

ВЫЯВЛЕНИЕ ДЛИННЫХ ВОЛН ПРИ АНАЛИЗЕ НЕКОТОРЫХ МАКРОПОКАЗАТЕЛЕЙ

Концевая Н.В.

Финансовый университет при Правительстве РФ, департамент математики, РФ, 125993,
г. Москва, Ленинградский просп., 49, 8 (926) 499-47-36, kontsevaya07@list.ru

Скорость изменения экономических процессов в последние десятилетия драматически нарастает. Существующие общепризнанные подходы к количественному анализу как динамических изменений, так и к оценке причинно-следственных связей, срабатывают все хуже в случае оценивания будущих состояний экономических показателей и трендов. Надежда на сохранение сложившихся тенденций создает поле для маневрирования на базе эконометрических подходов, но эта надежда становится все более призрачной, тогда как вероятности шоковых событий как в политике, так и в экономике становятся все более вероятными.

Структура временного ряда наблюдений экономических показателей предполагает наличие нескольких возможных составляющих, причем цикличность в наблюдаемом процессе может быть заметна только на достаточно больших интервалах для наблюдений (в несколько десятилетий). Проблема выявления цикличности сводится к выбору наилучшей спецификации тренд-сезонной модели, после удаления которой становится возможным оценить наличие циклических колебаний у интересующего экономического показателя. Таким образом, процедура выделения цикла – это поэтапная процедура удаления детерминированных компонент структуры временного ряда, позволяющая, в результате редукции, получить интересующую латентную компоненту, демонстрирующую волновую природу процесса.

В работе для построения тренд-сезонных моделей использовались разные типы моделирования динамики временного ряда – на основе аддитивной и мультипликативной модели. Наилучшие результаты были получены на базе включения в параболическую модель фиктивных переменных. Количество фиктивных переменных было принято равным числу наблюдений в пределах одного цикла колебаний (квартальные наблюдения) минус один. В результате, при исследовании динамики некоторых Российских макропоказателей было обнаружено присутствие циклической компоненты с большим периодом (порядка 20-25 лет).

Длинные волны в экономике являются общепризнанным явлением, дискутируем вопрос о длине волны. Данный подход при моделировании динамики среднедушевых доходов населения позволил получить подтверждение существования длинных циклов в экономике России.

Литература

1. *Бабешко Л.О., Концевая Н.В., Орлова И.В.* Эконометрические исследования: инструменты и методы // *сер. Научный фонд. М.: Центркаталог, 2021, с. 240*
2. *Концевая Н.В.* Прогнозирование национального дохода на основе модифицированной кейнсианской модели // *Проблемы экономики и юридической практики, 2021, т.17-№ 2. - с.170-175*