

Diseño y análisis estadístico en las encuestas de hogares de América Latina

Andrés Gutiérrez¹

2021-07-13

¹Experto regional en estadísticas sociales - Unidad de Estadística Social - Comisión Económica para América Latina y el Caribe (CEPAL) - andres.gutierrez@cepal.org

Índice general

Prefacio	9
Resumen	11
1. Introducción	13
I Diseño estadístico de las encuestas de hogares	21
2. Elementos básicos y planeación	23
I. Universo, muestra y unidades	23
II. Periodicidad en el tiempo	24
III. Rotación de paneles	29
IV. Parámetros de interés	32
3. Definición del marco muestral	39
I. El marco de muestreo	39
II. Los censos y su incidencia en los marcos de muestreo	42
III. Construcción de las UPM	45
4. Metodologías de estratificación	49
I. Dimensiones estructurales en el marco de muestreo	50
II. Información a nivel de UPM	53
III. Metodologías univariadas sobre medidas de resumen	55
IV. Metodologías multivariadas sobre la matriz de información	57
V. Evaluación y escogencia de la mejor estratificación	58
5. Diseño y mecanismo de selección de la muestra	63
I. Diseños de muestreo	65
II. El diseño de muestreo estándar en una encuesta de hogares	75
III. Acerca del efecto de diseño	77
6. El efecto de diseño	81
I. Formas comunes del efecto de diseño	81

II.	Estimación del efecto de diseño	83
III.	El efecto de diseño en subpoblaciones	83
IV.	Otras consideraciones	85
7.	Cálculo del tamaño de muestra	91
I.	Confiabilidad y precisión	91
II.	El efecto de diseño en la determinación del tamaño de muestra .	93
III.	Escenarios de interés	95
IV.	Otros escenarios de interés	107
V.	Algunas consideraciones adicionales	113
	Referencias	117

Índice de cuadros

2.1. Esquema de una encuesta transversal.	26
2.2. Esquema de una encuesta repetida.	26
2.3. Esquema de una encuesta tipo panel.	27
2.4. Esquema de una encuesta de panel dividido.	28
2.5. Esquema de una encuesta de panel rotativo.	28
2.6. Rotación de paneles en un diseño $2(2)2$	30
2.7. Rotación de paneles en un diseño $4(0)1$	30
2.8. Composición del mercado de trabajo en dos periodos de tiempo	35
4.1. Efectos de diseño $DEFF_p$ y efecto de diseño generalizado $G(S)$ considerando tres ($H = 3$) y cuatro ($H = 4$) estratos para ocho variables.	60

Índice de figuras

1.	Licencia de Creative Commons	9
1.1.	Esquema de procesos en el análisis y diseño de una encuesta de hogares.	18
4.1.	<i>Histograma de la medida de resumen (y) sobre las UPM</i>	56
4.2.	Comportamiento esperado en los estratos de muestreo para algunas variables de interés.	62

Prefacio



Figura 1: Licencia de Creative Commons

La versión online de este libro está licenciada bajo una [Licencia Internacional de Creative Commons para compartir con atribución no comercial 4.0](#).

Este libro es el resultado de un compendio de las experiencias internacionales prácticas adquiridas por el autor como Asesor Regional en Estadísticas Sociales de la CEPAL.

Resumen

Las encuestas de hogares son un instrumento necesario para realizar seguimiento a un conjunto amplio de indicadores requeridos para el diseño y evaluación de las políticas públicas. Las encuestas de hogares que se implementan en América Latina son de tipo y características diversas. Aunque los conceptos y procesos para su diseño y análisis guardan similitudes, este documento se enfoca principalmente en los procesos referidos a las encuestas de empleo y de propósitos múltiples, con las que los países estiman los principales indicadores relacionados con el mercado laboral, el nivel y distribución de ingresos y la condición de pobreza y las principales características sociodemográficas de la población. Se realiza un recorrido por los diferentes diseños de muestreo, las metodologías más usadas en la selección de las muestras y las estrategias de estimación de los parámetros de interés. También se revisan las técnicas utilizadas para medir el error de muestreo y los métodos disponibles para encarar desafíos como la ausencia de respuesta y la desactualización de los marcos de muestreo.

UNBIS Keywords. Encuestas por muestreo, encuestas de hogares, indicadores socioeconómicos.

Capítulo 1

Introducción

Las encuestas de hogares son un caso particular de investigación social que indaga acerca de características específicas a nivel del individuo, del hogar o de la vivienda, con el fin de obtener inferencias precisas acerca de constructos de interés. Por su naturaleza, estas investigaciones están relacionadas con variables de salud, educación, ingresos, gastos, situación laboral, acceso y uso de servicios, entre muchas otras. En algunas ocasiones, las encuestas de hogares tienen como objetivo la estimación de uno o varios indicadores que resumen un constructo económico o social. Sin embargo, existe una tendencia creciente de extender las encuestas a constructos más diversos. Es así como cada vez tienen más espacio las encuestas de propósitos múltiples como una fuente relevante de información que permite monitorear indicadores sociales.

En este tipo de encuestas, el hogar es la unidad de análisis, la cual ha sido definida por la División de Estadística de la Organización de las Naciones Unidas (ONU, 2011) como:

- a. Un grupo de dos o más personas que se combinan para ocupar la totalidad o parte de una vivienda y para proporcionarse alimentos y posiblemente otros artículos esenciales para la vida. El grupo puede estar compuesto solo de personas relacionadas o de personas no relacionadas o de una combinación de ambos. El grupo también puede compartir sus ingresos.
- b. Una persona que vive sola en una vivienda separada o que ocupa, como huésped, una habitación (o habitaciones) separada de una vivienda pero que no se une a ninguno de los otros ocupantes de la vivienda para formar parte de un hogar de múltiples personas.

Nótese que la anterior definición refleja la dinámica natural del cambio en las poblaciones de hogares, por lo cual se deben tener distintos enfoques para abordar el problema de la medición de indicadores sociales. En América Latina, existen

una gran variedad de encuestas que abordan diferentes problemáticas sociales. Todas y cada una de ellas han sido diseñadas cuidadosamente para que respondan a las necesidades de la sociedad. Este documento plantea una recopilación de las técnicas usadas tanto en su diseño, como en su análisis.

No todas las encuestas se diseñan de la misma forma y por ende debe haber una distinción entre ellas. Por ejemplo, [Kalton and Citro \(1993\)](#) afirman que las encuestas de hogares pueden clasificarse en varios tipos:

- *Encuestas repetidas*, definidas como una serie de encuestas transversales aplicadas en diferentes momentos del tiempo con el mismo diseño metodológico, en donde la selección de hogares se hace de forma independiente para cada aplicación.
- *Encuestas tipo panel*, para las cuales los datos son recolectados en diferentes momentos del tiempo utilizando la misma muestra de hogares en el tiempo.
- *Encuestas rotativas*, en donde un porcentaje de hogares se mantiene en un periodo de tiempo respondiendo la encuesta y en cada aplicación algunos hogares son reemplazados por nuevos hogares de forma planificada.

El diseño de la encuesta dependerá sistemáticamente del objetivo de la medición. Por ejemplo, [Kalton \(2009\)](#) afirma que es prudente hacer una buena inversión en el desarrollo e implementación de un buen diseño para amortizar los costos de todo el estudio. Por lo tanto, lo que se quiere al diseñar una encuesta de hogares es que sea un instrumento confiable, que brinde estimaciones exactas y precisas, puesto que de lo contrario no se podrían monitorear las políticas públicas y los indicadores de interés de forma consistente. Por ejemplo, uno de los indicadores sociales con mayor impacto es la tasa de desocupación, que mide la razón entre la cantidad de personas que se encuentran desocupados, pero que forman parte del mercado de trabajo. Las encuestas de empleo tienen características particulares, diferentes a las de las encuestas que miden otro tipo de constructos. [Duncan and Kalton \(1987\)](#) mencionan que las encuestas de hogares pueden proveer estimaciones de los parámetros poblacionales en distintos puntos del tiempo, por ejemplo, la estimación de la tasa de desocupación mensual; proveer estimaciones del cambio neto de los parámetros poblacionales entre periodos de tiempo, por ejemplo, el cambio en la tasa de desocupación entre dos periodos consecutivos; o incluso medir varios componentes de cambio individual, por ejemplo cambios brutos en la situación laboral de los jefes de hogar, para lo cual se requiere que la encuesta contemple un diseño de panel o de panel rotativo.

Objetivos de Desarrollo Sostenible

La medición de los indicadores en el mercado de trabajo es sólo un pequeño componente en el vasto universo de posibilidades de medición que brindan las encuestas de hogares. Por esta razón, este tipo de levantamientos se ha convertido en una herramienta fundamental para medir indicadores sociales en todo el mundo y que, en particular, permiten que las naciones de América Latina puedan hacer seguimiento a su desarrollo económico y social. Sin embargo, este

tipo de instrumentos puede ser utilizado como herramienta para monitorear el progreso de los países en términos de metas y objetivos comunes. Es así como en 2015, la Asamblea General de la Organización de las Naciones Unidas aprobó una resolución que plantea un plan de acción en favor de las personas, el planeta y la prosperidad (ONU, 2015). Esa resolución propone el seguimiento de 17 Objetivos de Desarrollo Sostenible (ODS) y 169 metas de carácter integrado e indivisible que se conjugan en las dimensiones económica, social y ambiental. Para realizar el seguimiento a los ODS es posible utilizar diferentes fuentes de información, como censos, registros administrativos, registros estadísticos, proyecciones demográficas y también las encuestas de hogares (ONU, 2016). En particular, cada una de las metas de los ODS contiene indicadores, muchos de los cuales no pudieran ser estimados de no ser por la información disponible en las encuestas de hogares.

Por ejemplo, el objetivo 8 busca *promover el crecimiento económico sostenido, inclusivo y sostenible, el empleo pleno y productivo y el trabajo decente para todos*. Claramente de este objetivo se desprenden indicadores que permiten conocer la evolución de los países en la consecución de las metas. Dentro de este objetivo, se encuentra la meta 8.6 que apunta a reducir sustancialmente la proporción de jóvenes sin empleo y sin educación o entrenamiento. Esta meta se mide con el indicador 8.6.1 definido como la proporción de jóvenes (entre 15 y 24 años de edad) sin educación y sin empleo.

Mercado de Trabajo

Desde otra perspectiva, en el marco de la Decimotercera Conferencia Internacional de Estadísticos del trabajo en 1982, la Organización Internacional del Trabajo (OIT) adoptó algunas directrices concernientes con la medición y análisis de estadísticas oficiales de la fuerza de trabajo, del empleo y del desempleo con miras a mejorar la comparabilidad de las cifras y mejorar su utilidad en los países (OIT, 1982). En esta resolución se hace un énfasis especial en que las encuestas de hogares constituyen un medio apropiado de recopilación de datos sobre la población económicamente activa y que la planeación de estas investigaciones en los países debería ceñirse a las normas internacionales. Por consiguiente, la resolución afirma que las encuestas de hogares deberían:

1. Brindar datos de la población económicamente activa, definida por las personas en edad laboral que se han integrado al mercado de trabajo (trabajadores o personas en búsqueda de empleo).
2. Proveer estadísticas básicas de sus actividades durante el año, así como las relaciones entre el empleo, ingreso y otras características económicas y sociales.
3. Proveer datos sobre otros temas particulares para responder a las necesidades a largo plazo y de índole permanente.

En el año 2013, la OIT decidió revisar esta resolución y propuso algunos cambios en el marco de la 19 Conferencia Internacional de Estadísticos del Trabajo

en donde se acogieron algunas modificaciones en términos de los objetivos de medición y el alcance de los sistemas nacionales de estadísticas del trabajo, el concepto de trabajo en todas sus formas, el empleo, la medición de las personas en situación de subutilización de la fuerza de trabajo, métodos de recopilación de datos, entre otras (OIT, 2013). Es así como las Oficinas Nacionales de Estadística (ONE) de América Latina no sólo planean las encuestas de hogares de tal forma que puedan responder a los nuevos retos en términos de la estimación de los parámetros de interés en cuanto al trabajo remunerado o no remunerado para mantener la comparabilidad de las estadísticas laborales entre los países, proporcionando nuevos y mejores indicadores para contribuir al análisis de la dinámica del mercado laboral, sino que se actualizan paulatinamente para poder brindar la información que la sociedad necesita a medida que evoluciona el constructo social de interés.

Ingresos y gastos

Es importante resaltar que los indicadores de bienestar (en términos de ingresos y gastos) también hacen parte del conjunto de parámetros que se pueden estimar desde las encuestas de hogares. Medir el ingreso a partir de las encuestas de hogares se constituye en un reto metodológico para los institutos nacionales de estadística en el mundo, y particularmente en América Latina. Es recomendable seguir las directrices de la Comisión Económica para Europa que revisten una actualización de los estándares internacionales, recomendaciones y buenas prácticas en la medición del ingreso en los hogares. Por ejemplo, el llamado Grupo de Canberra ha revisado exhaustivamente el tópico de la estimación del ingreso estudiando las prácticas de algunos países en términos del aseguramiento de la calidad y la publicación de este tipo de estadísticas oficiales y ha provisto la siguiente definición de ingreso en el hogar (ONU, 2011):

El ingreso del hogar se compone de las entradas monetarias, en especie o en servicios que por lo general son frecuentes y regulares, están destinadas al hogar o a los miembros del hogar por separado y se reciben a intervalos anuales o con mayor frecuencia. Durante el período de referencia en el que se reciben, tales entradas están potencialmente disponibles para el consumo efectivo y, habitualmente, no reducen el patrimonio neto del hogar.

Con base en lo anterior, el uso de las encuestas de hogares para estimar el ingreso reviste retos metodológicos mayores puesto que los entrevistados deben responder con precisión cuando se les indague por este constructo que contiene los ingresos personales de cada individuo en el hogar, como sueldos y salarios, ganancias, ingresos del empleo, pensiones, etc. y también los ingresos del hogar, incluidas las rentas por alquiler y los ingresos generados por el comercio. Por lo tanto, el diseño de la encuesta debe tener en cuenta la definición de un instrumento que sea relevante para el respondiente y le permita identificar y, en algunas ocasiones, recordar la información con un cierto grado de exactitud.

Por ejemplo, si el respondiente es empleado regular, el instrumento de medición debería planearse de tal manera que el entrevistado pueda recordar la información de interés, como los rubros de seguridad social hechos por su empleador. Por otro lado, si se requiere que el respondiente brinde información acerca de un determinado periodo de tiempo, el planteamiento de la pregunta, la forma de indagar y el entrenamiento de los encuestadores pueden sesgar sistemáticamente la respuesta y por consiguiente inducir estimaciones poco confiables. Mucho se ha investigado al respecto de cómo realizar preguntas certeras en este tipo de levantamientos y el lector interesado puede consultar los trabajos de [Biemer and Lyberg \(2003\)](#), [Presser et al. \(2004\)](#), y [Groves et al. \(2009\)](#).

Esquema del documento

Este documento pretende revisar algunas de las metodologías más usadas por las ONE de América Latina en cuanto al diseño y análisis estadístico de las encuestas de hogares y puede servir de guía técnica a los estadísticos de la región que se encuentran involucrados en los procesos técnicos de este tipo de encuestas. De la misma forma, este documento considera conjuntamente los dos principales momentos de las encuestas: el diseño y el análisis. Nótese que estos momentos están escindidos por el levantamiento de la información en campo y parten la realización de la encuesta en dos. Los lectores que están familiarizados con la investigación social a través de las encuestas de hogares encontrarán que estas operaciones estadísticas se planean teniendo en cuenta muchos pormenores que podrían suceder en campo. Es por esto que el trabajo de las encuestas asciende cuando se logra plasmar la información recolectada en una de base de datos. En este segundo momento es cuando se debe asegurar que lo que se planificó efectivamente sea incorporado en el análisis de esta información. Desde esta perspectiva, este documento puede verse en dos momentos: los capítulos 2, 3 y 4 abordan el diseño, mientras que los capítulos 4, 5 y 6 y 7 abordan el análisis. Esta distinción así como los procesos que la componen se presenta en la [Figura 1.1](#).

En el primer capítulo se considera una breve introducción a la problemática de las encuestas de hogares. En el capítulo dos se aborda con más detalle los elementos básicos que se consideran por lo regular en los diseños de las encuestas de hogares. Un aspecto relevante de este documento es que, si bien considera que las encuestas de hogares tienen muchos elementos en común, diferencia de forma cuidadosa las particularidades de cada encuesta. Por ejemplo, en este capítulo se trata el tema del diseño de las encuestas rotativas y se profundiza en los diferentes parámetros que se pueden considerar en este tipo de operaciones; asimismo, describe las características metodológicas que se deben considerar al momento de diseñar la encuesta y revisa los conceptos esenciales que determinarán el tipo de aplicación que se debe considerar. El capítulo tres describe los principales diseños de muestreo que se utilizan en este tipo de estudios y expone de forma estándar los conceptos de estratificación y aglomeración de las poblaciones. El capítulo cuatro complementa estos conceptos con varias aplicaciones prácticas

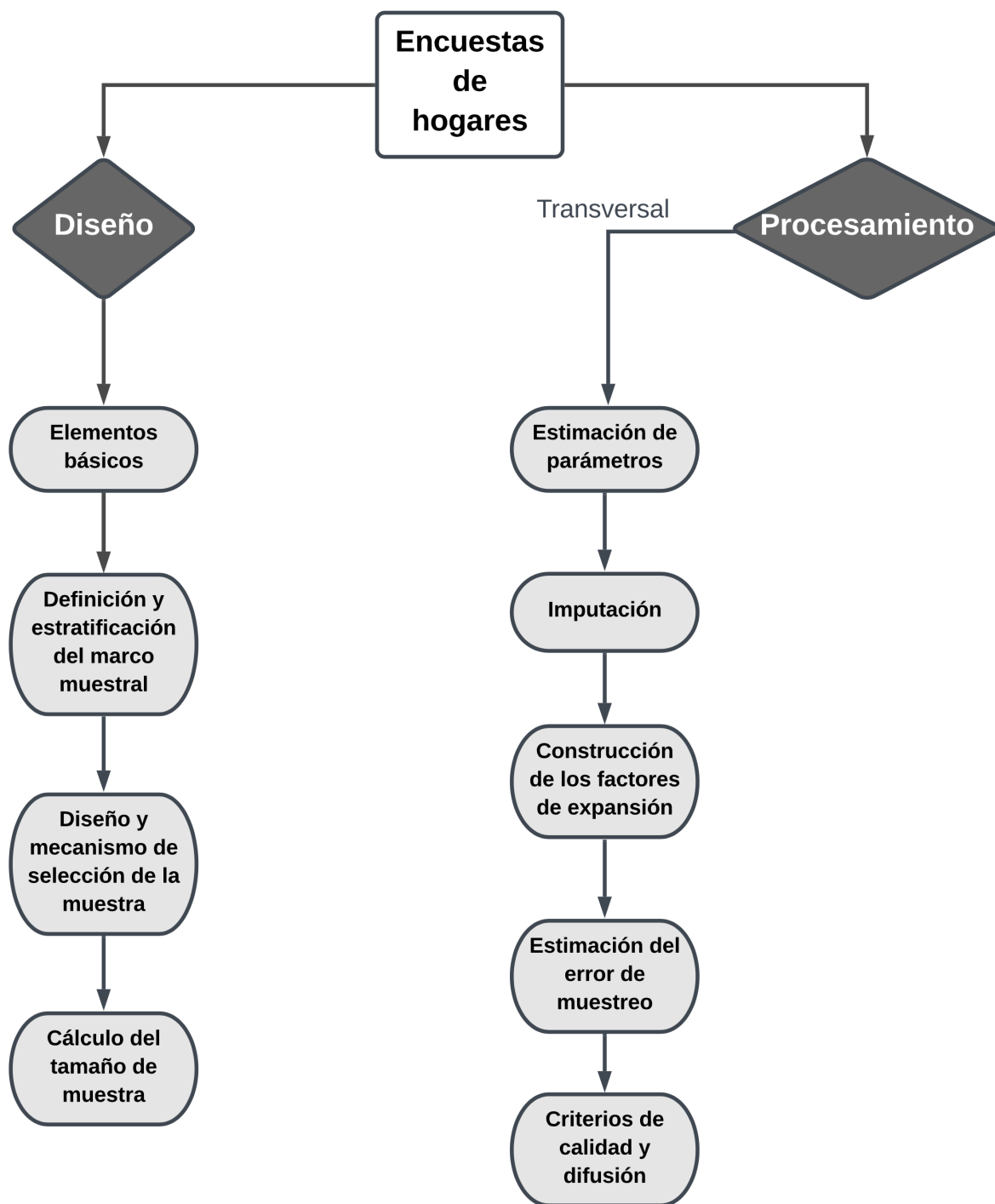


Figura 1.1: Esquema de procesos en el análisis y diseño de una encuesta de hogares.

para determinar el tamaño de muestra adecuado para lograr los objetivos de la investigación. A pesar de que la literatura relacionada con la práctica del muestreo es relativamente abundante, existen pocos ejemplos prácticos que logren representar la problemática del tamaño de muestra y el lector podrá encontrar herramientas ilustrativas basadas en múltiples escenarios de la problemática social.

Pasando a la parte del análisis de las encuestas, el capítulo cinco revisa los procesos de imputación y ponderación en la encuesta. Los procesos de imputación tratan de recuperación tanta información como sea posible para que el investigador pueda contar con una base de datos rectangular y completa. Luego de esto, es necesario aplicar los factores de expansión a la información contenida en la base de datos para que se puedan realizar inferencias a nivel nacional o regional. Sin embargo, en aquellos casos en donde la imputación no resulta ser una técnica adecuada para completar la información faltante, es necesario realizar ajustes sistemáticos en los factores de expansión para que la muestra efectiva siga siendo una muestra representativa de toda la población. El capítulo seis analiza las principales metodologías de estimación, tanto de los parámetros de interés como de sus errores de muestreo. Si hay algo que distingue el análisis de las encuestas de cualquier otro tipo de estudio estadístico es que las propiedades importantes como insesgamiento, consistencia y eficiencia están basadas en el diseño de muestreo y no en supuestos metodológicos ligados a algún modelo estocástico. Es por esto que se presta especial atención a la estimación del error de muestreo, que no es otra cosa que una función de la varianza de las estimaciones, y se presentan las metodologías más comunes en términos de aproximaciones teóricas y computacionales al error de muestreo. El capítulo siete presenta de forma detallada los procesos que se surten cuando se agregan encuestas a lo largo de un periodo de tiempo. Acudiendo a la perspectiva del autor, el capítulo ocho presenta los criterios de calidad que se deberían tener en cuenta para decidir si una cifra, resultante de un proceso de estimación estadística basada en encuestas de hogares, debería ser o no publicada a la sociedad. Por último, el capítulo nueve presenta una discusión acerca del uso presente de las encuestas de hogares y los retos que depara el futuro en materia de la medición de indicadores sociales a través de las encuestas de hogares. Asimismo, en los anexos se contempla una revisión del software que se utiliza actualmente en los ONE para llevar a cabo esta ardua tarea de diseñar y analizar las encuestas de hogares, una revisión rápida de algunas de las encuestas de la región, así como algunas directrices que se deberían considerar al momento de documentar los procesos asociados a las encuestas de hogares.

Parte I

Diseño estadístico de las encuestas de hogares

Capítulo 2

Elementos básicos y planeación

El fortalecimiento continuo de las investigaciones sociales es un objetivo que los institutos nacionales de estadística procuran cumplir de forma sistemática. En el caso de aquellas operaciones que conllevan la recolección de información primaria y que involucran la selección y medición de hogares y sus miembros, mantener una documentación adecuada que describa las razones por las cuales se ha optado por cierta metodología de recolección en particular es un requisito fundamental para cumplir este cometido. En este apartado se exploran diferentes métodos de recolección de la información y se discuten las diferentes particularidades en la planeación de una encuesta de hogares.

I. Universo, muestra y unidades

El término encuesta se encuentra directamente relacionado con una población finita compuesta de individuos a los cuales es necesario observar y medir. Este proceso muchas veces es realizado por medio de una entrevista. El conjunto de unidades de interés recibe el nombre de *población objetivo* o *universo* y sobre ellas se obtiene la información de interés para el estudio. Por ejemplo, la *Encuesta Nacional de Empleo y Desempleo* de Ecuador define su población objetivo como todas las personas mayores de 10 años residentes en viviendas particulares en Ecuador.

Las *unidades de análisis* corresponden a los diferentes niveles de desagregación establecidos para consolidar el diseño de la encuesta y sobre los que se presentan los resultados de interés. En México, la *Encuesta Nacional de Ingresos y Gastos de los Hogares* define como unidades de análisis el ámbito al que pertenece la vivienda: urbano alto, complemento urbano y rural. Por otro lado, la *Gran Encuesta Integrada de Hogares* de Colombia tiene cobertura nacional y sus uni-

dades de análisis están definidas por 13 grandes ciudades junto con sus áreas metropolitanas.

Como se explicará más adelante, es muy difícil contar con una lista actualizada de todos los hogares del país; por lo tanto, para recolectar la información de la población objetivo, el diseño de una encuesta de hogares en América Latina plantea la necesidad de seleccionar en varias etapas ciertas *unidades de muestreo* que sirven como medio para seleccionar finalmente a los hogares y personas que participarán de la muestra. Cuando se requiere seleccionar personas, se hace necesario seleccionar un subconjunto de zonas geográficas; para cada zona seleccionada, se procede a seleccionar a su vez un subconjunto de secciones cartográficas, que antecede a la selección de hogares y, finalmente, para cada hogar se seleccionan las personas; siendo estas las unidades de observación. Por ejemplo, se puede citar la experiencia de Brasil con la *Pesquisa Nacional por Amostra de Domicílios* que se realiza por medio de una muestra de viviendas en tres etapas: las unidades primarias de muestreo (UPM) son los municipios, mientras que las unidades secundarias de muestreo (USM) son los sectores censales, que conforman una malla territorial conformada en el último Censo Demográfico. Por último, las unidades finales en ser seleccionadas son las viviendas.

Duncan and Kalton (1987, , pág. 105) afirman que la composición de la población de interés en las encuestas de hogares cambia durante el tiempo, puesto que los individuos nacen, mueren, migran, e incluso pasan a ser parte de organizaciones que hacen que pierdan su estatus de elegibilidad como unidades de observación en una encuesta. Nótese que la población objetivo de la mayoría de encuestas de hogares en América Latina se refiere a la población civil excluyendo a los miembros de organizaciones militares, personas recluidas en cárceles, personas que se encuentran en hospitales, etc. De igual forma, se debe tener en cuenta que los hogares pueden crearse o desintegrarse rápidamente. Por ende, los equipos técnicos de las ONE que están a cargo del diseño de las encuestas de hogares, que miden de forma transversal a la población de interés, deben tener en cuenta que, aunque los objetivos de la encuesta no cambian en el tiempo, sí lo hace la población objetivo y se deben plantear esquemas de seguimiento y actualización que den cuenta de esta realidad.

II. Periodicidad en el tiempo

las Oficinas Nacionales de Estadística - que son los entes encargados de administrar, diseñar, analizar y difundir los resultados de las encuestas - no realizan este tipo de levantamientos de manera aislada; de hecho una característica fundamental de estas operaciones estadísticas es que se han convertido en un insumo fundamental para realizar un seguimiento periódico de muchos indicadores de interés. Por lo tanto, muchas encuestas de hogares se realizan de forma sistemática en el tiempo, aunque algunas otras que no tienen una periodicidad predefinida. Es por esto que la planeación de la encuesta debe contemplar este tipo de esquemas continuos para que el levantamiento de la información primaria en

campo se haga de manera más eficiente y, de la misma forma, que la estimación de los indicadores de interés se pueda realizar ajustándose a los recursos de la operación. Como se mencionó anteriormente, dado que la población es dinámica en el tiempo, la planeación y análisis de este tipo de encuestas es desafiante, puesto que si la composición de la población y las características de los elementos se considerara fija, una encuesta transversal (realizada una sola vez en un periodo de tiempo largo) sería suficiente para realizar estimaciones precisas que resuelvan los objetivos del estudio.

En algunas ocasiones, basta con realizar una medición simple en un punto específico del tiempo para completar los objetivos de la investigación. Este es el caso de las encuestas de ingresos y gastos cuya periodicidad es, en general, no menor a cinco años y las cuales son utilizadas para, entre muchos otros propósitos, actualizar la canasta básica familiar, de la cual se derivan los insumos básicos para la medición de la pobreza (CEPAL, 2018). Para otro tipo de problemáticas, como por ejemplo el seguimiento al mercado de trabajo, es necesario recurrir a la medición periódica a través de encuestas de hogares, en donde los cambios naturales en las características de la población hacen que realizar una medición simple en un punto del tiempo sea inviable a la luz del seguimiento y monitoreo de los indicadores de interés.

Por consiguiente, al momento de realizar la planeación de una encuesta continua o periódica se debe tener en cuenta que, a pesar de que crezca la dificultad en el diseño, es posible obtener información más oportuna para la toma de decisiones y la formulación de políticas públicas. De esta manera, y teniendo en cuenta que el tiempo hace que la estructura de las poblaciones cambie, sin importar si la constituyen individuos, hogares, familias, negocios, etc., las unidades de observación deben ser consideradas como parte de la población de interés cuando nacen, inmigran o alcanzan un umbral predefinido de edad. Asimismo, las unidades ya harán parte de la población de interés cuando mueran, emigren, o se involucren en instituciones (como el servicio militar). Por ejemplo, si las unidades de interés son los hogares, es evidente que la población no es la misma en diferentes puntos del tiempo (por ejemplo, en dos años distintos) puesto que se crean nuevas unidades cuando los jóvenes dejan a sus padres y forman nuevos hogares independientes, o cuando ocurre una separación o un divorcio; en donde un hogar se divide en dos. Además, los hogares en donde todos sus miembros han fallecido dejan de ser parte de la población objetivo. De la misma forma, dos hogares dejan de ser parte de la población objetivo cuando se unen a través de un matrimonio o algún otro tipo de unión civil. Teniendo en cuenta el papel dinámico de las poblaciones y los objetivos de investigación es posible plantear diferentes tipos de levantamientos; a continuación enumeramos algunas categorías de encuestas que las ONE realizan en la región.

A. Encuestas transversales

Este tipo de encuestas son diseñadas para recolectar información únicamente en un punto específico del tiempo, o sobre un periodo de referencia, y proveen

toda la información pertinente acerca de la población particular restringida a un tiempo y periodo de recolección específico. Puesto que el propósito fundamental de este tipo de encuestas no se centra en las comparaciones intertemporales, no es posible estimar cambios de ningún tipo, a no ser que se realicen indagaciones retrospectivas. La siguiente tabla muestra un esquema de este tipo de operaciones estadísticas en donde se observa una muestra de una población específica en un periodo de tiempo específico (Tiempo 2). Dado que es una muestra transversal, no hay un patrón de repetición en los restantes periodos.

Cuadro 2.1: *Esquema de una encuesta transversal.*

Muestra	Tiempo 1	Tiempo 2	Tiempo 3	Tiempo 4	Tiempo 5	Tiempo 6
1		x				
2		x				
3		x				
4		x				
5		x				
6		x				

B. Encuestas repetidas

Cuando existe interés en realizar un seguimiento del fenómeno en observación durante el tiempo, se utilizan encuestas repetidas que recolectan información de manera periódica. Este tipo de encuestas proveen información acerca de la dinámica de la composición de la población en el tiempo. De esta forma, en cada levantamiento se observa una muestra de la población en un tiempo determinado. Por ejemplo, la siguiente tabla muestra un acercamiento gráfico a este tipo de encuestas en donde se evidencia el carácter sistemático de estas operaciones estadísticas; además de mostrar que no es posible medir cambios individuales porque las muestras son independientes en el tiempo.

Cuadro 2.2: *Esquema de una encuesta repetida.*

Muestra	Tiempo 1	Tiempo 2	Tiempo 3	Tiempo 4	Tiempo 5	Tiempo 6
1	x					
2		x				
3			x			
4				x		
5					x	
6						x

C. Encuestas panel

Las encuestas en panel están diseñadas para recolectar información periódica sobre la misma muestra en diferentes puntos del tiempo. Por definición, las unidades de muestreo son las mismas en los diferentes periodos de tiempo y, de manera general, se miden las mismas variables en cada levantamiento. Por la caracterización propia de este tipo de encuestas, sí es posible estimar los cambios individuales, así como los cambios netos sobre la población. Sin embargo, como la muestra no cambia en ningún momento del tiempo, las inferencias que se realicen estarán supeditadas a la población de la cual se seleccionó la muestra en un principio (Tiempo 1). Si la población cambia su estructura, no será posible captar este cambio puesto que las inferencias resultantes de este tipo de encuestas no son representativas de la población actual. La siguiente tabla muestra un esquema propio de las encuestas de panel en donde los individuos que fueron seleccionados la primera vez son observados a lo largo del tiempo.

Cuadro 2.3: *Esquema de una encuesta tipo panel.*

Muestra	Tiempo 1	Tiempo 2	Tiempo 3	Tiempo 4	Tiempo 5	Tiempo 6
1	x	x	x	x	x	x
2	x	x	x	x	x	x
3	x	x	x	x	x	x
4						
5						
6						

D. Encuestas de panel dividido

Para hacerle frente a las dificultades propias de las encuestas de panel y poder observar tanto los cambios individuales, como los cambios en la estructura de la población, se definen las encuestas de panel dividido. Estas operaciones estadísticas son una combinación del diseño de panel puro y del diseño repetido y su objetivo es realizar inferencias precisas acerca de los cambios de una cohorte a través del tiempo y, al mismo tiempo, del cambio en estructura de la población actual. De esta forma, se realiza el seguimiento continuo, periódico y sistemático de una muestra a través del tiempo, pero en cada levantamiento se incluyen nuevos elementos seleccionados de la población actual. Como se señalará más adelante, este tipo de encuestas cubre con eficiencia la mayoría de indicadores de interés en un estudio de investigación social. La siguiente tabla muestra una caracterización de estos levantamientos que fijan una muestra de panel a lo largo del tiempo, y a la vez que se añaden nuevas observaciones.

Cuadro 2.4: *Esquema de una encuesta de panel dividido.*

Muestra	Tiempo 1	Tiempo 2	Tiempo 3	Tiempo 4	Tiempo 5	Tiempo 6
1	x	x	x	x	x	x
2	x					
3		x				
4			x			
5				x		
6					x	
7						x

E. Encuestas de panel rotativo

Mantener una muestra de panel es un proceso costoso desde una perspectiva económica y logística, pero también se debe tener en cuenta el desgaste de la fuente, que tenderá a brindar menos información a medida que avanza el estudio. Además, es evidente que a medida que el tiempo transcurra la propensión a responder será más baja, puesto que el entrevistado se sentirá agotado al ser visitado una y otra vez. Por lo tanto, se definen las encuestas de panel rotativo para poder realizar inferencias parciales - restringidas a periodos de tiempo específicos - del cambio individual y a la vez captar el cambio estructural de la población. Estas encuestas incorporan nuevos elementos de la población y a la vez mantienen elementos comunes con mediciones anteriores. Obviando las dificultades que acarrea la ausencia de respuesta, las encuestas panel definen un traslape completo entre las muestras de dos puntos cualesquiera en el tiempo; sin embargo, en las encuestas rotativas existe un traslape parcial, por lo que se reduce el efecto del desgaste del panel (sobre la población inicial) y el efecto de la pérdida de muestra. Además, la inclusión de nuevos elementos en la muestra provee información pertinente del cambio en la composición estructural de la población. La siguiente tabla ejemplifica el diseño de las encuestas rotativas.

Cuadro 2.5: *Esquema de una encuesta de panel rotativo.*

Muestra	Tiempo 1	Tiempo 2	Tiempo 3	Tiempo 4	Tiempo 5	Tiempo 6
1	x					
2	x	x				
3	x	x	x			
4		x	x	x		
5			x	x	x	
6				x	x	x
8					x	x
9						x

III. Rotación de paneles

Algunas encuestas de hogares en América Latina permiten que un hogar sea visitado en más de una ocasión con el fin de tener estimaciones precisas acerca de los cambios de estado que el hogar o las personas que lo habitan puedan sufrir. Por ejemplo, un hogar que en un periodo estuvo en condición de pobreza extrema, puede estar en otro periodo en condición de pobreza o inclusive puede pasar a estar fuera de la pobreza; en las encuestas de fuerza laboral, una persona puede pasar de estar empleada en un periodo a desempleada en otro periodo. Estos cambios y la dinámica propia que conllevan son de interés para los investigadores y deben ser contemplados desde una perspectiva más amplia en cuanto a su diseño. Nótese que este tipo de variaciones sobre los individuos necesariamente tiene que ser captada a través de un componente de panel, por lo que las encuestas transversales o repetidas no serían viables para realizar estas estimaciones.

En América Latina hay una gran variedad de encuestas de hogares que utilizan diseños rotativos (ver anexo). Por ejemplo, la *Encuesta Permanente de Hogares* en Argentina renueva periódicamente el conjunto de hogares que serán entrevistados mediante un esquema¹ de rotación 2(2)2 que selecciona a las viviendas para ser entrevistadas en dos periodos consecutivos, luego los siguientes dos periodos esas viviendas salen de la selección, para finalmente volver a ser encuestadas en los siguiente dos periodos. De esta forma, un hogar es seguido a lo largo de 18 meses y esto permite cumplir con los objetivos de la encuesta. Este esquema induce algunas propiedades interesantes, que pueden ser ejemplificadas usando la siguiente tabla definido para los cuatro trimestres de los años 2016, 2017, 2018 en cuatro grupos de muestra: A, B, C y D.

- Entre el primer y el segundo periodo de medición hay un traslape del 50 % de hogares. En particular, nótese que entre 2016-T1 y 2016-T2, la muestra se conserva en un 50 %, puesto que $a1$ y $d1$ se repiten. Esto mismo sucede en cada trimestre del esquema rotacional.
- En el tercer periodo no habrá traslape con el primer periodo. Nótese que entre 2016-T1 y 2016-T3 no existe ningún elemento en común. De la misma manera, entre 2016-T2 y 2016-T4, no existe ningún elemento en común. Este mismo patrón se encuentra a lo largo del esquema rotacional.
- En el cuarto periodo se tendrá un 25 % de traslape con el primer periodo. Nótese, por ejemplo, que entre 2017-T1 y 2017-T4, $d3$ se repite; de la misma manera, entre 2017-T4 y 2018-T3, $d4$ se repite.
- Finalmente en el quinto periodo se volverá a tener un 50 % de traslape con respecto al primer periodo. Por ejemplo, 2016-T1 y 2017-T1 comparten el 50 % de la muestra $a1$ y $b1$; asimismo, 2017-T1 y 2018-T1 comparten el 50 % de la muestra $c3$ y $b3$.

¹Un esquema de rotación $x(y)z$, se define como aquel en donde la vivienda entra al panel por x meses, se excluye por los siguientes y meses y este patrón se repite z veces en el tiempo.

Cuadro 2.6: Rotación de paneles en un diseño $2(2)2$.

Año	Trimestre	A	B	C	D
2016	T1	$a1$	$b1$	$c1$	$d1$
	T2	$a1$	$b2$	$c2$	$d1$
	T3	$a2$	$b2$	$c2$	$d2$
	T4	$a2$	$b1$	$c3$	$d2$
2017	T1	$a1$	$b1$	$c3$	$d3$
	T2	$a1$	$b2$	$c4$	$d3$
	T3	$a2$	$b2$	$c4$	$d4$
	T4	$a2$	$b3$	$c3$	$d4$
2018	T1	$a3$	$b3$	$c3$	$d3$
	T2	$a3$	$b4$	$c4$	$d3$
	T3	$a4$	$b4$	$c4$	$d4$
	T4	$a4$	$b3$	$c5$	$d4$

Otro ejemplo de una encuesta que utiliza rotación de paneles es la *Encuesta Continua de Empleo* que, aplicada por el Instituto Nacional de Estadística de Bolivia, hace uso de una metodología mixta que permite el seguimiento continuo y transversal a la tasa de desempleo y a la tasa de subocupación, así como el seguimiento a los cambios que se presentan entre los periodos de interés (trimestres y semestres), a través del análisis longitudinal de los datos en el sector urbano (pues el diseño no es rotativo en el sector rural, debido a la baja incidencia de desempleo en esta zona). En este esquema rotacional $4(0)1$ una vivienda es entrevistada durante cuatro trimestres consecutivos, y luego sale del panel definitivamente. Un ejemplo de este tipo de esquemas se presenta en la siguiente tabla. - Nótese que entre el primer y el segundo periodo de medición hay un traslape del 75 % de hogares. En particular, entre 2016-T1 y 2016-T2, la muestra se conserva en tres cuartas partes puesto que $a1$, $c1$ y $d1$ se repiten. Esto mismo sucede en cada trimestre del esquema rotacional. - Por otro lado, entre el primer y el tercer periodo habrá un traslape del 50 %. Nótese que entre 2016-T1 y 2016-T3, la mitad de la muestra se conserva puesto que $a1$ y $c1$ se repiten. Este mismo patrón se encuentra a lo largo del esquema rotacional. - Entre el primer y el cuarto periodo se tendrá un 25 % de traslape. Nótese, por ejemplo, que entre 2017-T1 y 2017-T4, $a2$ se repite; de la misma manera, entre 2017-T4 y 2018-T3, $d3$ se repite. - Finalmente entre el primer y quinto periodo no se tiene ningún tipo de traslape.

Cuadro 2.7: Rotación de paneles en un diseño $4(0)1$.

Año	Trimestre	A	B	C	D
2016	T1	$a1$	$b1$	$c1$	$d1$
	T2	$a1$	$b2$	$c1$	$d1$
	T3	$a1$	$b2$	$c2$	$d1$

Año	Trimestre	A	B	C	D
2017	T4	$a1$	$b2$	$c2$	$d2$
	T1	$a2$	$b2$	$c2$	$d2$
	T2	$a2$	$b3$	$c2$	$d2$
	T3	$a2$	$b3$	$c3$	$d2$
	T4	$a2$	$b3$	$c3$	$d3$
2018	T1	$a3$	$b3$	$c3$	$d3$
	T2	$a3$	$b4$	$c3$	$d3$
	T3	$a3$	$b4$	$c4$	$d3$
	T4	$a3$	$b4$	$c4$	$d4$

Los diseños de las encuestas de hogares deben tener en cuenta la rotación de los paneles y el número de veces que es visitado un hogar. Esta caracterización depende directamente de los indicadores a los cuales la encuesta debe responder. Por ejemplo, el diseño de rotación debe ser diferente si el interés se centra en indicadores de cambio trimestral, a si se requieren indicadores de cambio anual. Por ejemplo, si el objetivo está en comparar las estimaciones de la tasa de desocupación el mismo mes entre diferentes años, el diseño 4(0)1 no es conveniente puesto que el traslape anual es nulo. En cualquier caso debe existir un esquema longitudinal, pero la diferencia principal radica en el tiempo en el que un hogar pertenecerá al panel. Por supuesto, hay que tener en cuenta que la tasa de ausencia de respuesta y pérdida de muestra por desgaste del respondiente crecerá en la medida en que se le pida a un hogar una participación más duradera en el tiempo.

La definición de los indicadores de interés debe primar sobre el diseño de las encuestas de hogares. Por ejemplo, si el objetivo de la encuesta se centra en la estimación del cambio del indicador en dos periodos de tiempo, entonces el cálculo de la precisión de las estimaciones debe tener en cuenta que las muestras no son independientes y por lo tanto se debe calcular la varianza de la primera ronda, la varianza de la segunda ronda y la correlación entre las dos rondas de interés. Estos tres componentes deben intervenir en el cálculo de los coeficientes de variación, así como en la determinación del tamaño de muestra en cada ronda. En efecto, como lo afirma [McLaren and Steel \(2001, pág. 236\)](#), para la estimación de tendencias, definidas a partir de series de tiempo macroeconómicas de los parámetros de interés en los estudios de fuerza laboral, el mejor patrón encontrado es el 1(2)m, en donde la vivienda entra en un primer mes en el panel, se excluye por los siguientes dos meses y este patrón se repite m veces consecutivas. A partir de allí, la vivienda ya no vuelve a ser incluida en el estudio. En resumen, por la naturaleza de las encuestas de hogares en la región, al momento de pensar en incluir o cambiar la estructura rotacional en el sistema de encuestas de hogares, se debería considerar en primer lugar el esquema de repartición mensual de paneles. Una mirada más profunda de este tipo de análisis longitudinales se encuentra presente en los capítulos posteriores de este documento.

IV. Parámetros de interés

Las encuestas son usadas para producir estimaciones de parámetros que describen la situación de una población, respondiendo a los objetivos de la investigación. Por lo general, el conocimiento de la población a cualquier nivel está reflejado en forma de totales, o de funciones de totales. Es por esta razón que este documento se enfoca y profundiza en las características inferenciales de los totales, puesto que la generalización a otros parámetros es inmediata. De esta manera, un **total poblacional** se define como la suma de las observaciones de una variable de interés, notada como y , en la población. Se calcula mediante la siguiente ecuación:

$$t_y = \sum_{k \in U} y_k$$

En donde U hace referencia al universo de estudio, mientras que y_k hace referencia a la variable de interés en el k -ésimo individuo. Por ejemplo, en una investigación social se puede realizar una encuesta para estimar el total de gasto de los hogares de un país en productos específicos de comida y bebidas no alcohólicas. En este ejemplo, la población U corresponde a los hogares, mientras que la variable y corresponde al gasto en comida y bebidas no alcohólicas, que es observada en el k -ésimo hogar, y notada como y_k .

Un caso particular de este parámetro es el **tamaño poblacional** que mide la cantidad de unidades que conforman una población y se denota como N . Por lo general, este parámetro es regularmente conocido, o al menos se tiene una aproximación de esta cantidad. En una encuesta de hogares, este parámetro podría denotar el número de hogares en el país - el cual no es conocido literalmente, aunque sí se conocen aproximaciones (o proyecciones) a esta cantidad con base en los resultados de los censos de población y vivienda - o el número de habitantes del país - el cual tampoco es conocido exactamente, aunque sí se cuente con proyecciones poblacionales. Este parámetro también toma la forma de un total poblacional:

$$N = \sum_{k \in U} 1$$

Tal vez el parámetro más relevante en la investigación social lo constituye el **promedio poblacional** que describe la cantidad que debería ser asignada a cada individuo de la población si hubiese una asignación equitativa de la variable de interés. De esta forma, el promedio se define como la suma de las observaciones de la variable en la población dividida por el tamaño poblacional N y se calcula mediante la siguiente expresión:

$$\bar{y}_U = \frac{t_y}{N}$$

Por ejemplo, en una encuesta de hogares es posible estimar el ingreso medio de la población, definido como el total de los ingresos de todos los hogares del país dividido entre el número de habitantes del país. En este caso la variable de interés y es el ingreso per cápita. De la misma forma, también se podría estimar el gasto promedio de los hogares en educación; en donde la variable de interés y es el gasto de todos los miembros del hogar en este concepto (sin importar la edad ni el nivel propedéutico) y N sería el número de hogares del país.

Un parámetro que es de particular interés es el **tamaño absoluto de un dominio poblacional** que mide la cantidad de unidades que conforman una subpoblación de interés U_d y que se denota como N_d . Por ejemplo, en las encuestas de fuerza laboral, es muy importante estimar con una alta precisión el número de personas que están desocupadas en un periodo de tiempo, y comparar su evolución a través del tiempo. En este caso, la subpoblación de interés, o dominio poblacional, estará definida por los desocupados. Nótese que este parámetro está definido como un total sobre una variable dicotómica z_{d_k} que toma el valor de 1, si el k -ésimo individuo tiene el atributo de interés y de 0, en otro caso. Este parámetro se calcula de la siguiente manera:

$$N_d = \sum_{k \in U} z_{d_k} = \sum_{k \in U_d} 1$$

De la misma forma, la incidencia relativa de los fenómenos sociales sobre los hogares o personas puede ser medida a través de la **proporción de un dominio poblacional**. Por ejemplo, la proporción de personas en condición de pobreza o de pobreza extrema son proporciones sobre toda la población, en donde la variable de interés z_{d_k} indica si el ingreso per cápita de un individuo es menor que la línea de pobreza; CEPAL (2018) presenta los pormenores metodológicos del cálculo de la pobreza en los países de América Latina y el Caribe. Este parámetro se calcula mediante la siguiente ecuación:

$$P_d = \frac{N_d}{N}$$

Finalmente, la **razón poblacional** se calcula como el cociente entre dos totales, el primer total t_y asociado a una variable de interés y , el segundo total t_x asociado a una variable de interés x . Por ejemplo, en la medición del mercado de trabajo, la tasa de desocupación es una razón entre el total de personas desocupadas y el total de personas activas. Nótese que para clasificar a una persona como desocupada, ocupada, activa o inactiva, es necesario realizar una indagación en la encuesta a cada uno de los miembros del hogar; por lo tanto ambas cantidades, numerador y denominador, corresponden a cantidades desconocidas de antemano. Es más, la condición de ocupación de las personas puede variar entre los periodos de observación. Este parámetro se calcula mediante la siguiente expresión:

$$R_U = \frac{t_y}{t_z}$$

En efecto, los indicadores de pobreza pueden expresarse como razones poblacionales; es el caso de la brecha de pobreza y de la incidencia de la pobreza expresada en términos de un umbral de poder adquisitivo (Foster et al., 1984). Este tipo de indicadores complejos se pueden expresar mediante la siguiente relación

$$F_\alpha = \frac{1}{N} \sum_U \left(\frac{u - y_k}{u} \right)^\alpha$$

En donde y_k determina el ingreso del individuo k , u se refiere al umbral que establece la línea de pobreza y $\alpha \geq 0$. Por ejemplo, en el caso en el que $\alpha = 0$, este indicador calcula la tasa de pobreza, que es la incidencia de este fenómeno en la población; si $\alpha = 1$, este indicador calcula la brecha de la pobreza, que es la cantidad de dinero que se necesitaría en promedio para que un país no tuviera personas en situación de pobreza. Por último si $\alpha = 2$, este indicador medirá la severidad de la pobreza, como una combinación entre la incidencia de la pobreza de los hogares, la brecha absoluta de ingreso de los hogares en situación de pobreza y la desigualdad de ingresos entre los hogares en situación de pobreza.

En este punto vale la pena resaltar que, en la definición de los parámetros básicos que se quieren estimar en una encuesta, el papel de los totales poblacionales es absolutamente relevante. De igual manera, existen otros parámetros que pueden ser considerados complejos - no por su forma funcional, sino por los procesos complejos que hay detrás del levantamiento de la información primaria - pero que al igual que los mencionados anteriormente resultan ser también una función de totales poblacionales. Por ejemplo, considere el **cambio neto** de los totales de la variable de interés y en dos periodos de tiempo (t_1 y t_2) dado por la siguiente expresión:

$$\Delta_y = t_y^2 - t_y^1$$

Este tipo de parámetros son muy comunes en las encuestas que se realizan para conocer la estructura y los cambios del mercado de trabajo. Por ejemplo, la siguiente tabla muestra la composición del mercado de trabajo en una población observada en dos periodos de interés (las cifras están en millones). De esta forma, los totales marginales de la tabla corresponden a los **cambios netos** que permiten una comparación simple con el periodo anterior. Específicamente, es posible observar que hay 313 mil empleados menos, 80 mil desempleados menos y 393 mil inactivos más en el segundo periodo, en comparación al primero.

Cuadro 2.8: *Composición del mercado de trabajo en dos periodos de tiempo*

Condición	Ocupado	Desocupado	Inactivo	Total
Ocupado	9222	128	662	10012
Desocupado	221	322	151	694
Inactivo	256	164	5941	6361
Total	9699	614	6754	17067

Una comparación más profunda está dada en términos de los **cambios brutos**, que corresponden a las entradas de la tabla cruzada. De esta manera, los cambios en la fuerza de trabajo de un periodo a otro, se explican porque el 92.1 % $= (9222/10012) \%$ de los empleados conservó su empleo; el 31.8 % de los desempleados y el 4.0 % de los inactivos consiguió un nuevo empleo; el 6.6 % de los empleados es ahora inactivo en la fuerza laboral y el 1.3 % de los empleados perdió su empleo. Así mismo, el 46.4 % de los desempleados conservó su clasificación; el 1.3 % de los empleados perdió su empleo y el 2.6 % de los inactivos entró a la fuerza laboral como desempleado; el 31.8 % de los desempleados es ahora empleado y el 21.8 % de los desempleados es ahora inactivo.

A. Ejemplos de indicadores de interés y su relación con los tipos de encuestas

En esta sección se relacionan algunos de los parámetros anteriormente mencionados con los tipos más comunes de encuestas. Estos ejemplos nos presentan algunas indicaciones del tipo de encuestas que se encuentran en América Latina y examinan el raciocinio detrás de estos levantamientos. Tomando en consideración las características generales de las encuesta de hogares, [Duncan and Kalton \(1987\)](#) mencionan las siguientes situaciones, ejemplificadas a continuación.

- **Estimación de parámetros poblacionales en un punto del tiempo.** Por ejemplo, suponga que se quiere estimar el *ingreso per cápita promedio por área (rural - urbano) en las regiones de un país*. En este tipo de estudios, la encuestas aptas serían las transversales, las repetidas, las de panel rotativo y las de panel dividido. Nótese que las encuestas de panel puro no son aptas para estimar este parámetro puesto que la muestra no es representativa de la población en el momento actual, sino que, por el contrario, es representativa de la población en el momento en la cual se extrajo la muestra.
- **Estimación de cambios netos.** Si se quisiera estimar la *diferencia en el número de ocupados de la fuerza de trabajo entre el segundo trimestre de 2021 y el primer trimestre de 2021 en un país*, entonces las encuestas aptas serían las repetidas, las de panel rotativo y las de panel dividido. Una encuesta transversal no sería apta para lograr esta estimación, puesto

que su frecuencia de realización no es trimestral. De la misma forma que en el parámetro anterior, las encuestas de panel puro no son aptas para captar este parámetro puesto que la muestra no es representativa de la población en el momento actual.

- **Estimación de cambios brutos y componentes individuales.** Para estimar el *porcentaje de personas ocupadas en el segundo trimestre de 2021 que estuvieron desocupadas en el primer trimestre de 2021 en un país* es necesario que la encuesta tenga algún patrón de selección de los mismos individuos en los dos periodos. De esta forma, las únicas encuestas aptas para estimar este tipo de cambios brutos son las de panel, panel rotativo y panel dividido. Las encuestas transversales o repetidas no podrían arrojar este tipo de estimativas puesto que su diseño no considera a los mismos individuos en la muestra en dos periodos de tiempo.
- **Estimación de la incidencia de eventos en un periodo de tiempo.** Suponga que se quiere estimar la *proporción de mujeres que fueron víctimas de un evento de violencia en los últimos seis meses en un país*. En este caso todas las encuestas resultarían aptas mediante ligeras modificaciones en el diseño. Por ejemplo, la encuesta transversal debería preguntar de forma retrospectiva; las encuestas repetidas podrían ser agregadas en los últimos seis meses, las encuestas de tipo panel rotativo y divididas deberían preguntar en cada medición de los últimos seis meses por este evento.
- **Estimación de la incidencia de eventos raros en el tiempo.** Por ejemplo, si se quisiera estimar la *proporción de personas con una enfermedad rara*, es posible que las encuestas transversales y de tipo panel no sean las más apropiadas. En el primer caso, dado que el evento es raro por definición, los requerimientos de tamaño de muestra en una encuesta transversal sobrepasarían el presupuesto y los costos de una encuesta regular; en el segundo caso, además de las consideraciones anteriormente planteadas del tamaño de muestra, por la misma definición de evento raro, tampoco sería plausible que en el panel se presentaran estos eventos en los individuos a través del tiempo. Por otro lado, al agregar las encuestas repetidas, las de panel rotativas y la parte nueva del panel dividido, podría ser posible llegar al tamaño de muestra adecuado para poder captar esta incidencia de forma precisa y eficiente.

Estos últimos ejemplos muestran la importancia de contar con procedimientos adecuados de acumulación de datos y encuestas a lo largo de un periodo de interés, por ejemplo de forma anual o semestral. La acumulación de datos genera una buena base inferencial para poder estimar todo tipo de parámetros en una ventana más amplia del tiempo. Es posible acumular datos eficientemente por medio de la agregación de encuestas repetidas. De esta forma se definiría una agregación de datos vertical que añade filas, puesto que en cada levantamiento aparecen nuevos individuos, dado que el diseño de las encuestas repetidas selecciona diferentes individuos en cada punto del tiempo. Este es el caso de la *Gran Encuesta Integrada de Hogares de Colombia* que está diseñada para tener representatividad

a niveles de desagregación mayores, juntando los individuos observados en los doce levantamientos continuos en un año.

Por otro lado, las encuestas de panel permiten un tipo diferente de agregación, no basado en individuos, sino en variables en el tiempo. A diferencia de las encuestas repetidas, las encuestas de panel, panel rotativo o panel dividido permiten observar a los individuos en diferentes periodos de tiempo y la agregación puede hacerse de forma horizontal, manteniendo a los individuos en las filas y añadiendo columnas cada vez que se observe una nueva medición en un periodo de tiempo diferente.

Capítulo 3

Definición del marco muestral

Todo procedimiento de muestreo probabilístico requiere de un dispositivo que permita identificar, seleccionar y ubicar a todos y cada uno de las unidades pertenecientes a la población objetivo, las cuales posteriormente participarán en el proceso de selección aleatoria que definirá la muestra. Este dispositivo se conoce con el nombre de **marco de muestreo**. En general, sin esta herramienta no es posible realizar ningún procedimiento de muestreo probabilístico, y es por esto que la etapa de definir y alistar un buen marco de muestreo es tomada con bastante rigurosidad en las ONE.

I. El marco de muestreo

Cuando se dispone de un marco de elementos, se puede aplicar un diseño de muestreo de elementos; en muchas ocasiones se utilizan diseños de muestreo de conglomerados aunque se disponga de un marco de elementos. Si no se dispone de un marco de elementos (o es muy costoso construirlo) se debe recurrir a diseños de muestreo en conglomerados; es decir, que se utilizan marcos de conglomerados. Por ejemplo, al realizar una encuesta cuya unidad de observación sean las personas que viven en una ciudad, es muy difícil poder acceder a un marco de muestreo de las personas. Sin embargo, se puede tener acceso a la división cartográfica de la ciudad y así seleccionar algunas comunas, localidades, o barrios de la ciudad, en una primera instancia, para luego, seleccionar a las personas en una segunda o tercera instancia. En el ejemplo anterior, las comunas, localidades, o barrios son un ejemplo claro de conglomerados. Estas agrupaciones de elementos tienen la característica de aparecer naturalmente.

Cuando se dispone de listados de unidades, por ejemplo, el listado de empleados de una entidad, es posible aplicar un diseño de muestreo de elementos, realizar la

correspondiente selección aleatoria y de acuerdo a ese mismo diseño realizar las estimaciones necesarias. Sin embargo, al realizar la planeación de una encuesta de hogares, es muy poco probable que se utilicen marcos de elementos, a no ser que el muestreo definido sea en dos fases: con una primera fase de selección de hogares y enlistamiento de personas o unidades, y una segunda fase de selección de personas o unidades. Por ejemplo, El INEC de Costa Rica realiza la Encuesta Nacional de Microempresas de los Hogares con base en la muestra de la Encuesta Nacional de Hogares (primera fase), en donde se identifican las actividades económicas de los respondientes y se enlistan los trabajadores autónomos. En una segunda fase se selecciona una submuestra con base en este marco de elementos. Cuando no existe un marco de muestreo disponible es necesario construirlo. Existen dos tipos de marcos de muestreo, a saber:

1. **De Lista:** listados físicos o magnéticos, ficheros o archivos de expedientes que permiten identificar y ubicar a los objetos que participarán en el sorteo aleatorio.
2. **De Área:** mapas de ciudades y regiones en formato físico o magnético, fotografías aéreas, imágenes de satélite o similares que permiten delimitar regiones o unidades geográficas en forma tal que su identificación y su ubicación sobre el terreno sea posible.

Es una virtud del marco si contiene *información auxiliar* que permita aplicar diseños muestrales y/o estimadores que conduzcan a estrategias de muestreo más eficientes con respecto a la precisión de los resultados. O también si la información auxiliar¹ está organizada por órdenes deseables. La información auxiliar *discreta* en el marco de muestreo permite la desagregación de la población objetivo en categorías o grupos poblacionales más pequeños. Por ejemplo, nivel socioeconómico, región, departamento, etc. Por otro lado, la información auxiliar *continua*, en forma de una o varias características de interés de tipo continuo y positivas, que esté altamente relacionada con la característica de interés permitirá mejorar la eficiencia de la estrategia de muestreo. Por otra parte, un marco de muestreo es defectuoso si presenta alguno o varios de los siguientes casos:

1. **Sobre-cobertura:** se presenta si en el dispositivo aparecen objetos que no pertenecen a la población objetivo. *No son todos los que están.*
2. **Sub-cobertura:** se da cuando algunos elementos de la población objetivo no aparecen en el marco de muestreo o cuando no se ha actualizado la entrada de nuevos integrantes. *No están todos los que son.*
3. **Duplicación:** se presenta si en el dispositivo aparecen varios registros para un mismo objeto. La razón más frecuente para la presencia de este defecto es la construcción no cuidadosa del marco a partir de la unión de registros administrativos de dos o más fuentes de información.

Estos defectos ocasionan errores en el cálculo de las expresiones que se utilizarán

¹Toda información disponible a nivel poblacional o para todos y cada uno de los elementos del universo afecta directamente la estrategia empleada para obtener los objetivos de la investigación. Con respecto a la información auxiliar que pueda existir para cada elemento de la población es deseable que esté bien correlacionada con la variable de interés.

para generar las correspondientes estimaciones, generando sesgo, pérdida de precisión y, en algunos casos, que los resultados del estudio se pongan en entredicho. No obstante, una vez que se ha definido el marco de muestreo, este empieza un periodo de decaimiento de su calidad y envejecimiento, conllevando dificultades en la realización de las encuestas de hogares que lo utilizan. Es por esta razón que, a partir de la realización de los censos de población y vivienda, las ONE actualizarán sus marcos de muestreo.

En resumen, el marco de muestreo es cualquier dispositivo o mecanismo usado para obtener acceso observacional a la población de interés, para identificar y seleccionar una muestra, de manera que respete el esquema de muestreo probabilístico y para establecer contacto con los elementos seleccionados, de manera presencial, por correo postal, por correo electrónico, o mediante procedimientos automatizados como los sistemas de captura CAPI o CATI.

Por otro lado, recordando que la población objetivo constituye el conjunto de elementos sobre la cual se desea información y se requieren estimaciones exactas y precisas acerca de sus parámetros, entonces la población del marco es el conjunto de todos los elementos que son enlistados directamente como unidades en el marco o identificados mediante un marco más complejo, tal como un marco para selección en varias etapas. Además, los elementos son las entidades que componen la población y las unidades de muestreo son las entidades del marco muestral. Cuando no hay uno disponible, es posible construirlo. Luego, las siguientes características son deseables para un marco de muestreo:

- Que las unidades en el marco son identificados con un serial.
- Que cualquier unidad puede ser ubicada (dirección, teléfono).
- Que se pueda ordenar sistemáticamente (geografía, tamaño).
- Que contenga información adicional para cada unidad.
- Que especifique el dominio geográfico o socioeconómico al cual pertenece cada unidad.
- Que cada elemento de la población está presente sólo una vez.
- Que no contenga elementos que no estén en la población.
- Que todos los elementos de la población de interés estén en el marco muestral.

La calidad del marco puede ser medida mediante la relación que existe entre la población objetivo y la población del marco. Esto quiere decir que la población enmarcada y la población de interés no siempre van a coincidir plenamente.

En las encuestas de hogares que precisan de un marco de áreas para su realización, el proceso de selección sistemática de los hogares necesita contar con un marco de muestreo que sirva de vínculo entre los hogares y las unidades de muestreo de las primeras etapas y que permita tener acceso a la población de interés. Como lo afirma [Gutiérrez \(2016\)](#), el marco de muestreo más utilizado en este tipo de encuestas es de áreas geográficas que vinculan directamente a los hogares o personas con un listado de divisiones cartográficas completamente exhaustivas. Por esta razón, los diseños de muestreo de estas encuestas se apoyan en la

aglomeración natural de los hogares en segmentos cartográficos, que a su vez están contenidos en agrupaciones mayores. ¿Cómo se aglomeran las personas y cómo podemos realizar un diseño de muestreo con base en esta forma de aglomeración? Pues bien, las personas se aglomeran en hogares, los cuales a su vez se aglomeran en comunidades más grandes: barrios, comunas, segmentos. Estas comunidades forman ciudades, veredas, centro poblados, etc. y la reunión de estas divisiones da como resultado el conjunto completo de unidades de interés en el país.

Por lo tanto, a pesar de que ningún país tiene a disposición una lista actualizada de todos los hogares junto con su ubicación e identificación, sí existe en todos los países listas de los segmentos cartográficos presentes en las zonas urbanas y rurales, que son actualizadas en cada censo. De esta forma, si se selecciona de forma probabilística una muestra de sectores y dentro de cada sector se selecciona de forma probabilística una muestra de hogares, entonces de forma indirecta estaremos seleccionando una muestra de hogares que puede representar la realidad de todo un país.

II. Los censos y su incidencia en los marcos de muestreo

Como se mencionó anteriormente, una característica esencial de los diseños de las encuestas de hogares es que la selección de las unidades finales de muestreo debe surtir varias etapas, de acuerdo a las agrupaciones definidas en los marcos de muestreo, que usualmente son marcos de área obtenidos de la división geográfica del país, región o municipio en áreas menores mutuamente excluyentes. Los institutos de estadística en América Latina hacen grandes esfuerzos para mantener actualizados sus marcos de muestreo. Por ejemplo, la *Encuesta Nacional de Hogares* de Costa Rica utiliza un marco muestral construido a partir de los censos nacionales de población y vivienda de 2011 y corresponde a un marco de áreas en donde sus unidades son superficies geográficas asociadas con las viviendas. Este marco en particular permite la definición de UPM con 150 viviendas en las zonas urbanas y 100 viviendas en las zonas rurales. En general, el marco está conformado por 10461 UPM (64.5% urbanas y 35.5% rurales). [Gambino and Silva \(2009\)](#) mencionan que, en la práctica, la consecución de los marcos de lista de los hogares en la última etapa del muestreo puede tornarse difícil puesto que dentro del conglomerado no es obvio observar de manera exhaustiva los hogares, especialmente cuando la frontera del conglomerado es una línea imaginaria. Por ejemplo, en la mayoría de casos, en el sector urbano, la distinción entre dos conglomerados está demarcada claramente por las calles que conforman la ciudad o el centro poblado; sin embargo, en la ruralidad, no solamente los caminos existentes sirven para delimitar los conglomerados. De la misma manera, esta delimitación se torna compleja cuando han ocurrido cambios en la infraestructura del área y aparecen nuevas construcciones.

II. LOS CENSOS Y SU INCIDENCIA EN LOS MARCOS DE MUESTREO 43

Observe que, en general, ante el estudio de un fenómeno social, las desagregaciones geográficas más amplias constituyen un interés natural para los usuarios de las encuestas; es así como los investigadores que planean las encuestas quisieran poder desagregar la información por las regiones geográficas más grandes, que a su vez tienen cierta independencia política y administrativa. Las estadísticas nacionales que se publican a partir de las encuestas de hogares cobran mayor relevancia a nivel de regiones, estados o departamentos. Este tipo de desagregaciones se conocen con el nombre de *dominios de representación*, que a su vez son agregaciones de los *estratos de muestreo*. Los diseños de las encuestas de hogares han ido evolucionando para permitir que este tipo de subpoblaciones tenga representatividad en la encuesta. Aunado a lo anterior, si la característica de interés con la cual se planea la encuesta hace que la distribución de la población sea altamente sesgada, como en el caso de los ingresos o gastos, es recomendable crear estratos de inclusión forzosa con las unidades más importantes en la población. Esta práctica asegura que el error de muestreo sea más bajo.

En promedio, los países de la región realizan los censos cada diez años, aunque en algunos casos este periodo se extiende de forma desafortunada. En este levantamiento masivo de información se enlistan todos los hogares del país, se enumeran todos los habitantes del país y se observan algunas variables de interés que servirán a su vez para asentar las bases de comparación de las cifras en los siguientes diez años. El periodo que existe entre la realización de dos censos se denomina *periodo intercensal* y en este se realizan encuestas de hogares de diferentes constructos económicos y sociales. Los Institutos Nacionales de Estadística (INE) utilizan las particiones geográficas y cartográficas generadas en el levantamiento del censo con el fin de seleccionar, mediante diseños en varias etapas, muestras de hogares. Comúnmente, estas particiones reciben el nombre de secciones cartográficas y están formadas por un número determinado de hogares contiguos. En adelante nos referiremos a estas particiones como Unidades Primarias de Muestreo (UPM), la cuales en el área urbana, pueden ser manzanas o agregaciones de manzanas, y en área rural pueden ser veredas o sectores censales definidos de antemano.

Algunos países hacen uso de la información censal para definir una estratificación socio económica sobre los segmentos cartográficos del marco de muestreo utilizando para tal fin la información recolectada en el censo de población más reciente. Esta práctica representa una ventaja metodológica porque, en la mayoría de encuestas, los parámetros de interés tienen un comportamiento estructural diferente en cada uno de los subgrupos poblacionales creados, tendiendo a tener una mayor precisión en la estimación de los parámetros de interés. Por ejemplo, a partir del censo, es posible crear un índice de condiciones de vivienda y/o bienestar (teniendo en cuenta las definiciones de las necesidades básicas insatisfechas o la pobreza multidimensional) para definir grupos de viviendas mutuamente excluyentes, que contengan viviendas parecidas dentro de ellos, pero que entre ellos sean muy disimiles. De esta forma, es posible estratificar los sectores cartográficos de todo un país y generar estimaciones más precisas de los indicadores sociales (como desocupación, pobreza, ingreso medio, etc.).

Para el caso de la *Gran Encuesta Integrada de Hogares* en Colombia, los criterios de estratificación forman dos grupos: el primero correspondiente a las 24 capitales junto con sus correspondientes áreas metropolitanas y el segundo correspondiente al resto de cabeceras municipales, centros poblados y la ruralidad dispersa. Además, la encuesta también contempla criterios de estratificación económica a nivel municipal como nivel de urbanización y estructura de la población, basada en la proporción de habitantes con necesidades básicas insatisfechas. De la misma manera, el diseño de la muestra maestra del Instituto Nacional de Estadística y Geografía de México contempla este tipo de estratificación basada en los indicadores generados con la información del Censo de Población y Vivienda 2010. Previo al proceso de estratificación sociodemográfica, fue necesario construir y seleccionar una serie de variables que lograran, en conjunto, separar el universo de UPM en agrupaciones que mejoraran las principales estimaciones de las diferentes encuestas usuarias del Marco de Muestreo (INEGI, 2012).

Ante la ausencia de un marco de muestreo de hogares y personas en los países de la región, el diseño de las encuestas de hogares se dice complejo puesto que involucra varias etapas de selección y estratificación. Por ende, los marcos de muestreo están conformados por unidades primarias de muestreo (UPM) que se definen como segmentos cartográficos individuales, como una agrupación de segmentos o incluso como una división de segmentos masivos. Por ejemplo, tomemos en consideración el estrato urbana, en donde las UPM corresponden a manzanas (o agregaciones o particiones de manzanas), mientras que en el caso rural, las UPM corresponden a comunidades (o agregaciones o particiones de comunidades). En cualquier caso, la unidad de observación está constituida por las viviendas ocupadas particulares donde residen personas. En general, salvo en algunos países, las UPM no tienen el mismo tamaño dentro de los estratos; es decir no están constituidas por un número igual de viviendas. El caso es más evidente en la ruralidad, en donde podría ocurrir que una única UPM agrupe un conjunto de viviendas con demasiada heterogeneidad y una alta dispersión geográfica. Es así como es posible encontrar UPM con pocas viviendas o UPM con demasiadas viviendas. Esto constituye una desventaja técnica a la hora de establecer metodologías apropiadas para la recolección de la información primaria y además para la estimación de los errores de muestreo que se derivan de las encuestas de hogares y por esto algunos países están considerando la re-definición de las UPM como unidades con un número uniforme de viviendas.

Como se indicó anteriormente, es usual que tras el levantamiento de un nuevo censo se actualice el marco de muestreo con el que se seleccionarán las viviendas y hogares para todas las encuestas subsiguientes. Por la naturaleza de los censos, los INE deben recorrer la geografía de los países produciendo una nueva cartografía que derivará en la actualización de los marcos de muestreo. Por ejemplo, considere un país que cuente con un marco de muestreo que consta de diez mil UPM y, para cada una de estas deberá ser clasificada por medio de una estratificación socioeconómica que estará basada en la información recolectada en el último censo de población y vivienda. Kish (1965, pág. 183) afirma que la selección de UPM con tamaño desigual acarrea algunos problemas técnicos como que el

tamaño de muestra final se convierte en una variable aleatoria, que depende de la probabilidad de selección de las UPM más grandes o más pequeñas. Lo anterior aumenta la incertidumbre en el costo final del operativo, pues si en una primera instancia se seleccionan UPM con pocas viviendas, será necesario volver a realizar un proceso adicional de selección de nuevas UPM para cumplir con la cuota de viviendas.

Con base en lo anterior, se esperaría que la actualización de la cartografía y de los marcos de muestreo se realizara mínimo cada diez años. Es importante que estas actualizaciones conlleven a una definición de los marcos de muestreo que permitan tener mayor fluidez en los procesos logísticos de selección de hogares y que induzcan una mejora en la precisión de las estimaciones de los parámetros de interés. Por ejemplo, una forma muy conveniente de abordar este desafío es creando UPM que contengan, en la medida de lo posible, un mismo número de viviendas y, de esta manera, mantener una distribución uniforme en cada estrato. Siguiendo el consejo de Valliant et al. (2013, pág. 212), si el equipo de planeación de la encuesta tiene la flexibilidad de definir las UPM, como usualmente es el caso en las encuestas de hogares, entonces las UPM definitivamente deberían estar conformadas por una cantidad igual de viviendas.

III. Construcción de las UPM

Un primer acercamiento a la definición de las UPM es establecer la unión o colapso de los mismos lugares poblados, sectores o secciones cartográficas, o áreas de empadronamiento vinculados a los censos de población y vivienda, como Unidades Primarias de Muestreo (UPM). Como se discutió anteriormente, el objetivo del marco es tratar de proveer la mejor información de en la selección de las unidades, reduciendo la variabilidad de la estrategia de muestreo.

Después de revisar minuciosamente los conjuntos de datos censales y la información cartográfica del censo en los niveles básicos (en adelante, y sin pérdida de generalidad, lo llamaremos secciones censales) es necesario construir un algoritmo que permitía crear UPM desde la cartografía, basado en uniones contiguas de secciones censales, que respeten los siguientes principios:

- La conformación de las Unidades Primarias de Muestreo (UPM) excluye todas las estructuras que no contienen hogares particulares ocupados.
- Las nuevas UPM inducidas por la unión de sectores censales deben estar contenidas de manera en un sólo municipio del país; es decir no podrán definirse UPM que pertenezcan a dos o más municipios.
- De la misma forma, debe haber una diferenciación estricta en las áreas urbanas y rurales. Ninguna UPM podrá estar definida en ambas áreas.

Nótese que siempre será necesario realizar una actualización de las viviendas con hogares particulares ocupados en las UPM seleccionadas en la primera etapa de muestreo. Esta actualización dará lugar al cálculo de las probabilidades de inclusión de segunda etapa, sin la cual no se podrían calcular factores de

expansión que induzcan el insesgamiento de los estimadores utilizados en las encuestas de hogares. Dado que este proceso es sistemático y debe ser realizado a lo largo del periodo intercensal, contar con UPM demasiado grandes (como lo pueden llegar a ser los Sectores Censales y/o los Lugares Poblados) no es una alternativa viable presupuestariamente puesto que se incrementarían los costes asociados a la actualización y no habría uniformidad en los procesos de muestreo.

Usualmente el tamaño de las UPM en América Latina ronda el rango de 75 a 225 viviendas. Para que exista una mayor eficiencia (logística y estadística) a la hora de realizar un muestreo en dos etapas, se recomienda que las UPM conformadas tengan algún grado de explicación con respecto a las características de interés que se quieren medir en la población. Por consiguiente, es necesario revisar los tamaños de estas agregaciones y su comportamiento en términos del *coeficiente de correlación intraclase* (ICC). Como se puede notar en [Cochran \(1977\)](#) y [Gutiérrez \(2016\)](#), en la construcción de las UPM, el parámetro predominante que se debe considerar es ICC, que para la realización de encuestas con selección en múltiples etapas puede ser aproximado mediante la siguiente expresión ([Valliant et al., 2013](#))

$$\delta = \frac{B^2}{B^2 + W^2}$$

En donde B^2 es la varianza relativa de los totales de la característica de interés entre las UPM y W^2 es la varianza relativa de los totales de la característica de interés dentro las UPM. El ICC es una medida de homogeneidad entre las variables que se desean medir y la conformación de las UPM. Además de afectar la variabilidad del estimador en muestreos multietápicos, esta medida determina el tamaño de muestra necesario para satisfacer los requerimientos de precisión en una encuesta de hogares.

La magnitud del ICC está directamente ligada al tamaño de las UPM. Por ende, en la conformación del marco de muestreo, es necesario ejecutar un algoritmo de control de tamaño de las UPM de tal forma que el ICC sea satisfactorio y coherente en los indicadores censales disponibles, como por ejemplo las dimensiones del índice de necesidades básicas insatisfechas (NBI), los indicadores del mercado de trabajo, los indicadores demográficos, entre otros.

En general, cuando el tamaño de las UPM es muy pequeño, las características de los elementos dentro de las UPM serán muy similares (sobre todo para indicadores socioeconómicos); por otro lado, si el tamaño de las UPM es demasiado grande, las características de los elementos serán más heterogéneas. Nótese que la disparidad en los tamaños de las UPM redundará en que los totales de las características de interés serán muy disímiles entre las UPM generando más varianza en el componente B^2 , por ende el ICC será más grande y se perderá precisión en el muestreo multietápico.

[Valliant et al. \(2013\)](#) afirman que la práctica estándar es combinar las secciones pequeñas o grupos de bloques que se ubican geográficamente para que todas

las UPM tengan un número mínimo de personas. Dado que la variación en los tamaños de las UPM tiene un efecto marcado en el ICC (medida necesaria para diseñar una muestra), y que en el caso de las encuestas de hogares se puede tener una cierta flexibilidad en la formación de estos grupos, entonces las UPM deberían conformarse con un número casi igual de viviendas. En general el proceso de construcción de las UPM debería tener en cuenta las siguientes características:

1. *Límites y contención*, pues las UPM deben estar contenidas dentro de límites departamentales, municipales, y estar diferenciadas por su naturaleza urbana o rural.
2. *Tamaño y extensión*, pues se debe procurar que las UPM estén dentro de rangos predefinidos en términos del número de viviendas y personas, respetando los límites geográficos, y que su extensión en kilómetros cuadrados no sea superior a un umbral predefinido para el operativo de campo.

De esta forma las cargas de trabajo (en los procesos de actualización, supervisión y levantamiento de la información primaria) serán uniformes. Además las estimaciones resultantes serán óptimas en términos de eficiencia y precisión estadística, puesto que inducirán pesos de muestreo uniformes que minimizarán la varianza de las estimaciones directas. A partir de la información contenida en los censos de población y vivienda, diferentes variables se podrían utilizar para evaluar la idoneidad de las UPM con el coeficiente de correlación intraclase y el efecto diseño DEFF. Por ejemplo, para evaluar la idoneidad de las UPM es posible analizar las siguientes variables agrupadas en los siguientes constructos:

1. Variables demográficas: grupos quinquenales de edad, sexo.
2. Necesidades básicas insatisfechas y sus dimensiones (acceso a la vivienda, acceso a servicios sanitarios, acceso a educación, situación en la ocupación y capacidad económica).
3. Variables de fuerza laboral: población en edad de trabajar, población económicamente activa, desocupados y ocupados.

En general, las medidas de correlación intraclase deben ser coherentes con las experiencias locales anteriores o con experiencias regionales que demuestren que el algoritmo de colapso y/o escisión de los sectores censales sí proporcione como resultado nuevas UPM que conserven las propiedades explicativas de los grupos desde el censo, con la ventaja de controlar su tamaño en viviendas.

Hansen et al. (1953) encontraron un efecto marcado en el tamaño de las UPM y la magnitud del ICC. Entre más pequeñas sean los conglomerados mayor será el ICC, entre más grandes sean los conglomerados menor será el ICC. Esta relación tiene una repercusión directa en la forma en que se llevarán a cabo las encuestas en el periodo intercensal. Si se crean UPM demasiado pequeñas, se precisará de un tamaño de muestra mucho mayor, y por ende un mayor coste logístico y económico. Si se crean UPM demasiado grandes, se precisará de un menor tamaño de muestra, pero con UPM inmanejables en su dimensión, que acarrearán operativos de actualización, supervisión y levantamiento demasiado

costosos, junto con una pérdida grande de precisión estadística.

Para ejemplificar la relación entre el ICC y el tamaño de muestra, considere los siguientes escenarios:

1. Si el ICC es cercano a cero, las UPM serán demasiado heterogéneas por dentro y muy homogéneas entre, por tanto se necesitará de muy pocas UPM para tener una inferencia precisa. Esto quiere decir que hay mucha dispersión dentro de las UPM, pero a la vez hay muy poca variación entre ellas. En el caso que el ICC sea idéntico a cero, sólo se necesitaría de una UPM en la muestra para tener una estimación precisa, con un submuestreo exhaustivo de todas las unidades dentro de la UPM (puesto que todas las unidades dentro de la UPM serán diferentes).
2. Si el ICC es cercano a uno, las UPM serán demasiado homogéneas por dentro y muy heterogéneas entre, por tanto se necesitará de una muestra grande de UPM para tener una inferencia precisa. Esto quiere decir que hay poca dispersión dentro de las UPM, pero a la vez hay mucha variación entre ellas. En el caso que el ICC sea idéntico a uno, para obtener una estimación precisa, se necesitaría de una muestra censal de UPM, en donde el submuestreo sea de una sola unidad (puesto que todas las unidades dentro de la UPM serán idénticas).

En resumen, la construcción de las UPM es un proceso que requiere de la más alta disposición de capacidades para que todas las operaciones estadísticas del periodo intercensal sean balanceadas en presupuesto y esfuerzo logístico. La función objetivo de este proceso es el ICC que, como se verá en los capítulos posteriores, determina el tamaño de muestra y la precisión de la inferencia.

Capítulo 4

Metodologías de estratificación

Para aumentar la eficiencia de la inferencia en las encuestas de hogares, es de particular interés que el marco de muestreo permita clasificar a las UPM de acuerdo con su nivel socio-económico con el fin de poder realizar selecciones independientes en cada categoría de la clasificación. De esta forma se garantiza la homogeneidad entre grupos y se disminuye la incertidumbre de la estimación. Este proceso se conoce con el nombre de estratificación.

En la literatura especializada, es posible encontrar varias metodologías que clasifican a cada una de las UPM del marco y a la vez disminuyen la varianza de los estimadores de muestreo. Este capítulo se realiza un resumen no exhaustivo de las principales técnicas utilizadas por los INE de la región, se proponen algoritmos para encontrar la mejor estratificación basada en los datos de los censos y se ilustran los procedimientos computacionales necesarios para implementar esta metodología. Si los estratos están conformados por unidades homogéneas que, a su vez, crean categorías heterogéneas entre sí, entonces se dice que el proceso de estratificación es eficiente y el error de muestreo se verá reducido significativamente.

Luego de definir las UPM en el marco de muestreo es necesario realizar una agrupación de estas de acuerdo con sus características sociodemográficas agregadas con el fin de obtener una partición que conforme grupos homogéneos, que induzcan una mayor precisión en la ejecución de las estrategias de muestreo que se propongan dentro de la planificación de las encuestas de hogares que realizan los INE. Es importante señalar que se debe estudiar una multitud de escenarios de estratificación y para encontrar una óptima clasificación de las unidades primarias de muestreo, puesto que esta partición será utilizada en todas las encuestas de hogares que utilicen este marco de muestreo en el periodo intercensal.

En síntesis, los procesos que intervienen en la estratificación del marco de muestreo son los siguientes:

1. Ejecución de múltiples escenarios de estratificación de las UPM utilizando información agregada del censo¹.
2. Para cada método señalado anteriormente realizar particiones de 3, 4, o 5 grupos en las áreas rural y urbana de forma independiente.
3. A raíz de las pruebas y los escenarios ejecutados, evaluar su efectividad mediante una única medida de calidad, definida como el DEFF generalizado y escoger el mejor escenario en términos de la metodología y del número de particiones.

Este capítulo presenta las diferentes variables utilizadas en el proceso de estratificación; establece la forma de agregación de las variables a nivel de las UPM para mantener una estructura uniforme que permita sacar un mejor provecho a la discriminación entre sus estructuras y por ende una mejor clasificación en los estratos; resume de forma no exhaustiva algunas de las metodologías usadas para la estratificación de marcos de muestreo (teniendo en consideración dos enfoques: univariados sobre medidas de resumen, y multivariados sobre toda la matriz de estratificación); presenta los criterios de evaluación de los métodos de estratificación y los hallazgos en el caso guatemalteco; y muestra un pequeño resumen de los resultados finales de la estratificación del marco de muestreo y expone algunas consideraciones y recomendaciones en el corto plazo.

I. Dimensiones estructurales en el marco de muestreo

El proceso de definición de un diseño de muestreo para las encuestas nacionales que necesita un país para responder a sus necesidades de información con miras en la elaboración de sus políticas públicas involucra varios procesos que hacen uso de los censos nacionales de población y el uso de una cartografía detallada del territorio nacional.

Como se indicó en el capítulo anterior, un aspecto fundamental para el diseño y desarrollo de encuestas de hogares involucra la definición de las UPM, definidas como unidades cartográficas que dividen el territorio nacional y permiten llevar a cabo los procesos de levantamiento de información y de trabajo de campo de la manera más idónea posible, y que además se construyen con el fin de facilitar la obtención de estimaciones precisas y confiables de los indicadores y parámetros de interés que requieren los tomadores de decisiones y expertos en políticas públicas.

Dependiendo de la planificación de las diferentes encuestas, las UPM pueden dar lugar a unidades secundarias de muestreo o permitir la selección directa

¹Aunque también es posible añadir información geoespacial, catastral o de cualquier índole si se tiene una cobertura completa a nivel de las UPM.

de las unidades de análisis como las viviendas, los hogares y/o las personas. Independientemente de las unidades de muestreo y las jerarquías que se definan para llevar a cabo la implementación del diseño de muestreo para las encuestas, es fundamental llevar a cabo un proceso de estratificación de las UPM en grupos que sean en lo posible lo más homogéneos en cuanto a sus características socioeconómicas y de bienestar y que definan una partición del territorio nacional (Gutiérrez, 2016).

Estos grupos se denominan en la literatura estadística como estratos y su unión debe cubrir todo el territorio nacional. Como estos grupos determinan una partición, dos estratos cualesquiera deben ser mutuamente excluyentes. Los INE utilizan las particiones geográficas y cartográficas generadas en el levantamiento del censo con el fin de seleccionar muestras de hogares, mediante la ejecución de diseños de muestreo probabilísticos, estratificados y en varias etapas. En particular, para aumentar la eficiencia de la inferencia en las encuestas de hogares, es de particular interés que el marco de muestreo permita clasificar a las UPM de acuerdo con su estructura socioeconómica, con el fin de poder realizar selecciones independientes en cada categoría de la clasificación.

De esta forma se garantiza la homogeneidad entre estratos y se disminuye la incertidumbre de la estimación. Este proceso se conoce con el nombre de estratificación y es un proceso fundamental para minimizar los errores de muestreo que se obtienen al ejecutar encuestas probabilísticas. En el caso particular de los países latinoamericanos, este proceso se lleva a cabo haciendo uso de la información censal a nivel de personas, hogares y viviendas, en diferentes constructos o dimensiones asociadas a la calidad de vida y bienestar (demografía, características de la vivienda, tenencia de enseres y servicios públicos entre otros). Las variables que se definan sobre estos constructos son agregadas partiendo de variables binarias que toman el un valor de uno, si el fenómeno en cuestión está asociado de forma positiva a mejores condiciones socioeconómicas. Por ejemplo:

- El acceso del hogar a una conexión de internet es una variable de interés en la estratificación puesto que discrimina entre los hogares con mejores condiciones de bienestar. En este caso, la variable se define como uno (1) si el hogar dispone del servicio de internet y cero (0) si el hogar no dispone de dicho servicio.
- La materialidad de los pisos, paredes y techos también es una variable importante en la estratificación de las UPM. Mejores materiales se asocian a una mayor capacidad económica y mejores condiciones habitacionales. Esta variable se definirá como uno (1) si la vivienda no tiene materiales precarios y cero (0) en otro caso.

El proceso anterior se realiza basado en referentes internacionales de calidad de vida y en un análisis exploratorio de datos de las diferentes variables candidatas a participar en el proceso de estratificación. En primer lugar, es necesario tomar en consideración que la estratificación que se pretende realizar debe ser llevada a nivel de las UPM. Esto implica que una vez que las UPM estén categorizadas en algún estrato, todos sus componentes también estarán clasificados en la misma

categoría; por consiguiente, las personas, los hogares y las viviendas de la UPM pertenecerán al estrato en el cual la UPM fue clasificada².

Con la información del censo se deben seleccionar y definir las variables que estén relacionadas directamente con los fenómenos que se estudiarán en las diferentes encuestas de hogares a lo largo del periodo intercensal. Una vez construidas las UPM, se calculan los agregados de las variables seleccionadas en las dimensiones observadas desde los censos, que por lo general son las siguientes:

- *Demografía y estructura de la población*: sexo, edad, parentesco, origen extranjero, pertenencia a grupos indígenas, número de hijos, número de dependientes, etc.
- *Educación*: analfabetismo, asistencia escolar, años de estudios, grado de escolaridad, etc.
- *Mercado de trabajo*: población en edad de trabajar, pertenencia a la fuerza de trabajo por sexo, condición de ocupación por sexo, rama de actividad, etc.
- *Características de la vivienda*: tipo de vivienda, materiales de construcción, hacinamiento, equipamiento, etc.
- *Acceso a servicios básicos*: fuente de agua, alcantarillado, acceso a salud, acceso a seguridad social, etc.
- *NBI o pobreza multidimensional*: viviendas con hacinamiento crítico, servicios inadecuados, alta dependencia económica, niños en edad escolar que no asisten a la escuela, aseguramiento en salud, entre otras.

La caracterización de estas dimensiones lleva a clasificar a las UPM en el marco. Por ejemplo, en la dimensión demográfica, es común que las UPM con mayor número de personas que se identifican como indígenas o pertenecientes a alguna etnia se relacionen con menores niveles de calidad de vida. De la misma manera, con los recientes fenómenos migratorios, las UPM que agrupan a extranjeros latinoamericanos están relacionadas con menores condiciones de bienestar. Asimismo, las UPM con una mayor porcentaje de niños en la primera infancia y con madres cabeza de familia generalmente se asocian a dificultades en su calidad de vida.

De la misma manera a nivel de educación, las UPM con mayores tasas de analfabetismo (que por lo general están en las áreas rurales), y con niños que no asisten a la escuela se asocian a menores condiciones de bienestar; mientras que las UPM que tienen un mayor porcentaje de población con estudios de educación superior (que por lo general se encuentran en las áreas urbanas de las ciudades grandes) se asocian con mayores condiciones de bienestar.

En la dimensión ocupacional, las UPM rurales concentran una alta proporción de población ocupada que no necesariamente muestra mejores condiciones de

²Cabe resaltar que, tomando en cuenta la información recolectada en el censo, es posible también clasificar a las personas o a los hogares en una primera instancia y después agregarlos hasta llegar al nivel de la UPM; sin embargo, en la práctica este proceso puede resultar un poco más complejo y no son claras sus ventajas.

vida. Por otra parte, las UPM que tienen una mayor incidencia de población desocupada y/o mayor proporción de personas dependientes (personas de 0 a 15 años o mayores de 65 años) pueden relacionarse con peores condiciones de vida.

Con respecto a las características de la vivienda, está bien documentado que las UPM con alto porcentaje de viviendas cuyos materiales de construcción de paredes, techos y pisos es precario se asocian con menores condiciones de bienestar y por lo general se presentan con mayor incidencia en las áreas rurales y en las áreas marginales de las zonas urbanas. De la misma manera las UPM que concentran viviendas con hacinamiento (si el número de personas del hogar sobre el número de cuartos es menor a tres) o con acceso inadecuado a las fuentes de agua potable, o con servicios sanitarios y de eliminación de aguas grises deficientes están asociadas a un menor bienestar socioeconómico.

II. Información a nivel de UPM

En primer lugar, es necesario tomar en consideración que la estratificación que se pretende realizar es a nivel de las UPM. Esto implica que una vez que la UPM esté categorizada en algún estrato, todos sus componentes también estarán clasificados en la misma categoría; por consiguiente las personas y los hogares de la UPM pertenecerán al estrato en el cual la UPM fue clasificado. Cabe resaltar que, tomando en consideración la información recolectada en el censo, es posible también clasificar a las personas o a los hogares en una primera instancia y después agregarlos hasta llegar al nivel de la UPM; sin embargo, en la práctica este proceso puede resultar un poco más complejo y no son claras sus ventajas. Por lo anteriormente mencionado, este documento estará enfocado en la clasificación de las UPM a partir de una matriz de información a nivel de esta misma agregación.

Debido a que las UPM tienen, en estricto rigor, tamaños diferentes, la escala y el nivel en el que se midan los indicadores puede afectar los procesos de clasificación. Luego, si la matriz de información con la cual se realiza la estratificación se construye con base en el número de personas (con determinadas características) dentro de la UPM, al no tener en cuenta el tamaño de esta, es muy probable que las metodologías de estratificación no logren agrupar de forma homogénea a las UPM. Por ejemplo, asuma que hay dos UPM con tamaño 100 y 300 hogares, que agrupan a 200 y 400 personas en la fuerza de trabajo, y además suponga que una de las variables de la matriz de información se define como el número de personas ocupadas. A su vez, asuma que la primera UPM pertenece a un sector acaudalado y la segunda UPM pertenece a un sector marginal. Es posible que el número de personas ocupadas en ambas UPM sea de 150 y que por esta razón queden erróneamente clasificadas en el mismo grupo. Por ende, definir la matriz de información en términos relativos (porcentaje de ocurrencia de cada variable) es una mejor alternativa para que el agrupamiento esté controlado por el tamaño de la UPM y supeditado únicamente a cambios estructurales en los constructos de medición del censo.

Por último, una vez que se ha definido el conjunto de variables que entrarán en la matriz de información, es necesario verificar que todos los indicadores de esta matriz apunten hacia el mismo horizonte del constructo censal. Es decir, que **todos** los indicadores estén expresados en términos de acceso al bienestar de cada uno de los constructos. Además, es necesario realizar un proceso de refinamiento sobre esta matriz para eliminar aquellas variables que puedan estar altamente correlacionadas con el resto de las variables o que puedan expresarse como combinación lineal de otras variables. De esta manera, se evitan los problemas de multicolinealidad y se asegura una estratificación parsimoniosa. Al final se debe contar con una matriz de información \mathbf{X} compuesta por P variables, y n_I filas; en donde cada fila de la matriz de información representará la observación de las UPM a nivel censal para cada una de las P variables.

La teoría estadística ha definido que la mejor estratificación es aquella que minimice los errores de muestreo de los estimadores, expresados en forma de varianzas o errores estándar. Además, una particularidad de los procesos de estratificación es que las varianzas de estos estimadores dependen a su vez de la variación de los microdatos a nivel poblacional, que se han observado en el censo. Sin embargo, lo que podría resultar ser una estratificación óptima para una variable tal vez sea, al mismo tiempo, una estratificación pésima para otras variables. Más aun, sabiendo que no todas las variables de interés que se observarán en las encuestas durante el periodo intercensal han sido medidas y observadas en el censo, se debe estudiar muy bien, por medio del estudio de numerosos escenarios, qué estratificación utilizar.

Hay un entendimiento tácito en todos los países de la región, repaldado en mayor o menor grado por evidencia empírica, de que la mayoría de los fenómenos sociales que se observan en las encuestas de hogares están supeditados a la distribución de la población en las UPM. Por ejemplo, si lo que se quiere medir es la informalidad en el mercado de trabajo, seguramente nos encontraremos con que este fenómeno está mucho más presente en aquellas UPM marginales, en donde también estarán presentes otros fenómenos como menos años de educación, menores tasas de acceso a la salud, menores ingresos y gastos, mayores tasas de embarazo adolescente, entre otros. De esta forma es necesario analizar las relaciones e incidencias de cada variable incluida. Por ejemplo:

- Analizar si la proporción de techos y paredes adecuadas se encuentra altamente correlacionada con la proporción de pisos adecuados.
- Tener en cuenta si la proporción de extranjeros es muy poco frecuente y sólo aparecen en algunas UPM muy específicas; en ese caso se recomendaría excluir esta variable dada su falta de discriminación.
- Analizar si la proporción de hogares con computadora y lavadora se correlacionan muy bien con la tenencia de internet y refrigerador, por lo cual estas variables no se considerarían en la matriz de estratificación.
- Evaluar si la tenencia de estufa y radio presentan indicadores muy altos a lo largo de las UPM y no incorporan capacidad de discriminación en el proceso de estratificación.

Este análisis exhaustivo de las características poblacionales indica que existe una alta correlación entre la UPM que se habita y la incidencia de fenómenos sociales y económicos. Por lo tanto, los ejercicios de estratificación que se deben estudiar tendrán una alta consistencia interna, de tal manera que al escoger la mejor estratificación se garantiza que los INE dispondrán de una clasificación óptima en el periodo intercensal para todas las encuestas de hogares que se ejecuten.

En general, hay dos grandes escenarios que deben ser revisados al momento de proponer una estratificación: univariados (sobre una medida de resumen de la matriz de información) y multivariados (sobre todas las variables de la matriz de información). Para cualquiera de estas, se recalca que el objetivo es encontrar la mejor partición que asegure que la varianza de los estimadores de muestreo sea mínima. A continuación, se presentan algunas técnicas que se pueden considerar y que además están disponibles en el software estadístico R mediante las librerías `stratification` (Baillargeon and Rivest, 2011) y `SamplingStrata` (Barcaroli, 2014). En ambos casos existe documentación disponible acerca de cómo utilizar las funciones de estratificación.

III. Metodologías univariadas sobre medidas de resumen

Es bien sabido que la mejor estratificación para una variable de interés es aquella que nace de su propia variación. Durante muchos años, se desarrollaron técnicas de estratificación sobre una sola variable de interés que dejaban de lado el carácter multipropósito de cualquier encuesta de hogares. Por esta razón, se sugiere partir de la matriz de información y resumir la variación y las correlaciones entre variables mediante alguna técnica multivariada de reducción de datos, como componentes principales, análisis factorial, o modelos no lineales. Como la matriz de información está en escala de porcentajes, es posible que la variabilidad recogida por la medida de resumen sea alta.

Por ejemplo, si se utiliza la técnica de componentes principales, entonces se tomaría como medida de resumen el primer componente, que resulta ser función del vector propio asociado al mayor valor propio de la matriz de covarianzas asociada a la matriz de información. Por otro lado, si se utilizara un análisis factorial confirmatorio, la medida de resumen podría ser el eje principal con la carga factorial más alta. La interpretación de estas medidas de resumen es una parte importante en la aplicación de las técnicas de estratificación. Nótese que la matriz de información está construida por cinco constructos censales (*demografía y estructura de la población, educación, mercado de trabajo, características de la vivienda y acceso a servicios básicos*) que deberían ser resumidos en una medida de bienestar de la UPM, que a su vez debe tener sentido en cuanto a la relación (o contribución) de las variables al componente o factor. En adelante, se utilizará la siguiente notación para referirse a la medida de resumen como función de todas las variables incorporadas en la matriz de información:

$$y = f(x_1, \dots, x_P)$$

Nótese que se esperaría que esta variable de resumen, al estar definida como una medida de bienestar sobre las UPM, tuviera un comportamiento sesgado, tal como se puede observar en la siguiente figura.

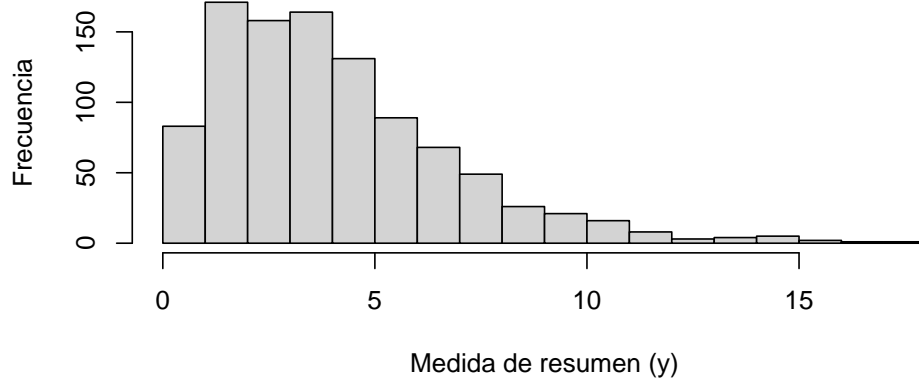


Figura 4.1: *Histograma de la medida de resumen (y) sobre las UPM*

Por ende, si esta característica es altamente sesgada, es recomendable crear un estrato de inclusión forzosa con estas unidades. Esta práctica asegura que el error de muestreo para este estrato sea nulo.

Partición en cuantiles (Q)

Este método divide la población de UPM en grupos creados a partir de la división en intervalos regulares de la distribución de la medida de resumen. Los cuantiles más usados son los cuartiles (que dividen la población en cuatro grupos), los quintiles (que dividen la población en cinco grupos) y los deciles (que dividen la población en 10 grupos); sin embargo, con los propósitos de estratificación, también es útil considerar la partición en terciles (que dividen la población en tres grupos).

Método de raíz de frecuencia acumulada (DH)

[Dalenius and Hodges \(1959\)](#) propusieron esta técnica de estratificación basada en la acumulación de la raíz cuadrada de las frecuencias acumuladas de la medida de resumen sobre las UPM. Esta técnica es exacta y no requiere de algún procedimiento iterativo. La idea principal de esta técnica es encontrar grupos que minimicen la siguiente función:

$$D = \sum_{h=1}^H W_h \sqrt{S_{y_h}^2}$$

En donde $W_h = N_h/N$ ($h = 1, \dots, H$) es el tamaño relativo del estrato h y $S_{y_h}^2$ es la varianza de la medida de resumen en el estrato h .

Estratificación óptima (LH)

Lavallée and Hidioglou (1988) propusieron por primera vez la construcción de una estratificación óptima para poblaciones de encuestas reales, basada en la minimización de una expresión ligada al tamaño de muestra. Más adelante Kozak (2004) definió un algoritmo iterativo mediante arranques aleatorios para optimizar el proceso de minimización.

Estratificación geométrica (GH)

Gunning and Horgan (2004) desarrollaron este método con el objetivo de que los coeficientes de variación de la medida de resumen tiendan a ser iguales dentro de los estratos y, de esta forma, encontraron que los límites que definían estos grupos estaban conformados en progresión geométrica.

IV. Metodologías multivariadas sobre la matriz de información

Partiendo de la matriz de información \mathbf{X} a nivel de las UPM, es posible considerar algunos procedimientos que no necesitan de la reducción a una sola dimensión, sino que admiten tantas dimensiones como indicadores definidos en las columnas de la matriz \mathbf{X} . Teniendo en cuenta que en el periodo intercensal se realizarán encuestas que miden variables que están fuertemente ligadas a las observadas en el censo, entonces encontrar una estratificación que sea óptima para todo el conjunto de variables de la matriz de información asegurará una partición óptima para todas las encuestas realizadas en el periodo intercensal. Las siguientes metodologías permiten minimizar conjuntamente la varianza de los P estimadores de muestreo en un diseño estratificado.

K-medias de Jarque (KmJ)

Jarque (1981) propone utilizar una versión modificada del algoritmo de K-medias (Macqueen, 1967), cuya objetivo es la minimización de la siguiente función de distancia:

$$\sum_{h=1}^H \sum_{k \in U_h} (\mathbf{x}_k - \bar{\mathbf{x}}_h)' \mathbf{\Lambda}^{-1} (\mathbf{x}_k - \bar{\mathbf{x}}_h)$$

En donde \mathbf{x}_j corresponde a la medición de las P variables de la matriz de información en la k -ésima UPM, $\bar{\mathbf{x}}_h$ es el vector de medias de la matriz de información en el estrato h y $\mathbf{\Lambda}$ es una matriz diagonal de tamaño $P \times P$ cuyas

entradas se definen como la varianza de las P variables de la matriz \mathbf{X} , es decir $\Lambda[p, p] = S_{x_p}^2$. Esta modificación tiene como objetivo minimizar la relación entre la varianza de un estimador de muestreo estratificado con asignación proporcional y la de un muestreo aleatorio simple. Como se puede ver en el anexo, cuando $\Lambda = \mathbf{I}$, el algoritmo resultante es idéntico al algoritmo clásico de K-medias.

Partición genética (BB)

[Ballin and Barcaroli \(2013\)](#) argumentan que la mejor estratificación es aquella partición del marco de muestreo que asegure el mínimo costo muestral que satisfaga algunas restricciones de precisión; o, que maximice la precisión de los indicadores de interés bajo las restricciones. Haciendo uso de algoritmos genéticos evolutivos, esta la estratificación multivariada del marco de muestreo parte de la consideración de estratificaciones univariadas independientes (una para cada variable de la matriz de información) y de la definición del producto cartesiano resultante de todas estas particiones (estratos atómicos). Este universo de posibles estratificaciones evoluciona, sujeto a las restricciones de precisión sobre cada variable de la matriz de información, hasta converger en el número de estratos definidos de antemano H .

V. Evaluación y escogencia de la mejor estratificación

En la evaluación de los escenarios de estratificación entran las técnicas univariadas y multivariadas. Al final, el resultado de aplicar una u otra técnica es simplemente una clasificación de las UPM. Por lo tanto, cada una de las posibles estratificaciones debe ser evaluada con base en la reducción de la varianza para todos los indicadores considerados en la matriz de clasificación. La medida clásica con la que se juzgan las bondades de una estrategia de muestreo es el efecto de diseño (DEFF). Por lo tanto, la evaluación de la estratificación debe estar supeditada también a esta medida, que para la variable $p = 1, \dots, P$, está dada por:

$$DEFF_p = \frac{Var_{ST}(\bar{x}_p)}{Var_{SI}(\bar{x}_p)} \quad p = 1, \dots, P.$$

En donde, $Var_{ST}(\bar{x}_p)$ y $Var_{SI}(\bar{x}_p)$ denotan la varianza del diseño estratificado y la varianza de un muestreo aleatorio simple para la media poblacional (porcentaje) de la p -ésima variable de la matriz de información. Por otro lado, [Gutiérrez \(2016, página 184\)](#) demuestra que, cuando la asignación es proporcional, esta relación se puede escribir de la siguiente manera:

$$DEFF_p = \frac{\sum_{h=1}^H W_h S_{x_{hp}}^2}{S_{x_p}^2} \quad p = 1, \dots, P.$$

En donde, para cada estrato $h = 1, \dots, H$, se tiene que $S_{x_p}^2$ es la varianza de la variable x_p en la población y $S_{x_{hp}}^2$ es la varianza de la variable x_p supeditada al estrato h . Nótese que una ventaja de expresar el efecto de diseño como en la ecuación anterior es que no dependerá del tamaño de muestra. Una vez definido el criterio de evaluación de la estratificación sobre una variable x_p , es necesario definir un criterio de estratificación multivariante que contemple cada una de las P variables. Siguiendo las ideas de [Jarque \(1981\)](#), se propone la siguiente medida de calidad, definida como el *efecto de diseño generalizado* ($G(S)$) sobre todas las variables de la matriz de información:

$$G(S) = \sum_{p=1}^P DEFF_p = \sum_{p=1}^P \frac{1}{S_{x_p}^2} \sum_{h=1}^H W_h S_{x_{hp}}^2$$

Ante una estratificación pertinente, se esperaría que $Var_{ST}(\bar{x}_p) < Var_{SI}(\bar{x}_p)$, por lo tanto $0 < DEFF_p < 1$, lo que conlleva a que $0 < F(S) < P$. Luego, se debería escoger el escenario para el cual $F(S)$ fuera mínimo. Nótese que, para cada uno de los escenarios en estudio, es necesario fijar el número de estratos; en general se propende porque el número de grupos esté entre tres y cinco. Esta escogencia del número de grupos debe ser discutida al interior del INE con los equipos que determinan la rotación de las UPM en cada periodo de levantamiento de las encuestas de hogares. Escoger un número alto de estratos reducirá la varianza, pero a su vez puede tener repercusiones negativas en la logística de rotación del diseño de muestreo de las encuestas, haciendo que se agoten rápidamente las UPM dentro de los estratos geográficos y socioeconómicos. Por lo anterior, se recomienda restringir los escenarios de evaluación a la consideración de $H = 3$ y $H = 4$ estratos.

El siguiente cuadro ejemplifica la evaluación de estas técnicas para dos escenarios de estratificación (tres y cuatro estratos) en una matriz de información que contiene 8 variables. De la tabla se puede deducir varias conclusiones interesantes. Por ejemplo, para el primer indicador, la mejor estratificación es DH con cuatro estratos; para el segundo indicador, la mejor estratificación es BB con cuatro estratos; mientras que para el último indicador, la mejor estratificación es LH con cuatro estratos. Como se puede notar, para cada indicador existirá un método que induzca una mayor eficiencia, pero que para otros indicadores puede ser deficiente. Esto claramente muestra que la estratificación con respecto a un solo indicador puede ser un procedimiento inadecuado. Por lo tanto, basados en este ejemplo, el mejor método sería DH con cuatro estratos puesto que induce una mayor eficiencia conjunta al reducir el efecto de diseño generalizado.

Cuadro 4.1: Efectos de diseño $DEFF_p$ y efecto de diseño generalizado $G(S)$ considerando tres ($H = 3$) y cuatro ($H = 4$) estratos para ocho variables.

DEFF	Q (H=3)	DH (H=3)	LH (H=3)	GH (H=3)	KmJ (H=3)	BB (H=3)	Q (H=4)	DH (H=4)	LH (H=4)	GH (H=4)	KmJ (H=4)	BB (H=4)
\bar{x}_1	0.87	0.85	0.81	0.82	1	0.88	0.8	0.70	0.76	0.72	0.71	0.77
\bar{x}_2	0.89	0.82	0.95	0.97	0.94	0.88	0.79	0.74	0.75	0.77	0.75	0.71
\bar{x}_3	0.87	0.97	0.83	0.96	0.89	0.95	0.74	0.75	0.79	0.77	0.79	0.71
\bar{x}_4	0.92	0.89	0.81	0.94	0.96	1	0.77	0.73	0.73	0.7	0.71	0.74
\bar{x}_5	0.85	0.83	0.96	0.96	0.83	0.81	0.8	0.73	0.8	0.78	0.8	0.79
\bar{x}_6	0.87	0.88	0.9	0.88	0.86	0.81	0.8	0.72	0.76	0.7	0.74	0.73
\bar{x}_7	0.87	0.95	0.99	0.83	0.86	0.84	0.75	0.7	0.77	0.72	0.77	0.77
\bar{x}_8	0.93	0.82	0.91	0.99	0.93	0.88	0.77	0.74	0.72	0.78	0.76	0.75
$G(S)$	7.07	7.01	7.16	7.35	7.27	7.05	6.22	5.81	6.08	5.87	6.03	5.97

Para tener comparabilidad y consistencia, los algoritmos de estratificación se deberían aplicar sobre cada una de las UPM en las áreas urbanas, pero independientemente de las UPM rurales. La escogencia del número de estratos debe ser discutida al interior de los INE y así determinar si escoger un número alto de estratos reduce la varianza significativamente, o si puede tener repercusiones negativas en la logística de rotación y desgaste de las UPM, haciendo que se agoten rápidamente dentro del cruce de los estratos geográficos y socioeconómicos. Es recomendable restringir los escenarios de evaluación a la consideración de $H=3$ o $H=4$ estratos. Este último componente es importante puesto que los diseños de muestreo deberían considerar un tamaño de muestra mínimo de dos UPM por estrato para poder estimar la varianza del estimador (Gutiérrez, 2016).

El efecto diseño no es el único aspecto por evaluar para la elección del procedimiento de estratificación. Es necesario verificar la estabilidad del método con respecto a los otros procedimientos de estratificación. Por ejemplo, la siguiente tabla muestra la matriz de coincidencias entre las diferentes clasificaciones de los estratos.

Técnica	Jarque	K-means	DAL	GEO	LH-S	LH-K	Percentil
Jarque	1	0,64	0,92	0,84	0,89	0,89	0,82
K-means	0,64	1	0,68	0,62	0,71	0,71	0,74
DAL	0,92	0,68	1	0,82	0,96	0,96	0,90
GEO	0,84	0,62	0,82	1	0,78	0,78	0,73
LH-S	0,89	0,71	0,96	0,78	1	1,00	0,93
LH-K	0,89	0,71	0,96	0,78	1,00	1	0,93
Percentil	0,82	0,74	0,90	0,73	0,93	0,93	1

Por último, suponiendo que se decidió la creación de tres estratos se encuentran numerado en orden ascendente que indica el nivel de bienestar socioeconómico, también se debe evaluar la coherencia de la distribución de las diferentes variables agregadas a nivel de UPM en los estratos. Por ejemplo, la proporción de

personas mayores de 15 años alfabetizadas debería tener mayor incidencia en los estratos más altos, y este patrón también se debería observar para diferentes indicadores como la proporción de hogares con internet, la proporción de tenencia de refrigerador, la proporción de tenencia de televisión por cable, la proporción de tenencia de automovil, la proporción de hogares con saneamiento adecuado, la proporción de hogares con pisos adecuados, la proporción de personas con educación superior, entre otras. La figura 4.2 muestra el comportamiento esperado en los estratos de muestreo para algunas variables de interés. De esta forma, el estrato uno debería presentar condiciones económicas más adversas, el estrato dos debería tener mejores condiciones, siendo el tercer estrato el que agrupa a las UPM con menores dificultades socioeconómicas. En el área rural debiesen aparecer una menor proporción de UPM en el estrato 3, dadas las condiciones menos favorables.

Si la contribución de algunas unidades al total poblacional es no significativa, y además esas unidades son de difícil acceso, es común que en algunos países de la región se opte por redefinir el universo y crear un estrato de exclusión forzosa. En este estrato no se realiza ninguna encuesta y las respectivas estimaciones no tendrán en cuenta a esta población excluida. Por último, como algunos procedimientos de clasificación se basan en la generación de números aleatorios, se recomienda documentar los códigos computacionales que se utilizaron para que los resultados puedan ser replicados, por lo que debe fijar una semilla aleatoria al comienzo del código computacional.

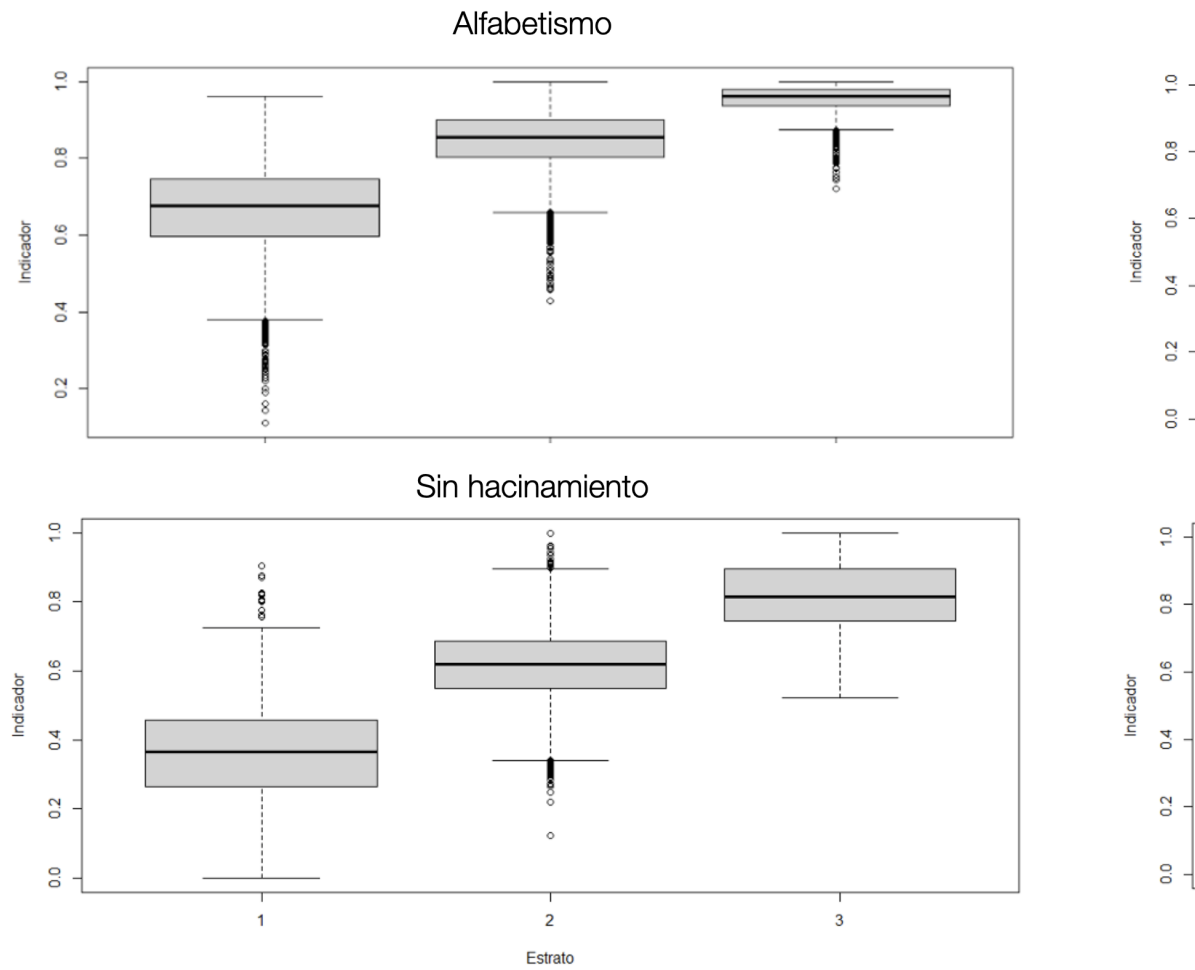


Figura 4.2: Comportamiento esperado en los estratos de muestreo para algunas variables de interés.

Capítulo 5

Diseño y mecanismo de selección de la muestra

Todas las encuestas de hogares en la región comparten el mismo principio inferencial: la selección de una muestra que puede representar la población de todo un país. Por supuesto, ante este objetivo tan ambicioso, es necesario contar con procedimientos robustos, probados y capaces de pasar los filtros más críticos y agudos. Tal vez en este momento de la historia, la práctica de estos procedimientos ya no genere ningún tipo de asombro, pero el lector podría animarse a contemplar todos los posibles escenarios que una sociedad enfrentaría ante la ausencia de las encuestas de hogares y sus repercusiones en materia del desarrollo social.

Es innegable la potencia y el poder que hay detrás de estas operaciones estadísticas que están sustentadas en el muestreo probabilístico que induce una inferencia que procede de lo particular a lo general, puesto que al seleccionar una muestra, esta sirve como base para obtener conclusiones acerca de la población. Al final la muestra será un vehículo adecuado para representar las características más importantes de la población en estudio, en la forma en que justamente las variables se incorporan en el formulario de la encuesta. [Gutiérrez \(2016\)](#) afirma que el muestreo es un procedimiento que responde a la necesidad de información estadística precisa sobre la población y los conjuntos de elementos que la conforman; el muestreo probabilístico trata con investigaciones parciales que apuntan a inferir a la población completa y en general está basado en los siguientes principios:

- *Aleatorización*: las unidades incluidas en la muestra son seleccionadas mediante un proceso probabilístico. De esta forma, además de eliminar los posibles sesgos de selección, la muestra resultante será válida para cualquier proceso de inferencia, puesto que se basa en el conjunto de todas las muestras que se pueden obtener con el esquema de muestreo definido.

- *Inclusión*: todas las unidades de la población tienen una probabilidad no nula de ser incluidas en la muestra. Lo anterior quiere decir que el procedimiento de selección le da chance de ser seleccionado a todas las unidades que componen la población. De esta manera, la muestra final puede estar compuesta por cualquier combinación plausible de hogares o individuos.

Para que los anteriores principios se cumplan a cabalidad, es necesario contar con un instrumento que permita seleccionar a los hogares del país de forma exhaustiva y completa; esto quiere decir que el instrumento debería contener todos y cada uno de los hogares de la población. Dado que no existe una lista que permita identificar y ubicar a cada uno de los hogares de la población, entonces se deben contemplar otras posibilidades que permitan lograr el objetivo. Debido al principio natural de la aglomeración de las poblaciones humanas, es posible lograr este cometido de manera indirecta a través de la definición de los marcos de muestreo de áreas.

Las encuestas han tenido una gran trascendencia en la evolución de las mediciones de los indicadores sociales, que a su vez conllevan a que los gobiernos realicen un seguimiento y monitoreo de las cifras más importantes para la sociedad. De esta forma se podrá investigar la efectividad de las políticas públicas, para concretar las metas de mejora en las condiciones sociales y/o económicas de la ciudadanía. Tal como lo afirma [Gutiérrez \(2016\)](#), el muestreo es un procedimiento que responde a la necesidad de información estadística precisa sobre la población y los conjuntos de elementos que la conforman. De esta forma, una muestra bien seleccionada de unos cuantos miles de individuos puede representar con gran precisión a una población de millones de personas.

En general, se puede afirmar que un concepto apropiado por la sociedad es el que define a una muestra representativa como un modelo reducido de la población. De este concepto se desprende un argumento de validez sobre la muestra: “una buena muestra es aquella que se parece a la población, de tal forma que las categorías aparecen con las mismas proporciones que en la población”. Sin embargo, en algunos casos es fundamental “sobrerepresentar” algunas categorías o incluso seleccionar unidades con probabilidades desiguales ([Tillé, 2006](#)). La muestra no debe ser un modelo reducido de la población; debe ser una herramienta usada para obtener estimaciones válidas: exactas, confiables, precisas y consistentes.

El concepto de muestra representativa no se debe usar para referirse a que la muestra debe parecerse a la población. La teoría de muestreo se ha ocupado de estudiar estrategias óptimas que permitan asegurar la calidad de las estimaciones; en general, el concepto de representatividad debe estar asociado con la estrategia de muestreo y no sólo con la muestra seleccionada. Consecuentemente, la muestra como subconjunto de la población es una herramienta que no admite el calificativo de representativa, puesto que su objetivo no es parecerse a la población sino permitir que, mediante la correcta caracterización de una estrategia de muestreo, el proceso de inferencia logre reproducir la estructura de la población.

Lo anterior no indica que debamos abandonar del todo este adjetivo (representativo) en los procesos de muestreo. Por el contrario, el objetivo del equipo técnico experto en la selección de muestras debe estar supeditado a lograr que efectivamente este adjetivo se pueda aplicar a todo el componente de diseño y estimación. Es decir, el calificativo de representatividad es objeto de un proceso conjunto de diseño de muestreo, estimación de parámetros, acercamiento a modelos estadísticos para hacer frente a la ausencia de respuesta, entre otros. Uno de los objetivos de este capítulo será hacer precisión sobre las estructuras de selección de las muestras en las encuestas por muestreo. Al escoger un mecanismo apropiado para la selección de la muestra, será posible afirmar que la estrategia de muestreo es efectivamente representativa de la población de interés, puesto que cumple con altos estándares de rigurosidad y calidad en cada uno de los componentes del proceso.

I. Diseños de muestreo

Una vez que los marcos de muestreo se han refinado y se ha definido una estratificación apropiada para las UPM que las componen, es necesario realizar el proceso de muestreo la selección final de los hogares. Este proceso de selección debe inducir insesgamiento, además de ser eficiente. Esto quiere decir que la inclusión de las unidades en la muestra estará supeditada a un esquema probabilístico libre de cualquier sesgo. Además de esto, se necesita que este mecanismo genere la menor dispersión posible en el proceso inferencial posterior.

El procedimiento de muestreo le asigna una probabilidad de selección conocida a cada posible muestra. Al diseñar un muestreo probabilístico, el investigador es el encargado de asignar estas probabilidades, mediante la definición del diseño de muestreo (Särndal et al., 2003). Aunque esta asignación de probabilidades se realiza de manera teórica, la pericia del equipo técnico deberá establecer cuál es la mejor forma de selección, y sobre esta escoger el mejor algoritmo de muestreo. Luego de establecer este conjunto de probabilidades, una única muestra es escogida mediante un mecanismo aleatorio que siga a cabalidad esta configuración estocástica inducida por el diseño de muestreo. Las probabilidades deben ser distintas de cero puesto que, de lo contrario, no se podría garantizar una inferencia insesgada, puesto que estaría excluyendo algunos sectores cartográficos del país. Además, estas mismas probabilidades se utilizan para crear los factores de expansión que definen todo el proceso de estimación, junto con el cálculo de los errores de muestreo, como se verá en los capítulos posteriores.

Existe una clara diferenciación entre un diseño de muestreo y un algoritmo de muestreo. El primero indica qué probabilidad de selección tendrán las posibles muestras en el soporte de muestreo, definido como el conjunto de todas las posibles muestras. Y el último se define como el proceso de selección de una única muestra que respeta las probabilidades del diseño de muestreo. En la definición de una encuesta de hogares es indispensable que se establezcan de antemano estos dos componentes. Es decir, si se ha decidido que el diseño de

muestreo sea en etapas, el equipo técnico deberá documentar exhaustivamente cada etapa de muestreo, definiendo sus correspondientes unidades de muestreo y por consiguiente, los diseños de muestreos en cada etapa. Luego, es igual de importante explicar qué algoritmos de selección serán utilizados en cada etapa de muestreo. De esta forma habrá total transparencia en la selección de las unidades y esto redundará en la obtención de cifras oficiales confiables y precisas.

Existen muchas formas de seleccionar una muestra de hogares y cada una de ellas induce una medida de probabilidad sobre los elementos que conforman la población de interés. En general, asociado a cada esquema particular de muestreo se define una única función que asocia a cada hogar k con una probabilidad de inclusión en la muestra s , definida de la siguiente manera:

$$\pi_k = Pr(k \in s)$$

Estas probabilidades de inclusión de los hogares, inducidas por los diseños de muestreo asociados a cada encuesta, cumplen con las siguientes propiedades

1. $\pi_k > 0$
2. $\sum_U \pi_k = n$

Observe que la primera propiedad garantiza que ningún hogar será excluido de la selección inicial. Si bien no todos los hogares serán seleccionados para pertenecer a la muestra s , todos tendrán un chance de ser escogidos por el mecanismo de selección aleatoria. En segunda medida, el tamaño de la muestra de hogares estará inducido por la magnitud de las probabilidades de inclusión. Por esta razón, una encuesta con una muestra grande asignará una mayor probabilidad de inclusión a todos los hogares, que una encuesta de tamaño de muestra más modesto. A continuación se presenta una lista no exhaustiva de diseños de muestreo utilizados en encuestas de hogares para la publicación de estadísticas oficiales, junto con la forma particular que toman las probabilidades de inclusión en cada esquema.

Muestreo aleatorio simple

Este diseño de muestreo supone que es posible realizar una enumeración de todas las posibles muestras de tamaño fijo y escoger una de ellas mediante una selección aleatoria que asigne la misma probabilidad a cada una. Para ejecutar este diseño de muestreo es necesario tener información suficiente y exhaustiva de la ubicación e identificación de todas las unidades de interés. Su uso es común en las etapas finales de selección de las encuestas, en donde los hogares o personas se seleccionan con la misma probabilidad. Por ejemplo, una vez se ha escogido un área de muestreo, una parte del operativo de campo deberá estar dedicada al enlistamiento de todas las viviendas en esa área seleccionada. Cuando se haya realizado este empadronamiento será posible asignarle la misma probabilidad de inclusión a cada vivienda en el área o en la UPM. Por ende, las probabilidades

de inclusión en el muestreo aleatorio simple sin reemplazo son todas iguales y dadas por la siguiente expresión:

$$\pi_k = Pr(k \in s) = \frac{\binom{1}{1} \binom{N-1}{n-1}}{\binom{N}{n}} = \frac{n}{N}$$

Como se verá en los siguientes capítulos, cuando se usa el estimador de Horvitz-Thompson en este diseño de muestreo para estimar un total poblacional, y suponiendo que $S_{y_U}^2$ denota la varianza de la característica de interés en la población finita, entonces las expresiones del estimador puntual y su varianza, respectivamente, toman la siguiente forma:

$$\hat{t}_{y,\pi} = \sum_s \frac{y_k}{\pi_k}$$

$$Var(\hat{t}_{y,\pi}) = \frac{N^2}{n} \left(1 - \frac{n}{N}\right) S_{y_U}^2$$

Una variante de este tipo de esquemas de selección de muestras de hogares dentro de la UPM es el muestreo sistemático, en donde se ordena el marco con algún patrón predefinido y posteriormente se selecciona un primer hogar (como arranque aleatorio). A partir de ese primer hogar seleccionado, se incluyen los restantes hogares en la muestra mediante saltos sistemáticos equi-espaciados por el siguiente factor $a = N/n$, conocido como el intervalo de salto. Por ejemplo, una muestra sistemática podría ser:

$$s = \{2, 12, 22, 32, 42\}$$

En donde el primer hogar elegido en la UPM fue el segundo y con saltos sistemáticos de diez hogares se va encuestando los restantes hogares en la lista. En este diseño la probabilidad de inclusión también es uniforme para cada hogar en la UPM y está dada por la siguiente expresión

$$\pi_k = Pr(k \in s) = \frac{1}{a} \approx \frac{n}{N}$$

Muestreo proporcional al tamaño

Este tipo de muestreo utiliza como insumo una característica de información auxiliar cuantitativa, también conocida como medida de tamaño (*MOS*, por sus siglas en inglés). Para la ejecución de este diseño, necesariamente el marco de muestreo deberá contener el valor correspondiente a la medida de tamaño para cada una de sus unidades. Este muestreo es utilizado con frecuencia en las etapas iniciales de selección de las muestras, particularmente en la selección de las UPM

que harán parte de la muestra. De esta forma, los conglomerados o UPM con más hogares o personas (medida de tamaño) tendrán una mayor probabilidad de ser seleccionados en la muestra. Por consiguiente, las probabilidades de inclusión en la muestra para las UPM serán desiguales y proporcionales a la medida de tamaño. Observe que la cantidad de individuos en las UPM es una cifra conocida, puesto que son resultado directo de los censos de población y vivienda.

Una de las ventajas de este tipo de muestreos es que hace más eficiente la estimación de los indicadores de interés. Para que esto ocurra, la medida de tamaño debe estar linealmente relacionada con la característica de interés. Esto a menudo sucede en las problemáticas sociales indagadas en las encuestas de hogares; puesto que a mayor número de hogares, se observa una mayor incidencia de estos fenómenos. Por ejemplo, restringidos a un estrato particular, es evidente que en las UPM con mas hogares se observarán mayor número de personas pobres, o de hogares con ingresos bajos, o de personas desocupadas, etc.

Por último, la medida de tamaño no necesariamente tiene que estar definida como el conteo simple de hogares o personas dentro de las UPM, también puede definirse como una función de estos conteos; por ejemplo, la raíz cuadrada, o incluso como una función compuesta de conteos de subpoblaciones. En el caso más simple, si N_i es la medida de tamaño de la i -ésima UPM U_i , es decir el número de hogares que componen esa UPM; n_I el número de UPM que serán seleccionadas en cada estrato y N la sumatoria (o total) del número de hogares en todas las UPM del estrato (es decir, el número de hogares en el estrato) se tiene que las probabilidades de inclusión a la muestra s_I están dadas por la siguiente expresión:

$$\pi_i = Pr(U_i \in s_I) = n_I * \frac{N_i}{N}$$

Por último, no es cierto que la asignación de probabilidades desiguales en las unidades de muestreo induzca sesgo en la encuesta. Esta frase es cierta, siempre y cuando el estimador que se utilice no sea el adecuado. Por ejemplo, la frase pierde su validez cuando se utiliza el estimador de expansión (Hansen-Hurwitz, para el caso de muestreos con reemplazo - Horvitz-Thompson, en muestreos sin reemplazo). Ahora, lo natural es que si el diseño es con probabilidades desiguales, éstas se utilicen dentro de un estimador que considere esta desigualdad y lo menos usual es que se utilice el estimador de expansión en donde habría que corregir el sesgo causado por la omisión de las probabilidades desiguales.

Muestreo estratificado

Esta familia de diseños de muestreo permite realizar inferencias precisas en subgrupos poblacionales de interés, usualmente definidos como agregaciones geográficas grandes. Por ejemplo, si se quieren estimaciones de la incidencia de la pobreza en las regiones geográficas de un país específico, entonces es pertinente que esta división geográfica sea considerada para la definición de los estratos.

Como se mencionó al inicio de este capítulo, estas divisiones territoriales se forman de manera natural, puesto que los estratos ya están definidos como regiones de interés en el seguimiento de los indicadores sociales.

Una consecuencia directa de la estratificación es que cada subgrupo tendrá un marco de muestreo de UPM independiente, disyunto y mutuamente excluyente. Esta última caracterización induce una de las mayores ventajas del muestreo estratificado puesto que hay independencia entre los estratos. Esto significa que, al interior de cada estrato, se pueden ejecutar distintas estrategias de muestreo de forma independiente. Es común que en los países de América Latina el cruce de las áreas geográficas grandes junto con la división socioeconómica conformen los estratos (justo como se ilustró en los capítulos anteriores); asimismo una desagregación común en investigación social es la división territorial del país: urbano y rural. Evidentemente, la realidad social del entorno urbano difiere tanto del entorno rural que bien vale la pena considerar esta escisión en el diseño de muestreo de las encuestas de hogares.

Las probabilidades de inclusión definidas por este diseño de muestreo variarán en función de cada estrato. Por ejemplo, si en cada estrato ($h = 1, \dots, H$) se hubiese planeado un diseño aleatorio simple, entonces las probabilidades de inclusión estarían dadas por la siguiente expresión

$$\pi_k = Pr(k \in s_h) = \frac{n_h}{N_h}$$

Por supuesto, es posible que la estrategia de muestreo cambie dependiendo de los estratos. Por ejemplo, en la planificación de las encuestas de uso de tiempo, una de las características de interés por las cuales se quiere indagar es la cantidad de horas que hombres y mujeres dedican a actividades de trabajo no remuneradas. Esta realidad cambia radicalmente entre zonas rurales y urbanas. Para este tipo de encuestas de hogares, la flexibilidad que tienen los diseños estratificados es un baluarte valioso que permite definir estrategias de muestreo más precisas.

En algunas ocasiones, se ha sugerido que el muestreo estratificado es el mejor diseño para una encuesta de hogares, lo cual es parcialmente cierto. Aunque en muchas ocasiones, la opción de estratificar es adecuada e inclusive conveniente, no es cierto estrictamente que el muestreo estratificado sea el mejor diseño de muestreo. De hecho, la varianza inducida por el diseño aleatorio estratificado puede llegar a ser más grande cuando no hay una clara homogeneidad en el comportamiento de la característica de interés dentro de los estratos.

Muestreo de conglomerados

Este diseño de muestreo surge como contraparte a la imposibilidad de generar una muestra de hogares directamente de un marco de muestreo que enliste todos y cada uno de los hogares en un país. De hecho, de forma hipotética, si fuese posible, los costos generados por una muestra aleatoria simple serían tan altos

que la harían inviable desde el punto de vista presupuestario. Así, ante la ausencia de un marco de muestreo de las unidades de interés, y aprovechando el principio de aglomeración de las poblaciones humanas (que forman hogares y se aglomeran en segmentos, ciudades, regiones, etc.), la idea general detrás de este diseño es la conformación de unidades homogéneas entre sí (conglomerados), de las cuales se extraerá una muestra y para cada elemento del conglomerado se realizará un proceso exhaustivo de medición censal. De esta forma, es natural definir a las UPM como los conglomerados. Luego de seleccionar una muestra de estas UPM se realiza un censo de hogares sobre cada una de las UPM seleccionadas. Nótese que este proceso logístico induce un esquema con ventajas económicas en términos presupuestales, puesto que limita el operativo de campo a un cierto número de UPM que se deben medir exhaustivamente.

A pesar de que esta estrategia resulte conveniente desde el punto de vista logístico y operativo, ciertamente no lo es desde el punto de vista de la eficiencia estadística; los errores de muestreo que se producen al utilizar esta metodología son bastante más elevados que en un diseño simple, puesto que al realizar el proceso de aglomeración, generalmente la variación interna de los conglomerados es muy baja y la variación entre conglomerados tiende a ser muy alta, generando mayor incertidumbre en la inferencia de la encuesta. Para superar estos inconvenientes, se podría pensar en un esquema de muestreo que aumente el tamaño de la muestra de conglomerados; sin embargo, este aumento puede llegar a ser tan grande que, en algunos estratos, se deberían seleccionar todas las UPM. Por supuesto, se trata de un esquema inviable en la práctica, pero que da paso al esquema de muestreo más común en las encuestas de hogares: la selección por etapas.

Como se mencionó en los capítulos anteriores, definir los conglomerados con tamaños muy desiguales redundaría en un aumento significativo de la varianza del estimador; es por esto que, en encuestas de hogares, se intenta crear conglomerados acotados, a nivel de manzana, o vereda. Esta es una práctica muy pertinente, puesto que la varianza del estimador de expansión estará en función de la varianza de los totales de los conglomerados; si existe una alta variación en los tamaños, habrá también una alta variación en los totales y, por consiguiente, la varianza del estimador será alta. De otra forma, si se tiene conocimiento de una característica de información auxiliar a nivel de los conglomerados (medida de tamaño), es posible hacer uso de esta información del marco para reducir la varianza en el estimador.

Muestreo en varias etapas

En este esquema de muestreo, la idea general es retomar los principios del muestreo de conglomerados y realizar un submuestreo de hogares dentro de los conglomerados o UPM seleccionadas inicialmente. Este submuestreo puede ser tan incluyente como sea necesario. En general, en América Latina son muy comunes los esquemas de selección en dos etapas: en la primera etapa se selecciona una muestra de UPM y en la segunda etapa se selecciona una muestra de hogares

en aquellas UPM seleccionadas en la primera etapa. Aunque, también es posible encontrar en algunos países esquemas en más de dos etapas. Por ejemplo, en una primera etapa se seleccionan municipios; en una segunda etapa se seleccionan UPM dentro de los municipios seleccionados; y en la segunda etapa se selecciona una muestra de hogares en aquellas UPM seleccionadas en la segunda etapa. Si un municipio es incluido en la muestra es posible realizar un proceso de aglomeración continúa sistemática, hasta llegar a la unidad de observación. Por ejemplo, en una ciudad seleccionada, es posible hacer un submuestreo de sus secciones cartográficas, luego seleccionar sectores cartográficos (contenidos en las secciones) y por último seleccionar hogares o personas.

Si el esquema de muestreo incluye la selección de municipios en la primera etapa, el diseño de muestreo apropiado en esta instancia deberá ser proporcional a una medida de tamaño, que puede ser definida como el número de habitantes de los municipios. De esta forma, con una probabilidad muy grande, a veces igual a uno, las ciudades más importantes (con más habitantes) serán siempre parte del estudio. Por otro lado, es posible que en algunas encuestas exista un submuestreo de personas dentro del hogar. En este caso, [Clark and Steel \(2007\)](#) aclaran que la escogencia de las personas dentro de los hogares no debería ser aleatoria simple puesto que ciertos grupos poblacionales podrían estar sub-representados o sobre-representados. En general, el muestreo en varias etapas tiene dos características esenciales que lo hacen robusto, en términos estadísticos, y eficiente al momento de planear la logística del levantamiento de información; estas son:

- La independencia: que implica que no hay ninguna correlación en el diseño de muestreo de las unidades primarias de muestreo. Esto quiere decir que en cada UPM se puede ejecutar con independencia cualquier estrategia de muestreo que se crea apropiada para seleccionar la submuestra de hogares.
- La invarianza: que implica que sin importar qué diseño de muestreo se ejecutó en la primera etapa para seleccionar las UPM, la segunda etapa de selección podrá ejecutarse de manera independiente de la primera etapa. Es decir, el submuestreo de los hogares es independiente del muestreo de las UPM.

Un esquema de selección bastante usado en las encuestas de hogares de América Latina es el relacionado con los diseños auto-ponderados, lo cuales, en la primera etapa de muestreo seleccionan n_I UPM con probabilidad proporcional al número de hogares que la habitan; es decir:

$$\pi_i = Pr(U_i \in S_i) = n_I \frac{N_i}{N}$$

En la segunda etapa de muestreo se seleccionan hogares dentro de las UPM que fueron incluidas en la etapa anterior. Esta selección de hogares se hace mediante un muestreo aleatorio simple, pero el tamaño de la submuestra es fijo para cada UPM. Es decir, no importa si una UPM es mucho más grande o más pequeña que las otras, el número de hogares que serán seleccionados será siempre el

mismo. Por ejemplo, se podrían seleccionar $n_0 = 10$ hogares por UPM, siempre. De esta forma, en la segunda etapa, la probabilidad de que el k -ésimo hogar sea seleccionado en la submuestra s_i de la UPM U_i que fue seleccionada en la muestra de la primera etapa s_I , está dada por la siguiente expresión:

$$\pi_{k|i} = Pr(k \in s_i | U_i \in s_I) = \frac{n_0}{N_i}$$

En los esquemas auto-ponderados, a pesar de tener dos diseños de muestreo diferentes en dos etapas (proporcional al tamaño y aleatorio simple), la probabilidad de inclusión de los hogares es siempre la misma para todos los hogares, como se puede ver en la siguiente expresión:

$$\pi_k = \pi_{k|i} * \pi_i = \frac{n_0}{N_i} \frac{n_I * N_i}{N} = \frac{n_0 * n_I}{N} = \frac{n}{N}$$

Nótese que $n = n_0 * n_I$ corresponderá con el número total de hogares que serán seleccionados, puesto que resulta ser la multiplicación del número de UPM que fueron seleccionadas en la primera etapa por el número de hogares que serán submuestreados en cada UPM en la segunda etapa. Este tipo de esquemas se utiliza cuando se quiere controlar el trabajo de campo y las cuotas por ciudad o municipio. Por otro lado, una particularidad de las encuestas de hogares es que, casi siempre, las personas y los hogares comparten las mismas probabilidades de inclusión. La razón de esto es que, en la mayoría de encuestas, el submuestreo de las personas es exhaustivo (censo en el hogar) y por ende, la probabilidad de inclusión en el submuestreo es forzosa.

$$\pi_k^{per} = Pr(persona \in hogar) = 1$$

Por lo anterior, se tiene que la probabilidad de inclusión de las personas en la muestra es idéntica a la del hogar:

$$1 * \pi_{k|i} * \pi_i = 1 * \frac{n}{N} = \frac{n}{N}$$

Muestreo en dos fases

En algunos casos en donde el marco de muestreo contiene poca o limitada información para proponer un diseño de muestreo eficiente, el investigador puede obtener información acerca de la población para construir un nuevo marco de muestreo reducido. En la primera fase, se selecciona una muestra de tamaño grande, conocida como *muestra maestra*. Para cada uno de los elementos en esa muestra se debe obtener información sobre una o más variables auxiliares, con el fin de estratificar de mejor manera, recolectar información auxiliar en la muestra, o simplemente para obtener muestras sucesivas y comparables a lo largo del ciclo de vida de la encuesta. En la segunda fase, con la ayuda de la información

obtenida en la primera fase, se selecciona una submuestra mediante un diseño de muestreo conveniente, mucho más eficiente y apropiado para estimar el fenómeno en estudio.

Por ejemplo, si se requieren estimativos precisos para distintos subgrupos poblacionales, pero no existe un marco de muestreo confiable o actualizado, que permita diseñar un muestreo estratificado, entonces es necesario realizar un esquema de muestreo en dos fases. De esta forma, se selecciona una muestra aleatoria simple de tamaño moderado. Luego, se realiza un empadronamiento de los individuos en la muestra, a los cuales se les pregunta acerca de su membresía a los subgrupos poblacionales de interés. Luego, en una segunda fase, con ayuda de la información recolectada en la primera fase, se realiza un diseño estratificado.

Un ejemplo de este tipo de diseños de muestreo se da en el caso de México, en donde el INEGI ha planteado la construcción de una muestra maestra que permita seleccionar submuestras para las encuestas de hogares más importantes a la vez que se va recopilando información de los hogares pertenecientes a esta muestra maestra. En [INEGI \(2012\)](#), se menciona que «a partir de la construcción del Marco Maestro de Muestreo 2012, se diseñó la Muestra Maestra para lograr mantener actualizada de forma continua la información de las viviendas particulares dentro de esta muestra. El diseño de la muestra maestra consideró y respetó las UPM formadas y la estratificación con que fue construido el marco de muestreo por lo que heredó la mayoría de sus propiedades. El diseño de la Muestra Maestra está basado en la cobertura, tamaño y distribución de las encuestas continuas y periódicas del INEGI. Los tamaños de muestra en viviendas para estas encuestas junto con el promedio óptimo de viviendas a seleccionar dentro de una UPM determinaron el número de UPM a seleccionar para la Muestra Maestra 2012». De esta forma, la muestra maestra constituye un elemento esencial para el levantamiento de la Encuesta Nacional de Ocupación y Empleo, la Encuesta Nacional sobre la Confianza del Consumidor, la Encuesta Nacional de Victimización y Percepción sobre Seguridad Pública, la Encuesta Nacional de Gasto de los Hogares, entre algunas otras.

En el caso de Costa Rica, la muestra de la Encuesta Nacional de Microempresas de los Hogares sigue un diseño en dos fases. La primera fase toma como base la Encuesta Nacional de hogares, en la cual se identifican aquellos hogares cuyos integrantes desarrollan actividades económicas concernientes con emprendimientos y microempresas. A partir de este listado exhaustivo, en una segunda fase, se selecciona a todas las personas al frente de estas microempresas y se les aplica un cuestionario con el fin de obtener información sobre sus características y sus actividades económicas. Por otro lado, en Chile se realiza el Estudio Nacional de la Discapacidad que asume un marco de muestreo reducido, en una primera fase, basado en la encuesta de hogares CASEN, en la cual se identifican los hogares que tienen miembros con alguna condición de discapacidad. En una segunda fase, se realiza una selección de hogares y mediante un cuestionario estructurado se indagan las características de las personas con esta condición.

A. Muestreo balanceado

El método del cubo permite seleccionar muestras balanceadas, manteniendo las proporciones de la población original en la muestra en diferentes variables de equilibrio, las cuales se espera que estén correlacionadas con las variables de interés. En general, el método del cubo permite la selección de una muestra aleatoria para la cual el inverso de las probabilidades de inclusión reproduce de forma exacta el total poblacional de las variables de balanceo. El método del cubo se desarrolla en dos etapas, una fase de vuelo y una fase de aterrizaje que son descritas en detalle por [Tillé \(2006\)](#).

[Gutiérrez \(2016\)](#) afirma que estos autores desarrollaron un procedimiento general y riguroso que permite la extracción de muestras probabilísticas balanceadas y la posterior estimación de las cantidades de interés, enmarcados bajo métodos de inferencia basados en el diseño de muestreo. Dado que bajo un diseño de muestreo balanceado el estimador para los totales de un conjunto de variables auxiliares, debe ser igual al total poblacional de las mismas, entonces la varianza del estimador del total poblacional de la característica de interés se debe reducir de acuerdo con el aumento de su correlación con las variables auxiliares.

El método del cubo se compone de dos fases: la fase de vuelo y la fase de aterrizaje. En la primera, para que las restricciones sean satisfechas exactamente, se deben redondear a cero (0) o uno (1) las probabilidades de inclusión. La fase de aterrizaje consiste en el manejo adecuado del redondeo apelando a la programación lineal. Por ejemplo, aplicando el método simplex sujeto a una función de costo relacionada con la varianza del estimador.

En las encuestas de hogares es posible utilizar el algoritmo de selección del método del cubo en cada uno de los estratos conformados en el diseño de muestreo para seleccionar UPM. El método del cubo es un algoritmo de selección, que a diferencia de los algoritmos de selección tradicionales permite reproducir de forma exacta el número total de personas por grupos de edad y sexo a nivel de la UPM para este caso concreto. En Perú, la Encuesta Demográfica y de Salud Familiar utiliza este tipo de muestreo en la selección de las UPM. Por ejemplo, como variables de balanceo se podrían definir las siguientes:

- Una columna de unos para que exista balanceo en el número de UPM.
- El vector de probabilidades de inclusión iniciales.
- Total de personas por grupos de edad y sexo (a partir de la información de los censo de población) para que en la UPM se puedan reproducir de forma exacta el total personas por grupos de edad y sexo.

Si la encuesta se realiza de forma periódica, es necesario actualizar los marcos de muestreo y los tamaños poblacionales a través de tiempo. Si es necesario, el investigador puede apoyarse en las proyecciones demográficas (nacimientos esperados, muertes esperadas y población proyectada) disponibles en fuentes oficiales.

II. El diseño de muestreo estándar en una encuesta de hogares

A continuación se describe de manera genérica cómo es un diseño de muestreo típico de una encuesta de hogares en la región. Por supuesto, en la práctica existen variantes que se pueden alejar un poco de esta generalización pero que, en general, mantienen la misma estructura. La mayoría de encuestas son de naturaleza multipropósito. Esto quiere decir que existen múltiples variables de interés. Por lo anterior, el investigador debe definir las variables más importantes de la investigación y sobre estas planear el diseño de muestreo. Esta directriz implica que para obtener simultáneamente la precisión requerida en todas las estimaciones, el tamaño de muestra será un poco más exigente. Asimismo, la definición de los dominios de representatividad debe estar directamente determinada por los objetivos de la encuesta y por la definición de las unidades de muestreo.

Se debe mencionar también que el diseño de muestreo de muchas de las encuestas de hogares que se realizan actualmente en la región mantienen el mismo espíritu de los diseños que anteriormente sirvieron para levantar la información primaria. Es decir, el nivel de innovación en este campo no se da de forma intempestiva, y más bien se podría afirmar que cada vez que se rediseña una encuesta de hogares, el punto de partida será el diseño anterior de la encuesta, lo cual es oportuno si es que se quiere mantener la comparabilidad de las cifras entre los levantamientos periódicos. Siempre que no haya un marco de muestreo de elementos, es posible utilizar los principios del muestreo en varias etapas, mediante la selección de diferentes unidades de muestreo que contienen a los elementos de interés. Por consiguiente, el diseño de muestreo de una encuesta de hogares es generalmente probabilístico estratificado y bietápico:

- Se realiza una estratificación por zona: urbano/rural, por región y por los estratos socioeconómicos definidos en los capítulos anteriores.
- De forma independiente, dentro de cada estrato se realiza un muestreo bietápico.
 - En la primera etapa, se seleccionan áreas cartográficas, conocidas como unidades primarias de muestreo (UPM) siguiendo un diseño de muestreo proporcional al número de viviendas, hogares o personas del conglomerado.
 - En la segunda etapa, se escoge aleatoriamente un número fijo de hogares dentro de cada UPM siguiendo un diseño de muestreo aleatorio simple.

Este tipo de esquemas tienen una consecuencia importante en cuanto a la eficiencia estadística. Nótese que, en la segunda etapa de muestreo, la variación que se pueda presentar entre los hogares seleccionados en una misma UPM es muy baja con respecto a la variación que se puede presentar entre diferentes UPM. Por el principio de representatividad, las personas se aglomeran de manera natural y forman conglomerados homogéneos. Es decir, dentro de una misma UPM, los hogares tendrán características sociales bastante similares. En particular, estos

hogares tendrán similares realidades en cuanto a su ingreso, gasto, desocupación, analfabetismo, educación, etc.

- No es de esperarse encontrar un hogar con altos niveles de ingreso y gasto, cuyos integrantes tienen un nivel de educación muy alto, habitando una vivienda que se encuentre en un sector marginal o deprimido de la ciudad, en donde el acceso al alcantarillado es precario, y con deficiencias en los servicios de electricidad o agua potable; aunque podría suceder, no es lo que se esperaría.
- De la misma forma, no es de esperar que un hogar pobre, cuyo ingreso per cápita es bastante bajo y no alcanza para cubrir las necesidades básicas de sus habitantes, ocupe una vivienda ubicada en un sector acaudalado.

De la misma manera, en este tipo de investigaciones sociales, la varianza existente entre los conglomerados es inmensa al compararla con la variación dentro de los conglomerados. Por esta razón, es de esperarse que existan diferencias significativas entre las UPM que componen la muestra, puesto que la realidad de una UPM en un sector deprimido no es la misma que la de una UPM en un sector opulento. Este es un reflejo de las desigualdades propias de América Latina, las cuales han ocupado la agenda política y legislativa de las últimas décadas. Retomaremos esta particularidad en los posteriores capítulos, cuando se aborde el tema de la eficiencia estadística y la medición del error de muestreo.

A continuación se definirán todos los elementos involucrados en la selección de una muestra de hogares. En general, los diseños de muestreo de las encuestas de hogares estimarán el total de cada UPM t_i mediante una sub-muestra seleccionada desde el marco de muestreo compuesto por los sectores cartográficos definidos en el último censo. Suponga que la población de hogares U se divide en N_I UPM, que definen una partición de la población, llamados también **conglomerados** y denotados como $U_I = \{U_1, \dots, U_{N_I}\}$ (U_I es la población de todas las UPM en un país y N_I es el número total de UPM dentro del país). Note que la i -ésima UPM U_i $i = 1, \dots, N_I$ contiene N_i hogares. Luego, el proceso de selección se surte de la siguiente manera:

- Una muestra s_I de UPM es seleccionada de U_I de acuerdo a un diseño de muestreo $p_I(s_I)$. El tamaño de la muestra de UPM se denota como n_I . Nótese que s_I representa la muestra aleatoria de UPM que fue seleccionada de acuerdo a la medida de probabilidad $p_I(s_I)$.
- Para cada UPM U_i $i = 1, \dots, n_I$ en la muestra seleccionada s_I , se realiza de forma independiente un submuestreo de hogares, de tal forma que en cada UPM existirá una muestra s_i de hogares de acuerdo a un diseño de muestreo $p_i(s_i)$. Nótese que s_i representa la muestra aleatoria de hogares que fue seleccionada en la segunda etapa de acuerdo a la medida de probabilidad $p_i(s_i)$.

Por lo tanto, en la primera etapa se ha identificado todos los sectores cartográficos de país y se ha generado el marco de muestreo de las UPM que se separan en grupos mutuamente excluyentes, según las variables de estratificación explícita

previamente definidas; dentro de cada estrato se selecciona la muestra de UPM en donde la probabilidad que tiene cada UPM de pertenecer a la muestra está determinada por el número de personas o viviendas (medida de tamaño). En esta etapa es importante tener en cuenta que se seleccionará un número mayor de UPM en los estratos más grandes; evidentemente las regiones con más habitantes tendrán una muestra de UPM más grande, aunque esta relación no siempre es lineal. se recomienda que el diseño de muestreo debe ser tan simple como sea posible¹.

A pesar de que la medida de tamaño permite que las UPM con mayor cantidad de hogares tengan una mayor probabilidad de ser escogidas, esta diferencia en las probabilidades de selección se compensa en la segunda etapa de muestreo, debido a que cada hogar tendrá igual probabilidad de ser elegido en la muestra dentro del estrato. Es pertinente observar que, para la segunda etapa se requiere contar con un listado exhaustivo de todos los hogares dentro de todas las UPM seleccionadas. Este proceso de selección requerirá de un empadronamiento previo que, no solo actualice el número de hogares, sino que permita identificarlos y ubicarlos dentro de la UPM. De esta manera, y de forma aleatoria simple, se elige una muestra de hogares y su tamaño no varía entre UPM.

III. Acerca del efecto de diseño

La estructura de cálculo del tamaño de muestra tiene como insumo central al efecto de diseño. Una expresión generalizada que da cuenta del efecto de aglomeración en los diseños de muestreo en varias etapas (Park and Lee, 2006) es la siguiente:

$$DEFF \approx 1 + (\bar{m} - 1)\rho$$

En donde \bar{m} representa el número promedio de hogares seleccionados dentro de cada UPM y ρ es el coeficiente de correlación intraclase, que representa el grado de homogeneidad de la variable de interés dentro de cada hogar. Sin embargo, esta cifra cambia dependiendo de si la inferencia de la encuesta de hogares se quiere realizar a nivel nacional o a nivel regional. Por ejemplo, UN (2005, capítulo 7) presenta el comportamiento de esta medida a lo largo de tres encuestas de hogares en Brasil: la *Pesquisa Nacional por Amostra de Domicílios* (PNAD), la *Pesquisa Mensal de Emprego* (PME) y la *Pesquisa de Padrões de Vida* (PPV). En general, estas encuestas utilizan estratificación y selección de UPM con probabilidades desiguales; además, el tamaño promedio de las UPM es de 250 viviendas, de las cuales son seleccionadas 13 por la PNAD, 20 en la PME y 16 y 8 viviendas en la PPV en la zona rural y urbana, respectivamente.

Basado en lo anterior, se nota que los efectos de diseño no solo son diferentes para cada parámetro que se desea estimar sino que varían de acuerdo a

¹Nótese que los esquemas de estimación se van volviendo más complejos a medida que el diseño de muestra agrega más etapas o más fases.

la subpoblación en la que se realice la estimación. Por ejemplo, considere el parámetro *proporción de hogares con electricidad*; en la PNAD se ha estimado que el efecto de diseño para este parámetro es de 7.92 a nivel nacional, de 1.03 en las áreas metropolitanas, de 4.43 en las ciudades grandes y de 7.27 en las áreas rurales. Por lo anterior, y basado en la expresión que define el efecto de diseño, se observa que, fijando $\bar{m} = 10$, el coeficiente de correlación intraclase varía dependiendo de la zona. En efecto, $\rho = 0.76$ a nivel nacional, $\rho = 0.0033$ en las zonas metropolitanas, $\rho = 0.38$ en las ciudades grandes y $\rho = 0.69$ en las áreas rurales. Lo anterior implica que hay una mayor heterogeneidad de los hogares con electricidad entre las UPM a nivel nacional y en las áreas rurales, es decir algunos hogares tienen electricidad y otros no entre las UPM. Sin embargo, en las zonas metropolitanas la variación de esta variable entre las UPM es casi nula, es decir que todos los hogares tienen electricidad entre las UPM de estas zonas.

Por otro lado, para la misma encuesta PNAD, los efectos de diseño para el número promedio de cuartos usados como dormitorios es de 2.14 a nivel nacional, de 2.37 en las áreas metropolitanas, de 1.72 en las ciudades grandes y de 2.09 en las áreas rurales. Considerando que $\bar{m} = 10$, el coeficiente de correlación intraclase es de $\rho = 0.12$ a nivel nacional, $\rho = 0.15$ en las zonas metropolitanas, $\rho = 0.08$ en las ciudades grandes y $\rho = 0.12$ en las áreas rurales. Lo anterior implica que hay una mayor homogeneidad del número de cuartos utilizados como dormitorio entre las UPM del país y de las zonas que lo componen. Al conocer el valor que toma el efecto de diseño para la estimación de un parámetro de interés, es posible crear escenarios de simulación que permitan establecer el tamaño de muestra en la planeación de las encuestas de hogares. Las anteriores expresiones corresponden al número de individuos que deberían ser seleccionados en cada subgrupo de interés. Por lo tanto, estos cálculos deben ser hechos tantas veces como subgrupos de interés exista en la encuesta, adecuando cada expresión a su contraparte poblacional. Por ejemplo, si el interés está en hacer inferencia en dos estratos: el rural y el urbano, entonces se debe calcular estas expresiones dos veces, una para cada estrato. Al final, el tamaño de muestra nacional será la sumatoria de los tamaños de muestra en cada uno de los estratos del país.

A. Efecto de la estratificación en las estrategias de muestreo

De hecho, la propuesta de [Park \(2003\)](#) apunta en este mismo sentido, pues propone que el efecto de diseño de cualquier encuesta se puede descomponer en tres partes que se relacionan entre sí de forma multiplicativa. En primer lugar está el efecto debido a la ponderación desigual, $def f^W$; en segundo lugar se encuentra el efecto debido a la estratificación, $def f^S$; y por último se tiene el efecto debido al muestreo en varias etapas, $def f^C$. Por lo tanto:

$$DEFF = def f^W \times def f^S \times def f^C$$

Al encontrar la mejor estratificación, el equipo del INE ha permitido que la segunda componente de esta descomposición sea mínima, en cuanto se han seguido los pasos necesarios para ello y se ha escogido la estratificación en tres particiones que aseguró un menor $def f^S$ para los indicadores estudiados. Ahora, cuando el marco se entregue al área de producción estadísticas, será tarea del INE asegurar que los efectos de diseño dados por el efecto de conglomeración y el uso del muestreo en varias etapas $def f^C$ sea mínimo, así como el efecto debido al uso de factores de ponderación desiguales, $def f^W$. En el primer caso, se deberá estudiar, para cada encuesta y operación estadística que haga uso del marco de muestreo estratificado, la relación entre UPMs y hogares a la luz de los indicadores de interés; en particular, es necesario decidir cuántos hogares serán seleccionados en cada UPM y cuántas UPMs serán seleccionadas dentro de cada estrato. De la misma manera, en el segundo caso, también se debe decidir, a la luz de la correlación entre los indicadores particulares de cada encuesta de hogares, cuáles variables de control serán utilizadas en la calibración de los estimadores. De esta forma, en esta estrategia tripartita, se asegura que el efecto de diseño de una encuesta levantada por el INE sea pequeño.

Capítulo 6

El efecto de diseño

Cuando se selecciona una muestra utilizando un diseño de muestreo complejo es muy improbable que exista independencia entre las observaciones. Además, como el muestreo de las encuestas de hogares es complejo, la distribución de la variable de interés no es la misma para todos los individuos. Por lo anterior, cuando se analizan datos que provienen de encuestas de hogares la inferencia correcta debe tener en cuenta estas grandes desviaciones con respecto al análisis estadístico clásico, que considera muestras aleatorias simples. Por ello, en la mayoría de ocasiones se necesita aumentar el tamaño de muestra para obtener la precisión deseada.

El efecto de diseño fue definido por [Kish \(1965, página 258\)](#) como *la relación entre la varianza real de una muestra y la varianza real de una muestra aleatoria simple del mismo número de elementos* y toma la siguiente expresión:

$$DEFF = \frac{Var(\hat{\theta})}{Var_{MAS}(\hat{\theta})}$$

En donde $Var(\hat{\theta})$ denota la varianza de un estimador $\hat{\theta}$ bajo un diseño de muestreo complejo P y $Var_{MAS}(\hat{\theta})$ denota la varianza del este estimador $\hat{\theta}$ bajo un diseño de muestreo aleatorio simple MAS . Esta cifra da cuenta del efecto de aglomeración causado por la utilización de un diseño de muestreo complejo (p), frente a un diseño de muestreo aleatorio simple MAS , en la inferencia de un parámetro de la población finita θ (que puede ser un total, un promedio, una proporción, una razón, un percentil, etc.).

I. Formas comunes del efecto de diseño

Por ejemplo, suponiendo que el parámetro de interés es la media poblacional (\bar{y}) de una variable de interés y (por ejemplo, el ingreso per cápita mensual), es

posible escribir la varianza del estimador bajo el diseño de muestreo complejo como

$$Var(\hat{y}) = \frac{DEFF}{n} \left(1 - \frac{n}{N}\right) S_y^2$$

En donde S_y^2 corresponde a la varianza de la características de interés, N es el tamaño de la población de interés y n el tamaño de la muestra de individuos. Por otro lado, suponiendo que el parámetro de interés es la proporción poblacional (\$P\$) de una variable dicotómica y (por ejemplo, el porcentaje de individuos de bajo de la línea de pobreza en un país), es posible escribir la varianza del estimador bajo el diseño de muestreo complejo como

$$Var(\hat{P}) = \frac{DEFF}{n} \left(1 - \frac{n}{N}\right) P(1 - P)$$

Cuando se trata de un diseño muestral multietápico, por ejemplo, es común seleccionar UPM en la primera etapa y posteriormente seleccionar hogares dentro de las áreas seleccionadas. En este contexto, el coeficiente de correlación intraclase está definido por

$$\rho = 1 - \frac{N_I}{N_I - 1} \frac{WSS}{TSS}$$

En donde $TSS = \sum_U (y_k - \bar{y}_U)^2$, $BSS = \sum_{U_I} N_I (\bar{y}_{U_I} - \bar{y}_U)^2$ y $WSS = TSS - BSS$. Cuando la característica de interés y es heterogénea entre los conglomerados, pero los conglomerados son homogéneos entre sí, entonces ρ es cercano a 0; mientras que si los conglomerados son heterogéneos entre sí, pero homogéneos dentro de cada uno, entonces ρ es cercano a 1. En este tipo de escenarios, el efecto de diseño se puede expresar de la siguiente manera

$$DEFF = 1 + (\bar{m} - 1)\rho$$

donde \bar{m} corresponde al promedio de hogares seleccionados por UPM y ρ es el coeficiente de correlación intraclase entre la variable de interés y las UPM. En general, nótese que el efecto de diseño será mayor cuando:

1. El coeficiente de correlación crezca, lo cual no puede ser controlado de antemano, puesto que se trata de la observación de la realidad. En general, ρ_y será más grande cuando la distribución de la variable de interés sea explicada por las UPM en el país. Por ejemplo, si el indicador de interés es la pobreza y los hogares pobres están aglomerados, segregados y separados de los hogares más acaudalados, entonces ρ_y será más grande; además, entre más segregación haya, mayor será su valor.

2. El promedio de hogares seleccionados por UPM ascienda. Esto es controlado de antemano en la etapa de diseño y será un número fijo y transversal en la encuesta.

II. Estimación del efecto de diseño

En la expresión de efecto de diseño se debe notar dos hechos importantes, en primer lugar, $Deff$ depende del diseño muestral $p(s)$, y en segundo lugar, depende del estimador del parámetro θ . De esta forma, no es correcto describir al $Deff$ únicamente como una medida de eficiencia del diseño muestral, puesto que bajo un mismo diseño, este puede tomar diferentes valores según el parámetro que se quiera estimar.

Nótese que ninguno de los componentes del efecto de diseño se conoce y por ende deben ser estimados. Un estimador aproximadamente insesgado de esta varianza S_U^2 es la varianza muestral ponderada, la cual está dada por la siguiente expresión:

$$\hat{S}_U^2 = \left(\frac{n}{n-1} \right) \frac{\sum_s w_k (y_k - \hat{\theta})^2}{\sum_s w_k - 1}$$

De esta forma, una estimación de la varianza $Var_{MAS}(\hat{\theta})$ bajo muestreo aleatorio simple está dada por la siguiente expresión:

$$\widehat{Var}_{MAS}(\hat{\theta}) = \frac{1}{n} \left(1 - \frac{n}{\hat{N}} \right) \hat{S}_U^2$$

En donde $\hat{N} = \sum_s w_k$. Por lo tanto, la estimación del efecto de diseño DEFF está dada por

$$\widehat{DEFF} = \frac{\widehat{Var}(\hat{\theta})}{\widehat{Var}_{MAS}(\hat{\theta})}$$

La idea del efecto de diseño trata de evaluar el mismo estimador bajo diferentes escenarios de muestreo. Como el estimador que se está estudiando $\hat{\theta}$ viene ponderado por los factores de expansión de la encuesta, entonces lo más conveniente es utilizar el mismo rasero para evaluar ambas estrategias de muestreo. Es posible encontrar una discusión más profunda sobre el efecto de diseño en [Gambino \(2009, sección 4.\)](#), [Särndal et al. \(2003, página 188\)](#) y [Gutiérrez et al. \(2016, página 101\)](#).

III. El efecto de diseño en subpoblaciones

La estimación del efecto de diseño es un problema común cuando se trabaja con estimaciones desagregadas en subpoblaciones de interés. Luego, cuando las subpoblaciones constituyen estratos (o agregaciones de estratos) planeados de antemano, para los cuales se conoce previamente su tamaño poblacional, se tiene el siguiente efecto de diseño:

$$DEFF_h = \frac{Var(\hat{\theta}_h)}{Var_{MAS}^h(\hat{\theta}_h)}$$

En donde $Var_{MAS}^h(\hat{\theta}_h)$ es la varianza restringida al estrato h ($h = 1, \dots, H$); en el caso en el que $\hat{\theta}_h$ corresponda al estimador del promedio poblacional en el estrato h , su valor es el siguiente:

$$Var_{MAS}^h(\hat{\theta}_h) = \frac{1}{n_h} \left(1 - \frac{n_h}{N_h} \right) S_{y_h}^2$$

Siendo n_h el tamaño de la muestra en el estrato h , N_h el tamaño poblacional del estrato h y $S_{y_h}^2$ la varianza muestral de la variable de interés restringida al subgrupo h . Cuando la subpoblación de interés no es un estrato o un post-estrato sino un subgrupo aleatorio - como por ejemplo las personas pobres, las personas ocupadas, o cualquier otro subgrupo no planeado en el diseño de la encuesta o en la etapa de calibración - cuyo tamaño de muestra no es fijo (o condicionalmente fijo por la calibración) sino aleatorio, entonces la estimación correcta del efecto de diseño es la siguiente:

$$DEFF = \frac{Var(\hat{\theta}_h)}{Var_{MAS}^U(\hat{\theta}_h)}$$

En donde $Var_{MAS}^U(\hat{\theta}_h)$ es la varianza poblacional del estimador de interés. En el caso en el que $\hat{\theta}_h$ corresponda al estimador del promedio poblacional en el estrato h , entonces su varianza estaría dada por la siguiente expresión:

$$Var_{MAS}^U(\hat{\theta}_h) = \frac{1}{n} \left(1 - \frac{n}{N} \right) S_{y_{hU}}^2$$

En donde $S_{y_{hU}}^2$ es la varianza muestral de la variable de interés calculada en toda la población. Por lo tanto, en ambos efectos de diseño, la estimación de la varianza del diseño de muestreo complejo $Var(\hat{\theta}_h)$ es la misma, pero el denominador cambia dependiendo de si el subgrupo es un estrato o no. Es por esta razón que en los software computacionales las cifras relacionadas con la estimación puntual, errores estándar, intervalos de confianza y coeficientes de variación coinciden plenamente. Sin embargo, tanto los software **Stata** como **SPSS** estiman

por defecto el DEFF. Nótese que, en este caso, las estimaciones de $Var_{MAS}^U(\hat{\theta}_h)$ y $Var_{MAS}^h(\hat{\theta}_h)$ serán diferentes, puesto que la primera involucra a toda la muestra, mientras que la segunda involucra únicamente a la muestra del estrato.

Cuando los subgrupos de interés son agregaciones de los estratos de diseño, no es correcto utilizar el enfoque que **Stata** trae por defecto. En efecto, Lumley (2010) afirma que el efecto del diseño compara la varianza de una media o total con la varianza de un estudio del mismo tamaño utilizando un muestreo aleatorio simple sin reemplazo y que su cálculo será incorrecto si los pesos de muestreo se han re-escalado o no son recíprocos a las probabilidades de inclusión. Además, en **R** se compara la varianza de la estimación con la varianza de una estimación basada en una muestra aleatoria simple del mismo tamaño que el de la subpoblación. Entonces, por ejemplo, en el muestreo aleatorio estratificado, el efecto de diseño calculado en un estrato será igual a uno.

IV. Otras consideraciones

A. El efecto de diseño general

Suponga que el diseño muestral es estratificado con H estratos; entonces por la independencia de la selección en los estratos, la varianza del estimador de un total poblacional t_y está dada por

$$Var(\widehat{t_{y,\pi}}) = \sum_{h=1}^H Var_h(\widehat{t_{y,\pi}})$$

donde

$$Var_h(\widehat{t_{y,\pi}}) = Def f_h \times Var_{MAS,h}(\widehat{t_{y,\pi}})$$

Por otro lado,

$$Var(\widehat{t_{y,\pi}}) = Def f \times Var_{MAS}(\widehat{t_{y,\pi}})$$

De esta forma, se tiene que

$$Def f = \frac{\sum_{h=1}^H Def f_h Var_{MAS,h}(\widehat{t_{y,\pi}})}{Var_{MAS}(\widehat{t_{y,\pi}})} = \frac{\sum_{h=1}^H Def f_h \frac{N_h^2}{n_h} (1 - \frac{n_h}{N_h}) S_{y,U_h}^2}{\frac{N^2}{n} (1 - \frac{n}{N}) S_{y,U}^2}$$

Es decir, el efecto de diseño puede ser visto como una combinación lineal de los efectos de diseño de los H estratos ($Def f = \sum_{h=1}^H Def f_h w_h$). En donde el peso w_h está dado por

$$w_h = \frac{\frac{N_h^2}{n_h} \left(1 - \frac{n_h}{N_h}\right) S_{y,U_h}^2}{\frac{N^2}{n} \left(1 - \frac{n}{N}\right) S_{y,U}^2}$$

Es claro que los pesos w_h son todos positivos, pero no necesariamente son menores a 1, y la suma de ellos tampoco es igual a 1. A continuación, examinamos la forma de w_h en el caso especial de muestras autoponderadas en todos los estratos. En este caso, se tiene que $\frac{n_h}{N_h} = \frac{n}{N}$ para todo $h = 1, \dots, H$, y se puede ver que

$$w_h = \frac{N_h S_{y,U_h}^2}{N S_{y,U}^2} = \frac{\sum_{U_h} (y_k - \bar{y}_{U_h})^2}{\sum_U (y_k - \bar{y}_U)^2}$$

Aunque $\sum_{h=1}^H w_h \neq 1$, el peso del estrato h sí tiene una interpretación interesante, pues queda definido como la suma de cuadrados dentro del estrato, dividido por la suma de cuadrados totales de la variable de interés. Y podemos concluir que cuando los estratos están bien contruidos, esto es, la variable de interés es homogénea dentro de cada estrato y los diferentes estratos son heterogéneos entre sí, los pesos w_h serán muy pequeños y el *Def* general resultará mucho más pequeño que los *Def* de los estratos.

Por otro lado, si los estratos no fueron contruidos teniendo en cuenta la variabilidad de la característica de interés, entonces $S_{y,U_h}^2 \approx S_{y,U}^2$ y $w_h = N_h/N$. De esta forma, la suma de los pesos es igual a 1, y se puede concluir que el *Def* del diseño general es un promedio ponderado de los efectos de los H estratos, y el estrato que tiene mayor peso será aquel que tiene mayor representación del universo.

Finalmente, alguno de los pesos w_h puede resultar ser mayor a 1 cuando para algún estrato $\frac{n_h}{N_h} \neq \frac{n}{N}$, y cuando los estratos no están bien contruidos.

B. El efecto de diseño en las encuestas de hogares de la región

La estructura de cálculo del tamaño de muestra tiene como insumo central al efecto de diseño. Una expresión generalizada que da cuenta del efecto de aglomeración en los diseños de muestreo en varias etapas ([Park and Lee, 2006](#)) es la siguiente:

$$DEFF \approx 1 + (\bar{m} - 1)\rho$$

En donde \bar{m} representa el número promedio de hogares seleccionados dentro de cada UPM y ρ es el coeficiente de correlación intraclase, que representa el grado de homogeneidad de la variable de interés dentro de cada hogar. Sin embargo, esta cifra cambia dependiendo de si la inferencia de la encuesta de hogares se quiere realizar a nivel nacional o a nivel regional. Por ejemplo, [UN](#)

(2005, capítulo 7) presenta el comportamiento de esta medida a lo largo de tres encuestas de hogares en Brasil: la *Pesquisa Nacional por Amostra de Domicílios* (PNAD), la *Pesquisa Mensal de Emprego* (PME) y la *Pesquisa de Padrões de Vida* (PPV). En general, estas encuestas utilizan estratificación y selección de UPM con probabilidades desiguales; además, el tamaño promedio de las UPM es de 250 viviendas, de las cuales son seleccionadas 13 por la PNAD, 20 en la PME y 16 y 8 viviendas en la PPV en la zona rural y urbana, respectivamente.

Basado en lo anterior, se nota que los efectos de diseño no solo son diferentes para cada parámetro que se desea estimar sino que varían de acuerdo a la subpoblación en la que se realice la estimación. Por ejemplo, considere el parámetro *proporción de hogares con electricidad*; en la PNAD se ha estimado que el efecto de diseño para este parámetro es de 7.92 a nivel nacional, de 1.03 en las áreas metropolitanas, de 4.43 en las ciudades grandes y de 7.27 en las áreas rurales. Por lo anterior, y basado en la expresión que define el efecto de diseño, se observa que, fijando $\bar{m} = 10$, el coeficiente de correlación intraclase varía dependiendo de la zona. En efecto, $\rho = 0.76$ a nivel nacional, $\rho = 0.0033$ en las zonas metropolitanas, $\rho = 0.38$ en las ciudades grandes y $\rho = 0.69$ en las áreas rurales. Lo anterior implica que hay una mayor heterogeneidad de los hogares con electricidad entre las UPM a nivel nacional y en las áreas rurales, es decir algunos hogares tienen electricidad y otros no entre las UPM. Sin embargo, en las zonas metropolitanas la variación de esta variable entre las UPM es casi nula, es decir que todos los hogares tienen electricidad entre las UPM de estas zonas.

Por otro lado, para la misma encuesta PNAD, los efectos de diseño para el número promedio de cuartos usados como dormitorios es de 2.14 a nivel nacional, de 2.37 en las áreas metropolitanas, de 1.72 en las ciudades grandes y de 2.09 en las áreas rurales. Considerando que $\bar{m} = 10$, el coeficiente de correlación intraclase es de $\rho = 0.12$ a nivel nacional, $\rho = 0.15$ en las zonas metropolitanas, $\rho = 0.08$ en las ciudades grandes y $\rho = 0.12$ en las áreas rurales. Lo anterior implica que hay una mayor homogeneidad del número de cuartos utilizados como dormitorio entre las UPM del país y de las zonas que lo componen.

como se verá en los capítulos posteriores, al conocer el valor que toma el efecto de diseño para la estimación de un parámetro de interés, es posible crear escenarios de simulación que permitan establecer el tamaño de muestra en la planeación de las encuestas de hogares. Las anteriores expresiones corresponden al número de individuos que deberían ser seleccionados en cada subgrupo de interés. Por lo tanto, estos cálculos deben ser hechos tantas veces como subgrupos de interés exista en la encuesta, adecuando cada expresión a su contraparte poblacional. Por ejemplo, si el interés está en hacer inferencia en dos estratos: el rural y el urbano, entonces se debe calcular estas expresiones dos veces, una para cada estrato. Al final, el tamaño de muestra nacional será la sumatoria de los tamaños de muestra en cada uno de los estratos del país.

C. Descomposición del efecto de diseño en las encuestas de hogares

Park (2003) propone que el efecto de diseño de cualquier encuesta se puede descomponerse en tres partes que se relacionan entre sí de forma multiplicativa. En primer lugar está el efecto debido a la ponderación desigual, $def f^W$; en segundo lugar se encuentra el efecto debido a la estratificación, $def f^S$; y por último se tiene el efecto debido al muestreo en varias etapas, $def f^C$. Por lo tanto:

$$DEFF = def f^W \times def f^S \times def f^C$$

La primera componente $def f^W$ del efecto de diseño general tiende a aumentar ligeramente la variación de las estrategias de muestreo. Valliant et al. (2018) afirman que esta componente puede ser estimada por medio de la siguiente expresión:

$$def f^W = 1 + cv^2(w_k)$$

En donde $cv(w_k)$ representa el coeficiente de variación de los pesos de muestreo w_k de las unidades en la encuesta. Si los pesos de muestreo son uniformes, entonces no habrá un incremento significativo en la varianza de la estrategia. Es por esto que los esquemas autoponderados son deseables en los diseños de muestreo de las encuestas de hogares. Por otra parte, si los pesos de muestreo tienen una variación grande, entonces habrá un incremento significativo en la varianza y, por ende, en el tamaño de muestra. Como se verá más adelante, los ajustes en el factor de expansión pueden inducir una alta variabilidad y por consiguiente se recomienda, en la medida de lo posible, crear clases o subgrupos de ajuste para mitigar y acotar la dispersión de los pesos finales de la encuesta.

Al encontrar la mejor estratificación, nos aseguramos de que la segunda componente $def f^S$ de esta descomposición sea menor a uno (es decir que la varianza se reduce). Lamentablemente, la reducción de la varianza no suele ser tan grande y no mitiga los efectos de aglomeración debido a las múltiples etapas de los diseños de muestreo complejos.

En general, la disminución del $def f$ debido a la estratificación se matiza con el aumento del $def f$ debido a la desigualdad de los pesos de muestreo. Es por esto que $def f^C$ predomina en el efecto de diseño general y es la razón por la cual se le presta mucha atención. UN (2008) propone que, para mitigar los efectos del muestreo multietápico, se consideren las siguientes estrategias:

1. Seleccionar tantas UPM como sea posible.
2. Definir las UPM tan pequeñas como sea posible, en términos del número de viviendas que las componen.
3. Seleccionar un número fijo de viviendas dentro de las UPM seleccionadas, en vez de un número variable.
4. Utilizar un muestreo sistemático en la UPM, en vez de seleccionar segmentos de viviendas contiguas.

Recuérdese que $def f^C = 1 + (\bar{m} - 1)\rho$. Por tanto, habiéndose definido el marco de muestreo, en el momento del levantamiento de la información primaria, ya no se tendrá control sobre el valor de la correlación intraclase ρ ; únicamente se tiene control sobre el número de viviendas que serán seleccionadas en promedio en las UPMS \bar{m} . Si el marco de muestreo quedó correctamente definido, entonces el valor de ρ será tan pequeño como fue posible establecerlo al proponer las UPM; de la misma manera, es recomendable que el equipo técnico dentro de los INEs defina el menor número promedio posible de encuestas dentro de las UPM \bar{m} para que el efecto de aglomeración sea mínimo.

Capítulo 7

Cálculo del tamaño de muestra

Uno de los tópicos más importantes en la literatura del diseño y análisis de encuestas de hogares es el tamaño de muestra. En general, en los libros de estadística y muestreo se establecen las características generales de los esquemas de muestreo y las propiedades estocásticas de los estimadores sin profundizar en que la muestra debe seleccionarse y que esta selección depende de cuántos hogares se necesiten en el estudio. De hecho, al hablar del tamaño de muestra en una encuesta de hogares, no solo se debe hacer referencia a los hogares, sino también a las personas. En efecto, la determinación del tamaño de muestra debe depender del propósito de la encuesta. Por ejemplo, considere una encuesta de propósitos múltiples que se levanta cada año con el fin de indagar acerca de fenómenos demográficos, sociales, educativos, y de condiciones de vida; en este contexto, se debe tener en cuenta que el tamaño de muestra definido debe ser útil, pertinente y apropiado para todas los indicadores que se desean medir al mismo tiempo. En este capítulo, el lector podrá encontrar una guía útil para identificar la mejor ruta a la hora de abordar el cálculo del tamaño de muestra en las encuestas de hogares.

I. Confiabilidad y precisión

Antes de introducir las metodologías básicas para el cálculo del tamaño de muestra mínimo, es necesario definir los diferentes tipos de error muestral en una encuesta. En principio, se define un intervalo de confianza para el parámetro θ , inducido por su estimador insesgado $\hat{\theta}$ (que se supone con distribución normal de media θ y varianza $Var(\hat{\theta})$), como

$$IC(1 - \alpha) = \left[\hat{\theta} - z_{1-\alpha/2} \sqrt{Var(\hat{\theta})}, \hat{\theta} + z_{1-\alpha/2} \sqrt{Var(\hat{\theta})} \right] \quad (7.1)$$

donde $z_{1-\alpha/2}$ se refiere al cuantil $(1 - \alpha/2)$ de una variable aleatoria con distribución normal estándar. Cuando el diseño de muestreo es complejo, es necesario reemplazar el percentil de la distribución normal estándar por el presentir de una distribución t - *student* con $N_I - H$ grados de libertad, suponiendo que hay N_I unidades primarias de muestreo y H estratos. En este orden de ideas, nótese que

$$1 - \alpha = \sum_{Q_0 \supset s} p(s),$$

donde Q_0 es el conjunto de todas las posible muestras cuyo intervalo de confianza contiene al parámetro θ . Desde la expresión del intervalo de confianza, se define el *margen de error*, como aquella cantidad que se suma y se resta al estimador insesgado. En este caso, se define como

$$ME = z_{1-\alpha/2} \sqrt{Var(\hat{\theta})} \quad (7.2)$$

Desde esta expresión también es posible definir el *error estándar*, dado por

$$EE = \sqrt{Var(\hat{\theta})} \quad (7.3)$$

Las anteriores medidas sólo tienen en cuenta la precisión del estimador. Una medida que tiene en cuenta la precisión y el sesgo del estimador es el *margen de error relativo*, que se define como

$$MER = z_{1-\alpha/2} \frac{\sqrt{Var(\hat{\theta})}}{E(\hat{\theta})} \quad (7.4)$$

De la misma manera, también se define el *coeficiente de variación* o *error estándar relativo* definido por

$$CV = \frac{\sqrt{Var(\hat{\theta})}}{E(\hat{\theta})} \quad (7.5)$$

El tamaño de muestra dependerá del tipo de error que se quiera minimizar. Por ejemplo, para una población particular, el tamaño de muestra requerido para minimizar el margen de error, no será el mismo que el que se necesitará para minimizar el coeficiente de variación.

II. El efecto de diseño en la determinación del tamaño de muestra

Al momento diseñar un estudio por muestreo con encuestas de hogares, es importante establecer el número mínimo de encuestas que se deben realizar. Esto es necesario para determinar el costo del estudio; y en el aspecto técnico, permite tener control desde la fase de diseño sobre la calidad estadística de los resultados esperados en el estudio. Como se mencionó anteriormente, esta calidad puede ser medida en términos del error muestral, con indicadores tales como el margen de error absoluto, el margen de error relativo o el coeficiente de variación. Estas medidas todas dependen de la varianza del estimador bajo el diseño muestral complejo; por lo tanto, contar con un valor aproximado para el efecto de diseño *Def* nos permite obtener una aproximación a dicha varianza, y acercarnos al error muestral del estudio en la fase del diseño.

Uno de los primeros paradigmas con el que se debe lidiar es el de la independencia entre las observaciones. Este es un supuesto que gobierna gran parte de la teoría de análisis estadístico, pero que infortunadamente no se aplica en el contexto de las encuestas de hogares. Ante los retos que se debe enfrentar y las diversas estrategias de recolección de información, las fórmulas que se desprenden del supuesto de que las observaciones corresponden a una muestra de variables independientes e idénticamente distribuidas no son plausibles.

La estratificación, las múltiples etapas y la aglomeración de las unidades de muestreo hacen que este supuesto no se cumpla en la práctica y por tanto, utilizar las expresiones tradicionales que se encuentran en los libros introductorios de estadística guiará a tamaños de muestra insuficientes. El problema del tamaño de muestra en encuestas de hogares ha sido abordado por diferentes autores con diferentes enfoques. Quizás uno de los más aceptados es aquel que define un factor de ajuste, llamado efecto de diseño (DEFF), en función de la correlación que hay entre la variable de interés con las unidades primarias de muestreo. A partir de este efecto de diseño se calcula el número de personas que deben ser encuestadas para minimizar un error de muestreo predefinido.

Cuando para la población de interés, se selecciona una muestra utilizando un diseño de muestreo de conglomerados o en varias etapas, no es imposible afirmar que existe independencia entre las observaciones. Lo anterior hace que no sea posible utilizar las fórmulas clásicas para la determinación de un tamaño de muestra, al considerar un diseño de muestreo aleatorio simple. Sin embargo, una forma sencilla de incorporar este efecto de aglomeración en las expresiones clásicas del muestreo aleatorio simple la da la siguiente relación, denotada como efecto de diseño:

$$DEFF(\hat{\theta}) = \frac{Var_p(\hat{\theta})}{Var_{MAS}(\hat{\theta})} \quad (7.6)$$

Esta cifra da cuenta del efecto de aglomeración causado por la utilización de un diseño de muestreo cualquiera (p), frente a un diseño de muestreo aleatorio simple (MAS) en la inferencia de un parámetro de la población finita θ (que puede ser un total, una proporción, una razón, un coeficiente de regresión, etc.). Por lo anterior, es posible escribir la varianza del estimador bajo el diseño de muestreo complejo como

$$Var_p(\hat{\theta}) = DEFF(\hat{\theta}) Var_{MAS}(\hat{\theta}) \quad (7.7)$$

$$= DEFF(\hat{\theta}) \frac{N^2}{n} \left(1 - \frac{n}{N}\right) S_{yU}^2 \quad (7.8)$$

Por lo tanto, si al implementar un muestreo aleatorio simple el tamaño de muestra n_0 es suficiente para conseguir la precisión deseada, entonces el valor del tamaño de muestra que tendrá en cuenta el efecto de aglomeración para un diseño complejo estará cercano a $n \approx n_0 \times DEFF$. UN (2008) afirma que, dada esta relación, no es deseable aceptar estrategias de muestreo que induzcan efectos de diseño mayores a 2.5 o 3. Lo cual quiere decir que los equipos técnicos dentro de los INEs deben plantear esquemas en donde el efecto de diseño para los indicadores claves de la encuesta no sea grande.

En particular, para el caso de una proporción, la calidad del estimador se puede medir en términos de que con un alto nivel de confianza $(1 - \alpha)$, la distancia entre el estimador y el parámetro no supere el margen de error previamente establecido (ME), esto es:

$$1 - \alpha = \Pr \left(|\hat{P} - P| < ME \right)$$

El estimador de Horvitz-Thompson de la proporción \hat{P} es insesgado para P y su distribución asintótica es gaussiana con varianza dada por

$$Var(\hat{P}) = Def \frac{N^2}{n} \left(1 - \frac{n}{N}\right) P(1 - P)$$

Al despejar el tamaño muestral n de la anterior expresión, se tiene que

$$n \geq \frac{P(1 - P) Def}{\frac{ME^2}{z_{1-\alpha/2}^2} + \frac{P(1-P) Def}{N}}$$

La cual puede ser reescrita como

$$n \geq \frac{P(1 - P)}{\frac{ME^2}{Def z_{1-\alpha/2}^2} + \frac{P(1-P)}{N}}$$

Por consiguiente, se donde se evidencia que valores grandes del efecto de diseño inducirán un mayor tamaño de muestra. Claramente el incremento no es lineal, más aún, el tamaño de muestre se ve más afectado en la medida en que el $Def f$ sea más grande.

III. Escenarios de interés

En general, en encuestas de hogares se parte de un marco de muestreo de áreas que agrupa a toda la población de un país. Estas áreas están definidas como agregaciones cartográficas o UPM y contienen a su vez a los hogares en donde se encuentran las personas que son susceptibles de ser entrevistadas. Sin embargo, debido a la agrupación natural de las personas en hogares, a veces los cálculos se hacen complejos, máxime conociendo que la población de interés es un subconjunto de los habitantes de los hogares. Por otro lado, debido a que el marco de muestreo comúnmente usado por las Oficinas Nacionales de Estadística (ONE) es una lista de UPM, se hace necesario más allá de calcular el tamaño de muestra de las personas, también calcular el tamaño de muestra de UPM y hogares en la muestra. Por lo tanto, en este documento se pretende sintetizar los mecanismos de asignación de muestra en tres escenarios que son comunes en la práctica estadística del diseño de encuestas de hogares:

1. Primer escenario: asignación del tamaño de muestra en problemas de inferencia que tienen que ver con la estimación de parámetros de personas. En este escenario se presenta la metodología apropiada para calcular el tamaño de muestra de UPM, hogares y finalmente personas.
2. Segundo escenario: cuando la variable de diseño y en general, las variables más importantes de la encuestas están presentes a nivel de hogar, entonces no es necesario realizar un submuestreo de personas. Partiendo de la lógica presentada en el escenario anterior, se presenta la metodología adecuada para calcular el tamaño de muestra de UPM y de hogares.
3. Tercer escenario: un caso menos común en los países de América Latina se presenta cuando el marco de muestreo empadrona las personas dentro de las UPM y además la encuesta sólo pretende observar características asociadas a los habitantes del hogar (y por tanto no intenta observar características ni del hogar ni de la vivienda). En este caso no hay un submuestreo de hogares.

En general, al definir las expresiones de tamaño de muestra, se debe ser cuidadoso con la notación, para lo cual suponemos una población U de N elementos sobre la que se desea seleccionar una muestra s de n elementos en los cuales se quiere medir una característica de interés. En algunos casos, la población U no constituye la población de interés sino que la contiene; es decir, si se define a U_d como la población de interés, entonces $U_d \subseteq U$. En términos de notación, se tiene lo siguiente:

- N es el tamaño de la población U .
- n es el tamaño de la muestra s .
- N_I es el número de UPM en el marco de muestreo.
- n_I es el número de UPM que se selecciona en la muestra de la primera etapa s_I .
- N_{II} es el número de hogares existentes en el país.
- n_{II} es el número de hogares seleccionados en la muestra de la segunda etapa s_{II} .
- \bar{n} es el número de personas promedio que se van a seleccionar en cada UPM.
- \bar{n}_{II} es el número de hogares promedio que se van a seleccionar en cada UPM.
- ρ es el coeficiente de correlación intraclase, calculado para la variable de interés sobre las UPM.
- b es el número promedio de personas por hogar.
- r es el porcentaje de personas con la característica de interés.
- z_α es el percentil $(1 - \alpha/2)$ asociado a una distribución normal estándar y a la confianza que se requiera en la inferencia.

Para introducir las metodologías apropiadas, junto con las expresiones adecuadas, en cada escenario se definirán las cantidades de interés, se dará una breve introducción al problema y se realizarán los cálculos detenidamente con ejemplos de encuestas reales. Para mantener la uniformidad en los cálculos, todos los ejemplos suponen una población de tamaño $N = 50$ millones, con $N_{II} = 12$ millones de hogares, para el cual se desea obtener una muestra con una confianza del 90 %. En cada escenario se supone que el país está dividido en $N_I = 30$ mil UPM, conformadas por segmentos cartográficos (agregaciones de manzanas).

A. Tamaño de muestra para UPM, hogares y personas

Cuando la unidad de observación sean las personas, sin importar que la variable de interés esté a nivel de hogar, será necesario siempre basar nuestros cálculos en el tamaño de muestra de las personas. Por ejemplo, para tener una inferencia apropiada al estimar el ingreso medio per cápita, el porcentaje de personas pobres o el porcentaje de personas con una característica particular es necesario definir a la población objetivo como todas las personas que componen un hogar para posteriormente medir la variable de interés que será observada para todas ellas.

Con estos elementos es posible realizar simulaciones de algunos escenarios de muestreo, que indiquen el tamaño de muestra necesario en cada una de las etapas de la selección de la muestra. Si fuese posible sistematizar los elementos más importantes a la hora de calcular el tamaño de muestra en una encuesta de hogares, sería necesario recurrir a los siguientes pasos de manera ordenada:

- **Definir la población de interés de manera explícita.** En particular, es necesario aclarar si la unidad de análisis son las personas o los hogares. De esta forma, se debe fijar los valores para r y b . Si la unidad de análisis

son todas las personas del hogar, entonces el porcentaje de personas con la característica de interés será $r = 1$, de otra forma $r < 1$. Por otro lado, el número promedio de personas por hogar b dependerá de la región o estrato en la que se requiera el cálculo.

- **Definir el número promedio de hogares.** El número promedio de hogares que se desea encuestar en cada una de las UPM está dado por \bar{n}_{II} . Este proceso debería ser repetido de forma iterativa en los pasos subsiguientes para poder evaluar la calidad del diseño. De las varias escogencias de \bar{n}_{II} será necesario escoger solo una.
- **Calcular el número promedio de personas que serán encuestadas.** Al igual que en el paso anterior es necesario probar varios escenarios que redundarán en la escogencia de un número óptimo de personas por UPM. Los valores de \bar{n} dependen directamente del paso anterior al escoger \bar{n}_{II} . Debido a que la selección de las personas está supeditada a la selección de los hogares, entonces \bar{n} se puede descomponer manteniendo la relación con r y b , de la siguiente manera:

$$\bar{n} = \bar{n}_{II} * r * b$$

- **Calcular el efecto de diseño.** Es necesario definir (o calcular con encuestas o censos anteriores) la correlación intraclase de la variable de interés con el agrupamiento por UPM ρ . Luego de esto, se debe calcular el efecto de diseño $DEFF$ como función de ρ y de \bar{n} . Ahora, el efecto de diseño $DEFF$, definido como una función de la correlación existente entre la variable de interés y la conformación de las UPM, está dado por la siguiente expresión

$$DEFF \approx 1 + (\bar{n} - 1)\rho$$

- **Calcular el tamaño de muestra de personas.** A partir de las expresiones de tamaño de muestra para diseños de muestreo complejos, calcular el tamaño de muestra necesario para lograr una precisión adecuada en la inferencia. En primer lugar, si lo que se quiere estimar es un promedio \bar{y}_U , el tamaño de muestra necesario para alcanzar un error relativo máximo de $\delta\%$ es de

$$n \geq \frac{S_{y_U}^2 DEFF}{\frac{\delta^2 \bar{y}_U^2}{z_\alpha^2} + \frac{S_{y_U}^2 DEFF}{N}}$$

Por otro lado, si lo que se quiere estimar es una proporción P , entonces la expresión apropiada para calcular el tamaño de muestra estará dada por

$$n \geq \frac{P(1-P) DEFF}{\frac{\delta^2 P^2}{z_\alpha^2} + \frac{P(1-P) DEFF}{N}}$$

- **Calcular el tamaño de muestra de hogares.** Es necesario calcular el número total de hogares que deben ser seleccionados para lograr entrevistar a todas las personas que serán observadas en el punto anterior. El número de hogares que deben ser seleccionados estará determinado por las cantidades n , b y r , de la siguiente forma

$$n_{II} = \frac{n}{r * b}$$

- **Calcular el número de UPMS.** Los hogares y las personas se observan a partir de las UPM. En este paso final es necesario calcular el número de UPM que deben ser seleccionadas en el muestreo a partir de la relación

$$n_I = \frac{n}{\bar{n}} = \frac{n_{II}}{\bar{n}_{II}}$$

Ejemplo: proporción de personas pobres

Suponga que el parámetro de interés es el porcentaje de personas pobres (cuyo ingreso está por debajo de un umbral preestablecido) y se quiere hacer inferencia con un error relativo máximo del 5 %. Por estudios anteriores en este país, se ha estimado que la proporción de personas pobres está alrededor de $P = 4\%$. Nótese que la población objetivo está conformada por todos los habitantes del hogar puesto que $r = 100\%$. En este país se ha estimado que el tamaño promedio del hogar es de alrededor de $b = 3.5$ personas. Por último, según levantamientos anteriores, la correlación intraclase de la característica de interés con las unidades primarias de muestreo es $\rho = 0.034$.

La siguiente tabla resume los resultados del ejercicio para $\bar{n}_{II} = 10$ hogares por UPM, los cuales implican que por cada UPM se entrevistarían en promedio a \bar{n} 35 personas. Con lo anterior se obtendría un efecto de diseño $DEFF = 2.2$, para un total de personas en la muestra de $n = 55936$ que serán observados a partir de la selección de $n_{II} = 15982$ hogares en $n_I = 1598$ UPM.

Hogares promedio por UPM	Personas promedio por UPM	DEFF	Muestra de UPM	Muestra de hogares	Muestra de personas
10	35	2.2	1598	15982	55936

Por supuesto que es posible plantear otros escenarios a medida que se evalúe el efecto que conlleva el cambio del número de hogares que se seleccionan en cada UPM. Por ejemplo, el investigador podría proponer que se seleccionarán en promedio 5 hogares por UPM, lo cual cambiaría el número de UPM que serían seleccionadas en la muestra de la primera etapa, así como también el número total de personas que serían seleccionadas en todo el operativo. Debido a que el efecto de diseño es una función del número de hogares promedio a seleccionar

en las UPM, esta cifra también variará. A continuación se muestran algunos resultados que permiten establecer estos escenarios cuando se varía el tamaño de muestra promedio de hogares por UPM. La escogencia del escenario ideal se debe dar en términos de la conveniencia logística y presupuestal en el estudio.

Hogares promedio por UPM	Personas promedio por UPM	DEFF	Muestra de UPM	Muestra de hogares	Muestra de personas
5	18	1.6	2315	11575	40512
10	35	2.2	1598	15982	55936
15	52	2.8	1359	20386	71351
20	70	3.4	1239	24787	86756
25	88	3.9	1167	29186	102152
30	105	4.5	1119	33582	117538
35	122	5.1	1085	37976	132915
40	140	5.7	1059	42366	148282
45	158	6.3	1039	46754	163640

Siguiendo las recomendaciones internacionales, se desestimarían los escenarios con efectos de diseño mayores a 3.

Ejemplo: ingreso promedio por persona

Suponga que se desea estimar el ingreso promedio por hogar con un error relativo máximo del 2 %. La variable de interés (ingreso) es continua y se estima que la media oscila alrededor de $\bar{y}_U = 1180$ dólares con una varianza de $S_{yU}^2 = 1845.94^2$. En este caso, la población objetivo son todos los habitantes del hogar, por lo cual $r = 1$. La composición del hogar se calcula en $b = 3.79$ personas por hogar. Por último, según levantamientos anteriores, la correlación intraclase de la característica de interés es $\rho = 0.035$. Nótese que la correlación intraclase cambia con respecto a la característica que se desee medir.

La siguiente tabla muestra los resultados del ejercicio al seleccionar $\bar{n}_{II} = 15$ hogares por UPM, que a su vez implica que por cada UPM se encontrarían en promedio $\bar{n} = 57$ personas por UPM. Con lo anterior se obtendría un efecto de diseño $DEFF = 3$, para un total de personas en la muestra de $n = 48861$ que serán observados a partir de la selección de $n_{II} = 12892$ hogares en $n_I = 859$ UPM.

Hogares promedio por UPM	Personas promedio por UPM	DEFF	Muestra de UPM	Muestra de hogares	Muestra de personas
15	57	3	859	12892	48861

A continuación se muestran algunos resultados que permiten establecer otros escenarios de muestreo cuando se varía el tamaño de muestra promedio de hogares por UPM. Recuérdese que cualquiera de estos escenarios es válido, desde el punto de vista de la eficiencia estadística, aunque no todos serán válidos si se tienen en cuenta otros aspectos como los logísticos o presupuestales. Por ejemplo, si se escogiera el penúltimo escenario, entonces para 50 hogares por UPM, se debería encuestar en promedio a 190 personas, lo cual reduciría el número de UPM a 662, pero aumentaría el tamaño de muestra general a 33098 personas, lo cual involucraría mayores costos de contratación de encuestadores, supervisores y seguramente un operativo de campo de más días de duración.

Hogares promedio por UPM	Personas promedio por UPM	DEFF	Muestra de UPM	Muestra de hogares	Muestra de personas
5	19	1.6	1422	7108	26938
10	38	2.3	1000	10001	37902
15	57	3.0	859	12892	48861
20	76	3.6	789	15783	59816
25	95	4.3	747	18672	70766
30	114	4.9	719	21560	81711
50	190	7.6	662	33098	125443
100	379	14.2	619	61857	234439

Siguiendo las recomendaciones internacionales, se desestimarían los escenarios con efectos de diseño mayores a 3.

Ejemplo: tasa de desocupación en adultos mayores

Suponga que la incidencia de este fenómeno está alrededor de $P = 5.5\%$ en la población objetivo que son las personas económicamente activas (PEA) mayores de 60 años; en este país, se ha estimado que en promedio hay $r = 4.6\%$ de adultos mayores por hogar que pertenecen a la PEA, cuyo tamaño promedio es de alrededor de $b = 5$ personas. Además, se quiere hacer inferencia con un error relativo máximo del 15%. Por último, según levantamientos anteriores, la correlación intraclase de la característica de interés es $\rho = 0.7$.

La siguiente tabla muestra los resultados del ejercicio, que implica que seleccionar $\bar{n}_{II} = 20$ hogares por UPM implicaría un promedio de $\bar{n} = 4.6$ adultos mayores en la PEA (casos de interés) por UPM. Con lo anterior se obtendría un efecto de diseño $DEFF = 3.5$, para un total de adultos mayores en la muestra de $n = 7272$ que serán observados a partir de la selección de $n_{II} = 31617$ hogares en $n_I = 1581$ UPM.

Hogares promedio por UPM	Personas promedio por UPM	DEFF	Muestra de UPM	Muestra de hogares	Muestra de casos
20	4.6	3.5	1581	31617	7272

En este caso la muestra en los 31617 hogares induce un operativo muy grande que implicaría la observación de $31617 * 5 = 158085$ personas, de las cuales $n = 7272$, serían los casos de interés. Como se ha visto en los anteriores ejemplos, es posible plantear otros escenarios a medida que se evalúe el efecto que conlleva el cambio del número de hogares que se seleccionan en cada UPM. A continuación se muestran algunos resultados que permite establecer estos escenarios cuando se varía el tamaño de muestra promedio de hogares por UPM.

Hogares promedio por UPM	Personas promedio por UPM	DEFF	Muestra de UPM	Muestra de hogares	Muestra de casos
5	1.1	1.1	1985	9926	2283
10	2.3	1.9	1716	17157	3946
15	3.5	2.7	1626	24387	5609
20	4.6	3.5	1581	31617	7272
25	5.8	4.3	1554	38848	8935
30	6.9	5.1	1536	46074	10597
50	11.5	8.3	1500	74983	17246
100	23.0	16.4	1472	147222	33861

Siguiendo las recomendaciones internacionales, se desestimarían los escenarios con efectos de diseño mayores a 3.

B. Tamaño de muestra para UPM y hogares

En algunas ocasiones la variable de interés y la unidad de observación están a nivel de hogar. Por ejemplo, cuando todas las variables de interés se miden en la vivienda. En este caso es posible modificar el algoritmo de la sección anterior para seleccionar únicamente a los hogares en la muestra, sin necesidad de realizar un submuestreo de personas. En este caso algunas cantidades desaparecen porque no son objeto de la población de hogares, por ejemplo r y b ; algunas otras expresiones deben ser redefinidas al contexto de los hogares, como por ejemplo, el coeficiente de correlación intraclase ρ , el efecto de diseño y todas las expresiones de tamaños de muestra. En todo caso, la adaptación del algoritmo se describe a continuación.

- **Definir el número promedio de hogares.** El número promedio de hogares que se desea encuestar en cada una de las UPM está dado por

\bar{n}_{II} . Esta cifra sigue siendo el insumo más importante del algoritmo y se propone crear escenarios de muestreo a partir de su modificación y evaluación del tamaño de muestra final.

- **Calcular el efecto de diseño.** Es necesario definir (o calcular con encuestas o censos anteriores) la correlación intraclase ρ_{II} de la variable de interés *a nivel del hogar* con el agrupamiento por UPM definido por la división cartográfica del último censo. Además de lo anterior, el efecto de diseño $DEFF$ será función del tamaño de muestra promedio de hogares por UPM \bar{n}_{II} , como se muestra a continuación:

$$DEFF \approx 1 + (\bar{n}_{II} - 1)\rho_{II}$$

- **Tamaño de muestra de hogares.** Partiendo de las expresiones de tamaño de muestra generales para muestreos complejos y teniendo en cuenta que la población de interés son los hogares y que la variable de interés y_{II} está a nivel de hogar, entonces el tamaño de muestra necesario para alcanzar un error relativo máximo de $\delta\%$ es de

$$n_{II} \geq \frac{S_{y_{II}}^2 DEFF}{\frac{\delta^2 \bar{y}_{II}^2}{z_\alpha^2} + \frac{S_{y_{II}}^2 DEFF}{N_{II}}}$$

La expresión apropiada para calcular el tamaño de muestra para una proporción estará dada por

$$n_{II} \geq \frac{P_{II} (1 - P_{II}) DEFF}{\frac{\delta^2 P_{II}^2}{z_\alpha^2} + \frac{P_{II} (1 - P_{II}) DEFF}{N_{II}}}$$

- **Cálculo del número de UPMs.** Los hogares se observan a partir de las UPM. En este paso final es necesario calcular el número de UPM que deben ser seleccionadas en el muestreo a partir de la relación

$$n_I = \frac{n_{II}}{\bar{n}_{II}}$$

B.1. Ejemplo: gasto promedio del hogar

Suponga que se desea estimar el promedio de gasto en dólares en los hogares del país con un error relativo máximo admisible del 3.5 %. La variable de interés (gasto) es continua y se estima que la media oscila alrededor de $\bar{y}_U = 1407$ dólares con una varianza de $S_{y_U}^2 = 2228^2$. En este ejemplo se supone que el país está dividido en $N_I = 10$ mil UPM y la correlación intraclase de la característica de interés, medida a nivel del hogar, con las UPM es de $\rho_{II} = 0.173$.

La siguiente tabla muestra los resultados del ejercicio para $\bar{n}_{II} = 12$ hogares por UPM, que serán observados a partir de la selección de $n_I = 1338$ UPM y $n_I = 16056$ hogares que inducen un efecto de diseño $DEFF = 2.9$.

Hogares promedio por UPM	DEFF	Muestra de UPM	Muestra de hogares
12	2.9	1338	16056

A continuación se muestran algunos resultados que permiten establecer otros escenarios de muestreo al variar el tamaño de muestra promedio de hogares por UPM. Nótese que, por ejemplo, en el caso de seleccionar 20 hogares por UPM, se debería seleccionar una muestra de 23695 hogares en tan solo 1185 UPM. Por otro lado, si sólo se seleccionaran 2 hogares por UPM, se tendrían que visitar 3246 UPM en todo el país, aunque el número de encuestas totales descendería a 6493.

Para este tipo de operativos, en donde los cuestionarios de gasto de los hogares están acompañados de un operativo exhaustivo que le permite al investigador conocer los hábitos de consumo del hogar de forma desagregada, y en donde se visita el hogar durante un periodo de tiempo determinado, tal vez sea más conveniente estudiar la viabilidad de seleccionar más hogares por UPM y menos UPM para que el operativo de campo no exija la contratación de demasiado personal en campo. Al estar agrupados en menos UPM, se podría definir un mejor levantamiento de la información con un equipo mediano de personas; de lo contrario, se debería contratar bastante más personal que cubra las UPM dispersas a lo largo del país.

Hogares promedio por UPM	DEFF	Muestra de UPM	Muestra de hogares
2	1.2	3246	6493
4	1.5	2102	8407
6	1.9	1720	10320
8	2.2	1529	12233
10	2.6	1414	14145
12	2.9	1338	16056
14	3.2	1283	17967
16	3.6	1242	19877
18	3.9	1210	21787
20	4.3	1185	23695

Siguiendo las recomendaciones internacionales, se desestimarían los escenarios con efectos de diseño mayores a 3.

B.2. Ejemplo: proporción de hogares sin agua potable

Suponga que se desea obtener una muestra con un error relativo máximo admisible del 10 % sobre la variable de interés (necesidades básicas insatisfechas en agua) y el parámetro de interés es el porcentaje de hogares con esta carencia. En este país, se estima que la proporción de hogares con esta condición asciende a $P = 7.5\%$.

En este ejemplo se supone que la correlación intraclase de la característica de interés con las UPM es de $\rho_{II} = 0.045$.

La siguiente tabla muestra los resultados del ejercicio para $\bar{n}_{II} = 10$ hogares por UPM, que serán observados a partir de la selección de $n_I = 436$ UPM y $n_{II} = 4357$ hogares que inducen un efecto de diseño $DEFF = 1.3$.

Hogares promedio por UPM	DEFF	Muestra de UPM	Muestra de hogares
10	1.3	436	4357

A continuación se muestran algunos resultados que permiten establecer otros escenarios de muestreo al variar el tamaño de muestra promedio de hogares por UPM. Observe que el efecto de diseño DEFF es directamente proporcional al número de hogares entrevistados por UPM y al tamaño de muestra de hogares final; de la misma manera, es inversamente proporcional al número de UPM.

Hogares promedio por UPM	DEFF	Muestra de UPM	Muestra de hogares
5	1.1	758	3790
10	1.3	436	4357
15	1.5	328	4924
20	1.6	274	5490
25	1.8	242	6057
30	2.0	221	6624
35	2.2	205	7190
40	2.3	194	7757
45	2.5	185	8323

Si siguiendo las recomendaciones internacionales, se desestimarían los escenarios con efectos de diseño mayores a 3.

C. Tamaño de muestra para UPM y personas

En algunos casos en donde la variable de interés esté a nivel de persona y el cuestionario de la encuesta no induzca preguntas acerca del hogar, y además exista un inventario detallado de las personas que residen en cada UPM, es posible evadir la selección de los hogares e ir directamente a la selección de personas. En este caso, la lógica del cálculo del tamaño de muestra se mantiene modificando en cierta manera el algoritmo de las secciones anteriores, tal como se ilustra a continuación.

- **Definir la población de interés de manera explícita.** En este caso solo se mantiene la expresión correspondiente a r que denota el porcentaje de personas con la característica de interés en la población.

- **Definir el número promedio de personas.** El número promedio de personas que se desea encuestar en cada una de las UPM está dado por \bar{n} . Al igual que en las secciones anteriores, se recomienda hacer una evaluación sobre esta cantidad para determinar posibles escenarios de muestreo. Nótese que, debido al efecto de r , la siguiente relación se mantiene

$$\bar{n}^e = \bar{n} * r$$

En donde \bar{n}^e denota el número promedio de encuestas realizadas en cada UPMS sobre la población de interés.

- **Calcular el efecto de diseño.** Es necesario definir el efecto de diseño $DEFF$ como una función de la correlación existente entre la variable de interés y la conformación de las UPM ρ^e , está dado por la siguiente expresión

$$DEFF^e \approx 1 + (\bar{n}^e - 1)\rho^e$$

- **Tamaño de muestra de personas.** A partir de las expresiones de tamaño de muestra para muestreos complejos, calcular el tamaño de muestra necesario para lograr una precisión adecuada en la inferencia. En primer lugar, el tamaño de muestra necesario para alcanzar un error relativo máximo de $\delta\%$ es de

$$n^e \geq \frac{S_{yU}^2 DEFF^e}{\frac{\delta^2 \bar{y}_U^2}{z_\alpha^2} + \frac{S_{yU}^2 DEFF^e}{N}}$$

Si lo que se quiere estimar es una proporción P , entonces la expresión apropiada para calcular el tamaño de muestra estará dada por

$$n^e \geq \frac{P(1-P) DEFF^e}{\frac{\delta^2 P^2}{z_\alpha^2} + \frac{P(1-P) DEFF^e}{N}}$$

- **Tamaño de muestra final.** Es necesario calcular el número total de personas que deben ser seleccionados para lograr observar a quienes hacen parte de la población objetivo. Esta cantidad está dada por la siguiente expresión.

$$n = n^e / r$$

- **Cálculo del número de UPMs.** Finalmente, las personas se observan a partir de las UPM. En este paso final es necesario calcular el número de UPM que deben ser seleccionadas en el muestreo a partir de la relación.

$$n_I = \frac{n}{\bar{n}} = \frac{n^e}{\bar{n}^e}$$

C.1. Ejemplo: ingreso promedio en personas empleadas

Suponga que se desea estimar el ingreso promedio en las personas empleadas con un error relativo máximo admisible del 2 %. La variable de interés (ingreso) es continua y se estima que la media oscila alrededor de $\bar{y}_U = 1458$ dólares con una varianza de $S_{y_U}^2 = 2191^2$. Nótese que la población objetivo son todas las personas empleadas, cuya proporción se estima en $r = 46$ %. La correlación intraclase de la característica de interés es $\rho = 0.038$.

La siguiente tabla muestra los resultados del ejercicio al seleccionar $\bar{n}_{II} = 50$ personas por UPM, que a su vez implica que por cada UPM se encontrarían en promedio \bar{n} 23 personas ocupadas por UPM. Con lo anterior se obtendría un efecto de diseño $DEFF = 1.8$, para un total de personas en la muestra de $n = 60933$ de las cuales habrían $n_e = 28029$ ocupados repartidos en $n_I = 1219$ UPM.

Personas promedio por UPM	Casos promedio por UPM	DEFF	Muestra de UPM	Muestra de Casos	Muestra de personas
50	23	1.8	1219	28029	60933

A continuación se muestran algunos resultados que permiten establecer otros escenarios de muestreo cuando se varía el tamaño de muestra promedio de hogares por UPM.

Personas promedio por UPM	Casos promedio por UPM	DEFF	Muestra de UPM	Muestra de Casos	Muestra de personas
25	12	1.4	1857	21360	46435
50	23	1.8	1219	28029	60933
75	34	2.3	1006	34695	75424
100	46	2.7	899	41360	89913
125	58	3.1	835	48023	104398

Siguiendo las recomendaciones internacionales, se desestimarían los escenarios con efectos de diseño mayores a 3.

C.2. Ejemplo: proporción de analfabetas pobres

Suponga que se quiere estimar la proporción de incidencia de la pobreza sobre la población analfabeta con un error relativo máximo admisible del 15 %. Se ha estimado que alrededor del $r = 14$ % de las personas del país no saben leer ni escribir. Por otro lado, tal como se vio en un ejemplo anterior, el fenómeno de la pobreza está estimado en $P = 4$ %. y la correlación intraclase de la característica de interés es $\rho^e = 0.045$.

La siguiente tabla muestra los resultados del ejercicio al seleccionar $\bar{n}_{II} = 100$ personas por UPM, que a su vez implica que por cada UPM se encontrarían en promedio \bar{n} 14 personas que no saben leer ni escribir por UPM. Con lo anterior se obtendría un efecto de diseño $DEFF = 1.6$, para un total de personas en la muestra de $n = 32671$ de las cuales habrían $n_e = 4574$ ocupados repartidos en $n_I = 327$ UPM.

Personas promedio por UPM	Casos promedio por UPM	DEFF	Muestra de UPM	Muestra de Casos	Muestra de personas
100	14	1.6	327	4574	32671

Es posible plantear otros escenarios a medida que se evalúe el efecto que conlleva el cambio del número de hogares que se seleccionan en cada UPM. A continuación se muestran algunos resultados que permite establecer estos escenarios cuando se varía el tamaño de muestra promedio de hogares por UPM.

Personas promedio por UPM	Casos promedio por UPM	DEFF	Muestra de UPM	Muestra de Casos	Muestra de personas
25	3.5	1.1	917	3211	22936
50	7.0	1.3	524	3665	26179
75	10.5	1.4	392	4120	29429
100	14.0	1.6	327	4574	32671
125	17.5	1.7	287	5029	35921

Siguiendo las recomendaciones internacionales, se desestimarían los escenarios con efectos de diseño mayores a 3.

IV. Otros escenarios de interés

En las encuestas de hogares también surgen escenarios particulares que llevan a sugerir distintos caminos para la adopción de un determinado tamaño de muestra. En esta sección analizaremos los casos en los que se quieren realizar diferencias de proporciones, diferencias en diferencias y pruebas de hipótesis.

A. Tamaño de muestra para la estimación de la diferencia de proporciones

Suponga una población U , que se encuentra particionada en dos subpoblaciones U_1 de tamaño N_1 y U_2 , de tamaño N_2 . El interés del investigador está en conocer la diferencia de algunas proporciones entre estos grupos. Por ejemplo, suponga

que se quiere conocer la diferencia entre las proporciones de niños desnutridos por sexo. Se espera que la proporción de niños desnutridos no supere la proporción de niñas desnutridas en el grupo control. Por lo tanto, el parámetro de interés se escribe como:

$$\theta = P_1 - P_2 = \frac{N_{d1}}{N_1} - \frac{N_{d2}}{N_2} \quad (7.9)$$

En donde $N_{di} = \sum_{k \in U_i} Z_{dik}$, para $i = 1, 2$. Ahora, Z_{dik} es una característica dicotómica que indica si el individuo k -ésimo de la subpoblación U_i está en estado de desnutrición. Por supuesto, bajo muestreo aleatorio simple, un estimador insesgado para θ es

$$\hat{\theta} = \hat{P}_1 - \hat{P}_2 = \frac{\hat{N}_{d1}}{N_1} - \frac{\hat{N}_{d2}}{N_2} \quad (7.10)$$

En donde, $\hat{N}_{di} = \frac{N_i}{n_i} \sum_{k \in S_i} Z_{dik}$, para $i = 1, 2$. La varianza del anterior estimador es:

$$Var(\hat{P}_1 - \hat{P}_2) = Var(\hat{P}_1) + Var(\hat{P}_2) - 2Cov(\hat{P}_1, \hat{P}_2)$$

Por otro lado, siendo T_1 y T_2 , el porcentaje de traslape de las subpoblaciones y la $R_{1,2}$ la correlación de Pearson entre los datos observados de ambas subpoblaciones, la covarianza entre este par de estimadores está determinada por la siguiente relación (Kish, 2004):

$$Cov(\hat{\theta}_1, \hat{\theta}_2) = \sqrt{Var(\hat{\theta}_1)} \sqrt{Var(\hat{\theta}_2)} \sqrt{T_1} \sqrt{T_2} R_{1,2}$$

Ahora, para encontrar el tamaño de muestra óptimo, es útil realizar los siguientes supuestos:

1. Asumir que las subpoblaciones son grandes y por ende $N_1 = N_2 = N$.
2. Por lo anterior, asumir que los tamaños de muestra pueden ser iguales, tales que $n_1 = n_2 = n$.

Nótese a su vez que, si el levantamiento de las observaciones no puede ser realizado utilizando muestreo aleatorio simple, sino que por el contrario, la muestra aleatoria fue seleccionada mediante un diseño de muestreo complejo con un efecto de diseño¹ (*DEFF*) no ignorable y mayor a uno, entonces la varianza tomaría la siguiente forma

$$Var(\hat{P}_1 - \hat{P}_2) = \frac{DEFF}{n} \left(1 - \frac{n}{N}\right) (P_1 Q_1 + P_2 Q_2) * \sqrt{T_1} \sqrt{T_2} R_{1,2} \quad (7.11)$$

¹Recuerde que si el muestreo es aleatorio simple, el efecto de diseño es $DEFF = 1$.

De esta manera, un intervalo de confianza del 95 % para la diferencia de proporciones está dado por

$$IC(95\%)_{P_1-P_2} = (\hat{P}_1 - \hat{P}_2) \pm Z_{1-\alpha/2} \sqrt{\frac{DEFF}{n} \left(1 - \frac{n}{N}\right) (P_1 Q_1 + P_2 Q_2) * \sqrt{T_1} \sqrt{T_2} R_{1,2}} \quad (7.12)$$

Lo anterior quiere decir que el margen de error, e , de la encuesta debe ser tal que:

$$e < Z_{1-\alpha/2} \sqrt{\frac{DEFF}{n} \left(1 - \frac{n}{N}\right) (P_1 Q_1 + P_2 Q_2) * \sqrt{T_1} \sqrt{T_2} R_{1,2}} \quad (7.13)$$

Por lo tanto, despejando n , se tiene que la muestra en cada subgrupo debe mayor que:

$$n > \frac{DEFF(P_1 Q_1 + P_2 Q_2) * \sqrt{T_1} \sqrt{T_2} R_{1,2}}{\frac{e^2}{Z_{1-\alpha/2}^2} + \frac{DEFF(P_1 Q_1 + P_2 Q_2) * \sqrt{T_1} \sqrt{T_2} R_{1,2}}{N}} \quad (7.14)$$

Para el levantamiento de una línea de base, que quiera estimar una diferencia de proporciones $P_1 - P_2$ (donde $Q_1 = 1 - P_1$ y $Q_2 = 1 - P_2$), entonces el tamaño de muestra mínimo² necesario para lograr una estimación confiable de esta diferencia, con menos de $\varepsilon\%$ de error, es:

$$n \geq \frac{(P_1 Q_1 + P_2 Q_2) DEFF * \sqrt{T_1} \sqrt{T_2} R_{1,2}}{\frac{\varepsilon^2}{z_\alpha^2} + \frac{(P_1 Q_1 + P_2 Q_2) DEFF * \sqrt{T_1} \sqrt{T_2} R_{1,2}}{N}} \quad (7.15)$$

Covarianza en comparaciones mensuales

Suponga que se quiere comparar la tasa de desempleo nacional entre dos meses consecutivos. En este escenario, asumiendo que existe independencia en el muestreo de los dos meses consecutivos, el porcentaje de traslape de muestra entre los dos meses (que por diseño es nulo) es igual a cero. Por lo tanto, $T_1 = T_2 = 0$. Luego, el término de la covarianza se anula. En resumen, la varianza del estimador en este caso sería igual a:

$$Var(\hat{P}_1 - \hat{P}_2) = Var(\hat{P}_1) + Var(\hat{P}_2)$$

²Note que el tamaño de muestra de toda la encuesta es $2n$, puesto que se debe seleccionar n elementos en cada subgrupo.

Covarianza en comparaciones trimestrales o anuales

Bajo un esquema rotativo 2(2)2, suponga que se quiere comparar la tasa de desempleo nacional entre trimestres consecutivos o entre el mismo mes de dos años consecutivos. En este escenario no existe independencia en el muestreo de los dos trimestres consecutivos puesto que la estructura del panel garantiza un traslape del 50 %. En este caso $T_1 = T_2 \approx 0.5$.

Por otro lado, existe una correlación natural entre las viviendas comunes en el panel que se midieron en los periodos de interés, por lo tanto $R_{1,2} \neq 0$. Note que esta correlación se calcula sobre los individuos comunes en el panel y sobre la variable dicotómica que induce la tasa de desempleo (perteneciente a la población económicamente activa). En resumen, el término de covarianza en este caso sería igual a:

$$Cov(\hat{P}_1, \hat{P}_2) = \frac{1}{2} \sqrt{Var(\hat{P}_1)} \sqrt{Var(\hat{P}_2)} R_{1,2}$$

Covarianza en comparaciones de un mismo mes

Suponga que se quiere comparar la tasa de desempleo entre hombres y mujeres en un mismo mes. En este escenario no existe independencia en el muestreo de hombres y mujeres puesto que estos grupos no son estratos de muestreo. En este caso T_1 es la proporción de hombres en la muestra y T_2 es la proporción de mujeres en la muestra. Nótese que $P_1 \neq P_2$.

Por otro lado, existe una correlación natural entre las UPMs que fueron seleccionadas y que contienen tanto a hombres como a mujeres, por lo tanto $R_{12} \neq 0$. Note que esta correlación se calcula sobre todos los individuos de la muestra pertenecientes a la fuerza de trabajo y sobre la variable dicotómica que induce la tasa de desempleo. En resumen, el término de covarianza en este caso sería igual a:

$$Cov(\hat{P}_1, \hat{P}_2) = \sqrt{Var(\hat{P}_1)} \sqrt{Var(\hat{P}_2)} \sqrt{T_1} \sqrt{T_2} R_{1,2}$$

Covarianza en comparaciones de un mismo mes

Suponga que se quiere comparar la tasa de desempleo entre dos ciudades del mismo país en un mismo mes. En este escenario existe independencia en el muestreo de las dos ciudades porque la selección es independiente en cada ciudad. Esta independencia se tiene por definición del diseño de muestreo puesto que ambas ciudades son estratos de muestreo. En este caso T_1 es la proporción de personas de la primera ciudad en la muestra y T_2 es la proporción de personas de la segunda ciudad en la muestra. Además, tampoco existe una correlación entre las UPMs que fueron seleccionadas entre estas ciudades porque la selección fue independiente, por lo tanto $R_{12} = 0$. En resumen, el término de covarianza es nulo y por ende la varianza del estimador sería igual a:

$$Var(\hat{d}) = Var(\hat{P}_1) + Var(\hat{P}_2)$$

B. Tamaño de muestra para la estimación del impacto en dos mediciones longitudinales

Para las encuestas que planean un seguimiento panel o de panel rotativo, es posible contemplar escenarios en los que se quiera estimar el efecto de una intervención, definido como la diferencia en diferencias de las proporciones de interés. De esta forma, el efecto se define como:

$$Efecto = (P_{1,1} - P_{2,1}) - (P_{1,2} - P_{2,2}) \quad (7.16)$$

En donde $P_{i,j}$ ($i, j = 1, 2$) corresponden a las proporciones del grupo i en la oleada j . Entonces el tamaño de muestra mínimo³ necesario para lograr una estimación confiable de esta diferencia, con menos de ε % de error, es:

$$n \geq \frac{\varepsilon^2}{z_\alpha^2} + \frac{(P_{1,SO}Q_{1,SO} + P_{1,LB}Q_{1,LB} + P_{2,SO}Q_{2,SO} + P_{2,LB}Q_{2,LB})(1 - TR)DEFF}{N} \quad (7.17)$$

En donde T corresponde a la tasa de traslape ($T = 1$ corresponde a un panel completo, $T = 0.5$ a un semi-panel con traslape del 50 % y el caso extremo $T = 0$ a una encuesta en donde no hay traslape) y $R_{1,2}$ se define como la correlación entre las dos oleadas ($R = 0$ implica que no hay correlación entre los dos momentos, $R = -1$ implica una máxima correlación negativa entre los dos momentos y $R = 1$ implica una correlación positiva máxima entre los dos momentos).

Por ejemplo, en una encuesta de fuerza laboral intermediada por alguna intervención gubernamental, puede ser de interés la evaluación del efecto de esa política de asistencia laboral entre hombres y mujeres en dos periodos de tiempo.

C. Tamaño de muestra para el contraste de hipótesis en la diferencia de proporciones

Suponga que el investigador desea realizar el contraste de una hipótesis de interés. En particular, suponga que hay dos grupos de interés en la población finita y que la hipótesis está inducida por la diferencia de las proporciones en las dos poblaciones. El investigador considera que la diferencia es significativa para el fenómeno en cuestión si es mayor que un valor D definido de antemano y conocido como el *tamaño del efecto* que el investigador desea detectar.

³Note que el tamaño de muestra de toda la encuesta es $4n$, en las dos oleadas, puesto que se debe seleccionar n elementos en cada grupo.

Nótese que la significación estadística, inducida por un valor-p, no siempre tiene la misma connotación de significación científica o económica, que puede presentarse en fenómenos raros, para los cuales no necesariamente se gozaría de significación estadística. Por lo tanto el sistema de hipótesis que se quiere contrastar es el siguiente:

$$H_o : P_1 - P_2 = 0 \quad vs. \quad H_a : P_1 - P_2 = D > 0$$

Nótese que, acudiendo a la distribución normal de los estimadores de las proporciones, y suponiendo independencia en el muestreo de los subgrupos, la regla de decisión en este caso induce el rechazo de la hipótesis nula cuando

$$\frac{\hat{P}_1 - \hat{P}_2}{\sqrt{Var(\hat{P}_1 - \hat{P}_2)}} > Z_{1-\alpha}$$

Si las características del estudio implican que el diseño de muestreo es complejo con un $DEFF > 1$, entonces esta regla de decisión rechaza la hipótesis nula si

$$\frac{\hat{P}_1 - \hat{P}_2}{\sqrt{\frac{DEFF}{n} \left(1 - \frac{n}{N}\right) (P_1 Q_1 + P_2 Q_2)}} > Z_{1-\alpha}$$

En este caso, es necesario controlar la probabilidad de cometer el error tipo 2 (aceptar una hipótesis nula, dado que ésta es falsa). A esta probabilidad se le conoce como *potencia} y, suponiendo que nuestro interés está en $P_1 - P_2 = D$, está dada por

$$\begin{aligned} \beta &\leq Pr \left(\frac{\hat{P}_1 - \hat{P}_2}{\sqrt{\frac{DEFF}{n} \left(1 - \frac{n}{N}\right) (P_1 Q_1 + P_2 Q_2)}} > Z_{1-\alpha} \mid P_1 - P_2 = D \right) \\ &= Pr \left(\frac{(\hat{P}_1 - \hat{P}_2) - D}{\sqrt{\frac{DEFF}{n} \left(1 - \frac{n}{N}\right) (P_1 Q_1 + P_2 Q_2)}} > Z_{1-\alpha} - \frac{D}{\sqrt{\frac{DEFF}{n} \left(1 - \frac{n}{N}\right) (P_1 Q_1 + P_2 Q_2)}} \right) \\ &= 1 - \Phi \left(Z_{1-\alpha} - \frac{D}{\sqrt{\frac{DEFF}{n} \left(1 - \frac{n}{N}\right) (P_1 Q_1 + P_2 Q_2)}} \right) \end{aligned}$$

Por lo anterior, se tiene que

$$1 - \beta \geq \Phi \left(Z_{1-\alpha} - \frac{D}{\sqrt{\frac{DEFF}{n} \left(1 - \frac{n}{N}\right) (P_1 Q_1 + P_2 Q_2)}} \right)$$

Entonces,

$$Z_{1-\beta} \leq Z_{1-\alpha} - \frac{D}{\sqrt{\frac{DEFF}{n} \left(1 - \frac{n}{N}\right) (P_1 Q_1 + P_2 Q_2)}}$$

En consecuencia, al despejar n , se tiene que la muestra en cada subgrupo debe mayor que:

$$n \geq \frac{DEFF(P_1 Q_1 + P_2 Q_2)}{\frac{D^2}{(Z_{1-\alpha} + Z_\beta)^2} + \frac{DEFF(P_1 Q_1 + P_2 Q_2)}{N}} \quad (7.18)$$

V. Algunas consideraciones adicionales

Cuando la encuesta se ha planeado para que tenga representatividad para algún conjunto de estratos, es necesario replicar estas mismas expresiones en cada uno de los subgrupos de interés. Por otro lado, las anteriores aproximaciones al cálculo de tamaño de muestra son insuficientes ante la realidad de la ausencia de respuesta y las desactualizaciones de los marcos de muestreo de UPM.

A. Ajustes de subcobertura

Debido a las características propias de las encuestas de hogares, siempre se presentará un fenómeno que puede ser descrito como una realidad: *existirá ausencia de respuesta en las encuestas de hogares*. En estos términos, los institutos nacionales de estadística deben tomar medidas preventivas al momento de adjudicar los tamaños de muestra en cada estrato, puesto que contar con un tamaño efectivo de muestra mucho menor al planeado inicialmente puede conllevar problemas de sesgo y de precisión en las estimaciones de las cifras nacionales o regionales, con las cuales se aborda la política económica y de desarrollo de los países de la región.

En encuestas de hogares cuyo diseño es longitudinal, no solamente se debe abordar el problema de la ausencia de respuesta al momento de la aplicación de la encuesta, sino que debe ser visto de manera integral y más general debido a que un hogar que pertenezca a un panel puede decidir no participar más después de un par de visitas. Es así como la atrición se convierte en un problema que enmarca la ausencia de respuesta como un fenómeno al cual se debe prestar atención para evitar problemas de sesgo y baja confiabilidad.

Kalton (2009) advierte que el diseño de la encuesta debe tener en cuenta el ajuste de submuestras; por ejemplo, para estimar el cambio de la condición de pobreza o indigencia en los hogares es necesario realizar un ajuste al tamaño de muestra inicial para que al final de la aplicación de la encuesta el tamaño de muestra efectivo cumpla con los requerimientos de precisión de la inferencia estadística. Los INE pueden estimar, con base en su vasta experiencia en la realización de

encuestas, la probabilidad de que una persona (o jefe de hogar) responda al instrumento. Si esta probabilidad es denotada como $\phi = Pr(k \in s_r)$, en donde s_r denota el subconjunto de respondientes efectivos, entonces los tamaños de muestra de individuos y hogares serán ajustados al dividirlos por ϕ . De esta forma, si esta probabilidad fue estimada en $\phi = 0.8$, entonces todos los tamaños de muestra calculados en los pasos anteriores deberán ser ajustados como

$$n_{final} = \frac{n_{inicial}}{0.8}$$

Por último, si la información auxiliar lo permite, este ajuste debería realizarse de manera diferenciada en cada uno de los estratos. Por ejemplo, si se conoce que este fenómeno de ausencia de respuesta tiene una mayor incidencia en lo rural que en lo urbano, entonces este ajuste debería tenerse en cuenta de forma diferenciada.

B. Sustituciones y reemplazos

Una práctica común en los operativos de campo de las encuestas de hogares en Latinoamérica es sustituir las UPM y viviendas para las cuales no se ha obtenido respuesta. Por ejemplo, se consideraría el reemplazo de las UPM cuando no se puede acceder al sitio geográfico por diferentes razones, como por ejemplo problemas de orden público o seguridad, algún cambio importante en la infraestructura de la zona, o porque no se tiene el consentimiento informado de las autoridades de la comunidad. En este caso, si no se puede acceder a la UPM, no se puede tampoco acceder a ninguno de los hogares que la integran. Los esquemas de sustituciones y reemplazos en las encuestas de hogares utiliza, por lo general, la metodología de *estratificación implícita* que permite seleccionar de manera automática a los reemplazos adecuados de acuerdo a la conformación de subgrupos poblacionales similares.

La estratificación implícita es usada cuando la encuesta está enfocada en un tema particular y, para su ejecución exitosa, requiere el uso del muestreo sistemático con probabilidades desiguales en la selección de las UPM, es decir en la definición del diseño de muestreo de la primera etapa. Según UN (2008, pág. 46), en la mayoría de países la secuencia podría empezar con el estrato urbano, desagregado por departamento, a su vez desagregado por municipio; el estrato rural, de forma similar, es desagregado por departamento, a su vez desagregado por comuna o vereda. Observe que la selección sistemática de UPM está condicionada a la medida de tamaño utilizada en la primera etapa, es decir el número de viviendas que la componen. De esta forma, la estratificación implícita consiste en que, para cada estrato explícito (urbano, rural, regiones, etc.) se crea una lista ordenada de UPM. Esta lista estará ordenada por los estratos implícitos definidos en la planeación de la encuesta (departamento, municipio) y dentro de cada subgrupo se ordenan las UPM en orden descendente (o ascendente). De esta forma, esta metodología constituye un método objetivo de selección de reemplazos, puesto que si no se puede acceder a la UPM seleccionada originalmente, su reemplazo será

la inmediatamente anterior (o posterior) en la lista estratificada implícitamente. Este procedimiento seleccionará como reemplazo a la UPM ubicada en el mismo municipio, dentro del mismo departamento, en la misma zona y con un número similar de viviendas, respetando el principio de representatividad. De otra forma, si no se considera un procedimiento similar a la estratificación implícita, los reemplazos de las UPM podrían ser seleccionados aleatoriamente en otro departamento y con un número de viviendas mucho más grande o mucho más pequeño, añadiendo sesgo a la selección inicial.

Aunque la estratificación implícita permite acotar el sesgo generado por la ausencia de respuesta de las UPM, Vehovar (1999, págs. 348 - 349) advierte que se debe tener precaución en cuanto a los usos de esta práctica puesto que también puede conllevar sesgos importantes en las estimaciones de interés. Lo anterior se desprende del hecho de que los individuos ubicados en zonas donde sí es posible acceder diferirán significativamente de aquellos individuos ubicados en las zonas de difícil acceso; es evidente que se trata de dos realidades diferentes. Por esta razón es útil que, después de haber valorado los posibles sesgos, si se ha tomado la determinación de realizar las sustituciones sobre las UPM de difícil acceso, se realice un seguimiento exhaustivo en cada levantamiento que permita clasificar el esquema de recolección de información primaria y se valore su impacto en la precisión de los estimadores resultantes.

Referencias

Bibliografía

- Baillargeon, S. and Rivest, L.-P. (2011). The construction of stratified designs in r with the package stratification. *Survey Methodology*, 37(1):53–65.
- Ballin, M. and Barcaroli, G. (2013). Joint determination of optimal stratification and sample allocation using genetic algorithm. *Survey Methodology*, 39(2):369–393.
- Barcaroli, G. (2014). Samplingstrata: An r package for the optimization of stratified sampling. *Journal of Statistical Software*, 61(1):1–24.
- Biemer, P. P. and Lyberg, L. E. (2003). *Introduction to survey quality*. Wiley series in survey methodology. Wiley-Interscience.
- CEPAL (2018). *Medición de la pobreza por ingresos - Actualización metodológica y resultados*. Metodologías de la CEPAL.
- Clark, R. G. and Steel, D. G. (2007). Sampling within households in household surveys. *Journal of the Royal Statistical Society: Series A (Statistics in Society)*, 170(1):63–82.
- Cochran, W. G. (1977). *Sampling Techniques*. Wiley, third edition edition.
- Dalenius, T. and Hodges, J. L. (1959). Minimum variance stratification. *Journal of the American Statistical Association*, 54(285):15.
- Duncan, G. J. and Kalton, G. (1987). Issues of design and analysis of surveys across time. *International Statistical Review / Revue Internationale de Statistique*, 55(1):97.
- Foster, J., Greer, J., and Thorbecke, E. (1984). A class of decomposable poverty measures. *Econometrica*, 52(3):761–766.
- Gambino, J. G. (2009). Design effect caveats. *The American Statistician*, 63(2):141–146.
- Gambino, J. G. and Silva, P. d. N. (2009). *Chapter 16 - Sampling and Estimation in Household Surveys*, volume 29 of *Handbook of Statistics*, page 407–439. Elsevier.

- Groves, R., Fowler, F., Couper, M., Lepkowski, J., Singer, E., and Tourangeau, R. (2009). *Survey Methodology*. John Wiley and Sons.
- Gunning, P. and Horgan, J. M. (2004). A new algorithm for the construction of stratum boundaries in skewed populations. *Survey Methodology*, 30(2):159–166.
- Gutiérrez, A., Zhang, H., and Montaña, C. (2016). Calculo del tamaño de muestra para la estimación de una varianza en poblaciones finitas con funciones en r. *Comunicaciones en Estadística*, 9(1):109.
- Gutiérrez, H. A. (2016). *Estrategias de muestreo: diseño de encuestas y estimación de parámetros*. Ediciones de la U, segunda edición edition. Google-Books-ID: UIVmE5pkRwIC.
- Hansen, M. H., Hurwitz, W. N., and Madow, W. G. (1953). *Sample survey methods and theory*, volume 1. Wiley New York.
- INEGI (2012). Metodología de la construcción del marco maestro de muestreo 2012 y del diseño de la muestra maestra 2012.
- Jarque, C. M. (1981). A solution to the problem of optimum stratification in multivariate sampling. *Journal of the Royal Statistical Society. Series C (Applied Statistics)*, 30(2):163–169.
- Kalton, G. (2009). Some issues in the design and analysis of longitudinal surveys.
- Kalton, G. and Citro, C. F. (1993). Panel surveys: adding the fourth dimension. *Survey Methodology*, 19(2):205–215.
- Kish, L. (1965). *Survey Sampling*. John Wiley and Sons.
- Kish, L. (2004). *Statistical Design for Research*. Wiley classic library edition. Wiley.
- Kozak, M. (2004). Optimal stratification using random search method in agricultural surveys. *Statistic in Transition*, 6(5):797–806.
- Lavallée, P. and Hidiroglou, M. A. (1988). On the stratification of skewed populations. *Survey Methodology*, 14(1):33–43.
- Lumley, T. (2010). *Complex surveys: a guide to analysis using R*. Wiley series in survey methodology. Wiley.
- Macqueen, J. (1967). Some methods for classification and analysis of multivariate observations. In *Proceedings of the Fifth Berkeley Symposium on Mathematical Statistics and Probability*, page 281–297. University of California Press.
- McLaren, C. and Steel, D. G. (2001). Rotation patterns and trend estimation for repeated surveys using rotation group estimates. *Statistica Neerlandica*, 55(2):221–238.
- OIT (1982). Resolución sobre estadísticas de la población económicamente activa, del empleo, del desempleo y del subempleo.

- OIT (2013). Estadísticas del trabajo, el empleo y la subutilización de la fuerza de trabajo.
- ONU (2011). *Canberra Group Handbook on Household Income Statistics*. United Nations Economic Commission for Europe, second edition edition.
- ONU (2015). Transformar nuestro mundo: la agenda 2030 para el desarrollo sostenible.
- ONU (2016). Global sustainable development report 2016.
- Park, I. (2003). Design effects and survey planning. page 8.
- Park, I. and Lee, H. (2006). Design effects for the weighted mean and total estimators under complex survey sampling. *Quality control and applied statistics*, 51(4):381.
- Presser, S., Rothgeb, J., Couper, M., Lessler, J., Martin, E., Martin, J., and Singer, E. (2004). *Methods for Testing and Evaluating Survey Questionnaires*. John Wiley and Sons.
- Särndal, C.-E., Swensson, B., and Wretman, J. (2003). *Model Assisted Survey Sampling*. Springer Science and Business Media. Google-Books-ID: uf-dONK3E1TcC.
- Tillé, Y. (2006). *Sampling Algorithms*. Springer Series in Statistics. Springer-Verlag.
- UN (2005). *Household surveys in developing and transition countries*. Studies in methods / United Nations, Department of Economic and Social Affairs, Statistics Division Series F.
- UN (2008). *Designing household survey samples: practical guidelines*. Studies in methods / United Nations, Department of Economic and Social Affairs, Statistics Division Series F. United Nations.
- Valliant, R., Dever, J. A., and Kreuter, F. (2013). *Practical Tools for Designing and Weighting Survey Samples*. Springer New York.
- Valliant, R., Dever, J. A., and Kreuter, F. (2018). *Practical Tools for Designing and Weighting Survey Samples*. Statistics for Social and Behavioral Sciences. Springer International Publishing.
- Vehovar, V. (1999). Field substitution and unit nonresponse. *Journal of Official Statistics*, 15(2):335–350.