Станкевич Иван Павлович Методы предобработки данных для использования в динамических моделях общего экономического равновесия

ОГЛАВЛЕНИЕ ДИССЕРТАЦИИ

кандидат наук Станкевич Иван Павлович

ВВЕДЕНИЕ

1. ОБЗОР ЛИТЕРАТУРЫ

1.1. Подходы к описанию многопродуктовой структуры экономики

1.2. Другие подходы к описанию экономики

1.3. Использование схемы декомпозиции

1.4. Вопросы оценивания макроэкономических моделей

2. ПОДГОТОВКА И СЕЗОННАЯ КОРРЕКТИРОВКА ДАННЫХ

2.1. Основные подходы и базовые предположения

2.2. Выделение сезонности при макроэкономическом моделировании

2.2.1. Аксиоматика выделения сезонности

2.2.2. Устойчивость мультипликативных соотношений для стандартных процедур

2.3. Описание и анализ процедуры выделения сезонности с детектором выбросов

2.4. Оценка качества процедуры выделения сезонности

2.4.1. Тестирование процедуры на искусственных данных

2.5. Сохранение статистических свойств ряда

2.5.1. Тесты на единичные корни

2.5.2. Тесты на коинтеграцию

2.6. Тестирование процедуры на статистических данных

2.7. Устранение разрывов в статистике ВВП

2.7.1. Проблемы современного представления статистики по ВВП России

2.7.2. Устранение разрывов в показателях в базовых ценах

2.7.3. Устранение разрыва в показателях в текущих ценах

2.8. Наукастинг показателей, публикующихся со значительной

задержкой

2.8.1. Методология

2.8.2. Данные и оценка качества

2.8.3. Результаты

3. МНОГОПРОДУКТОВАЯ МОДЕЛЬНАЯ ДЕКОМПОЗИЦИЯ КОМПОНЕНТ ВВП

3.1. Случай двух продуктов

3.1.1. Модификация СББ-функции

3.2. Результаты оценки декомпозиции на российских данных

3.2.1. Процедура оценки параметров декомпозиции

3.2.2. Проверка устойчивости схемы декомпозиции

3.2.3. Оценка декомпозиции на статистических данных

3.2.4. Обсуждение полученных результатов

4. МНОГОПРОДУКТОВАЯ МОДЕЛЬ ЭКОНОМИКИ С ПРОИЗВОДИТЕЛЕМ И ПОТРЕБИТЕЛЕМ

4.1. Производитель

4.1.1. Постановка задачи

4.1.2. Решение задачи производителя

4.1.3. Проверка модельных соотношений на данных

4.2. Потребитель

4.2.1. Задача агрегированного потребителя

4.2.2. Решение задачи агрегированного потребителя

4.2.3. Оценка модели агрегированного потребителя

4.3. Блок торговцев товарами

ЗАКЛЮЧЕНИЕ

СПИСОК ИСПОЛЬЗОВАННОЙ ЛИТЕРАТУРЫ

ПРИЛОЖЕНИЕ 1: РЕШЕНИЕ ЗАДАЧИ ПРОИЗВОДИТЕЛЯ

Введение