

## **Завдання для самостійної роботи з курсу «Часові ряди»**

1. Виконайте завдання самостійної роботи Вашого варіанту (варіанти знаходяться на с.2 даного документу). 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:
  - a. титульну сторінку (обов'язково слід вказати номер варіанту та прізвище виконавця);
  - b. виконані завдання роботи (кожне завдання має починатися з нової сторінки);
  - c. список використаної літератури (на окремій сторінці).
3. Роботу слід вкласти до прозорого файлу разом з дискетою, що містить електронну версію роботи (разом з відповідним файлом в середовищі EViews), та здати викладачу **до 14.00 6 грудня 2005 року**.

**Завдання 1.** Написати звіт про роботу та основні досягнення відомого економіста, що має значні здобутки в теорії та практиці аналізу часових рядів. Слід зазначити його коротку біографію, основні праці, результати, їхнє застосування в сучасній економіці, здобуті нагороди (3-5 сторінок).

**Завдання 2.** З обраних на початку семестру 5 часових рядів обрати 1, для якого реалізувати **ВСІ** вивчені протягом семестру методи прогнозування. Результатом роботи має бути:

- дані часового ряду (назва, періодичність, безпосередньо дані);
- зведена таблиця прогнозних значень за ВСІМА методами на 4-6 періодів;
- зведена таблиця помилок прогнозування (на основі даних 2005 року);
- обґрунтований вибір найкращої моделі прогнозування;
- повна інформація по обраній моделі, її розрахунку, реалізації, графічному представленню тощо.

### **Варіанти завдання 1.**

1. Фелпс (Phelps E.S.)
2. Прескотт (Prescott E.C.)
3. Лукас (Lucas R.E.)
4. Дж. Тейлор (Taylor J.)
5. Фулер (Fuller W.A.)
6. Сімс (Sims C.A.)
7. Грейнджер (Granger C.W.J.)
8. Уотсон (Watson M.W.)
9. Хансен (Hansen L.P)
10. Діболд (Diebold F.X.)
11. Юл (Yule G.U.)
12. Сток (Stock J.H.)
13. Нельсон (Nelson C.R.)
14. Харві (Harvey A.C.)
15. Хендрі (Hendry D.F.)
16. Гамільтон (Hamilton J.D.)
17. Болерслев (Bollerslev T.)
18. Чоу (Chow G.C.)
19. Енгл (Engle R.F.)
20. Хілдрет (Hildreth C.)