







Название матрицы	Комментарий
<code>all</code>	все данные, скаченные из EViews, содержат данные с 1992 г, включают столбец <code>obs</code> , <code>time</code> и <code>time_y</code>
<code>df_sa</code>	то же, что и <code>all</code> , но без <code>obs</code> и <code>time</code>
<code>df_final</code>	то же, что и <code>df_sa</code> , но данные с 1995 г., часть переменных прологарифмирована
<code>df</code>	то же, что и <code>df_final</code> , но с индексом <code>t</code> , отражающим номер наблюдения
<code>fit_set_2var</code>	показывает, какие переменные входят в <code>fit_set</code> из двух переменных
<code>fit_set_3var</code>	показывает, какие переменные входят в <code>fit_set</code> из трех переменных
<code>fit_set_info</code>	объединение <code>fit_set_2var</code> и <code>fit_set_3var</code>
<code>add_3</code>	список переменных, входящих в набор из трех переменных
<code>add_6</code>	список переменных, входящих в набор из шести переменных
<code>add_23</code>	список переменных, входящих в набор из 23 переменных
<code>var_set_info</code>	объединение таблиц <code>add_3</code> , <code>add_6</code> и <code>add_23</code>
<code>actual_obs</code>	таблица с данными, где все наблюдения стоят друг под другом
<code>deltas</code>	список $\delta_i$ для каждой переменной и вида модели для in-sample расчетов
<code>rwwn_list</code>	описание двух моделей для in-sample расчетов (RW и WN)
<code>rwwn_forecast_list</code>	обозначение моделей, для которых будут строиться in-sample прогнозы
<code>rwwn_forecasts</code>	все in-sample прогнозы для всех переменных в каждый момент времени по RW и по WN
<code>rwwn_obs</code>	объединение <code>rwwn_forecasts</code> с фактическими наблюдениями и квадратом ошибки
<code>msfe0_all</code>	среднеквадратичная ошибка по каждой переменной по RW и WN
<code>rwwn_wlist</code>	описание оцененных RW и WN моделей.
<code>msfe0</code>	среднеквадратичная ошибка по каждой переменной для каждой переменной в соответствии с тем классом временного ряда, который был выбран тестом на (не)стационарность
<code>var_list</code>	описание всех частотных VAR-моделей, подлежащих оценке
<code>var_forecast_list</code>	список VAR моделей, по которым строятся прогнозы
<code>var_forecasts</code>	in-sample прогнозы по VAR-моделям (для каждого периода времени, сортировано по моделям)
<code>var_obs</code>	то же, что и <code>var_forecasts</code> плюс фактические значения и квадрат ошибки
<code>msfe_Inf</code>	msfe in-sample прогнозов VAR, сортировано по переменным
<code>var_wlist</code>	подробное описание оцененных VAR моделей
<code>msfe_Inf_info</code>	объединение <code>msfe_Inf</code> с информацией о самой модели
<code>msfe_0_Inf</code>	объединение <code>msfe_Inf_info</code> с msfe по RW или WN и соотношение MSFE
<code>fit_inf_table</code>	подсчет <code>fit</code> для каждого <code>fit_set</code> , <code>var_set</code> и количества

<code>bvar_forecast_list</code>	список прогнозов по BVAR моделям
<code>bvar_forecasts</code>	прогнозы in-sample по всем переменным в каждый момент времени
<code>bvar_obs</code>	то же, что и <code>bvar_forecasts</code> , но с фактическими наблюдениями и квадратом ошибки
<code>msfe_lam</code>	среднеквадратичная ошибка для каждой переменной и каждой BVAR-модели, в которой она участвует
<code>bvar_wlist</code>	полная таблица с описанием BVAR моделей
<code>msfe_lam_info</code>	объединение <code>msfe_lam</code> с описанием каждой модели
<code>msfe_0_lam</code>	объединение <code>msfe_lam_info</code> с <code>msfe</code> по RW или WN и соотношение MSFE
<code>fit_lam_table</code>	считает <code>fit</code> для каждой возможной модели, для каждого <code>var_set</code> и <code>fit_set</code>
<code>fit_goal</code>	содержит <code>fit</code> для VAR-модели из 3 переменных для разного количества лагов и для разных <code>fit_set</code>
<code>fit_lam_table</code>	сопоставляет с <code>fit_lam_table</code> с <code>fit_goal</code> и рассчитывает разницу <code>fit</code> -ов.
<code>best_lambda</code>	для каждой модели и номера лагов выбирает такое сочетание гиперпараметров, при котором отличие <code>fit</code> в BVAR наименьшее
<code>bvar_out_list</code>	описание всех моделей BVAR, для которых будет строиться прогноз out-of-sample
<code>bvar_out_forecast_list</code>	расширенный список оцененных BVAR, подсчитанных по схеме rolling window
<code>bvar_out_forecasts</code>	out-of-sample прогнозы для всех переменных, для всех BVAR моделей для каждого момента времени
<code>bvar_out_obs</code>	совмещает <code>bvar_out_forecasts</code> с фактическими значениями и информацией о модели, считает квадрат ошибки
<code>omsfe_bvar_table</code>	содержит out-of-sample MSFE для каждой переменной для каждого набора данных, количества лагов, прогнозного окна и <code>fit_set</code>
<code>rwnn_var_unique_wlist</code>	содержит список моделей (VAR,RW,WN) с которыми происходит сравнение прогнозной способности BVAR
<code>rwnn_var_out_list</code>	полная информация по всем RW,WN и VAR моделям, по которым строится прогноз out-of-sample
<code>rwnn_var_out_forecast_list</code>	список всех прогнозных моделей и максимальных прогнозных окон по ним. Модели, использующие наблюдения, в конце выборки имеют меньшее прогнозное окно, чем более ранние за отсутствием наблюдений, с которыми прогноз будет сравниваться.
<code>rwnn_var_out_forecasts</code>	все out-of-sample прогнозы по VAR,RW и WN моделям
<code>rwnn_var_out_obs</code>	сопоставляет <code>rwnn_var_out_forecasts</code> с фактическими наблюдениями и с информацией о типе модели, также считает квадрат ошибки
<code>omsfe_rwnn_var_table</code>	выдает MSFE по каждой переменной для моделей VAR,RW и WN для каждого набора переменных, количества лагов, прогнозного окна
<code>omsfe_selected_rwnn</code>	выбирает MSFE по RW и WN для каждой переменной в соответствии с тестом на (не)стационарность

omsfe_bvar_table	MSFE прогнозов по каждой переменной в зависимости от <b>fit_set</b> , количества лагов и горизонта прогнозирования
omsfe_var_banbura	MSFE по VAR - моделям только для переменных, входящих в <b>desired_fit_set</b>
omsfe_var_banbura	MSFE по BVAR - моделям только для переменных, входящих в <b>desired_fit_set</b>
omsfe_rwwb_banbura	MSFE по RW и WN - моделям только для переменных, входящих в <b>desired_fit_set</b>
var_bvar_omsfe_banbura_table	MSFE по VAR и BVAR, нормированные на MSFE по RW и WN, для переменных, входящих в <b>desired_fit_set</b> .
all_rmsfe_wide	Перегруппировка <b>var_bvar_omsfe_banbura_table</b>
some_rmsfe_wide	То же, что и <b>all_rmsfe_wide</b> , но для выбранных прогнозных окон
create_best_var_list	выбор наилучшего лага для VAR по критерию Шварца