



Семинар ЕЭК ООН по Сезонной корректировке
20 – 23 февраля 2012г., Анкара, Турция

Вопросы для обсуждения на семинаре по Сезонной корректировке

Ану Пелтола
Экономический отдел статистики, ЕЭК ООН



Программа наращивания потенциала в области экономической статистики



- ❖ ЕЭК ООН организует при поддержке
Мирового Банка:
 - **Семинар I** – КЭС и корректировка на сезонные колебания, 14-17 марта 2011 г., Астана
 - **Семинар II** – Трудности расчета индекса потребительских цен, 10-13 Октябрь 2011 г., Стамбул
 - **Семинар III** – Осуществление СНС 2008 года, 29 Ноября - 2 Декабря 2011 г., Киев
 - **Семинар IV** – по Сезонной корректировке 20 – 23 февраля 2012г., Анкара

Вопросы для обсуждения на семинаре

- ❖ Четыре основные темы для этого семинара:
 1. Использование календаря и регрессоров
 - > точность
 2. Совершенствование сезонных корректировок
 - > качество
 3. Как понять диагностику качества
 - > знания
 4. Публикация сезонно скорректированных данных
 - > читабельность

Использование календаря и регрессоров

- ❖ Каково влияние календарных эффектов на оценку экономической деятельности?
- ❖ Как пошагово определить национальный календарь?
- ❖ Как убедиться в том, что календарь был правильно задан в Demetra+?
- ❖ Как проанализировать пригодность календаря?
- ❖ Как соединить национальный календарь с встроенными календарными переменными?

Совершенствование сезонных корректировок

- ❖ Как усовершенствовать качество первой корректировки на сезонные колебания? Например, если я получу плохие или нежелательные результаты.
- ❖ Как исправить неверные спектральные сезонные пики?
- ❖ Как выбрать между спецификациями (RSA0-RSA5)?
Подробное объяснение опций.
- ❖ Как создать свою собственную спецификацию?
- ❖ Как убедиться в том, что результаты верны и правильно истолкованы? Как избежать ошибок?
- ❖ Нужно ли нам проводить корректировку резко отклоняющихся значений или неправильного компонента перед проведением корректировки на сезонные колебания?

Как понять диагностику качества

- ❖ Как считывать и понимать результаты?
- ❖ Что означают эти понятия: неправильный компонент, Тренд-Цикл – модель ARIMA?
- ❖ Более подробная информация по анализу остаточных величин
- ❖ Влияют ли резко отклоняющиеся значения на конечные результаты?
- ❖ Когда результаты считаются сомнительными?
 - Когда уровень нестабильности слишком высок?
 - Когда важна сезонность?
 - При наличии небольших спектральных вершин по остаточным величинам?
 - В случае гипотетической автокорреляции рядов, скорректированный с учетом сезонных изменений?

Как понять диагностику качества – Специфические проблемы

- ❖ Значение статистики Фридмана?
- ❖ Отсутствие авторегрессивного спектрального графика по остаточным величинам
- ❖ Новое среднее отклонение нерегулярного компонента меньше отклонения сезонного компонента?
- ❖ Спектральные сезонные вершины двусмысленны
- ❖ Коэффициент эксцесса и нормальность выделены желтым цветом? Асимметрия?
- ❖ $D+$ не осуществляет оценку нелинейности – почему?
- ❖ Как интерпретировать прямую линию в соотношении $S-I$?
- ❖ Как объяснить нулевую точку при испытании автокорреляцию?
- ❖ Кривая графика сезонных колебаний построена нечетко
- ❖ Нет графиков для спектрального анализа остаточных величин – почему?
- ❖ Статистика Льюнга-Бокса и Бокса-Пирса выявляет сезонные колебания в остаточных величинах
- ❖ Специфика квартальных данных

Публикация сезонно скорректированных данных

- ❖ Пользователи не понимают значения корректировки на сезонные колебания – могут прийти в замешательство
- ❖ Требуются метаданные и объяснения
- ❖ Как документально доказывать проведение корректировки на сезонные колебания?
- ❖ Как опубликовывать результаты?
- ❖ Как объяснить изменения, вызванные применением скорректированной модели? Требуется политика пересмотра
- ❖ Должны ли мы сохранять соответствие между показателями цен и объема? Как насчет прямой/косвенной корректировки?
- ❖ Каких руководящих принципов необходимо придерживаться при опубликовании данных?

Agenda

Понедельник, 20 февраля 2012г.

❖ Сессия 1

Выводы по исследованиям вопросов сезонной корректировки

- Вопросы для обсуждения на семинаре
- Краткие выводы по исследованиям вопросов сезонной корректировки

❖ Первый набор исследований

- Армения, Азербайджан, Монголия и Украина

❖ Сессия 2

Использование календаря и регрессоров

- Влияние эффектов календаря
- Построение календарных регрессоров и использование календарного модуля

❖ Упражнение

- Constructing calendar regressors and refining regressors in Demetra+

Agenda

Вторник, 21 февраля 2012г.

❖ Сессия 3

Совершенствование сезонных корректировок

- Как выбрать идеальный набор регрессоров и спецификаций
- Примеры проблемных временных рядов

❖ Второй набор исследований

- Беларусь x 2, Казахстан and Молдова

❖ Экскурсия по городу

❖ Упражнения:

- Реальные примеры и анализ диагностики

Agenda

Среда, 22 февраля 2012г.

❖ Сессия 4

Как понять диагностику качества

- Обзор основных диагностик качества
- Как читать диагностику и как улучшить результаты по ним?

❖ Третий набор исследований

- Грузия, Кыргызстан, Россия, Таджикистан

❖ Сессия 5

Публикация сезонно скорректированных данных

- Документация внутренняя и пользователя
- Публикация сезонно скорректированных данных и примеры

❖ Работа в группах

- Составление публикации данных с сезонной корректировкой

Agenda

Четверг, 23 февраля 2012г.

❖ Сессия 6

К политике сезонной корректировки и пересмотра

- Результаты работы в группах
- К политике сезонной корректировки

❖ Сессия 7

Советы по качеству

- Вопросы и отзывы участников
- Советы – по вопросам улучшения качества

❖ Закрытие семинара