

Ekonometria (MSZ) – Zadanie domowe 4

Paweł Cibis

20 maja 2007

Wykonaj prostą analizę szeregu czasowego:

1. Przygotuj szereg czasowy (powinien zawierać w miarę wyraźne wahania sezonowe).
2. Sporządź wykres liniowy szeregu czasowego.
3. Kilka ostatnich obserwacji potraktuj jako wartości nieznane (model będzie miał za zadanie dokonać ich prognozy).
4. Wyodrębnij linię trendu (np. za pomocą funkcji REGLINW).
5. Na podstawie wykresu ustal liczbę faz wahań i wyodrębnij wahania sezonowe – przyjmij model addytywny lub multiplikatywny (na dodatkowe punkty można zrobić oba modele).
6. Oblicz wartości wynikające z obu modeli (z uwzględnieniem wahań).
7. Dla każdego modelu oblicz średniokwadratowe błędy prognozy *ex post* na podstawie rzeczywistych i teoretycznych wartości kilku ostatnich obserwacji (przeznaczonych wcześniej na prognozę).

Za zadanie będzie można otrzymać do 6 punktów.

Termin oddania: 4 czerwca 2007

Życzę powodzenia!

Paweł Cibis