

Literatura zabývající se předpověďmi získala v poslední dekádě nový impuls, když DSGE modely (dynamické stochastické modely všeobecné rovnováhy) začaly v kvalitě předpovědí konkurovat čistě empirickým modelům. Bylo ukázáno, že průměrování mezi DSGE modely a modely časových řad může zlepšit vlastnosti předpovědí oproti nejlepší alternativní neprůměrované specifikaci. Vzhledem k tomu, že se kvalita předpovědí v čase mění, je nutné užívat vhodnou metodu, která změny v čase zachytí. Klademe si za cíl vyplnit několik bílých míst současné literatury zkombinováním velkého množství empirických a teoretických modelů k předpovídání makroekonomických veličin v různých zemích. Oproti současné literatuře bude velké množství modelů vyžadovat efektivní algoritmy k průměrování dílčích predikcí. V sérii odborných článků představíme nová kombinační schémata, která budou odpovídat několika stylizovaným faktům, která jsou běžná v literatuře zabývající se makroekonomickými předpověďmi.

Cílem projektu je zkombinování velkého množství empirických a teoretických modelů k předpovídání makroekonomických veličin v různých zemích. Představíme nová kombinační schémata, která budou odpovídat stylizovaným faktům, která jsou běžná v literatuře zabývající se makroekonomickými předpověďmi.

Navrhovatel projektu: Univ. Prof. Dr. Jesús Crespo Cuaresma
Období řešení projektu: 1. 1. 2017 – 31. 12. 2019
Rozpočet projektu: 4 425 000 Kč