Прикладная эконометрика, 2023, т. 70, с. 122–143.
Applied Econometrics, 2023, v. 70, pp. 122–143.
DOI: 10.22394/1993-7601-2023-70-122-143

И.П. Станкевич[1]

Применение MIDAS-моделей с марковским переключением для наукастинга ВВП и его компонентов

В работе рассматривается вопрос наукастинга ВВП России по использованию и его компонентов при помощи MIDAS-моделей с марковским переключением. Рассматриваются разные способы получения наукастов на основе полученных результатов: взвешенные по вероятностям нахождения в том или ином режиме в следующий период времени, по наиболее вероятному режиму, в условиях правильного предсказания режима. Полученная модель сравнивается со стандартными эконометрическими моделями наукастинга. Показано, что среди всех протестированных моделей максимальная точность обеспечивается MIDAS-моделями с марковским переключением с правильным предсказанием режима. MIDAS-модели с марковским переключением без правильного предсказания режима также стабильно работают лучше стандартных MIDAS-моделей и MFBVAR-моделей для большинства рассмотренных рядов данных.

Ключевые слова: наукастинг; ВВП России; прогнозирование; модели с марковским переключением; MIDAS-модели.

JEL classification: C53; E37.

1. Введение

Наукастинг — оценка текущего уровня публикующихся с задержкой показателей на основе значений более оперативных индикаторов — является важной задачей с точки зрения оперативной подстройки действий экономических агентов под изменяющиеся макроэкономические условия. Возможность получить первые оценки показателя не через несколько месяцев после окончания периода, а через несколько дней (лаг публикации наиболее оперативно выходящих показателей) очень ценна как для государственных органов, так и для частных компаний. Особенно возрастает актуальность задач наукастинга в кризисные периоды, что во многом и обусловило рост интереса к этой задаче в последние несколько лет, после начала кризиса, связанного с распространением COVID-19, и на фоне событий 2022 г. Из всех макроэкономических показателей одним из самых главных и при этом наименее оперативных является ВВП, что обуславливает высокую актуальность задачи наукастинга ВВП и его компонентов, публикующихся с еще более значительной задержкой, чем ВВП.

[1] **Станкевич Иван Павлович** — НИУ ВШЭ, Москва; istankevich@hse.ru.