

## ЛИНЕЙНЫЙ АНАЛИЗ ВРЕМЕННЫХ РЯДОВ В УСЛОВИЯХ ЭКОНОМИЧЕСКОЙ НЕСТАБИЛЬНОСТИ

**Рыжкова Т.В.**

РЭУ им. Г.В.Плеханова, Москва, Россия 115998, Стремянный пер., 36,  
RTVHOME@yandex.ru

В настоящее время следует учитывать, что исследование социально-экономических процессов, их моделирование и прогнозирование будет происходить в условиях нестабильности. В этой связи актуальными могут стать адаптационные методы и модели, включающие элементы экспертных оценок и методики нормативного прогнозирования. Известно, что в прогностике различают два подхода к решению задач прогнозирования: поисковый прогноз и нормативный, или плановый прогноз. Причем, каждый из них может происходить в условиях активного мониторинга, т.е. с учетом экспертного мнения и пассивного мониторинга. Нормативный прогноз может активно влиять на варианты конечного прогнозного решения. Плановый результат для будущих значений показателя прогнозирования «вынуждает» строить модель с учетом заложенных в плане требований к значению показателя. Линейный анализ временных рядов относится к непосредственным методам анализа временных рядов, поскольку обходится без построения модельных уравнений процесса. Поэтому линейный анализ может служить первым этапом исследования, где эффективно можно применить комбинированные приемы так называемого «мягкого моделирования».

В работе разобран пример построения линейной модели прогнозирования продаж автомобилей ЦФО России (01.01.2005г. по 01.12.2014г.). Рынок легковых автомобилей этого округа хорошо развит, поэтому данные являются наиболее представительными для целей прогнозирования. На рассматриваемом временном интервале были выделены две зоны нестабильности макроэкономического характера: первая зона нестабильности в 2008г., вторая – в 2014г. В 2008 году «пик» продаж, может быть объяснен кризисом 2008-2009г.г. Известно, что это был период, когда люди, желая сохранить свои накопления, часто совершали покупки автомобилей. Второй период нестабильности, собственно, является объектом прогнозирования (2014г.) и может быть связан с реакцией рынка на политические и экономические санкции в отношении России. Техника построения модели включала трендовую экстраполяцию с учетом экспертных значений плана, сезонное выравнивание в зоне нестабильности, комбинацию прогнозных моделей и элементы EXPOST прогнозирования.

### **Литература.**

1. Кендлл М., Стьюарт А. «Многомерный статистический анализ и временные ряды». - М.: Наука, 1976. 736с.
2. Слуцкий Л. «Курс МВА по прогнозированию в бизнесе». - М.: Альпина, 2006, 277с.
3. Рыжкова Т.В. «Активное вариантное поисковое и нормативное прогнозирование состояний компании». - М.: Сб. докл., II Межд.науч.конф. «The Modeling of Non-linear Processes and Systems». Вып.14., 2011г., 253с.