

Πρόβλεψη της μεγέθυνσης του ΑΕΠ της Ευρωπαϊκής Ένωσης με τη χρήση μοντέλων MIDAS: Ο ρόλος των Προπορευόμενων Δεικτών Εμπιστοσύνης και Χρηματοοικονομικών Δεικτών

Έλενα Ανδρέου και Μαγδαληνή Τοφινή

ΠΕΡΙΛΗΨΗ

Οι συνέπειες των πρόσφατων οικονομικών και υγειονομικών κρίσεων έχουν μειώσει σημαντικά την παγκόσμια εμπιστοσύνη, ενισχύοντας το ενδιαφέρον και την ανάγκη να επισημανθούν οι βραχυπρόθεσμες προοπτικές οικονομικής δραστηριότητας και τα μοτίβα του επιχειρηματικού κύκλου σε διεθνές επίπεδο, χρησιμοποιώντας προπορευόμενους δείκτες. Ως εκ τούτου, η ανάλυσή μας στοχεύει να αξιολογήσει την προβλεπτική ικανότητα της τριμηνιαίας μεγέθυνσης του ΑΕΠ στην Ευρωπαϊκή Ένωση μέσω της προσέγγισης της μοντελοποίησης MIDAS, χρησιμοποιώντας τους προπορευόμενους (soft) δείκτες εμπιστοσύνης και χρηματοοικονομικούς δείκτες που είναι διαθέσιμοι σε υψηλότερη μηνιαία συχνότητα. Τα αποτελέσματά μας υποδεικνύουν ότι μπορεί να είναι ευνοϊκό να συμπεριληφθούν οι (soft) προβλεπτικοί δείκτες σε υψηλότερη συχνότητα από την μεγέθυνση του ΑΕΠ, σύμφωνα με τις αρχές της *μεροληψίας* και της *αποδοκότητας*. Αξιοσημείωτα, ο αδιαμφισβήτητος ρόλος του Δείκτη Εμπιστοσύνης Καταναλωτών στην περιγραφή και την πρόβλεψη των μεταβολών στην μεγέθυνση του ΑΕΠ της Ευρωπαϊκής Ένωσης και άλλων ευρωπαϊκών χωρών μέσω των μοντέλων MIDAS αναδεικνύεται.