

Контрольна робота з курсу «Прогнозування»

Завдання:

За допомогою сайту www.bank.gov.ua створити файл, що містить помісячну інформацію про заданий у варіанті часовий ряд з 2001 по 2007 роки.

1. Перевірити ряд на стаціонарність за допомогою „методу поворотних значень”.
2. Побудувати та оцінити найкращу модель з трендом.
3. Здійснити згладжування за 6 різними методами.
4. Визначити наявність сезонних коливань.
5. Здійснити прогнозування за моделями, що були побудовані в пп. 2-5.
6. Перевести ряд до стаціонарного методом „різниць”. Над отриманим рядом виконати завдання пп.2-6.
7. Обрати і оцінити найкращу *ARIMA*–модель.
8. Обрати і оцінити найкращу *GARCH*–модель.
9. Використовуючи всі наявні дані, побудувати найкращу економетричну модель.
10. Виписати прогнози на 2008 рік за всіма побудованими моделями.

Варіант 1

Часовий ряд: M0

Варіант 2

Часовий ряд: M2

Варіант 3

Часовий ряд: M3

Варіант 4

Часовий ряд: M1

Варіант 5

Часовий ряд: Витрати та заощадження населення

Варіант 6

Часовий ряд: Інвестиції в основний капітал

Варіант 7

Часовий ряд: Обсяг промислової продукції

Варіант 8

Часовий ряд: Обсяг продукції сільського господарства

Варіант 9

Часовий ряд: Середньомісячна номінальна заробітна плата працівників

Варіант 10

Часовий ряд: Кредити, надані у національній валюті

Варіант 11

Часовий ряд: Середній курс гривні до австралійського долара

Варіант 12

Часовий ряд: Середній курс гривні до канадського долара

Варіант 13

Часовий ряд: Середній курс гривні до євро

Варіант 14

Часовий ряд: Середній курс гривні до російського рубля

Варіант 15

Часовий ряд: Кредити, надані у іноземній валюті