

Лабораторная работа №2. Разложение временного ряда на составляющие динамики.

1. Исходный временной ряд в уровнях (тот же что и Л.р.№1) разложить на составляющие динамики с помощью фиктивных переменных. Построить графики фактического и смоделированного значения и остатков. Ряд остатков проверить на стационарность. Дать экономическую интерпретацию имеющихся структурных изменений.
2. Построить ретропрогноз на 1 год по модели, построенной в п.1. Для этого исходный ряд разбиваем на два интервала. На первом переоцениваем модель из п.1. и по ней строим прогноз. Построенный прогноз сравниваем с имеющимся фактом (второй интервал), вычисляем ошибку точности прогноза MAPE. Построить графики фактического и спрогнозированного значения.
3. Построить прогноз на 2 года вперед по модели построенной в п.1.
4. Оформить отчет в Word.