

РЕФЕРАТ

Магістерська дисертація: 95 с., 8 рис., 8 табл., 3 додатки, 34 джерела.

Об'єкт дослідження – прогнозування макроекономічних показників.

Предмет дослідження – методи оцінки кількості факторів та оптимального лагу у динамічній факторній моделі.

Мета роботи – проаналізувати предмет дослідження, розглянути методи визначення оптимальної кількості параметрів, порівняти їх роботу на реальних даних.

У роботі розглянуто два методи оцінювання оптимальної кількості факторів, що входять в модель, та максимального лагу, з яким вони входять в модель. Перший метод заснований на інформації, що міститься в автоковаріаціях різних порядків, а другий - на мінімізації похибки передбачення. Обидва методи були застосовані до даних за депозитними банківськими ставками України за останні 10 років і порівняні на основі результатів застосування.

Були виявлені переваги та недоліки методів у порівнянні один з іншим, та дані рекомендації щодо вибору методів в залежності від даних, на основі яких буде проводитися моделювання. Зокрема, перший метод не дає бажаного результату на сильно корельованих на різних вимірах даних.

Новизна даної роботи полягає в застосуванні альтернативного методу, а саме методу, що заснований на інформації в автоковаріаційних матрицях, до моделювання макроекономічних даних, та порівнянні його зі стандартним методом на основі похибки передбачення.

В подальших дослідженнях пропонується модифікувати метод на основі інформації в автоковаріаційних матрицях, щоб обійти обмеження методу на сильну корельованість даних.

ДИНАМІЧНА ФАКТОРНА МОДЕЛЬ, ДЕПОЗИТНІ СТАВКИ,
ІНФОРМАЦІЯ КУЛЬБАКА-ЛЯЙБЛЕРА, КРИТЕРІЙ БАРТЛЕТА, ФІЛЬТР
КАЛМАНА