

3. ЭКОНОМИЧЕСКИЙ АНАЛИЗ

3.1. КРАТКОСРОЧНЫЙ ПРОГНОЗ МАКРОЭКОНОМИЧЕСКОГО РАЗВИТИЯ РОССИИ НА ОСНОВЕ АНАЛИЗА МНОЖЕСТВЕННОЙ ЛИНЕЙНОЙ РЕГРЕССИОННОЙ МОДЕЛИ ВВП

Баженов О.В., к.э.н., доцент,
кафедра учета, анализа и аудита;
Сафронов А.А., студент,
кафедра Эконометрики и статистики;
Гельбух К.Е., студент, кафедра
Международной экономики

*Уральский федеральный университет
им. первого Президента России Б.Н. Ельцина,
г. Екатеринбург*

Одними из основных задач экономистов являются оценка потенциальных возможностей экономики, выявление рисков и, как результат, составление прогноза развития страны на определенный период. В данной статье представлены результаты исследования, описывающие процесс прогнозирования динамики валового внутреннего продукта (ВВП) Российской Федерации на трехлетний период с использованием эконометрических методов анализа статистической информации. Полученные результаты позволяют авторам сформулировать гипотезу о существовании тренда развития страны на краткосрочную перспективу в случае исключения факторов, значительно, но не системно влияющих на экономическое положение РФ.

Литература

1. Федеральная служба государственной статистики [Электронный ресурс] : официальный сайт. Режим доступа: <http://www.gks.ru>.
2. Angelini E. et al. Short-term forecasts of Euro area GDP growth [Electronic resource] / E. Angelini, G. Camba-Mendez, D. Giannone, L. Reichlin, G. Rünstler // Econ. j. – 2011. – No. 14. – Pp. 25-44.
3. Bai J. Determining the number of factors in approximate factor models [Text] / J. Bai, S. Ng // Econometrica. – 2002. – Vol. 70. – Pp. 191-221.
4. Geweke J. The dynamic factor analysis of economic time series [Text] / J. Geweke // Aigner D. Latent variables in socio-economic models / Aigner D., Goldberger A. – North-Holland, 1977.
5. Hara N. New monthly estimation approach for nowcasting GDP growth: the case of Japan [Text] / N. Hara, S. Yamane // Bank of Japan working paper series. – 2013. – No. 13-E-14.
6. Mariano R. A new coincident index of business cycles based on monthly and quarterly series [Text] / R. Mariano, Y. Murasawa // J. Appl. Econ. – 2003. – Vol. 18. – Pp. 427-443.
7. Satoshi Urasawa. Real-time GDP forecasting for Japan: a dynamic factor model approach [Text] / Satoshi Urasawa // Japanese Int. economies. – 2014. – Vol. 34. – P. 117.
8. Stock J. A probability model of the coincident economic indicators [Text] / J. Stock, M. Watson // In: Lahiri K. Leading economic indicators: new approaches and forecasting records / K. Lahiri, G. Moore. – Cambridge University Press, Cambridge, 1991.

Ключевые слова

Макроэкономическое развитие; прогнозирование; моделирование; множественная линейная регрессионная модель (МЛРМ); ВВП; эконометрические методы; статистика.

Баженов Олег Викторович

Сафронов Антон Александрович

Гельбух Кирилл Евгеньевич

РЕЦЕНЗИЯ

Актуальность проблемы. Актуальность исследования обосновывается необходимостью разработки механизма представления прогнозного экономического состояния Российской Федерации в условиях существующей экономической нестабильности.

Научное направление работы. Экономический анализ и прогнозирование.

Класс статьи: оригинальное научное исследование.

Научная новизна: на основе проведенного авторами анализа статистических данных, сформулирован краткосрочный прогноз макроэкономического развития РФ.

Практическая значимость данной работы заключается в формировании множественной линейной регрессионной модели валового внутреннего продукта (ВВП) РФ и экстраполяции ее с целью составления краткосрочного прогноза.

Формальная характеристика статьи.

Стиль изложения – хороший, не требует правки, сокращения. Рисунки информативны.

Общее заключение. Статья актуальна, обладает научной и практической новизной, рекомендуется для печати в журнале «Аудит и финансовый анализ».

Юрьева Л.В., д.э.н., доцент, профессор кафедры учета, анализа и аудита Уральского федерального университета им. первого Президента России Б.Н. Ельцина, г. Екатеринбург.

3. ECONOMIC ANALYSIS

3.1. SHORT RUN FORECAST OF MACROECONOMIC DEVELOPMENT OF RUSSIA, BASED ON ANALYSIS OF THE MULTIPLE LINEAR REGRESSION MODEL OF GDP

O.V. Bazhenov, Ph.D. in Economics,
associate professor, at the Department
of accounting, analysis and audit;
A.A. Safronov, student, at the Department
of Econometrics and Statistics;
K.E. Gelbukh, student, at the Department
of World Economics

Ural federal university named after the first President of Russia B.N. Yeltsin, Ekaterinburg city

One of the main tasks are the economists estimate the potential of the economy, risk identification, and, as a result, the composition of the country's development forecast for a certain period. This article presents the results of a study describing the process of predicting the dynamics of Russia's GDP in the three-year period, using econometric methods for the analysis of statistical information.

The results allow the author to formulate a hypothesis about the existence of the country's development trend in the short term, in the case of exclusion factors significantly, but did not systematically affect the economic situation in Russia

Literature

1. Angelini E. et al. Short-term forecasts of Euro area GDP growth [Electronic resource] / E. Angelini, G. Camba-Mendez, D. Giannone, L. Reichlin, G. Rünstler // *Econ. j.* – 2011. – No. 14. – Pp. 25-44.
2. Bai J. Determining the number of factors in approximate factor models [Text] / J. Bai, S. Ng // *Econometrica.* – 2002. – Vol. 70. – Pp. 191-221.
3. Federal state statistics service [Electronic resource] : official website. Mode of access: <http://www.gks.ru>.
4. Geweke J. The dynamic factor analysis of economic time series [Text] / J. Geweke // Aigner D. Latent variables in socio-economic models / Aigner D., Goldberger A. – North-Holland, 1977.
5. Hara N. New monthly estimation approach for nowcasting GDP growth: the case of Japan [Text] / N. Hara, S. Yamane // *Bank of Japan working paper series.* – 2013. – No. 13-E-14.
6. Mariano R. A new coincident index of business cycles based on monthly and quarterly series [Text] / R. Mariano, Y. Murasawa // *J. Appl. Econ.* – 2003. – Vol. 18. – Pp. 427-443.
7. Satoshi Urasawa. Real-time GDP forecasting for Japan: a dynamic factor model approach [Text] / Satoshi Urasawa // *Japanese Int. economies.* – 2014. – Vol. 34. – P. 117.
8. Stock J. A probability model of the coincident economic indicators [Text] / J. Stock, M. Watson // In: Lahiri K. Leading economic indicators: new approaches and forecasting records / K. Lahiri, G. Moore. – Cambridge University Press, Cambridge, 1991.

Keywords

Macroeconomic development; forecasting; modeling; multiple linear regression model (MLRM); forecasting; GDP; econometric methods; statistics.