

ЛОВУШКИ И ПРЕПЯТСТВИЯ НА ПУТИ ОПРЕДЕЛЕНИЯ ТЕКУЩИХ ЭКОНОМИЧЕСКИХ ТЕНДЕНЦИЙ

Губанов В. А.

Институт народнохозяйственного прогнозирования РАН, Россия, 117418,
Москва, Нахимовский пр - т, 47,
Тел.: (499) 724-12-04, факс: (499) 129-09-22,
E-mail: v.gubanov@forecast.ru

Основная информационная база для определения текущих тенденций в экономике – это экономические временные ряды (ЭВР) той или иной степени агрегированности. На основе анализа ЭВР формируется представление о текущей динамике в целом.

Наибольшие сложности вызывает определение краткосрочных изменений текущей экономической динамики [1]. Здесь можно выделить две основные проблемы. Их необходимо преодолеть, чтобы получить более надежные результаты по оценке текущих тенденций.

Первая проблема связана с дефектами статистики (частая смена классификаторов, досчет уровней ЭВР и т.д.). Вторая - связана с ограничениями использования стандартных алгоритмов обработки и анализа ЭВР. Это проблемы с сезонной корректировкой коротких временных рядов и идентификацией конъюнктурных циклов отдельных показателей.

Не касаясь проблем официальной статистики, рассмотрим ограничения и препятствия на пути использования популярных алгоритмов обработки и интерпретации статистических данных. Родовой дефект большинства алгоритмов связан с их ориентацией на стационарную или квазистационарную динамику развития. Поэтому для коротких и существенно нестационарных ЭВР многие классические понятия теряют смысл (например, понятие «частоты» сезонных колебаний).

Один из основных вопросов, связанных с адекватностью выводов, – это до сих пор не решенная задача об оптимальном интервале анализа исследуемых рядов [2]. Поэтому в докладе приводятся варианты оценок минимальной и максимальной длительности анализа каждого из используемых показателей. Поясняются причины, по которым такой оптимальный временной интервал должен существовать.

Литература.

1. Бессонов В.А. Анализ краткосрочных тенденций в экономике: как рассеять «туман настоящего»? // *Вопросы экономики*. 2011, N2. – Стр. 93 – 108.
2. Орлов Ю.Н., Осминин К.П. Нестационарные временные ряды: Методы прогнозирования с примерами анализа финансовых и сырьевых рынков. – М.: Книжный дом «Либроком», 2011. – 384 с.