

РАЗРАБОТКА И ПРИМЕНЕНИЕ МОДЕЛЕЙ MSVARX ДЛЯ АНАЛИЗА ЭКОНОМИЧЕСКИХ ЦИКЛОВ

Макаревич А.С.

Белорусский Государственный Университет

Минск, 2018

План доклада

Описание задач

Анализ экономических циклов

Декомпозиция временных рядов

Модели с переключением состояний

Экспериментальные исследования

Корректировка по Хамильтону

Моделирование с MS-ARX

Разработка библиотеки TS4DS

Задача анализа экономических циклов

- ▶ Базовый ряд – Реальный ВВП РБ (цены 2014 г.)
- ▶ Экономический цикл (по НБЭИ США)
 - ▶ объект: тренд ВВП
 - ▶ фазы: «рост» и «спад»
 - ▶ точки: «пик» и «дно»

Задача анализа экономических циклов

- ▶ Базовый ряд – Реальный ВВП РБ (цены 2014 г.)
- ▶ Экономический цикл (по НБЭИ США)
 - ▶ объект: тренд ВВП
 - ▶ фазы: «рост» и «спад»
 - ▶ точки: «пик» и «дно»
- ▶ Опережающий индикатор – Индекс Экономических Настроений (ИЭН)
 - ▶ по данным сист. мониторинга предприятий НБ РБ
 - ▶ циклы опережают ВВП на 4-5 месяца

Декомпозиция временных рядов

Хамильтона

Модели с переключением состояний

По MS-ARX

План доклада

Описание задач

Анализ экономических циклов

Декомпозиция временных рядов

Модели с переключением состояний

Экспериментальные исследования

Корректировка по Хамильтону

Моделирование с MS-ARX

Разработка библиотеки TS4DS

Корректировка по Хамильтону

Картинки по Хам

Моделирование с MS-ARX

Картинки режимов

План доклада

Описание задач

Анализ экономических циклов

Декомпозиция временных рядов

Модели с переключением состояний

Экспериментальные исследования

Корректировка по Хамильтону

Моделирование с MS-ARX

Разработка библиотеки TS4DS

Библиотека TS4DS

1. content...
2. c2