

# Содержание

## Предисловие

## Глава 1. Значение и содержание социально-экономического прогнозирования

1.1. Роль прогнозирования в принятии управленческих решений

1.2. Классификация социально-экономических прогнозов и методов прогнозирования

1.3. Инструментарий прогнозирования

Контрольные вопросы

## Глава 2. Временные ряды и их предварительный анализ

2.1. Виды временных рядов

2.2. Основные показатели динамики социально-экономических явлений

2.3. Компоненты временных рядов

2.4. Основные характеристики временных рядов

Контрольные вопросы

Задачи и упражнения

## Глава 3. Моделирование тенденции развития

3.1. Проверка гипотезы о существовании неслучайной составляющей временного ряда

3.2. Модели кривых роста

3.3. Сглаживание временных рядов с помощью скользящих средних

3.4. Определение порядка аппроксимирующего полинома с помощью метода последовательных разностей

3.5. Проверка адекватности и точности моделей временного ряда

Контрольные вопросы

Задачи и упражнения

## Глава 4. Прогнозирование периодических колебаний

4.1. Методы выделения сезонных колебаний

4.2. Методы спектрального анализа для исследования периодических

колебаний

Контрольные вопросы

Задачи и упражнения

## Глава 5. Адаптивные методы прогнозирования

5.1. Сущность адаптивных методов. Экспоненциальное сглаживание

5.2. Адаптивные многопараметрические модели.

Учет сезонности

Контрольные вопросы

Задачи и упражнения

## Глава 6. Модель авторегрессии — проинтегрированного

скользящего среднего

6.1. Модели авторегрессии

6.2. Модель скользящего среднего

6.3. Модель авторегрессии-скользящего среднего

6.4. Модель Бокса—Дженкинса

6.5. Прогнозирование на основе модели авторегрессии

проинтегрированного скользящего среднего

Контрольные вопросы

Задачи и упражнения

## Глава 7. Нестационарные временные ряды и тестирование на стационарность

Контрольные вопросы

Задачи и упражнения

## Глава 8. Модели волатильности

Контрольные вопросы

Задачи и упражнения

## Глава 9. Многофакторные модели прогнозирования

9.1. Распределенные лаги

- 9.2 Прогнозирование на основе индикаторов
- 9.3 Принцип баланса переменных
- 9.4 Адаптивная модель множественной регрессии

Контрольные вопросы

Задачи и упражнения

## Глава Ю. Экспертные методы прогнозирования

10.1.Метод Дельфи

10.2.Прогнозный сценарий

Контрольные вопросы

Задачи и упражнения

## Глава 11. Системно-структурные методы прогнозирования

11.1.Матричный метод

11.2.Морфологический анализ

Контрольные вопросы

Задачи и упражнения

## Литература

Ресурсы Интернет

## ПРИЛОЖЕНИЕ 1

Начало работы с EViews6.0

## ПРИЛОЖЕНИЕ 2

Статистические таблицы