

Федір Журавка, Ганна Філатова, Джон О. Айедогбон

Прогнозування державного боргу на основі ARIMA моделі

Робота присвячена дослідженню теоретичних та практичних аспектів щодо прогнозування державного боргу України. Проведено візуальний аналіз динаміки обсягу державного боргу, на основі чого зроблено висновок про поглиблення боргової кризи в Україні. Розглянута інтегрована модель авторегресії ковзного середнього (ARIMA), як базова модель прогнозування, з розглядом ідентифікації, оцінки роботи моделі, та її діагностики. За допомогою програмного комплексу EViews в роботі проілюстрована процедура прогнозування державного боргу України для моделі ARIMA: здійснено перевірку ряду на стаціонарність, перетворення часового ряду місячних даних державного боргу на стаціонарний шляхом здійснення ряду перетворень, визначення параметрів моделі та, як результат, було обрано найоптимальнішу специфікацію моделі ARIMA.

На основі здійсненого моделювання часового ряду зроблено висновок про можливість застосування ARIMA-інструментарію для прогнозування значень державного боргу країни.

Ключові слова: борг, боргова стійкість, моделювання, аналіз часових рядів, Україна

Класифікація JEL: H60, H63



Стаття знаходиться у відкритому доступі і може розповсюджуватися на умовах ліцензії [Creative Commons Attribution 4.0 International license](https://creativecommons.org/licenses/by/4.0/), що дозволяє необмежене повторне використання, розповсюдження та відтворення на будь-якому носії за умови наявності відповідного посилання на оригінальну версію статті

Федор Журавка, Анна Филатова, Джон О. Айедогбон

Прогнозирование государственного долга на основе ARIMA модели

Работа посвящена исследованию теоретических и практических аспектов касательно прогнозирования государственного долга Украины. Проведен визуальный анализ динамики объема государственного долга, на основе чего сделан вывод об углублении долгового кризиса в Украине. Рассмотрена интегрированная модель авторегрессии скользящего среднего (ARIMA), как базовая модель прогнозирования, с рассмотрением идентификации, оценки работы модели, и ее диагностики. С помощью программного комплекса EViews в работе проиллюстрирована процедура прогнозирования государственного долга Украины для модели ARIMA: осуществлена проверка ряда на стационарность, преобразование часового ряда месячных данных государственного долга на стационарный путем осуществления ряда преобразований, определение параметров модели и, как результат, было выбрана самая оптимальная спецификация модели ARIMA.

На основе осуществленного моделирования часового ряда сделан вывод о возможности применения ARIMA-инструментария для прогнозирования значений государственного долга страны.

Ключевые слова: долг, долговая устойчивость, моделирование, анализ временных рядов, Украина

Классификация JEL: H60, H63



Статья находится в открытом доступе и может распространяться на условиях лицензии [Creative Commons Attribution 4.0 International license](https://creativecommons.org/licenses/by/4.0/), что позволяет неограниченное повторное использование, распространение и воспроизведение на любом носителе при условии наличия соответствующей ссылки на оригинальную версию статьи