

Prognozy stanowią istotny instrument w zarządzaniu oraz w polityce gospodarczej. Trafne prognozy – choć trudno je otrzymać – mogą stanowić o przewadze konkurencyjnej czy poprawności prowadzonej polityki gospodarczej. Do prognozowania wykorzystuje się metody mechaniczne (np. średnie ruchome) i analityczne o różnym stopniu skomplikowania. Najczęściej realizowane są przy pomocy jednego wybranego modelu. Rzadziej w prognozowaniu wykorzystuje się model łączący informacje z wielu modeli.

Celem projektu jest wskazanie możliwości, jakie niesie za sobą uśrednianie wyników ocen parametrów z różnych modeli, aby zbudować trafniejsze prognozy. Jest to zupełnie odmienne podejście od dotychczas stosowanego polegającego na uśrednianiu prognoz wygenerowanych różnymi metodami prognozowania. W propozycji tej dostajemy jeden model prognostyczny bazujący na informacjach pochodzących z wielu różnych modeli cząstkowych. Jest to swego rodzaju łączenie wiedzy z różnych podejść. Dlaczego takie podejście? Odpowiedź jest prosta. W ekonometrii i prognozowaniu mamy do czynienia zarówno z modelami bardzo prostymi (czasami wręcz naiwnymi), jak i z modelami bardzo skomplikowanymi od strony specyfikacji i estymacji. Niestety okazuje się czasami, że poziom zaawansowania modelu nie zawsze przekłada się na jakość prognoz jakie on generuje. Zdarza się, że nieskomplikowane modele, których dopasowanie do danych jest słabe, lepiej prognozują, a niżeli modele silnie oparte o teorie z nauk ekonomicznych. Dlatego w projekcie proponujemy łączenie wyników modelowania z różnych – zarówno tych prostych, jak i tych skomplikowanych – podejść z wykorzystaniem metody BACE (*Bayesian Averaging of Classical Estimates*) tak, aby zmaksymalizowano szansę na to, iż uzyskane prognozy będą trafniejsze. Efektem projektu będzie zatem opracowanie dostępnego dla wszystkich użytkowników modułu dla programu `gretl`, który pozwoli na automatyczne generowanie prognoz z modeli uśrednionych.

Badanie skuteczności proponowanej metody zostanie zrealizowane na podstawie powszechnie dostępnych danych makroekonomicznych dla krajów zrzeszonych w OECD.