

Завдання для самостійної роботи з курсу «Фінансове прогнозування»

1. Виконайте завдання самостійної роботи Вашого варіанту. Номер варіанту відповідає Вашому номеру у списку журналу групи.
2. Результати роботи слід оформити у вигляді **скріпленого надрукованого** документу обсягом 10-15 сторінок, що має містити:
 - а. титульну сторінку (обов'язково слід вказати номер варіанту та прізвище виконавця);
 - б. виконані завдання роботи (кожне завдання має починатися з нової сторінки);
 - с. список використаної літератури (на окремій сторінці).
3. Роботу слід вкласти до прозорого файлу разом з дискетою, що містить електронну версію роботи (разом з відповідними файлами та даними), та здати викладачу **до 15.25 11 квітня 2008 року**.

Завдання 1. Виконати аналіз часових рядів у Вашій базі даних (квартальні чи місячні дані 3 різних економічних змінних, кожен ряд містить не менше 30 спостережень) за допомогою всіх відомих Вам методів аналізу та прогнозування (метод поворотних точок, методи згладжування, методи виділення тренду, виділення сезонності, моделювання стаціонарних часових рядів). Вибрати найкращий метод, довести правильність вибору. На основі обраного методу здійснити прогнозування на 2008 рік. Оформити результати (в роботі мають бути представлені початкові дані, результати застосування кожного з методів, доведення вибору найкращої моделі, прогнози на 2008 рік, графічне представлення інформації, висновки).

Завдання 2. Написати звіт про роботу та основні досягнення відомого економіста, що має значні здобутки в теорії та практиці аналізу часових рядів (згідно номеру варіанта). Слід зазначити його коротку біографію, основні праці, результати, їхнє застосування в сучасній економіці, здобуті нагороди (3-5 сторінок).

Варіанти завдання 2.

- | | |
|-------------------------------|-----------------------------|
| 1. Бокс (Box) | 16.Прескотт (Prescott E.C.) |
| 2. Болерслев (Bollerslev T.) | 17.Пао (Rao P.) |
| 3. Гамільтон (Hamilton J.D.) | 18.Сімс (Sims C.A.) |
| 4. Глейзер (Glejzer) | 19.Сток (Stock J.H.) |
| 5. Голдфельд (Goldfeld) | 20.Тобін (Tobin) |
| 6. Грейнджер (Granger C.W.J.) | 21.Уайт (White H.) |
| 7. Грін (Greene W.) | 22.Уотсон (Watson M.W.) |
| 8. Дж. Тейлор (Taylor J.) | 23.Фелпс (Phelps E.S.) |
| 9. Діболд (Diebold F.X.) | 24.Фулер (Fuller W.A.) |
| 10.Діккі Д. (Dickey D.) | 25.Хансен (Hansen L.P.) |
| 11.Енгл (Engle R.F.) | 26.Харві (Harvey A.C.) |
| 12.Йохансен (Johansen S.) | 27.Хендрі (Hendry D.F.) |
| 13.Кальман (Kalman) | 28.Хілдрет (Hildreth C.) |
| 14.Лукас (Lucas R.E.) | 29.Чоу (Chow G.C.) |
| 15.Нельсон (Nelson C.R.) | 30.Юл (Yule G.U.) |