

Inhaltsverzeichnis

Vorwort	I
Einleitung	1
I. Grundzüge der Saisonbereinigung der Deutschen Bundesbank	3
1. Begriffsgerüst	3
2. Schätzung von Saisoneinflüssen	5
3. Erkennung und Ersetzung von Extremwerten für die Saisonbereinigung	17
4. Schätzung von Kalendereinflüssen	20
5. Ablauf des Census X-11-Verfahrens	27
6. Laufende Arbeiten mit Census X-11	29
II. Neue Optionen in Census X-12-ARIMA	33
1. Aufbau von Census X-12-ARIMA	33
2. Neuer Vorabteil: RegARIMA	36
2.1. Problemstellung	36
2.2. RegARIMA-Modelle	38
2.3. Beispiel: Produktionsindex für das Bauhauptgewerbe	48
III. Auswirkungen des Übergangs von Census X-11 auf X-12-ARIMA	59
1. Schätzung von Kalendereinflüssen	59
2. Erkennung und Ersetzung von Extremwerten	66
3. Wahl von Saisonfiltern	69
4. Revisionsanalyse	78
4.1. Prognosen und Revisionen	79
4.2. Revisionen	80
4.2.1. Vorbemerkungen	80
4.2.2. Trendrevisionen	87
4.2.3. Revisionen saisonbereinigter Angaben	93
IV. Ausblick	101
Literaturverzeichnis	103

Tabellenverzeichnis

1.	Gehaltssumme in der westdeutschen Industrie Rohe Saisonfaktoren	8
2.	Umsatz im westdeutschen Bauhauptgewerbe Rohe Saisonfaktoren; X-11-Originalansatz	19
3.	Umsatz im westdeutschen Bauhauptgewerbe Rohe Saisonfaktoren; Bundesbankansatz	19
4.	Einfluß der Wochentage auf die Produktion im westdeutschen Verarbeitenden Gewerbe; Original X-11-Regressionsansatz	22
5.	Behandlung der Feiertage im Rahmen der Kalenderbereinigung	23
6.	Einfluß der Wochentage auf die Produktion im westdeutschen Verarbeitenden Gewerbe; Bundesbank-Regressionsansatz	24
7.	Einfluß der Arbeits- bzw. Wochenendtage auf die Produktion im westdeutschen Verarbeitenden Gewerbe; Bundesbank- Regressionsansatz	24
8.	Einfluß der Arbeitstage auf die Produktion im westdeutschen Verarbeitenden Gewerbe; Bundesbank-Regressionsansatz	25
9.	Näherungsweise Entsprechung von (Θ_{12}, θ_1) -Kombinationen im Airline-Modell sowie von Saison- und Trendfiltern in X-11	45
10.	Produktion im westdeutschen Bauhauptgewerbe Schätzergebnisse für ARIMA-Parameter	50

11.	Einfluß der Wochentage auf die Produktion im westdeutschen Verarbeitenden Gewerbe; RegARIMA-Schätzansatz	60
12.	Einfluß der Arbeits- bzw. Wochenendtage auf die Produktion im westdeutschen Verarbeitenden Gewerbe; RegARIMA-Schätzansatz	60
13.	Schätzergebnisse für die Kalendereffekte in Zeitreihen für Westdeutschland nach X-11-Bundesbank und RegARIMA	62
14.	Automatisch gewählte, RegARIMA-basierte und Vorgaben für Saisonfilter im Vergleich	73
15.	Durchschnittlich betragsmäßig prozentuale Abweichung der jeweils ersten von der endgültigen Trendschätzung	88
16.	Durchschnittlich betragsmäßig prozentuale Abweichung der ersten von den endgültigen saisonbereinigten Angaben	94

Abbildungsverzeichnis

1.	Gehaltssumme in der westdeutschen Industrie Ursprungswerte, saisonbereinigte Angaben und Trend	7
2.	Gehaltssumme in der westdeutschen Industrie Rohe und endgültige Saisonfaktoren	10
3.	Gehaltssumme in der westdeutschen Industrie Rohe und endgültige Saisonfaktoren für Juni bei unterschiedlicher Wahl saisonaler Glättungsfilter	12
4.	Gehaltssumme in der westdeutschen Industrie Rohe und endgültige Saisonfaktoren für Februar und März	13
5.	Umsätze des Einzelhandels Rohe und endgültige Saisonfaktoren	15
6.	X-11	28
7.	Auftragseingang aus dem Inland bei den Vorleistungs- güterproduzenten Arbeitstäglich bereinigte Reihe und Trendkurven	30
8.	X-12-ARIMA	34
9.	Produktion im westdeutschen Verarbeitenden Gewerbe Ursprungswerte, logarithmierte Ursprungswerte	40
10.	Produktion im westdeutschen Verarbeitenden Gewerbe Vorjahresveränderung der logarithmierten Ursprungswerte, Vormonatsdifferenz der Vorjahresveränderung der logarithmierten Ursprungswerte	42

11.	Produktion im westdeutschen Bauhauptgewerbe	49
12.	Produktion im westdeutschen Bauhauptgewerbe Rohe extremwertbereinigte und endgültige Saisonfaktoren für Februar; Eis- und Schneetage im Februar	52
13.	Produktion im westdeutschen Bauhauptgewerbe Saisonbereinigte Angaben	53
14.	Produktion im westdeutschen Bauhauptgewerbe Rohe extremwertbereinigte und endgültige Saisonfaktoren	55
15.	Umsätze im westdeutschen Bauhauptgewerbe Rohe extremwertbereinigte Saisonfaktoren für April	70
16.	Auftragseingang im Investitionsgütergewerbe aus dem Inland Saisonbereinigte Angaben	76
17.	Index der Ausführpreise Saisonbereinigte Angaben	77
18.	Saisonbereinigte Ergebnisse nach X-11 und X-12-ARIMA	100