

Лабораторная работа №1. Формы временного ряда.

1. Исходный временной ряд преобразовать в индексные формы (базисная, цепная, к соответствующему периоду предыдущего года, нарастающим итогом соответствующему периоду предыдущего года). Построить графики, сравнить их.
2. Провести анализ на стационарность рядов из п.1. в пакете EViews, с помощью всех имеющихся тестов. Результат оформить в таблицу в следующем виде (Это образец):

Таблица

Результаты применения тестов ADF и KPSS

Переменная	ADF тест			KPSS тест			Результат
	спецификация	ADF статистика	Критические значения	спецификация	LM статистика	Критические значения	
k	T,4	-2.275	-3.533	T	0.166	0.146	I(1)
Δk	N,3	-2.282	-1.949	C	0.177	0.463	I(0)
ms	T,1	-7.242	-3.523	T	0.083	0.164	I(0)
gr	T,4	-4.218	-3.544	T	0.181	0.146	–

Примечание к таблице 2. Для ADF теста спецификация T означает, что тестируемая модель содержит тренд и константу, C – модель содержит только константу, N – модель без тренда и константы. Различные спецификации тестируемых моделей имеют свои собственные критические значения, используемые при тестировании нулевых гипотез. Для ADF теста в спецификации, после типа модели, приведено количество запаздывающих разностей. Для KPSS теста спецификация T означает, что нулевая гипотеза – ряд стационарный относительно тренда, а альтернативная – нестационарный с константой, C означает, что нулевая гипотеза – ряд стационарный с константой, а альтернативная – нестационарный без константы.