

Прикладная эконометрика, 2024, т. 74, с. 78–103.

Applied Econometrics, 2024, v. 74, pp. 78–103.

DOI: 10.22394/1993-7601-2024-74-78-103

Е.В. Астафьева, М.Ю. Турунцева¹

Повышение качества прогнозирования простейшими методами комбинирования отдельных прогнозов

Комбинирование прогнозов считается наиболее простым способом улучшения качества прогнозирования по сравнению с индивидуальными моделями. В данной работе проверяются возможности простейших методов комбинирования, таких как простое среднее и оценки на основе среднеквадратической ошибки прогнозов предыдущих периодов, для улучшения качественных характеристик краткосрочных прогнозов пяти показателей цен на ресурсы (нефть и металлы). В основе работы лежит база прогнозов ИЭП им. Гайдара, которая обеспечивает массив первичных (объединяемых) прогнозов и позволяет строить их комбинации в режиме реального времени. Полученные результаты позволяют сделать вывод, что даже самые простые методы комбинирования могут повысить точность прогнозов. Кроме этого, в случае цен на ресурсы можно даже выделить группу методов (а именно, комбинирование с весами, обратно пропорциональными среднеквадратическим ошибкам отдельных прогнозов), обеспечивающих максимальный выигрыш в качестве для большинства периодов.

Ключевые слова: комбинирование прогнозов; объединение прогнозов; цены на нефть; цены на алюминий; цены на золото; цены на никель; цены на медь.

JEL classification: C53; E31.

1. Введение

Прогнозирование экономических показателей представляет собой комплексную многоэтапную задачу, включающую целый ряд шагов и требующую от исследователя глубоких знаний в области как самой экономики, так и математических методов ее анализа и прогнозирования. Это, в свою очередь, приводит к проблеме выбора наиболее подходящей для целей прогнозирования модели, варианта решения соответствующей задачи, что порождает огромное разнообразие прогнозов даже для одного показателя. В каждом конкретном случае качество прогноза определяется выбором аналитика на каждом из этапов построения прогноза. И трудно сказать заранее, какой из прогнозов будет иметь лучшие качественные характеристики: например, корректная с точки зрения экономической теории модель с неверно оцененными параметрами может уступать по качеству прогнозирования не полностью специфицированной теоретической модели с корректировками оценок.

¹ Астафьева Екатерина Викторовна — РАНХиГС, Москва; eastafyeva@ranepa.ru.

Турунцева Марина Юрьевна — РАНХиГС, Институт Гайдара, Москва; turuntseva@ranepa.ru, turuntseva@iep.ru.