

图书基本信息

书名：<<经济指数时间序列季节调整与Demetra软件的应用>>

13位ISBN编号：9787564204433

10位ISBN编号：7564204435

出版时间：2009-3

出版时间：上海财经大学出版社

作者：张鸣芳

页数：200

版权说明：本站所提供下载的PDF图书仅提供预览和简介，请支持正版图书。

更多资源请访问：<http://www.tushu007.com>

前言

2004年初,当笔者在研究居民消费价格指数动态变化时,发现一些发达国家既编制上一年同期比的经济指标,又编制经季节调整后环比的经济指标,特别是国家进行短期经济波动监控的经济指标。如美国、加拿大、澳大利亚、新西兰、欧盟各国的政府统计部门及中央银行等不仅编制、公布经季节调整的经济指标,同时也对季节调整的理论、方法进行大量深入的研究,新的方法、新的程序不断涌现。

然而,在我国,无论是政府统计机构还是银行机构等实务部门都未编制和公布任何经季节调整的经济指标。

在理论界,对经济指标时间序列季节调整的研究也凤毛麟角,查阅资料时,找不到一本专门研究时间序列季节调整的教材或论著,有关季节调整理论和方法的论文也非常稀少。

此时,正值笔者博士论文选题阶段,便萌生了以季节调整为专题研究的想法,同时选择在我国经济中具有重要地位的、资料相对容易获取的几个重要的经济指数为实证对象,确定了以“经济指数时间序列季节调整方法及其实证研究”为题撰写博士论文,并决定“抛砖引玉”出版一本专门研究季节调整理论和方法的专著。

2005年12月,博士论文答辩顺利通过,本书就是在博士论文基础上补充修改完成的。

内容概要

《经济指数时间序列季节调整与Demetra软件的应用》的章节安排和主要研究内容：第一章，阐述我国经济指数季节调整的意义；概括介绍国际上季节调整方法的发展历程和最新发展趋势；对我国有关季节调整理论与方法的研究现状和存在问题进行剖析。

第二章，季节调整的基本理论问题研究。

在研究了现代时间序列因素分解的基础上，进一步对各因素的成因进行分析；剖析时间序列分解模型的假设条件及选择依据；对基于模型的季节调整方法与基于过滤器的季节调整方法的原理进行比较。

第三章，季节调整基本技术研究。

主要对季节调整过滤器选择与平滑技术、日历相关因素的分析与测定技术、极端或异常值识别及分析技术等基本原理、基本技术等较为详细的过程分析。

第四章，季节调整的基本方法比较研究。

包括X-11季节调整方法的理论基础、方法特点及缺陷分析，X-11-ARI-MA季节调整方法的发展及应用特点分析，X-12-ARIMA季节调整方法的新特征及应用研究，TRAMO/SEATS季节调整的特征研究及与X-12-ARIMA方法的比较分析。

第五章，我国经济指数季节模式测定和季节调整的研究。

在对我国主要经济指数定基比换算的基础上，用X-12-ARIMA和TRAMO/SEATS两种方法对我国主要经济指数。

季节模式进行实证测定和分析。

通过幂等诊断、平滑间距诊断等方法对X-12-ARIMA和TRAMO/SEATS两种方法在我国的应用进行质量诊断的比较。

第六章，我国春节影响因素的季节调整研究。

分析中国移动假日春节影响估计的意义，在对目前现有的估计春节影响的方法探讨基础上，提出用引入不同区间虚拟变量的方法对我国居民消费价格指数中的春节影响因素进行估计和调整。

第七章，Demetra软件的应用。

介绍软件的基本功能，包括自动模块和详细分析模块、Demetra软件的X-12-ARI-MA方法的实现、TRAMO/SEATS的实现。

书籍目录

前言第一章 经济指数时间序列季节调整概述第一节 时间序列季节调整的基本内涵与意义探讨第二节 国际上时间序列季节调整的研究与发展第三节 我国经济指数时间序列季节调整的现状与问题第二章 时间序列季节调整的基本理论问题第一节 影响时间序列变动的因素分解及成因分析第二节 时间序列分解模型的假设条件及选择依据第三节 基于过滤器的方法与基于模型方法的原理比较第三章 时间序列季节调整的基本技术第一节 过滤器选择与平滑技术第二节 交易日影响因素的分析与测定技术第三节 异常值识别和分析技术第四章 季节调整方法的发展与比较第一节 X-11季节调整方法的基本思想、方法步骤及评价分析第二节 X-11-ARIMA季节调整方法的发展及应用特点第三节 X-12-ARIMA季节调整方法的新特征及应用研究第四节 TRAMO/SEATS季节调整方法第五章 我国经济指数季节模式测定和季节调整的实证研究第一节 我国主要经济指数季节模式测定第二节 我国主要经济指数季节调整结果分析第三节 X-12和T/S方法季节调整质量诊断的比较第六章 春节影响因素的季节调整研究第一节 春节影响因素估计的意义第二节 估计春节影响因素的方法探讨第三节 我国居民消费价格指数春节影响季节调整实证研究第七章 DEMETRA软件的应用第一节 DEMETRA软件简介第二节 季节调整方法的DEMETRA软件实现第三节 DEMETRA季节调整详细分析模块附录A我国主要经济指数定基比换算结果表附录B我国主要经济指数季节调整结果输出表(表1~表16)附录C剔除春节影响居民消费价格指数季节调整模型信息输出表、诊断输出表参考文献后记

章节摘录

第一章 经济指数时间序列季节调整概述 第一节 时间序列季节调整的基本内涵与意义探讨

尽管国际上季节调整理论与实践已走过八十多个年头，然而有关季节调整的概念却一直未有一个全球统一、明确的定义。

在探讨季节调整具体方法之前，有必要对季节调整的一些基本内涵和意义进行研究。

一、季节调整定义探讨 关于季节调整，目前国际上有较为简单的定义，也有较为详细、全面的定义。

《美国政府统计术语词典》将季节调整定义为一个过程：“季节调整是一个数学过程，经过这个过程，循环的非经济因素的影响从一个经济时间序列中被剔除。

”而1998年版的《剑桥统计词典》，则将季节调整定义为：“一个专用名词，它应用于那些一年期内周期性变动已经被剔除的时间序列。

”上述词典的简单定义，仅涉及了季节调整剔除循环季节变动的主要方面。

.....

版权说明

本站所提供下载的PDF图书仅提供预览和简介，请支持正版图书。

更多资源请访问:<http://www.tushu007.com>