

Η κατάσταση των μακροοικονομικών προβλέψεων στην Κύπρο

Έλενα Ανδρέου, Άντρος Κούρτελλος

ΠΕΡΙΛΗΨΗ

Το αντικείμενο του άρθρου αφορά τις προκλήσεις που ανακύπτουν στην εκτίμηση μακροοικονομικών προβλέψεων στην Κύπρο και οφείλονται στο γεγονός ότι τα διάφορα δεδομένα τα οποία είναι χρήσιμα για τους σκοπούς των προβλέψεων είναι διαθέσιμα σε μεικτές συχνότητες. Για παράδειγμα, οι περισσότερες μακροοικονομικές μεταβλητές είναι διαθέσιμες σε τριμηνιαίες ή μηνιαίες συχνότητες ενώ άλλοι σημαντικοί δείκτες είναι διαθέσιμοι σε υψηλότερες συχνότητες. Παραθέτουμε μια ανασκόπηση των μονομεταβλητών και πολυμεταβλητών χρονοσειρών καθώς και των διαρθρωτικών δυναμικών προγνωστικών μοντέλων που επιτρέπουν τη χρήση δεδομένων διαφορετικών συχνοτήτων. Επιπρόσθετα, εξετάζουμε πως τα μοντέλα μεικτών συχνοτήτων μπορούν να φανούν χρήσιμα στην ενημέρωση των προβλέψεων σε πραγματικό χρόνο.