

CZU: 332.14:519.862

SCHEMA GENERALĂ PENTRU DETERMINAREA PARAMETRILOR MODELULUI ARIMA ÎN PROGNOZAREA ECONOMICĂ

Dmitri TERZI

Universitatea de Stat din Moldova

În lucrare sunt considerate seriile de timp care sunt determinate în condițiile de invarianță a distribuției reciproce a probabilității de observare ca o condiție pentru construirea modelului ARIMA. Sunt prezentate: a) schema generală pentru determinarea parametrilor modelului ARIMA pe baza covarianței dintre anumite serii de timp cu laguri diferite; b) programe de modelare a seriilor de timp pentru testarea modelelor; c) recomandări pentru prognoză pe baza unor informații din diverse exemple.

Cuvinte-cheie: ARIMA, serii de timp, staționaritate, prognoză, covariație, autocorelație și autocorelație parțială, schemă generală, determinarea parametrilor și testarea modelelor.

THE GENERAL SCHEME FOR DETERMINING THE PARAMETERS OF THE ARIMA MODEL IN ECONOMIC FORECASTING

In this paper we consider the time series that are determined under the conditions of invariance of the mutual distribution of the probability of observation as a condition for building the ARIMA model. The following are presented: a) general scheme for determining the parameters of the ARIMA model based on covariance between different time series with different lags; b) time series modeling programs for models testing; forecasting recommendations based on information from various examples.

Keywords: ARIMA, time series, stationarity, forecast, covariance, autocorrelation and partial autocorrelation, general scheme, parameter determination and model testing.

Prezentat la 11.10.2017

Publicat: decembrie 2017