

表 1

宏观经济指标集

分类	月度经济指标
CPI	CPI: 总和, CPI: 食品烟酒, CPI: 衣着, CPI: 居住, CPI: 生活用品及服务, CPI: 交通和通信, CPI: 医疗保健
RPI	RPI: 总和, RPI: 食品, RPI: 饮料烟酒, RPI: 服装鞋帽, RPI: 纺织品, RPI: 家用电器及音像器材, RPI: 日用品, RPI: 化妆品, RPI: 金银珠宝, RPI: 燃料
PPI 和 IPI	出厂: 总和, 出厂: 生产资料, 出厂: 生产资料: 采掘业, 出厂: 生产资料: 原料业, 出厂: 生产资料: 加工业, 出厂: 生活资料, 出厂: 生活资料: 食品, 出厂: 生活资料: 衣着, 出厂: 生活资料: 一般日用品, 出厂: 生活资料: 耐用消费品, 购进: 总和, 购进: 燃料动力, 购进: 黑丝金属材料, 购进: 有色金属材料和电线, 购进: 化工原料, 购进: 木材及纸浆, 购进: 建筑材料及非金属矿, 购进: 其他工业原材料及半成品, 购进: 农副产品, 购进: 纺织原料
工业主要产品产量	铁矿石原矿, 烧碱, 塑料制品, 水泥, 生铁, 粗钢, 钢材, 乳制品, 纱, 布
能源主要产品产量	柴油, 焦炭, 发电量, 火力发电量
货币供应量	流通中现金(M0)供应量, 货币(M1)供应量, 货币和准货币(M2)供应量
进出口	进出口总值, <u>进出口总值</u> , 进口总值, 出口总值, 进口商品价格指数, 出口商品价格指数
固定资产投资	<u>固定资产投资额</u> , <u>房地产投资额</u>
社会消费品零售	社会消费品零售总额
财政及外汇	国家财政收入, 国家财政支出（不含债务还本）, 国家外汇储备
外商直接投资	<u>实际利用外商投资金额</u> , <u>外资企业实际利用外商投资金额</u>
企业商品价格指数	CGPI: 总和, CGPI: 企业矿产品, CGPI: 企业煤油电, CGPI: 企业农产品
消费者景气指数	消费者预期指数, 消费者满意指数, 消费者信心指数
银行间同业拆借利率	加权平均利率: 总和, 加权平均利率: 隔夜, 加权平均利率: 7 天, 加权平均利率: 15~20 天, 加权平均利率: 1 个月, 加权平均利率: 2 个月, 加权平均利率: 3 个月, 加权平均利率: 4 个月
金融机构存贷款	金融机构人民币各项存款（期末）, 金融机构人民币各项贷款（期末）
交通运输	<u>客运量</u> , <u>铁路客运量</u> , <u>公路客运量</u> , <u>水路客运量</u> , <u>民航客运量</u> , <u>货运量</u> , <u>铁路货运量</u> , <u>公路货运量</u> , <u>水路货运量</u> , <u>民航货运量</u>
邮电业务总量	<u>邮政业务总量</u> , <u>电信业务总量</u>
农业生产价格指数	农业生产资料价格指数（总和）

注：有下划线的为累计同比变量，其他为当月同比变量。

表 2

2018 年估算结果与 2018 年实际数据对比

		行业 1	行业 2	行业 3	行业 4	行业 5	行业 6	行业 7	行业 8	行业 9
中间投入 （万亿元）	预测值	4.6872	88.2522	19.1262	4.2015	6.1529	2.5797	4.5405	2.1693	20.3776
	真实值	4.3029	89.7082	20.2567	4.6156	6.1514	2.9235	4.7194	2.3859	22.2807
中间投入率	预测值	0.4096	0.7456	0.7449	0.3209	0.6040	0.6096	0.3914	0.2513	0.4995
	真实值	0.3867	0.7500	0.7570	0.3448	0.5461	0.6454	0.4360	0.2594	0.5200
中间投入贡 献系数	预测值	1.4700	0.3384	0.3540	2.1522	0.6820	0.6263	1.6245	3.0216	1.0037
	真实值	1.5859	0.3334	0.3210	1.9002	0.8311	0.5494	1.2934	2.8557	0.9230

表 3

各行业增加值及最终使用预测效果

			行业 1	行业 2	行业 3	行业 4	行业 5	行业 6	行业 7	行业 8	行业 9
增加值	高维 DFM _s	RMSE	0.4730	1.9178	0.4204	0.5232	0.4014	0.0263	1.3086	0.4104	1.3509
		MAPE	0.0819	0.0623	0.1039	0.1487	0.0614	0.0242	0.2372	0.1171	0.1321
		NRMSE	0.4805	0.4835	0.3929	0.6101	0.1847	0.1187	0.8798	0.3094	0.3279
	DFM _s	RMSE	0.4711	1.4100	0.4773	0.3919	0.5190	0.0164	1.0635	0.2097	1.5019
		MAPE	0.0873	0.0483	0.1282	0.1205	0.0778	0.0136	0.1551	0.0588	0.1335
		NRMSE	0.4786	0.3555	0.4461	0.4570	0.2388	0.0738	0.7150	0.1581	0.3645
	ARIMA	RMSE	1.9007	2.2849	0.2797	1.0838	1.3758	0.0658	1.1085	0.5048	1.9768
		MAPE	0.3487	0.0852	0.0473	0.3310	0.1833	0.0566	0.2514	0.0854	0.1877
		NRMSE	1.9309	0.5760	0.2614	1.2639	0.6330	0.2971	0.7453	0.3806	0.4797
最终使用	高维 DFM _s	RMSE	0.8447	1.8074	1.3281	0.2685	1.1916	0.1063	0.2304	0.1682	0.4229
		MAPE	0.2935	0.0414	0.0842	0.1244	0.2566	0.0614	0.1447	0.0439	0.0309
		NRMSE	1.6038	0.4343	0.2876	0.4967	0.9213	0.2926	0.3893	0.1870	0.0835
	DFM _s	RMSE	0.8787	1.8882	1.3521	0.2312	1.1520	0.2638	0.1728	0.4497	1.8982
		MAPE	0.2949	0.0403	0.0955	0.0945	0.3030	0.1806	0.1052	0.1249	0.1154
		NRMSE	1.6683	0.4537	0.2928	0.4277	0.8907	0.7260	0.2919	0.4997	0.3749
	ARIMA	RMSE	1.3556	2.9694	0.8052	0.6794	1.1405	0.2761	0.2744	0.2243	2.3833
		MAPE	0.4662	0.0914	0.0558	0.2587	0.3156	0.1978	0.1855	0.0589	0.1675
		NRMSE	2.5739	0.7135	0.1744	1.2568	0.8818	0.7598	0.4637	0.2493	0.4707
进口	高维 DFM _s	RMSE	0.0425	2.2005	0.0236	0.0000	0.1961	0.0120	0.0249	0.0000	0.0773
		MAPE	0.0781	0.1976	0.5898	0.0000	0.3125	0.0523	0.4190	0.0000	0.0746
		NRMSE	0.6251	1.9822	1.4043	0.0000	0.8619	0.0849	0.5512	0.0000	0.3503
	DFM _s	RMSE	0.1389	2.2573	0.0267	0.0000	0.1672	0.0556	0.0243	0.0000	0.0516
		MAPE	0.2449	0.2130	0.6497	0.0000	0.2377	0.1562	0.2575	0.0000	0.0581
		NRMSE	2.0443	2.0333	1.5907	0.0000	0.7350	0.3946	0.5381	0.0000	0.2339
	ARIMA	RMSE	0.2028	1.1686	0.0235	0.0000	0.2139	0.0739	0.0319	0.0000	0.0916
		MAPE	0.3291	0.1103	0.5795	0.0000	0.3193	0.2311	0.3146	0.0000	0.1051
		NRMSE	2.9854	1.0527	1.4020	0.0000	0.9400	0.5251	0.7075	0.0000	0.4152

注：其中 MAPE 及 NRMSE 指标对应的数字没有单位，其余数字单位为万亿元。