Опубликован на (https://www.bnm.md)

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: торговля товарами и услугами, оплата труда работников, личные трансферты. 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 2.2.0, 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]

Метки

Сезонная корректировка [3]

тренд [4]

сезонные колебания [5]

Источник URL:
https://www.bnm.md/ru/content/sezonno-skorrektirovannye-statisticheskie-ryady

Ссылки по теме:

[1] https://www.bnm.md/bdi/pages/reports/dbp/DBP21.xhtml?id=0&lang=ru [2] https://www.bnm.md/bdi/pages/reports/dbp/DBP7.xhtml?id=0&lang=ru [3] https://www.bnm.md/ru/search?hashtags[0]=Сезонная корректировка [4] https://www.bnm.md/ru/search?hashtags[0]=тренд [5] https://www.bnm.md/ru/search?hashtags[0]=сезонные колебания