

Встреча экспертов по тематике
«Опережающие индикаторы: анализ предсказательной силы для
показателей Единого экономического пространства»

План мероприятия
11 декабря 2013 г. (среда)

10-00 – 10-10	Приветствие экспертов <i>Евгений Хотулев</i> , Директор Департамента макроэкономической политики Евразийской экономической комиссии.
10-10 – 10-40	«Основы построения опережающих индикаторов» Докладчик: <i>Андрей Липин</i> , начальник отдела методологии и анализа Департамента макроэкономической политики Евразийской экономической комиссии.
10-40 – 11-40	«Процедура отбора индивидуальных опережающих индикаторов» - <i>Определение точек завершения последовательностей роста и рецессий.</i> - <i>Оценивание логит-регрессий точек разворота целевой переменной на точки разворота предикторов с лагами.</i> - <i>Анализ коэффициентов парной корреляции между целевой переменной</i> Докладчик: <i>Андрей Орлов</i> , консультант отдела методологии и анализа Департамента макроэкономической политики Евразийской экономической комиссии
11-40 – 12-00	Кофе-брейк
12-00 – 13-00	«Построение сводных опережающих индикаторов» - <i>Опережающий индекс по методологии ОЭСР (CLI)</i> - <i>Опережающий индекс по методологии Conference Board (CBI)</i> Докладчик: <i>Юрий Жуков</i> , советник отдела методологии и анализа Департамента макроэкономической политики Евразийской экономической комиссии
13-00 – 14-00	Обед
14-00 – 14-30	«Комбинация одномерных прогнозов (по Грейнджеру)» Докладчик: <i>Андрей Орлов</i> , консультант отдела методологии и анализа Департамента макроэкономической политики Евразийской экономической комиссии
14-30 – 15-30	«Тестирование качества прогноза» - <i>Тестирование прогностической силы (MSFE, MAE)</i> - <i>Тестирование предсказанных вероятностей точек разворота (QPS, LPS)</i> - <i>Прогностические тесты Тиммермана-Песарана</i> Докладчик: <i>Андрей Липин</i> , начальник отдела методологии и анализа Департамента макроэкономической политики Евразийской экономической комиссии.
15-30 – 15-50	Кофе-брейк
15-50 – 17-30	«Модельный подход к построению опережающих индикаторов» - <i>Динамические факторные модели</i> - <i>Модели с марковскими переключениями</i> <i>Андрей Орлов</i> , консультант отдела методологии и анализа Департамента макроэкономической политики Евразийской экономической комиссии