

Spis treści

Wstęp	7
Rozdział 1. Podstawowe zagadnienia prognostyczne	11
1.1. Prognozowanie i prognozy	11
1.2. Rodzaje prognoz i modeli prognostycznych.....	12
1.3. Ocena dokładności i dopuszczalności prognoz	18
1.3.1. Mierniki <i>ex ante</i>	19
1.3.2. Mierniki <i>ex post</i>	21
1.3.3. Dopuszczalność prognoz i horyzont predykcji.....	24
Rozdział 2. Prognozowanie na podstawie klasycznego przyczynowo-opisowego modelu ekonometrycznego	27
2.1. Postać modelu ekonometrycznego	27
2.2. Etapy budowy modelu ekonometrycznego.....	29
2.2.1. Etap I – specyfikacja zmiennych i wybór postaci analitycznej modelu.....	29
2.2.2. Etap II – estymacja parametrów strukturalnych i parametrów struktury stochastycznej modelu	29
2.2.3. Etap III – weryfikacja modelu.....	30
2.2.4. Etap IV – praktyczne wykorzystanie oszacowanego modelu w celu prognozowania.....	38
2.3. Przykład modelowania i prognozowania na podstawie klasycznego modelu ekonometrycznego	39
2.4. Zadania	64
2.5. Odpowiedzi.....	68
Rozdział 3. Modele szeregów czasowych	69
3.1. Wprowadzenie	69
3.2. Wybór postaci analitycznej funkcji trendu	71
3.3. Prognozowanie na podstawie modeli trendu	76
3.4. Prognozowanie na podstawie modeli trendu uwzględniających wahania periodyczne	98

3.5. Zadania	104
3.6. Odpowiedzi.....	106
Rozdział 4. Prognozowanie w warunkach zmian strukturalnych	108
4.1. Zmiany strukturalne i ich identyfikacja	108
4.2. Model prognostyczny w warunkach zmian struktury	110
4.3. Trend pełzający i metoda wag harmonicznycy	121
4.4. Zadania	132
4.5. Odpowiedzi.....	135
Rozdział 5. Mechaniczne metody prognozowania	137
5.1. Modele szeregów czasowych ze stałym poziomem zmiennej prognozowanej	137
5.1.1. Metoda naiwna	137
5.1.2. Modele średniej ruchomej	138
5.1.3. Prosty model wygładzania wykładniczego.....	139
5.2. Prognozy na podstawie modeli wyrównywania wykładniczego z trendem	145
5.2.1. Model liniowy Browna.....	145
5.2.2. Model liniowy Holta.....	146
5.2.3. Model nieliniowy z dwoma parametrami	146
5.3. Zadania	153
5.4. Odpowiedzi.....	154
Bibliografia.....	157
Tabele	159