

## **Контрольна робота з курсу «Прогнозування»**

### **Завдання:**

За допомогою сайту [www.bank.gov.ua](http://www.bank.gov.ua) створити файл, що містить помісячну інформацію про заданий у варіанті часовий ряд з 2001 по 2005 роки.

1. Перевірити ряд на стаціонарність за допомогою „методу поворотних значень”.
2. Побудувати та оцінити найкращу модель з трендом.
3. Здійснити згладжування за 6 різними методами.
4. Визначити наявність сезонних коливань.
5. Здійснити прогнозування за моделями, що були побудовані в пп. 2-5.
6. Перевести ряд до стаціонарного методом „різниць”. Над отриманим рядом виконати завдання пп.2-6.
7. Обрати і оцінити найкращу *ARIMA*–модель.
8. Обрати і оцінити найкращу *GARCH*–модель.
9. Використовуючи всі наявні дані, побудувати найкращу економетричну модель.
10. Виписати прогнози на 2006 рік за всіма побудованими моделями.

### **Варіант 1**

Часовий ряд: M0

### **Варіант 2**

Часовий ряд: M2

### **Варіант 3**

Часовий ряд: M3

### **Варіант 4**

Часовий ряд: M1

### **Варіант 5**

Часовий ряд: Витрати та заощадження населення

### **Варіант 6**

Часовий ряд: Інвестиції в основний капітал

**Варіант 7**

Часовий ряд: Обсяг промислової продукції

**Варіант 8**

Часовий ряд: Обсяг продукції сільського господарства

**Варіант 9**

Часовий ряд: Середньомісячна номінальна заробітна плата працівників

**Варіант 10**

Часовий ряд: Кредити, надані у національній валюті

**Варіант 11**

Часовий ряд: Середній курс гривні до австралійського долара

**Варіант 12**

Часовий ряд: Середній курс гривні до канадського долара

**Варіант 13**

Часовий ряд: Середній курс гривні до євро

**Варіант 14**

Часовий ряд: Середній курс гривні до російського рубля

**Варіант 15**

Часовий ряд: Кредити, надані у іноземній валюті