

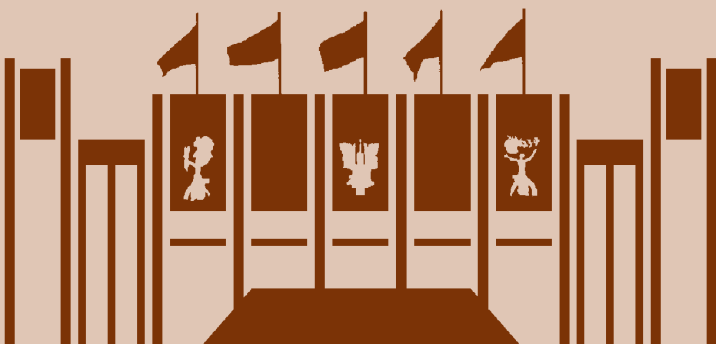
ИНСТИТУТ
МЕЖДУНАРОДНЫХ ИССЛЕДОВАНИЙ
МГИМО (У) МИД РОССИИ

АНАЛИТИЧЕСКИЕ ЗАПИСКИ

ВЫПУСК 3 (49)
март 2012

Виктор Артюшкин,
Татьяна Полякова

Влияние мировых цен на углеводороды
на экономику и политику стран СНГ



Центр глобальных проблем

УДК 338
ББК 65.5

АНАЛИТИЧЕСКИЕ ЗАПИСКИ

*Институт международных исследований
МГИМО (У) МИД России*

Выпуск 3 (49)

Март 2012

Тема

Влияние мировых цен на углеводороды на экономику и политику стран СНГ

Рецензенты:

*Ружинская Т.И., к.э.н., доцент кафедры
МЭО и ВЭС МГИМО*

Казанцев А.А., к.п.н., с.н.с. ЦЕАБ ИМИ

Главный редактор Александр Орлов

Редактор выпуска Виктор Сергеев

Редактор Валентина Шанкина

Компьютерная верстка Анатолий Казанцев

Адрес редакции: 119454 Москва,
проспект Вернадского, 76,
Институт международных исследований
МГИМО (У) МИД России

E-mail: ktsmi@mgimo.ru

Издательство «МГИМО – Университет»
119454, Москва,
пр. Вернадского, 76
Отпечатано в отделе
оперативной полиграфии
и множительной техники
МГИМО (У) МИД России
117218, Москва,
ул. Новочеремушкинская, 26

Точка зрения авторов исследований
может не совпадать с позицией и оценками
других специалистов ИМИ МГИМО (У).

© Виктор Федорович Артюшкин, 2012

© Татьяна Викторовна Полякова, 2012

© МГИМО (У) МИД России, 2012

Заказ № 111. Тираж 500 экз.
Подписано в печать 12.03.2012

**Институт международных исследований
МГИМО (У) МИД России**



Центр глобальных проблем

АНАЛИТИЧЕСКИЕ ЗАПИСКИ

**выпуск 3 (49)
март 2012**

**Виктор Артюшкин,
Татьяна Полякова**

**Влияние мировых цен на углеводороды
на экономику и политику стран СНГ**

Москва
МГИМО – Университет
2012

Данная работа посвящена моделированию экономических процессов и их взаимодействию с процессами политическими.

Динамика конъюнктуры мировых рынков углеводородов, с одной стороны, определяется как экономическими, так и политическими процессами и событиями, с другой стороны, сама оказывает влияние на развитие политических и экономических процессов.

В статье обосновывается упрощение поставленной задачи, которую предлагается заменить эквивалентной — анализом только мирового спроса на нефть. Ретроспективный анализ подтверждает адекватность построенной модели. Она хорошо описывает кризисные процессы 1980–1981, 2000 и 2008 гг. Это позволило обосновать прогноз циклической составляющей и рассмотреть возможные экономические и политические последствия.

Модель компактная, строится на биржевой статистике, рассчитывается стандартными процедурами оптимизации, поэтому может являться полезным инструментом анализа энергетической политики для политологов.

Среднесрочный прогноз, сделанный на основе предложенной модели, показывает наступление глубокого мирового кризиса в 2015–2017 гг. Анализ прогноза и учет политического и экономического контекста позволяет выстраивать наиболее вероятные сценарии будущего. Отмечены опасности для России и стран СНГ, связанные с особенностями их экономического развития на данном этапе, а также возможные пути смягчения последствий кризиса.

This article is devoted to the modeling of economic processes and their interaction with the political process.

Dynamics of world hydrocarbons markets, on the one hand, is defined influence by economic and political processes and events, and on the other hand, conversely, it has an effect on the development of political and economic processes.

The article suggests a specific model to solve the problem, which is proposed to replace the existing procedure based exclusively on the analysis of world oil demand. A retrospective analysis confirms the adequacy of this model. The model adequately describes the development of the crisis of 1980–1981, 2000 and 2008. It permits to validate the prediction of the cyclic component and to consider the possible economic and political consequences to which may lead.

The model is compact, based on stock-exchange statistics, calculated by standard optimization procedures and, therefore, may be useful tool of the energy policy analysis for political scientists.

The medium-term forecast on the basis of the proposed model shows the advent of a acute global financial crisis in 2015–2016. Prognosis analysis and political and economic context assessment allow the drafting of the most likely scenarios for the future. The article depicts considerable challenges for Russia and CIS countries stemming from their economic development, as well as possible ways to offset them while mitigating the effects of the crisis.

Содержание

Введение.....	4
Обоснование модели прогноза.....	5
Построение прогноза.....	12
Некоторые выводы.....	15

Введение

Тема «Влияние мировых цен на углеводороды на экономику и политику стран СНГ» весьма обширна и многогранна. Многие ее аспекты уже исследованы достаточно глубоко, однако весьма актуальной остается задача прогнозирования в рамках данной и многих других политэкономических проблем. Более того, полноценное исследование должно включать в себя решение задачи прогнозирования цен на углеводороды, поэтому мониторинг и анализ экономики и политики стран СНГ в энергетической сфере является базой, первым этапом для последующего этапа – прогноза цен и построения на его основе сценариев развития экономической и политической ситуации в странах СНГ.

Однако задача построения прогноза может иметь различную постановку – ориентацию на разные аспекты исследования. Например, долгосрочный прогноз цен на углеводороды общего характера требует перехода в анализе на уровень масштабных экономических проектов, таких как пути и способы модернизации экономик, комплексного развития территорий и т.п.

При общем среднесрочном прогнозировании снижается уровень факторов, определяющих прогноз, и требуется выявление и учет тенденций в форме простых регрессионных моделей.

Для построения краткосрочного прогноза цен необходимо уметь строить и линейные, и нелинейные модели, возможно, по существенно нестационарным временным рядам. Неопределенность в этом случае столь велика, что при небольших временных рядах эффективность математических моделей не превосходит эффективности предсказаний хорошего эксперта.

Кроме того, в рамках каждого варианта прогноз может быть направлен на предсказание различных аспектов. Например, прогноз можно нацелить на точное предсказание численных значений показателей. Или, напротив, уделять особое внимание только характеру динамики, чтобы предсказывать моменты перемены тенденций.

В работе мы рассмотрим краткосрочный прогноз динамики цен на углеводороды и используем его для построения сценариев развития ситуации в странах СНГ.

Построенные таким образом наиболее вероятные сценарии будущего могут быть полезны для анализа ситуации и планирования российской внешней политики.

Обоснование модели прогноза

Цена, конъюнктура, спрос, предложение на рынках углеводородов являются экономическими категориями, поведение которых подчинено экономическим законам. Однако исключительная важность энергоресурсов не только для развития, но и самого существования экономик превращают их в объект пристального политэкономического анализа.

Взаимосвязь экономических и политических процессов и событий хорошо видна на примере поведения биржевых показателей. Наблюдаемая динамика временных рядов, описывающих состояние рынка, является картиной, обобщающей как мировые экономические, так и политические процессы в их взаимосвязи. Анализ таких интегрированных показателей усложняется элементами неопределенности экономических и политических процессов, а также ситуативными особенностями их взаимодействия.

Нестационарность временных рядов (в нашем случае биржевых нефтяных котировок) определяет класс моделей, среди которых надо искать функции, наиболее адекватно описывающие существующую динамику биржевых показателей (процедура выбора будет описана ниже). При этом рассчитывать на точное моделирование достаточно трудно, так как в реальном процессе слишком велико влияние случайных факторов, главным выразителем которых является спекулятивная составляющая.

Масштабность процессов, определяющих динамику мировых цен на углеводороды, требует анализа состояния всей Мир-системы, а значит междисциплинарного моделирования, учитывающего множество разноплановых факторов. Построение таких моделей является весьма сложной задачей даже для специально сформированных научных коллективов.

Одним из возможных упрощений является построение модели формирования мировой цены нефти. Сведение анализа мировых цен на углеводороды к анализу только мировой цены на нефть, во-первых, отвечает задаче получения не количественных, а качественных оценок состояний рынка, и, во-вторых, дает возможность работы с базой данных, которая является выверенной, легко доступной и представленной в статистике на протяжении нескольких десятилетий.

Но главным обоснованием является то, что мировые цены на нефть в большинстве случаев служат базой для расчета цен контрактов на другие углеводороды, поэтому понимание их динамики является ключевой задачей.

Ведущая роль мировых цен на нефть оформилась во многом благодаря наличию развитой биржевой торговли на этот товар. Разнообразная биржевая статистика давно служит исследовательской базой для построения и расчета разнообразных эконометрических моделей.

Однако, мировые цены на нефть, в свою очередь, тоже зависят от большого количества факторов, содержащих элементы неопределенности. Поэтому построение точных краткосрочных моделей цены также оказывается весьма сложной задачей.

Следующим шагом по упрощению задачи является сосредоточение не на прогнозе цены, то есть ее значения, а на анализе динамики конъюнктуры, ее формирующей, и общемировом политическом и экономическом контексте, на базе которого происходит рождение цены. Тогда становится возможным через понимание логики формирования цены в прошлом предсказывать ее наиболее вероятную динамику в будущем.

Этот подход предполагает классификацию типов взаимодействий по коротким цепочкам двух видов: цена→событие→цена, или событие→цена→событие, чтобы затем использовать их при прогнозе. Таким образом, в качестве альтернативы задачи прогноза цен мы будем рассматривать более простую задачу прогнозирования динамики конъюнктуры.

Конъюнктура на рынке определяется соотношением спроса и предложения и фиксируется в цене. Горизонт краткосрочного прогноза задает требуемый масштаб исходных данных. В качестве таковых рассмотрим среднегодовые мировые показатели цены, спроса и предложения на нефть (Рис. 1).

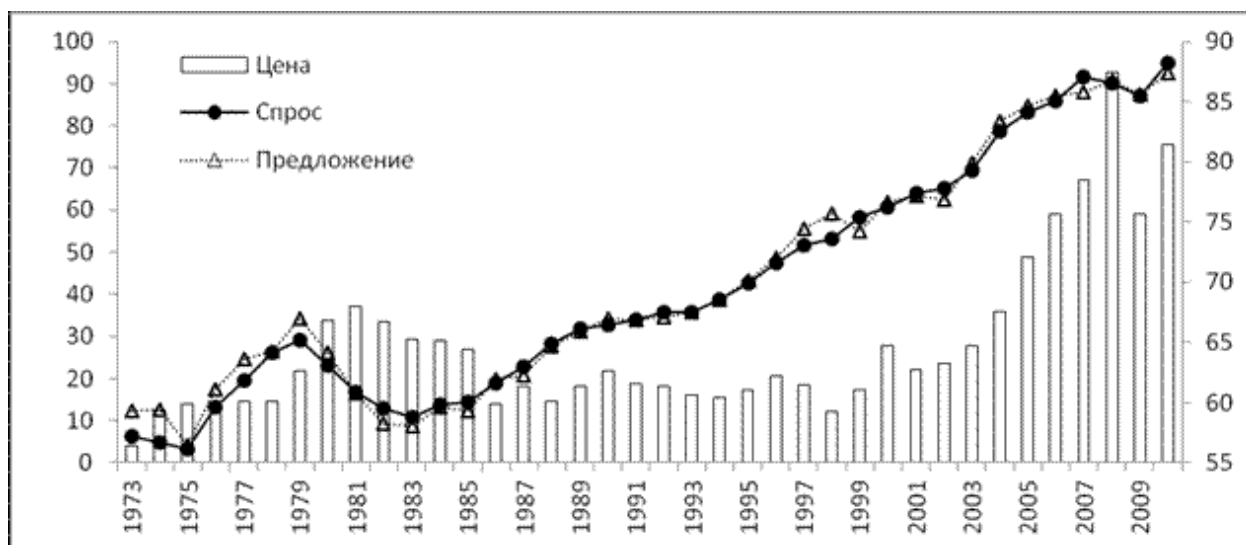


Рис. 1. Мировые цена, спрос, предложение на нефть (млн баррелей в сутки).

Анализ временных рядов — мировой цены нефти, мирового спроса на нефть и мирового предложения нефти — позволяет сделать следующие выводы:

1. Спрос и предложение являются нестационарными временными рядами с относительно малыми приращениями.

2. Коэффициент корреляции между ценой и спросом больше, чем между ценой и предложением. Между собой спрос и предложение коррелируют весьма сильно. Поэтому для ухода от имеющейся мультиколлениарности между факторами, анализ конъюнктуры на мировом рынке нефти будем проводить на базе только одного спроса (Рис. 2)¹.

¹ «Быстрый рост нефтяных цен с начала тысячелетия явно вызван не войнами и не революционным настроением венесуэльского лидера. Более того, он идет независимо от некогда всемогущей Организации стран-экспортеров нефти (ОПЕК). Цены следовали за уровнем добычи членами ОПЕК примерно до начала 1990-х годов, а потом пошли вверх совершенно самостоятельно. Смена движущей силы произошла, когда спрос на энергоносители в Китае и Индии стал расти беспрецедентными темпами, и рынок стал определять спрос, а не предложение. Эта долгосрочная тенденция со всей очевидностью продолжается и сейчас, обеспечивая постоянное давление на цены снизу». Ставка на нефть: цены на нефть рвутся вверх — но причем здесь банковские ставки? Михаил Журавлев. RusEnergy. 20 сентября 2007 г.

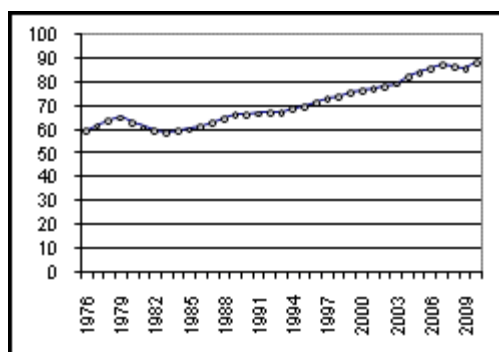


Рис. 2. Мировой спрос на нефть (млн баррелей в сутки).

Поясним шаги построения модели спроса.

Начнем с преобразования: построим временной ряд, состоящий из изменений спроса (первые разности, то есть разность текущего и предыдущего значений).

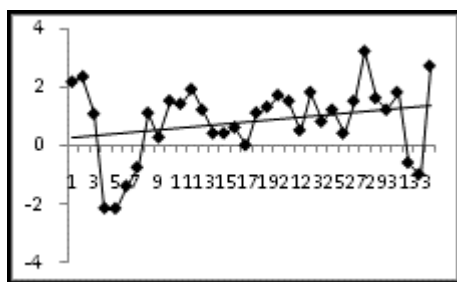


Рис. 3. Изменения мирового спроса на нефть (млн баррелей в сутки).

Затем удалим из этого ряда обнаруженный возрастающий тренд (на *Рис. 3* показан прямой линией) и получим временной ряд изменений мирового спроса, представляющий отклонения разного знака около нулевого значения (*Рис. 4*).

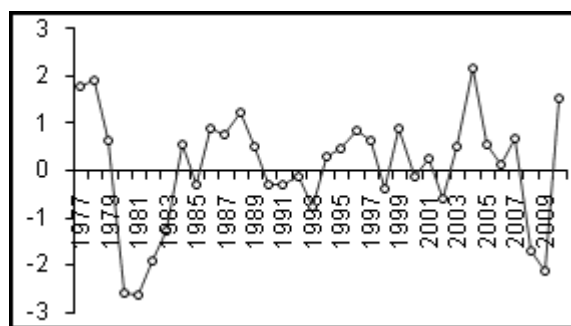


Рис.4. Изменения мирового спроса на нефть без тренда (млн баррелей в сутки).

Именно для описания динамики этого выделенного ряда будем строить модель. Причем одним из критериев соответствия возьмем качественную схожесть поведения модельной и реальной кривых спроса на нефть.

Когда речь идет об анализе макроэкономических значений, естественным желанием является обнаружить циклическое поведение показателей. Ведь в динамике многих экономических и даже политических явлений выявлено присутствие циклов. Они различаются своими характеристиками (периодом, амплитудой и т.п.) и природой происхождения, но отражают главную особенность поведения показателя – цикличность развития.

Помочь решить задачу обнаружения цикличности во временном ряду может построение автокорреляционной функции. Она показывает степень схожести динамики в различных участках ряда.

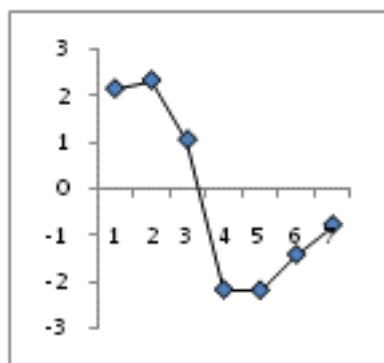


Рис. 5. Базовый цикл.

Проследим, например, тип динамики первых семи точек ряда (показан на Рис. 5) с динамикой взятых подряд семи точек в других местах. Степень схожести меняется от +0,9 до -0,9 (возможный интервал значений коэффициента корреляции [-1; 1]). Если цикличность присутствует, то коэффициент корреляции меняется по периодике с удалением от начальных точек и эта закономерность должна проявиться в поведении автокорреляционной функции (Рис. 6).

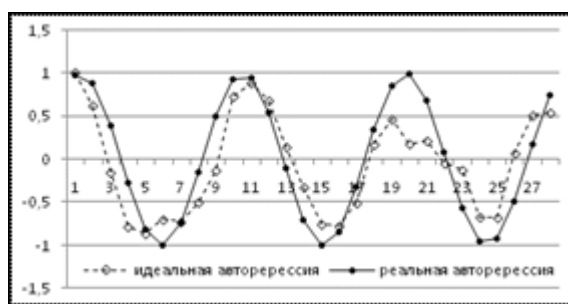


Рис. 6. Автокорреляционная функция изменений спроса.

Для наглядности и обоснованности выводов о наличии цикличности в динамике изменений спроса на графике представлен вид идеальной (показан сплошной линией) и реальной автокорреляционной функции. Представленные данные обосновывают поиск модели среди периодических функций.

Специальных методов выбора аппроксимирующей функции для нестационарного временного ряда нет. Многое зависит от того, какие параметры в модель закладывает сам исследователь и как он определит спецификацию модели.

Возьмем дискретную аппроксимирующую функцию в виде суммы двух периодик с различными параметрами, задающими амплитуду, частоту и смещение периодических колебаний.

$$f_i(c, a_1, a_2, a_3, a_4, b_1, b_2, b_3, b_4) = \frac{a_1}{i+c} \cos(a_2 i^{a_3} + a_4) + \frac{b_1}{i+c} \sin(b_2 i^{b_3} + b_4)$$

Нелинейность модели и большое количество параметров (девять) осложняют процесс поиска тех значений, при которых приближение к фактическому ряду является наилучшим. При отсутствии методов, позволяющих однозначно определить наилучший вариант, поиск приходится осуществлять путем подбора значений параметров. Кроме того, для выбора параметров необходимо привлекать и неформализованные критерии. Например, искать кривую с относительно плавной динамикой. Плавной, потому что модельную кривую мы трактуем как функцию, соответствующую совокупной динамике макроэкономических процессов. А эти процессы имеют инерционную динамику.

На *Рис. 7* сплошной линией показан график варианта модели, имеющий хорошие показатели аппроксимации. Именно с ним мы будем работать дальше.

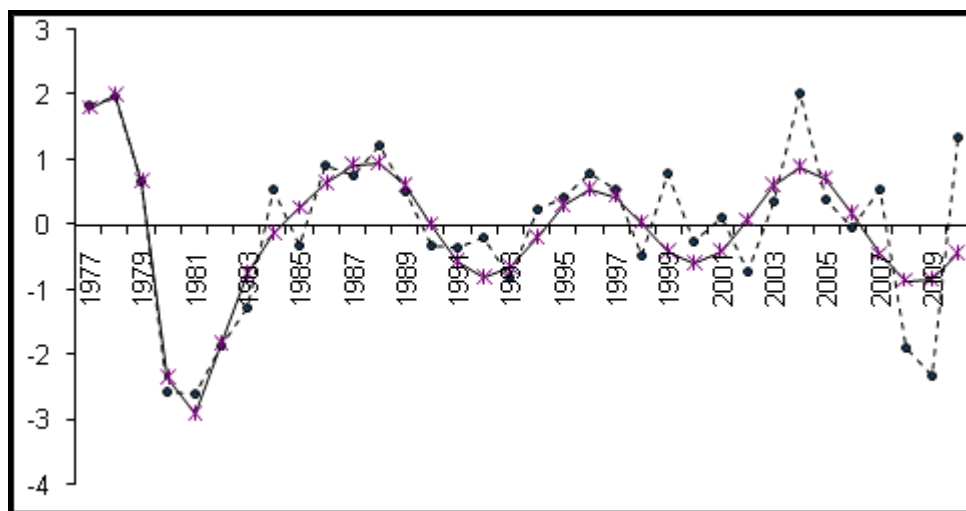


Рис. 7. Модельные и фактические значения изменений мирового спроса на нефть (млн баррелей в сутки).

Если принять тезис о том, что представленная гладкая кривая соответствует динамике мировой экономики, то получается, что за сильные скачки спроса отвечают неэкономические факторы. Они, как видно, могут по-разному исказить экономически предопределенное значение спроса, порождая тем самым ощущение непредсказуемости его поведения.

Проверим качество аппроксимации предложенной модели. Для этого проанализируем адекватность описания моделью событий прошлого. Если соответствие будет установлено, мы будем иметь основания использовать эту модель в прогнозе будущей динамики спроса.

На интервале 1977–1998 гг. точность аппроксимации очень хорошая, а после 1999 г. отклонения от модельной кривой возрастают. Является ли это показателем того, что модель перестает работать? Покажем, что это не так.

Во-первых, то, что воспринимается как недостаток модели, является ее достоинством. А именно, благодаря тому, что мы не решаем задачу максимально точного описания поведения спроса, в ошибках-остатках для нас, как мы уже отмечали, содержится не только случайный шум, но и составляющая, указывающая на присутствие значимых не экономических факторов. Если сильные отклонения от гладкой кривой считать реакциями на такие воздействия, то анализ «остатков» является как возможностью, так и способом обнаружения политически обусловленного поведения конъюнктуры.

Во-вторых, хотя отклонения после 1999 г. возросли, циклический характер поведения усредненной динамики не нарушился. А значит, мы просто имеем дело с процессом, у которого возросли колебания относительно все той же базовой макроэкономической периодики.

Согласно нашему подходу мировой спрос описывает динамику развития мировой экономики. Биржевая торговля чутко реагирует на разнообразные мировые события, оказывающие влияние на механизмы обеспечения мировых экономик энергоносителями. Это могут быть и экономические, и политические, и техногенные события. Их настолько много и представлены на практике они настолько широко, что показатели мирового спроса и мировой цены можно считать интегрированными показателями состояния и функционирования всей Мир-системы. Поэтому систематический рост отклонений должен отражать существенные изменения в мировой экономике и мировой политике, проявляющиеся и в характере поведения мирового рынка нефти. Анализ прошлого показывает, что, в интересующие нас моменты, такие изменения действительно были.

На рубеже 1998–1999 гг. модель обнаруживает окончание трансформации мировой системы в однополюсную структуру. После развала СССР в 1991 г. миру понадобился некоторый переходный период, чтобы он начал функционировать в соответствии с однополюсной ориентацией. Этот переход сопровождался расширением, углублением и совершенствованием технологического обеспечения бурно развивающегося процесса глобализации.

Снижение роли национальных границ для расширения базы функционирования международных компаний привело к неоднозначным результатам. С одной стороны, появилась возможность выстраивания дублирующих и конкурирующих вариантов экономической деятельности. И это, в среднем, повысило устойчивость развития мировых экономических процессов.

С другой стороны, увеличилась скорость реализации экономических новаций, повысилась их эффективность, выросли свободные капиталы. Негативным следствием этого стал гипертрофированный рост объемов деривативов и доли спекулятивных операций.

Все это в совокупности привело к тому, что в случае экономических или политических кризисных явлений, сбой прокатывается не по отдельным странам, а по всей мировой системе, проявляясь в резких колебаниях экономических показателей. Возросшая рефлексия рынка и выразилась в увеличении колебаний изменения спроса.

Предложенная модель, хотя и воспроизводит изменения амплитуды колебаний значений временного ряда мирового спроса (амплитуда колебаний до 2000 г. убывала, а после 2000 г. возрастала), однако в полной мере отразить новое свойство динамики не

смогла. Это связано с тем, что, по утверждению многих экономистов, роль спекулятивного фактора в динамике современной мировой экономики очень велика. Это приводит к гипертрофированно большим скачкам спроса (для модели это не прогнозируемая случайная составляющая) и, как следствие, к экономически неоправданным колебаниям цен на мировых рынках углеводородов.

Тем не менее предположения о грядущей динамике спроса и соответствующих ценовых реакциях строить можно. Так, например, скачки спроса и цен в 2010 г. по отношению к 2009 г. в соответствии со спекулятивным поведением рынка можно было ожидать, так как скачок вверх – это спекулятивная компенсаторная реакция на предшествующий провал. Это же предположение можно было сделать на основе модели. Ее поведение указывало на начавшуюся тенденцию повышения в 2009–2010 гг.

Еще одним подтверждением сохранения качества модели после 1999 г. является описание провала мировой экономики в кризисное состояние в 2008–2009 гг. Уже в 2007 г. модельный цикл экономического развития перешел в отрицательные значения, а реальная динамика была прямо противоположной. Искажения были настолько велики, спекулятивны и безосновательны, что неминуемо в 2008–2009 гг. должно было последовать падение спроса и цены в соответствии с логикой динамики базового макроэкономического процесса.

Изложенное показывает, что модель обладает двумя свойствами. С одной стороны, это хорошая аппроксимирующая функция, с другой – фильтр для выделения моментов времени, в которые имели место политические события, значимые для рынка углеводородов.

Следовательно, модель является как методом, помогающим выделять и классифицировать характер экономических и политических взаимодействий, так и методом, позволяющим на основе этой классификации, а также политических и экономических прогнозов, предсказывать динамику конъюнктуры.

Построение прогноза

Таким образом, получив положительные результаты аппроксимации и подтверждение адекватного поведения модели в течение прошедшего периода времени, можно перейти к построению прогноза. Для этого, соблюдая математическую корректность, сделаем предположение о сохранении в будущем существующих принципов функционирования мирового рынка нефти.

Итак, рассчитаем значения модели всего лишь на несколько лет вперед, то есть сделаем краткосрочный прогноз. Горизонт достоверного краткосрочного прогноза, в силу множества неопределенностей, ограничен всего лишь несколькими годами. В расчетах будем пользоваться биржевой статистикой.

Существенным плюсом работы с биржевой статистикой является учет фьючерсных контрактов – сделок по будущим поставкам. Объемы фьючерсных контрактов являются показателем ожиданий биржевых игроков и поэтому могут использоваться в качестве прогнозных значений спроса.

Хронологически данные по «будущему» спросу появляются следующим образом: в июле календарного года приводятся первые совокупные данные по фьючерсным контрактам уже на следующий год (которые затем периодически уточняются). Таким образом, в середине года мы получаем первые официальные данные, позволяющие судить о намерениях (ожиданиях) участников рынка на следующий год. Благодаря этому трехлетний горизонт краткосрочного прогноза за счет фьючерсной статистики текущего и следующего годов может быть увеличен до 5 лет. Поэтому, добавив оценки спроса на 2011, 2012 гг., построим модельный прогноз до 2016 г. (Рис. 8).

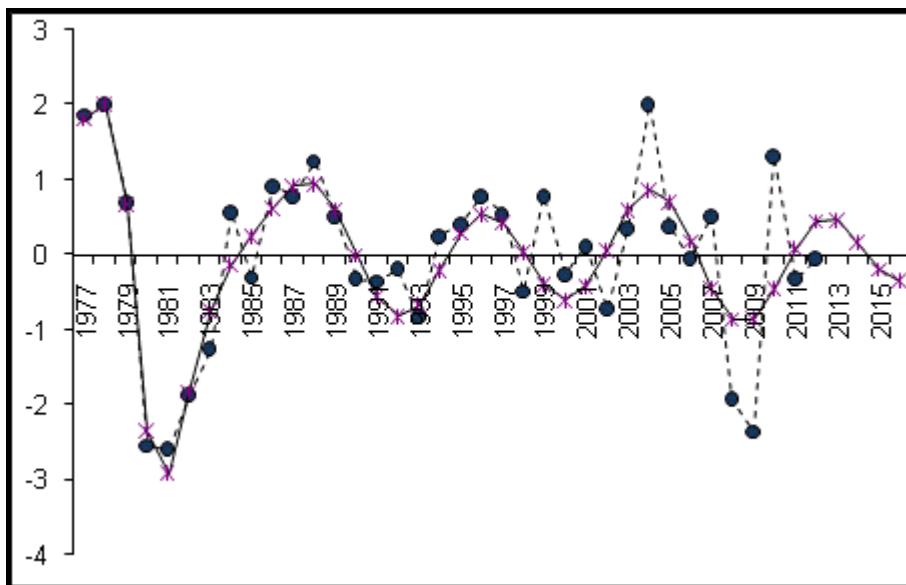


Рис. 8. Прогноз динамики спроса.

Посмотрим, как мы можем использовать прогноз для предсказания определяемых спросом экономических и политических процессов.

* * *

Полемика по поводу текущего состояния мировой экономики и ее дальнейшей динамики, вызванная кризисом 2008—2009 гг., до сих пор продолжается. Из обсуждающихся вариантов, за каждым из которых стоит серьезная экономическая аргументация, можно выделить три. Первый вариант: кризис еще продолжается и вообще будет затяжным. Второй вариант: мировая экономика, не справившись с одним кризисом, попала в новый кризис. И третий вариант: мир медленно, но поступательно выходит из кризиса.

Динамика модели соответствует третьему варианту. Это означает, что к приведенным доказательствам математической адекватности модели можно представить серьезное экономическое обоснование².

На *Рис. 6* видно, что циклическая составляющая динамики мирового спроса в 2012 и 2013 гг. будет расти. Значит, при благоприятных условиях эта тенденция проявится в росте показателей мировой экономики. Тогда окончательный выход ее из кризиса будет сопровождаться умеренным ростом цен на нефть, потому что резкого их увеличения ослабевшая после кризиса мировая экономика не выдержит.

К тому же, коллективные усилия экономически развитых стран, вне зависимости от их эффективности, будут препятствовать негативным спекулятивным атакам на мировой рынок нефти, а значит, способствовать поступательному экономическому росту³.

Конъюнктура на мировых рынках энергоносителей в 2012 и 2013 гг. будет положительной для экономик тех странах СНГ, которые экспортируют энергоресурсы, и негативной для тех, которые их импортируют.

Благоприятные экономические тенденции для России, однако, окажутся весьма непродолжительными. Уже в 2014 г. начнется понижательная фаза экономического цикла. Возможно, она временно будет искажена спекулятивной игрой на повышение цен подобно тому, как это было в 2004, 2008, 2010 гг., но экономическая закономерность все-таки проявит себя.

Если спекулятивный скачок не будет базироваться на масштабных экономических или политических событиях, спрос вернется к своим экономически определенным значениям, как это было в 2000, 2003, 2005, 2006, 2011 гг. Если же понижательная фаза совпадет с длительными кризисными экономическими и/или политическими процессами, то падение спроса, конъюнктуры и цены может быть значительным.

Вероятность второго варианта видится нам несколько большей. Так думать заставляет тенденция углубления европейского экономического кризиса, стагнация американской экономики, кризисные политические процессы в Северной Африке и нарастание напряжения на Ближнем и Среднем Востоке.

К информации в пользу худшего сценария следует отнести и прогнозы развития мировой экономики, сделанные на основе анализа больших циклов экономической

² «Мы здесь, в России, в полной мере осознаём, что риски растут не только для одной европейской зоны, а для всех экономик мира. И сейчас нужно не «заговаривать» и не успокаивать рынки, а принимать чёткие, продуманные меры по предотвращению тех негативных процессов, которые многие эксперты уже стали называть второй волной кризиса. Мы так не считаем и, наоборот, призываем не нагнетать. Я согласен с теми экспертами, которые считают, что мы находимся в стадии выхода из кризиса. Он, видимо, я согласен здесь, будет продолжительным, затяжным, но это всё-таки подъём». В.В.Путин, выступление на Инвестиционном форуме ВТБ Капитал «Россия зовёт!». 6 октября 2011. <http://premier.gov.ru/events/news/16653/>

³ В США будет сформирован орган для контроля над ценами на нефть. США попытается «искоренить» случаи финансовых махинаций на рынках нефти. «Мы хотим быть уверенными в том, что никто не наживается на жителях Америки, преследуя свои корыстные краткосрочные цели». Президент США Б.Обама на встрече с избирателями в городе Рино, штат Невада 21 апреля 2011 г., <http://www.ap.org/>.

конъюнктуры Кондратьева. «Общая закономерность при переходе от одной волны к другой состоит в резком усилении социально-политической напряженности в мире, которая приводит к войнам и революциям. При этом при переходе от понижательной волны к повышательной, как правило, происходят крупные революционные потрясения или резкий рост политической нестабильности. При переходе от повышательной волны к понижательной, как правило, происходят масштабные (общеевропейские или мировые) войны или же крупные военные конфликты, затрагивающие интересы многих великих держав... Период 2014–2020 гг., подобно периоду 1939–1949 гг. и периоду 1975–1983 гг., скорее всего, будет насыщен социальными и военно-политическими конфликтами»⁴.

Наиболее вероятным конфликтом, укладывающимся в пессимистический прогноз, является возможная война США (НАТО) с Ираном. Анализ, прогноз и учет политических последствий такого развития событий для России и стран СНГ становятся все более актуальным.

Понижательная тенденция спроса на энергоносители 2014–2016 гг. является весьма опасной в экономическом плане. Проблема заключается в том, что в 2008–2009 гг. был не региональный, а мировой кризис, выход из которого оказался тяжелым и продолжительным. И, во-вторых, ни окончательного понимания механизмов кризиса, ни способов решения очевидных мировых системных проблем и противоречий пока не найдено. Поэтому циклическая предопределенность спада мирового спроса в 2014–2016 гг. может спровоцировать новый масштабный кризис. Резервов для его эффективного преодоления как экономических, так и политических в России, да и в мире, стало намного меньше.

Некоторую надежду можно увидеть в том, что, судя по графику, глубина минимума 2016–2017 гг. меньше, чем в 2008–2009 гг. Значит, если политический контекст будет способствовать удержанию спроса и цен на среднем уровне, то удастся минимизировать неотвратимые потери.

Итак, если согласиться с обоснованностью и адекватностью модели, то мы имеем следующий прогноз: 1) приближается масштабный кризис мировой экономики; 2) времени до его начала осталось всего несколько лет; 3) динамика выхода на кризис — это прохождение максимума и переход в фазу снижения (*Рис. 6*). Отсюда следует, что *на первый план выходит задача экстренного укрепления российской экономики и обороноспособности.*

⁴ Пантин В.И. Длинные волны и перспективы мирового социально-политического развития в первой половине XXI в. // Прогноз и моделирование кризисов и мировой динамики / Отв. Ред. А.А. Акаев, А.В. Коротаев, Г.Г. Малинецкий. — М.: Издательство ЛКИ, 2010. СС. 127–128.

Некоторые выводы

Подведем итоги. Прогнозируемый нами острый мировой экономический кризис, способный получить солидную социально-политическую составляющую, для стран СНГ будет еще более тяжелым, чем для России. Зависимость их экономик от конъюнктуры мировых рынков энергоресурсов, хоть и в разной степени, но является определяющим для их функционирования и развития. Поэтому интеграция с российской экономикой в ситуации грядущего мирового кризиса становится единственным путем спасения национальных экономик. Этим, например, объясняется большое количество стран СНГ, неожиданно решивших войти в зону свободной торговли. Важным условием такого решения явилась правовая и практическая подготовленность этого типа интеграции. Достижения России, Белоруссии и Казахстана на пути создания зоны свободной торговли и таможенного союза оказались убедительными.

Начатая работа по созданию Евразийского экономического союза к 2015 г. является для России, Белоруссии и Казахстана одним из немногих реальных путей ускоренной подготовки к непростым временам кризиса. И пусть пока только три страны начали движение к такой интеграции, но юридическая подготовка и первые практические шаги создают почву для быстрого включения в нее новых членов, как это было в случае зоны свободной торговли. Одним из мотивов такой интеграции является исторический путь создания, развития и выстраивания экономических связей между республиками в составе Советского Союза, наследниками которого являются страны СНГ.

Одновременно ожидать ослабления зависимости экономик стран СНГ от цен на рынках энергоносителей в ближайшее десятилетие не следует, поскольку не существует ни внешних, ни внутренних предпосылок успешной модернизации их экономик. Более того, прогнозируемый нами экономический кризис для мировой экономики, ослабленной в 2008–2009 гг., будет еще большим испытанием, что приведет к усилению политического и экономического значения поставок энергоносителей. Это сделает Россию центром «спасительной» интеграции в Евразийском экономическом союзе на пространстве СНГ. Причем выгоды от интеграции с Россией и ее притягательность будут тем выше, чем больше проектов модернизации успеет реализовать сама Россия.

Артиюшкин Виктор Федорович – старший научный сотрудник Центра глобальных проблем ИМИ МГИМО (У).

Основные научные интересы: математическое моделирование экономических, политических и социальных процессов; междисциплинарные методы исследования; глобальные экономические и политические процессы; энергетическая безопасность.

Полякова Татьяна Викторовна – старший научный сотрудник Центра глобальных проблем ИМИ МГИМО (У), эксперт Центра стратегических разработок, лектор российско-канадского семинара «Вопросы права и управления в ТЭК», менеджер по международным связям и проектам программы МБДА по нефти и газу МГИМО (У).

Область научных интересов — анализ переходных процессов в экономике в целом и нефтяной и газовой отраслях в частности.

Центр глобальных проблем (ЦГП) ИМИ МГИМО (У) МИД России действует с 2004 г.

ЦГП видит свою задачу в изучении крупных проблем современной мировой политики, требующих сочетания специальных методов исследования (экономических, историко-культурных, когнитивных), а также знаний в области естественных наук и современной технологии.

К числу таких проблем, в первую очередь, относятся:

- Воздействие мирового рынка на экономическую и политическую структуры отдельных государств.

- Изменения политических режимов государств, осуществляемые под давлением предпочтений, существующих в «мировом сообществе» («волны демократии»).

- Конфликты, вызываемые цивилизационными и культурными различиями.

- Глобальное воздействие на мировую политику ресурсных ограничений (энергетические и экономические проблемы).

Подробнее о ЦГП см. на Инет-сайте ИМИ МГИМО (У) www.mgimo.ru/ktsmi

Институт международных исследований (ИМИ) МГИМО (У) МИД России создан в мае 2009 года в целях развития и углубления аналитической работы Университета в области международных отношений, придания ей системного и прогностического характера, освоения новых исследовательских секторов (региональных и проблемных), проведения экспертизы и обоснования внешнеполитических инициатив и мероприятий. В сферу научных интересов ИМИ входит изучение концептуальных аспектов внешней политики России, выявление и исследование тенденций эволюции и развития международных процессов, анализ крупных и актуальных международных проблем.

ИМИ является правопреемником и продолжателем исследовательских и аналитических структур МГИМО (У) – **Проблемной научно-исследовательской лаборатории системного анализа международных отношений (1976–1990 гг.)**, **Центра международных исследований (1990–2004 гг.)** и **Научно-координационного совета по международным исследованиям (2004–2009 гг.)**.

В настоящее время в состав ИМИ входит одиннадцать научных центров:

- Центр глобальных проблем,
- Центр постсоветских исследований,
- Центр БРИКС,
- Центр евро-атлантической безопасности,
- Центр проблем Кавказа и региональной безопасности,
- Центр исследований Восточной Азии и ШОС,
- Центр ближневосточных исследований,
- Центр региональных политических исследований,
- Центр партнерства цивилизаций,
- Центр североевропейских и балтийских исследований,
- Аналитический центр.

Директор ИМИ – А.А. Орлов, профессор МГИМО (У), Чрезвычайный и Полномочный Посланник.

«Аналитические записки» Института международных исследований МГИМО (У) МИД России (до мая 2009 г. – «Аналитические записки» НКСМИ) издаются с ноября 2004 г. Выходят с периодичностью не реже одного раза в месяц тиражом от 300 до 900 экземпляров. Рассылаются в Администрацию Президента Российской Федерации, органы исполнительной и законодательной власти, российские представительства за рубежом, профильные научно-исследовательские центры системы РАН, ведущие политологические центры, а также крупные библиотеки. Материалы для данного издания готовятся входящими в состав ИМИ МГИМО (У) научными центрами, а также известными российскими дипломатами, учеными, общественными деятелями.

Связь с редакцией по адресу: ktsmi@mgimo.ru