

Projekt zaliczeniowy z „Ekonometrii i prognozowania”
Uniwersytet WSB Merito w Toruniu 2023/2024

Nr indeksu
Imię i Nazwisko
Nr grupy ćwiczeniowej
Imię i Nazwisko prowadzącego

1. Specyfikacja modelu

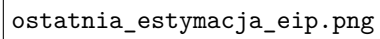
1.1. Zapis hipotezy modelowej

2. Estymacja modelu

2.1. Wklejenie wyników pierwszej estymacji parametrów modelu

pierwsza_estymacja_eip.png

2.2. Wklejenie wyników ostatniej estymacji parametrów modelu (po eliminacji *a posteriori*)

A rectangular box with a thin black border, intended for a screenshot or image. The text 'ostatnia_estymacja_eip.png' is written in the bottom-left corner of the box.

ostatnia_estymacja_eip.png

2.3. Zapis modelu empirycznego

3. Weryfikacja modelu

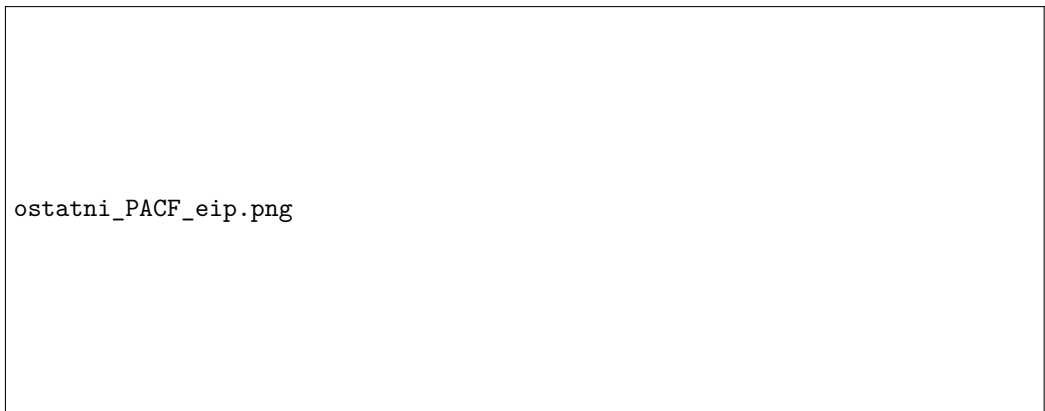
3.1. Weryfikacja istotności parametrów strukturalnych

3.2. Weryfikacja istotności współczynnika R^2

3.3. Weryfikacja losowości procesu resztowego (składnika losowego)

3.3.1. test Quenouille'a

3.3.2. test w oparciu o wartości PACF



ostatni_PACF_eip.png

3.3.3. test Durбина-Watsona

3.4. Weryfikacja normalności rozkładu reszt (składnika losowego)

3.5. Weryfikacja jednorodności wariancji reszt (składnika losowego)



wyniki_testow_eip.png

3.6. Weryfikacja efektu ARCH

3.7. Weryfikacja poprawności postaci modelu

3.7.1. test nieliniowości na kwadraty

3.7.2. test nieliniowości na logarytmy

3.7.3. test specyfikacji RESET

3.8. Weryfikacja stabilności ocen parametrów strukturalnych CUSUM

4. Interpretacje

4.1. Interpretacje ocen parametrów strukturalnych

4.2. Interpretacja ocen parametrów zmiennych sezonowych

4.3. Współczynnika determinacji R^2

4.4. Błędu standardowego reszt S_e oraz współczynnika zmienności losowej V_e

4.5. Całościowa ocena jakości oszacowanego modelu:

5. Prognozy

prognozy_eip.png

Kwartał	Błąd <i>ex ante</i> względny	Błąd <i>ex post</i> bezwzględny	Błąd <i>ex post</i> względny
2023:1			
2023:2			
2023:3			
2023:4			