

01.08.2017

Сезонно скорректированные статистические ряды

Макроэкономическая статистика внутригодовых изменений является важным инструментом анализа эволюции экономических процессов, обоснования экономической политики и разработки прогнозов. Однако, зачастую статистические данные зависят от сезонных колебаний или других эффектов, маскирующих изменения динамического ряда и затрудняющих четкое понимание экономических явлений. По этим причинам, некоторые статистические ряды подлежат сезонной корректировке с целью исключения влияния обычных сезонных колебаний и типичных календарных эффектов.

В интерактивной базе данных представлены результаты сезонной корректировки квартальных статистических рядов основных компонентов текущего счета платежного баланса: торговли товарами и услугами, оплаты труда работников, личных переводов. Сезонной корректировке подверглись также ежемесячные данные о переводах денежных средств из-за границы в пользу физических лиц.

Сезонная корректировка была выполнена с использованием приложения JDEMETRA+, версия 2.1.0, с применением метода X-13 ARIMA.

Основными предметами оценки являются:

- тренд (основная тенденция временного ряда, которая соответствует систематическим и фундаментальным изменениям, присущим определённому показателю в течение длительного периода времени);
- влияние сезонной составляющей (влияние тех событий, которые происходят ежегодно в одно и то же время, в одинаковом масштабе и с одинаковой направленностью);
- календарный эффект (эффект, не имеющий стабильного распределения в течении года, вызванный календарными расхождениями от года к году);
- нерегулярная компонента (демонстрирует те эффекты, которые в отсутствие дополнительной информации считаются непредсказуемыми с точки зрения времени возникновения, области охвата и продолжительности).


Оценка календарного эффекта основана на анализе влияния праздничных нерабочих дней в Республике Молдова [Ст.111 п. (1) Трудового кодекса Республики Молдова].

Предпочтение было отдано автоматическому выбору модели сезонной корректировки, но после анализа тестов нормальности, гетероскедастичности, корреляции и пр., для проблемных рядов модель корректировки выбиралась вручную. В случае выбора модели разложения, использовался мультипликативный метод, т.к. в большинстве экономических рядов отмечается наличие пропорциональности компонентов временного ряда; при этом, в некоторых случаях использовался аддитивный метод.

Отметим, что также преследовалась цель обеспечить соответствие во времени исходных и сезонно скорректированных данных.

Сезонно скорректированные временные ряды будут обновляться по мере регулярного пересмотра исходных данных..

 [Основные агрегаты текущего счёта платёжного баланса](#) ^[1]

 [Переводы денежных средств из-за границы, осуществлённые в пользу физических лиц через банковскую систему Республики Молдова](#)

[2]

Смотрите также

Метки

[Сезонная корректировка](#) ^[3]

[тренд](#) ^[4]

[сезонные колебания](#) ^[5]

Источник УРЛ:

<http://bnm.md/ru/content/sezonno-skorrektirovannye-statisticheskie-ryady>

Ссылки по теме:

[1] <http://bnm.md/bdi/pages/reports/dbp/DBP5.xhtml?id=0&lang=ru>

[2] <http://bnm.md/bdi/pages/reports/dbp/DBP7.xhtml?id=0&lang=ru>

[3] [http://bnm.md/ru/search?hashtags\[0\]=Сезонная корректировка](http://bnm.md/ru/search?hashtags[0]=Сезонная%20корректировка)

[4] [http://bnm.md/ru/search?hashtags\[0\]=тренд](http://bnm.md/ru/search?hashtags[0]=тренд)

[5] [http://bnm.md/ru/search?hashtags\[0\]=сезонные колебания](http://bnm.md/ru/search?hashtags[0]=сезонные%20колебания)