**Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение высшего образования**

**«РОССИЙСКАЯ АКАДЕМИЯ НАРОДНОГО ХОЗЯЙСТВА**

**и ГОСУДАРСТВЕННОЙ СЛУЖБЫ**

**при ПРЕЗИДЕНТЕ РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ»**

**ИНСТИТУТ ЭКОНОМИКИ, МАТЕМАТИКИ И ИНФОРМАЦИОННЫХ ТЕХНОЛОГИЙ**

**ЭКОНОМИЧЕСКИЙ ФАКУЛЬТЕТ**

**ОТДЕЛЕНИЕ ЭКОНОМИКИ**

Направление 38.03.01 Экономика

Выпускающая кафедра: микроэкономика

УТВЕРЖДАЮ

Заведующий

выпускающей кафедры

\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

«\_\_\_\_» \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_20\_\_\_г.

**ЗАДАНИЕ**

**на выпускную квалификационную работу**

студента ЭО-15-01 группы очной формы обучения

Касьяновой Ксении Алекссевны

*(Ф.И.О.)*

1.Тема выпускной квалификационной работы:

Прогнозирование иерархических врменных рядов

2. Цель исследования:

сравнение моделей, учитывающих иерархическую структуру данных, выявление факторов, позволяющих улучшить прогнозы агрегированного временного ряда.

3.Задачи исследования:

1) сбор данных с трехуровневой иерархической структурой;

2) выбор моделей для прогнозирования агрегированного ряда;

3) сравнение различных методов комбинирования прогнозов нижних рядов, полученнных по выбранным моделям;

4) кластеризация временных рядов третьего уровня для получения агрегированных ря-

дов второго уровня, сравнение качества прогнозов полученным по рядам второго уровня, сгруппированным по оригнальным признакам и по кластерам;

5) прогнозирование рядов второго и третьего уровня по выбранным моделям, сравнение

суммы и оптимальной комбинации этих прогнозов с прогнозом агрегированного вре-

менного ряда.

4. Ожидаемый результат:

Используя модели, учитывающие иерархическую структуру данных, можно значительно учлучшить прогнозы агрегированного временного ряда.

5. Руководитель:

старший преподаватель

Демешев Борис Борисович

*(Ф.И.О., должность, ученая степень, звание)*

6.Срок сдачи законченной выпускной квалификационной работы:

«\_\_\_\_\_» мая 2019 г.

7. Задание составил: старший преподаватель

Демешев Борис Борисович

*(Ф.И.О., должность, ученая степень, звание)*

\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_(подпись руководителя)

«\_\_\_\_\_»\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_20\_\_\_г.

8. Задание принял к исполнению:

\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_(подпись студента)

«\_\_\_\_\_»\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_20\_\_\_г.