Publicat pe (https://www.bnm.md)

01.08.2017

Serii statistice ajustate sezonier

Statisticile macroeconomice infraanuale reprezintă un instrument esenţial în analiza evoluţiei proceselor economice, argumentarea politicilor economice, elaborarea de pronosticuri. Însă, deseori aceste statistici sunt influenţate de fluctuaţiile sezoniere şi alte efecte, care pot masca unele mişcări ale seriei şi împiedică înţelegerea clară a fenomenului economic. În consecinţă, o multitudine de serii statistice sunt supuse ajustării sezoniere, care are ca scop eliminarea fluctuaţiilor sezoniere obişnuite, precum şi a efectelor de calendar tipice.

În baza de date interactivă sunt prezentate rezultatele ajustării sezoniere pentru seriile trimestriale ale principalelor componente din contul curent al balanţei de plăţi: comerţul cu bunuri şi servicii, compensarea pentru muncă, transferurile personale. De asemenea, au fost supuse ajustării sezoniere şi seriile lunare ale transferurilor de mijloace băneşti din străinătate efectuate în favoarea persoanelor fizice.

Ajustarea sezonieră a fost efectuată utilizând aplicația JDEMETRA+, versiunea 2.2.0, metoda X-13 ARIMA.

Principale estimări realizate sunt:

- trendul (tendinţa generală, de lungă durată ce corespunde unei evoluţii, mişcări sistematice, fundamentale, sesizabile pe perioade lungi);
- efectul componentei sezoniere (evenimente care se întâmplă în acelaşi moment, cu aceeaşi magnitudine şi direcţie în fiecare an);
- efectul de calendar (efect care nu are o distribuire anuală stabilă în timp, fiind provocat de divergenţe calendaristice de la an la an);
- componenta iregulară (efectele care în lipsa informaţiei suplimentare sunt considerate imprevizibile din punctul de vedere al timpului de apariţie, suprafeţei de acoperire şi duratei).

Estimarea efectului de calendar s-a bazat pe analiza influenţei zilelor de sărbătoare nelucrătoare din Republica Moldova [Art. 111 al. (1) din Codul muncii al Republicii Moldova].

S-a optat pentru selecţia automată a modelului de ajustare sezonieră, însă în urma analizei testelor de normalitate, heteroscedasticitate, corelaţie etc., pentru seriile cu probleme, modelul de ajustare a fost ales manual. În cazul alegerii schemei de descompunere s-a optat pentru cea multiplicativă, deoarece în majoritatea seriilor economice se atestă existenţa unei relaţii de proporţionalitate a componentelor seriei, însă în unele cazuri a fost folosită metoda aditivă.

De menţionat că s-a urmărit şi consistenţa în timp între datele iniţiale şi cele ajustate sezonier.

Revizuirea regulată a seriilor brute de date va implica şi revizuirea seriilor ajustate sezonier.

Principalele agregate ale contului curent al balanţei de plăţi [1];

Transferurile de mijloace băneşti din străinătate în favoarea persoanelor fizice efectuate prin sistemul bancar naţional [2].

Tag-uri

Ajustare sezonieră [3]

fluctuaţii sezoniere [4]

trend [5]

Sursa URL:
https://www.bnm.md/ro/content/serii-statistice-ajustate-sezonier

Legături conexe:

[1] https://www.bnm.md/bdi/pages/reports/dbp/DBP21.xhtml?id=0&lang=ro [2] https://www.bnm.md/bdi/pages/reports/dbp/DBP7.xhtml?id=0&lang=ro [3] https://www.bnm.md/ro/search?hashtags[0]=Ajustare sezonieră [4] https://www.bnm.md/ro/search?hashtags[0]=fluctuaţii sezoniere [5] https://www.bnm.md/ro/search?hashtags[0]=trend