

Некоторые подходы к прогнозированию экономических показателей.- М.
ИЭПП.2005.С. 195

Настоящая работа является продолжением исследований ИЭПП, проведенных в 2002-2003 гг. по вопросам моделирования и прогнозирования социально-экономических временных рядов. В работе представлен обзор литературы, вышедшей в последние годы и посвященной прогнозированию с использованием различных типов эконометрических моделей. Предложен метод прогнозирования с применением информативных структур: дано теоретическое обоснование, приведены результаты прогнозирования и сравнения с результатами прогнозирования при помощи моделей ARIMA. Рассматривается эконометрическая модель сценарных прогнозов основных макроэкономических показателей РФ. Приведены результаты расчетов прогнозных значений, построенные на основе двух сценариев. Предпринята попытка построения системы индикаторов - предвестников финансового кризиса.

Содержание

Введение	5
<i>М. Турунцева</i>	
1. Эконометрические методы прогнозирования социально-экономических показателей	7
1.1. Эконометрические методы прогнозирования.....	7
1.2. Прогнозирование с использованием моделей временных рядов	11
1.3. Методы оценки качества прогнозов	13
1.4. Анализ и сравнение прогнозных свойств различных моделей.....	18
Литература к статье 1	22
<i>А. Юдин</i>	
2. Прогнозирование временных рядов с использованием информативных структур	24
2.1 Теоретические основы прогнозирования с использованием информативных структур статистических систем	24
2.1.1. Статистические системы и их структуры: основные понятия	24
2.1.2. Информативные структуры статистических систем	32
2.1.3. Сложность статистических систем.....	39
2.1.4. Принципы прогнозирования статистических систем	43
2.2. Прогнозирование временных рядов с использованием информативных структур.....	46
2.2.1. Результаты расчетов	47
2.2.2. Сравнение с прогнозом по ARIMA- моделям.....	56
Приложение к статье 2	59
Литература к статье 2.....	101
<i>Дробышевский, П. Кадочников, С. Пономаренко</i>	

3. Среднесрочный макропрогноз для России на основании структурных эконометрических уравнений	104
3.1.Макроэкономическая модель, исходные данные и условия.....	104
3.2.Уравнения модели и оценка их прогностических характеристик	108
3.2.1.Валовой внутренний продукт	108
3.2.2.Индекс потребительских цен	111
3.2.3.Налоговые доходы.....	114
3.2.4.Золотовалютные резервы	118
3.2.5.Реальный эффективный курс рубля	121
3.2.6.Номинальный обменный курс.....	124
3.2.7.Экспорт	127
3.2.8.Импорт.....	130
3.2.9.Розничный товарооборот	132
3.2.10.Индекс промышленного производства	134
3.2.11.Безработица	136
3.2.12.Реальные доходы населения.....	139
Приложение к статье 3.....	141
Литература к статье 3	142

П. Трунин

4. Мониторинг финансового кризиса в РФ	144
4.1 Обзор литературы	145
4.1.1.Теоретическая литература	145
4.1.2.Эмпирическая литература	150
4.2.Методологические вопросы	154
4.2.1.Индикаторы	155
4.2.2.Определение валютного кризиса.....	158
4.3.Мониторинг возможности финансового кризиса в РФ в 1999-2004 г.г.....	160
4.3.1. Индикаторы – предвестники финансового кризиса	160
Литература к статье 4.....	185