

Сравнительный анализ некоторых подходов к тестированию относительного качества краткосрочных прогнозов российских макроэкономических показателей.

Т.М.Рябичева

Московский физико-технический институт (государственный университет)

Разработка методов тестирования относительного качества прогнозов и их сравнительный анализ является актуальной темой для исследования, поскольку в настоящее время повсеместно публикуется и используется огромное количество прогнозов различных показателей, но при этом далеко не всегда информация о примененных методах прогнозирования бывает доступна читателю.

Целью данной работы является исследование целого перечня временных рядов, отражающих динамику российских макроэкономических показателей в краткосрочном периоде; построение прогнозов при помощи рекурсивной и скользящей схемы с несколькими вариантами выбора окна прогнозирования; выявление показателей различных информационных критериев; сравнение различных прогнозов по значению качественных характеристик.

Для простейшей оценки качества построенных прогнозов используются следующие показатели : средняя абсолютная процентная ошибка прогнозирования, средняя абсолютная ошибка прогнозирования, корень квадратный из средней квадратичной ошибки прогнозирования.

Для расчета данных характеристик используются следующие данные: h – длина интервала (горизонт) прогнозирования; $f_{T,i}$ – прогнозное значение временного ряда, рассчитанное в момент времени T на i шагов вперед; y_{T+i} – истинное значение временного ряда в момент времени $T+i$ [1].

Корень квадратный из средней квадратичной ошибки прогнозирования и средняя абсолютная ошибка прогнозирования зависят от размерности прогнозируемого показателя и, следовательно, могут принимать довольно большие значения. Поэтому они используются аналогично информационным критериям при сравнении качества моделей: лучшей считается та модель, у которой статистика меньше. С этой точки зрения средняя абсолютная процентная ошибка является более удобным инструментом для оценки качества прогнозов, поскольку измеряется в процентах от истинного значения прогнозируемого показателя и может быть использована и как сравнительная характеристика качества прогнозов, построенных по различным моделям, и как характеристика качества прогноза конкретной

модели при некотором критическом уровне ошибки прогнозирования [2].

Литература:

1. *West K.D.* (2006) *Handbook of Economic Forecasting, Volume 1* – Wisconsin, 2006.
2. *Турунцева М., Киблицкая Т.* (2010) Качественные свойства различных подходов к прогнозированию социально-экономических показателей РФ. – М.: Институт экономики переходного периода, 2010.