

Produsul intern brut trimestrial – estimări „semnal”

Precizări metodologice

Estimările “semnal” ale Produsului intern brut trimestrial sunt produse pentru a oferi cea mai rapidă imagine asupra evoluției economiei și au următoarele caracteristici:

- sunt în concordanță cu standardele metodologice ale Sistemului conturilor naționale (SEC) 2010;
- sunt produse și publicate la cel mult 45 de zile după încheierea trimestrului de referință;
- au la bază un set incomplet de informații comparativ cu estimările provizorii ale conturilor naționale trimestriale, inclusiv a Produsului intern brut, motiv pentru care fac obiectul revizurilor trimestriale.

Diferențele dintre estimările “semnal” și estimările provizorii ale Produsului intern brut sunt determinate de următoarele aspecte:

- Operativitate: estimările “semnal” sunt disponibile mai devreme decât cele provizorii (40-45 de zile față de 70-75 de zile).
- Acuratețe: se face un compromis între operativitate și acuratețe. Estimările “semnal” sunt, în general, mai puțin precise decât cele provizorii, dar se urmărește ca pierderea în precizie să fie redusă la un nivel cât mai scăzut.
- Sferă de cuprindere: numărul variabilelor acoperite de estimările “semnal” este limitat.
- Informații disponibile: estimările “semnal” au la bază un set limitat de date. Adesea, unele informații furnizate de anchetele statistice sau sursele administrative nu sunt disponibile.
- Metodă de estimare: în funcție de sursele de date disponibile se poate utiliza metoda directă (prin utilizarea datelor existente și a estimărilor pentru cele nedisponibile) sau metoda indirectă (prin utilizarea tehnicilor de regresie).

Estimările “semnal” ale Produsului intern brut trimestrial în conturile naționale românești se realizează prin aplicarea metodei directe având în vedere existența surselor de date infra-anuale, în special a anchetelor statistice ce oferă informații care permit estimarea Produsului intern brut trimestrial (PIBT) la prețul pieței prin **metoda de producție**, conform relației:

$$\text{PIBT} = \text{VAB} + \text{IP} - \text{SP}$$

unde:

VAB = valoarea adăugată brută la preț de bază;

IP = impozitele pe produs;

SP = subvențiile pe produs.

Pe lângă estimările brute ale Produsului intern brut trimestrial, prin care se compară PIBT din anul curent față de aceeași perioadă din anul anterior, se calculează și estimări ajustate sezonier, utilizând metoda regresivă, metodă recomandată de regulamentele europene, prin care se poate compara PIBT din două trimestre consecutive.

Ajustarea sezonieră are drept scop eliminarea efectelor sezoniere din cadrul seriei de date pentru a se evidenția evoluția economică reală din perioade consecutive¹.

¹ „PIB - serie ajustată sezonier” este utilizat în compararea trimestrului de referință cu trimestrul anterior, în timp ce „PIB – serie brută” se utilizează, preponderent, în compararea cu perioada corespunzătoare din anul anterior.

Pentru ajustarea seriilor principalelor agregate pe baza cărora se estimează PIB prin metoda de producție și prin metoda cheltuielilor, se utilizează pachetul de programe JDEMETRA versiunea 2.2.0 (metoda TRAMO/SEATS și X-13ARIMA-SEATS). Acesta realizează estimarea efectului sezonier (evenimente care se întâmplă în același moment, cu aceeași magnitudine și direcție în fiecare an, cum ar fi: anotimpuri, vacanțe, etc., a numărului de zile lucrătoare diferit de la o lună la alta și efectului calendarului, cum ar fi Paștele ortodox, an bisect și alte sărbători naționale) precum și identificarea și corectarea valorilor extreme (schimbări de nivel ocazionale, tranzitorii sau permanente) și interpolarea valorilor lipsă.

Conturile naționale trimestriale din România prezintă, în general, o puternică sezonabilitate, fiind ajustate și în funcție de numărul de zile lucrătoare și calendar chiar dacă efectul acestora din urmă este nesemnificativ.

Seria ajustată sezonier s-a obținut prin eliminarea din seria brută a efectului sezonier, cu ajutorul unor coeficienți de corecție, stabiliți în funcție de modelul de regresie folosit (aditiv sau multiplicativ). Modelul aditiv sau multiplicativ folosit pentru regresie este identificat automat de programul JDemetra în funcție de natura seriilor supuse ajustării.

Seriile ajustate sezonier pentru ultimii 5 ani și trimestrele disponibile din anul de referință se recalculează în fiecare trimestru ca urmare a revizurii seriilor brute de date trimestriale și anuale, pe măsură ce devin disponibile surse date statistice și administrative cu un grad mai mare de cuprindere și de exactitate, a introducerii în seria de date a ultimei observații disponibile, a modificării modelelor adoptate și a parametrilor de regresie.

Inchiderea sau reducerea unor activități economice, începând cu a doua jumătate a lunii martie, ca urmare a epidemiei cu virusul Corona, a fost diferită de alte crize economice mai mult sau mai puțin recente. Instaurarea Stării de urgență și ordonațele de urgență emise de guvern în vederea protejării populației împotriva infecției și reducerii riscului de raspândire a virusului au avut un impact important asupra economiei României, ca de altfel și a altor țări.

Astfel, institutele naționale de statistică au trebuit să facă față unor noi provocări legate de colectarea datelor statistice prin anchete infra-anuale și de asigurarea unei cât mai bune calități a indicatorilor produși.

În fața acestei situații, Eurostat și autoritățile statistice naționale din Sistemul Statistic European au lucrat împreună pentru elaborarea de orientări metodologice și note privind modul de abordare a problemelor metodologice declanșate de aceste schimbări în producția statistică. Acest lucru asigură că statisticile europene continuă să se fundamenteze pe baze temeinice.

O secțiune metodologică a fost deschisă pe site-ul Eurostat care să vină în sprijinul statisticienilor europeni, dar nu numai, în cadrul căreia au fost prezentate noi orientări și note metodologice.

În cadrul acestei secțiuni a fost postată și o notă metodologică dedicată conturilor naționale trimestriale, "Orientări privind estimarea conturilor naționale trimestriale (inclusiv estimări semnal) în contextual crizei COVID-19". Documentul este postat pe site-ul INS la secțiunea Produse statistice/Date/Produsul intern brut