

IZVJEŠĆE O TESTIRANJU AGSIFAL-a

AGSIFAL pokazuje bolje prognostičke sposobnosti u odnosu na standardne ekonometrijske filtere Hodrick and Prescott (1997), Baxter and King (1999), Christiano and Fitzgerald (2003). Ograničenja AGSIFALA u odnosu na druge je što iziskuje izvođenje svakog pojedinačnog filtera (za GDP, nezaposlenost, inflaciju) što s jedne strane jest ograničenje no s druge strane ukazuje na potrebu razvoja specifičnih ekonometrijskih filtera za pojedine vremenske serije a ne univerzalnih filtera (koji nisu temeljeni na ekonomskoj teoriji) univerzalnog formata za sve vremenske serije.

Autor: Prof.dr.sc. Marinko Škare, voditelj projekta

