

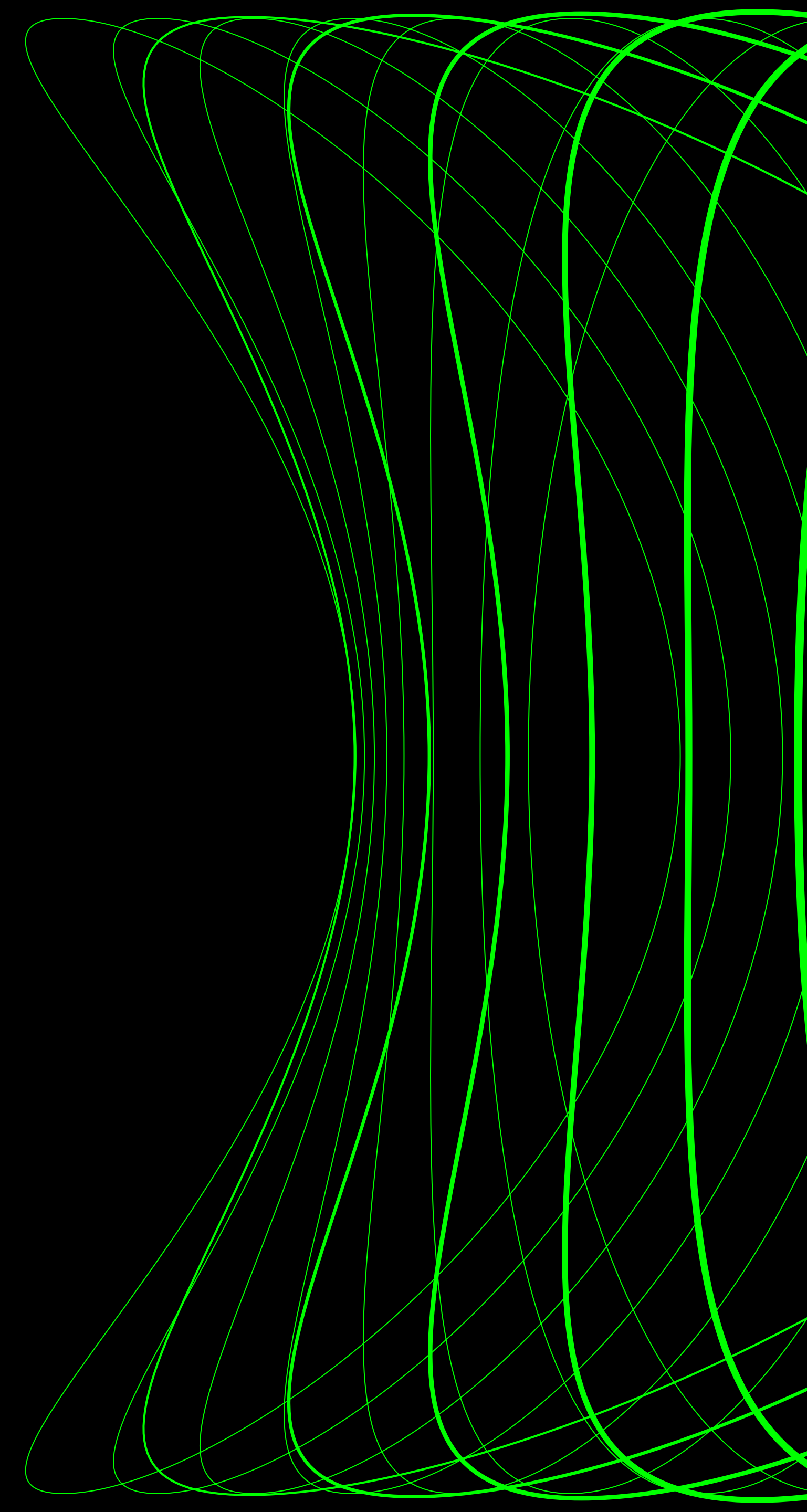
цифровой
прорыв

сезон: III

КЕЙС

БАНК РОССИИ

Создание модели для прогнозирования
макроэкономических показателей



Кейсодержатель

Название организации

Банк России

Сфера деятельности

Защита и обеспечение устойчивости рубля; развитие и укрепление банковской системы Российской Федерации; обеспечение стабильности и развитие национальной платежной системы; развитие финансового рынка Российской Федерации; обеспечение стабильности финансового рынка Российской Федерации.

Краткое описание кейса

Создание модели
для прогнозирования
макроэкономических показателей

Сайт организации

<https://www.cbr.ru/>

Постановка задачи

На основе исторических данных из нескольких сотен макроэкономических и финансовых показателей построить модель, которая сможет используя принципы метообучения адаптироваться к задачам прогнозирования новых переменных, в том числе имеющих короткую историческую длину.

Проблематика

Совершенствование методов прогнозирования является важной задачей как для центральных банков, так и для других экономических институтов, ведь точность и качество прогноза определяют качество принимаемых решений. Чем точнее прогноз, тем при прочих равных проще принимать решения.

Особенностью задач макроэкономического и макрофинансового прогнозирования является работа с наборами данных с относительно небольшим количеством на-

блюдений, что усложняет процесс построения качественных моделей.

Решение

Решение кейса представляет собой программный код модели, которая, принимая на вход исторические данные относительно общего набора показателей и исторические данные о переменной интереса (которую модель не видела в процессе обучения), прогнозирует динамику этой переменной на период от месяца до года.

Необходимые данные, дополнения /пояснения/уточнения

Для оценки модели и прогнозирования макроэкономических и финансовых показателей предлагается использовать набор данных, характеризующих различные аспекты экономической и финансовой ситуации в российской экономике.

Сформированный датасет будет предоставлен участниками и будет состоять из

данных, взятых из различных источников официальной статистики, включающих в том числе данные, опубликованные на официальных сайтах Росстата и Банка России.

Сайт Росстата: <https://rosstat.gov.ru>

Сайт Банка России: <https://cbr.ru>

Требования к результату и критерии оценивания

Для оценки решений применяется метод экспертных оценок и автоматизированные средства оценивания.

Жюри состоит из отраслевых экспертов и/или представителей Кейсодержателя.

На основании описанных ниже характеристик, жюри выставляет оценки 0-3 балла.

Итоговая оценка определяется, как сумма баллов всех экспертов, отраслевых и/или представителей Кейсодержателя, умноженная на значение метрики автоматического средства оценивания.



Технический эксперт оценивает решение по следующим критериям:

- 1. Запускаемость кода**
- 2. Обоснованность выбранного метода** (описание подходов к решению, их обоснование и релевантность задаче)
- 3. Точность работы алгоритма** (возможность оценить формальной метрикой с обоснованием выбора)
- 4. Адаптивность/
Масштабируемость**
- 5. Отсутствие в решении импортного ПО и библиотек, кроме свободно распространяемого с обоснованием выбора**

Автоматизированные средства оценивания точности работы предложенных участниками алгоритмов (решений) выставляют оценку в диапазоне 0-1, где 1 равно 100% точности работы решения.

Итоговая оценка определяется как итоговый балл жюри, умноженный на оценку автоматизированной системы.

Ссылки на датасет



https://ai-data.obs.ru-moscow-1.hc.sbercloud.ru/алгоритм_на_страже_экономической_стабильности.zip

**цифровой
прорыв** 

сезон: III

