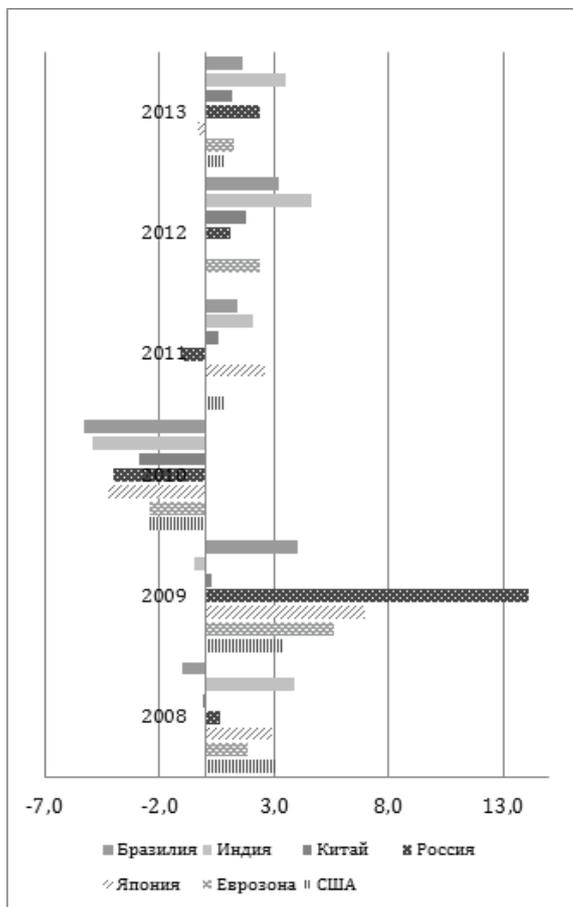


Источник: OECD Economic Outlook



Рисунок 2

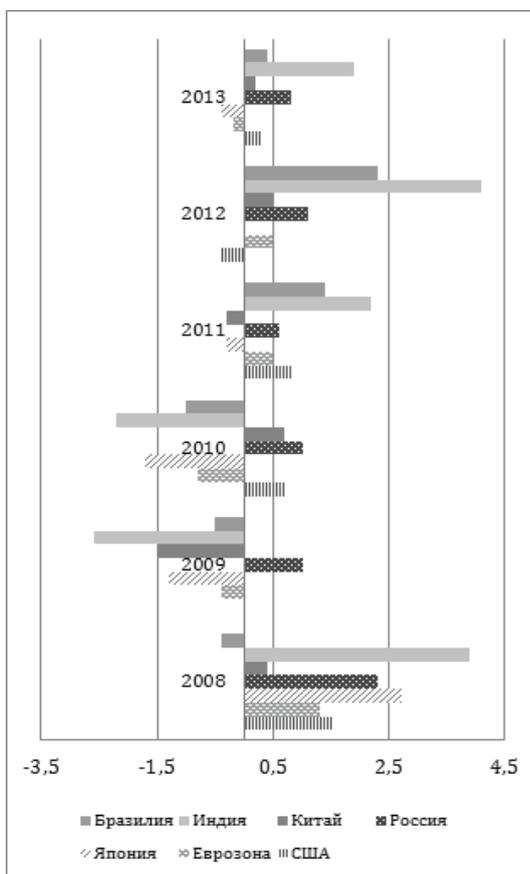
Погрешности в весеннем прогнозе МВФ предшествующего года
(апрель предшествующего года)



Источник: IMF World Economic Outlook

Рисунок 3

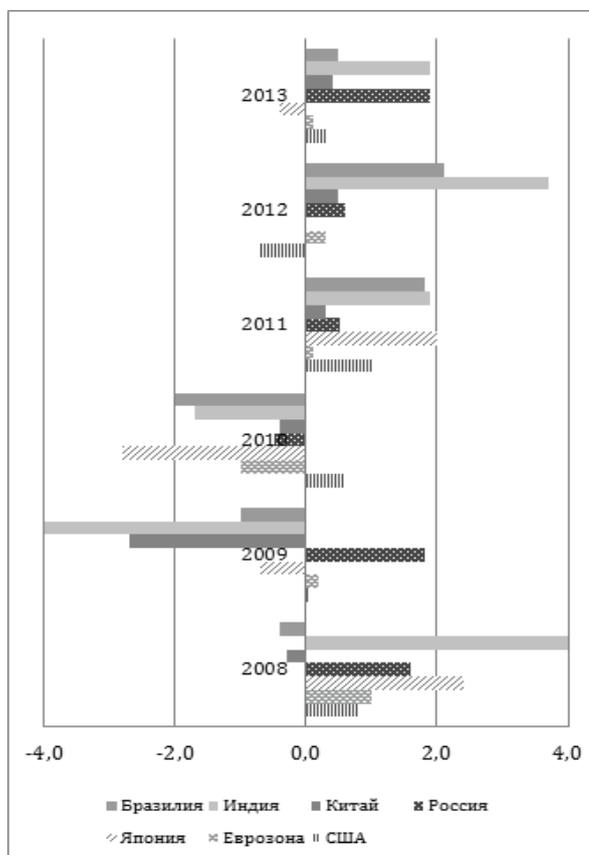
Погрешности в весеннем прогнозе ОЭСР текущего года (апрель текущего года)



Источник: OECD Economic Outlook



Погрешности в весеннем прогнозе МВФ текущего года (апрель текущего года)



Источник: IMF World Economic Outlook

В целом, в предкризисный период прогнозы обеих организаций оказались более оптимистичными по сравнению с реальным экономическим ростом. Значительные погрешности были допущены лишь в первых вариантах прогнозов (т.е. сделанных накануне анализируемого года в предшествующий год) на 2009 год. В пост-кризисный период темпы восстановления экономик мира были существенно переоценены и ОЭСР, и МВФ.

Важна выявленная закономерность: ошибки в прогнозах в основном касались стран, подверженных внешним факторам. Спрогнозированные темпы роста в кризисный период в США, Еврозоне, Японии, России и Бразилии весной 2008 года

оказались ошибочными. Так, например, из-за резкого экономического спада в России погрешность прогнозов достигла 13%. В период мирового финансового кризиса в экономике Китая наблюдалась стабилизация прироста ВВП на фиксированном уровне (около 10%), в Индии до 2010 года происходил активный рост ВВП, темпы роста в 2010 году достигла 10,5%. МВФ и ОЭСР заметно занижали прогнозы роста в 2009-2010 гг., ожидая спадов роста из-за кризиса. Экономика Индии менее зависима от внешних факторов, чем, например, Бразилии и России, поэтому негативное влияние мировой конъюнктуры в кризисный период оказалось значительно слабее, чем в других странах.

Кроме того, прогнозы, сделанные ОЭСР и МВФ за год до анализируемого года (весной предшествующего года) в кризисный период содержат погрешности в прогнозировании в основном в отношении экономически развитых стран: США, Еврозона, Япония. В то же время, в прогнозах на 2010 год организации несколько недооценили темпы восстановления развивающихся экономик, а в последующие года наоборот переоценивали темпы прироста ВВП. Прогнозы, сделанные обеими организациями непосредственно в год, в отношении которого делаются расчеты, ошибочны в большей степени в отношении развивающихся стран – Бразилии, Индии, Китая. Соответствующий вывод свидетельствует о действительно более динамичном развитии экономик стран с развивающимися рынками, чьи темпы роста или наоборот падения, опережают проводимые анализы ОЭСР и МВФ. В связи с этим, развивающиеся страны, скорее к которым в данном случае можно отнести и Россия, должны осуществлять сотрудничество между собой и с ОЭСР с целью совершенствования макроэкономического прогнозирования, более точной оценки современных процессов в рамках межстрановой интеграции и развития внешнеэкономической деятельности в отношении друг друга и развитых стран.

Демонстрация точных и максимально правдивых показателей экономического роста непосредственно влияют на имидж государства, на активность иностранных инвесторов и служат основой для развития межгосударственной кооперации и укрепления внешнеэкономических позиций. В связи с этим ОЭСР стремится избежать в будущем допущенные ранее ошибки в прогнозировании. Ключевой задачей ОЭСР в данном направлении в настоящее время является проработка и анализ ошибок и усовершенствование методик прогнозирования на будущее, включение новых индикаторов и методов оценки влияния интеграционных процессов.

В свете новых вызовов социально-экономического характера, с которыми сталкиваются страны-члены и партнеры ОЭСР, и анализа последствий мирового финансового кризиса, доказавшего глобальную взаимосвязанность экономик, на заседании Совета Министров (МСМ) в 2012 году была запущена инициатива «Новые подходы к экономическим вызовам» (New Approaches to Economic Challenges (NAEC))⁷ с целью активизации процесса постоянного совершенствования

⁷ New Approaches to Economic Challenges. OECD // <http://www.oecd.org/naec/>



аналитических структур организации и политических консультаций. Растущая взаимозависимости стран мира ОЭСР требует пересмотра и совершенствования существующих методов прогнозирования. В рамках данной программы проводятся постоянные семинары, которые включают в себя обсуждение достигнутых результатов проекта и научные презентации по новым инструментам и подходам к решению актуальных проблем. Основные решения по результатам и дальнейшим направлениям работы НАЕС выносятся на ежегодные заседания Совета Министров ОЭСР, по итогам которых публикуются отчеты о работе и общие рекомендации.

В рамках инициативы НАЕС будут вновь исследованы различные аспекты политики. Основной упор в данном проекте делается на необходимость открытости государственного регулирования для поддержки инклюзивного роста. В термин «новые подходы» относительно благосостояния общества вкладывается не только такие традиционные показатели как рост ВВП и доходы населения, но и образование, здравоохранение, безопасность, экология, равенство и др.

В программе работы НАЕС определены конкретные проекты и задачи, которые можно разделить на три категории:

□ разработка новых инструментов экономической политики, которая предусматривает совершенствование методики долгосрочного прогнозирования;

□ проведение всестороннего анализа взаимосвязей между экономическим ростом, неравенством, состоянием окружающей среды и экономической стабильностью с целью определения вариантов совмещения различных реформ для достижения устойчивого и инклюзивного роста;

□ разработка мер по улучшению институтов госуправления с целью формирования и реализации более эффективной политики с целью адаптации к условиям глобализирующегося мира.

В рамках работы проекта НАЕС феврале 2014 года был выпущен доклад «Прогнозы ОЭСР во время и после финансового кризиса» (OECD forecasts during and after the financial crisis: a post mortem)⁸, где была проведена оценка и анализ ошибок ОЭСР в прогнозировании роста ВВП стран-членов и ключевых партнеров. Данный опыт привел к ряду изменений в процедурах прогнозирования ОЭСР.

Конечной целью проекта «Новые подходы к экономическим вызовам» является создание концепции инклюзивного роста, где будут представлены статистические инструменты оценки современных процессов в экономике стран (в том числе с учетом взаимосвязанности экономик) и предложены практические рекомендации по осуществлению ключевых задач социально-экономического развития.

⁸ OECD forecasts during and after the financial crisis: a post mortem, OECD Economics Department Policy Note, No. 23 // <http://www.oecd.org/eco/outlook/oecd-forecasts-during-and-after-the-financial-crisis-a-post-mortem.htm>

Роль и воздействие макроэкономического прогнозирования в современном мире и в условиях глобальной конкуренции становятся все более ощутимыми и требуют дальнейших исследований и взаимного сотрудничества национальных агентств и международных организаций. Применение мирового опыта прогнозирования и учет лучших практик, накопленных в ОЭСР, позволяет странам сформировать новый подход к национальному прогнозированию и адаптировать международные методологии к отечественным реалиям.

БИБЛИОГРАФИЯ:

Евразийская экономическая комиссия, ЕЭК // <http://www.eurasiancommission.org/ru/nae/news/Pages/24-09-2014-1.aspx> (Eurasian Economic Commission, EEC)

Покровский В.Н. Метод прогнозирования и сценарии развития России до 2060 г. // <http://ukros.ru/wp-content/uploads/2013/01/%D0%9F%D0%BE%D0%BA%D1%80%D0%BE%D0%B2%D1%81%D0%BA%D0%B8%D0%B9.doc> (Pokrovskiy V.N. Metod prognozirovanija i scenarii razvitija Rossii do 2060 goda)

IMF World Economic Outlook // <http://www.imf.org/external/Pubs/ft/weo/2014/01/>

New Approaches to Economic Challenges. OECD // <http://www.oecd.org/naec/>

OECD Economic Outlook // <http://www.oecd.org/eco/economicoutlook.htm>

OECD forecasts during and after the financial crisis: a post mortem, OECD Economics Department Policy Note, No. 23 // <http://www.oecd.org/eco/outlook/oecd-forecasts-during-and-after-the-financial-crisis-a-post-mortem.htm>

OECD Forecasting Methods // <http://www.oecd.org/eco/outlook/forecastingmethodsandanalyticaltools.htm>

The Concise Encyclopedia of Economics. N. Gregory Mankiw. New Keynesian Economics. 2008 // <http://www.econlib.org/library/Enc/NewKeynesianEconomics.html>

