

**ЭКОНОМЕТРИЧЕСКОЕ
МОДЕЛИРОВАНИЕ ИМПУЛЬСНЫХ
ОТКЛИКОВ МАКРОЭКОНОМИЧЕСКИХ
ПОКАЗАТЕЛЕЙ**

ПРОБЛЕМА

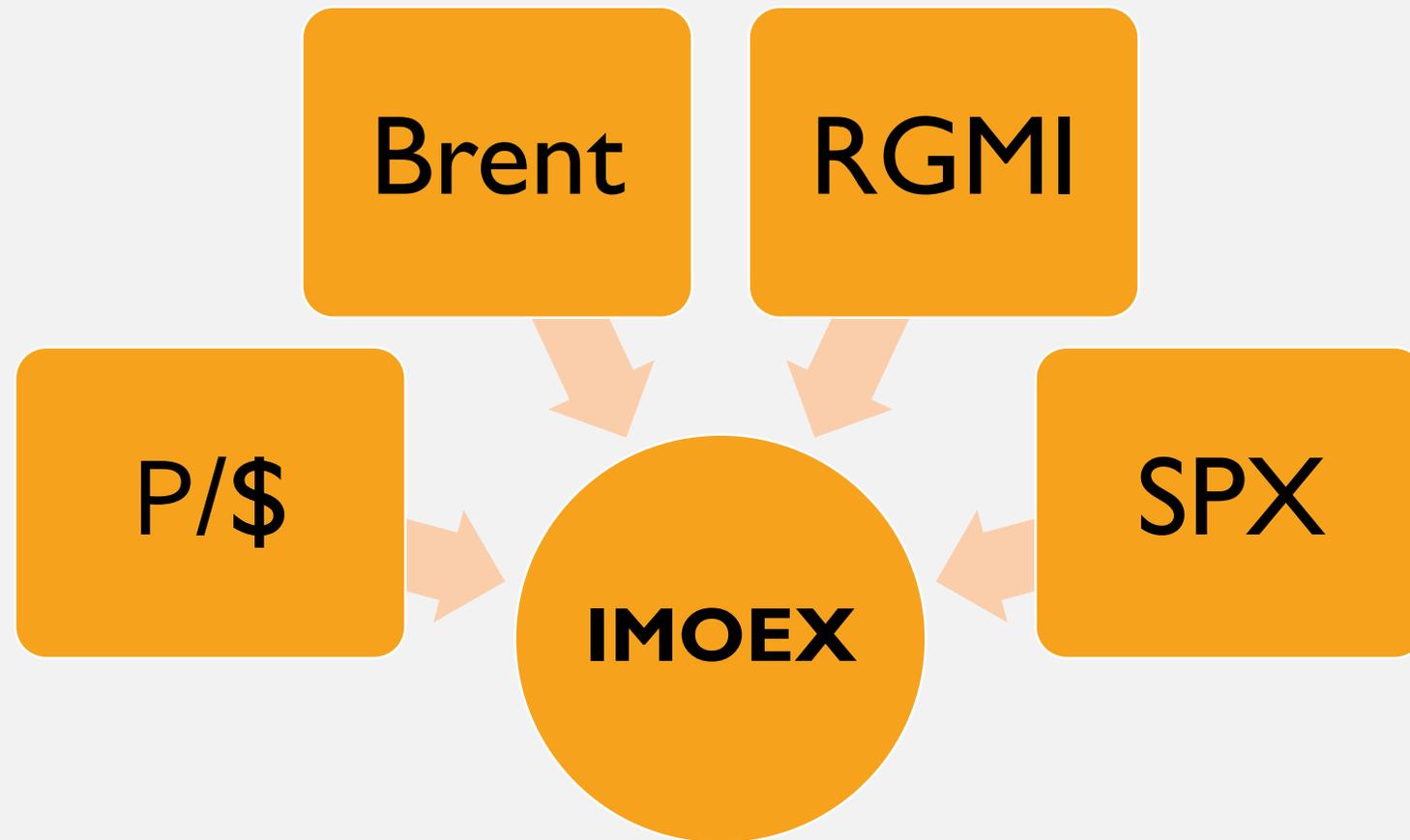
$$X(t = 0) \quad X(t = -1, -2, -3, \dots)$$



$$Y(t = 0)$$

$$Y(t = 0)$$

ПЕРЕМЕННЫЕ

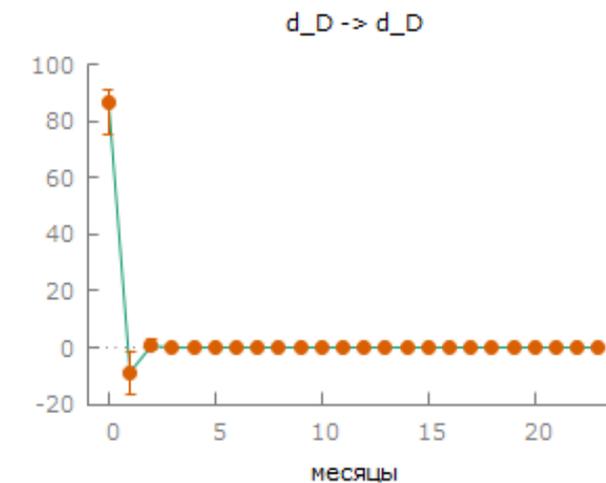
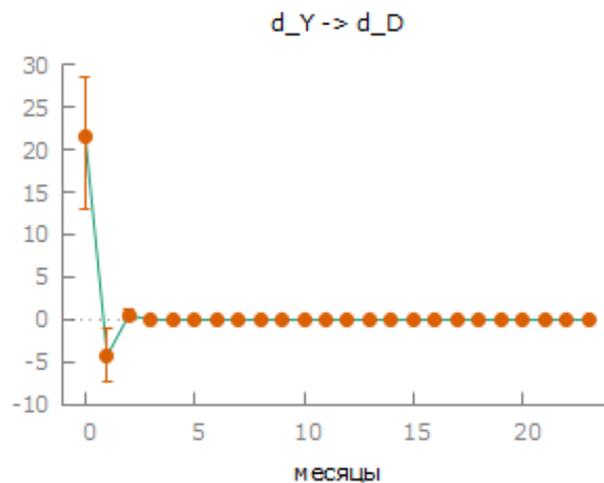
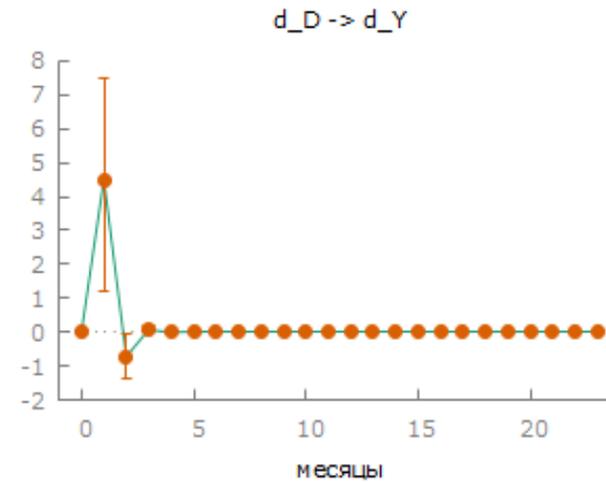
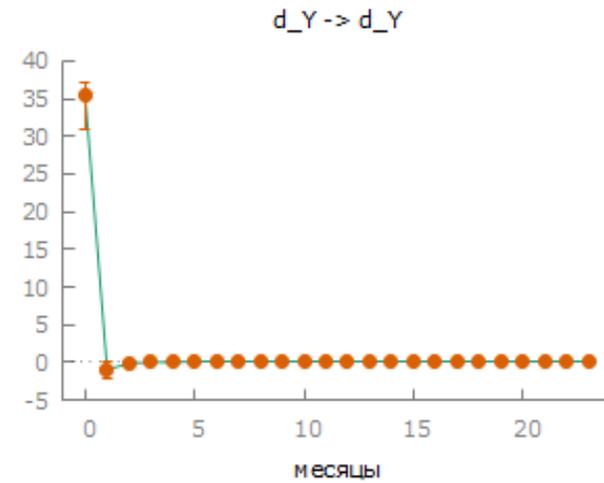


МОДЕЛЬ

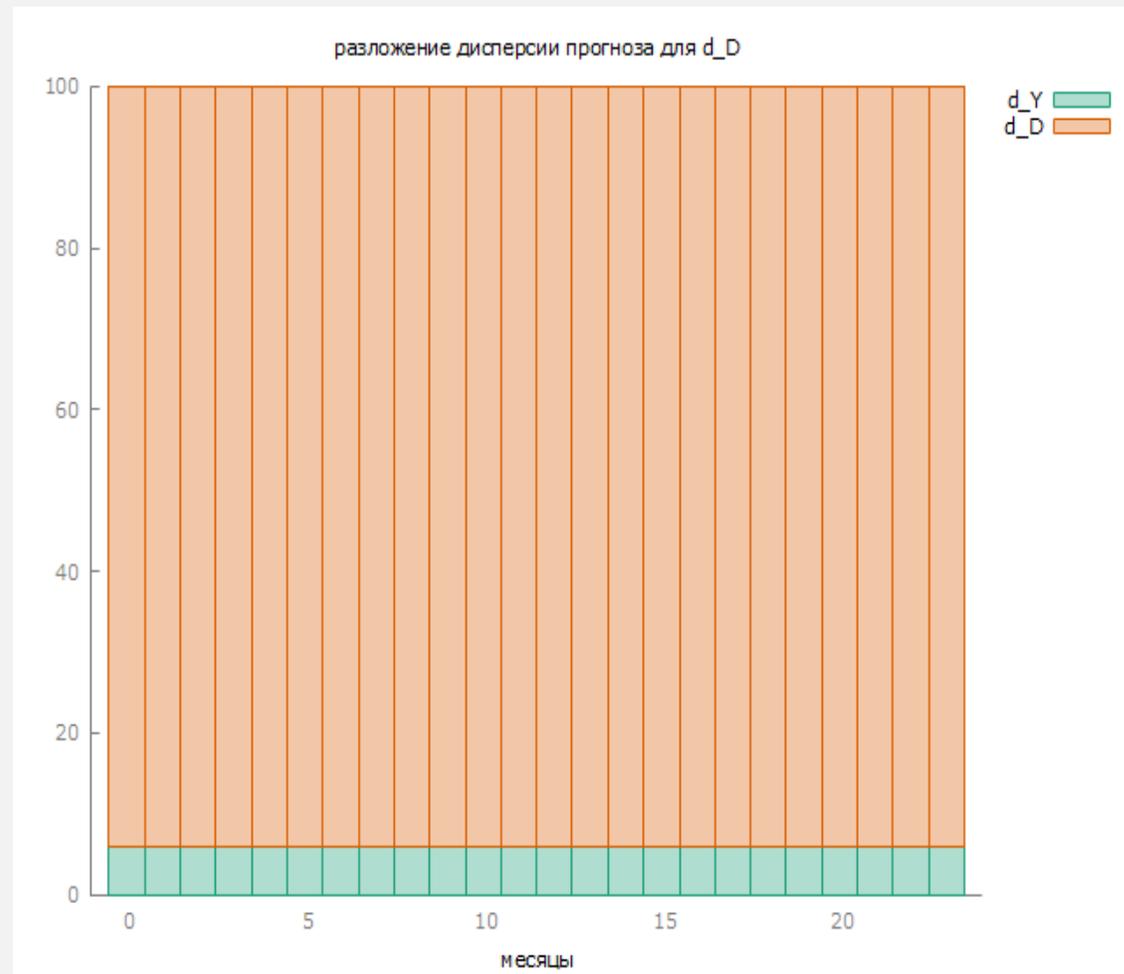
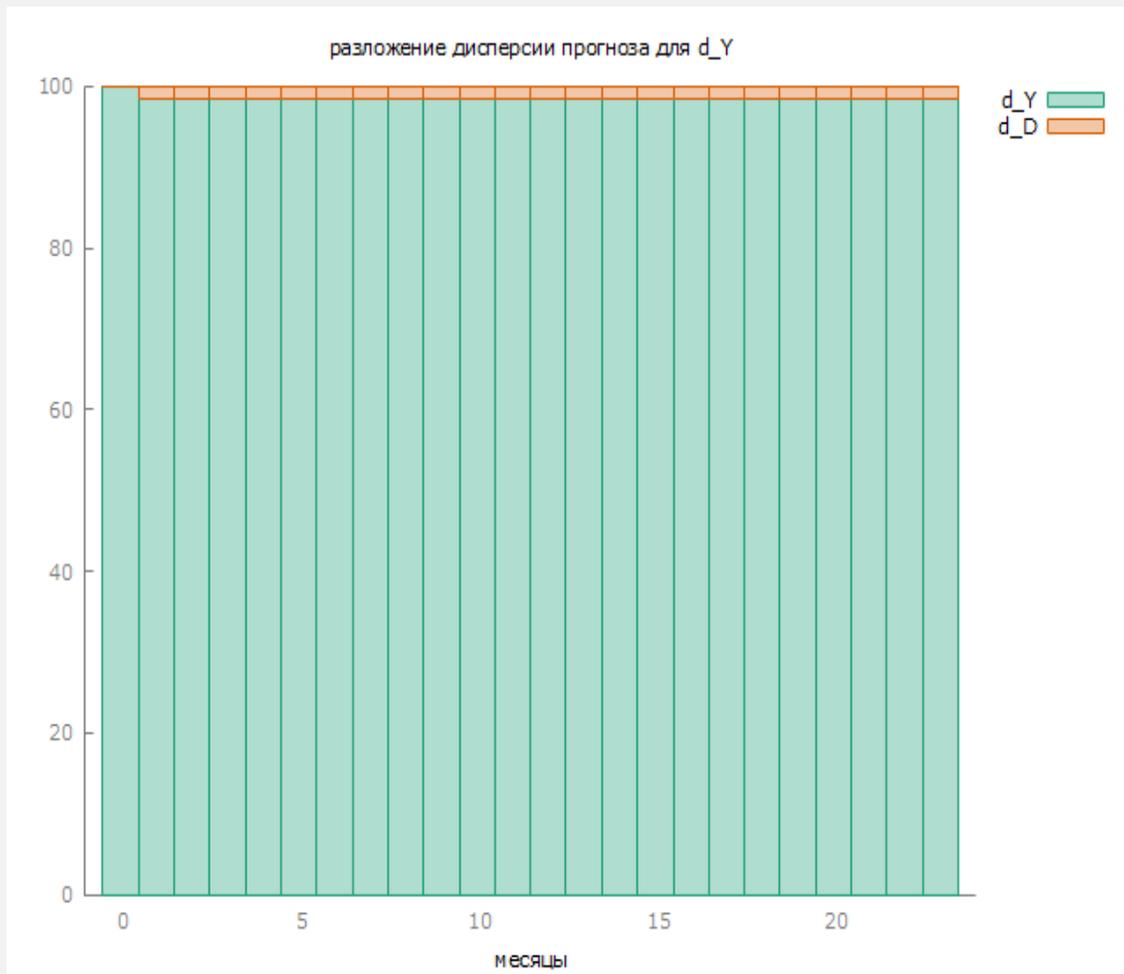
$$\begin{cases} Y = 10,8739 - 0,059 * Y_{t-1} + 0,052 * D_{t-1} + 22,815 * X1 - 5,783 * X3 + 1,719 * X4 \\ D = 36,66 - 0,059 * Y_{t-1} - 0,101 * D_{t-1} - 5,793 * X1 - 7,989 * X3 + 0,723 * X4 \end{cases}$$

Проблема в том, что коэффициенты модели векторной авторегрессии неинтерпретируемы!

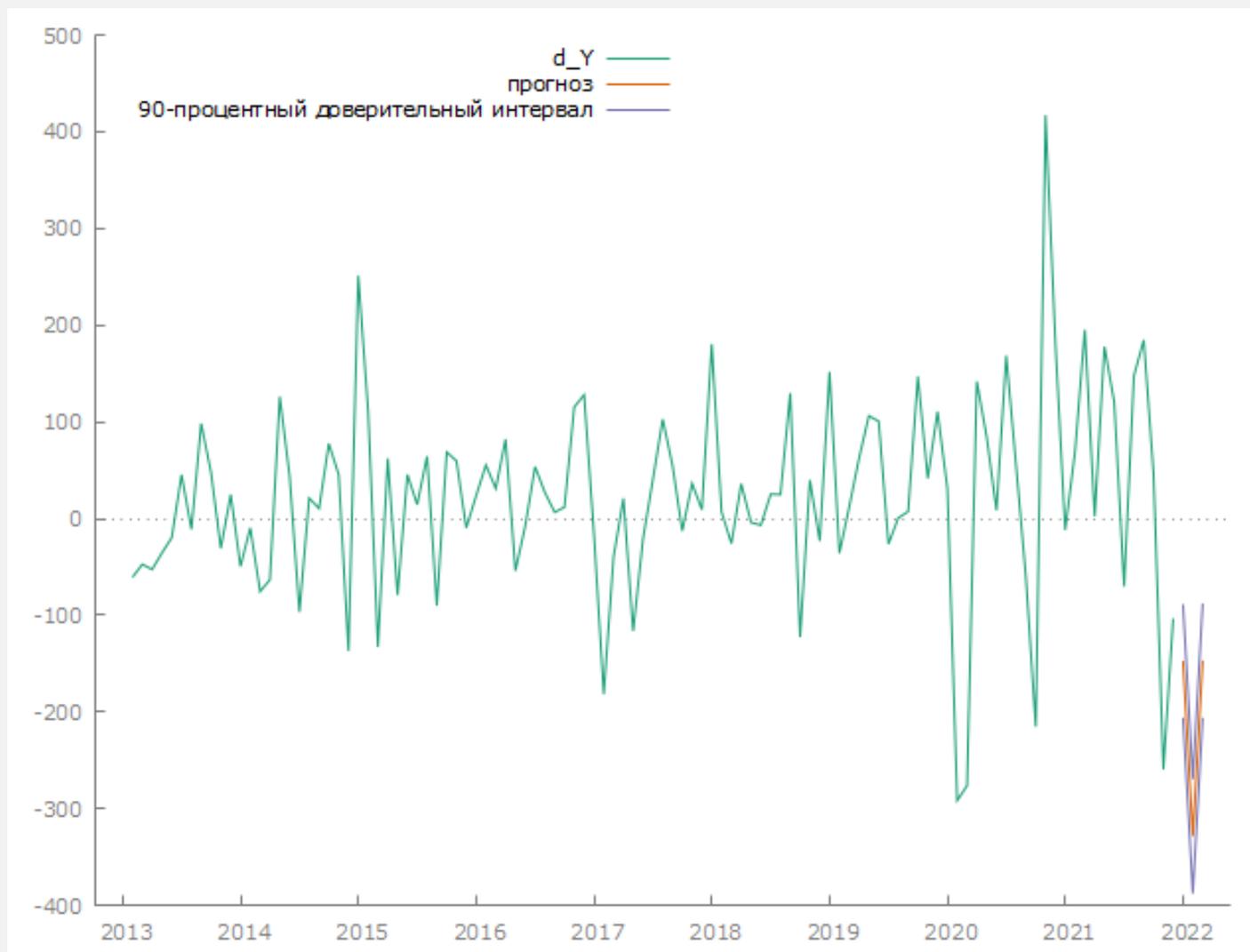
ИМПУЛЬСНЫЕ ОТКЛИКИ



ДЕКОМПОЗИЦИЯ ДИСПЕРСИИ



ПРОГНОЗ



СПАСИБО ЗА ВНИМАНИЕ!