



## Методика расчета консенсус-прогнозов

Настоящая Методика определяет правила и порядок расчета консенсус-прогнозов на основе прогнозов от участников рынка.

### Общие положения

1. Консенсус-прогнозы публикуются в разделе «Индексы» <https://cbonds.ru/indexes/> в категории «Консенсус-прогнозы».
2. Период прогнозирования для консенсус-прогнозов указан в названии индекса. Когда период прогнозирования становится не актуальным, консенсус-прогнозы переносятся в группу «Консенсус-прогнозы (архив)».
3. На странице консенсус-прогнозов в блоке «Котировки участников рынка» отражены прогнозные значения по данному индексу от участников рынка. В поле «ДАТА И ВРЕМЯ (UTC+3)» отображается дата прогноза от участника рынка, в полях «MIN» и «MAX» - диапазон прогнозируемого значения, в поле «LAST» - конкретное прогнозируемое значение.
4. Расчет консенсус-прогнозов осуществляется по группам индексов, указанных в Приложении №1.
5. Консенсус-прогнозы рассчитываются на основе прогнозов от участников рынка и итоговое значение консенсуса является значением индекса.
6. Консенсус-прогнозы рассчитываются на основе прогнозов от участников рынка, которые есть на конец дня. Если прогноз от участника появился позже, то данный прогноз будет учтен в консенсус-прогнозе за дату следующего расчета.

### Методика расчета

Консенсус-прогноз рассчитывается как медианное значение, имеет ежедневную периодичность. В расчет попадают прогнозы участников рынка **за последние 28 дней, включая дату расчета**. От каждого участника в расчете учитывается наиболее актуальный прогноз.

Алгоритм расчета:

1. Сбор значений

В расчет попадают котировки участников рынка **за последние 28 дней, включая дату расчета**. От каждого участника рынка в расчете учитывается наиболее актуальный прогноз.

Если от участника рынка по индексу дан диапазон значений, то для дальнейших шагов в расчете учитывается среднее значение данного диапазона.

2. Сортировка значений

Выбранные прогнозы участников рынка сортируются в порядке возрастания.

3. Расчет медианы

Медиана рассчитывается как значение, занимающее центральное положение после сортировки данных.

Если количество значений четное, медиана определяется как среднее арифметическое двух центральных значений.

#### 4. Формирование консенсус-прогноза:

Полученная медиана является консенсус-прогнозом на текущий день. Значение консенсус-прогноза является значением индекса.

Данная методика обеспечивает стабильный и регулярный расчет консенсус-прогнозов, основанных на медиане, что делает их устойчивыми к выбросам и изменениям в данных.

**Приложение №1: Группы консенсус-прогнозов, по которым осуществляется расчет**

- Валютные консенсус-прогнозы
- Консенсус-прогнозы доходностей облигаций
- Консенсус-прогнозы по процентным ставкам
- Консенсус-прогнозы по товарам
- Консенсус-прогнозы по ВВП
- Консенсус-прогнозы по инфляции
- Консенсус-прогнозы по экспорту
- Консенсус-прогнозы по импорту
- Консенсус-прогнозы по сальдо государственного бюджета к ВВП
- Консенсус-прогнозы по индексам