

СОДЕРЖАНИЕ

Предисловие

Глава 1 ВВЕДЕНИЕ В АНАЛИЗ И ПРОГНОЗИРОВАНИЕ ВРЕМЕННЫХ РЯДОВ

§1.1. Типы экономических прогнозов

§ 1.2. Основные аналитические характеристики динамики и их использование при прогнозировании

§1.3. Компонентный состав временных рядов

Глава 2 ИСПОЛЬЗОВАНИЕ СКОЛЬЗЯЩИХ СРЕДНИХ

§2.1. Сглаживание временных рядов с помощью простых скользящих средних

§ 2.2. Особенности применения взвешенных скользящих средних

Глава 3 ПРОГНОЗИРОВАНИЕ ТЕНДЕНЦИИ РАЗВИТИЯ С ПОМОЩЬЮ МОДЕЛЕЙ КРИВЫХ РОСТА

§3.1. Применение трендовых моделей в социально-экономических исследованиях

§ 3.2. Определение коэффициентов трендовых моделей методом наименьших квадратов в матричном виде

§ 3.3. Выявление автокорреляции первого порядка: критерий Дарбина-Уотсона

§ 3.4. Оценка точности выбранных моделей прогнозирования

Глава 4 СТАТИСТИЧЕСКИЙ АНАЛИЗ И ПРОГНОЗИРОВАНИЕ СЕЗОННЫХ КОЛЕБАНИЙ

§4.1. Выделение сезонной составляющей

§ 4.2. Прогнозирование с помощью тренд-сезонных моделей

§ 4.3. Применение фиктивных переменных для моделирования сезонных колебаний

Глава 5. АДАПТИВНЫЕ МЕТОДЫ ПРОГНОЗИРОВАНИЯ.
ИСПОЛЬЗОВАНИЕ МОДЕЛЕЙ ARIMA В ЭКОНОМИЧЕСКИХ
ИССЛЕДОВАНИЯХ

§5.1. Применение адаптивных методов при краткосрочном прогнозировании

§ 5.2. Прогнозирование с помощью моделей ARIMA

Контрольные вопросы

Тесты

Приложения

Список литературы