

Интервальное прогнозирование по оцененной эконометрической модели

1. Прогнозирование доверительными интервалами и проверка адекватности модели
2. Формулировка домашнего творческого задания на тему “построение модели делового цикла экономики России с учетом мирового финансового кризиса, санкций и стоимостью денег во времени”
3. ДЗ

Таким образом интервал нижняя граница $Y_0^- = 21407,07$, верхняя граница $Y_0^+ = 23470,7$ с вероятностью в 95% накрывает истинное значение. В нашем примере 2018 год, это год контролирующей выборки, и по скольку доверительный интервал накрыл значение эндогенной переменной из контролирующей выборки, то у нас есть основания интерпретировать оценённую модифицированную модель Самуэльсона-Хикса, как адекватную (по ней можно прогнозировать).

Если доверительные интервалы (с разумными уровнями доверительной вероятности) не накрывают значение эндогенных переменных из контролирующей выборки, то модель признаётся не адекватной и следует искать ошибку в спецификации (например, в пропуске значащих объясняющих переменных (это понятие будет точно определено на следующем занятии)). Одно из назначений модели это прогнозирование.

ДЗ Осуществить прогнозирование к модифицированным моделям государственных расходов и инвестиций в России.

ДТЗ Построение модели делового цикла экономики России с учетом мирового финансового кризиса, санкций и стоимостью денег во времени. Объясняющая переменная в такой модели выбрать привлекая модифицированный коэффициент детерминации, проверить адекватность оценённой модели с помощью интервального прогнозирования на дату контролирующей выборки. Исследовать отсутствие автокорреляции у случайных возмущений модели. Срок сдачи [через 2 недели (16 декабря)].

Структура ДТЗ:

А. Титульный лист имя автора и проверяющего.

В. Содержание:

- постановка задачи
- методичка решения
- полученные результаты и выводы
- Список литературы.
- Приложение

Оценивание модели может быть либо в Excel, либо в RStudio.