



Эконометрические модели

Прогнозирование

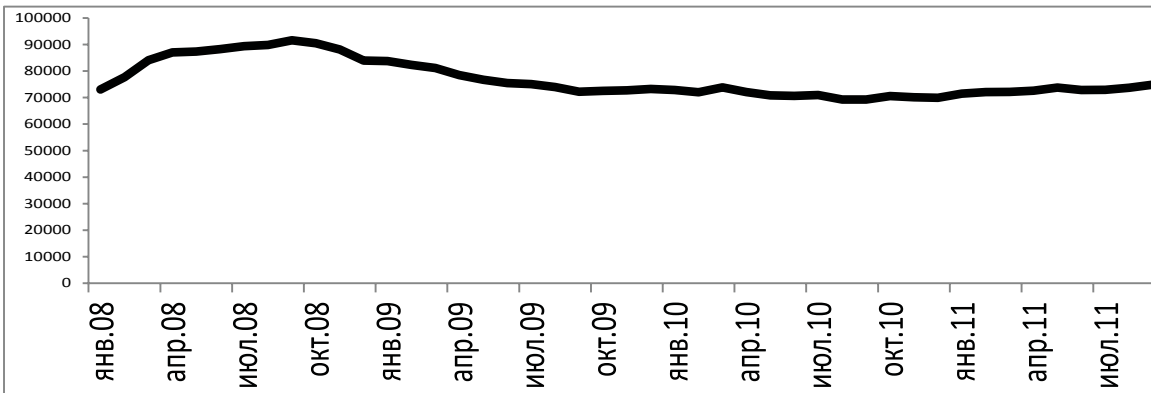
Рынок строящегося жилья Санкт-Петербурга

**ЧЕЛОВЕК, КОТОРЫЙ НЕ ЗНАЕТ КУДА ОН ИДЕТ
ОЧЕНЬ УДИВИТСЯ, ПОПАВ НЕ ТУДА...**

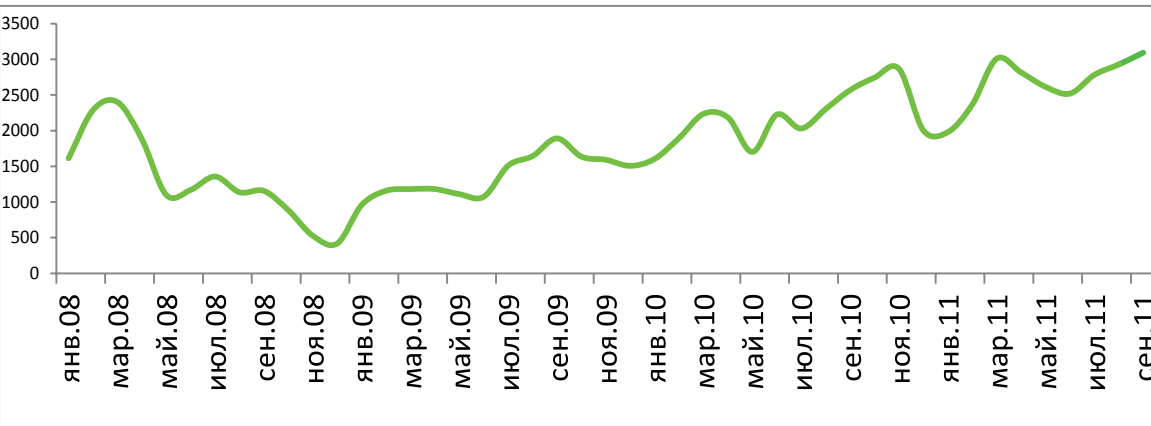
(автор неизвестен)

- 1. Основные показатели**
 - 2. Исходные данные**
 - 3. Типы прогнозных моделей**
-
- 4. Общая схема построения прогноза**
 - 5. Долгосрочный прогноз**
 - 6. Система корректировки прогноза**

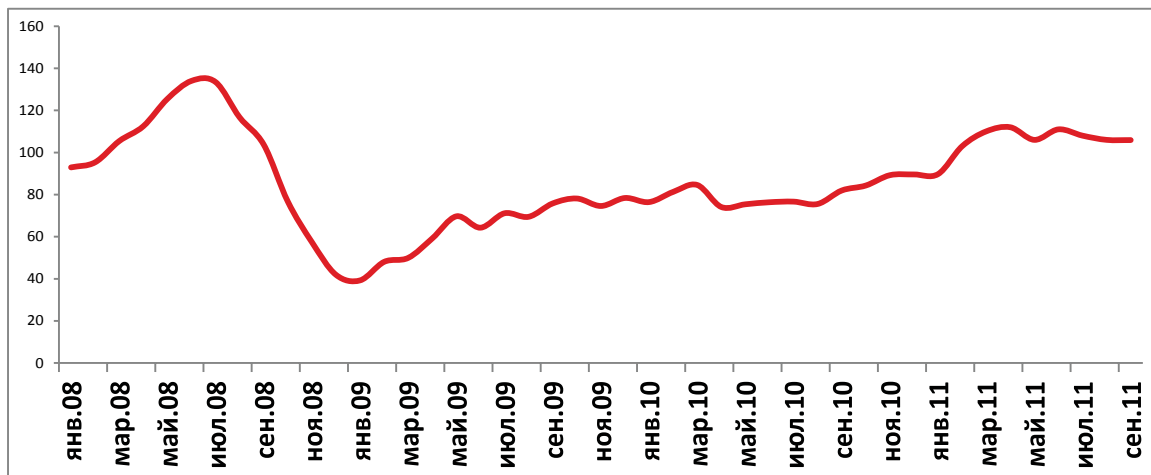
1. Основные показатели



Средние цены м2 предложения, тыс. руб./м2

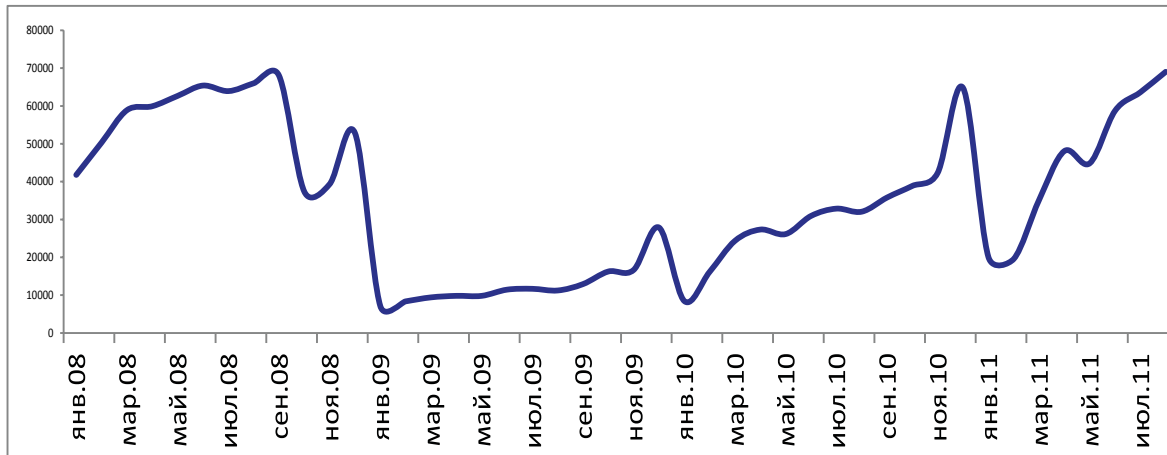


Показатель активности спроса, пункты

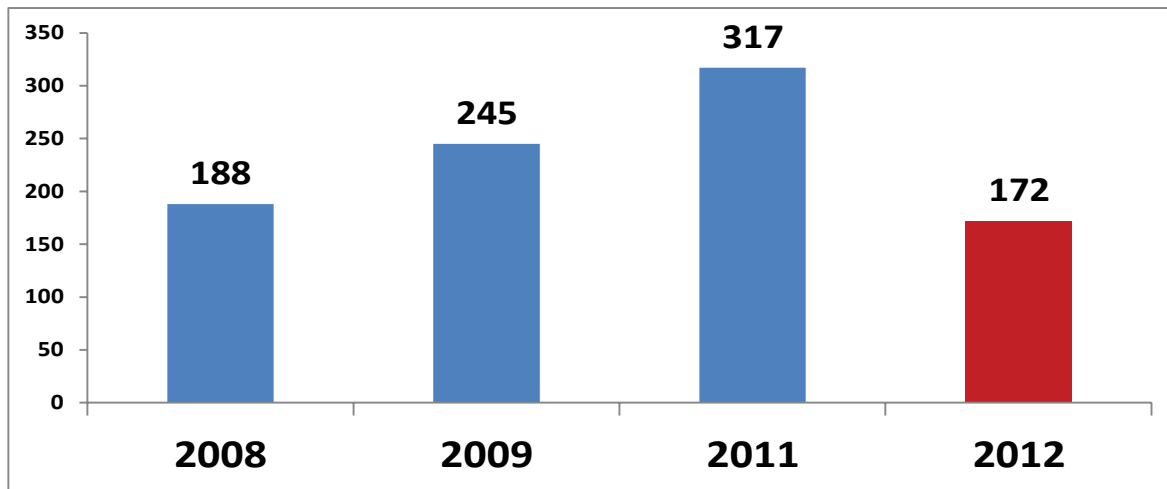


Стоимость барреля нефти марки Brent, ам.долл./баррель

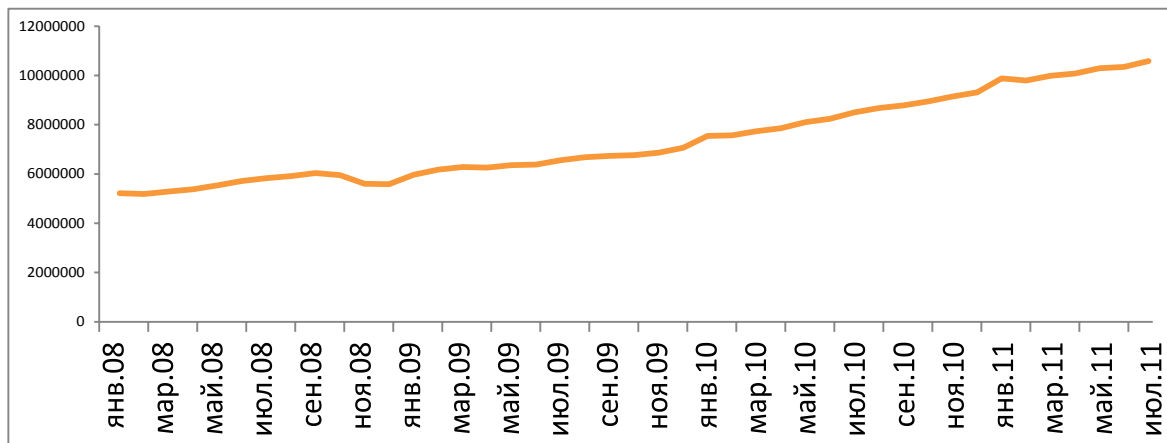
1. Основные показатели



Ипотечные жилищные кредиты, млн. руб.



Объем предложения, кол-во объектов, шт.



Депозиты физ. лиц, млн. руб.

**Средние цены м2
предложения,
*тыс. руб./м2***



**Бюллетень
Недвижимости**

www.bn.ru

**Базы данных
NormInfo**

**mystery-
shopping**

2. Исходные данные

**Показатель активности
спроса, *пункты***



**Клуб Аналитиков
NormINfo**

**Стоимость барреля нефти
марки Brent,
*ам.долл./баррель***



Фондовая биржа
www.rts.ru

2. Исходные данные

Ипотечные жилищные
кредиты, *млн. руб.*



Центральный Банк РФ

www.cbr.ru

Объем предложения,
кол-во объектов, шт.



**Базы данных
NormInfo**

Депозиты
физ. лиц, *млн. руб.*



Центральный Банк РФ

www.cbr.ru

АКТИВНОСТЬ СПРОСА

Средние цены м2

ЧТО Прогнозируем?

КАКИЕ Факторы используем?

1

Ипотечные жилищные
кредиты, млн. руб.

+

Депозиты
физ. лиц, млн. руб.

2

Стоимость барреля нефти
марки Brent,
ам.долл./баррель

3

Объем предложения,
кол-во объектов, шт.



Регрессионный анализ

Сезонная декомпозиция

Экспоненциальное сглаживание



Мы используем:

Авторегрессия

ARIMA

4. Схема построения прогноза

1
**Исходные
данные**



**гипотезы
длина ряда
сбор данных**

2
**Анализ
данных**



описательный



аналитический

3
**Определение
модели**

4. Схема построения прогноза

4 Качество модели

R²

Тест Жарка-Бера

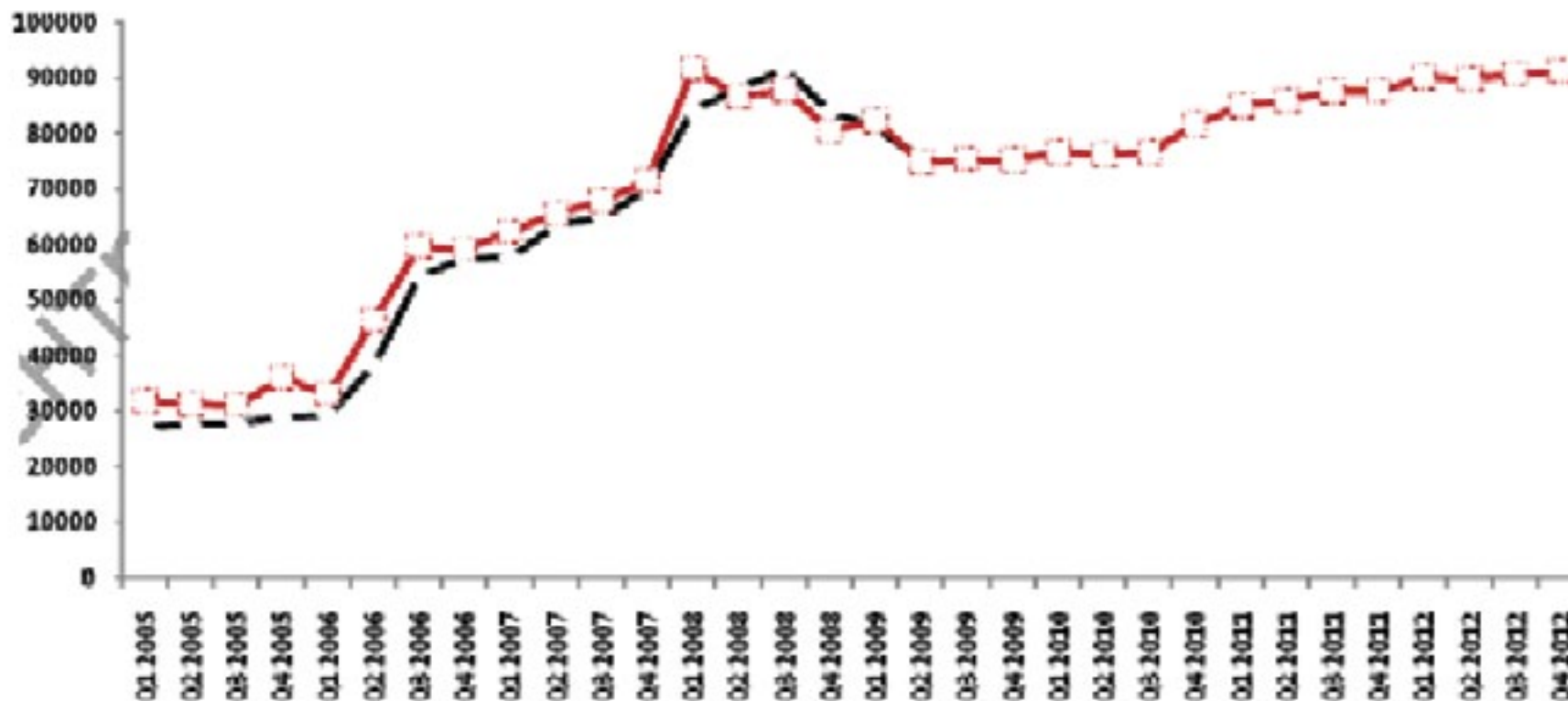
Маре

Поиска автокорреляции

Тесты на условную гетероскедастичность

5 Корректировка модели

ПРОГНОЗ ИЗМЕНЕНИЯ СРЕДНЕЙ ЦЕНЫ М2. АВГУСТ 2009



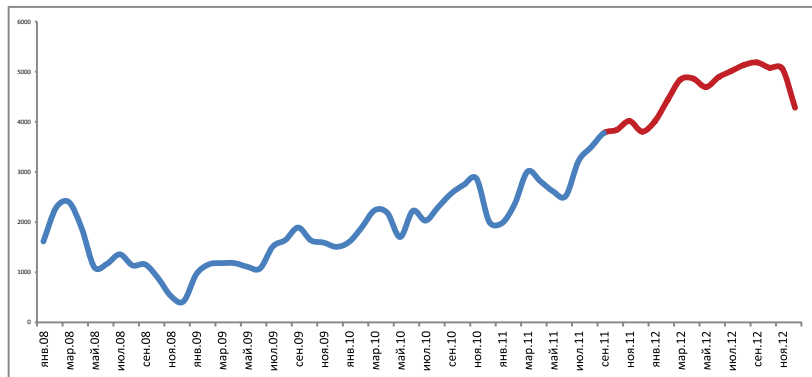
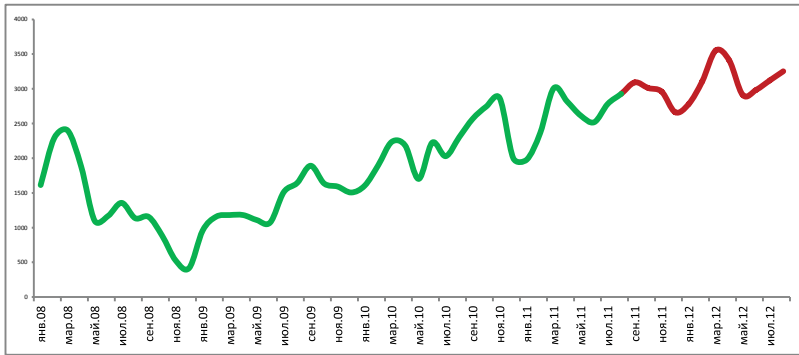
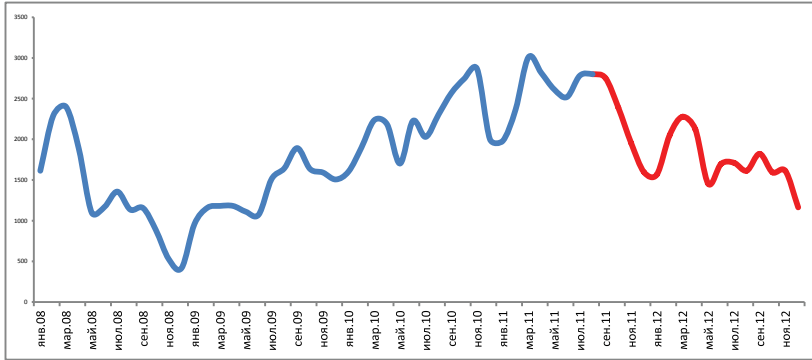
НА КОНЕЦ 3 КВ. 2011 ГОДА ПРОГНОЗ СРЕДНЕЙ ЦЕНЫ М2 - **78 489р./м2**

Индекс средних цен м2 ВН - **74 847р./м2**

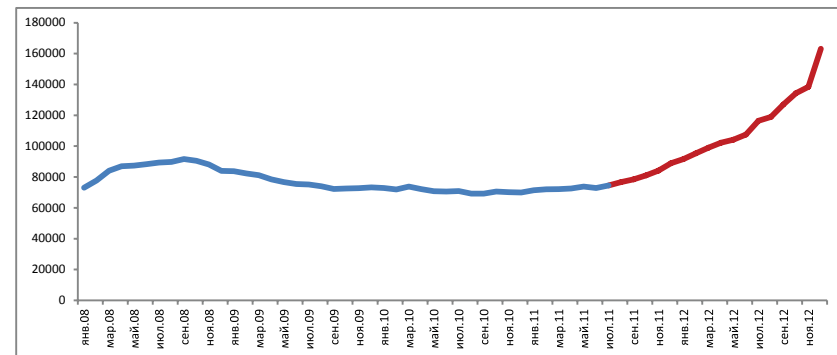
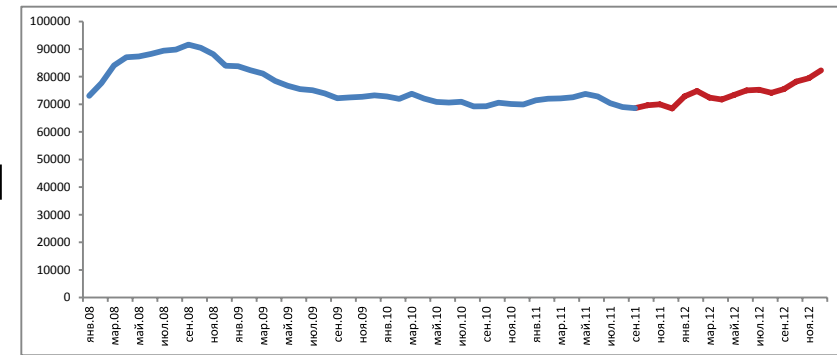
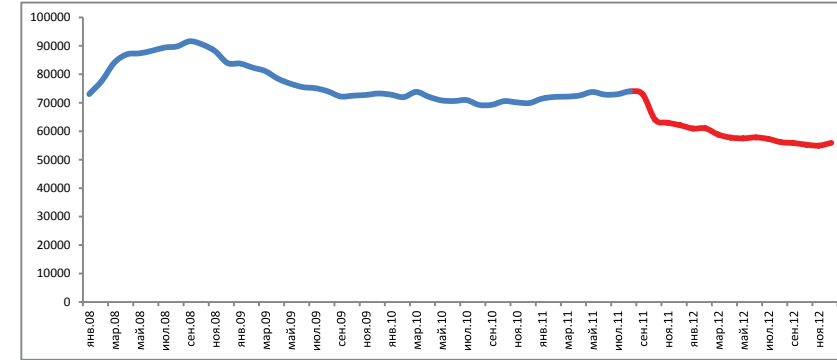
Ошибка прогнозного значения - **4,64%**(в пределах 5%).

5. Система мониторинга и корректировки

Активность спроса



Средняя цена м2



Негативный

Оптимистичный

Умеренный

**НЕТ ВЕЩИ, КОТОРУЮ НЕЛЬЗЯ
БЫЛО БЫ УЛУЧШИТЬ**

Аксиома Форда

ВОПРОСЫ?