

ACTA DE SESIÓN No. 2 - AYUDA DE MEMORIA

Ciudad: Bogotá D.C.

Lugar: Sesión virtual, plataforma Teams

Tema: Segunda Sesión Comité de Estadísticas Estratégicas (CSEE)

Hora: 4:00 p.m. a 6:00 p.m.

Fecha: 30/08/2021

Dependencia responsable:
Secretaría Técnica (DSCN)

Participantes

Miembros (delgados) CSEE

Dr. Dr. Juan José Ospina
Subgerente de Política Monetaria e Información Económica
Banco de la República (BanRep)

Dr. Daniel Santiago Wills
Subdirector de Política Macroeconómica Ministerio de Hacienda y Crédito Público (MinHacienda)

Dr. Víctor Manuel Nieto
Subdirector de Estudios Macroeconómicos Departamento Nacional de Planeación (DNP)

Laura Pabón Alvarado, Directora de Desarrollo Social, Departamento Nacional de Planeación

Dr. Juan Daniel Oviedo Arango
Director Departamento Administrativo Nacional de Estadística (DANE)

Invitados permanentes CSEE

Banco de la República

Carlos Julio Varela
Director del Departamento Técnico y de Información Económica

Carlos Alfonso Huertas
Director del Departamento de Programación e Inflación

Celina Gaitán Maldonado
Adolfo León Cobo Serna

Ministerio de Hacienda y Crédito Público

Steven Zapata Álvarez
Subdirector Técnico de programación Macroeconómica

Departamento Administrativo Nacional de Estadística

Juan Pablo Cardoso
Director Técnico de la Dirección de Síntesis y Cuentas Nacionales (DSCN)

Nicolás Chudt
Profesional Especializado (DSCN)

Orden del día

1. Verificación del quórum
2. Presentaciones de agenda y desarrollo del plan de implementación del proceso de ajuste estacional y de calendario
3. Varios

Desarrollo

Objetivo

Desarrollar la cuarta sesión del Comité de Seguimiento a Estadísticas Estratégicas en el marco de la Resolución 0995 del 17 de junio de 2020, por la cual se regula su funcionamiento.

1. Verificación del quórum

Se verificó el quórum del Comité de Seguimiento a Estadísticas Estratégicas a cargo del Departamento Administrativo Nacional de Estadística (DANE), en cabeza de la Dirección de Síntesis Cuentas Nacionales.

Se contó con la asistencia de delegados de las cuatro entidades que conforman el comité. Respecto a

los invitados permanentes participaron los delegados del Banco de la República, del Ministerio de Hacienda y Crédito Público, del Departamento Nacional de Planeación y por parte del DANE, el director técnico de DSCN y un profesional especializado de DSCN.

2. Presentaciones de agenda y desarrollo del plan de implementación del proceso de ajuste estacional y de calendario

El director del DANE, Dr. Juan Daniel Oviedo, el director técnico de Cuentas Nacionales, JuanPablo Cardoso y el profesional especializado, Nicolás Chudt, presentaron el avance en el análisis y revisión técnica del ajuste estacional y de calendario que aplica la DSCN para las series coyunturales. Durante el inicio de la sesión, el director del DANE hizo énfasis en el compromiso del DANE en generar estadísticas que no solo siguen los lineamientos y recomendaciones internacionales, sino también, estadísticas que generen tranquilidad y transparencia a los usuarios que usan las series desestacionalizadas. Seguida a la apertura, los miembros del comité expresaron sus inquietudes sobre la temática tratada e hicieron énfasis en su intención de participar activamente en el ejercicio de revisión del proceso.

El director técnico de la DSCN para dar respuesta a las inquietudes planteadas en sesión previa por parte los miembros del comité, frente a algunos resultados obtenidos del proceso expuso los resultados de las respectivas revisiones y expresó cómo los usuarios especializados han usado con mayor frecuencia los resultados de las series desestacionalizadas producidas por la DSCN; y dada la amplia variedad de métodos de ajuste de las series, surgió la necesidad no solamente de explicar la línea de trabajo que actualmente maneja la dirección, sino también, de realizar una revisión de los modelos y parámetros empleados para el ajuste estacional y de calendario de la DSCN.

El director técnico de la DSCN especificó que el objetivo principal del ejercicio es la revisión, actualización y/o validación de los parámetros y métodos en la desestacionalización de las series en la DSCN, partiendo de las líneas establecidas por las buenas prácticas y recomendaciones internacionales, principalmente, las del manual del FMI, no sin antes reiterar la obligación que tienen las oficinas de estadística en asegurar un procedimiento para generar series desestacionalizadas a partir de mediciones consistentes, estandarizadas e imparciales y que sean un referente para que el usuario externo tenga el poder de generar o replicar sus propios resultados, bajo los lineamientos establecidos por el manual de las cuentas nacionales trimestrales del FMI.

Bajo este contexto se manifestó que lo que se espera es diseñar y aplicar un plan de implementación con los procedimientos, parámetros y demás elementos actualizados y validados para las series originales trimestrales y mensuales de las cuentas nacionales. Nicolás Chudt precisó los siguientes puntos a tener en cuenta para el plan de trabajo: i) la revisión de los procedimientos (archivos, recursos, otros) de ajuste estacional y calendario; ii) la revisión de los parámetros y los criterios usados para ajuste estacional y de calendario; iii) tener mesas de trabajo con oficinas estadísticas y entes especializados; iv) actualizar y validar las temáticas revisadas; y por último, v) incorporar e implementar

las actualizaciones donde aplique.

Por otro lado, se explicó que existen insumos especiales para este ejercicio como lo son: i) las metodologías y modelos estadísticos, ii) 300 series temporales; iii) referencias bibliográficas; iv) conclusiones de las mesas de trabajo con oficinas estadísticas y entes multilaterales (FMI). De esta manera, el ejercicio inicial que se propuso parte de tres fases: fase 1 - una revisión conceptual y procedimental (2021/05/17-2021/07/08): revisión de los procesos y procedimientos actuales, así como en diferentes referentes internacionales (FMI); fase 2 - una revisión de los parámetros del ajuste estacional (2021/07/09-2021/07/30): revisión de los procedimientos estadísticos y los criterios actuales en la DSCN para cada uno de los parámetros; y fase 3 - la implementación y actualizaciones del proceso de ajuste estacional y de calendario (2021/08/01-15/02/2022): generar una propuesta de análisis que involucre las revisiones trabajadas durante las fases previas.

En esta parte, el director del DANE realizó una intervención en la que consideró conveniente la participación de usuarios como el Banco de la República, para robustecer el análisis y que el plan de trabajo se debería complementar con aportes técnicos que los usuarios consideren necesarios. En ese punto, varios de los miembros confirmaron esta afirmación e indicaron que ellos podrían exponer varios ejercicios que existen de autoevaluación, para complementar el ejercicio. En esta instancia se generó la necesidad de crear una agenda de trabajo conjunta que materialice dichos aportes.

El profesional especializado del DANE finalizó la presentación, indicando los avances en cada fase, en la que precisó: para la fase 1 el diagnóstico inicial con el que se cuenta, el cual fue presentado a la Dirección General del DANE; las mesas de trabajo realizadas con: el Instituto Nacional de Estadística y Censos de la República Argentina (INDEC), el Banco Central de Chile y el FMI. En la Tabla 1 se exponen las conclusiones de dichas mesas. Para la fase 2, la forma de análisis de los procesos internos de la DSCN se estructuró de acuerdo con la parametrización de los modelos: transformación, modelos de regresión, identificación de outliers, estimación de SARIMA, proceso para forzar series, Método X11 versus método SEAT y desestacionalización indirecto versus directa. Por último, para la fase 3, la aplicación del plan de implementación en las series originales para la publicación de las series de cuentas nacionales.

Tabla 1: principales conclusiones de las mesas

CONCEPTO	INDEC	BANCO CENTRAL CHILE
Transform	Se acogen a los criterios del sistema (AICC test) y determinan la forma funcional.	Todas las series son transformadas a través del logaritmo natural.
Regression	Validan todas las variables regresoras (tanto de efecto calendario como por valores atípicos) con un nivel de confianza al 5 %.	Manejan nivel de confianza al 5 % o al 10 %. Incluye modelo de calendario chileno. Para el caso de los años bisiestos, el valor del coeficiente es forzado al 0.036 en las series mensuales cuando el valor está por encima.
Outlier	Ajustan las validaciones de los regresores de acuerdo con la rutina que el sistema X13Arima-seat tiene implementada.	Ajustan las validaciones de los regresores de acuerdo con la rutina que el sistema X13Arima-seat tiene implementada.

CONCEPTO	INDEC	BANCO CENTRAL CHILE
Arima/automdl	Ajustan el modelo SARIMA de acuerdo con la rutina que el sistema X13Arimaseat tiene implementada.	Corren la rutina implementada por el programa y estiman un modelo por medio de SAS para comparar y definir con que modelo se quedan.
Force	Ajustan modelo de acuerdo con la rutina que el sistema X13Arima-seat tiene implementada (Dagum-chollete y/o Denton).	Corren una rutina implementada en SAS para el ajuste por desagregación temporal (metodología Dagum- chollete).
x11	Ajustan modelo teniendo en cuenta los filtros de acuerdo con la rutina que el sistema X13Arima-seat tiene (Henderson).	Ajustan modelo teniendo en cuenta los filtros de acuerdo con la rutina que el sistema X13Arima-seat tiene (Henderson).
Método de ajuste	Indirecto: a partir de las series trimestrales desestacionalizadas de cada actividad (incluido los impuestos) agregan los datos para generar las series desestacionalizadas del PIB.	Indirecto: a partir de las series mensuales desestacionalizadas de cada actividad económica (incluido los impuestos) y del IMACEC agregan los datos para generar las series desestacionalizadas de cada actividad y la serie del PIB.
Estrategia de actualización	Método Actual: los modelos y parámetros se ajustan durante períodos de revisión específicos realizados cada vez que se produce una revisión importante de los datos originales.	Método concurrente: los modelos y parámetros se ajustan durante períodos de revisión específicos realizados cada vez que se produce una revisión importante de los datos originales.

Estas mesas contaron, además, con el acompañamiento técnico del Fondo Monetario Internacional en las sesiones del 7 y 8 de julio de 2021, cada una de 4 horas; y el asesoramiento de los expertos Martha Tovar y Jens Mehrhoff. Entre los principales puntos hablados se destacan:

- Dos temas abordados: i) la validación de los ajustes realizados por parte del DSCN en línea con las mejores prácticas internacionales y; ii) los detalles de la parametrización para la evaluación.
- La forma de realizar los ajustes estacionales con outlier. (la DSCN realiza ajustes de acuerdo con la desestacionalización directa). Los outliers sobre la marcha en 2020 fueron un ajuste parcial y estuvieron en línea con las mejores prácticas internacionales, según el FMI.
- Se discutió parte de la parametrización, la selección de los modelos, variables y demás. La explicación dada por la DSCN fue clara para el experto, sobre todo, para lo relacionado con el modelo que tiene en cuenta los días festivos en Colombia, incluido el año bisiesto y la Semana Santa.
- Celebrar reunión entre el FMI y los usuarios (BanRep), para hablar sobre el enfoque técnico de los ajustes estacionales.
- El concepto general del FMI fue favorable. La DSCN debe decidir sobre el ajuste estacional que se aplique, garantizando la calidad de la información.
- Todos los procesos y criterios de la DSCN en el proceso de ajuste estacional y de calendario fueron expuestos.
- El FMI dio visto bueno frente a los procedimientos, los cuales están en línea con las mejores prácticas internacionales.
- La DSCN expuso la inquietud sobre el resultado contra intuitivo que dio la variación anual del

PIB y la variación anual del Valor Agregado.

- El FMI dio soporte a la DSCN en el proceso de ajuste estacional y se trabajó en un ejercicio particular, por el resultado mencionado previamente.
 - Los resultados obtenidos destacan dos puntos importantes: i) el proceso y los criterios aplicados para el ajuste estacional hecho por la DSCN es correcto, pero ii) existe un ruido que afecta los resultados estacionales del PIB.
- Respecto al segundo punto, después de correr los modelos estacionales y desagregar los componentes (tendencia-ciclo, componente estacional estricto, componente de efecto calendario y componente regular) se pudo ver que los resultados cambian su significancia en lo que respecta al componente calendario.
- Desde el análisis de ajuste estacional, la serie de impuestos tiene efectos estacionales y de calendario, los cuales afectan de manera significativa los resultados de ajuste estacional del PIB.

De los temas hablados, se llegó a tres consideraciones sustanciales la primera, para los criterios de ajuste estacional, la DSCN está en línea con las buenas prácticas y no es necesaria una actualización de los métodos para las series que ajusta la dirección; segundo, no se puede identificar el calendario (Colombia) en PIB porque está escondido por el ruido que proviene de los impuestos; por ello, solo se refleja el efecto por año bisiesto; y tercero, el FMI recomendó evaluar dos opciones: i) ajustar el modelo de ajuste estacional y de calendario para la serie del PIB de acuerdo con los parámetros establecidos para el Valor Agregado; o ii) ajustar el modelo de ajuste estacional y de calendario para la serie del PIB a partir de la agregación de la serie desestacionalizada de Valor agregado más la de impuestos.

Para la fase 2, el profesional especializado expuso los resultados de cada uno de los campos de parametrización para el proceso de desestacionalización y destacó que, en principio, no se requiere de una actualización a los procesos actuales, sin que esto no impida incluir nuevos parámetros y criterios que ayuden a perfeccionar el modelo. En este punto, los miembros del comité, específicamente del Banco de la República consultaron sobre el cálculo de promedio móvil para el ajuste estacional y adicional, sobre el manejo de la discrepancia estadística para las series desestacionalizadas. En este punto, el profesional especializado se comprometió en indagar sobre el manejo que se le da en otras oficinas estadísticas, dado que, en el caso particular del DANE, las series desestacionalizadas no enfocan sus resultados en estas temáticas.

Para la fase 3, teniendo en cuenta las recomendaciones del FMI, los resultados de las mesas de trabajo con las oficinas estadísticas de INDEC y BC de Chile y tercero y las revisiones y validaciones de los procesos de ajuste estacional realizados por la DSCN se aplica el plan de implementación, el cual tendrá como fecha de ejecución para la publicación de febrero de 2022.

3. Varios

Finalmente, y para el cierre, el Dr. Carlos Julio Varela recordó el interés particular que tiene el Banco de la

República respecto a la medición de cultivos ilícitos en las cuentas nacionales, a lo que la DSCN contestó que el FMI recomienda construir una cuenta satélite para el enclave con el fin de que este tipo de actividades se pueda incorporar dentro del marco central y no como una estadística externa; también se mencionó sobre la transferencia de información a través del formato SDMX; los dos puntos quedaron como temas de revisión en una próxima sesión.

Compromisos

Coordinar reunión con el Banco de la República para que presente algunos ejercicios de validación técnica y autoevaluación que permitan complementar procesos y dar respuesta a las dudas relacionadas con el proceso de ajuste estacional y de calendario. Con esta reunión también se espera resolver en mayor detalle algunas de las observaciones realizadas en la sesión, como son el manejo del año corrido para series desestacionalizadas, la discrepancia estadística, entre otros. (responsable: DANE-DSCN y Banco de la República).

Próxima reunión

Responsable de convocar: Secretaría Técnica
DSCN

Fecha: por definir.