

РЕФЕРАТ

Дипломна робота: 103 с., 41 рис., 9 табл., 2 дод., 15 джерел.

СТАЦІОНАРНІСТЬ ЧАСОВИХ РЯДІВ, КОІНТЕГРАЦІЯ,
МАКРОЕКОНОМІЧНІ ФАКТОРИ, ВЕКТОРНА АВТОРЕГРЕСІЯ,
ВЕКТОРНА МОДЕЛЬ КОРЕКЦІЇ ПОМИЛОК

Об'єкт дослідження – часові ряди обсягів продажів автомобілів на ринку України та часові ряди деяких макроекономічних показників України.

Предмет дослідження – моделі прогнозування з використанням макроекономічних параметрів.

Мета дослідження – проаналізувати об'єкт дослідження, побудувати деякі макроекономічні моделі, провести порівняння результатів.

Методи дослідження – метод перевірки стаціонарності: доповнений тест Діккі-Фуллера; метод перевірки коінтеграції: тест Йохансена.

Актуальність – планування стратегії дій є обов'язковим для будь-якого бізнесу. Враховуючи досить складні економічну та політичну ситуації в Україні, необхідно будувати адекватні моделі прогнозування майбутнього попиту, що врахують їх вплив.

Результати дослідження – було побудовано і порівняно результати двох моделей – векторної авторегресії та векторної моделі корекції помилок.

Шляхи подальшого розвитку предмету дослідження – використання у прогнозуванні додаткових змінних, що можуть мати вплив на об'єкт дослідження, а також вивчення та порівняння результатів з іншими методами прогнозування.