Белорусский государственный университет

|  |  |
| --- | --- |
|  | Кафедра математического моделирования и анализа данных  УТВЕРЖДАЮ  Заведующий кафедрой \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ Бодягин И.А.  «\_\_» \_\_\_\_\_\_\_\_ 2018 г. |

**ЗАДАНИЕ НА ДИПЛОМНУЮ РАБОТУ**

Обучающегося Макаревич А.С.

1. Тема дипломной работы Разработка и применение моделей MS-VARX для анализа экономических циклов

Утверждена приказом ректора БГУ от 22.11.2017 №1641-ПС

1. Исходные данные к дипломной работе
2. Сайт Национального банка Республики Беларусь // [Электронный ресурс] / Режим доступа: http://www.nbrb.by. Дата доступа: 10.09.2016.
3. Разработка системы опережающих экономических индикаторов и экономических диффузных индексов для основных видов экономической деятельности и экономики Республики Беларусь в целом с использованием экономико-математических, эконометрических методов и моделей на основе данных системы мониторинга предприятий Национального банка Республики Беларусь: отчет о НИР (заключ.) / 40 НИИ ППМИ; рук. В.И. Малюгин. — Минск, 2017. — 142 с. — ГР 20162817.
4. *Stata Press*. Datasets for Stata Time-Series Reference Manual, Release 12. // [Электронный ресурс] / Режим доступа: https://www.stata-press.com/data/r12/ts.html. Дата доступа: 17.03.2018
5. Перечень подлежащих разработке вопросов

3.1. Метода Хамильтона как альтернатива фильтру Ходрика – Прескотта

3.2. Модели семейства MS-VARX для анализа экономических циклов

3.3. Разработка библиотеки для анализа временных рядов

4. Перечень графического материала: результаты компьютерного моделирования рядов и оценивания моделей.

5. Дата выдачи задания \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

6. Срок сдачи законченной дипломной работы \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

Руководитель \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ Малюгин В.И.

Подпись обучающегося \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

Дата \_\_\_\_ \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_