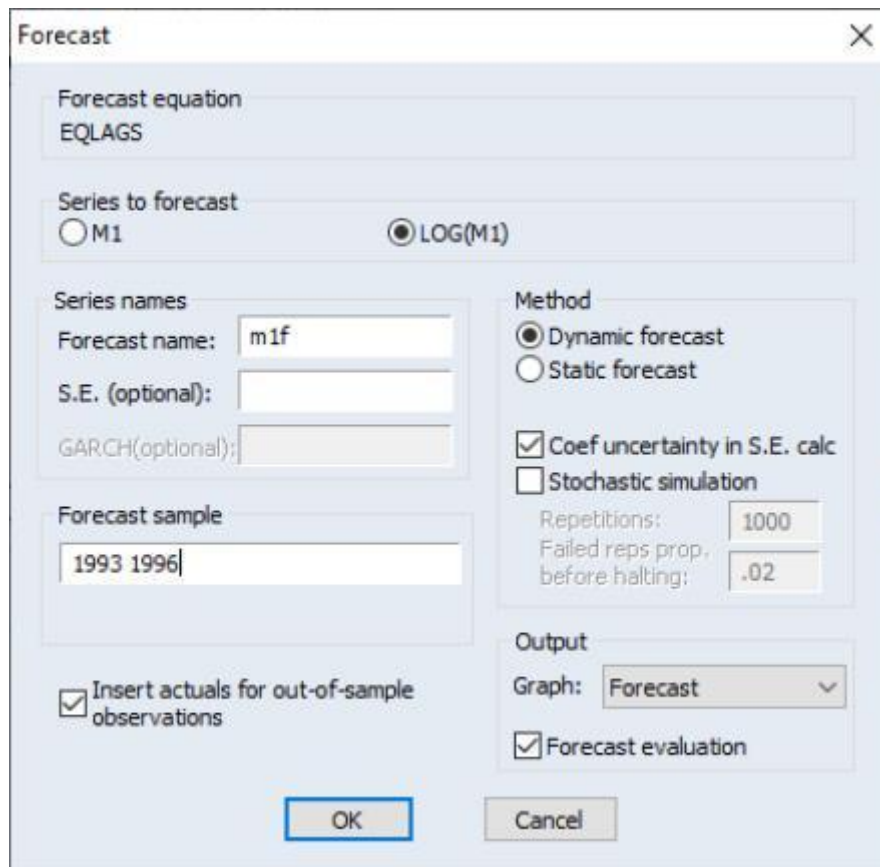


EViews 演示-从估计的方程预测

我们一直在处理我们的数据子集，以便我们可以将基于此模型的预测与 1993 年第一季度至 1996 年第四季度的估计后样本的实际数据进行比较。

单击 EQLAGS 方程工具栏中的 **Forecast** 按钮以打开预测对话框：

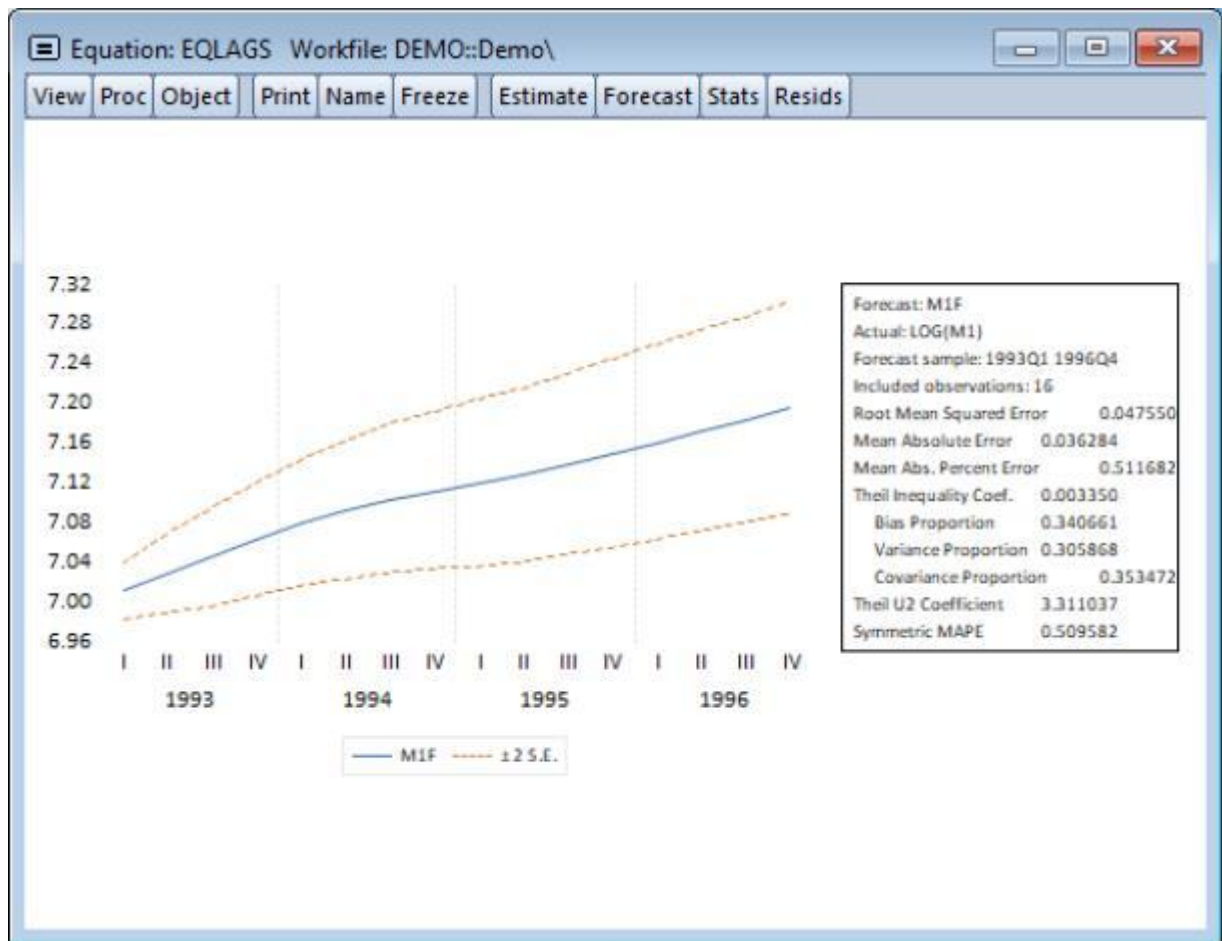


The image shows the 'Forecast' dialog box in EViews. It is titled 'Forecast' and has a close button (X) in the top right corner. The dialog is organized into several sections:

- Forecast equation:** A text box containing 'EQLAGS'.
- Series to forecast:** Two radio buttons: 'M1' (unselected) and 'LOG(M1)' (selected).
- Series names:** Three text boxes: 'Forecast name:' with 'm1f', 'S.E. (optional):' (empty), and 'GARCH(optional):' (empty).
- Forecast sample:** A text box containing '1993 1996'.
- Method:** Two radio buttons: 'Dynamic forecast' (selected) and 'Static forecast' (unselected). Below them are two checked options: 'Coef uncertainty in S.E. calc' and 'Stochastic simulation'. Further down are two text boxes: 'Repetitions:' with '1000' and 'Failed reps prop. before halting:' with '.02'.
- Output:** A dropdown menu for 'Graph:' set to 'Forecast', and a checked option for 'Forecast evaluation'.
- Bottom section:** A checked option 'Insert actuals for out-of-sample observations', and two buttons: 'OK' and 'Cancel'.

我们将预测样本设置为 1993Q1–1996Q4，并为预测和预测标准误差提供名称，以便将两者都保存为工作文件中的序列。预测值将保存在 **M1_F** 中，预测标准误差将保存在 **M1_SE** 中。

另请注意，我们选择预测 **M1** 的对数，而不是水平，并且我们要求图形和预测评估输出。**Dynamic** 选项仅使用 1993 年第一季度开始时可用的信息构建样本期间的预测。当您单击 **OK** 时，EViews 会同时显示预测图和评估实际数据拟合质量的统计数据：



或者，我们也可以选择检查对 **M1** 水平的预测。单击 **EQLAGS** 工具栏中的 **Forecast** 按钮打开预测对话框，然后在 **Series to forecast** 选项下选择 **M1**。输入一个新名称来保存预测和标准误差，例如 **M1LEVEL_F** 和 **M1LEVEL_SE**，然后单击 **OK**。

Forecast

Forecast equation
EQLAGS

Series to forecast
☒ M1 ☐ LOG(M1)

Series names
Forecast name: m1level_f
S.E. (optional): m1level_se
GARCH(optional):

Forecast sample
1993 1996

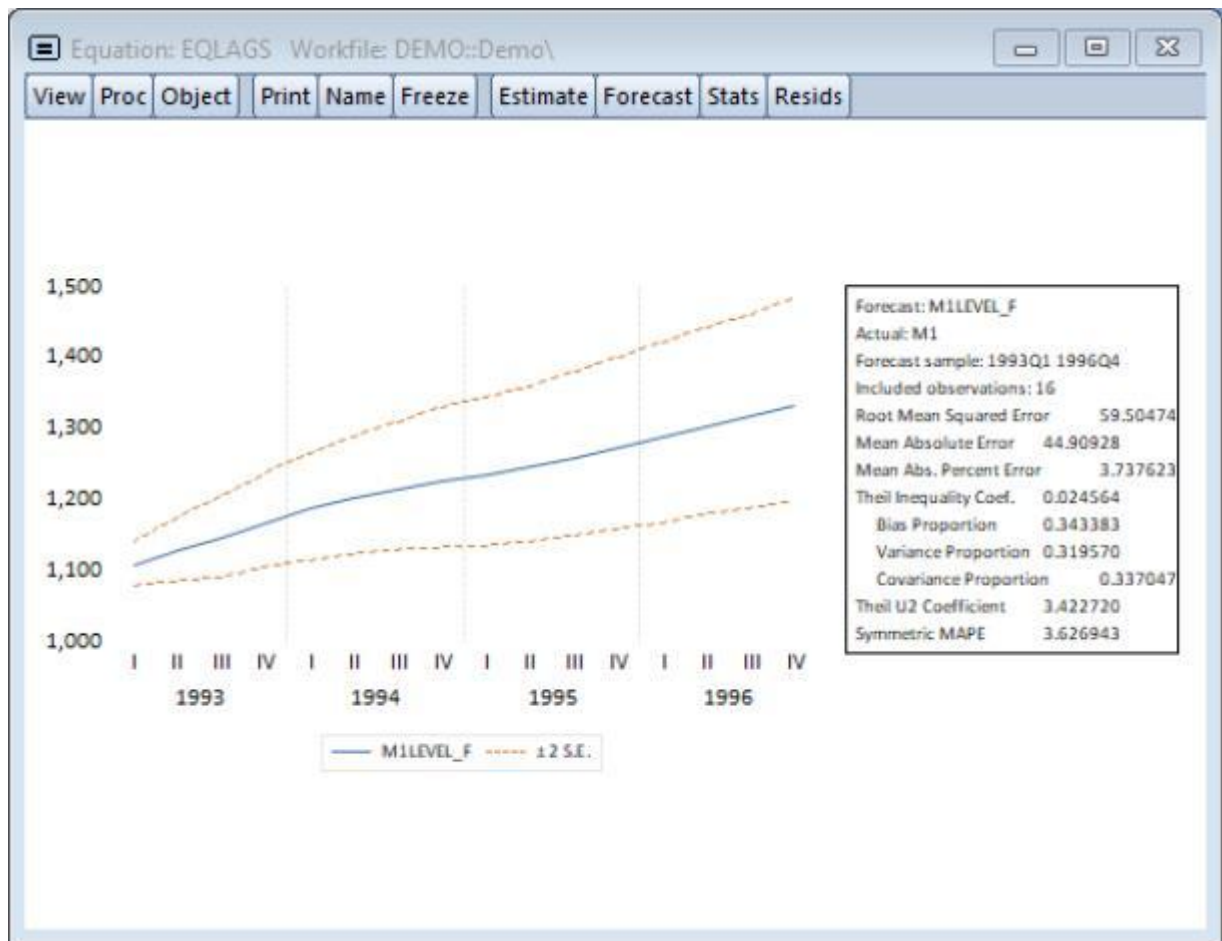
☒ Insert actuals for out-of-sample observations

Method
☒ Dynamic forecast
☐ Static forecast
☒ Coef uncertainty in S.E. calc
☐ Stochastic simulation
Repetitions: 1000
Failed reps prop. before halting: .02

Output
Graph: Forecast
☒ Forecast evaluation

OK Cancel

EViews 将呈现 M1 水平的预测图表，以及该预测的不对称置信区间：

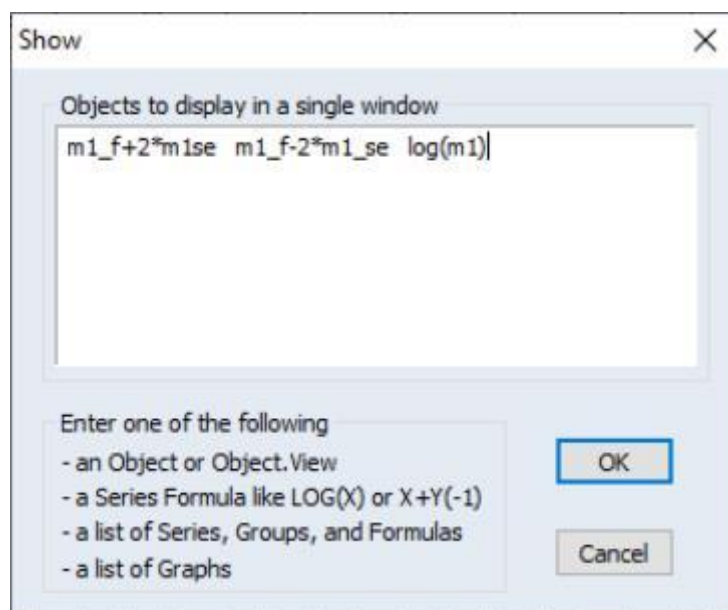


预测程序生成的序列是普通的 EViews 序列，您可以以通常的方式使用它们。例如，我们可以使用 $\text{LOG}(\text{M1})$ 的预测序列和预测的标准误差来绘制实际值与预测值的（近似）95% 置信区间。

我们将首先创建一个包含这些值的新组对象。从主菜单中选择 **Quick/Show...**，然后输入表达式：

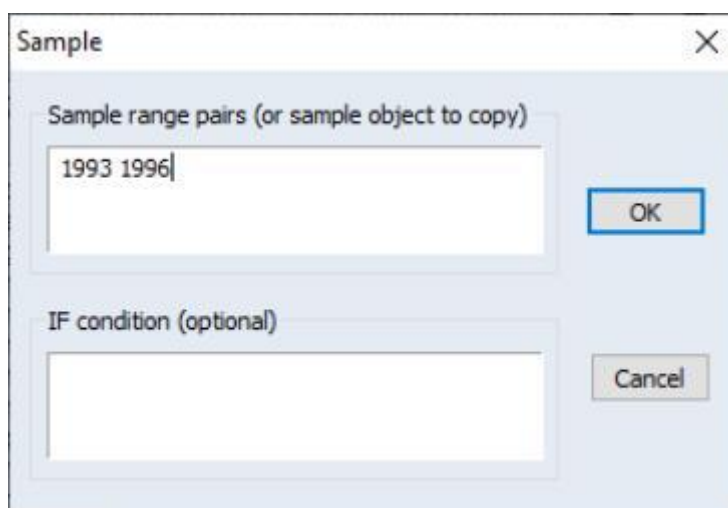
```
m1_f+2*m1_se m1_f-2*m1_se log(m1)
```

创建一个包含 $\text{LOG}(\text{M1})$ 预测的置信区间和 $\text{LOG}(\text{M1})$ 实际值的组：

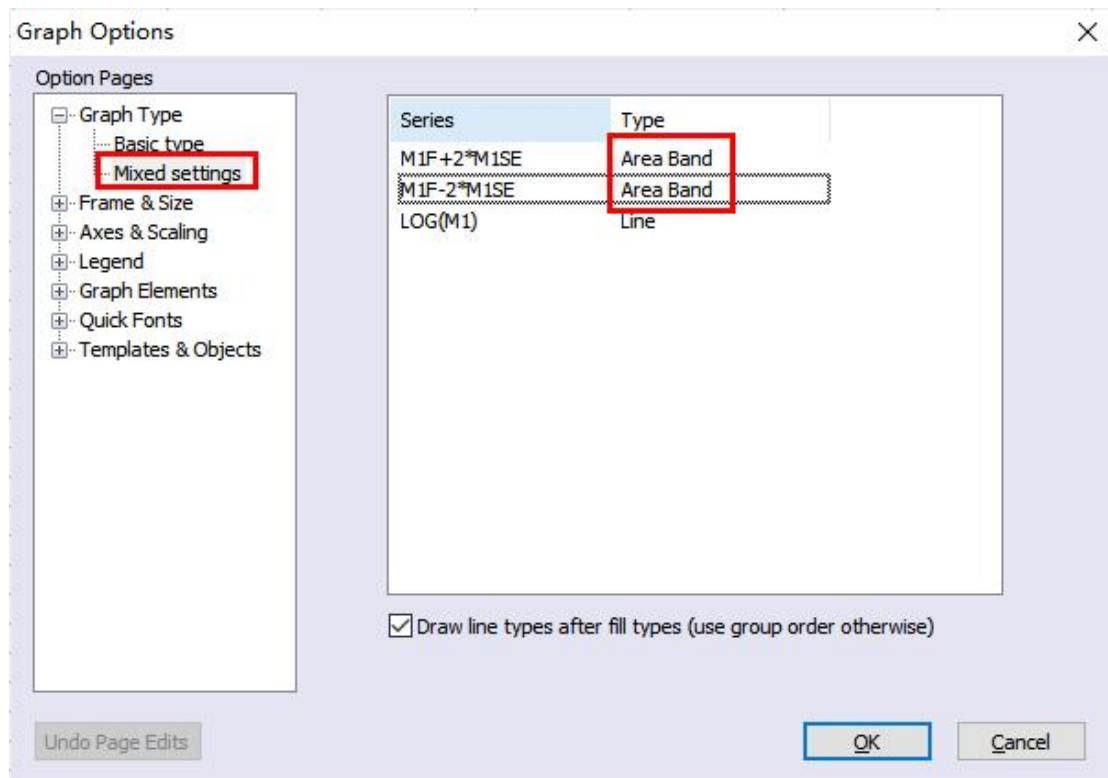
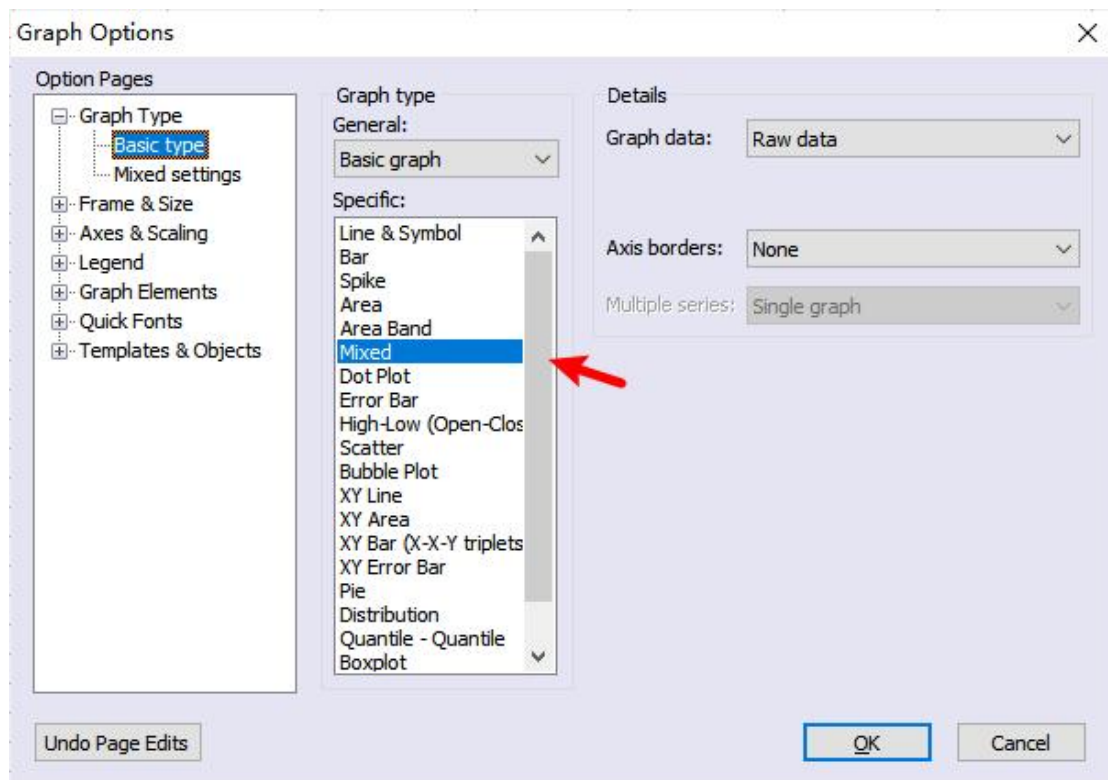


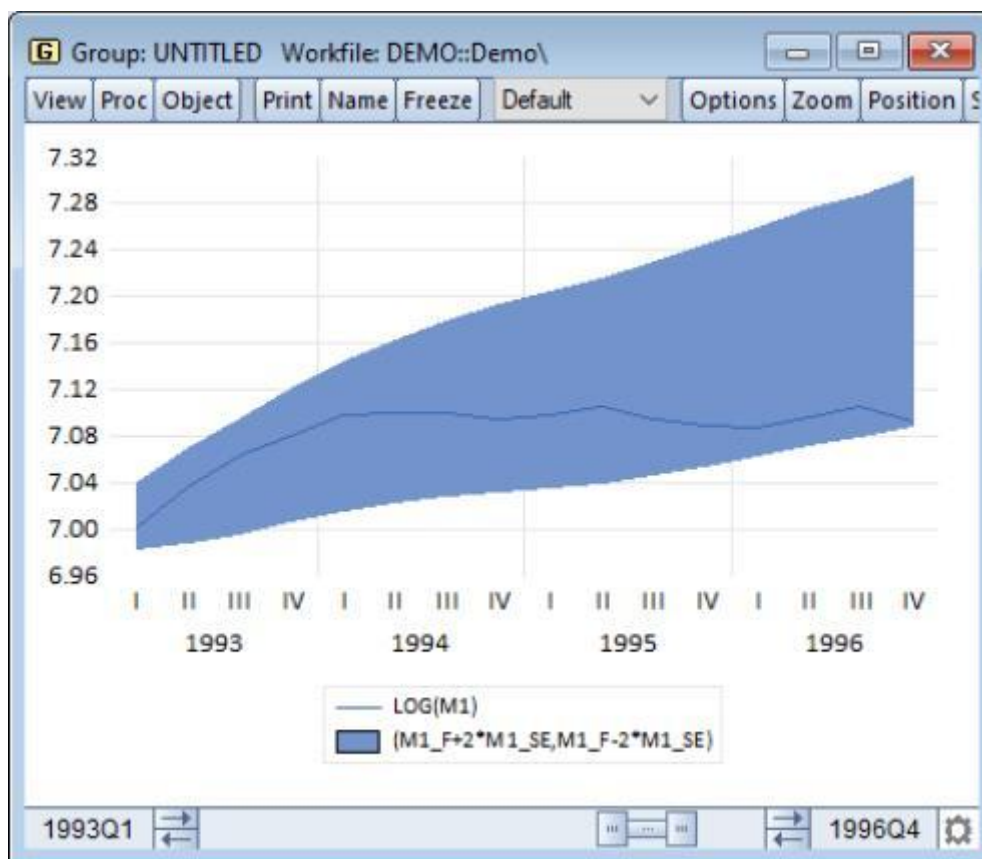
对话框中有三个表达式。前两个代表（大约）**95%** 预测区间的上限和下限，通过评估点预测值加上和减去标准误差的两倍来计算。最后一个表达式表示因变量的实际值。

当您单击 **OK** 时，EViews 会打开一个无标题的组窗口，其中包含数据的电子表格视图。在绘制数据之前，我们将更改观测样本，以便我们仅绘制预测样本的数据。选择 **Quick/Sample...** 或单击组工具栏中的 **Sample** 按钮，然后将样本更改为仅包括预测期：



要绘制预测期间的数据，请从组窗口中选择 **View/Graph...** 并从 **Graph Options** 对话框左侧的列表中选择 **Mixed**，然后转到 **Mixed settings** 节点，将前两项设置为 **Area Band**，以及最后一项为 **Line**：

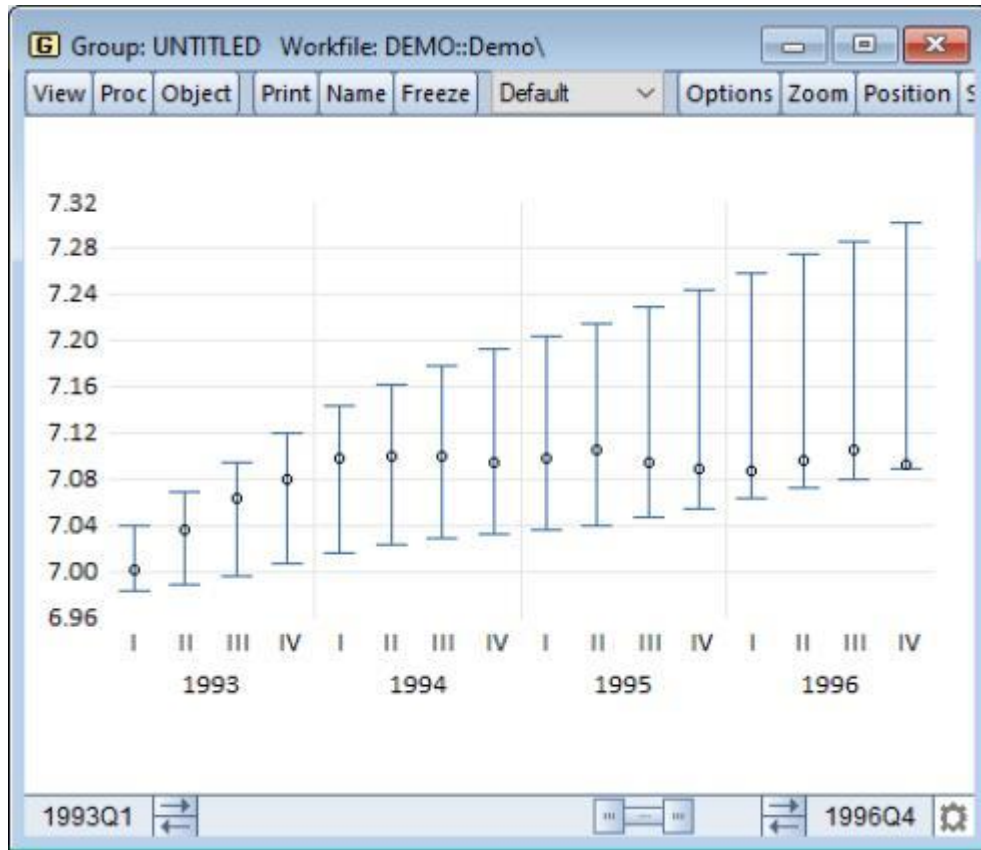




$\log(M1)$ 的实际值用线表示，面积带显示大约 95% 的置信区间。

（请注意，图表底部的滑块表示我们仅查看工作文件范围的子集）。

对于这些数据的替代视图，您可以从对话框的列表中选择 **View/Graph...** 和 **Error Bar**，该对话框将显示如下图表：



该图清楚地表明 $\text{LOG}(\text{M1})$ 的预测高估了预测期最后四个季度的实际值。