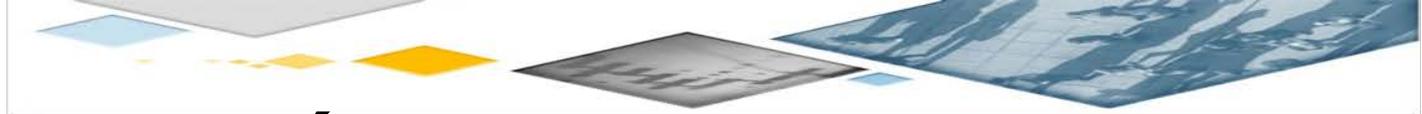


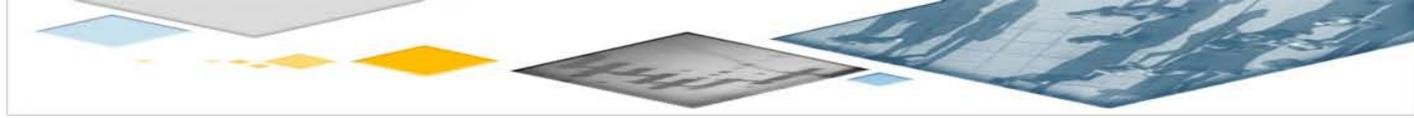
Migración y automatización en Jdemetra de los índices de coyuntura para la corrección de efectos de calendario y desestacionalización en Eustat

Logroño, Jecas 2018



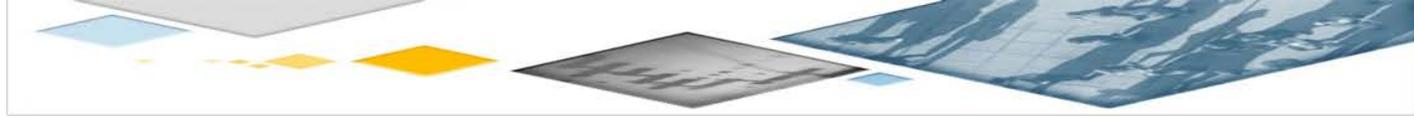
Índice

- Introducción. Tratamiento actual
- Jdemetra+
- Revisión de las series de Eustat
- Industrialización en el proceso de producción



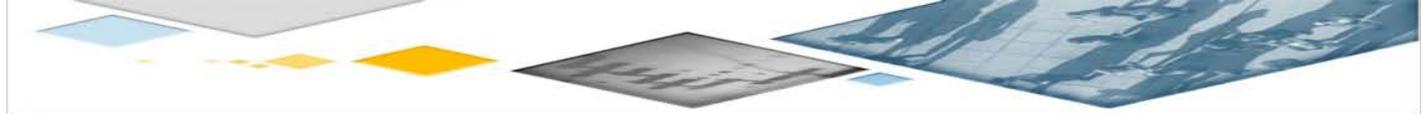
Introducción

- Actualmente se tratan cerca de 500 series mensuales ó trimestrales
- Se difunden series brutas, corregidas y desestacionalizadas
- La serie ciclo-tendencia se difunde en el gráfico interactivo que acompaña la nota de prensa



Introducción

- El tratamiento actual es mediante Tramo-Seats
- Procedimiento automático en cada período
- Utilización de calendario por territorio y específico para cada serie
- Aproximación indirecta para el agregado geográfico de la CAE como ponderación de los territorios



Introducción

- Inconvenientes del tratamiento actual:
 - Falta de revisión periódica del ajuste del modelo
 - Procedimiento no integrado en producción
 - Falta de tratamiento adecuado de outliers



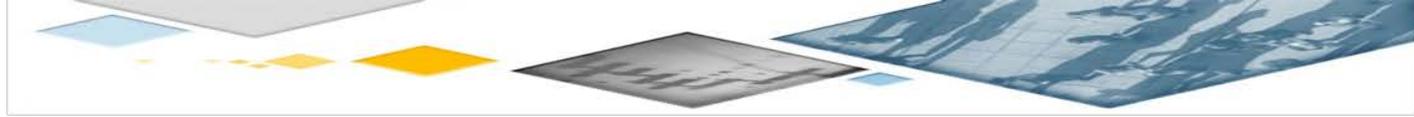
JDemetra+

- Promovido por Eurostat, en desarrollo desde 2012 por el NBB (National Bank of Belgium), antecedentes en Demetra y Demetra+
- Desde 2015 software oficial recomendado por Eurostat y el BCE
- Incorpora los métodos basados en modelos Arima de Tramo-Seats y métodos basados en medias móviles de X-13Arima-Seats



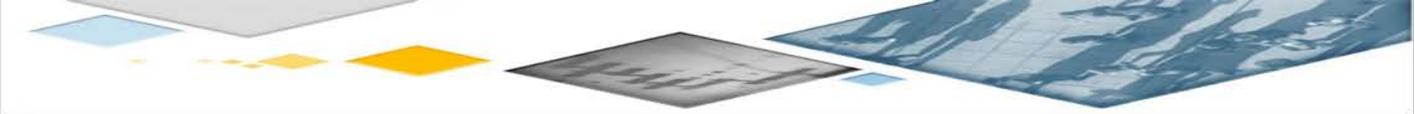
JDemetra+

- ESS guidelines for seasonal adjustment (2009, revision 2015): guía de referencia para llevar a cabo un ajuste estacional adecuado (recomendaciones)
- Handbook on seasonal adjustment (2018): manual de referencia para entender las metodologías del ajuste estacional



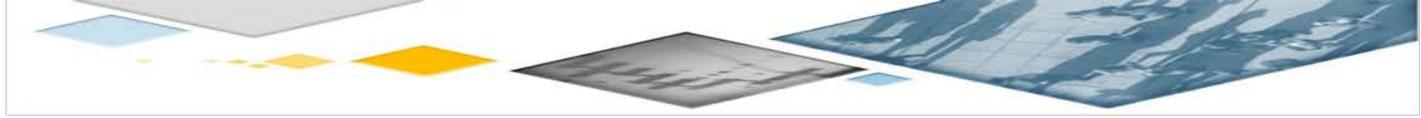
JDemetra+

- Jdemetra+ en Eustat:
 - Grupo de personas para tratamiento de series temporales
 - Curso de Dominique Ladiray (INSEE) (noviembre? 2016)
 - Curso impartido por la UPV (I. Díaz-Emparanza) en febrero de 2017
 - Curso de postgrado promovido por Eustat e impartido actualmente por la UPV durante el curso académico 2018-2019



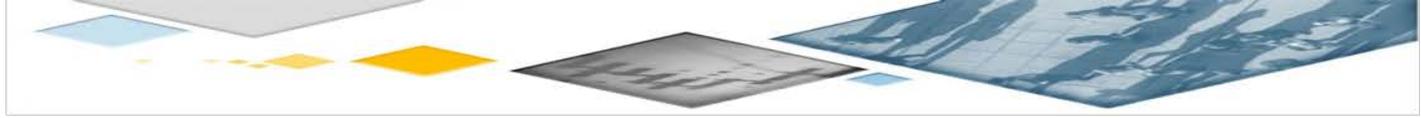
Revisión de las series de Eustat

- Contrato con la UPV durante 2018 para la revisión de todas las series de coyuntura
- Identificación del modelo para cada serie: orden del componente AR y MA, tipo de ajuste de calendario (festivos por th para cada serie), tratamiento de outliers
- Tratamiento mediante Jdemetra+ y obtención de resultados del ajuste y de los componentes de cada serie: datos corregidos y datos desestacionalizados



Revisión de las series de Eustat

- Propuesta de tratamientos y revisiones:
- Identificación del modelo una vez al año para cada serie y estimación de los parámetros con cada nuevo dato
- No hay detección de nuevos outliers en el año
- Calendarios centralizados que utiliza cada operación con fechas específicas en algunos casos



Revisión de las series de Eustat

- Mantener series corregidas y desestacionalizadas abiertas
- Aproximación indirecta en el agregado geográfico: las series de la CAE son agregadas de las de los territorios

Industrialización en el proceso de producción

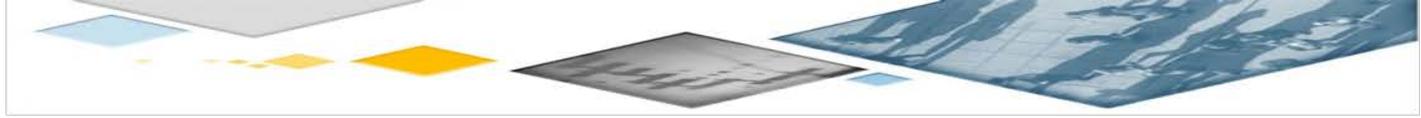
- Aprovechando el cambio de base de cada índice
- La aplicación de cada operación llamará a una macro Sas
- Esa macro Sas llamará a Jdemetra+ y recogerá los resultados

Industrialización en el proceso de producción

- Mantenimiento de los parámetros de ajuste en cada caso y de las salidas
- Una vez al año identificado el modelo, cada nuevo período la llamada a la macro será con los parámetros del modelo
- Se obtendrán nuevos coeficientes en cada período y nuevas series corregidas y desestacionalizadas

Industrialización en el proceso de producción

- Pendiente de decidir la difusión: todas las series (bruta, corregida, desestacionalizada, corregida y desestacionalizada) ó sólo algunas



Muchas gracias