

Spis treści

Wstęp	7
1. Istota prognozowania na podstawie szeregów czasowych	11
<i>Mariusz Hamulczuk, Stanisław Stańko</i>	
1.1. Prawidłowości występujące w szeregach czasowych cen surowców rolnych.....	11
1.2. Analiza i pomiar prawidłowości	17
1.3. Ekstrapolacja prawidłowości	25
1.4. Metody prognozowania na podstawie szeregów czasowych.....	29
2. Metodologia ARIMA	35
<i>Mariusz Hamulczuk</i>	
2.1. Modele ARIMA	35
2.1.1. Procesy stacjonarnych szeregów czasowych	36
2.1.2. Procesy niestacjonarnych i sezonowych szeregów czasowych	39
2.2. Identyfikacja modeli ARIMA	41
2.3. Estymacja i weryfikacja modeli ARIMA.....	50
3. Metody sezonowej korekty danych: X-12-ARIMA i TRAMO/SEATS.....	55
<i>Sylwia Grudkowska</i>	
3.1. Wprowadzenie.....	55
3.2. Metoda X-12-ARIMA.....	56
3.2.1. Model RegARIMA	60
3.2.2. Algorytm X-11	72
3.3. Metoda TRAMO/SEATS.....	75
3.3.1. Algorytm TRAMO	76
3.3.2. Procedura SEATS.....	77
3.4. Walidacja modelu.....	81
4. Analiza i modele szeregów czasowych cen zbóż i cen mleka	93
<i>Sylwia Grudkowska</i>	
4.1. Ceny pszenicy	93
4.2. Ceny żyta.....	103
4.3. Ceny mleka.....	116

5. Analiza i modele szeregów czasowych cen skupu żywca	125
<i>Katarzyna Hertel</i>	
5.1. Ceny żywca wieprzowego.....	125
5.2. Ceny żywca drobiowego	134
5.3. Ceny wołowiny	144
6. Weryfikacja empiryczna metod prognostycznych	155
<i>Mariusz Hamulczuk, Cezary Klimkowski</i>	
6.1. Metodyka oceny przydatności metod.....	155
6.1.1. Metodyka oceny prognoz wygasłych	156
6.1.2. Prognozy naiwne	158
6.1.3. Prognozy ekspertów ARR	160
6.2. Dokładność prognoz obliczonych z wykorzystaniem modeli RegARIMA oraz TRAMO.....	162
6.3. Dokładność prognoz obliczonych z wykorzystaniem modeli ARIMA ..	173
6.3.1. Pszenica	175
6.3.2. Żyto	177
6.3.3. Mleko	180
6.3.4. Żywiec wieprzowy	182
6.3.5. Żywiec wołowy	184
6.3.6. Żywiec drobiowy	187
Podsumowanie.....	191
<i>Mariusz Hamulczuk</i>	
Literatura	197