

***Зыбайлова Инна Васильевна***

студентка

***Духнай Ольга Сергеевна***

студентка

***Шахбазова Ольга Павловна***

д-р биол. наук, доцент, профессор,

заведующая кафедрой

ФГБОУ ВПО «Донской государственной

аграрный университет»

г. Новочеркасск, Ростовская область

## **АНАЛИЗ КОРРЕЛЯЦИОННОЙ ЗАВИСИМОСТИ НЕФТИ И КУРСА РУБЛЯ**

*Аннотация:* данная статья отражает результаты исследования зависимости между ценой на нефть и курсом рубля при помощи вычисления коэффициента корреляции. По приведенным данным выявляется зависимость между обозначенными показателями, которая свидетельствует о падении курса рубля при снижении цены на нефть.

*Ключевые слова:* цена на нефть, курс рубля, коэффициент корреляции.

Уже довольно давно методы статистики применяются во всех областях жизнедеятельности человека. Статистика в экономике играет одну из самых важных ролей. Так как именно эта научная отрасль занимается анализом и обработкой объемного количества информации и стабилизирует социально-экономические отношения субъектов хозяйствования. Зачастую в экономических исследованиях находят решение поставленной задачи в выявлении факторов, определяющих уровень, динамику процесса в экономике. Данную функцию нередко отражает корреляционно-регрессионный анализ. Для достижения достоверности проводимого анализа существует необходимость не только в выявлении определенных взаимосвязей, но и в определении количественной оценки данных показателей.

Корреляционная зависимость – взаимозависимость двух или нескольких случайных величин. Изменения значений одной или нескольких из этих величин приводят к систематическому изменению значений других величин [1].

Оценивая временной интервал, на примере периода падения цен на нефть и одновременного роста курса доллара по отношению к другим валютам, можно выявить высокий уровень корреляции между стоимостью сырой нефти и курсом доллара. Данная зависимость является обратной, при которой цена на сырую нефть движется в противоположном направлении относительно движения доллара, из чего следует сделать вывод, что любое существенное изменение курса доллара относительно других основных валют оказывает значительное влияние на стоимость сырой нефти.

Наибольшую долю в структуре экспорта в 2014 г. занимала нефть (58,6%) [3]. Россия в большей степени экспортирует сырьё, после реализации импортных товаров, произведенных не сырьевыми отраслями, рубли нужно конвертировать в валюту для закупки новых партий товара [2]. В обмен на нефть Россия импортирует то, что не производится в стране. Наряду с продукцией высокотехнологичных производств, продукцией лёгкой и обрабатывающей промышленности, значительную долю импорта составляет так называемый «критический импорт», то есть те товары, без которых невозможно обойтись либо крайне затруднительно. К такой группе можно отнести автомобильные комплектующие, запчасти для обслуживания импортных машин и оборудования, лекарства, расходные материалы для диагностического и медицинского оборудования и прочее. Устранение диспропорции в развитии отраслей в сторону импортозамещения и увеличение доли высокотехнологичных отраслей в ВВП страны, способны повысить конкурентоспособность России и улучшить качество жизни граждан. При снижении мировых цен на нефть страна получает меньше валютной выручки, спрос на валюту повышается, стоимость которой остается относительно неизменной, из этого следует, что рублей на покупку валюты потребуется больше из-за их удешевления, следовательно, рост рублёвых цен является неизбежным, и рубль ослабевает. Роль нефти в ценообразовании рубля в последнее

время еще более возросла. По отношению к прошлым годам корреляция была положительная, но не столь сильная. Можно предположить, что зависимость от цен на нефть по-прежнему будет сохранять высокие показатели, так как в бюджете заложена цена выше текущей рыночной. Если цены на нефть вернуться к своим предыдущим значениям, то корреляция снова может снизиться.

Российский рубль сильно коррелирует с нефтяными ценами, по итогам 2015 года уровень корреляции достиг 0,82 или 82%, что является максимальным показателем за последние десять лет. Однако курс рубля зависел не только от нефти, но и под влиянием санкций и масштабного оттока капитала. В настоящее время взаимосвязанное движение нефти и рубля с одной стороны является положительным фактором, так как именно данная взаимосвязь позволяет компенсировать падение нефтяных доходов, иначе на фоне падения цен на нефть имели бы место огромный дефицит и сильная рецессия.

Таким образом, снижение доходов на нефть сильно ударит по российской экономике: дефицит бюджета возрастет, курс рубля ослабнет. Однако можно прогнозировать и позитивный сценарий для экономики России. При установлении цены на нефть на уровне 50 долларов (и при этом будет наблюдаться негативная тенденция, так как на рынке будет ожидать дальнейшее снижение цен в среднесрочной перспективе), то курс рубля к доллару сбалансируется в виде суммы в размере 68 рублей, при снижении до 40 долларов возможно ожидание 85 рублей за доллар. Подорожание нефти приведет к укреплению рубля. При 60 долларах за баррель возможно ожидание курса в размере менее 56 рублей за доллар, при 70 – менее 50. В долгосрочной перспективе экономика диверсифицируется и начнет возрастать, результат будет зависеть не только от нефтегазовых денег, но и от экономической политики государства.

### ***Список литературы***

1. Корреляция, корреляционная зависимость [Электронный ресурс]. – Режим доступа: <http://statpsy.ru/correlation/correlation>
2. Покутняя И.В. Влияние цены на нефть и изменение курса валют / И.В. Покутняя, О.П. Шахбазова // Сборник материалов научно-практической

конференции: Новое слово в науке. – Чебоксары: ЦНС «Интерактив плюс», 2014. – С. 275–276.

3. Ширяев Д.В. Анализ и последствия снижения курса российского рубля / Д.В. Ширяев // Молодой ученый. – 2015. – №24. – С. 618–622.