

ОЦЕНКА КАЧЕСТВА КРАТКОСРОЧНЫХ ПРОГНОЗОВ РОССИЙСКИХ ВНЕШНЕТОРГОВЫХ ПОКАЗАТЕЛЕЙ (апрель 2009 г. – июнь 2020 г.) И МИРОВЫХ ЦЕН НА НЕКОТОРЫЕ ВИДЫ СЫРЬЯ (апрель 2009 г. – июль 2020 г.)

Е. Астафьева, с.н.с., РАНХиГС,
М. Турунцева, зав. лабораторией, ИЭП им. Е.Т. Гайдара и РАНХиГС

В данной статье мы приводим результаты анализа качественных свойств прогнозов некоторых показателей, ежемесячно публикуемых Институтом экономической политики имени Е.Т. Гайдара в бюллетене «Модельные расчеты краткосрочных прогнозов социально-экономических показателей РФ»¹ (далее – «прогнозы ИЭП»). Мы рассматриваем простейшие статистики (MAPE, MAE, RMSE) как прогнозов ИЭП, так и альтернативных прогнозов (наивных; наивных сезонных и прогнозов, построенных с использованием скользящего среднего). Помимо сравнительного анализа на основе простейших статистик качества мы также исследуем отсутствие значимых отличий между прогнозами ИЭП и альтернативными прогнозами на основе теста знаков².

Для анализа были взяты ряды показателей экспорта во все страны, импорта из всех стран, экспорта в страны вне СНГ и импорта из стран вне СНГ, а также некоторых показателей мировых цен на природные ресурсы (нефть, алюминий, золото, медь и никель). Оценки качества показателей внешней

Таблица 1
Простейшие статистики качества прогнозов и результаты теста знаков

		Экспорт		в страны дальнего зарубежья	Импорт		из стран дальнего зарубежья	Цены на ресурсы				
		ARIMA	SM		ARIMA	SM		нефть	алюминий	золото	медь	никель
Прогнозы ИЭП	MAPE	17.20%	14.59%	16.64%	15.47%	13.50%	14.79%	19.50%	9.13%	7.47%	11.15%	15.73%
	MAE	5.20	4.62	4.32	3.00	2.59	2.53	12.42	0.18	100.66	0.73	2.38
	RMSE	6.99	5.93	5.77	4.17	3.47	3.46	16.77	0.23	128.44	1.02	3.10
Наивные прогнозы	MAPE	14.79%		15.70%	19.11%		20.75%	16.83%	8.65%	6.97%	9.69%	14.78%
	MAE	4.64		4.16	3.63		3.43	10.34	0.17	94.46	0.63	2.25
	RMSE	5.85		5.40	5.17		5.10	14.18	0.21	119.75	0.84	2.88
	Z	-1.34	-0.42	-0.49	-4.64	-6.96	-5.97	-6.30	-2.17	-3.29	-4.27	-2.10
		не отв	не отв	не отв	отв	отв	отв	отв	отв	отв	отв	отв
Наивные сезонные прогнозы	MAPE	22.13%		23.67%	22.80%		23.49%	31.50%	17.82%	12.49%	19.01%	25.34%
	MAE	6.72		6.09	4.16		3.73	19.56	0.33	170.73	1.23	3.75
	RMSE	8.37		7.83	6.58		6.37	25.61	0.43	215.49	1.52	4.86
	Z	-6.68	-6.11	-5.76	-5.27	-6.47	-4.99	-7.70	-13.65	-10.29	-13.65	-8.12
		отв	отв	отв	отв	отв	отв	отв	отв	отв	отв	отв
Скользящее среднее	MAPE	19.33%		20.68%	22.50%		23.52%	24.04%	13.38%	10.36%	14.02%	20.22%
	MAE	5.91		5.34	4.13		3.76	14.54	0.25	141.24	0.91	3.01
	RMSE	7.31		6.80	6.06		5.88	19.48	0.31	178.58	1.13	3.76
	Z	-4.15	-5.69	-4.01	-5.62	-7.73	-6.96	-3.43	-9.17	-9.38	-7.28	-3.92
		отв	отв	отв	отв	отв	отв	отв	отв	отв	отв	отв

¹ См.: http://www.iep.ru/index.php?option=com_bibiet&Itemid=124&catid=123&lang=ru&task=showallbib. С августа по декабрь 2012 г. – Бюллетень «Модельные расчеты краткосрочных прогнозов социально-экономических показателей РФ». С января 2013 г. – регулярный раздел «Научного вестника ИЭП им. Гайдара.ру»: <http://www.iep.ru/ru/ob-izdaniy.html>

² Методика анализа сравнительного качества прогнозов подробно описана в работе: Турунцева М.Ю., Киблицкая Т.Р. Качественные свойства различных подходов к прогнозированию социально-экономических показателей РФ, Москва: ИЭПП, 2010. Научные труды № 135Р.

торговли построены для всего массива прогнозов с апреля 2009 г. по июнь 2020 г., для показателей цен на природные ресурсы – с апреля 2009 г. по июль 2020 г. Поскольку для каждой точки из рассматриваемого интервала имеется по 6 прогнозных значений, всего у нас есть массив из 810 точек (135 прогнозных месяцев по 6 прогнозов для каждого месяца) для показателей внешней торговли и 816 точек для показателей мировых цен на природные ресурсы.

Основные результаты расчетов представлены в *табл. 1*. Рассматриваемые показатели традиционно относятся к числу плохо прогнозируемых. Так, к числу хороших с точки зрения качества прогнозов показателей ($5\% < \text{MAPE} < 10\%$) относятся только показатели мировых цен на золото и алюминий. Все остальные показатели относятся к числу плохих ($\text{MAPE} > 10\%$)

ВНЕШНЕТОРГОВЫЕ ПОКАЗАТЕЛИ

Оценки прогнозов внешнеторговых показателей свидетельствуют об их достаточно низких качественных характеристиках. Для ARIMA-прогнозов средняя абсолютная процентная ошибка составляет 15–17%; для SM-прогнозов расхождения с истинными значениями показателей несколько меньше (14–15%), но все равно существенны.

Средняя абсолютная процентная ошибка ARIMA-прогнозов *экспорта во все страны* составляет 17,2%. По качественным характеристикам они уступают наивным прогнозам, расхождения которых с истинными значениями показателя составляют 14,8%, но в соответствии с тестом знаков преимущества наивных прогнозов незначимы. При прогнозировании на основе структурной модели ошибка ниже, и составляет 14,6%. Альтернативные методы построения прогнозов уступают по качественным характеристикам SM-прогнозам, и по результатам теста знаков для наивных сезонных прогнозов и скользящего среднего эти различия значимы. Кроме этого, при проверке на основании того же теста, гипотеза об отсутствии значимых различий между ARIMA-прогнозами и SM-прогнозами также отвергается (значение статистики составило (-1,98)). Следовательно, значимо лучшими (в большинстве случаев) прогнозами показателя суммарного экспорта являются прогнозы на основе структурной модели.

В соответствии с оценками, полученными по месяцам, в последние полгода рассматриваемого периода ARIMA-прогнозы суммарного экспорта демонстрируют увеличение абсолютной процентной ошибки, составившей в среднем за эти 6 месяцев 39,4%. SM-прогнозы в январе-июне 2020 г. также демонстрируют рост абсолютной процентной ошибки, причем рост существенный (до 42,4%). Для обоих методов прогнозирования наиболее существенные расхождения между истинными и прогнозируемыми значениями показателей наблюдаются в апреле-мае 2020 г. В последние полгода прогнозы ИЭП уступают по качеству всем альтернативным методам: средняя абсолютная процентная ошибка наивных прогнозов в эти 6 месяцев составляет 33,5%, наивных сезонных прогнозов – 31,8%, скользящего среднего – 37,2%.

При прогнозировании *экспорта в страны дальнего зарубежья* средняя абсолютная процентная ошибка составляет 16,6%. По качественным характеристикам прогнозы ИЭП данного показателя превосходят наивные сезонные прогнозы и прогнозы на основе скользящего среднего, но уступают наивным прогнозам, демонстрирующим ошибку на уровне 15,7%. Проверка гипотезы о несущественности различий между ARIMA-прогнозами данного показателя и простейшими методами на основании теста знаков свидетельствует о значимых преимуществах прогнозов ИЭП перед наивными сезонными прогнозами и прогнозами на основе скользящего среднего, а преимущества наивных прогнозов признаны незначимыми.

В последние 6 месяцев рассматриваемого периода абсолютная процентная ошибка ARIMA-прогнозов экспорта в страны дальнего зарубежья составляет в среднем 45,5%. В эти полгода прогнозы ИЭП проигрывают по качественным характеристикам прогнозам, построенным всеми простейшими методами: средняя абсолютная процентная ошибка наивных прогнозов в январе-июне 2020 г. составляет 34,8%, наивных сезонных прогнозов – 33,8%, скользящего среднего – 39,2%.

Оценка качества краткосрочных прогнозов

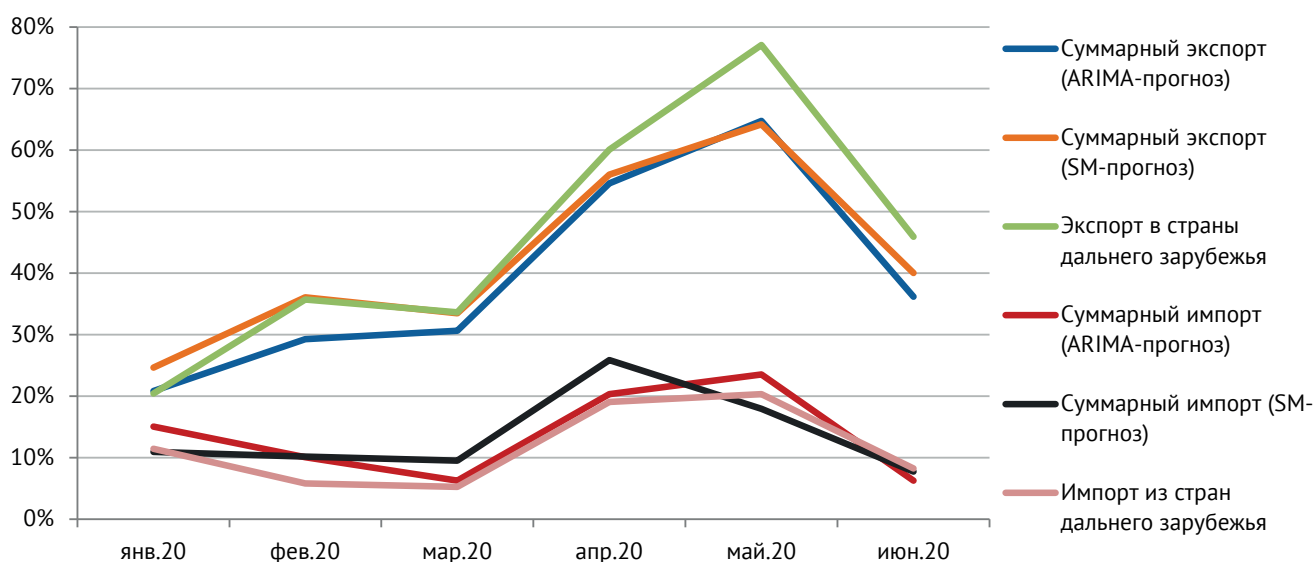


Рис. 1. Средняя абсолютная процентная ошибка прогнозов внешнеэкономических показателей, построенных для периода 01/2020 – 06/2020

Средняя абсолютная процентная ошибка ARIMA-прогнозов *импорта из всех стран* составляет 15,5%. По качественным характеристикам прогнозы данного показателя, построенные по моделям временных рядов, превосходят все альтернативные методы, причем на основании теста знаков преимущества ARIMA-прогнозов значимы. Средняя абсолютная процентная ошибка прогнозирования на основе структурной модели составляет 13,5%. При этом и альтернативные методы построения прогнозов, и ARIMA-прогнозы, значимо уступают SM-прогнозам по качественным характеристикам (значение статистики критерия при сравнении прогнозов ИЭП составило (-3,02)).

В последние полгода рассматриваемого периода ARIMA-прогнозы ИЭП суммарного импорта демонстрируют уменьшение абсолютной процентной ошибки, SM-прогнозы – незначительное увеличение. В эти 6 месяцев расхождения с истинными значениями показателей составляют для ARIMA-прогнозов 13,6%, для SM-прогнозов – 13,7%. Рост средней абсолютной процентной ошибки демонстрируют и наивные прогнозы, а наивные сезонные прогнозы и прогнозы на основе скользящего среднего в последние полгода, напротив, характеризуются улучшением качественных характеристик: средняя абсолютная процентная ошибка наивных прогнозов в январе-июне 2020 г. составляет 19,9%, наивных сезонных прогнозов – 9,3%, скользящего среднего – 14,3%. Так что и ARIMA-прогнозы, и SM-прогнозы в последние полгода рассматриваемого периода уступают по качеству наивным сезонным прогнозам.

При прогнозировании *импорта из стран дальнего зарубежья* средняя абсолютная процентная ошибка составляет 14,8%, что существенно ниже значений ошибок для всех альтернативных методов, и в соответствии с тестом знаком во всех случаях полученные различия значимы. В последние полгода рассматриваемого периода ARIMA-прогнозы данного показателя демонстрируют уменьшение абсолютной процентной ошибки до уровня 11,7%, обеспечиваемое сокращением отклонений прогнозов от реальных значений импорта из стран дальнего зарубежья в I квартале 2020 г. В эти полгода расхождения наивных прогнозов с истинными значениями показателя составляют 19,9%, наивных сезонных прогнозов – 8,7%, скользящего среднего – 14,0%, так что в январе-июне 2020 г. прогнозы ИЭП уступают по качеству наивным сезонным прогнозам.

ДИНАМИКА ЦЕН НА НЕКОТОРЫЕ ВИДЫ СЫРЬЯ НА МИРОВОМ РЫНКЕ

В соответствии с оценками качественных характеристик в рассматриваемом периоде лучшими свойствами обладают прогнозы *цен на золото*, для которых средняя абсолютная процентная ошибка прогнозирования составляет 7,5%. ARIMA-прогнозы данного показателя превосходят по качеству

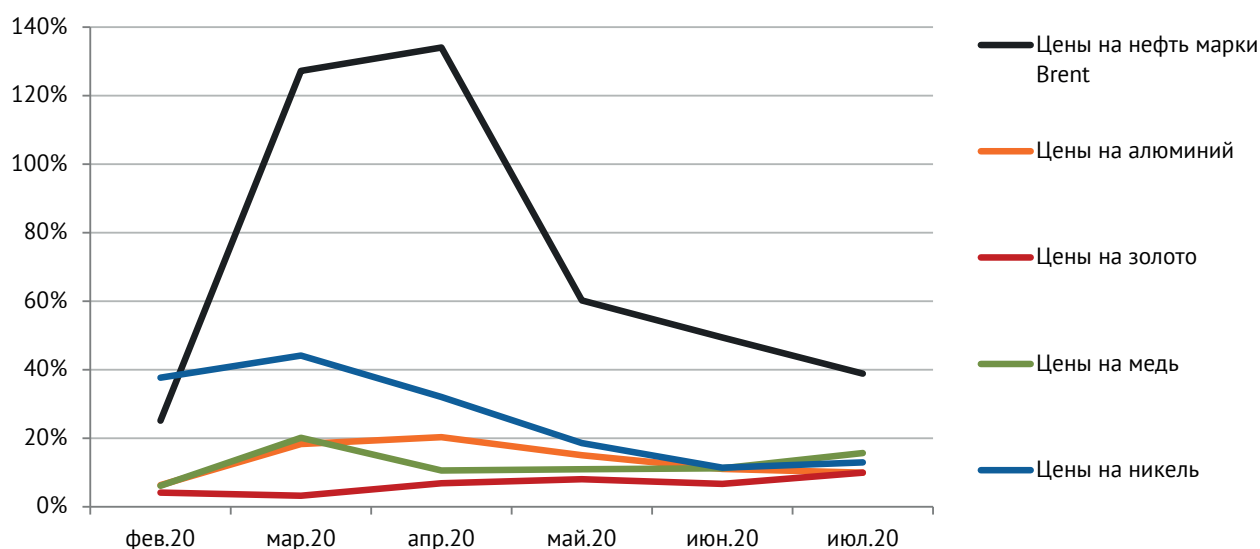


Рис. 2. Средняя абсолютная процентная ошибка прогнозов цен на ресурсы, построенных для периода 02/2020 – 07/2020

наивные сезонные прогнозы и прогнозы, полученные на основе скользящего среднего, но уступают наивным прогнозам, ошибка которых равна 7,0%. На основании теста знаков гипотеза о несущественности различий между прогнозами ИЭП и всеми альтернативными методами отвергается, так что для цен на золото значимо лучшими являются наивные прогнозы. В соответствии с оценками, полученными по месяцам, в феврале-июле 2020 г. расхождения ARIMA-прогнозов цен на золото с истинными значениями показателя составляют в среднем 6,4%. В эти полгода прогнозы ИЭП превосходят по качеству все альтернативные методы: средняя абсолютная процентная ошибка наивных прогнозов составляет 9,4%, наивных сезонных прогнозов – 21,5%, скользящего среднего – 17,5%.

К числу удовлетворительных прогнозов относятся также прогнозы *цен на алюминий*, расхождения которых с истинными значениями составляют в среднем 9,1%. Несмотря на достаточно высокий уровень ошибки, прогнозы ИЭП данного показателя демонстрируют лучшие качественные характеристики в сравнении с наивными сезонными прогнозами и прогнозами, полученными на основе скользящего среднего. В обоих случаях применение теста знаков для проверки гипотезы о несущественности различий свидетельствует о том, что прогнозы ИЭП значимо лучше прогнозов, построенных простейшими методами. Лучшие качественные характеристики в рассматриваемом периоде для цен на алюминий демонстрируют наивные прогнозы, расхождения которых с истинными значениями составляют в среднем 8,7%. Но по результатам теста знаков их преимущества перед ARIMA-прогнозами незначимы. Оценки, полученные по месяцам, показывают, что в феврале-июле 2020 г. средняя абсолютная процентная ошибка прогнозирования цен на алюминий увеличилась до 13,5%. Большинство альтернативных методов также демонстрируют увеличение ошибки в сравнении со средним значением за весь рассматриваемый период: расхождения наивных прогнозов с истинными значениями цен на алюминий составляют в среднем за эти полгода 11,6%, наивных сезонных прогнозов – 16,2%, прогнозов, полученных на основе скользящего среднего – 14,3%. Так что и в феврале-июле 2020 г. прогнозы ИЭП, полученные по моделям временных рядов, уступают по качеству наивным прогнозам.

Для остальных показателей данного раздела средняя абсолютная процентная ошибка прогнозирования в рассматриваемом периоде превышает 10%. При прогнозировании *цен на медь* она составляет 11,2%. Прогнозы ИЭП данного показателя превосходят по качеству наивные сезонные прогнозы и прогнозы, полученные на основе скользящего среднего. Но значимо лучшими качественными характеристиками обладают наивные прогнозы, ошибка которых составляет 9,7%. Оценки, полученные по месяцам, свидетельствуют, что в феврале-июле 2020 г. среднемесячная абсолютная процентная ошибка ARIMA-прогнозов цен на медь составляет в среднем 12,4%. В эти 6 месяцев прогнозы ИЭП уступают по качеству не только наивным прогнозам, но и прогнозам на основе скользящего среднего:

наивные прогнозы демонстрируют расхождения с истинными значениями на уровне 11,9%, наивные сезонные прогнозы – 15,5%, скользящее среднее – 12,3%.

Средняя абсолютная процентная ошибка прогнозирования *цен на никель* в рассматриваемом периоде составляет 15,7%. По качественным характеристикам прогнозы ИЭП данного показателя превосходят наивные сезонные прогнозы и прогнозы, полученные на основе скользящего среднего, но уступают наивным прогнозам. Тест знаков для проверки гипотезы о несущественности различий между ARIMA-прогнозами и простейшими методами свидетельствует о том, что прогнозы ИЭП значительно предпочтительнее скользящего среднего и наивных сезонных прогнозов и значительно уступают наивным прогнозам. В последние 6 месяцев рассматриваемого периода абсолютная процентная ошибка ARIMA-прогнозов цен на никель увеличивается, причем увеличивается существенно – до уровня 26,1%. Большинство альтернативных методов, напротив, демонстрируют улучшение качественных характеристик прогнозов в феврале-июле 2020 г.: расхождения наивных прогнозов с истинными значениями цен на никель составляют в среднем за эти полгода 18,6%, наивных сезонных прогнозов – 4,6%, скользящего среднего – 10,4%. Так что в феврале-июле 2020 г. ARIMA-прогнозы уступают по качеству всем простейшим методам.

Самую высокую в данной группе показателей среднюю абсолютную процентную ошибку прогнозирования, составляющую 19,5%, демонстрируют прогнозы *цен на нефть марки Brent*. Как и в случае цен на остальные ресурсы, прогнозы ИЭП цен на нефть по качественным характеристикам превосходят наивные сезонные прогнозы и прогнозы, полученные на основе скользящего среднего, но уступают наивным прогнозам, ошибка которых равна 16,8%. По результатам теста знаков их преимущества перед ARIMA-прогнозами значимы. В последние полгода рассматриваемого периода среднемесячная абсолютная процентная ошибка прогнозов ИЭП цен на нефть демонстрирует существенный рост, составляя в среднем 72,5%. Однако и в эти 6 месяцев прогнозы ИЭП оказываются качественно менее предпочтительными только в сравнении с наивными прогнозами: средняя абсолютная процентная ошибка наивных прогнозов данного показателя в феврале-июле 2020 г. составляет 67,9%, наивных сезонных прогнозов – 91,6%, скользящего среднего – 78,3%.

* * *

Таким образом, качество прогнозов рассматриваемых показателей остается на достаточно низком уровне. Как и ранее, данные показатели можно отнести к группе плохо прогнозируемых рядов. 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 значимо лучшими прогнозы ИЭП оказываются в 3-х случаях из 9-ти. В оставшихся 6-ти случаях лучшими являются наивные прогнозы. Кроме этого, следует отметить, что в последние полгода рассматриваемого периода прогнозы большинства внешнеторговых показателей демонстрируют ухудшение качественных характеристик, уступая по качеству альтернативным методам. Прогнозы ИЭП показателей мировых цен на природные ресурсы, кроме цен на золото, демонстрируя увеличение ошибки в последние 6 месяцев, также уступают по качеству альтернативным методам.