

Документ подписан простой электронной подписью  
Информация о владельце:  
ФИО: Костровец Лариса Борисовна  
Должность: директор  
Дата подписания: 16.05.2026 10:39:46  
Уникальный программный ключ:  
6882606104c36dbde41c4ab93a65382136a292d6

Приложение 4  
к образовательной программе

**РАБОЧАЯ ПРОГРАММА ДИСЦИПЛИНЫ**

Б1.В.07 Стратегическое прогнозирование рынка  
(индекс, наименование дисциплины в соответствии с учебным планом)

38.04.02 Менеджмент  
(код, наименование направления подготовки)

Стратегическое управление  
(наименование образовательной программы)

очная форма обучения  
(форма обучения)

Год набора – 2026

Донецк

**Автор(ы)-составитель(и) РПД:**

Козлов Владислав Сергеевич, д-р экон. наук, доцент, профессор кафедры менеджмента непроизводственной сферы

**Заведующий кафедрой:**

Тарасова Елена Владимировна, канд. экон. наук, доцент, заведующий кафедрой менеджмента непроизводственной сферы

Рабочая программа дисциплины Б1.В.07 Стратегическое прогнозирование рынка одобрена на заседании кафедры менеджмента непроизводственной сферы Донецкого филиала РАНХиГС

протокол № 11 от «18» марта 2026 г.

## СОДЕРЖАНИЕ

1. Перечень планируемых результатов обучения по дисциплине, соотнесенных с планируемыми результатами освоения программы
2. Объем и место дисциплины в структуре образовательной программы
3. Содержание и структура дисциплины
4. Типы оценочных материалов, показатели и критерии оценивания
5. Формы аттестации и типовые оценочные материалы для текущего контроля успеваемости обучающихся, критерии и шкалы оценивания по контрольным точкам
6. Формы промежуточной аттестации, критерии и шкала оценивания, типовые оценочные материалы по дисциплине
7. Методические материалы по освоению дисциплины
8. Учебная литература и ресурсы информационно-телекоммуникационной сети «Интернет»
9. Материально-техническая база, информационные технологии, программное обеспечение и информационные справочные системы

**1. Перечень планируемых результатов обучения по дисциплине, соотнесенных с планируемыми результатами освоения образовательной программы**

Дисциплина Б1.В.07 Стратегическое прогнозирование рынка обеспечивает формирование у обучающихся следующих профессиональных компетенций:

<b>ОТФ/ТФ и реквизиты ПС (при наличии)</b>	<b>Код компетенции</b>	<b>Наименование компетенции</b>	<b>Код индикатора достижения компетенции</b>	<b>Наименование индикатора достижения компетенции</b>	<b>Образовательный результат</b>
08.036 Специалист по работе с инвестиционными проектами, утв. приказом Министерства труда и социальной защиты РФ от 23 сентября 2024 года №497н. В Управление рисками инвестиционного проекта	ПК-1	Способен осуществлять управление рисками инвестиционного проекта	ПК-1.1	Выявляет и документирует риски инвестиционного проекта	<i>ПК-1.1. 3-15 Знает: особенности применения механизмов привлечения инвестиций для различных отраслей экономики</i>
			ПК-1.4	Разрабатывает мероприятия по управлению рисками в рамках реализации инвестиционного проекта	<i>ПК-1.4. У-10 Умеет: анализировать данные о факторах, ценах и тенденциях рынка в рамках реализации инвестиционного проекта  ПК-1.4. У-11 Умеет: использовать эконометрические методы прогнозирования развития рынка на краткосрочную, среднесрочную и долгосрочную перспективу</i>
08.043 Экономист предприятия, утв. приказом Министерства труда и социальной защиты	ПК-2	Способен осуществлять стратегическое управление ключевыми экономическими показателями и бизнес-	ПК-2.1	Формирует экономическую постановку задач либо отдельных их этапов	<i>ПК-2.1. 3-1 Знает: методы экономического анализа и учета показателей деятельности организации и ее подразделений</i>
					<i>ПК-2.1. 3-4 Знает: отечественный и зарубежный опыт рациональной организации экономической деятельности организации в условиях рыночной экономики</i>

<p>Российско й Федераци и от 30 марта 2021 года №161н В/02.7 Стратегич еское управлени е экономич ескими показател ями</p>		<p>процессами</p>			<p><i>ПК-2.1. У-3 Умеет: производить анализ хозяйственной деятельности организации</i></p>
			<p>ПК-2.3</p>	<p>Разрабатыва ет и обосновывае т финансово- экономическ ие показатели, характеризу ющие деятельност ь хозяйствую щих субъектов, и методик их расчета</p>	<p><i>ПК-2.3. 3-9 Знает: порядок разработки перспективных и годовых планов финансово- хозяйственной и производственной деятельности организации</i></p>
					<p><i>ПК-2.3. У-8 Умеет: разрабатывать стратегии поведения экономических агентов на различных рынках</i></p>
					<p><i>ПК-2.3. У-11 Умеет: составлять прогноз основных финансово- экономических показателей деятельности организации</i></p>
			<p>ПК-2.6</p>	<p>Прогнозируе т динамику основных финансово- экономическ их показателей деятельност и организации</p>	<p><i>ПК-2.6. 3-9 Знает: порядок разработки перспективных и годовых планов финансово- хозяйственной и производственной деятельности организации</i></p>
					<p><i>ПК-2.6. У-11 Умеет: составлять прогноз основных финансово- экономических показателей деятельности организации</i></p>

## **2. Объем и место дисциплины (модуля) в структуре образовательной программы**

Общий объем дисциплины:

3,00 з.е., 108 ак.час

Контактная работа обучающихся с преподавателем по видам учебных занятий: 28 ак. час на контактную работу с преподавателем, из них 14 ак.час на лекции и 14 ак.час на практические занятия. 71 ак. час на самостоятельную работу обучающихся.

Б1.В.07 Стратегическое прогнозирование рынка реализуется на 2-м курсе в 3-м семестре после изучения дисциплин:

- Стратегическое планирование и бизнес-план;
- Управление изменениями.

### 3. Содержание и структура дисциплины (модуля)

#### 3.1. Структура дисциплины (модуля)

*Очная форма обучения*

№ п/п	Наименование тем и (или) разделов	ВСЕГО	Объем дисциплины, ак.час											Форма текущего контроля успеваемости, промежуточной аттестации	
			Контактная работа обучающихся с преподавателем по видам учебных занятий								Самостоятельная работа				
			Период теоретического обучения						Период промежуточной аттестации (сессия)		СРкр	СРэк	СР		
			Занятия лекционного типа		Занятия семинарского типа		ИК	КСР	КЭ	Кат.тэк					Контроль
			Л	ВЛ	ЛР	ПЗ									
<b>Раздел 1. Теоретико-методологические основы стратегического прогнозирования рынка</b>															
Тема 1.	Предпосылки, понятийный аппарат и классификация прогнозов и планов в системе стратегического прогнозирования рынка	14	2	0	0	2	0	0	0	0	0	0	0	10	Доклад, Тестирование

Тема 2.	Методология, принципы и технологии стратегического прогнозирования	14	2	0	0	2	0	0	0	0	0	0	10	Тестирование, Контрольное задание
<b>Раздел 2. Информационно-аналитическое обеспечение и региональный контекст прогнозирования</b>														
Тема 3.	Информационное обеспечение прогнозирования рынка	14	2	0	0	2	0	0	0	0	0	0	10	Тестирование, Контрольное задание
Тема 4.	Стратегическое прогнозирование социально-экономического развития региона как фактор рыночной конъюнктуры	14	2	0	0	2	0	0	0	0	0	0	10	Тестирование, Контрольное задание
<b>Раздел 3. Прикладное прогнозирование рыночной динамики и трансформация прогнозов в управленческие решения</b>														
Тема 5.	Цели, задачи и функции стратегического прогнозирования в управлении рыночными рисками	14	2	0	0	2	0	0	0	0	0	0	10	Тестирование, Контрольное задание
Тема 6.	Прогнозирование рыночной динамики:	14	2	0	0	2	0	0	0	0	0	0	10	Тестирование, Контрольное задание

	спрос, предложение, цены и поведение конкурентов													
Тема 7.	Трансформация прогнозных сценариев в стратегические управленческие решения: механизмы, фильтры и процедуры имплементации	15	2	0	0	2	0	0	0	0	0	0	11	Тестирование, Контрольное задание
Промежуточная аттестация		9	0	0	0	0	0	0	0	9	0	0	0	Зачет с оценкой
<b>Итого</b>		108	14	0	0	14	0	0	0	9	0	0	71	

*Используемые сокращения:*

Л – лекции - занятия, предусматривающие преимущественную передачу учебной информации обучающимся педагогическими работниками организации и (или) лицами, привлекаемыми организацией к реализации образовательных программ на иных условиях).

ВЛ – видео лекции.

ЛР – лабораторные работы.

ПЗ – практические занятия (за исключением лабораторных работ).

ИК – индивидуальные консультации.

КСР – контроль самостоятельной работы

КЭ – консультации перед экзаменом

Каттэк – контактная работа на аттестацию в период экзаменационных сессий

СРкр – самостоятельная работа на подготовку курсовой работы/ курсового проекта.

СРэк – самостоятельная работа на подготовку к экзамену.

СР – самостоятельная работа в семестре на подготовку к учебным занятиям.

### 3.2. Содержание дисциплины

#### **Тема 1. Предпосылки, понятийный аппарат и классификация прогнозов и планов в системе стратегического прогнозирования рынка. ПК-1.4, ПК-2.1**

В рамках темы изучаются ключевые вопросы, закладывающие фундамент всей дисциплины: рассматриваются предпосылки возникновения стратегического прогнозирования, обусловленные усложнением рыночной среды, ростом неопределенности, недостаточностью реактивного управления и потребностью бизнеса в снижении рисков при принятии долгосрочных решений; формируется понятийный аппарат: даются строгие определения базовым категориям — прогнозу (вероятностное суждение о будущем), плану (директивное решение), программе (системе мероприятий), стратегии (долгосрочному вектору развития) и стратегическому прогнозированию как процессу разработки многовариантных моделей будущего рынка. Особое внимание уделяется разграничению этих понятий, чтобы студенты четко понимали разницу между вероятностным прогнозом и обязательным к исполнению планом.

Изучается классификация прогнозов и планов по нескольким основаниям: по горизонту упреждения (оперативные, кратко-, средне- и долгосрочные), по масштабу (макро-, мезо- и микроуровень), по функциональному признаку (прогнозы спроса, предложения, цен, емкости рынка, конкурентной среды), по характеру (поисковые — от настоящего к будущему, и нормативные — от желаемого будущего к настоящему), а также по степени формализации (интуитивные экспертные и формализованные фактографические).

#### **Тема 2. Методология, принципы и технологии стратегического прогнозирования. ПК-1.4, ПК-2.3**

В данной теме изучается понятие методологии как системы принципов, методов и технологий, организующих процесс разработки прогнозов. Рассматриваются фундаментальные принципы стратегического прогнозирования: системность (рынок как целостная совокупность взаимосвязанных элементов), непрерывность (постоянное уточнение прогнозов по мере поступления новых данных), вариантность (обязательная разработка множества альтернативных сценариев), адекватность (соответствие методов природе изучаемых рыночных процессов), верифицируемость (возможность проверки точности прогнозов на ретроспективных данных) и целенаправленность (прогноз всегда служит

конкретным управленческим задачам). Изучается классификация методов прогнозирования по степени формализации.

Отдельно рассматриваются современные технологии стратегического прогнозирования: сценарное планирование третьего поколения, включающее кросс-импакт анализ (оценку взаимного влияния событий друг на друга) и метод «десяти сил», форсайт (технологические дорожные карты, анализ слабых сигналов и диких карт), а также элементы машинного обучения для прогнозирования рыночных процессов (кластеризация, классификация, регрессионные модели на основе больших данных). Изучаются критерии выбора конкретного метода прогнозирования в зависимости от горизонта прогноза, наличия и качества ретроспективных данных, степени неопределенности рыночной среды, требуемой точности и доступных ресурсов. Анализируются типичные ошибки при выборе и применении методов: путаница между корреляцией и причинностью, игнорирование структурных сдвигов, ложная уверенность в экстраполяции и недооценка когнитивных искажений экспертов. В качестве практического кейса рассматривается ситуация, когда компания, слепо экстраполируя прошлые темпы роста рынка, полностью пропустила технологический разрыв и потеряла лидерство из-за применения неадекватного метода прогнозирования.

### **Тема 3. Информационное обеспечение прогнозирования рынка. ПК-1.1, ПК-1.4, ПК-2.1**

В данной теме изучается понятие информационного обеспечения как совокупности источников, методов сбора, обработки и хранения данных, необходимых для разработки обоснованных рыночных прогнозов. Рассматриваются основные требования к информации для целей стратегического прогнозирования: достоверность (отсутствие систематических ошибок и искажений), репрезентативность (отображение всех значимых характеристик рынка), своевременность (актуальность данных на момент прогнозирования), сопоставимость (возможность сравнения за разные периоды и по разным источникам), полнота (отсутствие критических пробелов) и регулярность поступления (возможность мониторинга динамики).

Изучается классификация информационных источников по различным основаниям. По происхождению выделяются первичные данные (собранные непосредственно исследователем) и вторичные данные (полученные из уже опубликованных источников). По характеру носителя информация делится на статистическую (официальные данные государственных органов,

центральных банков, международных организаций), аналитическую (обзоры, рейтинги, исследования консалтинговых компаний), нормативно-правовую (законы, постановления, отраслевые стандарты), корпоративную (финансовая и управленческая отчетность компаний, данные CRM-систем) и альтернативную (геолокационные данные, спутниковые снимки, big data, социальные медиа, отзывы потребителей, поисковые запросы). Отдельно рассматриваются специфические источники для прогнозирования рынка: данные розничного аудита, панельные исследования домохозяйств, таможенная статистика, данные банковских транзакций, трекинг цен конкурентов, патентная информация, базы данных деловой прессы и профессиональных ассоциаций.

Изучаются методы сбора и первичной обработки информации: анкетирование, интервью, наблюдение, контент-анализ, веб-скрейпинг, API-запросы к открытым данным. Рассматриваются проблемы качества информации, с которыми сталкивается прогнозист: наличие лагов (запаздывание публикации статистических данных), расхождения между разными источниками, неполнота официальной статистики для узких рыночных сегментов, искажения в корпоративной отчетности, шум и выбросы в больших данных, проблема конфиденциальности и ограниченного доступа к чувствительной рыночной информации. Изучаются методы верификации информации: перекрестная проверка по независимым источникам, логический контроль непротиворечивости, анализ аномалий и выбросов. Рассматриваются подходы к работе в условиях информационной недостаточности: использование прокси-переменных, даунсемплинг и апсемплинг данных, методы восполнения пропусков, применение экспертных оценок для восполнения пробелов. Изучаются технологии хранения и организации информации для целей прогнозирования: базы данных временных рядов, хранилища данных, дата-марты, системы бизнес-аналитики.

Особое внимание уделяется построению системы информационного мониторинга рынка как непрерывного процесса сбора и обновления данных с настройкой индикаторов раннего предупреждения. В качестве практического кейса анализируется ситуация, когда прогнозист, полагаясь исключительно на официальную статистику, не заметил реальной доли неформального сектора на рынке, что привело к фатальной ошибке в прогнозе емкости рынка, и демонстрируется, как использование альтернативных данных (спутниковые снимки парковок, данные мобильных операторов, соцмедиа) позволило скорректировать прогноз.

#### **Тема 4. Стратегическое прогнозирование социально-экономического развития региона как фактор рыночной конъюнктуры. ПК-1.4, ПК-2.6.**

В данной теме изучается взаимосвязь между прогнозами развития региона и конъюнктурой локальных рынков. Рассматривается понятие региона как сложной социально-экономической системы, включающей демографические, производственные, инфраструктурные, финансовые и институциональные подсистемы, каждая из которых формирует спрос и предложение на конкретных товарных рынках. Изучаются основные объекты регионального стратегического прогнозирования, значимые для рыночной конъюнктуры: валовой региональный продукт и его отраслевая структура, численность и половозрастной состав населения, миграционные потоки, доходы и расходы населения, уровень безработицы и занятость по отраслям, инвестиционная активность, ввод жилья и коммерческой недвижимости, развитие транспортной и энергетической инфраструктуры, бюджетная политика региона (налоговые льготы, субсидии, государственные закупки), институциональная среда (административные барьеры, качество регуляторики).

Рассматриваются методы регионального прогнозирования, имеющие прямое применение для рыночного анализа: балансовый метод (прогноз производства и потребления ресурсов), нормативный метод (расчет потребностей на основе социальных нормативов), экономико-математическое моделирование (многоотраслевые межрегиональные модели, эконометрические модели региональной динамики), метод экономической базы (экспортная база региона как драйвер роста локального рынка), сценарный подход (инерционный, инвестиционный, инновационный сценарии развития региона). Изучаются механизмы трансляции региональных прогнозов в рыночную конъюнктуру. Демографические прогнозы определяют потенциальную емкость потребительских рынков (продукты питания, одежда, образование, здравоохранение, жилье). Прогнозы доходов населения формируют структуру потребительского спроса по ценовым сегментам и категориям товаров (нормальные товары, товары первой необходимости, товары роскоши).

Изучаются риски, возникающие при игнорировании регионального контекста: усреднение разнородных региональных рынков (ошибка «средней температуры по больнице»), недоучет региональной специфики потребительского поведения, запаздывание реакции на региональные кризисы, ошибочное масштабирование успешной стратегии с одного региона на все остальные. Отдельно рассматривается практика использования

региональных стратегий социально-экономического развития (официальных документов, принимаемых на уровне субъектов федерации) как источника прогнозной информации: целевые ориентиры региона, заявленные инвестиционные проекты, планы развития инфраструктуры, демографические и миграционные программы, меры поддержки отдельных отраслей. Анализируются расхождения между официальными региональными прогнозами и реальной динамикой, а также методы их выявления и корректировки.

### **Тема 5. Цели, задачи и функции стратегического прогнозирования в управлении рыночными рисками. ПК-1.1, ПК-1.4.**

В данной теме изучается роль прогнозирования как инструмента снижения неопределенности и управления рисками на рынке. Рассматривается понятие рыночного риска как вероятности отклонения фактических рыночных параметров (спроса, цены, предложения, доли рынка) от прогнозируемых значений, что влечет за собой экономические потери. Изучается классификация рыночных рисков, управление которыми требует прогнозирования: риск изменения потребительского спроса (колебания объемов и структуры), ценовой риск (волатильность рыночных цен), конкурентный риск (появление новых игроков, изменение стратегий действующих), технологический риск (появление товаров-субститутов, смена технологических укладов), регуляторный риск (изменение законодательства, налоговой политики, торговых ограничений), репутационный риск (изменение общественных настроений и доверия к бренду), риск каналов сбыта (банкротство дистрибьюторов, изменение условий работы торговых сетей).

Формулируются цели стратегического прогнозирования в контексте управления рыночными рисками: идентификация потенциальных угроз и возможностей на ранних стадиях, количественная оценка вероятности и масштаба неблагоприятных отклонений, обоснование выбора стратегических альтернатив с учетом риск-профиля, разработка упреждающих мер по снижению уязвимости, создание системы раннего предупреждения о наступлении рискованных событий. Определяются задачи стратегического прогнозирования в данной области: сбор и анализ информации о факторах рыночной нестабильности, построение многовариантных сценариев развития рынка с оценкой вероятности каждого, выявление критических точек принятия решений (моментов, когда необходимо реагировать на отклонения), расчет коридоров допустимых отклонений (границ, за пределами которых требуется корректировка стратегии), разработка системы индикаторов раннего предупреждения

(опережающих показателей, сигнализирующих о приближении рисковогó события), оценка чувствительности стратегических результатов к изменениям рыночных параметров.

Изучаются функции стратегического прогнозирования в управлении рыночными рисками. Аналитическая функция заключается в выявлении причинно-следственных связей между факторами нестабильности и рыночными показателями. Предупредительная функция реализуется через заблаговременное обнаружение зон потенциальной уязвимости и формирование сигналов о приближении критических изменений. Целеполагающая функция обеспечивает согласование желаемых рыночных результатов с реалистичной оценкой возможных отклонений. Альтернативная функция создает веер возможных стратегических реакций на различные сценарии развития событий. Оценочная функция позволяет ранжировать риски по степени критичности и определять приоритетность мер реагирования. Контрольная функция заключается в сопоставлении фактической рыночной динамики с прогнозными границами и инициировании корректирующих действий при выходе за допустимые пределы.

Рассматриваются методы прогнозирования, специально ориентированные на управление рисками: стресс-тестирование (оценка устойчивости стратегии при экстремальных значениях рыночных параметров), анализ чувствительности (изменение выходных показателей в ответ на изменение входных факторов), имитационное моделирование (метод Монте-Карло для построения распределения вероятностей рыночных результатов), анализ сценариев «что, если», построение карт рисков на основе прогнозных данных. Изучается процедура интеграции прогнозирования в процесс управления рыночными рисками: идентификация рисков на основе прогнозных моделей, оценка вероятности и потенциального ущерба с использованием прогнозных распределений, ранжирование рисков по степени критичности, разработка мер реагирования (избежание, снижение, передача, принятие) с опорой на прогнозные сценарии, мониторинг индикаторов раннего предупреждения и пересмотр прогнозов. Особое внимание уделяется когнитивным ловушкам при прогнозировании рисков: ошибка самоуверенности (недооценка вероятности редких событий), ошибка подтверждения (игнорирование сигналов, противоречащих желаемому прогнозу), ошибка доступности (переоценка рисков недавних событий и недооценка давних), ошибка планирования (систематический оптимизм при оценке сроков и затрат). Рассматриваются способы калибровки прогнозов для коррекции этих искажений.

## **Тема 6. Прогнозирование рыночной динамики: спрос, предложение, цены и поведение конкурентов. ПК-1.4, ПК-2.3.**

В данной теме изучаются методы и модели прогнозирования ключевых рыночных параметров, определяющих конъюнктуру и стратегические возможности компании. Рассматривается понятие рыночной динамики как совокупности изменений во времени объемов спроса, предложения, ценового уровня и конкурентных позиций участников рынка. Изучается прогнозирование спроса как центрального элемента рыночного анализа. Рассматриваются основные подходы к прогнозу спроса: прогноз на основе временных рядов (анализ трендов, сезонности, циклических колебаний и случайной компоненты), прогноз на основе эконометрических моделей (выявление зависимости спроса от цены, доходов потребителей, цен на товары-заменители и дополняющие товары, рекламных расходов, сезонных факторов), прогноз на основе потребительских интенций (опросы о планируемых покупках, тестирование концепций продуктов), прогноз на основе аналогий (сравнение с жизненными циклами аналогичных товаров на других рынках).

Изучаются специфические методы прогнозирования спроса для новых рынков и инновационных продуктов: метод диффузии инноваций (модели Басса, логистическая кривая, описывающая распространение нового продукта через новаторов и последователей), метод аналогий (перенос закономерностей с рынков-аналогов по уровню развития, культуре, технологии), метод экспертных панелей с построением пессимистического, базового и оптимистического сценариев. Рассматривается прогнозирование предложения как оценки объема и структуры товаров и услуг, которые производители готовы вывести на рынок.

Изучаются факторы, определяющие динамику предложения: производственные мощности и уровень их загрузки, технологические ограничения и инновации, цены на сырье и комплектующие, логистические условия, барьеры входа и выхода с рынка, ожидания производителей относительно будущей конъюнктуры. Рассматриваются методы прогноза предложения: экстраполяция динамики ввода и вывода мощностей, анализ инвестиционных планов основных игроков, моделирование ценовой эластичности предложения, анализ технологических дорожных карт отраслей-поставщиков. Изучается прогнозирование цен как результат взаимодействия прогнозов спроса и предложения, а также самостоятельный объект прогнозирования. Рассматриваются основные подходы к ценовому прогнозированию: прогноз на основе динамики издержек (ценообразование по принципу «издержки плюс» с прогнозом затрат на сырье, энергию, труд),

прогноз на основе баланса спроса и предложения (равновесная цена в зависимости от прогнозных объемов спроса и предложения), прогноз на основе цен конкурентов (гипотетическое ценообразование с учетом реакции игроков), прогноз на основе биржевых и сырьевых индикаторов (для товаров, цены которых привязаны к биржевым котировкам), прогноз с учетом инфляционных ожиданий и валютных курсов (для импортозависимых и экспортных рынков). Изучаются модели формирования цен в разных рыночных структурах: для рынка совершенной конкуренции (цены как внешний фактор, прогноз через баланс отраслевого спроса и предложения), для олигополии (модели ценового лидерства, сговора, ценовых войн с элементами теории игр), для монополистической конкуренции (прогноз ценовой премии за дифференциацию), для монополии (прогноз через оценку ценовой эластичности спроса и максимизацию прибыли).

Рассматриваются типовые конкурентные стратегии и способы их прогнозирования: стратегия ценовой войны (условия возникновения, вероятная длительность, точка выхода), стратегия дифференциации (прогноз направлений инноваций конкурентов), стратегия следования за лидером (идентификация лидера и прогноз реакции последователей), стратегия нишевания (прогноз, какие сегменты атакует конкурент). Изучаются методы интеграции прогнозов спроса, предложения, цен и конкурентного поведения в единую прогнозную модель рынка. Рассматриваются итерационные процедуры согласования прогнозов: балансировка спроса и предложения с корректировкой цен до достижения равновесия, прогнозирование конкурентных реакций с пересчетом долей рынка и объемов продаж, построение имитационных моделей рынка, учитывающих одновременное изменение всех параметров. Изучается оценка точности прогнозов рыночной динамики: расчет средней абсолютной процентной ошибки, анализ систематических и случайных ошибок, ретроспективное тестирование прогнозных моделей, построение доверительных интервалов и коридоров прогноза. Анализируются типичные ошибки при прогнозировании рыночной динамики: игнорирование асимметрии реакции конкурентов (недооценка агрессивности ответа), недоучет запаздываний (лаг между изменением цены и реакцией спроса), усреднение разнородных сегментов рынка, экстраполяция конкурентного равновесия на периоды структурных сдвигов, проекция собственных стратегических намерений на конкурентов. В качестве практического кейса рассматривается ситуация выхода компании на олигопольный рынок с прогнозом реакции действующих игроков. Демонстрируется, как первоначальный прогноз, предполагавший пассивное принятие нового игрока, оказался ошибочным, когда конкуренты развязали

ценовую войну и инвестировали в агрессивный маркетинг.

На основе анализа ошибок строится скорректированная прогнозная модель, учитывающая три типа возможных реакций конкурентов (агрессивная ценовая, дифференциация, кооперация) с оценкой вероятности каждого сценария.

### **Тема 7. Трансформация прогнозных сценариев в стратегические управленческие решения: механизмы, фильтры и процедуры имплементации. ПК-1.4, ПК-2.3, ПК-2.6.**

В данной теме изучается завершающий этап стратегического прогнозирования – переход от множества вероятностных описаний будущего к конкретным действиям компании на рынке. Рассматривается фундаментальная проблема разрыва между прогнозом и решением: прогноз дает знание о том, что может произойти, но не предписывает, что делать, тогда как решение требует выбора единственного курса действий в условиях многовариантного прогноза. Изучаются механизмы трансформации прогнозных сценариев в стратегические решения. Механизм редукции неопределенности заключается в последовательном сужении веера возможных будущих состояний рынка до множества, которое компания способна охватить своей стратегией. Механизм приоритизации сценариев предполагает ранжирование прогнозных альтернатив по вероятности, потенциальному влиянию на бизнес и степени управляемости. Механизм стратификации решений разделяет стратегические решения на три категории в зависимости от горизонта прогноза: решения, принимаемые уже сегодня на основе существующей прогнозной информации, решения, которые могут быть отложены до получения дополнительных данных, и решения, требующие создания опционов (заранее подготовленных альтернатив). Рассматриваются фильтры, через которые проходит прогнозная информация перед превращением в решение. Фильтр достоверности отсеивает прогнозные сценарии с низкой степенью обоснованности (противоречащие фундаментальным ограничениям, основанные на ненадежных данных, полученные из непроверенных источников). Фильтр реализуемости оценивает, какие сценарии компания в принципе способна обслужить своими ресурсами и компетенциями. Фильтр стратегической совместимости проверяет соответствие прогнозных сценариев миссии, ценностям и долгосрочным целям компании. Фильтр экономической эффективности сравнивает ожидаемую ценность каждого варианта действий (с учетом вероятностей сценариев) с затратами на его реализацию. Фильтр приемлемости риска отсеивает стратегии, которые при неблагоприятном

развитии событий могут привести к недопустимым потерям, даже если их ожидаемая ценность высока.

Изучаются процедуры имплементации прогнозных сценариев в стратегическое управление. Процедура построения стратегических опционов заключается в разработке заранее подготовленных альтернативных планов действий для ключевых прогнозных сценариев (например, план агрессивного расширения при оптимистическом сценарии, план удержания при базовом, план сокращения и ухода с сегментов при пессимистическом). Процедура создания системы индикаторов раннего предупреждения включает выбор опережающих показателей, изменение которых сигнализирует о движении рынка в сторону того или иного прогнозного сценария, установление пороговых значений (триггеров), при достижении которых активируется соответствующий опцион, и назначение ответственных за мониторинг и принятие решения об активации. Процедура регулярного пересмотра прогнозов и решений предполагает периодическую сверку фактической рыночной динамики с прогнозными сценариями, обновление вероятностей сценариев на основе новой информации, корректировку активных стратегий и пересмотр неактивированных опционов. Процедура стресс-тестирования стратегии заключается в проверке устойчивости выбранного курса действий при реализации различных прогнозных сценариев, включая экстремальные и маловероятные. Изучаются методы формализации процесса трансформации прогнозов в решения.

Рассматриваются когнитивные и организационные барьеры эффективной трансформации прогнозов в решения: стратегическая слепота (неспособность руководства воспринять прогнозы, противоречащие их ментальной модели рынка), инерция принятых решений (продолжение следования ранее выбранному курсу даже при изменении прогноза), конфликт интересов (подразделения могут лоббировать сценарии, выгодные им, а не компании в целом), дефицит внимания к долгосрочным прогнозам (приоритизация текущих операционных проблем), ложное чувство контроля (уверенность в способности повлиять на рыночную динамику в обход прогнозов). Изучаются методы преодоления этих барьеров: введение процедуры «предсмертного анализа» (pre-mortem), когда команда еще до принятия решения письменно фиксирует, почему эта стратегия могла бы провалиться, использование независимого рецензента прогнозов (адвоката дьявола), ротация членов прогнозных групп для снижения группового мышления, привязка системы мотивации к точности прогнозов и качеству использования прогнозной информации. В качестве практического кейса рассматривается ситуация крупной розничной сети, которая разработала три

прогнозных сценария развития рынка (энергичный рост, стагнация, рецессия) и подготовленные для каждого сценария стратегические опционы (открытие новых магазинов, оптимизация ассортимента, сокращение издержек). Демонстрируется, как система индикаторов раннего предупреждения (динамика потребительских расходов, уровень безработицы в регионах присутствия, индекс потребительского доверия) сработала при достижении пороговых значений, запустив процедуру переключения с базового на антикризисный сценарий. Анализируются факторы успешной трансформации: регулярность пересмотра вероятностей сценариев, четкое распределение ответственности за мониторинг триггеров, готовность руководства действовать в соответствии с прогнозом вопреки инерции.

#### 4. Типы оценочных материалов, показатели и критерии оценивания

4.1. Оценочные материалы по дисциплине Б1.В.07 Стратегическое прогнозирование рынка входят в состав оценочных материалов по образовательной программе. Совокупность оценочных материалов по всем дисциплинам (модулям) образовательной программы составляют фонд оценочных средств (далее – ФОС). ФОС используется при проведении текущего контроля успеваемости и промежуточной аттестации обучающихся с целью оценивания достижения обучающимися планируемых результатов обучения.

4.2. ФОС разработан как комплекс проверочных заданий различного типа и уровня сложности, включает критерии и шкалы оценивания, а также «ключи» правильных ответов. ФОС формируется как отдельный документ и хранится в электронном виде, доступ к ФОС предоставлен ограниченному кругу лиц.

4.3. Для самостоятельной работы обучающихся при подготовке к текущему контролю успеваемости и промежуточной аттестации в рабочих программах дисциплин размещены типовые проверочные задания, которые можно условно разделить на задания закрытого, комбинированного и открытого типов.

Задания закрытого типа – это тестовые задания, в которых каждый вопрос сопровождается готовыми вариантами ответов, из которых необходимо выбрать один или несколько правильных.

Задания комбинированного типа – это тестовые задания, в которых каждый вопрос сопровождается готовыми вариантами ответов, из которых необходимо выбрать один или несколько правильных и обосновать свой выбор.

Задания открытого типа – это задания, в которых на каждый вопрос

должен быть предложен развернутый обоснованный ответ.

В зависимости от типа задания рекомендованы определенная последовательность выполнения и система оценивания выполнения заданий.

#### 4.4. Типы заданий, сценарии выполнения, критерии оценивания

ТИП ЗАДАНИЯ	ИНСТРУКЦИЯ	СЦЕНАРИИ ВЫПОЛНЕНИЯ	КРИТЕРИИ ОЦЕНИВАНИЯ
Задание закрытого типа с выбором одного правильного ответа из нескольких предложенных	Прочитайте текст, выберите правильный ответ	<ol style="list-style-type: none"> <li>1. Внимательно прочитать текст задания и понять, что в качестве ответа ожидается только один из предложенных вариантов.</li> <li>2. Внимательно прочитать предложенные варианты ответа.</li> <li>3. Выбрать один верный ответ.</li> <li>4. Записать только номер (или букву) выбранного варианта ответа (например, 3 или В).</li> </ol>	Ответ считается верным, если правильно указана цифра или буква
Задание закрытого типа на установление соответствия	Прочитайте текст и установите соответствие	<ol style="list-style-type: none"> <li>1. Внимательно прочитать текст задания и понять, что в качестве ответа ожидаются пары элементов.</li> <li>2. Внимательно прочитать оба списка: список 1 – вопросы, утверждения, факты, понятия и т.д.; список 2 – утверждения, свойства объектов и т.д.</li> <li>3. Сопоставить элементы списка 1 с элементами списка 2, сформировать пары элементов.</li> <li>4. Записать попарно буквы и цифры (в зависимости от задания) вариантов ответа (например, А1 или Б4).</li> </ol>	Ответ считается верным, если правильно указаны цифры или буквы
Задание закрытого типа с выбором нескольких правильных ответов из нескольких предложенных	Прочитайте текст, выберите правильные ответы	<ol style="list-style-type: none"> <li>1. Внимательно прочитать текст задания и понять, что в качестве ответа ожидается несколько правильных ответов из предложенных вариантов.</li> <li>2. Внимательно прочитать предложенные вариант-ты ответа.</li> <li>3. Выбрать несколько правильных ответов.</li> <li>4. Записать только номера (или буквы) выбранного варианта ответа (например, 1 4 или А Г).</li> </ol>	Ответ считается верным, если правильно установлены все соответствия (позиции из одного столбца верно сопоставлены с позициями другого)
Задание закрытого типа на установление	Прочитайте текст и установите	<ol style="list-style-type: none"> <li>1. Внимательно прочитать текст задания и понять, что в качестве ответа ожидается</li> </ol>	Ответ считается верным, если правильно указана вся

последовательности	последовательность	<p>последовательность элементов.</p> <p>2. Внимательно прочитать предложенные варианты ответа.</p> <p>3. Построить верную последовательность из предложенных элементов.</p> <p>4. Записать буквы/цифры (в зависимости от задания) вариантов ответа в нужной последовательности (например, БВА или 135).</p>	последовательность цифр
Задание комбинированного типа с выбором одного правильного ответа из предложенных и обоснованием выбора	Прочитайте текст, выберите правильный ответ и запишите аргументы, обосновывающие выбор ответа	<p>1. Внимательно прочитать текст задания и понять, что в качестве ответа ожидается только один из предложенных вариантов.</p> <p>2. Внимательно прочитать предложенные варианты ответа.</p> <p>3. Выбрать один верный ответ.</p> <p>4. Записать только номер (или букву) выбранного варианта ответа.</p> <p>5. Записать аргументы, обосновывающие выбор ответа (например, 4 текст обоснования).</p>	<p>Ответ считается верным, если правильно указана цифра или буква и приведены корректные аргументы, используемые при выборе ответа</p>
Задание открытого типа с развернутым ответом	Прочитайте текст и запишите развернутый обоснованный ответ	<p>1. Внимательно прочитать текст задания и понять суть вопроса.</p> <p>2. Продумать логику и полноту ответа.</p> <p>3. Записать ответ, используя четкие компактные формулировки.</p> <p>4. В случае расчетной задачи, записать решение и ответ</p>	<p>Ответ считается верным:</p> <p>1. Отсутствие фактических ошибок.</p> <p>2. Раскрытие объема используемых понятий (полнота ответа).</p> <p>3. Обоснованность ответа (наличие аргументов).</p> <p>4. Логическая последовательность излагаемого материала.</p>

4.5. Общая шкала оценивания результатов текущего контроля успеваемости и промежуточной аттестации обучающихся с применением БРС Донецкого филиала РАНХиГС.

Итоговая балльная оценка	Традиционная система	Бинарная система	ECTS	
			Для традиционной системы	Для бинарной системы
90-100	Отлично	Зачтено	A	P/ Passed
80-89	Хорошо		B	P/ Passed
75-79			C	P/ Passed
70-74	Удовлетворительно		B	P/ Passed
60-69			E	P/ Passed
0-59	Неудовлетворительно	Не зачтено	F	F/Failed

Соотношение баллов за текущий контроль успеваемости и промежуточную аттестацию, а также повторную промежуточную аттестацию:

Максимальная сумма баллов за текущий контроль успеваемости	Максимальная сумма баллов за промежуточную аттестацию	Максимальная итоговая балльная оценка	Максимальная сумма баллов за повторную промежуточную аттестацию
100 баллов	100 баллов	100 баллов	100 баллов

## **5. Формы аттестации, типовые оценочные материалы для текущего контроля успеваемости обучающихся, критерии и шкалы оценивания по контрольным точкам**

5.1. В ходе реализации дисциплины Б1.В.07 Стратегическое прогнозирование рынка используются следующие формы текущего контроля успеваемости обучающихся (в том числе, задания к контрольным задания по разделам):

доклад, опрос, тестирование, контрольное задание.

### **Критерии оценивания по видам задания**

Критерии оценивания опроса:

Баллы	Описание критерия
3	Обучающийся полно излагает материал (отвечает на вопрос), дает правильное определение основных понятий; обнаруживает

	понимание материала, может обосновать свои суждения, применить знания на практике, привести необходимые примеры не только из учебника, но и самостоятельно составленные; излагает материал последовательно и правильно с точки зрения норм литературного языка.
2	Обучающийся дает ответ, удовлетворяющий тем же требованиям, что и для оценки «отлично», но допускает 1–2 ошибки, которые сам же исправляет, и 1–2 недочета в последовательности и языковом оформлении излагаемого.
1	Обучающийся обнаруживает знание и понимание основных положений данной темы, но излагает материал неполно и допускает неточности в определении понятий или формулировке правил; не умеет достаточно глубоко и доказательно обосновать свои суждения и привести свои примеры; излагает материал непоследовательно и допускает ошибки в языковом оформлении излагаемого.
0	Обучающийся обнаруживает незнание вопроса, допускает ошибки в формулировке определений и правил, искажающие их смысл, беспорядочно и неуверенно излагает материал.

Критерии оценивания доклада:

Критерии оценки	Диапазон баллов	Описание критерия
Содержание и раскрытие темы	1	Детальное, последовательное описание всех этапов с конкретными примерами
Грамотность изложения	0,5	Соблюдены все правила грамматики, орфографии и пунктуации
Стилистика	0,5	Единый стиль изложения, точные формулировки, уместное использование терминов, лаконичность
Логика изложения	0,5	Чёткая последовательность изложения, логические связи между частями текста, аргументы подтверждают выводы
Оригинальность	0,5	Уникальный подход к теме, нестандартные решения, инновационные идеи, собственная позиция автора
Итого максимально:	3	

Критерии оценивания тестовых заданий:

Балы	Описание критерия	
3	Свыше 80% правильных ответов.	Обучающийся демонстрирует глубокое познание в освоенном материале.

2	Свыше 70% правильных ответов.	Обучающимся материал освоен полностью, без существенных ошибок.
1	Свыше 50% правильных ответов.	Обучающимся материал освоен, знания обучающегося не ниже базового уровня.
0	Менее 50% правильных ответов.	Обучающимся материал не освоен, знания обучающегося ниже базового уровня.

Критерии оценивания контрольных заданий:

Балы	Описание критерия
3	Обучающимся задание выполнено без ошибок и в полном объеме.
2	Обучающимся в целом задание выполнено, имеются отдельные неточности или недостаточно полные ответы, не содержащие ошибок.
1	Обучающимся допущены отдельные ошибки при выполнении задания
0	У обучающегося отсутствуют ответы на большинство вопросов задачи, задание не выполнено или выполнено не верно.

5.2. Типовые оценочные материалы для текущего контроля успеваемости обучающихся (вне контрольных точек):

## **РАЗДЕЛ 1. ТЕОРЕТИКО-МЕТОДОЛОГИЧЕСКИЕ ОСНОВЫ СТРАТЕГИЧЕСКОГО ПРОГНОЗИРОВАНИЯ РЫНКА**

### **Тема 1. Предпосылки, понятийный аппарат и классификация прогнозов и планов в системе стратегического прогнозирования рынка**

#### **Вопросы для опроса:**

Какие макроэкономические и технологические предпосылки XX–XXI веков сделали необходимым выделение стратегического прогнозирования рынка в отдельную дисциплину?

Чем принципиально отличается прогноз от плана в контексте рыночной неопределенности?

Назовите основные критерии классификации прогнозов (по горизонту, по масштабу, по функциям). Какой горизонт считается стратегическим?

В чем разница между поисковым (исследовательским) и нормативным (целевым) прогнозированием рынка?

Как соотносятся понятия «рыночная конъюнктура», «тренд», «цикл» и «шок» в системе стратегического прогноза?

Какие виды планов (корпоративные, отраслевые, региональные) наиболее тесно связаны с долгосрочными рыночными прогнозами?

Почему классификация прогнозов по степени формализации (интуитивные и формализованные) критически важна для рынков с высокой волатильностью?

Какие исторические примеры недооценки стратегических рыночных прогнозов привели к серьезным экономическим кризисам?

Как понятие «зоны неопределенности» влияет на выбор типа прогноза (точечный, интервальный, сценарный)?

Что такое иерархия прогнозов (глобальный → национальный → отраслевой → рыночный) и зачем она нужна?

Тестовые задания:

Тест 1.

Внимательно прочитать текст задания и понять, что в качестве ответа ожидается только один из предложенных вариантов.

Внимательно прочитать предложенные варианты ответа.

Выбрать один верный ответ.

Записать только букву выбранного варианта ответа.

Что из перечисленного наиболее полно характеризует прогноз как категорию стратегического прогнозирования рынка?

- а) директивный план действий, обязательный для исполнения;
- б) вероятностное научно обоснованное суждение о будущем состоянии рынка;
- в) система взаимоувязанных мероприятий для достижения целей;
- г) долгосрочный вектор развития, определяющий позиционирование компании.

Какой из перечисленных признаков относится к классификации прогнозов по горизонту упреждения?

- а) прогноз спроса;
- б) микроэкономический прогноз;
- в) среднесрочный прогноз;
- г) нормативный прогноз.

Какая функция прогноза по отношению к плану заключается в заблаговременном обнаружении зон потенциальной уязвимости и рыночных угроз?

- а) аналитическая;
- б) предупредительная;
- в) альтернативная;
- г) целеполагающая.

## Тест 2.

Внимательно прочитать текст задания и понять, что в качестве ответа ожидается несколько правильных ответов из предложенных вариантов.

Внимательно прочитать предложенные варианты ответа.

Выбрать несколько правильных ответов.

Записать только буквы выбранных вариантов ответа.

Какие из перечисленных положений характеризуют предпосылки возникновения стратегического прогнозирования рынка?

- а) усложнение рыночной среды и рост неопределенности (VUCA-факторы);
- б) полная предсказуемость потребительского поведения;
- в) недостаточность реактивного управления (реагирования на свершившиеся события);
- г) отсутствие потребности бизнеса в снижении долгосрочных рисков;
- д) необходимость научного обоснования стратегических решений.

Какие понятия относятся к базовым категориям системы «стратегическое прогнозирование – планирование – программирование»?

- а) прогноз;
- б) бенчмаркинг;
- в) план;
- г) программа;
- д) стратегия.

Какие из перечисленных оснований используются для классификации прогнозов?

- а) по горизонту упреждения;
- б) по цвету маркетинговых материалов;
- в) по масштабу (макро-, мезо-, микроуровень);
- г) по характеру (поисковые и нормативные);
- д) по степени формализации (интуитивные и формализованные).

## Тест 3.

Внимательно прочитать текст задания и понять, что в качестве ответа ожидается последовательность элементов.

Установите последовательность этапов разработки прогноза в системе

стратегического планирования рынка (от исходного этапа к завершающему):

- а) разработка плана действий на основе выбранного прогнозного сценария;
- б) анализ ретроспективных данных о состоянии рынка;
- в) контроль фактических результатов и их сопоставление с прогнозными показателями;
- г) построение многовариантных прогнозных моделей (поисковых и нормативных);
- д) выбор прогнозного сценария для дальнейшего планирования.

Установите последовательность этапов разграничения понятий «прогноз – план – программа – стратегия» (от наименее определенного к наиболее формализованному):

- а) программа (система взаимосвязанных мероприятий);
- б) прогноз (вероятностное суждение о будущем);
- в) стратегия (долгосрочный вектор развития);
- г) план (директивное решение с целевыми ориентирами).

### **Контрольное задание**

Компания, работающая на рынке бытовой электроники, разрабатывает долгосрочную стратегию на 5 лет. В ходе стратегической сессии возник спор между двумя отделами. Отдел маркетинга настаивает на том, что необходимо принять за основу оптимистичный прогноз роста рынка на 15% ежегодно и сразу планировать расширение сети магазинов. Отдел стратегического развития утверждает, что сначала нужно построить три сценария (оптимистичный, базовый, пессимистичный), оценить их вероятности, а только потом переходить к планированию.

Вопросы к заданию:

1. Дайте определение понятиям «прогноз» и «план» применительно к описанной ситуации. В чем принципиальное различие между этими категориями?
2. К какому типу прогнозов (по характеру) относится оптимистичный прогноз отдела маркетинга – поисковому или нормативному? Аргументируйте ответ.
3. Какую функцию прогнозирования по отношению к планированию демонстрирует позиция отдела стратегического развития, настаивая на многовариантности?

## **Тема 2. Методология, принципы и технологии стратегического прогнозирования**

## Вопросы для опроса

Перечислите основные принципы стратегического прогнозирования (системность, альтернативность, верифицируемость и др.) и раскройте один из них.

Чем методология прогнозирования рынка отличается от методологии прогнозирования природных процессов?

Какие технологии (методы) относятся к группе экспертных и в каких рыночных ситуациях они предпочтительнее формальных моделей?

Опишите суть метода «Дельфи» применительно к долгосрочному прогнозу спроса.

В чем преимущества и ограничения экстраполяционных методов (трендовые модели) для стратегического рыночного прогнозирования?

Как метод «сценариев» позволяет преодолеть ограниченность одного детерминированного прогноза?

Что такое «кросс-импакт-анализ» и для прогнозирования каких рыночных факторов он используется?

Как современные технологии искусственного интеллекта (нейросети, машинное обучение) меняют методологию прогнозирования рыночной динамики?

Почему принцип обратной связи между прогнозом и управленческим решением является обязательным для методологии?

Какие критерии используются для верификации (оценки точности) стратегических рыночных прогнозов при отсутствии исторических аналогов?

### Тестовые задания:

Тест 1.

Внимательно прочитайте текст задания и понять, что в качестве ответа ожидается только один из предложенных вариантов.

Внимательно прочитайте предложенные варианты ответа.

Выбрать один верный ответ.

Записать только букву выбранного варианта ответа.

Какой принцип стратегического прогнозирования требует обязательной разработки множества альтернативных сценариев развития рынка, а не одного детерминированного прогноза?

- а) принцип системности;
- б) принцип непрерывности;
- в) принцип вариантности;
- г) принцип верифицируемости.

Какой метод прогнозирования относится к группе фактографических?

- а) метод Дельфи;
- б) мозговой штурм;
- в) экстраполяция трендов;
- г) метод сценариев.

Какая технология прогнозирования предполагает оценку взаимного влияния событий друг на друга (например, как событие А меняет вероятность события Б)?

- а) кросс-импакт анализ;
- б) регрессионный анализ;
- в) метод «дерева целей»;
- г) анализ временных рядов.

Что из перечисленного является типичной ошибкой при применении методов прогнозирования?

- а) использование нескольких независимых источников данных;
- б) путаница между корреляцией и причинностью;
- в) регулярное уточнение прогнозов по мере поступления новых данных;
- г) сопоставление прогноза с фактическими значениями.

Тест 2.

Внимательно прочитать текст задания и понять, что в качестве ответа ожидается несколько правильных ответов из предложенных вариантов.

Внимательно прочитать предложенные варианты ответа.

Выбрать несколько правильных ответов.

Записать только буквы выбранных вариантов ответа.

Какие принципы относятся к фундаментальным принципам стратегического прогнозирования?

- а) системность;
- б) спорадичность;
- в) вариантность;
- г) верифицируемость;
- д) субъективность.

Какие методы входят в группу экспертных методов прогнозирования?

- а) метод Дельфи;
- б) корреляционно-регрессионный анализ;
- в) мозговой штурм;
- г) метод аналогий;
- д) метод комиссий.

Какие критерии используются при выборе конкретного метода

прогнозирования?

- а) горизонт прогноза (кратко-, средне-, долгосрочный);
- б) цвет логотипа компании;
- в) степень неопределенности рыночной среды;
- г) наличие и качество ретроспективных данных;
- д) предпочтения руководителя без учета специфики задачи.

Какие технологии относятся к современным технологиям стратегического прогнозирования?

- а) форсайт (технологические дорожные карты);
- б) анализ слабых сигналов и диких карт;
- в) метод бухгалтерского баланса;
- г) сценарное планирование с кросс-импакт анализом;
- д) расчет амортизационных отчислений.

Тест 3.

Внимательно прочитать текст задания и понять, что в качестве ответа ожидается последовательность элементов.

Внимательно прочитать предложенные варианты ответа.

Построить верную последовательность из предложенных элементов.

Записать буквы вариантов ответов в нужной последовательности.

Установите последовательность этапов проведения метода Дельфи (от начала к завершению):

- а) обобщение полученных ответов и расчет медианных оценок;
- б) формирование экспертной группы и анонимная рассылка первого опросника;
- в) предоставление экспертам обратной связи (статистики ответов группы) и повторное анкетирование;
- г) формулировка проблемы и разработка вопросов для экспертов;
- д) достижение консенсуса или стабилизации оценок.

Установите последовательность применения методов прогнозирования в зависимости от степени неопределенности рыночной среды (от низкой неопределенности к высокой):

- а) экспертные методы (Дельфи, мозговой штурм);
- б) экстраполяция трендов;
- в) форсайт и анализ диких карт;
- г) корреляционно-регрессионные модели.

### **Контрольное задание**

Крупная розничная сеть планирует выход на новый региональный рынок. Руководство поручило аналитическому отделу разработать прогноз спроса на ближайшие три года. Аналитики имеют следующие исходные

данные: временные ряды продаж аналогичных товаров в других регионах за последние 5 лет, результаты опроса 50 экспертов (владельцев локальных торговых точек), а также информацию о планируемом строительстве жилого комплекса рядом с потенциальным местом размещения магазина. Горизонт прогноза – 3 года. Степень неопределенности оценивается как высокая из-за отсутствия опыта работы в данном регионе и нестабильной экономической ситуации.

Вопросы к заданию.

1. Какие принципы стратегического прогнозирования должны быть соблюдены аналитиками при разработке прогноза? Назовите не менее трех принципов и кратко поясните, как каждый из них применим к данной ситуации.

2. Какой метод прогнозирования (фактографический или экспертный) следует выбрать в качестве основного при высокой степени неопределенности? Аргументируйте ответ.

3. Предложите комбинированную технологию прогнозирования, которая объединяет использование имеющихся данных и экспертных оценок. Опишите последовательность действий аналитиков.

4. Какие типичные ошибки при выборе и применении методов прогнозирования могут допустить аналитики в данной ситуации? Назовите не менее двух ошибок и предложите способы их избежать.

## **РАЗДЕЛ 2. ИНФОРМАЦИОННО-АНАЛИТИЧЕСКОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ И РЕГИОНАЛЬНЫЙ КОНТЕКСТ ПРОГНОЗИРОВАНИЯ**

### **Тема 3. Информационное обеспечение прогнозирования рынка**

#### **Вопросы для опроса**

Назовите три основных источника вторичной информации для прогнозирования рынка и укажите их недостатки.

Какие требования предъявляются к качеству данных (репрезентативность, достоверность, актуальность) при построении стратегических прогнозов?

Чем отличаются оперативные индикаторы (краткосрочные) от опережающих индикаторов для долгосрочного прогнозирования?

Какие данные о поведении конкурентов являются наиболее ценными, но труднодоступными для прогнозных моделей?

Как проблемы пропущенных данных (missing data) и выбросов влияют на точность прогнозов спроса и предложения?

Что такое «информационный шум» и как методы фильтрации данных помогают выделить сигнал тренда?

Роль маркетинговых панелей (домашних, розничных) в информационном обеспечении прогнозирования рынка FMCG.

Какие специфические данные о ценах (биржевые котировки, индексы цен производителей, потребительские цены) необходимы для прогнозирования?

Как использовать Big Data (данные поисковых систем, соцсетей, GPS) для улучшения кратко- и среднесрочных рыночных прогнозов?

Назовите основные риски информационного обеспечения: асимметрия информации, инсайдерские данные, запаздывание официальной статистики.

### Тестовые задания

#### Тест 1.

Внимательно прочитать текст задания и понять, что в качестве ответа ожидается только один из предложенных вариантов.

Внимательно прочитать предложенные варианты ответа.

Выбрать один верный ответ.

Записать только букву выбранного варианта ответа.

Какое требование к информации означает, что данные должны отражать все значимые характеристики рынка без критических пробелов?

- а) достоверность;
- б) репрезентативность;
- в) своевременность;
- г) сопоставимость.

Какие данные относятся к первичным источникам информации для прогнозирования рынка?

- а) данные Росстата о розничном товарообороте;
- б) результаты собственного опроса потребителей;
- в) обзор рынка от консалтинговой компании;
- г) финансовая отчетность конкурента из открытых источников.

Что из перечисленного относится к альтернативным источникам данных для прогнозирования рынка?

- а) данные налоговой отчетности;
- б) геолокационные данные мобильных устройств;
- в) официальные данные центрального банка;
- г) отраслевые стандарты и нормативы.

Какая проблема информационного обеспечения возникает из-за того, что официальная статистика публикуется со значительной задержкой относительно отчетного периода?

- а) проблема шума;
- б) проблема конфиденциальности;
- в) проблема лагов;
- г) проблема неполноты.

#### Тест 2.

Внимательно прочитать текст задания и понять, что в качестве ответа

ождается несколько правильных ответов из предложенных вариантов.

Внимательно прочитать предложенные варианты ответа.

Выбрать несколько правильных ответов.

Записать только буквы выбранных вариантов ответа.

Какие требования предъявляются к информации для целей стратегического прогнозирования рынка?

- а) достоверность;
- б) репрезентативность;
- в) случайность;
- г) своевременность;
- д) сопоставимость.

Какие источники информации относятся к статистическим?

- а) данные государственных органов статистики;
- б) данные центральных банков;
- в) отзывы потребителей в социальных медиа;
- г) данные международных организаций (МВФ, Всемирный банк);
- д) посты в Telegram-каналах.

Какие методы сбора информации используются для первичной обработки данных при прогнозировании рынка?

- а) анкетирование;
- б) веб-скрейпинг;
- в) экстраполяция трендов;
- г) интервью;
- д) регрессионный анализ.

Какие способы верификации информации применяются для проверки достоверности данных?

- а) перекрестная проверка по независимым источникам;
- б) логический контроль непротиворечивости;
- в) принятие данных на веру без проверки;
- г) анализ аномалий и выбросов;
- д) использование только одного источника.

Какие подходы используются для работы в условиях информационной недостаточности?

- а) использование прокси-переменных;
- б) отказ от прогнозирования;
- в) методы восполнения пропусков (импутация);
- г) применение экспертных оценок для восполнения пробелов;
- д) игнорирование отсутствующих данных.

### Тест 3.

Внимательно прочитать текст задания и понять, что в качестве ответа ожидается последовательность элементов.

Внимательно прочитать предложенные варианты ответа.

Построить верную последовательность из предложенных элементов.

Записать буквы вариантов ответов в нужной последовательности.

Установите последовательность этапов построения системы информационного мониторинга рынка (от начала к завершению):

- а) настройка индикаторов раннего предупреждения;
- б) определение перечня критических переменных рынка;
- в) регулярный сбор и обновление данных;
- г) выбор источников информации для каждой переменной;
- д) анализ отклонений и формирование сигналов.

Установите последовательность действий при верификации информации из сомнительного источника:

- а) проведение логического контроля на внутреннюю непротиворечивость;
- б) поиск альтернативных независимых источников по тому же показателю;
- в) выявление аномалий и выбросов в данных;
- г) сравнение данных из разных источников;
- д) принятие решения о допустимости использования информации.

### Контрольные задания

#### **Задание 1.**

Компания, производящая детское питание, планирует выход на региональный рынок. Аналитическая группа должна собрать информацию для прогноза емкости рынка и динамики спроса. В распоряжении аналитиков имеются следующие потенциальные источники:

официальные данные Росстата о рождаемости и доходах населения в регионе – публикуются с лагом 6-9 месяцев, агрегированы по региону в целом;

данные панельного розничного аудита (Nielsen, GFK) – платные, детальные, но только по крупным торговым сетям;

открытые данные о продажах в маркетплейсах (Wildberries, Ozon) – реальные продажи, но с искажениями из-за акций и скидок;

опрос 500 матерей с детьми до 3 лет (собственное исследование) – требует времени и бюджета, возможна социально желаемая реакция;

геолокационные данные мобильных приложений (агрегированные) – показывают посещаемость детских клиник и магазинов, но требуют обработки.

Вопросы к заданию. Для каждого из пяти источников информации оцените его по трем критериям: достоверность, своевременность и

репрезентативность. Перечислите сильные стороны и ограничения каждого источника.

Какие три источника вы рекомендуете использовать в качестве основных для прогнозирования? Обоснуйте свой выбор.

Как вы будете проверять достоверность информации из выбранных источников? Опишите конкретные процедуры верификации.

Предположим, что данные Росстата о рождаемости (источник № 1) и данные розничного аудита о продажах детского питания (источник № 2) показывают разнонаправленную динамику: рождаемость падает, а продажи растут. Как вы объясните это расхождение и какому источнику вы доверитесь больше? Почему?

## **Задание 2.**

Сеть кофеен «UrbanCoffee» насчитывает 120 точек в 15 городах. Руководство приняло решение о внедрении системы информационного мониторинга рынка для оперативного прогнозирования спроса и раннего обнаружения изменений рыночной конъюнктуры. Вам поручено разработать концепцию информационного обеспечения.

Вопросы к заданию.

Определите пять ключевых показателей, которые необходимо отслеживать для прогнозирования спроса на кофе навынос в конкретном городе. Для каждого показателя поясните, почему он важен, укажите возможный источник данных и рекомендуемую периодичность обновления.

Выберите один из названных вами показателей и предложите для него два альтернативных источника информации на случай, если основной источник окажется недоступным или ненадежным.

Опишите процедуру перекрестной проверки достоверности данных о потребительском спросе, используя не менее трех различных типов источников.

Какие проблемы информационного обеспечения (лаги, неполнота, шум, конфиденциальность) являются наиболее критичными для вашей системы мониторинга? Для каждой названной проблемы предложите способ ее минимизации.

Разработайте пошаговый алгоритм действий аналитика при получении сигнала от системы мониторинга о резком (на 20% за неделю) падении трафика во всех кофейнях одного из городов. Что нужно проверить в первую очередь? Какие источники информации задействовать для выяснения причин?

## **Тема 4. Стратегическое прогнозирование социально-экономического развития региона как фактор рыночной конъюнктуры**

### **Вопросы для опроса**

Каким образом прогноз ВРП (валового регионального продукта) влияет на прогноз потребительского спроса на локальном рынке?

Назовите три ключевых региональных фактора (кроме дохода), которые должны учитываться при прогнозировании емкости рынка.

Как миграционные процессы, спрогнозированные на региональном уровне, трансформируют структуру спроса на жилье и услуги?

В чем проявляется противоречие между отраслевыми (национальными) прогнозами и региональными рыночными реалиями?

Какие методы используются для «дезагрегирования» общенационального прогноза спроса до уровня региона?

Как региональная инвестиционная политика (строительство инфраструктуры, особые экономические зоны) изменяет прогноз предложения на рынке B2B?

Прогноз занятости и безработицы в регионе: как он связан с прогнозом платежеспособного спроса?

Приведите пример, когда позитивный прогноз развития региона приводил к перегреву локального рынка (пузырю).

Как стратегические документы региона (стратегия социально-экономического развития) служат исходной точкой для рыночного прогноза?

Что такое «региональный мультипликатор спроса» и как он используется при прогнозировании вторичных рыночных эффектов?

Тестовое задание:

Тест 1.

Внимательно прочитать текст задания и понять, что в качестве ответа ожидается только один из предложенных вариантов.

Внимательно прочитать предложенные варианты ответа.

Выбрать один верный ответ.

Записать только букву выбранного варианта ответа.

Что из перечисленного относится к объектам регионального стратегического прогнозирования, непосредственно влияющим на рыночную конъюнктуру?

- а) курс акций компании;
- б) численность и половозрастной состав населения;
- в) дизайн упаковки товара;
- г) система мотивации персонала.

Какой метод регионального прогнозирования основан на том, что экспортная база региона является драйвером роста локального рынка?

- а) нормативный метод;
- б) метод экономической базы;
- в) балансовый метод;
- г) метод экстраполяции.

Прогноз какого показателя напрямую определяет потенциальную емкость потребительских рынков (продукты питания, одежда, жилье)?

- а) объема инвестиционной активности;

- б) уровня безработицы;
- в) численности и половозрастной структуры населения;
- г) налоговой ставки на прибыль.

Какая ошибка возникает при игнорировании региональной дифференциации и усреднении разнородных региональных рынков?

- а) ошибка выжившего;
- б) ошибка «средней температуры по больнице»;
- в) ошибка подтверждения;
- г) ошибка планирования.

## Тест 2.

Внимательно прочитать текст задания и понять, что в качестве ответа ожидается несколько правильных ответов из предложенных вариантов.

Внимательно прочитать предложенные варианты ответа.

Выбрать несколько правильных ответов.

Записать только буквы выбранных вариантов ответа.

Какие подсистемы региона, прогнозируемые в рамках социально-экономического развития, формируют спрос и предложение на локальных товарных рынках?

- а) демографическая;
- б) производственная;
- в) корпоративная культура;
- г) инфраструктурная;
- д) институциональная.

Какие методы относятся к методам регионального прогнозирования?

- а) балансовый метод;
- б) метод Дельфи;
- в) нормативный метод;
- г) метод экономической базы;
- д) метод «диких карт».

Какие механизмы трансляции региональных прогнозов в рыночную конъюнктуру являются прямыми?

- а) прогнозы доходов населения формируют структуру потребительского спроса;
- б) прогнозы инвестиционной активности влияют на рынок строительных материалов;
- в) прогнозы численности населения не влияют на рынок жилья;
- г) бюджетная политика региона влияет на конкурентоспособность локального бизнеса;
- д) прогнозы погоды определяют спрос на сезонные товары.

Какие риски возникают при игнорировании регионального контекста в рыночном прогнозировании?

- а) недоучет региональной специфики потребительского поведения;
- б) более точное прогнозирование общероссийских трендов;
- в) запаздывание реакции на региональные кризисы;
- г) ошибочное масштабирование успешной стратегии с одного региона на все остальные;
- д) полное отсутствие каких-либо рисков.

Какие источники прогнозной информации содержатся в официальных региональных стратегиях социально-экономического развития?

- а) целевые ориентиры региона;
- б) планы развития инфраструктуры;
- в) внутренние регламенты компании;
- г) демографические и миграционные программы;
- д) меры поддержки отдельных отраслей.

Тест 3.

Внимательно прочитать текст задания и понять, что в качестве ответа ожидается последовательность элементов.

Внимательно прочитать предложенные варианты ответа.

Построить верную последовательность из предложенных элементов.

Записать буквы вариантов ответов в нужной последовательности.

Установите последовательность этапов увязки региональных и рыночных прогнозов:

- а) построение интегральных индексов рыночной привлекательности регионов;
- б) определение перечня региональных факторов, влияющих на спрос;
- в) корреляционно-регрессионный анализ зависимости спроса от региональных факторов;
- г) сбор региональных статистических данных;
- д) кластерный анализ регионов по типу потребительского поведения.

Установите последовательность влияния региональных демографических изменений на рыночную конъюнктуру:

- а) изменение емкости потребительского рынка;
- б) прогноз изменения численности населения региона;
- в) корректировка стратегии компании (открытие/закрытие точек, изменение ассортимента);
- г) изменение объема спроса на конкретные товарные категории;
- д) сравнение прогнозной и фактической демографической динамики.

### **Контрольное задание**

Федеральная сеть дискаунтеров «Экономъ» планирует расширение в трех регионах: Краснодарский край, Мурманская область и Республика Дагестан. Стратегический отдел компании подготовил предварительный прогноз, основанный на среднероссийских показателях роста доходов населения (прогноз +3% ежегодно). Однако региональный директор обратил внимание, что игнорирование региональных различий может привести к серьезным ошибкам.

#### **Вопросы к заданию.**

Назовите не менее четырех региональных факторов (помимо доходов населения), которые существенно различаются в указанных трех регионах и влияют на спрос в дискаунтерах. Для каждого фактора кратко поясните, как именно он влияет на рыночную конъюнктуру.

Объясните, в чем заключается ошибка «средней температуры по больнице» применительно к данной ситуации. Почему использование среднероссийских показателей опасно для регионального прогноза?

Выберите два из трех регионов и предположите, как разница в демографической структуре (доля детей, доля пенсионеров, миграционная динамика) повлияет на ассортиментную матрицу дискаунтера. Приведите конкретные примеры товарных категорий, которые будут более или менее востребованы.

Какие официальные региональные документы (стратегии, программы) вы порекомендуете изучить аналитикам перед окончательным прогнозом? Какие конкретные разделы этих документов наиболее важны для прогнозирования спроса в дискаунтерах?

## **РАЗДЕЛ 3. ПРИКЛАДНОЕ ПРОГНОЗИРОВАНИЕ РЫНОЧНОЙ ДИНАМИКИ И ТРАНСФОРМАЦИЯ ПРОГНОЗОВ В УПРАВЛЕНЧЕСКИЕ РЕШЕНИЯ**

### **Тема 5. Цели, задачи и функции стратегического прогнозирования в управлении рыночными рисками**

#### **Вопросы для опроса**

Назовите три главные цели стратегического прогнозирования с точки зрения снижения рыночных рисков.

Чем отличается риск-менеджмент на основе прогноза от реактивного управления уже наступившим ущербом?

Какие виды рыночных рисков (ценовой, риск ликвидности, конкурентный, репутационный) поддаются прогнозированию лучше, а какие хуже?

Как функция «раннего предупреждения» (early warning) реализуется через систему прогнозных индикаторов?

Опишите процедуру построения риск-аппетита компании на основе вероятностных прогнозов рыночной динамики.

Каким образом прогнозирование поведения конкурентов помогает

снизить стратегический риск потери доли рынка?

Что такое «стресс-тестирование» рыночного прогноза и для каких целей оно применяется?

Как прогнозирование изменения покупательских предпочтений снижает риск устаревания продукта?

В чем заключается функция прогнозирования для формирования страховых резервов и хеджирования рыночных позиций?

Какие этические и регуляторные ограничения существуют при использовании прогноза для управления рисками на финансовых рынках (инсайд, манипулирование)?

Тестовые задания:

Тест 1.

Внимательно прочитать текст задания и понять, что в качестве ответа ожидается только один из предложенных вариантов.

Внимательно прочитать предложенные варианты ответа.

Выбрать один верный ответ.

Записать только букву выбранного варианта ответа.

Что из перечисленного наиболее полно характеризует рыночный риск как объект стратегического прогнозирования?

- а) вероятность отклонения фактических рыночных параметров от прогнозируемых значений, влекущая экономические потери;
- б) гарантированное наступление неблагоприятного события;
- в) возможность получения сверхприбыли без каких-либо угроз;
- г) фиксированный убыток, заложенный в бюджет компании.

Какая функция стратегического прогнозирования в управлении рыночными рисками заключается в заблаговременном обнаружении зон потенциальной уязвимости и формировании сигналов о приближении критических изменений?

- а) аналитическая;
- б) целеполагающая;
- в) предупредительная;
- г) оценочная.

Какой метод управления рисками предполагает оценку устойчивости стратегии при экстремальных значениях рыночных параметров?

- а) анализ чувствительности;
- б) стресс-тестирование;
- в) имитационное моделирование;
- г) сценарный анализ.

Какая когнитивная ошибка заключается в систематическом оптимизме

при оценке сроков и затрат, что искажает прогноз рисков?

- а) ошибка самоуверенности;
- б) ошибка подтверждения;
- в) ошибка доступности;
- г) ошибка планирования.

Тест 2.

Внимательно прочитать текст задания и понять, что в качестве ответа ожидается несколько правильных ответов из предложенных вариантов.

Внимательно прочитать предложенные варианты ответа.

Выбрать несколько правильных ответов.

Записать только буквы выбранных вариантов ответа.

Какие виды рисков относятся к рыночным рискам, управление которыми требует стратегического прогнозирования?

- а) риск изменения потребительского спроса;
- б) пожарный риск на складе;
- в) конкурентный риск (появление новых игроков);
- г) технологический риск (появление товаров-субститутов);
- д) регуляторный риск (изменение законодательства).

Какие функции выполняет стратегическое прогнозирование в управлении рыночными рисками?

- а) аналитическая (выявление причинно-следственных связей);
- б) декоративная (создание видимости научного подхода);
- в) предупредительная (раннее обнаружение угроз);
- г) альтернативная (создание веера стратегических реакций);
- д) оценочная (ранжирование рисков по степени критичности).

Какие методы прогнозирования специально ориентированы на управление рыночными рисками?

- а) стресс-тестирование;
- б) метод Дельфи;
- в) анализ чувствительности;
- г) имитационное моделирование (метод Монте-Карло);
- д) экстраполяция трендов.

Какие задачи решает стратегическое прогнозирование в области управления рыночными рисками?

- а) построение многовариантных сценариев с оценкой вероятности каждого;
- б) разработка системы индикаторов раннего предупреждения;
- в) гарантированное устранение всех рисков;
- г) оценка чувствительности стратегических результатов к изменениям

рыночных параметров;

д) игнорирование маловероятных событий как незначимых.

Какие когнитивные искажения наиболее опасны при прогнозировании рыночных рисков?

а) ошибка самоуверенности (недооценка вероятности редких событий);

б) ошибка подтверждения (игнорирование сигналов, противоречащих желаемому прогнозу);

в) эффект Даннинга-Крюгера;

г) ошибка доступности (переоценка рисков недавних событий);

д) эффект якоря.

Тест 3.

Внимательно прочитать текст задания и понять, что в качестве ответа ожидается последовательность элементов.

Внимательно прочитать предложенные варианты ответа.

Построить верную последовательность из предложенных элементов.

Записать буквы вариантов ответов в нужной последовательности.

Установите последовательность этапов интеграции прогнозирования в процесс управления рыночными рисками:

а) ранжирование рисков по степени критичности;

б) идентификация рисков на основе прогнозных моделей;

в) мониторинг индикаторов раннего предупреждения и пересмотр прогнозов;

г) разработка мер реагирования с опорой на прогнозные сценарии;

д) оценка вероятности и потенциального ущерба с использованием прогнозных распределений.

Установите последовательность применения методов анализа рисков от наиболее простого к наиболее сложному (вычислительно):

а) имитационное моделирование (метод Монте-Карло);

б) анализ чувствительности;

в) стресс-тестирование;

г) сценарный анализ (оптимистичный, базовый, пессимистичный).

### **Контрольное задание.**

Компания «ТехноИмпорт» занимается поставками электроники из Азии и реализует ее через маркетплейсы. Финансовый директор компании требует от аналитического отдела спрогнозировать рыночные риски на следующий год. Аналитики выделили следующие ключевые факторы неопределенности: колебания курса рубля (прогнозный диапазон  $\pm 15\%$  от текущего уровня), возможное введение дополнительных пошлин на импортную электронику (вероятность 30%), появление нового локального производителя с более

низкими ценами (вероятность 20%), сезонное снижение спроса в летние месяцы (ежегодно повторяющийся фактор).

Вопросы к заданию.

К какому типу рыночных рисков относится каждый из перечисленных факторов? (курсовой риск, регуляторный риск, конкурентный риск, риск изменения спроса). Ответ представьте в виде перечисления.

Какие три функции стратегического прогнозирования в управлении рисками наиболее важны для данной компании? Поясните, как каждая из этих функций может быть реализована на практике применительно к описанной ситуации.

Для каждого из четырех факторов риска предложите опережающий индикатор (показатель раннего предупреждения), изменение которого сигнализирует о приближении рискованного события. Например, для курсового риска индикатором может быть динамика цен на нефть.

Какая когнитивная ошибка чаще всего допускается при оценке вероятности редких событий (например, введение пошлин или появление нового конкурента)? Опишите, как компания может скорректировать свои прогнозы для минимизации этой ошибки.

Предложите три меры реагирования, которые компания может подготовить заранее (стратегические опционы) для снижения негативных последствий от реализации курсового риска.

## **Тема 6. Прогнозирование рыночной динамики: спрос, предложение, цены и поведение конкурентов**

### **Вопросы для опроса**

Назовите основные методы прогнозирования общего рыночного спроса для нового продукта, не имеющего аналогов.

Как прогнозируется эластичность спроса по цене в долгосрочном периоде и почему она выше, чем в краткосрочном?

Какие модели (структурные, временных рядов, эконометрические) лучше подходят для прогнозирования предложения на олигопольном рынке?

Опишите логику прогнозирования цены равновесия на основе пересечения прогнозных кривых спроса и предложения.

Как можно спрогнозировать вероятный ответ конкурента на снижение цены, используя теорию игр?

Какие индикаторы указывают на предстоящее изменение конкурентной стратегии (патентная активность, динамика найма, изменения ассортимента)?

Методы прогнозирования волатильности цен (модели GARCH) – для каких типов рынков они применимы?

Как сезонные и циклические колебания спроса учитываются в стратегическом (долгосрочном) прогнозе, а не только в оперативном?

Что такое «прогнозирование на основе анализа намерений покупателей» (опросы, тесты) и каковы его ограничения?

Как строится комплексный прогноз динамики рынка, если спрос,

предложение, цены и действия конкурентов взаимозависимы (системная динамика)?

Тестовые задания

Тест 1.

Внимательно прочитать текст задания и понять, что в качестве ответа ожидается только один из предложенных вариантов.

Внимательно прочитать предложенные варианты ответа.

Выбрать один верный ответ.

Записать только букву выбранного варианта ответа.

Какая модель прогнозирования спроса используется для описания распространения нового продукта через новаторов и последователей?

- а) модель Басса;
- б) модель Хольта-Уинтерса;
- в) модель регрессии;
- г) модель скользящей средней.

Что из перечисленного относится к факторам, определяющим динамику рыночного предложения?

- а) доходы потребителей;
- б) производственные мощности и уровень их загрузки;
- в) потребительские предпочтения;
- г) сезонность спроса.

Для какого типа рыночной структуры наиболее актуально прогнозирование поведения конкурентов с использованием элементов теории игр?

- а) совершенная конкуренция;
- б) монополия;
- в) олигополия;
- г) монополия.

Какая типичная ошибка прогнозирования рыночной динамики заключается в недооценке агрессивности ответных действий конкурентов?

- а) игнорирование асимметрии реакции конкурентов;
- б) недоучет запаздываний;
- в) усреднение разнородных сегментов;
- г) экстраполяция конкурентного равновесия.

Тест 2.

Внимательно прочитать текст задания и понять, что в качестве ответа ожидается несколько правильных ответов из предложенных вариантов.

Внимательно прочитать предложенные варианты ответа.

Выбрать несколько правильных ответов.  
Записать только буквы выбранных вариантов ответа.

Какие подходы используются для прогнозирования спроса?

- а) прогноз на основе временных рядов;
- б) прогноз на основе эконометрических моделей;
- в) прогноз на основе баланса спроса и предложения;
- г) прогноз на основе потребительских интенций;
- д) прогноз на основе аналогий.

Какие факторы влияют на динамику рыночного предложения?

- а) технологические ограничения и инновации;
- б) цены на сырье и комплектующие;
- в) уровень доходов потребителей;
- г) барьеры входа и выхода с рынка;
- д) ожидания производителей относительно будущей конъюнктуры.

Какие методы используются для прогнозирования поведения конкурентов?

- а) анализ публичных стратегий конкурентов (презентации, отчеты);
- б) мониторинг инвестиционной активности конкурентов;
- в) экстраполяция собственных продаж;
- г) анализ динамики рыночных долей;
- д) расчет ценовой эластичности спроса.

Какие типовые конкурентные стратегии подлежат прогнозированию?

- а) стратегия ценовой войны;
- б) стратегия дифференциации;
- в) стратегия минимизации налогов;
- г) стратегия следования за лидером;
- д) стратегия нишевания.

Какие показатели используются для оценки точности прогнозов рыночной динамики?

- а) средняя абсолютная процентная ошибка;
- б) коэффициент детерминации;
- в) анализ систематических и случайных ошибок;
- г) цветовая гамма графика;
- д) ретроспективное тестирование прогнозных моделей.

Тест 3.

Внимательно прочитать текст задания и понять, что в качестве ответа ожидается последовательность элементов.

Внимательно прочитать предложенные варианты ответа.

Построить верную последовательность из предложенных элементов.

Записать буквы вариантов ответов в нужной последовательности.

Установите последовательность этапов построения прогноза спроса на основе временного ряда:

- а) выделение тренда;
- б) выявление сезонной компоненты;
- в) сбор и первичная обработка исторических данных о продажах;
- г) учет случайной (нерегулярной) компоненты;
- д) построение комбинированного прогноза с учетом всех компонент.

Установите последовательность действий при прогнозировании поведения конкурентов в олигопольном рынке:

- а) определение возможных стратегий конкурента (цена, объем, реклама);
- б) сбор информации о целях, ограничениях и предположениях конкурента;
- в) выбор наиболее вероятной стратегии конкурента на основе равновесия по Нэшу;
- г) построение матрицы выигрышей для различных комбинаций стратегий;
- д) мониторинг фактических действий конкурента и корректировка прогноза.

Тест 4.

Внимательно прочитать текст задания и понять, что в качестве ответа ожидаются пары элементов.

Внимательно прочитать оба списка: список 1 – термины; список 2 – определения.

Сопоставить элементы списка 1 с элементами списка 2, сформировать пары элементов.

Записать попарно цифры и буквы вариантов ответа в таблицу.

Список 1 (термины):

1. Прогнозирование спроса на основе временных рядов
3. Модель диффузии инноваций Басса
4. Прогнозирование предложения
5. Ценовая эластичность спроса
6. Равновесие по Нэшу
7. Стратегия ценовой войны
8. Анализ публичных стратегий конкурентов
9. Метод аналогий в прогнозировании
10. Индикаторы раннего предупреждения

## 11. Асимметрия реакции конкурентов

### Список 2 (определения):

А. Метод прогнозирования спроса на новый продукт, описывающий его распространение на рынке через две группы потребителей – новаторов (принимающих решение самостоятельно) и последователей (ориентирующихся на мнение других).

Б. Оценка будущего объема товаров и услуг, которые производители готовы вывести на рынок, с учетом производственных мощностей, технологических ограничений, цен на сырье и ожиданий производителей.

В. Ситуация, при которой конкуренты по-разному реагируют на действия компании: один игрок отвечает агрессивно и немедленно, другой – пассивно или с задержкой, что необходимо учитывать при прогнозировании.

Г. Показатель, измеряющий степень изменения объема спроса в ответ на изменение цены; используется для прогнозирования ценовых последствий при корректировке стоимости товара.

Д. Метод прогнозирования, при котором закономерности развития одного рынка (или товара) переносятся на другой рынок при условии их сходства по ключевым характеристикам.

Е. Совокупность опережающих показателей, изменение которых сигнализирует о приближении определенного сценария рыночной динамики и позволяет своевременно скорректировать стратегию.

Ж. Концепция теории игр, при которой каждый участник рынка выбирает стратегию, наилучшим образом отвечающую на действия других, и ни один из игроков не может улучшить свое положение, меняя стратегию в одиночку.

З. Агрессивная конкурентная стратегия, заключающаяся в последовательном снижении цен для вытеснения соперников с рынка; прогнозирование ее вероятности требует анализа издержек и намерений конкурентов.

И. Анализ отчетов для инвесторов, интервью топ-менеджеров, инвестиционных презентаций и патентной активности конкурентов для выявления их целей, ограничений и будущих рыночных действий.

К. Метод прогнозирования, основанный на выделении тренда, сезонности, циклических и случайных компонент в исторических данных о продажах.

### **Контрольное задание 1.**

Компания «ФрешМаркет» выводит на рынок новую линейку готовых салатов в упаковке. Руководство просит аналитический отдел разработать прогноз рыночной динамики на ближайшие два года. Исходные данные: рынок готовой еды в регионе растет на 8-10% ежегодно; в сегменте салатов работают три основных конкурента с долями 35%, 25% и 20%; продукт компании является инновационным (увеличенный срок хранения без

консервантов); потребительские опросы показывают высокую заинтересованность (65% опрошенных готовы попробовать); планируемая цена на 15% выше средней рыночной.

Вопросы к заданию.

Какие методы прогнозирования спроса целесообразно применить для нового продукта, не имеющего исторических данных о продажах? Назовите не менее двух методов и поясните, как каждый из них может быть использован в данной ситуации.

Как прогноз поведения конкурентов повлияет на ценовую стратегию «ФрешМаркет»? Опишите два возможных сценария реакции конкурентов (агрессивный и пассивный) и предложите ответные действия компании для каждого сценария.

Какие факторы предложения могут ограничить способность компании удовлетворить потенциально высокий спрос? Назовите не менее трех факторов и предложите способы минимизации этих ограничений.

Компания планирует использовать модель диффузии инноваций Басса для прогнозирования распространения нового продукта. Объясните, что означают параметры «коэффициент инновации» ( $p$ ) и «коэффициент имитации» ( $q$ ) в этой модели. Какие значения этих коэффициентов вы предположите для рынка готовых салатов и почему?

Какие индикаторы вы будете отслеживать в первые три месяца после запуска, чтобы оперативно корректировать прогноз? Назовите не менее трех индикаторов и для каждого укажите, какое отклонение от плана потребует пересмотра стратегии.

## **Тема 7. Трансформация прогнозных сценариев в стратегические управленческие решения: механизмы, фильтры и процедуры имплементации**

### **Вопросы для опроса**

Опишите механизм перехода от вероятностного прогноза («с вероятностью 30% рынок упадет») к бинарному управленческому решению («инвестировать или нет»).

Что такое «фильтры принятия решений» (например, пороговые значения доходности, лимиты риска) и как они связаны с прогнозными интервалами?

Назовите основные процедуры имплементации: директивное планирование, адаптивное управление, формирование резервов, опционные стратегии.

Как концепция «реальных опционов» позволяет использовать прогноз неопределенности для гибких инвестиционных решений?

Какие организационные барьеры (когнитивные, политические, бюрократические) мешают трансформации прогноза в решение и как их преодолеть?

Что такое «алгоритм ветвления решений» на основе сценарного прогноза (decision tree)?

Как разрабатываются ключевые показатели эффективности (KPI) для мониторинга реализации решения, принятого на основе прогноза?

Опишите процедуру «постпрогнозного аудита»: зачем сравнивать реализовавшуюся динамику с прогнозом и как корректировать управление?

Каким образом механизм «скользящего прогноза» (rolling forecast) интегрирован в ежеквартальный цикл управленческих решений?

Приведите пример успешной трансформации негативного сценарного прогноза (например, падение спроса на 20%) в конкретное стратегическое решение (диверсификация, сокращение мощностей, смена каналов сбыта).

Тестовые задания:

Тест 1.

Внимательно прочитать текст задания и понять, что в качестве ответа ожидается только один из предложенных вариантов.

Внимательно прочитать предложенные варианты ответа.

Выбрать один верный ответ.

Записать только букву выбранного варианта ответа.

Какой механизм трансформации прогнозных сценариев в решения заключается в последовательном сужении веера возможных будущих состояний рынка до множества, которое компания способна охватить своей стратегией?

- а) механизм приоритизации сценариев;
- б) механизм редукции неопределенности;
- в) механизм стратификации решений;
- г) механизм опционного планирования.

Какой фильтр трансформации прогнозов в решения отсеивает сценарии, противоречащие фундаментальным ограничениям или основанные на ненадежных данных?

- а) фильтр реализуемости;
- б) фильтр стратегической совместимости;
- в) фильтр достоверности;
- г) фильтр экономической эффективности.

Что представляет собой стратегический опцион в контексте имплементации прогнозных сценариев?

- а) единственный безальтернативный план действий;
- б) заранее подготовленный альтернативный план действий для определенного сценария;
- в) финансовый инструмент для хеджирования рыночных рисков;
- г) обязательство действовать определенным образом независимо от сценария.

Какая процедура заключается в проверке устойчивости выбранного курса действий при реализации различных прогнозных сценариев, включая экстремальные?

- а) стресс-тестирование стратегии;
- б) анализ чувствительности;
- в) построение дерева решений;
- г) мониторинг триггеров.

Какое когнитивное препятствие мешает эффективной трансформации прогнозов в решения и выражается в неспособности руководства воспринять прогнозы, противоречащие их ментальной модели рынка?

- а) инерция принятых решений;
- б) стратегическая слепота;
- в) конфликт интересов;
- г) ложное чувство контроля.

Тест 2.

Внимательно прочитайте текст задания и понять, что в качестве ответа ожидается несколько правильных ответов из предложенных вариантов.

Внимательно прочитайте предложенные варианты ответа.

Выбрать несколько правильных ответов.

Записать только буквы выбранных вариантов ответа.

Какие механизмы используются для трансформации прогнозных сценариев в стратегические решения?

- а) механизм редукции неопределенности;
- б) механизм случайного выбора;
- в) механизм приоритизации сценариев;
- г) механизм стратификации решений;
- д) механизм игнорирования альтернатив.

Какие фильтры проходит прогнозная информация перед превращением в управленческое решение?

- а) фильтр достоверности;
- б) фильтр реализуемости;
- в) фильтр стратегической совместимости;
- г) фильтр экономической эффективности;
- д) фильтр эстетической привлекательности.

Какие процедуры относятся к процедурам имплементации прогнозных сценариев в стратегическое управление?

- а) построение стратегических опционов;
- б) создание системы индикаторов раннего предупреждения;
- в) регулярный пересмотр прогнозов и решений;

- г) разовое принятие плана без последующих корректировок;
- д) стресс-тестирование стратегии.

Какие методы используются для формализации процесса трансформации прогнозов в решения?

- а) метод дерева решений;
- б) метод анализа реальных опционов;
- в) метод портфельного управления сценариями;
- г) метод монетарного правила;
- д) метод мониторинга с триггерами.

Какие организационные барьеры препятствуют эффективной трансформации прогнозов в решения?

- а) стратегическая слепота руководства;
- б) инерция принятых решений;
- в) полное отсутствие бюрократии;
- г) конфликт интересов между подразделениями;
- д) дефицит внимания к долгосрочным прогнозам.

### Тест 3.

Внимательно прочитайте текст задания и понять, что в качестве ответа ожидается последовательность элементов.

Внимательно прочитайте предложенные варианты ответа.

Построить верную последовательность из предложенных элементов.

Записать буквы вариантов ответов в нужной последовательности.

Установите последовательность этапов трансформации прогнозных сценариев в стратегические решения:

- а) разработка стратегических опционов для ключевых сценариев;
- б) построение многовариантных прогнозных сценариев;
- в) мониторинг индикаторов раннего предупреждения и активация опциона;
- г) фильтрация сценариев по критериям достоверности, реализуемости и эффективности;
- д) создание системы триггеров (пороговых значений) для переключения между опционами.

Установите последовательность применения метода «предсмертного анализа» (pre-mortem):

- а) команда письменно фиксирует причины, по которым стратегия могла бы провалиться;
- б) предполагается, что стратегия уже реализована и провалилась;
- в) выявленные риски учитываются при доработке стратегии и системы мониторинга;
- г) участники генерируют сценарии возможных неудач без ограничений;

д) формулируется стратегическое решение, которое предстоит оценить.

Контрольные задания:

Задание 1.

Крупная логистическая компания «Быстрый груз» разработала три прогнозных сценария развития рынка грузоперевозок на ближайшие три года: оптимистичный (рост рынка 10% в год, снижение цен на топливо), базовый (рост 4% в год, стабильные цены), пессимистичный (падение 5% в год, рост цен на топливо на 20%). Руководство компании признает, что прогнозы сами по себе бесполезны, если они не трансформируются в конкретные управленческие решения.

Вопросы к заданию.

Опишите, как работает механизм редукции неопределенности применительно к данной ситуации. Какие будущие состояния рынка компания заведомо исключает из рассмотрения и почему?

Через какие три фильтра должны пройти прогнозные сценарии перед тем, как на их основе будут приняты решения? Для каждого фильтра приведите пример применительно к компании «Быстрый груз».

Разработайте для каждого из трех сценариев по два стратегических опциона (альтернативных плана действий). Например, для оптимистичного сценария – расширение парка и выход на новые направления.

Предложите систему из трех индикаторов раннего предупреждения, которые позволят компании понять, какой сценарий начинает реализовываться. Для каждого индикатора укажите пороговое значение (триггер), при достижении которого следует активировать соответствующий опцион.

Какие организационные барьеры могут помешать руководству компании своевременно переключиться с базового сценария на антикризисный при ухудшении рыночной ситуации? Предложите два способа преодоления этих барьеров.

Задание 2.

Производственная компания «СтройИндустрия» работает на рынке строительных материалов. Руководство компании разработало три прогнозных сценария развития рынка на ближайшие два года:

оптимистичный сценарий (вероятность 25%): рост жилищного строительства на 15% в год, снижение цен на сырье на 10%, отсутствие новых регуляторных ограничений;

базовый сценарий (вероятность 55%): рост строительства на 5% в год, стабильные цены на сырье, незначительные ужесточения требований к качеству материалов;

пессимистичный сценарий (вероятность 20%): падение объемов строительства на 10% в год, рост цен на сырье на 20%, введение обязательной сертификации новых видов продукции.

Компания имеет свободные производственные мощности (загружены на 70%), финансовый резерв в размере 200 млн рублей и возможность привлечения кредитов. В настоящее время компания реализует стратегию удержания доли рынка (20% в регионе) при базовом сценарии.

Вопросы к заданию.

Опишите, как работает механизм редукации неопределенности применительно к данной ситуации. Какие будущие состояния рынка компания уже исключила из рассмотрения и почему?

Через какие три фильтра должны пройти прогнозные сценарии перед тем, как на их основе будут приняты стратегические решения? Для каждого фильтра приведите конкретный пример проверки применительно к компании «СтройИндустрия».

Разработайте для каждого из трех сценариев по два стратегических опциона (заранее подготовленных плана действий). Для каждого опциона укажите: конкретные действия компании, требуемые ресурсы, ожидаемый результат.

Предложите систему из трех индикаторов раннего предупреждения, которые позволят компании понять, какой сценарий начинает реализовываться. Для каждого индикатора укажите: что именно измеряется, источник данных, пороговое значение (триггер), при достижении которого следует активировать соответствующий опцион.

Какие организационные барьеры (не менее двух) могут помешать руководству компании своевременно переключиться с базового сценария на антикризисный при ухудшении рыночной ситуации? Предложите конкретные способы преодоления каждого барьера.

Опишите процедуру стресс-тестирования текущей стратегии (удержание доли рынка) для пессимистичного сценария. Какие показатели компании окажутся под наибольшей угрозой и какие меры можно принять заранее для повышения устойчивости?

5.3. 5.3 Один или несколько тематических блоков дисциплины завершаются контрольной точкой (далее – КТ). Текущий контроль успеваемости по дисциплине предусматривает три КТ в течение периода освоения дисциплины.

Максимальное количество баллов за любой тип работ в рамках КТ составляет 100 (сто) баллов.

Распределение весовых коэффициентов по КТ в рамках текущего контроля по дисциплине:

Наименование контрольной точки	Максимальное количество баллов за работу в рамках КТ, которое может набрать обучающийся	Коэффициент веса контрольной точки	Результат контрольной точки, участвующий в формировании итоговой балльной оценки по дисциплине (отражается в журнале)
--------------------------------	---	------------------------------------	---

			БРС в СДО)
КТ 1	100	0,1	10
КТ 2	100	0,1	10
КТ 3	100	0,1	10
Итого:	x	0,1	30

Формула расчета результата контрольной точки:

Результат контрольной точки = Количество баллов за работу в рамках КТ x Коэффициент веса контрольной точки.

5.4. Формы текущего контроля успеваемости обучающихся в рамках КТ и типовые оценочные материалы:

### **КТ– 1.**

#### **Раздел 1**

##### Тематика докладов:

1. Историческая эволюция прогнозирования: от интуитивных предсказаний к научным методам.
2. VUCA-факторы как ключевая предпосылка возникновения стратегического прогнозирования рынка.
3. Сравнительный анализ понятий: прогноз, план, программа, стратегия – разграничение и взаимосвязь.
4. Прогноз как вероятностное суждение: отличие от достоверного знания и директивного плана.
5. Классификация прогнозов по горизонту упреждения: оперативные, кратко-, средне- и долгосрочные прогнозы.
6. Классификация прогнозов по масштабу: макро-, мезо- и микроуровень в рыночном прогнозировании.
7. Поисковые и нормативные прогнозы: сравнительная характеристика и области применения.
8. Интуитивные (экспертные) и формализованные (фактографические) прогнозы: достоинства и ограничения.
9. Функциональная классификация прогнозов: спрос, предложение, цены, емкость рынка, конкурентная среда.
10. Место прогнозирования в системе стратегического планирования рынка.
11. Функции прогноза по отношению к плану: аналитическая, предупредительная, альтернативная.
12. Отличие рыночного прогнозирования от маркетинговых

исследований и бизнес-планирования.

13. Ошибки смещения прогноза и плана: анализ провалов известных компаний (Nokia, Blockbuster, Kodak).

14. Роль государственного регулирования в системе стратегического прогнозирования и планирования рынка.

15. Прогнозирование и форсайт: сходства, различия и области применения.

16. Классификация планов в системе стратегического управления рынком.

17. Принципы построения системы прогнозов и планов в организации.

18. Логическая цепочка «анализ прошлого → прогноз → план → реализация → контроль».

19. Нормативно-правовая база стратегического прогнозирования в Российской Федерации.

20. Критерии качества прогнозов: точность, надежность, верифицируемость и их значение для стратегического планирования.

#### Методические рекомендации по подготовке доклада.

Подготовка доклада способствует формированию навыков исследовательской работы, расширяет познавательные интересы, приучает критически мыслить. При написании доклада по заданной теме составляется план, подбираются основные источники. В процессе работы с источниками, систематизируют полученные сведения, делают выводы и обобщения.

Подготовка доклада требует от обучающегося большой самостоятельности и серьезной интеллектуальной работы, которая принесет наибольшую пользу, если будет включать с себя следующие этапы: изучение наиболее важных научных работ по данной теме, перечень которых дает сам преподаватель; анализ изученного материала, выделение наиболее значимых для раскрытия темы фактов, мнений разных ученых и научных положений; обобщение и логическое построение материала доклада, например, в форме развернутого плана; написание текста доклада с соблюдением требований научного стиля.

Построение доклада включает три части: вступление, основную часть и заключение. Во вступлении указывается тема доклада, устанавливается логическая связь ее с другими темами или место рассматриваемой проблемы среди других проблем, дается краткий обзор источников, на материале которых раскрывается тема и т. п. Основная часть должна иметь четкое логическое построение, в ней должна быть раскрыта тема доклада. В заключении обычно подводятся итоги, формулируются выводы,

подчеркивается значение рассмотренной проблемы и т. п.

Критерии оценивания доклада:

Критерии оценки	Диапазон баллов	Описание критерия
Содержание и раскрытие темы	0-20	Детальное, последовательное описание всех этапов с конкретными примерами
Грамотность изложения	0-20	Соблюдены все правила грамматики, орфографии и пунктуации
Стилистика	0-20	Единый стиль изложения, точные формулировки, уместное использование терминов, лаконичность
Логика изложения	0-20	Чёткая последовательность изложения, логические связи между частями текста, аргументы подтверждают выводы
Оригинальность	0-20	Уникальный подход к теме, нестандартные решения, инновационные идеи, собственная позиция автора
Итого максимально:	100	

Вопросы для опроса:

№ п.п.	Содержание вопроса
1.	Дайте определение информационного обеспечения прогнозирования рынка. Какие задачи оно решает?
2.	Перечислите основные требования к информации, используемой для стратегического прогнозирования рынка (не менее пяти).
3.	Что означает требование репрезентативности информации? Почему оно критически важно для прогнозирования?
4.	Чем отличаются первичные источники информации от вторичных? Приведите примеры каждого типа.
5.	Какие источники относятся к статистической информации? Назовите не менее трех.
6.	Что такое альтернативные данные (big data, геолокация, соцмедиа, поисковые запросы)? Приведите примеры их использования для прогнозирования рынка.
7.	Какие методы сбора информации используются при прогнозировании рынка? Опишите два из них.

8.	Что такое проблема лагов в информационном обеспечении? Как она влияет на своевременность прогнозов?
9.	В чем заключается проблема расхождения данных из разных источников? Как следует поступать прогнозисту в такой ситуации?
10.	Что такое верификация информации? Опишите процедуру перекрестной проверки данных.
11.	Какие методы используются для восполнения пробелов в данных при информационной недостаточности?
12.	Что такое прокси-переменные? Приведите пример использования прокси для прогнозирования спроса.
13.	Какие проблемы информационного обеспечения наиболее характерны для развивающихся рынков?
14.	Что такое шум в данных? Как отличить шум от значимого сигнала?
15.	Как обеспечить конфиденциальность персональных данных при сборе информации для прогнозирования?
16.	Что такое система информационного мониторинга рынка? Из каких элементов она состоит?
17.	Какие источники информации о конкурентах являются легальными и этичными для использования в прогнозировании?
18.	Какова роль открытых данных (open data) государственных органов в прогнозировании рынка?
19.	Что такое дата-марты и хранилища данных? Как они используются для организации информационного обеспечения прогнозирования?
20.	Предложите алгоритм действий аналитика при обнаружении аномалии (выброса) в данных, используемых для прогнозирования.

#### Критерии оценивания опроса:

Диапазон баллов	Описание критерия
85-100	Обучающийся полно излагает материал (отвечает на вопрос), дает правильное определение основных понятий; обнаруживает понимание материала, может обосновать свои суждения, применить знания на практике, привести необходимые примеры не только из учебника, но и самостоятельно составленные; излагает материал последовательно и правильно с точки зрения норм литературного языка.
65-84	Обучающийся дает ответ, удовлетворяющий тем же требованиям, что и для оценки «отлично», но допускает 1–2 ошибки, которые сам же исправляет, и 1–2 недочета в последовательности и языковом оформлении излагаемого.

55-64	Обучающийся обнаруживает знание и понимание основных положений данной темы, но излагает материал неполно и допускает неточности в определении понятий или формулировке правил; не умеет достаточно глубоко и доказательно обосновать свои суждения и привести свои примеры; излагает материал непоследовательно и допускает ошибки в языковом оформлении излагаемого.
0-54	Обучающийся обнаруживает незнание вопроса, допускает ошибки в формулировке определений и правил, искажающие их смысл, беспорядочно и неуверенно излагает материал.

## **КТ-2.**

### **Раздел 2.**

#### Тестовые задания

1. Что из перечисленного относится к объектам регионального стратегического прогнозирования, непосредственно влияющим на емкость потребительского рынка?

- а) курс акций региональных компаний;
- б) численность и половозрастная структура населения;
- в) дизайн упаковки локальных товаров;
- г) система мотивации персонала региональных предприятий.

2. Какой метод регионального прогнозирования основан на том, что экспортная база региона является основным драйвером роста локальных рынков?

- а) нормативный метод;
- б) метод экономической базы;
- в) балансовый метод;
- г) метод экстраполяции трендов.

3. Какая ошибка возникает при игнорировании региональной дифференциации и использовании среднероссийских показателей для прогнозирования локальных рынков?

- а) ошибка выжившего;
- б) ошибка «средней температуры по больнице»;
- в) ошибка подтверждения;
- г) ошибка планирования.

4. Прогноз какого регионального показателя напрямую определяет потенциальный спрос на рынке жилья и строительных материалов?

- а) прогноз налоговых поступлений;
- б) прогноз инфляции;
- в) прогноз ввода жилья и миграции населения;

г) прогноз курса национальной валюты.

5. Какие официальные документы регионального уровня являются важнейшим источником прогнозной информации для бизнеса?

- а) внутренние приказы губернатора;
- б) стратегии социально-экономического развития региона;
- в) уставы муниципальных образований;
- г) протоколы заседаний регионального правительства.

6. Что из перечисленного наиболее полно характеризует рыночный риск как объект стратегического прогнозирования?

- а) гарантированное наступление неблагоприятного события;
- б) вероятность отклонения фактических рыночных параметров от прогнозируемых значений, влекущая экономические потери;
- в) возможность получения сверхприбыли без каких-либо угроз;
- г) фиксированный убыток, заложенный в бюджет компании.

7. Какая функция стратегического прогнозирования заключается в заблаговременном обнаружении зон потенциальной уязвимости и формировании сигналов о приближении критических изменений?

- а) аналитическая;
- б) целеполагающая;
- в) предупредительная;
- г) оценочная.

8. Какой метод управления рисками предполагает оценку устойчивости стратегии при экстремальных значениях рыночных параметров?

- а) анализ чувствительности;
- б) стресс-тестирование;
- в) имитационное моделирование;
- г) сценарный анализ.

9. Какая когнитивная ошибка заключается в систематическом оптимизме при оценке сроков и затрат, что искажает прогноз рисков?

- а) ошибка самоуверенности;
- б) ошибка подтверждения;
- в) ошибка доступности;
- г) ошибка планирования.

10. Какой вид риска относится к рыночным рискам, требующим стратегического прогнозирования?

- а) пожарный риск на складе;
- б) конкурентный риск (появление новых игроков);
- в) кадровый риск (увольнение ключевого сотрудника);

г) технический риск (поломка оборудования).

11. Что представляет собой метод Монте-Карло в контексте прогнозирования рыночных рисков?

- а) метод экспертных оценок;
- б) метод имитационного моделирования для построения распределения вероятностей рыночных результатов;
- в) метод экстраполяции трендов;
- г) метод сценарного планирования.

12. Какая задача стратегического прогнозирования в области управления рисками заключается в определении границ, за пределами которых требуется корректировка стратегии?

- а) построение многовариантных сценариев;
- б) расчет коридоров допустимых отклонений;
- в) идентификация потенциальных угроз;
- г) оценка чувствительности стратегии.

13. Какая модель прогнозирования спроса используется для описания распространения нового продукта на рынке через новаторов и последователей?

- а) модель Хольта-Уинтерса;
- б) модель Басса;
- в) модель скользящей средней;
- г) модель регрессии.

14. Что из перечисленного относится к факторам, определяющим динамику рыночного предложения?

- а) доходы потребителей;
- б) потребительские предпочтения;
- в) производственные мощности и уровень их загрузки;
- г) сезонность спроса.

15. Для какого типа рыночной структуры прогнозирование поведения конкурентов с использованием теории игр является наиболее критичным?

- а) совершенная конкуренция;
- б) монополия;
- в) олигополия;
- г) монополия.

16. Какая типичная ошибка прогнозирования рыночной динамики заключается в недооценке агрессивности ответных действий конкурентов?

- а) игнорирование асимметрии реакции конкурентов;
- б) недоучет запаздываний;
- в) усреднение разнородных сегментов;

г) экстраполяция конкурентного равновесия.

17. Какой метод прогнозирования спроса целесообразно применять для нового инновационного продукта, не имеющего исторических данных о продажах?

- а) экстраполяцию трендов;
- б) модель диффузии инноваций Басса;
- в) метод скользящей средней;
- г) анализ временных рядов.

18. Что такое ценовая эластичность спроса?

- а) показатель, измеряющий степень изменения объема спроса в ответ на изменение цены;
- б) способность компании удерживать цены при росте издержек;
- в) разница между максимальной и минимальной ценой на рынке;
- г) скорость изменения цен в течение года.

19. Какое конкурентное равновесие в теории игр означает, что ни один из игроков не может улучшить свое положение, меняя стратегию в одиночку?

- а) равновесие по Парето;
- б) равновесие по Нэшу;
- в) равновесие по Штакельбергу;
- г) равновесие Бертрана.

20. Какой метод прогнозирования поведения конкурентов предполагает анализ отчетов для инвесторов, интервью топ-менеджеров и патентной активности?

- а) метод Дельфи;
- б) анализ публичных стратегий конкурентов;
- в) экстраполяция рыночных долей;
- г) метод сценариев.

Критерии оценивания тестовых заданий:

Диапазон баллов	Описание критерия	
85-100	Свыше 80% правильных ответов.	Обучающийся демонстрирует глубокое познание в освоенном материале.
65-84	Свыше 70% правильных ответов.	Обучающимся материал освоен полностью, без существенных ошибок.
55-64	Свыше 50% правильных ответов.	Обучающимся материал освоен не полностью, имеются значительные пробелы в знаниях.

0-54	Менее 50% правильных ответов.	Обучающимся материал не освоен, знания обучающегося ниже базового уровня.
------	-------------------------------	---

### КТ—3.

#### Раздел 3.

#### Контрольные задания:

##### Задание 1.

Сеть розничных магазинов «Домашний уют» (120 магазинов в 8 регионах) разработала три прогнозных сценария развития рынка товаров для дома на ближайшие 3 года:

Сценарий	Вероятность	Ключевые параметры
Оптимистичный	20%	Рост реальных доходов населения +5% в год, рост рынка +12% в год, снижение арендных ставок на 10%
Базовый	60%	Стагнация доходов, рост рынка +3% в год, аренда без изменений
Пессимистичный	20%	Падение доходов на 5% в год, сжатие рынка на 8% в год, рост аренды на 15%

В настоящее время компания реализует стратегию открытия 15 новых магазинов в год, основанную на экстраполяции прошлых темпов роста (базовый сценарий). Генеральный директор выразил сомнение в том, что компания готова к переключению между сценариями.

Опишите механизм стратификации решений применительно к данной ситуации. Какие решения компания должна принять немедленно, какие отложить до получения дополнительных данных, а для каких создать стратегические опционы?

Разработайте для каждого из трех сценариев по два стратегических опциона. Для каждого опциона укажите конкретные действия, требуемые ресурсы и ожидаемый результат.

Предложите систему из четырех индикаторов раннего предупреждения. Для каждого индикатора определите: что измеряется, источник данных, пороговое значение (триггер), какой опцион активируется при достижении триггера.

Проведите анализ организационных барьеров, которые могут помешать компании своевременно переключиться с базового сценария на

пессимистичный. Назовите не менее трех барьеров и для каждого предложите способ преодоления.

Опишите процедуру стресс-тестирования текущей стратегии (открытие 15 магазинов в год) для пессимистичного сценария. Какие финансовые и операционные показатели окажутся под наибольшей угрозой?

### Задание 2.

Фармацевтическая компания «МедТех» инвестировала 500 млн рублей в разработку нового лекарственного препарата. Препарат находится на финальной стадии клинических испытаний. Компания построила три прогнозных сценария рыночного успеха после выхода на рынок:

Успех (вероятность 25%): препарат получает регистрацию без замечаний, занимает 15% целевого рынка, окупаемость за 2 года.

Умеренный результат (вероятность 50%): регистрация с дополнительными требованиями, доля рынка 7%, окупаемость за 4 года.

Провал (вероятность 25%): отказ в регистрации или жесткие ограничения, потеря инвестиций.

Совет директоров требует разработать механизм трансформации этих сценариев в управленческие решения на каждом этапе (регистрация, вывод на рынок, первые продажи).

Какой механизм трансформации прогнозов в решения (редукция, приоритизация, стратификация) является наиболее подходящим для данной ситуации на этапе до получения результатов регистрации? Обоснуйте ответ.

Примените фильтры трансформации (достоверность, реализуемость, стратегическая совместимость, экономическая эффективность, приемлемость риска) к сценарию «Умеренный результат». Какой вывод о целесообразности продолжения проекта сделает каждый фильтр?

Разработайте три реальных опциона (финансово-управленческих механизма), которые компания может заложить в инвестиционное соглашение или внутренний регламент. Для каждого опциона укажите: условие активации, конкретные действия, ожидаемый эффект.

Предложите систему мониторинга с триггерами для первого года после выхода препарата на рынок. Включите не менее четырех показателей, для каждого укажите: измерение, источник, «зеленую» и «красную» зоны.

Опишите процедуру «предсмертного анализа» (pre-mortem) для сценария «Провал». Какие три основные причины провала могут быть выявлены еще до получения окончательных результатов испытаний? Какие меры можно принять заранее для снижения вероятности каждой причины?

### Задание № 3

Крупная IT-компания «СофтСолюшнс» разрабатывает корпоративную систему трансформации прогнозных сценариев в стратегические решения. В компании создан отдел стратегического прогнозирования, но его рекомендации часто игнорируются операционными подразделениями. Руководство поставило задачу разработать формальные процедуры имплементации, обязательные для всех подразделений.

Вопросы.

Предложите организационную модель интеграции прогнозирования в управление (централизованная, децентрализованная или гибридная) для данной компании. Аргументируйте выбор, указав достоинства и недостатки выбранной модели.

Разработайте регламент взаимодействия между отделом стратегического прогнозирования и руководителями операционных подразделений. Включите в регламент: периодичность встреч, форматы предоставления прогнозов, процедуру формальной презентации.

Опишите процедуру документирования прогнозных допущений. Зачем необходимо фиксировать допущения и их последующие изменения? Какой документ должен создаваться и как часто пересматриваться?

Предложите систему мотивации для руководителей подразделений, стимулирующую использование прогнозной информации при принятии решений. Как учесть точность прогнозов и качество их использования?

Разработайте процедуру «адвоката дьявола» для критической оценки прогнозных сценариев перед принятием стратегических решений. Кто должен выполнять эту роль? Какие вопросы должен задавать «адвокат дьявола»?

Какие показатели КРІ для отдела стратегического прогнозирования вы предложите, чтобы оценить эффективность трансформации прогнозов в реальные управленческие решения (а не только точность прогнозов)?

#### Задание 4

Логистическая компания «ТрансЛогистик» специализируется на грузоперевозках между Россией и странами Европы. Внезапно возникли геополитические риски, которые не были учтены в стандартных прогнозных сценариях компании (так называемая «дикая карта»). Вероятность резкого падения объема перевозок (на 40-60% в течение месяца) оценивается как высокая. У компании нет готового сценария и опционов для такой ситуации.

Вопросы.

Как должен быть скорректирован механизм редукции неопределенности в условиях появления «дикой карты»? Какие новые будущие состояния рынка необходимо теперь учитывать?

В условиях дефицита времени (неделя на принятие решений) предложите ускоренную процедуру трансформации прогнозов в решения. Какие фильтры можно ослабить, а какие ужесточить?

Разработайте экстренные стратегические опционы для трех возможных траекторий развития событий:

- краткосрочный кризис (1-3 месяца) с последующим восстановлением;
- затяжной кризис (1-2 года) с изменением структуры рынка;
- необратимая потеря европейского направления.

Предложите систему индикаторов раннего предупреждения, специфичную для геополитических рисков. Какие источники информации (включая альтернативные) следует мониторить?

Какие когнитивные искажения (ошибка самоуверенности, ошибка подтверждения, стратегическая слепота) наиболее опасны для руководства компании в данной кризисной ситуации? Опишите, как каждое искажение может проявиться и как его нейтрализовать.

Разработайте план коммуникации с ключевыми стейкхолдерами (персонал, клиенты, кредиторы) в зависимости от того, какой сценарий начнет реализовываться. Какие решения должны быть объявлены немедленно, а какие – отложены?

#### Задание 5.

Авиакомпания «СкайЛайн» разработала четыре прогнозных сценария развития рынка авиаперевозок на ближайшие 5 лет:

Сценарий	Вероятность	Цена на нефть	Пассажиропоток	Регуляторная среда
Зеленый (устойчивый рост)	30%	\$50-60/барр.	+7% в год	Либерализация, открытие новых направлений
Желтый (стагнация)	40%	\$70-80/барр.	+2% в год	Без изменений
Красный (кризис)	20%	\$100+/барр.	-5% в год	Ужесточение требований, закрытие направлений
Синий (технологический прорыв)	10%	\$40-50/барр.	+12% в год	Появление электрической авиации, новые правила

Компания имеет парк из 50 самолетов (средний возраст 8 лет), кредитный портфель 2 млрд рублей, долю рынка 15% на внутренних линиях и 5% на международных.

Вопросы.

- Примените последовательно все четыре механизма трансформации прогнозов в решения (редукцию неопределенности, приоритизацию сценариев, стратификацию решений, опционное планирование) к данным сценариям. Опишите результат применения каждого механизма.
- Проведите фильтрацию всех четырех сценариев. Какой сценарий (или сценарии) будет отсечен фильтром реализуемости? Какие ресурсы или компетенции потребуются для обслуживания сценария «Синий»?
- Рассчитайте ожидаемую ценность каждого сценария, если известна прогнозная прибыль: «Зеленый» – 500 млн руб./год, «Желтый» – 200 млн руб./год, «Красный» – убыток 300 млн руб./год, «Синий» – 800 млн руб./год. Какой сценарий имеет наибольшую ожидаемую ценность? Следует ли принимать решение только на основе этого расчета?
- Разработайте портфельную стратегию (распределение ресурсов между сценариями) для авиакомпании. Какую долю инвестиций (в процентах) вы направите на усиление стратегии для «Зеленого» сценария, на хеджирование рисков «Красного» и на создание возможностей для «Синего»? Обоснуйте пропорции.
- Предложите метод дерева решений для последовательных инвестиционных выборов авиакомпании на 5-летнем горизонте. Какие ключевые точки принятия решений (этапы) должны быть включены в дерево?
- Опишите процедуру регулярного пересмотра прогнозов и решений в авиакомпании. С какой периодичностью следует пересматривать вероятности сценариев? Какие триггеры должны инициировать внеплановый пересмотр?
- Какие методы преодоления инерции принятых решений вы предложите руководству авиакомпании, учитывая, что высока вероятность «Красного» сценария, но менеджеры психологически настроены на «Зеленый»? Опишите не менее двух методов.

Критерии оценивания контрольных заданий:

Диапазон баллов	Описание критерия
85-100	Обучающимся задание выполнено без ошибок и в полном объеме.
65-84	Обучающимся в целом задание выполнено, имеются отдельные неточности или недостаточно полные ответы, не содержащие ошибок.
55-64	Обучающимся допущены отдельные ошибки при выполнении задания

0-54	У обучающегося отсутствуют ответы на большинство вопросов задачи, задание не выполнено или выполнено не верно.
------	--

5.5. Описание дополнительных материалов и оборудования, необходимых для выполнения проверочных заданий (*при необходимости*).

Для решения контрольных заданий обучающемуся разрешается использование калькулятора.

## **6. Формы промежуточной аттестации, критерии и шкала оценивания, типовые оценочные материалы по дисциплине**

6.1. Промежуточная аттестация (зачет с оценкой) проводится в письменной форме. Обучающийся получает перечень заданий и приступает к написанию ответов.

Задания к зачету с оценкой по темам

### **Тема 1. Предпосылки, понятийный аппарат и классификация прогнозов и планов в системе стратегического прогнозирования рынка**

1. Что из перечисленного наиболее полно характеризует прогноз как категорию стратегического прогнозирования рынка?

- а) директивный план действий, обязательный для исполнения;
- б) вероятностное научно обоснованное суждение о будущем состоянии рынка;
- в) система взаимоувязанных мероприятий для достижения целей;
- г) долгосрочный вектор развития, определяющий позиционирование компании.

2. Какой признак относится к классификации прогнозов по горизонту упреждения?

- а) прогноз спроса;
- б) микроэкономический прогноз;
- в) среднесрочный прогноз;
- г) нормативный прогноз.

3. Какая функция прогноза по отношению к плану заключается в заблаговременном обнаружении зон потенциальной уязвимости?

- а) аналитическая;
- б) предупредительная;
- в) альтернативная;
- г) целеполагающая.

4. Какая предпосылка обусловила возникновение стратегического прогнозирования рынка?

- а) полная предсказуемость потребительского поведения;
- б) усложнение рыночной среды и рост неопределенности (VUCA-факторы);
- в) отсутствие потребности бизнеса в снижении долгосрочных рисков;
- г) стабильность всех рыночных параметров.

5. Что из перечисленного относится к базовым категориям системы «стратегическое прогнозирование – планирование»?

- а) бенчмаркинг;
- б) аутсорсинг;
- в) программа;
- г) франчайзинг.

Открытые вопросы

1. Дайте определение понятиям «прогноз», «план», «программа» и «стратегия». В чем принципиальное различие между этими категориями?

2. Перечислите не менее четырех оснований для классификации прогнозов и приведите пример каждого.

3. Опишите логическую цепочку «анализ прошлого → прогноз → план → реализация → контроль». Какую роль в этой цепочке играет прогнозирование?

4. На примере компании Nokia или Blockbuster объясните, к каким последствиям приводит смещение прогноза и плана.

5. Какие VUCA-факторы наиболее сильно повлияли на развитие стратегического прогнозирования в последние 10 лет? Аргументируйте ответ.

## **Тема 2. Методология, принципы и технологии стратегического прогнозирования**

1. Какой принцип стратегического прогнозирования требует обязательной разработки множества альтернативных сценариев?

- а) принцип системности;
- б) принцип непрерывности;
- в) принцип вариантности;
- г) принцип верифицируемости.

2. Какой метод прогнозирования относится к группе фактографических?

- а) метод Дельфи;
- б) мозговой штурм;
- в) экстраполяция трендов;
- г) метод сценариев.

3. Какая технология прогнозирования предполагает оценку взаимного влияния событий друг на друга?

- а) кросс-импакт анализ;
- б) регрессионный анализ;
- в) метод «дерева целей»;
- г) анализ временных рядов.

4. Что из перечисленного является типичной ошибкой при применении методов прогнозирования?

- а) использование нескольких независимых источников данных;
- б) путаница между корреляцией и причинностью;
- в) регулярное уточнение прогнозов;
- г) сопоставление прогноза с фактическими значениями.

5. Какой метод относится к экспертным методам прогнозирования?

- а) корреляционно-регрессионный анализ;
- б) метод аналогий;
- в) метод Дельфи;
- г) эконометрическое моделирование.

Открытые вопросы

1. Раскройте содержание принципов системности, непрерывности, вариантности и верифицируемости применительно к прогнозированию рынка.

2. Опишите процедуру проведения метода Дельфи. Каким образом обеспечивается анонимность и обратная связь?

3. В чем отличие поисковых сценариев от нормативных? Приведите примеры каждого типа для рынка электромобилей.

4. Какие критерии используются при выборе метода прогнозирования в зависимости от горизонта прогноза и степени неопределенности?

5. Что такое форсайт? Опишите такие инструменты форсайта, как технологические дорожные карты и анализ слабых сигналов.

### **Тема 3. Информационное обеспечение прогнозирования рынка**

1. Какое требование к информации означает, что данные должны отражать все значимые характеристики рынка без критических пробелов?

- а) достоверность;
- б) репрезентативность;
- в) своевременность;
- г) сопоставимость.

2. Какие данные относятся к первичным источникам информации?

- а) данные Росстата о розничном товарообороте;
- б) результаты собственного опроса потребителей;
- в) обзор рынка от консалтинговой компании;
- г) финансовая отчетность конкурента.

3. Что из перечисленного относится к альтернативным источникам данных?

- а) данные налоговой отчетности;
- б) геолокационные данные мобильных устройств;
- в) официальные данные центрального банка;
- г) отраслевые стандарты.

4. Какая проблема информационного обеспечения возникает из-за задержки публикации статистических данных?

- а) проблема шума;
- б) проблема конфиденциальности;
- в) проблема лагов;
- г) проблема неполноты.

5. Какой метод используется для восполнения пробелов в данных при информационной недостаточности?

- а) экстраполяция;
- б) импутация (методы восполнения пропусков);
- в) дефляция;
- г) агрегирование.

Открытые вопросы

1. Перечислите и кратко охарактеризуйте не менее пяти требований к информации для целей стратегического прогнозирования рынка.

2. В чем отличие первичных источников информации от вторичных? Приведите по три примера каждого типа.

3. Что такое альтернативные данные (big data, геолокация, соцмедиа)? Приведите два примера их использования для прогнозирования спроса.

4. Опишите процедуру верификации информации на примере перекрестной проверки данных о рыночной доле конкурента.

5. Какие проблемы информационного обеспечения наиболее характерны для прогнозирования на развивающихся рынках? Предложите способы их минимизации.

#### **Тема 4. Стратегическое прогнозирование социально-экономического развития региона как фактор рыночной конъюнктуры**

1. Что из перечисленного относится к объектам регионального прогнозирования, влияющим на емкость потребительского рынка?

- а) курс акций региональных компаний;
- б) численность и половозрастная структура населения;
- в) дизайн упаковки локальных товаров;
- г) система мотивации персонала.

2. Какой метод регионального прогнозирования основан на том, что экспортная база региона является драйвером роста локальных рынков?
- а) нормативный метод;
  - б) метод экономической базы;
  - в) балансовый метод;
  - г) метод экстраполяции.
3. Какая ошибка возникает при игнорировании региональной дифференциации и использовании среднероссийских показателей?
- а) ошибка выжившего;
  - б) ошибка «средней температуры по больнице»;
  - в) ошибка подтверждения;
  - г) ошибка планирования.
4. Прогноз какого регионального показателя напрямую определяет спрос на рынке жилья?
- а) прогноз налоговых поступлений;
  - б) прогноз инфляции;
  - в) прогноз ввода жилья и миграции населения;
  - г) прогноз курса валюты.
5. Какие официальные документы региона являются важнейшим источником прогнозной информации для бизнеса?
- а) внутренние приказы губернатора;
  - б) стратегии социально-экономического развития региона;
  - в) уставы муниципальных образований;
  - г) протоколы заседаний правительства региона.

#### Открытые вопросы

1. Опишите механизмы трансляции региональных демографических прогнозов в рыночную конъюнктуру (на примере двух различных товарных рынков).
2. Как прогноз инвестиционной активности региона влияет на рынки строительных материалов, оборудования и B2B-услуг?
3. Почему использование среднероссийских прогнозных показателей опасно для регионального рыночного прогнозирования? Приведите конкретный пример.
4. Какие разделы региональной стратегии социально-экономического развития наиболее важны для прогнозирования спроса на товары повседневного спроса?
5. Сравните влияние на рыночную конъюнктуру трех различных региональных факторов: демографического, инфраструктурного и бюджетно-налогового.

## **Тема 5. Цели, задачи и функции стратегического прогнозирования в управлении рыночными рисками**

1. Что наиболее полно характеризует рыночный риск как объект стратегического прогнозирования?

- а) гарантированное наступление неблагоприятного события;
- б) вероятность отклонения фактических рыночных параметров от прогнозируемых значений;
- в) возможность получения сверхприбыли без угроз;
- г) фиксированный убыток, заложенный в бюджет.

2. Какая функция прогнозирования заключается в заблаговременном обнаружении зон потенциальной уязвимости?

- а) аналитическая;
- б) целеполагающая;
- в) предупредительная;
- г) оценочная.

3. Какой метод предполагает оценку устойчивости стратегии при экстремальных значениях рыночных параметров?

- а) анализ чувствительности;
- б) стресс-тестирование;
- в) имитационное моделирование;
- г) сценарный анализ.

4. Какая когнитивная ошибка заключается в систематическом оптимизме при оценке сроков и затрат?

- а) ошибка самоуверенности;
- б) ошибка подтверждения;
- в) ошибка доступности;
- г) ошибка планирования.

5. Какой вид риска относится к рыночным рискам?

- а) пожарный риск на складе;
- б) конкурентный риск;
- в) кадровый риск;
- г) технический риск.

### **Открытые вопросы**

1. Перечислите не менее пяти видов рыночных рисков, управление которыми требует стратегического прогнозирования. Дайте краткую характеристику каждого.

2. Опишите последовательность этапов интеграции прогнозирования в процесс управления рыночными рисками.

3. В чем отличие стресс-тестирования от анализа чувствительности? Приведите примеры применения каждого метода.

4. Какие когнитивные искажения наиболее опасны при прогнозировании рыночных рисков? Опишите способ коррекции каждого искажения.

5. Что такое метод Монте-Карло? Как он применяется для прогнозирования распределения вероятностей рыночных результатов?

### **Тема 6. Прогнозирование рыночной динамики: спрос, предложение, цены и поведение конкурентов**

1. Какая модель прогнозирования спроса описывает распространение нового продукта через новаторов и последователей?

- а) модель Хольта-Уинтерса;
- б) модель Басса;
- в) модель скользящей средней;
- г) модель регрессии.

2. Что из перечисленного относится к факторам динамики рыночного предложения?

- а) доходы потребителей;
- б) производственные мощности;
- в) потребительские предпочтения;
- г) сезонность спроса.

3. Для какого типа рыночной структуры прогнозирование поведения конкурентов с использованием теории игр наиболее критично?

- а) совершенная конкуренция;
- б) монополия;
- в) олигополия;
- г) монопосония.

4. Какая ошибка заключается в недооценке агрессивности ответных действий конкурентов?

- а) игнорирование асимметрии реакции конкурентов;
- б) недоучет запаздываний;
- в) усреднение разнородных сегментов;
- г) экстраполяция конкурентного равновесия.

5. Что такое равновесие по Нэшу в контексте прогнозирования конкурентного поведения?

- а) ситуация, когда все игроки получают одинаковую прибыль;
- б) ситуация, когда ни один игрок не может улучшить положение, меняя стратегию в одиночку;
- в) ситуация, когда лидер рынка диктует условия всем остальным;
- г) ситуация, когда игроки договариваются о разделе рынка.

### Открытые вопросы

1. Опишите основные подходы к прогнозированию спроса: на основе временных рядов, эконометрических моделей и потребительских интенций.
2. Что такое модель диффузии инноваций Басса? Каковы ее основные параметры и как они интерпретируются?
3. Как прогнозирование поведения конкурентов в олигополии отличается от прогнозирования на рынке совершенной конкуренции?
4. Какие методы анализа публичной информации используются для прогнозирования стратегий конкурентов?
5. Опишите типовые конкурентные стратегии (ценовая война, дифференциация, следование за лидером, нишевание) и способы прогнозирования каждой из них.

### **Тема 7. Трансформация прогнозных сценариев в стратегические управленческие решения: механизмы, фильтры и процедуры имплементации**

1. Какой механизм трансформации заключается в последовательном сужении веера возможных будущих состояний рынка?
  - а) механизм приоритизации сценариев;
  - б) механизм редукции неопределенности;
  - в) механизм стратификации решений;
  - г) механизм опционного планирования.
2. Какой фильтр отсеивает сценарии, противоречащие фундаментальным ограничениям или основанные на ненадежных данных?
  - а) фильтр реализуемости;
  - б) фильтр стратегической совместимости;
  - в) фильтр достоверности;
  - г) фильтр экономической эффективности.
3. Что представляет собой стратегический опцион?
  - а) единственный безальтернативный план действий;
  - б) заранее подготовленный альтернативный план действий для определенного сценария;
  - в) финансовый инструмент для хеджирования рисков;
  - г) обязательство действовать определенным образом.
4. Какая процедура заключается в проверке устойчивости стратегии при различных сценариях, включая экстремальные?
  - а) стресс-тестирование стратегии;
  - б) анализ чувствительности;
  - в) построение дерева решений;
  - г) мониторинг триггеров.

5. Какое когнитивное препятствие выражается в неспособности руководства воспринять прогнозы, противоречащие их ментальной модели?

- а) инерция принятых решений;
- б) стратегическая слепота;
- в) конфликт интересов;
- г) ложное чувство контроля.

#### Открытые вопросы

1. Опишите три механизма трансформации прогнозных сценариев в стратегические решения (редукция неопределенности, приоритизация сценариев, стратификация решений). Приведите пример каждого.

2. Перечислите и кратко охарактеризуйте пять фильтров, через которые проходит прогнозная информация перед превращением в управленческое решение.

3. Что такое система индикаторов раннего предупреждения и триггеров? Разработайте пример для гипотетической компании.

4. Опишите процедуру «предсмертного анализа». В чем ее ценность для трансформации прогнозов в решения?

5. Какие организационные барьеры мешают эффективной трансформации прогнозов в решения? Предложите способы преодоления не менее трех барьеров.

#### Критерии и шкала оценивания на основе БРС.

КРИТЕРИИ ОЦЕНИВАНИЯ	РЕЗУЛЬТАТ В БАЛЛАХ
Дан полный, в логической последовательности развернутый ответ на поставленный вопрос, где он продемонстрировал знания предмета в полном объеме учебной программы, достаточно глубоко осмысливает дисциплину, самостоятельно, и исчерпывающе отвечает на дополнительные вопросы, приводит собственные примеры по проблематике поставленного вопроса, решил предложенные практические задания без ошибок	90-100
Дан развернутый ответ на поставленный вопрос, где обучающийся демонстрирует знания, приобретенные на лекционных и семинарских занятиях, а также полученные посредством изучения обязательных учебных материалов по курсу, дает аргументированные ответы, приводит примеры, в ответе присутствует свободное владение монологической речью, логичность и последовательность ответа. Однако допускается неточность в ответе. Решил предложенные практические задания с небольшими неточностями.	75-89
Дан ответ, свидетельствующий в основном о знании процессов изучаемой дисциплины, отличающийся недостаточной глубиной и полнотой раскрытия темы, знанием основных вопросов теории, слабо сформированными навыками анализа явлений, процессов, недостаточным умением давать	60-74

аргументированные ответы и приводить примеры, недостаточно свободным владением монологической речью, логичностью и последовательностью ответа. Допускается несколько ошибок в содержании ответа и решении практических заданий.	
Дан ответ, который содержит ряд серьезных неточностей, обнаруживающий незнание процессов изучаемой предметной области, отличающийся неглубоким раскрытием темы, незнанием основных вопросов теории, несформированными навыками анализа явлений, процессов, неумением давать аргументированные ответы, слабым владением монологической речью, отсутствием логичности и последовательности. Выводы поверхностны. Решение практических заданий не выполнено, т.е. обучающийся не способен ответить на вопросы даже при дополнительных наводящих вопросах преподавателя.	1-59

## 7. Методические материалы по освоению дисциплины (модуля)

Подготовка к лекциям.

Главное в период подготовки к лекционным занятиям – научиться методам самостоятельного умственного труда, сознательно развивать свои творческие способности и овладевать навыками творческой работы. Для этого необходимо строго соблюдать дисциплину учебы и поведения. Четкое планирование своего рабочего времени и отдыха является необходимым условием для успешной самостоятельной работы. В основу его нужно положить рабочие программы изучаемых в семестре дисциплин. Каждому обучающемуся следует составлять еженедельный и семестровый планы работы, а также план на каждый рабочий день. С вечера всегда надо распределять работу на завтрашний день. В конце каждого дня целесообразно подводить итог работы: тщательно проверить, все ли выполнено по намеченному плану, не было ли каких-либо отступлений, а если были, по какой причине это произошло. Нужно осуществлять самоконтроль, который является необходимым условием успешной учебы. Если что-то осталось невыполненным, необходимо изыскать время для завершения этой части работы, не уменьшая объема недельного плана.

Самостоятельная работа на лекции.

Слушание и запись лекций – сложный вид вузовской аудиторной работы. Внимательное слушание и конспектирование лекций предполагает интенсивную умственную деятельность обучающегося. Краткие записи лекций, их конспектирование помогает усвоить учебный материал. Конспект является полезным тогда, когда записано самое существенное, основное и сделано это самим обучающимся. Не надо стремиться записать дословно всю лекцию. Такое «конспектирование» приносит больше вреда, чем пользы. Запись лекций рекомендуется вести по возможности собственными формулировками. Желательно запись осуществлять на одной странице, а следующую оставлять для проработки учебного материала самостоятельно в домашних условиях. Конспект лекции лучше подразделять на пункты, параграфы, соблюдая красную строку.

Этому в большой степени будут способствовать пункты плана лекции, предложенные преподавателям. Принципиальные места, определения, формулы и другое следует сопровождать замечаниями «важно», «особо важно», «хорошо запомнить» и т.п. Можно делать это и с помощью разноцветных маркеров или ручек. Лучше если они будут собственными, чтобы не приходилось просить их у однокурсников и тем самым не отвлекать их во время лекции. Целесообразно разработать собственную «маркографию» (значки, символы), сокращения слов. Не лишним будет и изучение основ стенографии. Работая над конспектом лекций, всегда необходимо использовать не только учебник, но и ту литературу, которую дополнительно рекомендовал лектор. Именно такая серьезная, кропотливая работа с лекционным материалом позволит глубоко овладеть знаниями.

#### Подготовка к практическим занятиям.

Подготовку к каждому практическому занятию каждый обучающийся должен начать с ознакомления с планом практического занятия, который отражает содержание предложенной темы. Тщательное продумывание и изучение вопросов плана основывается на проработке текущего материала лекции, а затем изучения обязательной и дополнительной литературы, рекомендованную к данной теме. На основе индивидуальных предпочтений обучающемуся необходимо самостоятельно выбрать тему доклада по проблеме практического занятия и по возможности подготовить по нему презентацию. Если программой дисциплины предусмотрено выполнение практического задания, то его необходимо выполнить с учетом предложенной инструкции (устно или 10 письменно). Все новые понятия по изучаемой теме необходимо выучить наизусть и внести в глоссарий, который целесообразно вести с самого начала изучения курса. Результат такой работы должен проявиться в способности обучающегося свободно ответить на теоретические вопросы практического занятия, его выступлении и участии в коллективном обсуждении вопросов изучаемой темы, правильном выполнении практических заданий и контрольных работ.

#### Структура практического занятия:

В зависимости от содержания и количества отведенного времени на изучение каждой темы может практическое занятие состоять из четырех-пяти частей:

1. Обсуждение теоретических вопросов, определенных программой дисциплины.
2. Доклад и/ или выступление с презентациями по проблеме практического занятия.
3. Обсуждение выступлений по теме – дискуссия.
4. Выполнение практического задания с последующим разбором полученных результатов или обсуждение практического задания, выполненного дома, если это предусмотрено программой.

## 5. Подведение итогов занятия.

Первая часть – обсуждение теоретических вопросов - проводится в виде фронтальной беседы со всей группой и включает выборочную проверку преподавателем теоретических знаний обучающихся. Примерная продолжительность – до 15 минут. Вторая часть – выступление обучающихся с докладами, которые должны сопровождаться презентациями с целью усиления наглядности восприятия, по одному из вопросов практического занятия. Обязательный элемент доклада – представление и анализ статистических данных, обоснование социальных последствий любого экономического факта, явления или процесса. Примерная продолжительность – 20-25 минут. После докладов следует их обсуждение – дискуссия. В ходе этого этапа практического занятия могут быть заданы уточняющие вопросы к докладчикам. Примерная продолжительность – до 15-20 минут. Если программой предусмотрено выполнение практического задания в рамках конкретной темы, то преподавателями определяется его содержание и дается время на его выполнение, а затем идет обсуждение результатов. Если практическое задание должно было быть выполнено дома, то на практическом занятии преподаватель проверяет его выполнение (устно или письменно). Примерная продолжительность – 15-20 минут. Подведением итогов заканчивается практическое занятие. Обучающимся должны быть объявлены оценки за работу и даны их четкие обоснования. Примерная продолжительность – 5 минут.

## Работа с литературными источниками.

В процессе подготовки к практическим занятиям, обучающимся необходимо обратить особое внимание на самостоятельное изучение рекомендованной учебно-методической (а также научной и популярной) литературы. Самостоятельная работа с учебниками, учебными пособиями, научной, справочной и популярной литературой, материалами периодических изданий и Интернета, статистическими данными является наиболее эффективным методом получения знаний, позволяет значительно активизировать процесс овладения информацией, способствует более глубокому усвоению изучаемого материала, формирует у обучающихся свое отношение к конкретной проблеме. Более глубокому раскрытию вопросов способствует знакомство с дополнительной литературой, рекомендованной преподавателем, что позволяет обучающимся проявить свою индивидуальность в рамках выступления на занятиях, выявить широкий спектр мнений по изучаемой проблеме.

## **8. Учебная литература и ресурсы информационно-телекоммуникационной сети Интернет**

### 8.1. Основная литература

1. Турун, П. П. Стратегическое планирование и прогнозирование: курс лекций : учебное пособие / П. П. Турун. — Ставрополь : СКФУ, 2021. — 207 с. — Текст : электронный // Лань : электронно-библиотечная система. — URL: <https://e.lanbook.com/book/386678>. — Режим доступа: для авториз. пользователей.

2. Саталкина, Н. И. Прогнозирование и планирование экономики : учебное пособие / Н. И. Саталкина, Ю. О. Терехова, Г. И. Терехова. — Тамбов : ТГТУ, 2018. — 154 с. — ISBN 978-5-8265-1991-2. — Текст : электронный // Лань : электронно-библиотечная система. — URL: <https://e.lanbook.com/book/319757> — Режим доступа: для авториз. пользователей.

3. Саталкина, Н. И. Прогнозирование и планирование экономики : учебное пособие / Н. И. Саталкина, Ю. О. Терехова, Г. И. Терехова. — Тамбов : ТГТУ, 2018. — 154 с. — ISBN 978-5-8265-1991-2. — Текст : электронный // Лань : электронно-библиотечная система. — URL: <https://e.lanbook.com/book/319757> — Режим доступа: для авториз. пользователей.

## 8.2. Дополнительная литература

1. Щепакин, М. Б. Прогнозирование и планирование деятельности на предприятии : учебник / М. Б. Щепакин. — Краснодар : КубГТУ, 2020. — 367 с. — ISBN 978-5-8333-0959-9. — Текст : электронный // Лань : электронно-библиотечная система. — URL: <https://e.lanbook.com/book/167041>. — Режим доступа: для авториз. пользователей.

2. Юсупова, И. В. Стратегическое планирование : учебное пособие / И. В. Юсупова. — Казань : КНИТУ-КАИ, 2025. — 144 с. — ISBN 978-5-7579-2743-5. — Текст : электронный // Лань : электронно-библиотечная система. — URL: <https://e.lanbook.com/book/506818>. — Режим доступа: для авториз. пользователей.

## 8.3. Нормативные правовые документы и иная правовая информация

1. Федеральный закон от 28.06.2014 № 172-ФЗ «О стратегическом планировании в Российской Федерации».

2. Постановление Правительства РФ от 14.11.2015 № 1238 «О порядке разработки прогноза социально-экономического развития РФ».

3. Приказ Росстата от 31.12.2021 № 945 «Об утверждении официальной статистической методологии прогнозирования социально-экономических показателей» (и аналогичные ведомственные приказы).

## 8.4. Интернет-ресурсы

<http://ecsocman.hse.ru>

<https://cyberleninka.ru/>

<https://e.lanbook.com>

## **5. Материально-техническая база, информационные технологии, программное обеспечение и информационные справочные системы**

Требования к аудитории:

- Лекционные
- Семинарские
- Помещения для самостоятельной работы

Требования к оборудованию:

- Доска
- проектор
- ПК (стационарный) или ноутбук: операционная система: не ниже

Windows 7 (или аналогичная по функциям)

Требования к программному обеспечению:

- пакет Microsoft Office