



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

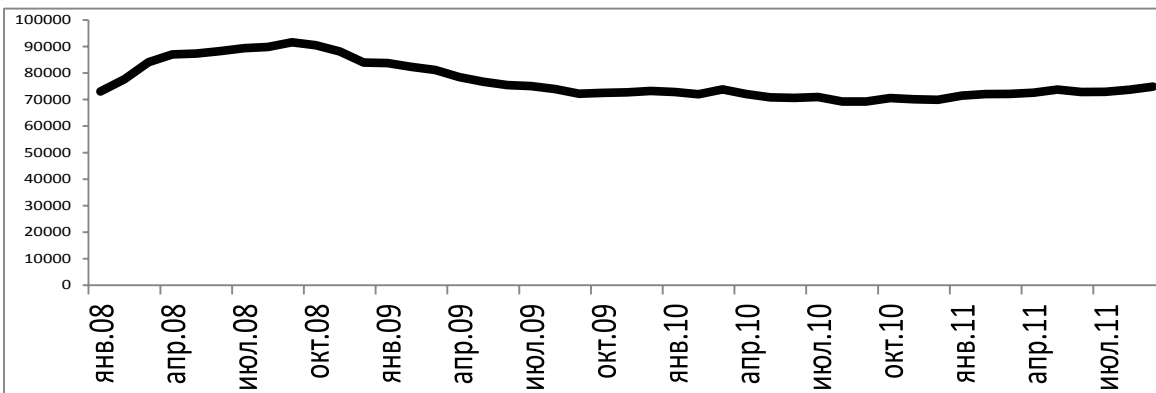
3. Типы прогнозных моделей

4. Общая схема построения прогноза

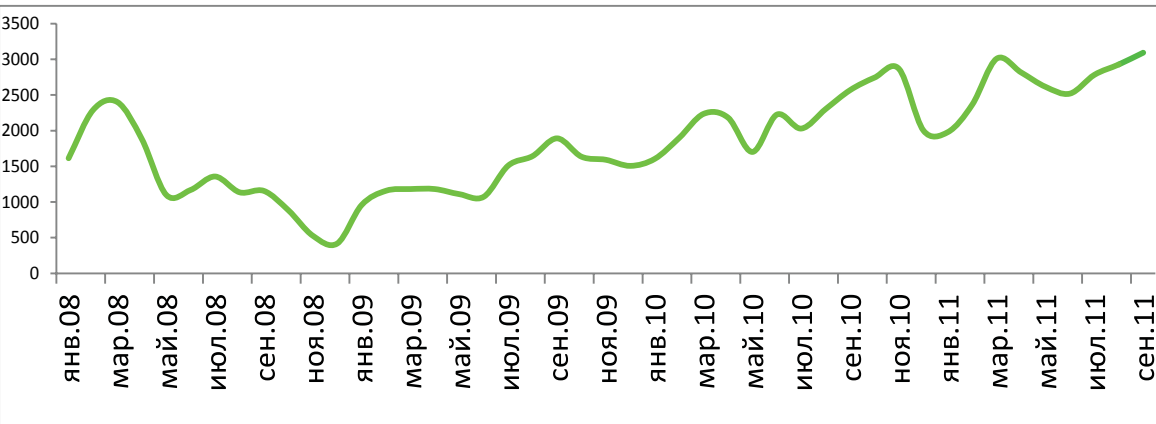
5. Долгосрочный прогноз

6. Система корректировки прогноза

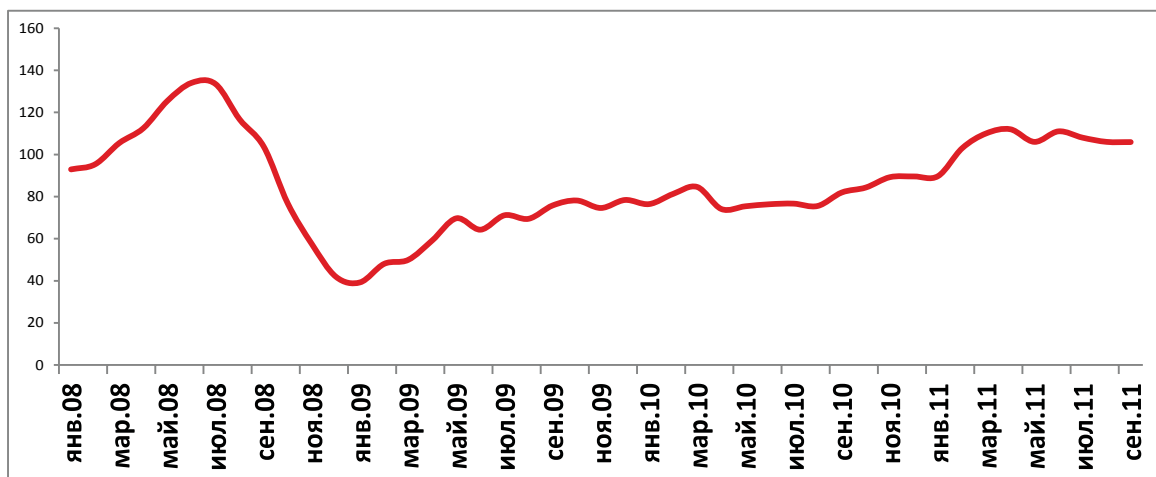
1. Основные показатели



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

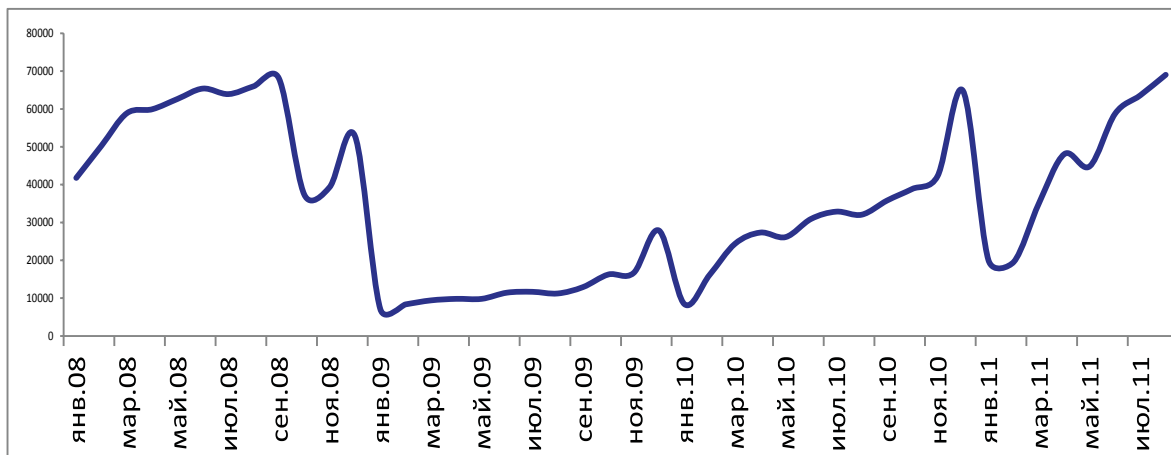


**Показатель активности
спроса, пункты**

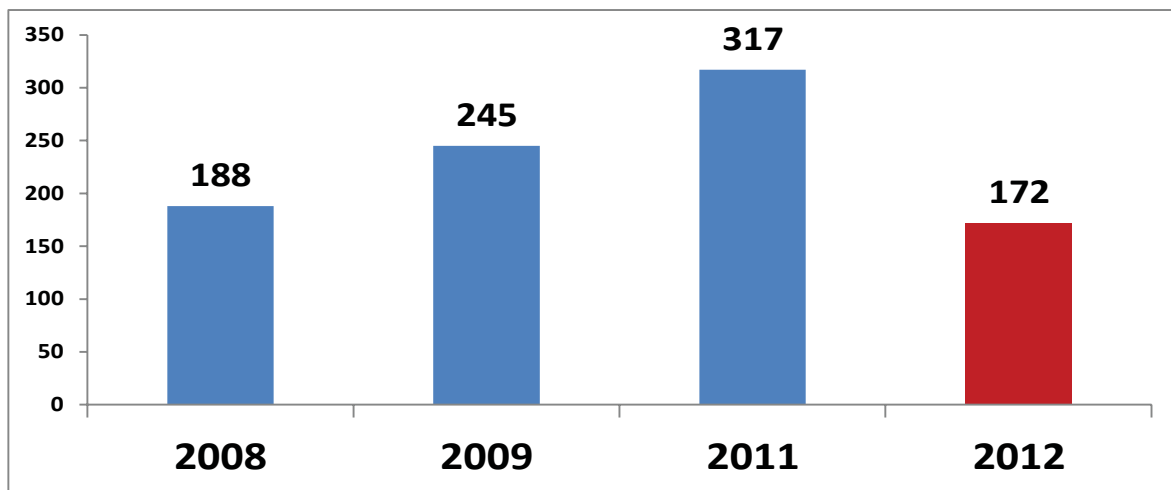


**Стоимость барреля нефти
марки Brent,
ам.долл./баррель**

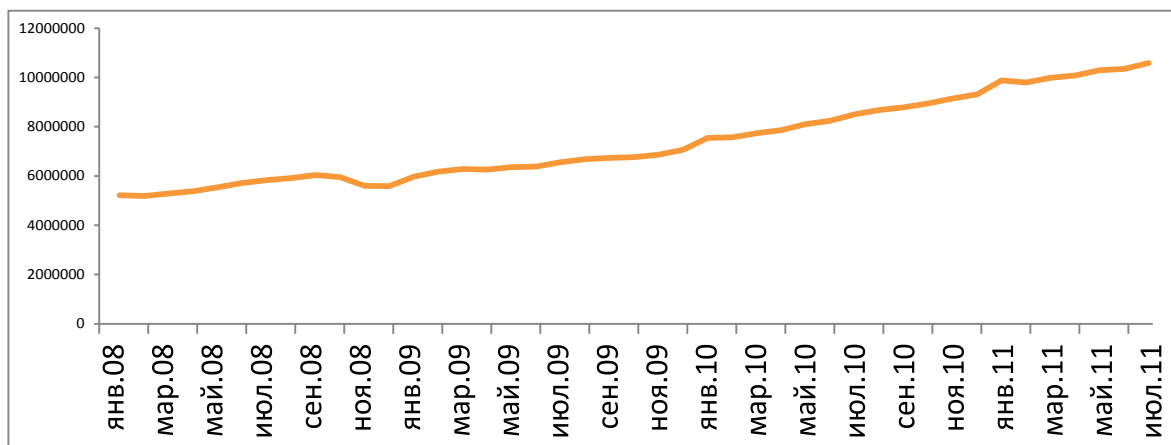
1. Основные показатели



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





4 Качество модели

R^2

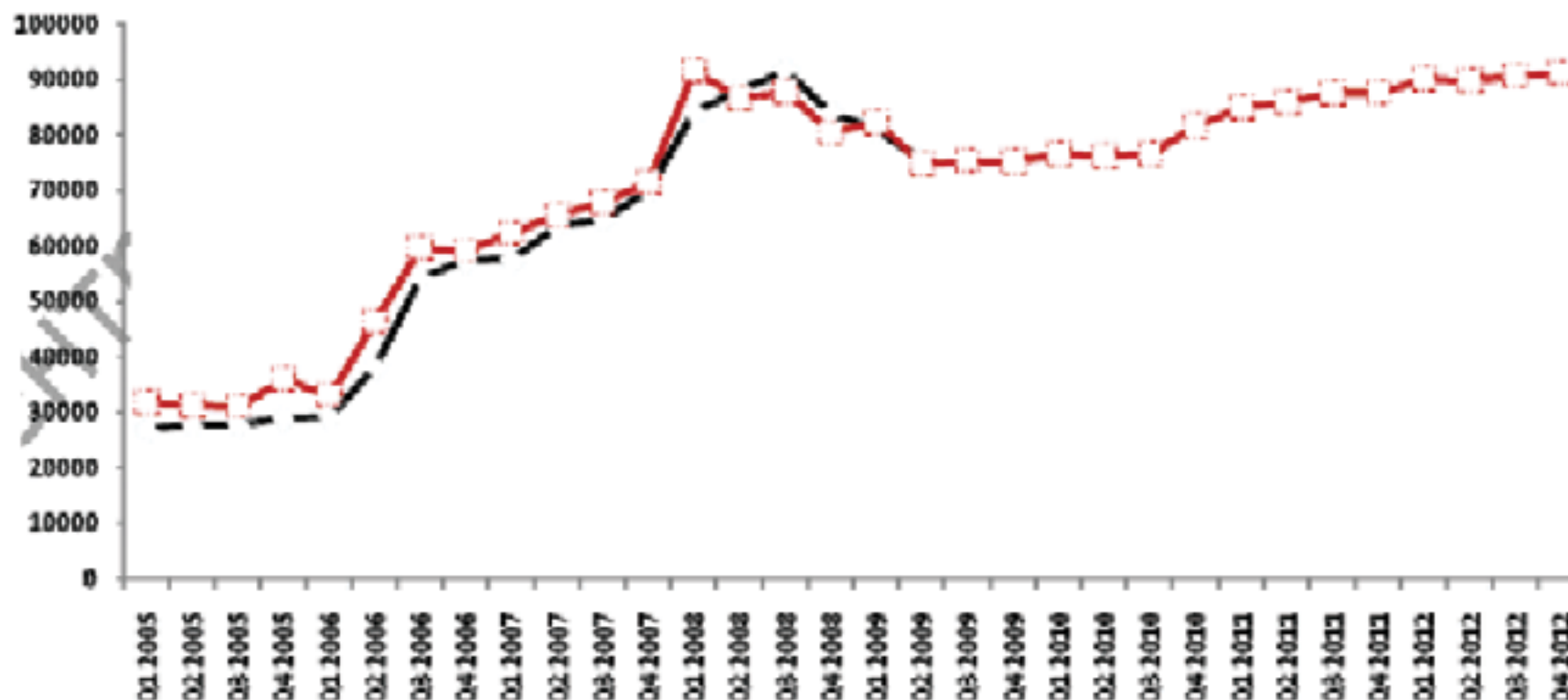
Тест Жарка-Бера

Маре

Тесты на условную гетероскедастичность

5 Корректировка модели

ПРОГНОЗ ИЗМЕНЕНИЯ СРЕДНЕЙ ЦЕНЫ М2. АВГУСТ 2009



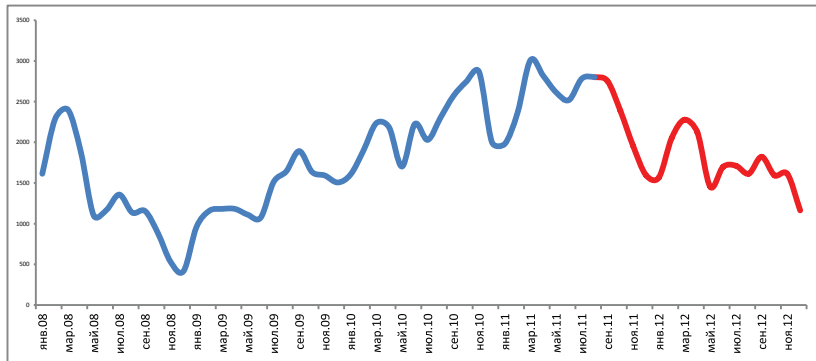
На конец 3 кв. 2011года прогноз средней цены м2 - **78 489р./м2**

Индекс средних цен м2 ВН на 26.09.2011- **75 199р./м2**

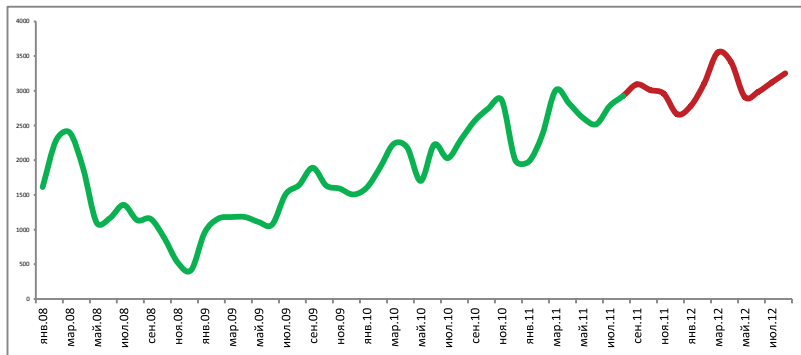
Ошибка прогнозного значения - **4,19%**(в пределах 5%).

5. Система мониторинга и корректировки

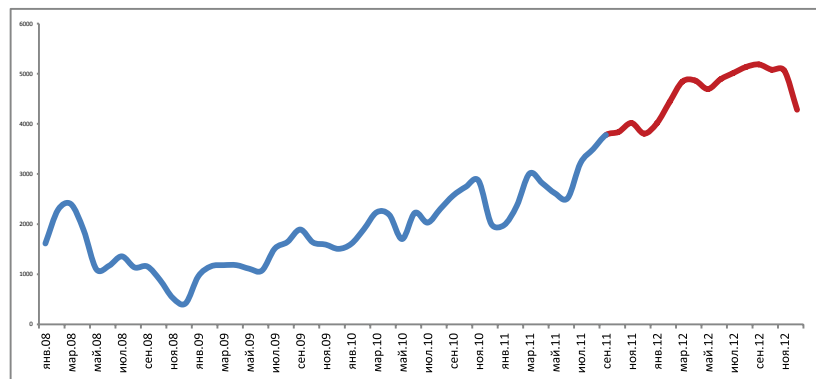
Активность спроса



Негативный

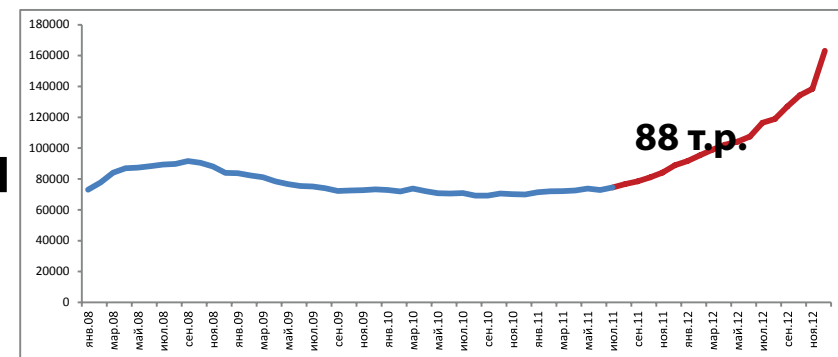
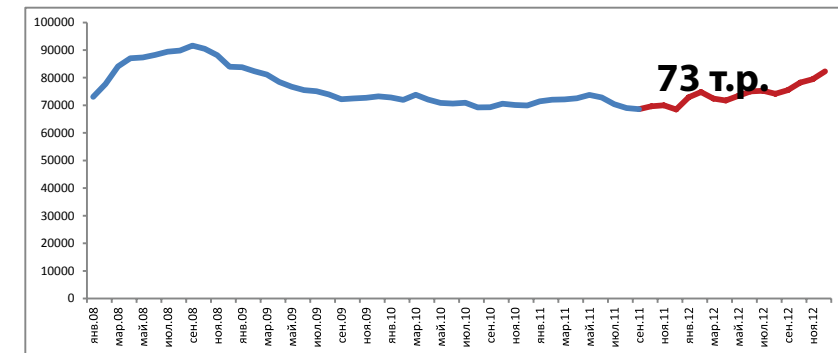
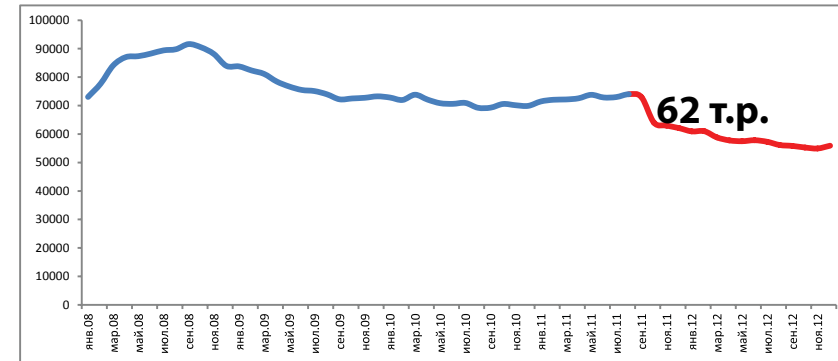


Умеренный



Оптимистичный

Средняя цена м2



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

Аксиома Форда

Спасибо за внимание!!!

ВОПРОСЫ?