
Семинар ЕЭК ООН по корректировке сезонных колебаний
20 - 23 февраля 2012 года, Анкара, Турция



Календарные эффекты

Ану Пелтола
Отдел экономической статистики, ЕЭК ООН

Краткий обзор

- ❖ Значение календарных эффектов
- ❖ Причины календарных эффектов
- ❖ Типы календарных эффектов
- ❖ Причины календарных коррекций
- ❖ Проблематичные вопросы использования календаря

Календарный эффект

- = любые экономические явления, связанные с календарем
- ❖ Сезонная компонента включает **сезонные** и **календарные** эффекты
 - ❖ Они удаляются перед выполнением сезонной корректировки
 - ❖ К ним относятся:
 - Количество различных дней в месяце
 - Операционные дни (рабочие / нерабочие, 6 предикторов)
 - Государственные и скользящие праздники (указываются пользователем)
 - Високосный год
 - ❖ Могут менять уровень деловой активности

Причины календарных эффектов

- ❖ Деятельность человека состоит из циклов:
 - 24-часовые чередования дней
 - Еженедельные выходные дни
 - Праздничные периоды
 - Традиционное поведение, связанное с календарем
- ❖ Эти социальные привычки и ритм жизни также приводят к сезонности
 - Разные привычки летом и зимой
 - ◆ Эти изменения отражаются сезонной компонентой

Корректировка на операционные/рабочие дни

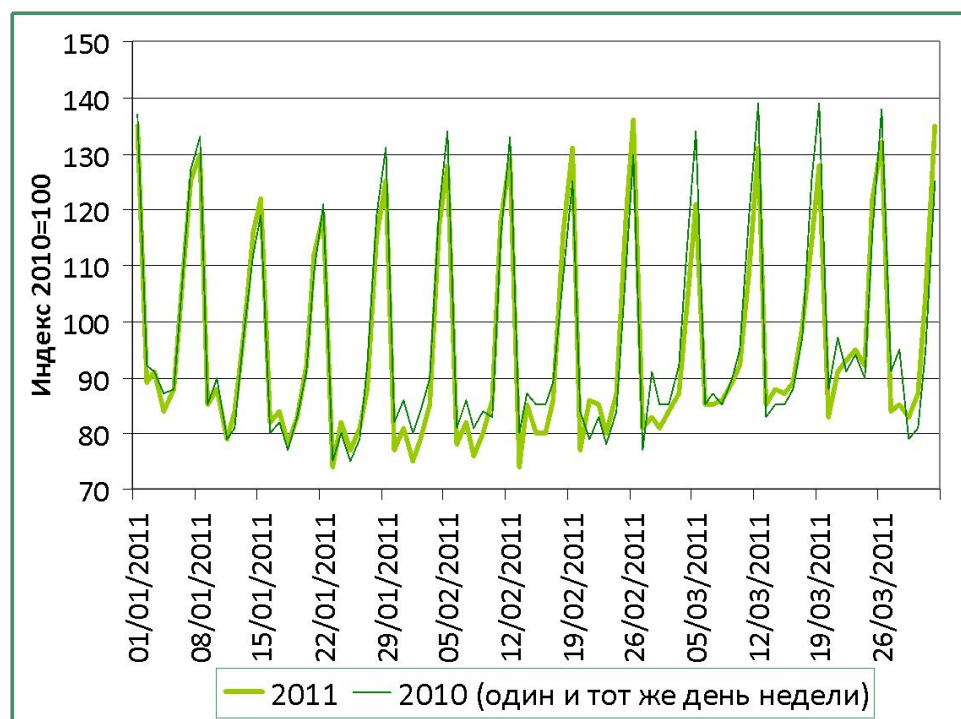
- ❖ Устраняют то несезонное календарное воздействие на динамический ряд, по которому имеется статистическое доказательство и экономическое объяснение
- ❖ Четыре возможности:
 - Количество различных дней в месяце
 - Операционные дни (рабочие / нерабочие, 6 предикторов)
 - Государственные и скользящие праздники (указываются пользователем)
 - Високосный год
- ❖ Предварительная проверка на наличие этих воздействий.
- ❖ Если операционные дни значительны:
 - Добавление переменной праздничных дней значительно улучшает результаты!

Эффект рабочих дней

- ❖ Объем производства может быть ниже по субботам и воскресеньям, чем в будние дни
- ❖ Уровень активности в определенный месяц будет выше, если месяц содержит больше будних дней
 - Эффект рабочих дней
- ❖ Иногда количество будних дней совершенно не влияет на уровень деловой активности, например, когда заводы работают посменно каждый день.

Эффект операционных дней

- = разность между днями недели
- ❖ Уровень измеряемой деятельности варьируется в зависимости от дня недели
- ❖ Различные дни могут иметь разные веса



Скользящие праздничные дни

- = Воздействие на динамические ряды праздничных дней, которые являются скользящими из года в год
- ❖ Примеры скользящих праздничных дней:
 - Пасха
 - Новый год по восточному календарю – где точная дата определяется лунными циклами
 - Рамазан
 - ❖ Должны быть добавлены пользователем Деметра +

Переходящие праздники

- ❖ В апреле 2008г. было на три дня больше рабочих дней, чем в апреле 2007г.
- ❖ Пасха не выпала на апрель 2008г.
- ❖ Без какой-либо корректировки, промышленное производство выросло на 8 процентов
- ❖ Рост, скорректированный на рабочие дни, 5%

Темпы роста (апрель 2008г.)		
	с апреля 2007г.	с марта 2008г.
Исходный ряд	8.1	-
Ряд, скорректированный на рабочие дни	5.1	-
Ряд, скорректированный на сезонные колебания	-	1.2

Государственные праздники

- ❖ Влияют на количество рабочих дней
- ❖ Использование списка государственных праздников очень важно для хорошего качества корректировки
- ❖ Улучшение оценки календарной составляющей
- ❖ Компенсационный праздник = представляют собой дополнительные праздничные дни, иногда объявляемые при выпадении государственного праздника на выходной день
- ❖ Должны быть добавлены пользователем в Demetra+

Эффект високосного года

- ❖ Эффект високосного года добавляет один день каждые четыре года
- ❖ Этот день может быть либо рабочим днем, либо он может выпасть на выходной день
- ❖ Demetra+ проверит на эффект високосного года и использует регрессионные переменные, только если эффект является значительным

Корректировка на операционные/рабочие дни

- ❖ Цель – получение сезонно скорректированного ряда, независимых от состава дней в месяце
 - При корректировке рабочих дней – дни равны
- ❖ Улучшает качество сезонной корректировки!
- ❖ Легче обнаружить скрытое развитие
- ❖ Используйте регрессионные переменные, только если эффекты являются значительным
- ❖ Использование списка государственных праздников очень важно!

Проблематичные вопросы использования календаря

- ❖ Изменения в регулярных национальных праздниках
 - Отмененные праздники – новые праздники
- ❖ Региональные различия в календаре праздников для страны
- ❖ Комплексный набор переходящих праздников
- ❖ Чрезмерное использование компенсационных праздников
- ❖ Изменения длительности праздников
- ❖ Совмещение национальных праздников с заданными корректировками календаря