

Б.А. Давыдов¹
В.Ф. Поминов²B.A. Davydiv
V.F. Pominov**ПУТИ ВЫСОКОТЕХНОЛОГИЧНОГО
ВЫХОДА ИЗ ТУПИКА В ОБЛАСТИ
ПРОГНОЗИРОВАНИЯ МИРОВОЙ ЦЕНЫ
НА НЕФТЬ**

В статье рассмотрены прогнозы мировой цены нефти в России и за рубежом. Показаны недостатки и негативные последствия. Предложены пути выхода из тупика в области прогнозирования мировой цены нефти.

Ключевые слова: прогнозирование, мировое топливно-энергетическое хозяйство, мировая цена нефти, федеральный бюджет.

**WORLD OIL PRICE FORECASTING:
HIGH-TECH WAYS OUT
OF THE DEAD END**

World oil price forecasting undertaken both in Russia and abroad is treated in the article. Some shortages and negative consequences are stated herein. Ways out of the world price forecasting dead-end are offered in the article.

Keywords: forecasting, world fuel & energy economy, world oil price, federal budget.

Досконально разобраться в механизме нефтяного ценообразования – задача первостепенной важности. Она должна решаться в рамках всеобъемлющего (системного, холистического) исследования, охватывающего не только топливно-энергетическое хозяйство, но и макроэкономическую среду, а также другие важные аспекты, в том числе относящиеся к геополитике и социальной жизни. Такое исследование отсутствует и в России, и за рубежом. Известные попытки прогнозирования мировой энергетики, включая мировую цену нефти, страдают рядом изъянов, в результате чего полагаться на них при принятии решений невозможно.

Вот смысл недавнего обнадеживающего заявления Президента России В.В. Путина: «Из-за вероятности кризиса нужно создать полномасштабную систему прогнозирования и управления рисками». Однако реальных мер по реализации этого заявления пока не видно, что подтверждает и нижеследующее изложение.

Не претендуя на истину в последней инстанции, в настоящей публикации авторы кратко излагают свое видение путей решения рассматриваемой проблемы в надежде на качественные сдвиги в ближайшем будущем.

Исключительная зависимость экономики России от уровня мировой цены на нефть тре-

бует весьма внимательного отношения к ее прогнозам, которые дают очень разные результаты даже у авторитетных международных организаций. Например, на 2012 г. мировая цена российской нефти марки “Urals” составляла по данным Всемирного банка 102 доллара за баррель, Международного валютного фонда – 119,7 доллара.

Парламентскими слушаниями в мае 2012 г. «Российские интересы в мировой энергетике: участие российских компаний в международных энергетических проектах (от экспорта сырья к экспорту инноваций, идей и технологий) зависимость российской экономики от цены на нефть признана критической, а «неконтролируемая волатильность мировой цены нефти является фактором, способным вызвать в России экономическую рецессию и масштабный политический кризис».

Официальные данные о результатах прогнозов мировой цены нефти показаны в таблице 1.

Таблица 1

**Прогнозы Правительства России
среднегодовой цены нефти «Юралс»
на 2009–2015 гг., доллары США за баррель**

Даты прогнозов	2009	2010	2011	2012	2013	2014	2015
Сентябрь 2009 г.	57	58	59	60	–	–	–
Сентябрь 2010 г.	–	–	75	78	79	–	–
Апрель 2011 г.	–	–	105	93	95	97	–

¹ Доктор экономических наук, профессор кафедры экономики НОУ ВПО «Российский новый университет».

² Докторант НОУ ВПО «Российский новый университет», председатель Межотраслевой группы экспертов.

Сентябрь 2011 г.	–	–	108	100	97	101	–
Июнь 2012 г.	–	–	–	115	97	101	104
Сентябрь 2012 г.:							
Варианты (сценарии) ¹	–	–	–	–	1	97	101
					2	97	101
					3	97	101
					A	80	81
					C	110	115
Консенсусные ²	–	–	–	109	107	105	106
Заложенные в федеральный бюджет	–	–	–	–	91	92	93
Необходимые для баланса бюджета ³	–	–	–	–	105	103	104
Фактические цены	61	78	109	111 ⁴	–	–	–

¹ Обозначения вариантов (сценариев) прогноза: 1 – консервативный, 2 – умеренно-оптимистичный (базовый), 3 – форсированного роста, А – негативный, С – оптимистичный.

² Среднеарифметические значения оценок из различных источников.

³ Приведены на заседании Правительства РФ 20 сентября 2012 г.

⁴ Январь – сентябрь.

Практически все разработчики прогнозов мировой цены нефти в открытых публикациях должных объяснений не приводят. Определить обоснованность предлагаемых ее значений, как правило, нельзя. Так, на запросы МГЭ представители Минэкономразвития России (МЭР) ограничивались сообщением, что прогнозные значения цены получены в результате изучения зарубежных материалов. Создается впечатление, что собственных глубоких разработок у МЭР не было, а эти значения выводятся умозрительно, на интуитивном уровне. Судя по заявлениям ряда официальных лиц, до последнего времени цены просто заведомо занижались, чтобы иметь «подушку безопасности».

В результате, как только обозначалось резкое отклонение от заложенных в бюджет параметров цены, в срочном порядке принимались поправки к ранее принятым федеральным законам о бюджете. Характерно, что инстанции, утверждавшие данные цены, в их суть вникать не пытались.

Примечательно заявление бывшего министра финансов Алексея Кудрина телепрограмме

«Вести 24» 10 апреля 2012 г: «Цену нефти прогнозировать невозможно», но тут же: «Прогнозы Международного энергетического агентства вызывают доверие». Комментарии очевидно излишни.

В конце 2011 г. от ставки на занижение цены почему-то отошли (объяснения, как обычно, отсутствуют), и ее новые значения на 2012 г. стали близкими к верхним пределам данного показателя из зарубежных прогнозов примерно на те же даты выполнения оценок.

Очевидно, исходя из того что в марте 2012 г. цена (как всегда неожиданно для чиновников) выросла до своего максимума в 123 доллара, в апреле МЭР повысило ее прогноз на 2012 г. с утвержденных ранее 100 до 115 долларов.

Дальше стало происходить (опять же непредвиденное) падение цены – в мае до 109, а в июне до 90 долларов. Тем не менее, в поправки к федеральному закону о федеральном бюджете от 5 июня 2012 г. вошла цифра 115. Глава МЭР теперь объявил ее нереалистичной и пообещал пересмотреть.

В последнее время стала развиваться концепция «так называемого бюджетного правила» (термин В.В. Путина) с целью (по словам главы МЭР) снизить влияние внешней конъюнктуры, для чего предельные бюджетные расходы рассчитываются исходя из средней (базовой) цены нефти за определенный предшествующий период времени. Далее предполагается придерживаться следующего порядка: дополнительные доходы от превышения фактической цены над базовой направлять в Резервный фонд, а по достижении его нормативной величины – в Фонд национального благосостояния и частично в приоритетные проекты. Если же фактическая цена превысит базовую, образующийся дефицит федерального бюджета покрывается за счет Резервного фонда.

Указанный период, предложенный Минфином России, для 2013 г. определен в 5 лет, а затем ежегодно увеличивается на один год: для 2014 г. – до 6 лет, для 2015 г. – до 7 лет и так далее, для бюджета 2018 г. и последующих лет период составит 10 лет. Объяснений преимуществ именно такого способа счета цены, результаты применения которого показаны в шестой строке таблицы 1, найти не удалось.

На первый взгляд, данный способ имеет то преимущество, что он более понятен и прост и, наверное, доступен для независимой проверки. Однако налицо ряд методических погрешностей, среди которых можно назвать, например, следующие: обходится молчанием то, что в середи-

не года, когда верстается бюджет, фактическая цена за этот год и цены последующих двух лет бюджетной трехлетки отсутствуют. Правда, тот факт, что в оценках июня 2012 г. базовая цена на 2013 г. заявлялась равной и 93, и 90 долл. (вместо 83), а на 2014 г. – 94 долл. (вместо 89), свидетельствует о том, что даже средние величины за прошлые периоды по необъяснимым причинам считаются совершенно по-разному. Поэтому проверять придется исходные материалы; цены разных лет не приводятся в сопоставимый вид; не ясно, что делать с расчетами базовой цены после 2018 г. Минфин России прорабатывал также кризисный вариант на 2013 г. для цены в 60 долларов, т.е. у базовой цены появляется полученная неизвестно как альтернатива, которая возвращает к только что отброшенному властями подходу.

Но самый главный изъян состоит в том, что механистический перенос прошлого на будущее, давно уже отвергнутый как антинаучный, может приводить к крупным ошибкам. Так, проверка для 2011 г. показала, что отклонения базовой цены, рассчитанной за предшествующие 5–10 лет, от фактической цены в этом году составляют 20–41% – погрешности такого же крупного порядка, как и в оценках прошлых лет. Это небезобидно. Ведь изменение мировой цены нефти на 1 доллар эквивалентно корректировке приходной части федерального бюджета примерно на 60 млрд рублей. Поэтому утверждение, что надо основываться на этой базовой цене как на «более фундаментальном показателе» по сравнению с текущими или прогнозными котировками, не выдерживает критики.

Можно конечно забыть о подобных изъянах, рассчитывая на достаточность Резервного фонда для компенсации дефицита федерального бюджета в случае превышения фактической цены над базовой. Но остается нерешенным вопрос о путях выхода из ситуации, когда Резервный фонд истощится до неприемлемого минимума.

Итак, предложена сомнительная «метода», на которой предписано основывать благосостояние страны. Резонно задать вопрос: можно ли мириться с таким порядком формирования ключевого показателя для главного финансового документа страны?

Одно дело – формирование значительной части бюджета и финансовых резервов страны за счет нефтегазовых доходов. Другое дело – эффективность расходования этих доходов. Этот процесс пока закрыт от попыток исчерпывающей объективной оценки, так же как и механизм привязки внутренних цен углеводородов к мировым.

На Петербургском международном экономическом форуме-2009 было высказано мнение, что Россию устроила бы «справедливая цена» нефти на уровне 70–75 долларов. В июне 2011 г. продекларирована бездефицитность бюджета страны на 2012 г. при цене не ниже 115–120 долларов. А по прошествии всего двух месяцев стали говорить о профицитности уже при 108 долларов. Наконец, в бюджете, принятом в декабре 2011 г., его дефицит на 2012, 2013 и 2014 гг. установлен соответственно в 1,5; 1,6 и 0,7% от ВВП при динамике цены нефти за три названных года 100, 97 и 101 долларов. Как указано выше, для 2012 г. цена в 100 долларов была повышена до 115, в результате чего дефицит сократили до 0,1% от ВВП. Однако в июне 2012 г. министр финансов России признал эту цену нереалистичной: мол, возможное ее снижение до 110, 107, 105 долларов за баррель окажется временным и будет достигнут запланированный уровень. Фактическая цена ниже 90 долларов стала для Минфина неожиданной. Очевидно, подобная ситуация будет всегда при отсутствии должных оценки и прогнозирования в России мирового топливно-энергетического хозяйства, включая мировую цену нефти. В результате ставится задача снизить влияние на бюджет нефтеценового фактора. Но когда это будет?

Весь XVI Петербургский экономический форум-2012 прошел под дамокловым мечом угрозы неожиданного резкого падения мировой цены нефти. Участвовавшие в форуме кураторы энергетических отраслей российской экономики все как один выражали надежду, что цена все-таки «смиловитесь» и не уйдет ниже приемлемого уровня. Если такого маловероятного сценария избежать не удастся, говорили многие из них, придется прибегнуть к срочному введению стресс-бюджета, например на вариант цены в 60 долларов и ниже, который, кстати, неофициально тоже вроде просчитывался с выводом о возможности исполнения бюджета за счет резервов – но в сравнительно ограниченный период.

Бессилие относительно цены проявилось на этом форуме и у представителей бизнеса. Они имели свои программы, исходящие из 100 или 90 долларов в целом за 2012 г. Некоторые не испытывают оптимизма и думают о запасных мерах на случай ухудшения ситуации.

Со стороны международного сообщества раздались голоса о приемлемости текущей цены. Высказывалось мнение, что многие ближневосточные страны балансируют свои бюджеты при цене 80–90 долларов.

При этом повсеместно отсутствовал даже намек на мысль о том, чтобы предпринять серьезную попытку предугадать движение цены или повлиять на него. То есть, весь истеблишмент пронизан ярко выраженным, можно сказать, маниакальным чувством зависимости от неуправляемой стихийной силы, как видно, даже не поддающейся пониманию. По крайней мере, именно таким менталитетом можно объяснить и появление рассмотренной выше шкалы механистического счета будущих цен, закладываемых в бюджет, исходя из ретроспективы.

Что ждет всех россиян в свете вышесказанного, остается неясным. В данной связи возникает резонный вопрос о механизме принятия основополагающих решений, и, что немаловажно, – кто и как их готовит, наконец, почему нет предвзвешенной квалифицированной дискуссии.

Других российских опубликованных прогнозов мировой цены – единицы. Авторы одного из них (из Института энергетической стратегии) используют для этого нейронную модель, утверждая, что последняя дает высокую точность. Если это так, то надо бы обеспечить ей повсеместное внедрение, для чего проверить технику расчетов. Скучное описание в доступных публикациях достаточно полной картины не открывает, и кроме того непонятно, как именно указанная модель вписана в сценарии развития мировой энергетики того же института.

Прогнозная оценка мировой цены нефти на перспективу, озвученная в апреле 2012 г. представителями Института энергетических исследований РАН, также не сопровождается необходимыми пояснениями.

Официальные инстанции такие инициативные расчеты пока игнорируют, тем более что они обычно не синхронизированы с конкретным циклом планового бюджетного периода.

К числу наиболее заметных последствий сложившейся общей ситуации в области глобального энергетического прогнозирования относятся провалы с качественным предвидением в таких сферах, как:

- наступление и ход финансового кризиса в увязке с волатильностью мировой цены нефти;
- прорывы в освоении сланцевых пород;
- параметры превращения Китая в лидеры глобального экономического роста, энергопотребления и энергетической экспансии;
- масштабы и последствия торговли «бумажной нефтью», роль в ней анонимности участников и сверхскоростных автоматически осуществляемых операций;

– просчеты в определении негативных воздействий подобных тенденций для российской экономики и определении путей их предотвращения, смягчения последствий.

Полный список ошибок прогнозирования весьма обширен, но мало кто озабочен необходимостью проанализировать их и досконально изучить причины и механизм их возникновения.

Сейчас большинство российских прогнозистов как бы спохватились и срочно подстраивают свои очередные сценарии под новые факты, не затрудняясь глубокой проработкой черновой исходной информации (например, почерпнутой в недрах ведущих бирж), а чаще следуя в фарватере идей, формируемых в зарубежных центрах. В результате, они фактически повторяют констатацию тех же основных трендов, которые уже зафиксированы во многих зарубежных сценариях.

Важным негативным обстоятельством является и то, что не проводится сравнения технологичности отечественных и зарубежных разработок в области комплексной оценки и прогнозирования топливно-энергетического хозяйства. Хотя последним и присущ ряд недостатков, однако, например по полноте и репрезентативности подачи открытых версий, они стоят на голову выше известных российских попыток, которые представлены маловразумительными аннотационными описаниями и слайдовыми демонстрациями. Выступать с такими опусами на мировой арене было бы ошибкой.

На эту общую ситуацию в России накладываются свои особенности. В последнее время появились (среди прочих):

- предвыборные статьи В.В. Путина, которые теперь расписаны в таблицы поручений;
- финальный документ Стратегии-2020;
- прогнозы энергетики мира и России;
- исследования ряда экспертов;
- заявления глав Минэкономразвития и Минфина.

По ряду важных позиций авторы этих разработок опровергают друг друга, причем обычно не учитывают мнения других.

Представленные выше факты и последствия неудачного прогнозирования в области энергетики дают основание заключить, что эта область знаний находится в кризисном состоянии, и это пагубным образом влияет и на общее состояние экономики многих стран. Такое положение не терпимо, и необходимо срочно изыскивать пути и способы выхода из тупика. Лишь следование истинно системному подходу позволит добиться прогресса, особенно при активных международных усилиях можно добиться существенного

повышения предсказуемости цены нефти даже в современных неопределенных условиях.

На Втором и Третьем симпозиумах по прогнозированию мировой энергетики (Эр-Рияд, январь 2012 г. и январь 2013 г.), в которых принимал участие один из авторов данной статьи, Генеральный секретарь Международного энергетического форума доктор Альдо Флоре-Квироса призывал разработчиков прогнозов руководствоваться конкретным спросом со стороны лиц, принимающих решения. Очевидно, что первыми должны быть лидеры стран «Группы двадцати».

В создании ограничений свободного колебания мировой цены на нефть важную роль играют инициативы, предпринимаемые в отдельных странах. Например, ужесточаются санкции к нефтяным спекулянтам в США, учреждена нефтяная полиция для тотального контроля над издержками и ценами в Германии, еще более радикально действующее в Австрии прямое регулирование нефтяных цен.

Несмотря на то что поручения мировых лидеров международным организациям в части контролирования волатильности мировой цены нефти были подписаны также Президентом России, профильные российские инстанции и организации в рассматриваемой деятельности не участвуют и о ней часто не информированы.

Межотраслевая группа экспертов в меру своих возможностей пытается переформатировать направленность некоторых международных проектов с целью достижения практически значимого результата. Для обеспечения полномасштабного голоса российской стороны в данной области на международной арене в ближайшее время целесообразно:

- обобщить аккумулированный на сегодня опыт ряда стран в части сдерживания волатильности мировой цены нефти;

- подготовить самостоятельную разработку по данной теме с акцентом на практически значимые рекомендации для мирового сообщества, лидеров стран «Группы двадцати»;

- добиться активного участия в специализированных международных мероприятиях, намечаемых крупнейшими организациями на 2013 г. по проблемам глобальной энергетики.

Необходимо, чтобы хотя бы небольшая группа ведущих специалистов плотно занялась этой комплексной работой, для чего требуется и соответствующее финансирование.

Определенную надежду вселяет обещание В.В. Путина о том, что с переходом к России председательства в «Группе двадцати» (с декабря 2012 г.) будет проведена инвентаризация

всех обязательств, данных ею ранее. Жизнь покажет...

Если же лидеры ведущих стран будут по-прежнему проводить вялую политику в отношении достижения ими же поставленных целей, то экспертному сообществу придется изыскивать иные пути и способы. В этой связи можно воспользоваться и последней инициативой президента Казахстана Нурсултана Назарбаева о проекте G-глобал, предусматривающего максимально широкое участие стран и экспертов в решении проблем в сетевом режиме на основе коммуникативной интернет-площадки, международного института прогностики и секретариата (выступление на V Астанинском экономическом форуме 23.05.2012 г.).

С целью существенного повышения роли России в деятельности стран «Группы двадцати» и «Группы восьми»:

- 1) поручить российским экспертам провести в 2013 г. комплексный анализ выполнения поручений глав этих стран в области энергетики и разработать конкретные рекомендации по обеспечению необходимого прогресса;

- 2) для выхода из тупика, возникшего как следствие разрозненных усилий в области прогнозирования мирового топливно-энергетического хозяйства, и для повышения доверия к отчетности о ценах нефти просить:

- международное энергетическое агентство (МЭА), Международный энергетический форум (МЭФ) и Организацию стран – экспортеров нефти (ОПЕК) обеспечить создание и поддержание Единой международной системы оценки и прогнозирования глобального топливно-энергетического хозяйства (ЕМС);

- международную организацию комиссий по ценным бумагам, в сотрудничестве с МЭА, МЭФ и ОПЕК, ввести и поддерживать новую транспарентно функционирующую Всемирную службу ценовой информации в качестве модуля ЕМС.

С этой целью необходимо провести международную встречу экспертов для выработки плана действий, включив в него рассмотрение мер по контролю над агентствами ценовой информации и созыва международной конференции по введению установленной мировой цены нефти;

- 3) включить в проект федерального закона «О государственном стратегическом планировании» положение о том, что к документам государственного стратегического планирования, разрабатываемым на федеральном уровне, относится Российская национальная система оценки и прогнозирования мирового топливно-энергетического хозяйства, в том числе мировых

цен нефти и других энергоресурсов, а также следующие формулировки:

– «развернуть в 2013 г. высокотехнологичную Российскую национальную систему оценки и прогнозирования мирового топливно-энергетического хозяйства, в том числе мировых цен нефти и других энергоресурсов, и обеспечить дальнейшее поддержание этой системы;

– поднять на качественно новый уровень международное сотрудничество в данной области, для чего добиваться создания параллельной Единой международной системы аналогичного профиля;

– функции органа, уполномоченного осуществлять координацию развертывания и обеспечения дальнейшего поддержания Российской национальной и Единой международной систем, возложить на Совет Безопасности Российской Федерации;

– для выполнения конкретных работ по обеим системам Совет Безопасности Российской Федерации формирует распределенную сеть экспертов, привлекаемых на индивидуальной основе».

Что касается федерального закона «О государственной информационной системе топливно-энергетического комплекса», то Россия могла бы стать пионером преобразования этой системы из традиционного пассивного вместилища всевозможных нередко хаотично собранных данных («информационного могильника») в умную базу данных, где вся информация подвергается определенному анализу и преобразованию с учетом интересов различных групп пользователей.

Реализация изложенных довольно неординарных усилий, по нашему мнению, существенно повысит гарантии энергетической безопасности в глобальном плане, а также в отношении отдельных регионов и стран. Как показано выше, сложившаяся в стране практика не позволяет выполнять эффективный мониторинг ключевых параметров, на которых строятся федеральный бюджет и финансовые резервы России, а также потенциал ее топливно-энергетического сектора.

Предпринимаемые усилия пока носят несистемный и узкоотраслевой характер, их уровень отстает от современных стандартов. Результат – неспособность предвидеть и предотвратить ряд негативных последствий ухудшения мировой ситуации в последние годы. Достаточно вспомнить, что во время мирового кризиса экономический спад в России оказался самым глубоким среди остальных стран «Группы двадцати». При

этом надо отметить, что в Китае спада вообще не было, а в Канаде он был незначительным.

Цена ошибок и просчетов со временем возрастает. Ныне усиливаются признаки возможного нового мирового кризиса, поэтому предстоит делать все для надлежащей оценки происходящих процессов и для разработки превентивных мер на случай возможного очередного коллапса цен.

Очевидно, что Россия не должна быть наблюдателем происходящих и ожидаемых процессов в мировом топливно-энергетическом хозяйстве. К этому обязывает статус одной из ведущих мировых энергетических держав и необходимость стабилизации экономического положения в стране. В конце прошедшего года Председатель Правительства РФ Д.А. Медведев в интервью газете «Коммерсант», отвечая на вопрос о том, считает ли он до сих пор ситуацию кризисной, ответил: «Сейчас ситуация в экономике не кризисная, но она предгрозовая» [1].

Положение российской экономики во многом зависит от динамики уровней мировой цены нефти, формируемых на мировых энергетических рынках. Поэтому назрела острая потребность найти выход из тупика, в который попало прогнозирование мировой энергетики. Участники МГЭ считают необходимым двигаться по четырем взаимосвязанным направлениям, перечисленным в таблице 2.

Таблица 2

Главные направления решения проблемы прогнозирования мировой цены нефти и регулирования ее движения

1. Развернуть Российскую национальную систему оценки и прогнозирования мирового топливно-энергетического хозяйства в макросреде, в том числе цены нефти и других энергоресурсов ¹ . Российская система легко трансформируется в соответствующую систему Евразийского экономического сообщества.
2. Создать параллельную Единую международную систему аналогичного профиля и тесно связанную с ней Всемирную службу ценовой информации ² .
3. Интенсифицировать международное сотрудничество для обеспечения более устойчивой и управляемой динамики мировой цены нефти, предусмотрев проведение для этой цели международной конференции.
4. Разработать Концепцию количественного измерения энергетической безопасности на международном и национальном уровнях и внести соответствующие изменения в законодательство и в стратегические документы.

¹ Включая также дальнейшее поддержание.

² Включая также дальнейшее поддержание.

Для достижения значимых результатов работы по этим направлениям важно объединить усилия научного и экспертного сообщества при поддержке бизнеса и соответствующих государственных структур. Представляется, что работа должна выполняться под руководством и при координации Совета Безопасности Российской Федерации, учитывая значимость и межве-

домственный характер предложенных направлений решения проблемы прогнозирования мировой цены нефти.

Литература

1. «Коммерсант» от 29 ноября 2012 г.