

ПРИМЕНЕНИЕ ПАКЕТА INTERDYME ДЛЯ ПРОГНОЗИРОВАНИЯ СЧЕТА ТЕКУЩИХ ОПЕРАЦИЙ ПЛАТЕЖНОГО БАЛАНСА РЕСПУБЛИКИ БЕЛАРУСЬ

<http://edoc.bseu.by>

Бурдыко Н.М., Гаспадарев О.И.

НИЭИ Минэкономики Республики Беларусь, г. Минск

Для стран с открытой экономикой, каковой является Республика Беларусь, существенна зависимость от внешнего сектора. Уровень и объем внешнеэкономической деятельности страны за определенный промежуток времени находит отражение в статистике платежного баланса. Анализ платежного баланса позволяет выделить параметры, которые приводят к дисбалансам во внешней торговле, найти инструменты их регулирования, оценить уровень конкурентоспособности страны на мировом рынке. Для нахождения реакции внешнего сектора на изменение тех или иных параметров в процессе регулирования необходимо осуществлять прогнозирование платежного баланса.

В основу разработанных моделей прогнозирования экспорта и импорта товаров положены методические рекомендации МВФ и Швеции. Средством для реализации полученных многофакторных эконометрических моделей выбран пакет Interdyme. Этот эконометрический пакет предоставляет пользователю возможность поддерживать большие банки данных (сотни тысяч динамических рядов), а также средства для разработки самостоятельных эконометрических моделей, состоящих из нескольких уравнений, и средства для проверки адекватности моделей.

Краткосрочный прогноз объема экспорта и импорта проводился по следующим моделям:

$$X = -0,197 + 0.642*Y - 0.022*R - 0.1*D + 0.686*M,$$

$$(0.966) \quad (4.3) \quad (-0.33) \quad (-0.64) \quad (9.61)$$

$$(R^2 = 0.71, \text{ Std. Error of estimate} = 0.068, \text{ DW} = 2.4)$$

$$M = 0,293 - 0.149*Y - 0.369*R + 0.071*D + 0.819*X,$$

$$(0.966) \quad (4.3) \quad (-0.33) \quad (-0.64) \quad (9.61)$$

$$(R^2 = 0.64, \text{ Std. Error of estimate} = 0.075, \text{ DW} = 2.48),$$

где X – экспорт товаров, Y – объем промышленного производства, R – реальный обменный курс доллара США, D – индекс цен РБ, M – импорт товаров.

Анализ моделей в пакете Interdyme позволил выявить существенную положительную зависимость объемов экспорта и импорта товаров от объемов промышленного производства. Реальный валютный курс не является существенным фактором, оказывающим влияние на объемы экспорта и импорта.

В работе обсуждаются возможности применения пакета Interdyme для построения системы эконометрических моделей, а также даны рекомендации по использованию данного пакета в системе Минэкономики РБ.