



# Các thành phần của dữ liệu chuỗi thời gian

Bởi:

Phạm Trí Cao

## Các thành phần

Các thành phần chính của dữ liệu chuỗi thời gian là

Xu hướng

Chu kỳ

Thời vụ

Ngẫu nhiên

## Xu hướng dài hạn

Xu hướng dài hạn thể hiện sự tăng trưởng hoặc giảm sút của một biến số theo thời gian với khoảng thời gian đủ dài. Một số biến số kinh tế có xu hướng tăng giảm dài hạn như

Tốc độ tăng dân số của Việt Nam có xu hướng giảm.

Tỷ trọng nông nghiệp trong GDP của Việt Nam có xu hướng giảm.

Mức giá có xu hướng tăng.

## Chu kỳ

Các số liệu kinh tế vĩ mô thường có sự tăng giảm có quy luật theo chu kỳ kinh tế. Sau một thời kỳ suy thoái kinh tế sẽ là thời kỳ phục hồi và bùng nổ kinh tế, kế tiếp tăng trưởng kinh tế sẽ chững lại và khởi đầu cho một cuộc suy thoái mới. Tùy theo nền kinh tế mà chu kỳ kinh tế có thời hạn là 5 năm, 7 năm hay 10 năm.

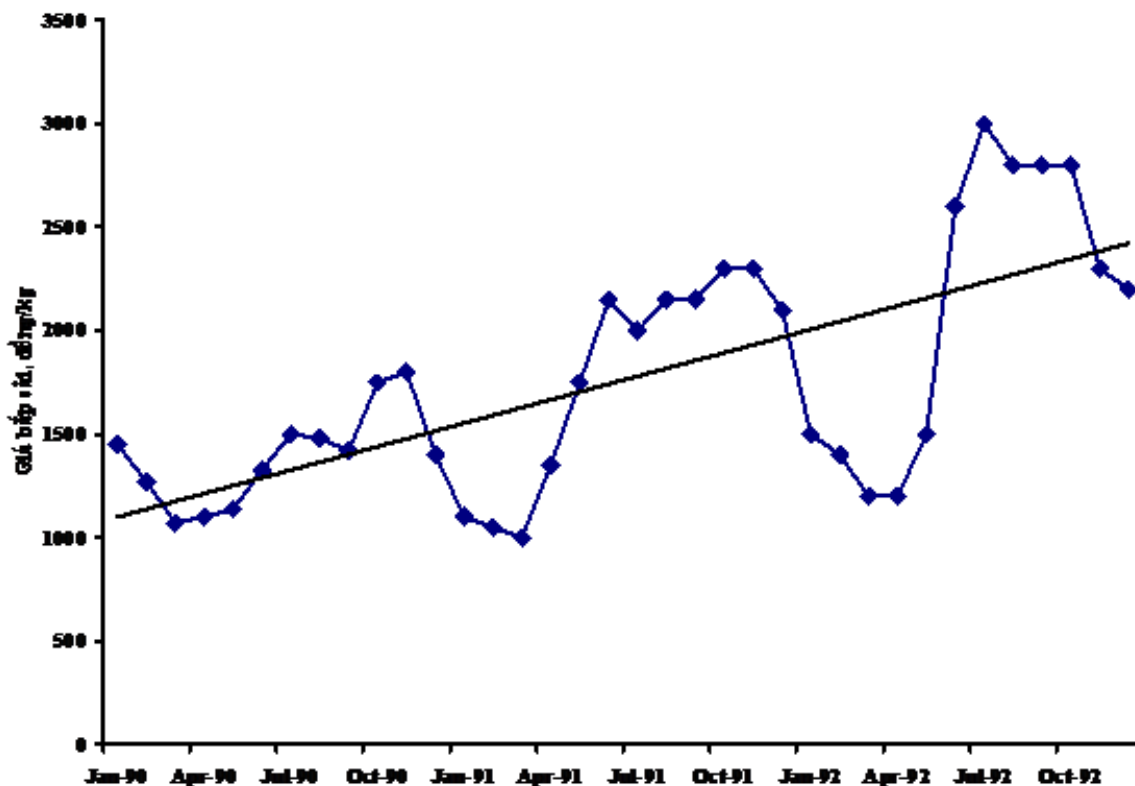
## Thời vụ

Biến động thời vụ của biến số kinh tế là sự thay đổi lặp đi lặp lại từ năm này sang năm khác theo mùa vụ. Biến động thời vụ xảy ra do khí hậu, ngày lễ, phong tục tập quán... Biến động thời vụ có tính ngắn hạn với chu kỳ lặp lại thường là 1 năm.

## Ngẫu nhiên

Những dao động không thuộc ba loại trên được xếp vào dao động ngẫu nhiên. Các nguyên nhân gây ra biến động ngẫu nhiên có thể là thời tiết bất thường, chiến tranh, khủng hoảng năng lượng, biến động chính trị...

## Xu hướng dài hạn

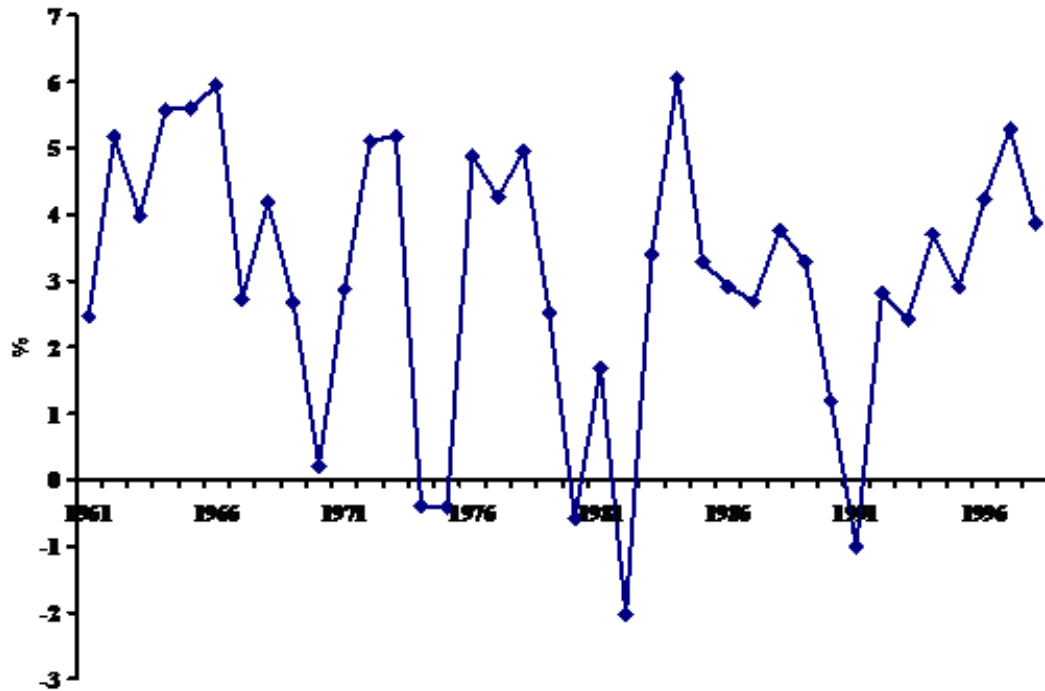


Hình 7.1. Xu hướng và thời vụ

Nguồn: Problem set 7, Analytic method for Policy Making, Chương trình Giảng dạy Kinh tế Fulbright Việt Nam 2000.

Bất thường(Ngẫu nhiên)Chu kỳ 10 năm

## Các thành phần của dữ liệu chuỗi thời gian



Hình 7.2. Chu kỳ và ngẫu nhiên-Tăng trưởng kinh tế của Hoa Kỳ giai đoạn 1961-1999.

Nguồn : World Development Indicator CD-Rom 2000, World Bank.