

NOTA TÉCNICA 01/2018

Pesquisa Industrial Mensal: Produção Física – PIM-PF

Ajuste Sazonal

O Instituto Brasileiro de Geografia e Estatística – IBGE – divulgará em 3 de abril de 2018, a revisão dos índices sazonalmente ajustados da Pesquisa Industrial Mensal Produção Física – PIM-PF.

Os dados dessazonalizados da pesquisa estão sendo recalculados a partir de uma atualização da estimativa do padrão sazonal, devido a informações fornecidas por novos dados não ajustados. As séries temporais originais (dados não ajustados) divulgadas não sofreram alterações.

Essa revisão cumpre os seguintes objetivos:

- a) Atualizar a identificação dos modelos, variáveis de regressão e reestimar seus respectivos parâmetros e fatores considerando todas as informações disponíveis de cada série temporal não ajustada;
- b) Ampliar a oferta de índices sazonalmente ajustados, incluindo as atividades de Impressão e reprodução de gravações; e de manutenção, reparação e instalação de máquinas e equipamentos, e a série para a unidade da federação do Mato Grosso;
- c) Atualizar a ferramenta para obtenção das séries ajustadas, migrando do software X-12 ARIMA para o software X-13 ARIMA-SEATS, ambos do U.S. Census Bureau.

O ajuste sazonal das séries da PIM-PF passa a ser obtidos utilizando-se o software X-13 ARIMA-SEATS. Para esse ajuste, estão sendo considerados os efeitos sazonais, o tratamento específico para o efeito calendário (Trading Day – TD), a identificação de outliers e a correção de dias úteis para feriados móveis (Carnaval, Corpus Christi e Páscoa). Para os feriados de Carnaval e Corpus Christi utiliza-se o programa GENHOL (Generate Holiday Regression Variables), disponibilizado pelo U.S. Census Bureau, de modo a gerar a matriz de coeficientes de regressão.

Os procedimentos descritos acima, passarão a ser utilizados na atualização dos modelos de ajuste sazonal da PIM-PF, a partir do mês abril de 2018 (em que ocorre a divulgação dos resultados do mês de referência de fevereiro de 2018). Anteriormente era utilizado o software X12-ARIMA, do U.S. Census Bureau e considerava-se, além dos efeitos sazonais, tratamento específico para o efeito calendário (Trading day – TD), identificação de outliers e correção de dias úteis para feriados móveis (Carnaval e Páscoa);

A atualização dos modelos foi definida com a série de 192 meses (janeiro de 2002 a dezembro de 2017) para a indústria geral, seções, atividades de indústria e as grandes categorias econômicas; e de 72 meses (janeiro de 2012 a dezembro de 2017) para as séries de impressão e reprodução de gravações; manutenção, reparação e instalação de

máquinas e equipamentos, e para a unidade da federação do Mato Grosso que passaram a ser ajustadas a partir dessa atualização.

Os novos modelos adotados estão disponíveis no portal do IBGE, podendo ser acessados em:

<https://www.ibge.gov.br/estatisticas-novoportal/economicas/industria/9294-pesquisa-industrial-mensal-producao-fisica-brasil.html?&t=notas-tecnicas>

Informações mais detalhadas sobre os procedimentos metodológicos podem ser solicitadas via email ibge@ibge.gov.br; atendimento telefônico 0800-721-8181, ou obtidas em contato com a Coordenação da Pesquisa - Avenida Chile, 500 - 5º andar - CEP 20031-070 - Rio de Janeiro - RJ, telefone:(21) 2142-4513.

Diretoria de Pesquisas

7 de março de 2018