Этапы прогнозирования.

1. Моделирование. Или спецификация. То есть процесс описания модели исследования и её составляющих.

Виды переменных:

-Эндогенные (зависимые, результативный признак) – та переменная, которую в дальнейшем мы будем прогнозировать, и она рассчитывается на основе модели. Обозначение - y  
-Экзогенные (независимые, факторные признаки) – то, что мы подставляем в модель в виде известных значений. Обозначение – x.

Построение линейной модели:

, где е – случайное возмущение, погрешность случайной модели (то есть то, что не включено в модель, но может повлиять), а, b – коэффициенты.

Y(с крышечкой) – оценка идеальной модели (то есть её упрощение). Тогда случайное возмущение писать не требуется (модель идеальная)

Метод наименьший квадратов – сумма квадратов отклонений значений от прогнозируемой и есть величина е.

*– RSS.*

Этапы прогнозирования:

1. Точечный прогноз переменных (факторов)
2. Точечный прогноз зависимой переменной
3. Интервальный прогноз зависимой переменной (добавить и отнять ошибку прогноза U)

Как посчитать U?