

М. Турунцева, Е. Астафьева, М. Баева, А. Божечкова, А. Бузаев, Т. Киблицкая, Ю. Пономарев, А. Скроботов

МОДЕЛЬНЫЕ РАСЧЕТЫ КРАТКОСРОЧНЫХ ПРОГНОЗОВ СОЦИАЛЬНО-ЭКОНОМИЧЕСКИХ ПОКАЗАТЕЛЕЙ РФ (сентябрь 2021 г. – февраль 2022 г.)

В статье представлены расчеты прогнозных значений различных экономических показателей Российской Федерации в сентябре 2021 г. – феврале 2022 г., построенные на основе моделей временных рядов, структурных эконометрических уравнений и моделей, оцененных с использованием результатов конъюнктурных опросов, а также на основе моделей, оцененных с использованием больших массивов данных.

Ключевые слова: прогнозирование, социально-экономические показатели РФ, временные ряды.

Е. Астафьева, М. Турунцева

ОЦЕНКА КАЧЕСТВА КРАТКОСРОЧНЫХ ПРОГНОЗОВ РОССИЙСКИХ ВНЕШНЕТОРГОВЫХ ПОКАЗАТЕЛЕЙ (апрель 2009 г. – июнь 2021 г.) И МИРОВЫХ ЦЕН НА НЕКОТОРЫЕ ВИДЫ СЫРЬЯ (апрель 2009 г. – июль 2021 г.)

В статье приведены результаты анализа качества прогнозов ИЭП им. Е.Т. Гайдара показателей внешней торговли Российской Федерации с апреля 2009 г. по июнь 2021 г. и мировых цен на некоторые виды сырья с апреля 2009 г. по июль 2021 г. Показано, что рассматриваемые ряды являются довольно сложными с точки зрения прогнозирования и их прогнозы не обладают высоким качеством. Лишь для двух показателей (мировых цен на золото и алюминий) MAPE прогнозов ИЭП меньше 10% на рассматриваемом интервале времени. Прогнозы остальных показателей имеют MAPE, превышающую 10%-ный порог. С точки зрения сравнительного качества лучшими прогнозы ИЭП оказываются в четырех случаях из девяти. В оставшихся пяти случаях лучшими являются наивные прогнозы. Следует отметить, что в последние полгода рассматриваемого периода прогнозы всех внешнеторговых показателей демонстрируют ухудшение качественных характеристик, уступая по качеству наивным прогнозам. Прогнозы ИЭП показателей мировых цен на природные ресурсы, кроме цен на никель, также демонстрируют увеличение ошибки в последние 6 месяцев, но в большинстве случаев превосходят по качеству альтернативные методы.

Ключевые слова: прогнозирование, качество прогнозов, внешняя торговля, мировые цена на природные ресурсы.