



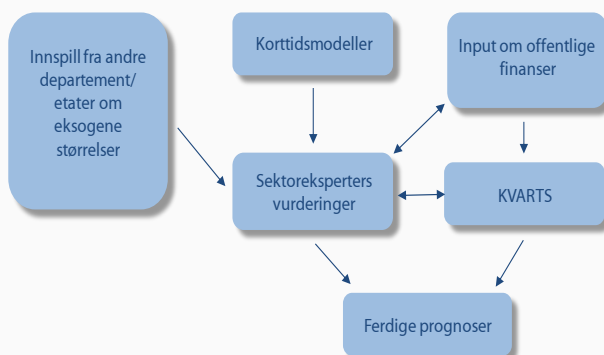
Finansdepartementet

Finansdepartementets system for kortsiktige prognoser (FINKOR) – utkast til notat

Olav Slettebø

Oslo, 28. november 2018

Skisse over prognosearbeidet i Økonomiavdelingen



Finansdepartementet

Hva skal vi med modeller for kortsiktige prognoser?

- Kan være mer treffsikre på kort sikt – gode erfaringer fra Norges Bank og andre policyinstitusjoner
- Fungere som kryssjekk av sektoreksperters vurderinger
- Kan systematisere strømmen av løpende statistikk
- Tapsfunksjon?

Kort om oppsettet

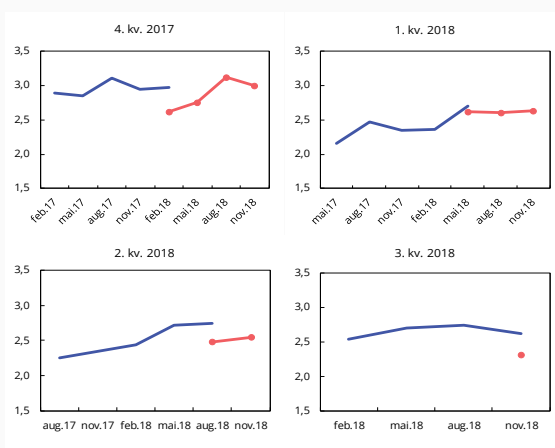
- VAR-, ARMA- og faktormodeller
- Foreløpig kun anslag for fastlands-BNP
- Ett anslag fra hver modellklasse
- Sammenvekting – ulike alternativer

Datasett – her er det litt av hvert

Kategori	Antall serier
Internasjonal økonomi	17
Undersøkelser (inkl. konjunkturbarometeret, reg. nettverk mv)	20
Annet (inkl. salg, oljeproduksjon, mv)	13
Industri	11
Eksport/import	11
Renter og valutakurs	10
Arbeidsmarked	5
Priser	4
Oslo Børs	4
Totalt	95

Tidsserier som inngår i FINs modellsystem

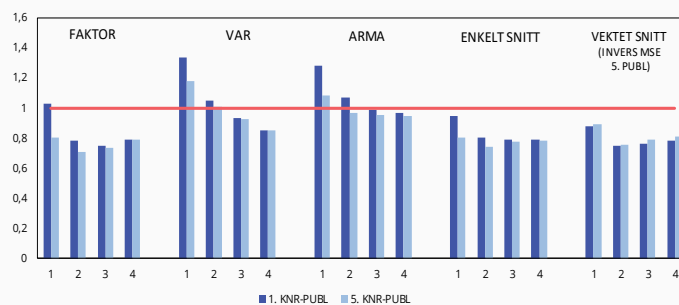
Trefferikhet, siste fire kvartaler



Blått: Anslag fra modellsystemet (altså ikke FINs offentlig publiserte anslag) for firekvartalersveksten i fastlands-BNP.

Rødt: Firekvartalersvekst i fastlands-BNP fra KNR, ulike publiseringer.

Relativ RMSE etter modellklasse



Det var det!