

## *INDICE*

### **CAPITOLO 1 - ASPETTI GENERALI**

- 1.1 INTRODUZIONE 7
- 1.2 CHE COSA È LA DESTAGIONALIZZAZIONE E A COSA SERVE UNA SERIE DESTAGIONALIZZATA 8
- 1.3 LA PROCEDURA TRAMO-SEATS 9
- 1.4 LA STRUTTURA DELLA GUIDA 11

### **CAPITOLO 2 - TRAMO**

- 2.1 INTRODUZIONE 15
  - 2.2 L'INPUT DI TRAMO 16
    - 2.2.1 IL FORMATO DEL FILE DI INPUT 16
    - 2.2.2 ALCUNI PARAMETRI INIZIALI 17
    - 2.2.3 L'ANALISI PRELIMINARE DELLA SERIE: CORREZIONE PER EFFETTI DI REGRESSIONE. 18
      - 2.2.3.1 Gli effetti di calendario dovuti ai giorni lavorativi 18
      - 2.2.3.2 Effetto Pasqua 18
      - 2.2.3.3 La correzione dei valori anomali 19
      - 2.2.3.4 Regressori esterni 20
    - 2.2.4 L'ANALISI PRELIMINARE DELLA SERIE: TRASFORMAZIONI 22
      - 2.2.4.1 Trasformazione logaritmica 23
      - 2.2.4.2 Differenziazione 23
    - 2.2.5 L'IDENTIFICAZIONE DEL MODELLO 25
    - 2.2.6 IL PARAMETRO RSA 26
  - 2.3 L'OUTPUT DI TRAMO 27
    - 2.3.1 INTRODUZIONE 27
    - 2.3.2 DESCRIZIONE ED INTERPRETAZIONE DEL FILE DI OUTPUT. 27
    - 2.3.3 L'ANALISI DEI GRAFICI 29
  - 2.4 ESEMPIO: ANALISI DELL'INDICE GENERALE DELLA PRODUZIONE INDUSTRIALE 30
- APPENDICE: Analisi dettagliata del file IPIGNGT.OUT 34

### **CAPITOLO 3 - SEATS**

- 3.1 INTRODUZIONE 45
  - 3.2 CONSIDERAZIONI TEORICHE 46
    - 3.2.1 CENNI ALL'ANALISI SPETTRALE 46
    - 3.2.2 CENNI ALLA SCOMPOSIZIONE DELLA SERIE IN COMPONENTI NON OSSERVABILI. 48
    - 3.2.3 STIMA DELLE COMPONENTI 48
    - 3.2.4 ERRORI DI STIMA 49
  - 3.3 L'OUTPUT DI SEATS 50
    - 3.3.1 DESCRIZIONE ED INTERPRETAZIONE DEL FILE DI OUTPUT 51
      - 3.3.1.1 Parte prima: stima del modello ARIMA 51
      - 3.3.1.2 Parte seconda: derivazione dei modelli per le componenti 51
      - 3.3.1.3 Parte terza: analisi degli errori 52
      - 3.3.1.4 Parte quarta: risultati finali 52
    - 3.3.2 L'ANALISI DEI GRAFICI 53
  - 3.4 ESEMPIO: L'ANALISI DELL'INDICE GENERALE DELLA PRODUZIONE INDUSTRIALE 53
- APPENDICE: Analisi dettagliata del file IPIGNGT.OUT 56

### **CAPITOLO 4 - UTILIZZO CONGIUNTO DI TRAMO E SEATS**

- 4.1 INTRODUZIONE 81
- 4.2 SCHEMA LOGICO PER PROCEDERE ALLA DESTAGIONALIZZAZIONE MEDIANTE TRAMO-SEATS 81
  - 4.2.1 SCHEMA DI PROCEDURA PER LA DESTAGIONALIZZAZIONE 83
- 4.3 ESEMPI 84
  - 4.3.1 LA SERIE DEI NUOVI ORDINATIVI ESTERI 84
  - 4.3.2 LE SERIE DELL'OCCUPAZIONE NELLE GRANDI IMPRESE 85

**CAPITOLO 4 - UTILIZZO CONGIUNTO DI TRAMO E SEATS**

4.1	INTRODUZIONE	81
4.2	SCHEMA LOGICO PER PROCEDERE ALLA DESTAGIONALIZZAZIONE MEDIANTE TRAMO-SEATS	81
4.2.1	<i>SCHEMA DI PROCEDURA PER LA DESTAGIONALIZZAZIONE</i>	83
4.3	ESEMPI	84
4.3.1	<i>LA SERIE DEI NUOVI ORDINATIVI ESTERI</i>	84
4.3.2	<i>LE SERIE DELL'OCCUPAZIONE NELLE GRANDI IMPRESE</i>	85
4.3.3	<i>LA SERIE DELLE ESPORTAZIONI VERSO I PAESI EXTRA-UE</i>	87
4.3.4	<i>LE SERIE DEI SETTORI DELLA PRODUZIONE INDUSTRIALE</i>	88

**CAPITOLO 5 - PROBLEMI APERTI E CASI DI STUDIO**

5.1	IL PROBLEMA DELLE REVISIONI	93
5.2	L'ANALISI DI STABILITÀ DEI COEFFICIENTI	99
5.3	IL PROBLEMA DELL'AGGREGAZIONE	103
5.4	CASI DI STUDIO	107
5.4.1	<i>SCELTA DELL'INTERVALLO TEMPORALE</i>	107
5.4.2	<i>LA SCELTA DELLA TRASFORMAZIONE LOGARITMICA</i>	110
5.4.3	<i>PROBLEMI NELLA DIAGNOSTICA</i>	111
5.4.4	<i>DATI ANOMALI PROBLEMATICI</i>	113

APPENDICE:	CLASSIFICAZIONE DEI PARAMETRI DI TRAMO-SEATS PER FUNZIONE	117
------------	---	-----

BIBLIOGRAFIA	128
--------------	-----