

ОГЛАВЛЕНИЕ

Предисловие

Введение

Литература

Глава 1. Основы разработки прогнозов развития социально-экономических систем

1.1. Понятийный аппарат прогнозирования

1.2. Общее содержание процедуры прогнозирования в практике управления

1.3. Типология методов прогнозно-аналитических исследований

Вопросы для самоконтроля

Литература

Глава 2. Эконометрические методы и модели в обосновании прогнозов развития

2.1. Особенности эконометрических методов прогнозирования

2.1.1. Основные понятия и определения

2.1.2. Процедура построения и использования эконометрической модели прогнозирования

2.2. Методы оценки качества эконометрических прогнозов

2.2.1. Характеристики информационной пригодности эконометрической модели

2.2.2. Характеристики прогностической пригодности эконометрической модели

2.2.3. Специальные методы тестирования важнейших статистических гипотез

2.3. Специфика требований к информационному обеспечению эконометрических исследований

Вопросы и задачи для самоконтроля

Литература

Глава 3. Прогнозирование на основе факторных регрессионных моделей

3.1. Основные понятия

3.2. Оценка параметров линейной регрессии методом наименьших квадратов

3.3. Оценка точности прогноза на модели многофакторной регрессии

3.4. Методы повышения качества прогноза на факторной модели

3.4.1. Дисперсионный анализ регрессионной модели

3.4.2. Уточнение спецификации регрессионной модели

3.4.3. Корреляционный анализ в спецификации регрессионной модели

3.4.4. Мультиколлинеарность: признаки и причины, методы устранения

3.4.5. Обнаружение гетероскедастичности остатков модели

3.4.6. Автокорреляция остатков регрессионной модели

3.4.7. Специальные приемы коррекции множественных регрессионных моделей

Вопросы и задачи для самоконтроля

Литература

Глава 4. Прогнозирование временных рядов

4.1. Особенности представления и моделирования временных рядов

4.1.1. Понятие стационарного процесса

4.1.2. Понятие белого шума в моделях динамики временных рядов

4.1.3. Общая процедура моделирования и прогноза временных рядов

4.1.4. Основы тестирования временных рядов. Идентификация характера тренда с использованием критерия Дикки—Фуллера

4.2. Прогнозирование на классических декомпозиционных моделях временных рядов

4.2.1. Прогнозирование с использованием алгоритмических методов сглаживания временных рядов

4.2.2. Прогнозирование с использованием аналитических методов сглаживания временных рядов

4.3. Прогнозирование на основе методологии Бокса—Дженкинса

Вопросы для самоконтроля

Задачи для самоконтроля

Литература

Глава 5. Прогнозирование с использованием систем одновременных уравнений

5.1. Понятие систем одновременных уравнений

5.2. Особенности оценивания параметров систем одновременных уравнений

5.3. Косвенный метод наименьших квадратов

5.4. Проблема идентифицируемости в системах одновременных уравнений

5.5. Двухшаговый метод наименьших квадратов

5.6. Прогнозирование на основе систем одновременных уравнений

Вопросы и задачи для самоконтроля

Литература

Глава 6. Прогнозирование на основе нейросетевого моделирования

Вопросы для самоконтроля

Литература

Глава 7. Прогнозирование с использованием методов линейного программирования

7.1. Расчет оптимальных значений задачи линейного программирования

7.2. Постоптимизационный анализ задачи линейного программирования

Вопросы и задачи для самоконтроля

Литература

Глава 8. Прогнозирование на основе экспертных суждений

8.1. Особенности экспертного оценивания и основы методики экспертного прогнозирования

8.2. Обоснование способов представления экспертных суждений

8.3.Обоснование качественного и количественного состава экспертной группы

8.3.1.Оценка количественного состава группы экспертов

8.3.2.Оценка качественного состава группы экспертов

8.4. Методы обработки результатов экспертного прогнозирования

8.4.1. Обоснование и вычисление групповой экспертной оценки

8.4.2. Методы оценки качества экспертного прогноза

Вопросы и задачи для самоконтроля

Литература

Глава 9. Методы комплексного прогнозирования

9.1.Специальные методы нормативного прогнозирования

9.2.Прогнозирование с использованием методологии сценарного исследования

Вопросы и задачи для самоконтроля

Литература

Заключение

Приложения

Приложение I. Иллюстративный материал

Приложение II. Статистические таблицы