

**Европейская экономическая комиссия****Конференция европейских статистиков****Шестьдесят седьмая пленарная сессия**

Париж, 26–28 июня 2019 года

Пункт 4 с) предварительной повестки дня

**Опережающие, композитные и психологические
индикаторы****Руководящие принципы подготовки опережающих,
композитных и психологических индикаторов****Записка Целевой группы по опережающим, композитным
и психологическим индикаторам***Резюме*

Настоящий документ представляет собой выдержку из главы 1 *Руководящих принципов подготовки опережающих, композитных и психологических индикаторов*. Он был подготовлен Целевой группой в составе Венгрии, Дании, Израиля, Италии, Мексики, Нидерландов, Турции, Швеции, Евростата, ОЭСР, СОООН и ЕЭК ООН. Г-н Йерун Булхауэр, Нидерландский институт социальных исследований, и г-н Джан Луиджи Мацци, «ГОПА консалтинг груп», принимали участие в работе этой целевой группы в качестве независимых экспертов. До октября 2017 года Целевая группа работала под председательством Швеции. С ноября 2017 года председателем группы стала Дания.

Цель руководящих принципов – служить ориентиром для национальных статистических управлений в вопросах их возможных функций в процессе разработки и составления опережающих, композитных и психологических индикаторов (ОКПИ) и источником практических и оперативных рекомендаций для статистических управлений, которые уже занимаются составлением ОКПИ или рассматривают возможность проведения этой работы.

Полный текст Руководящих принципов направлен всем членам Конференции европейских статистиков для электронных консультаций. При положительном итоге консультаций пленарной сессии КЕС будет предложено одобрить Руководящие принципы.



I. Введение

1. В последнее десятилетие растет интерес к опережающим, композитным и психологическим индикаторам как инструменту, позволяющему лучше понять процесс социально-экономического развития общества. Эти показатели, о которых все чаще говорят в средствах массовой информации, играют все более важную роль в общественных дискуссиях и в процессе принятия директивных решений.
2. Опережающие, композитные и психологические индикаторы (ОКПИ) служат эффективным средством передачи статистической информации и выхода на аудиторию пользователей статистических данных. Они могут предоставлять актуальную и своевременную информацию о тех аспектах экономики и социального общества, которые не охватываются другими статистическими данными. Они также позволяют получить в простом и сжатом виде информацию о сложных явлениях, например об экономическом развитии на данный момент и о его предполагаемой динамике или об уровне благополучия граждан и о том, насколько счастливыми они себя ощущают.
3. Если у некоторых статистических управлений уже имеется опыт работы по составлению опережающих, композитных и психологических индикаторов и распространению такой информации, то для многих статистических служб это совершенно новая сфера. В целях оказания помощи статистическим управлениям в подготовке опережающих, композитных и психологических индикаторов, Бюро Конференции европейских статистиков (КЕС) учредило в 2016 году целевую группу для разработки практических и оперативных рекомендаций для статистических управлений, которые уже занимаются составлением ОКПИ или рассматривают возможность проведения этой работы. Настоящие Руководящие принципы являются итогом работы Целевой группы.
4. В Руководящих принципах подтверждаются и упоминаются существующие международные методические справочники и пособия, например справочники и пособия Евростата, Организации экономического сотрудничества и развития (ОЭСР) и Статистического отдела Организации Объединенных Наций (СОООН).

II. Справочная информация

A. Опережающие, композитные и психологические индикаторы

5. Опережающие, композитные и психологические индикаторы (ОКПИ) охватывают обширную и разнообразную группу статистических показателей, которые, каждый по-своему, должны давать информацию об обществе и его отдельных представителях. Опережающие индикаторы предваряют разработку базового ряда данных. Как правило, опережающие индикаторы рассчитываются с целью прогнозирования циклов промышленного производства или динамики валового внутреннего продукта (ВВП), которые используются в качестве косвенных показателей экономического развития. Опережающие показатели строятся на основе одного или чаще нескольких отдельных показателей, которые, как выяснилось, в совокупности приобретают в сравнении с выбранным базовым рядом данных опережающие свойства. Композитные индикаторы составляются для оценки сложных или многомерных явлений путем объединения отдельных индикаторов в единый показатель посредством вычисления среднего арифметического или с использованием более сложных статистических методов. Психологические индикаторы должны отражать представления, настрой и ожидания групп респондентов, например различных групп людей, домашних хозяйств или предприятий. Эти показатели обычно опираются на результаты качественных обследований, при проведении которых изучались мнения о прошлых, нынешних или будущих тенденциях, на основе которых строится данный индикатор.
6. ОКПИ позволяют получить информацию по широкому кругу вопросов, на которые не распространяется сфера того массива, каковым можно считать традиционную официальную статистику, или которые, как правило, не охватываются

национальными статистическими управлениями (НСУ). Кроме того, с помощью ОКПИ информация по сложным вопросам может быть представлена в довольно простой и сжатой форме, что привлекает многих пользователей статистических данных. В их числе следует назвать директивные органы и средства массовой информации, которые все шире прибегают к опережающим, композитным и психологическим индикаторам.

7. На протяжении прошедшего десятилетия ОКПИ становились все более востребованными и теперь все чаще встречаются в различных областях, включая анализ циклов деловой активности, оценку благополучия и применение психологических индикаторов, отражающих уверенность деловых кругов в динамике экономического развития и их ожидания или же виды на будущее населения и степень бытующего в обществе ощущения довольства и защищенности. ОКПИ все чаще применяются при проведении международных сопоставлений для оценки показателей стран и все шире используются для разработки политики.

8. Востребованность ОКПИ обусловлена меняющимися потребностями пользователей, которым нужны более сопоставимые показатели, позволяющие представить информацию в сжатом виде и пролить свет на области, традиционно не относящиеся к основной сфере интересов большинства НСУ или вообще упускаемые ими из виду. Некоторые ОКПИ могут рассчитываться сравнительно быстро и соответственно позволяют получить представление о происходящих событиях раньше, чем при использовании традиционных статистических рядов данных. Этому способствует тот факт, что появляется все больше данных, вычислительных мощностей и инструментальных средств ИТ, благодаря чему составлять ОКПИ теперь гораздо легче, чем прежде. Ввиду этого многие ОКПИ рассчитываются другими поставщиками данных, а не НСУ.

В. Роль национальных статистических управлений

9. ОКПИ, в принципе, являются именно той областью, в которой официальная статистика может быть полезна всем заинтересованным сторонам. Вместе с тем практикуемые странами методы различаются между собой, равно как и мнения относительно роли НСУ при подготовке ОКПИ. Некоторые НСУ полагают, что ОКПИ находятся за рамками выпускаемой ими статистической продукции, или же не относят их построение к числу приоритетных задач. К тому же порой НСУ опасаются, что выпуск ОКПИ может ударить по их репутации как поставщика официальных статистических данных.

10. Другие НСУ накопили значительный опыт составления ОКПИ или рассматривают возможность проведения этой работы. НСУ могут обеспечить подготовку индикаторов на основе принципов официальной статистики и, распространяя их, формировать у пользователей более высокое мнение об актуальности и ценности официальной статистики. Кроме того, если статистические управления не будут заниматься подготовкой этих индикаторов, опираясь на свои данные и опыт, их могут составлять другие организации, не придерживающиеся принципов официальной статистики. Такие организации могут не вкладывать необходимые средства для обеспечения выпуска высококачественных показателей и обходиться без достаточно полного документального отражения источников данных и применяемых методов.

11. Однако в вопросе о роли национальных статистических управлений в случае ОКПИ пока нет консенсуса. Следует ли отнести подготовку ОКПИ к сфере деятельности других организаций, или же НСУ должны играть более активную роль в процессе разработки и выпуска ОКПИ? Должны ли НСУ активнее предоставлять данные и предлагать свой экспертный потенциал другим организациям, занимающимся составлением ОКПИ?

С. Предмет Руководящих принципов и порядок их использования

12. Предметом Руководящих принципов являются опережающие, композитные и психологические индикаторы. Речь не идет о трех отдельных, взаимоисключающих друг друга группах показателей. Так, например, композитный индикатор может быть и опережающим, а психологический индикатор может строиться как композитный. В настоящих Руководящих принципах опережающие индикаторы представлены не в виде отдельной группы показателей, а как подгруппа композитных и психологических индикаторов. Ввиду этого в главе 4 о психологических индикаторах рассматриваются и опережающие психологические индикаторы, а в главах 5 и 6, посвященных композитным показателям, обсуждаются также опережающие композитные индикаторы. Для удобства пользования при упоминании группы опережающих, композитных и психологических индикаторов везде в Руководящих принципах употребляется аббревиатура ОКПИ.

13. В Руководящих принципах не затрагиваются отдельные количественные показатели, которые могут толковаться или использоваться как психологические или опережающие индикаторы. Например, статистические данные о динамике запасов, выдаче разрешений на строительство и объемах продаж автомобилей или индексы промышленного производства могут использоваться в качестве индикаторов ожиданий деловых кругов или ранних индикаторов цикла деловой активности. Роль НСУ в подготовке таких показателей не вызывает сомнений, и при их составлении НСУ имеют возможность опереться на многочисленные международные статистические стандарты и рекомендации в отношении их расчета. По той же причине в Руководящих принципах не затрагиваются традиционные статистические показатели, такие как валовой внутренний продукт (ВВП) или индекс потребительских цен (ИПЦ).

14. В Руководящих принципах содержится вводная информация об ОКПИ, освещаются их основные параметры и даются общие рекомендации статистическим управлениям относительно их возможных функций в процессе разработки, составления и распространения ОКПИ, а также практические и оперативные рекомендации тем статистическим управлениям, которые уже занимаются составлением ОКПИ или рассматривают возможность проведения этой работы. В Руководящих принципах освещаются плюсы и минусы показателей и возможностей различных типов, указываются опасности, которые статистическим учреждениям следует учитывать, приступая к такой работе, и в общих чертах изложена базовая процедура построения этих индикаторов. Руководящие принципы не содержат подробных методологических или технических рекомендаций в отношении составления ОКПИ. Вместо этого приводятся ссылки на существующие методологические справочники и пособия, например справочники и пособия ОЭСР, Евростата и СОООН. Руководящие принципы могут использоваться при принятии решения о целесообразности выпуска ОКПИ и о порядке организации работы по их составлению и распространению, для получения же упомянутых более подробно разработанных методических указаний следует обращаться к существующим международным руководствам.

Д. Инициативы Конференции европейских статистиков

15. В связи с растущей значимостью ОКПИ Бюро КЕС в январе 2014 года провело углубленный анализ опережающих, композитных и психологических индикаторов с целью обсуждения вопроса о роли официальной статистики в этом контексте. В качестве основы для такого углубленного анализа секретариат ЕЭК ООН организовал обследование по вопросу о практике составления ОКПИ в отдельных странах и получил ответы от 38 стран – членов КЕС. Результаты обзора подтвердили факт применения различных методов и наличие различных мнений относительно участия НСУ в подготовке ОКПИ. Бюро пришло к выводу о том, что обмен опытом и информацией о передовой практике будет полезен странам в процессе подготовки ОКПИ. Кроме того, Бюро констатировало, что в этой области не достает

международной координации, и указало на необходимость выработки общего понимания роли статистических управлений в этой области и рекомендаций для НСУ, занимающихся составлением ОКПИ или рассматривающих возможность проведения этой работы.

16. Пленарная сессия КЕС, проходившая в апреле 2014 года, подтвердила наличие не только большого интереса к ОКПИ, но и расхождений в мнениях в отношении того, в какой степени НСУ следует заниматься составлением этих индикаторов. Участники Конференции пришли к выводу о том, что было бы полезно продолжить обсуждение роли официальной статистики, а также трудностей, возникающих в процессе составления и публикации ОКПИ, и уточнить круг обязанностей и границы ответственности национальных статистических управлений в этом отношении. Во исполнение этого решения Конференции в декабре 2015 года в Женеве был организован международный семинар по вопросу о роли НСУ при подготовке ОКПИ. На семинаре обсуждалась роль официальной статистики и национальных статистических органов в рамках подготовки ОКПИ, а также методологические и практические вопросы составления и распространения таких индикаторов.

17. Исходя из этого в феврале 2016 года Бюро учредило целевую группу для разработки руководящих принципов подготовки ОКПИ. В руководящих принципах следовало уточнить возможные функции НСУ при подготовке ОКПИ и сформулировать практические и оперативные рекомендации для НСУ, занимающихся составлением ОКПИ или рассматривающих возможность проведения этой работы. Целевая группа начала работу в марте 2016 года, наметив основное содержание руководящих принципов и организовав процесс подготовки отдельных глав, назначив по каждой из них ведущего составителя и соавторов. В ходе второго международного семинара по ОКПИ, проходившего в июле 2017 года в Женеве, были представлены проекты глав с целью получения информации от участвующих стран и организаций.

18. В марте–апреле 2018 года были проведены промежуточные консультации по первому проекту руководящих принципов, чтобы все члены КЕС могли рассмотреть руководящие принципы и представить Целевой группе свои замечания и предложения на предмет их доработки. Такие предложения представили организаторам промежуточных консультаций 37 стран, три международных организации и три научно-исследовательских учреждения. Информация о проекте руководящих принципов и результатах промежуточных консультаций была представлена на пленарной сессии КЕС в июне 2018 года. Участники Конференции поддержали проект руководящих принципов и подчеркнули растущий интерес к опережающим, композитным и психологическим индикаторам как средству представления пользователям официальной статистики актуальной и своевременной информации об экономическом и социальном развитии. Конференция предложила Целевой группе учесть замечания и предложения, высказанные в ходе промежуточных консультаций, и распространить среди членов КЕС обновленный вариант руководящих принципов для проведения заключительной серии консультаций с целью представления этого варианта для утверждения на пленарной сессии КЕС 2019 года.

III. Цель Руководящих принципов

19. В рамках Руководящих принципов ставятся следующие основные задачи:

A. Сформулировать рекомендации в отношении возможных функций НСУ при подготовке ОКПИ

20. В Руководящих принципах описываются различные функции НСУ при подготовке ОКПИ и сформулированы основные рекомендации в отношении удовлетворения потребностей пользователей в ОКПИ с соблюдением принципов официальной статистики. В них освещаются проблемы и вопросы, связанные с подготовкой индикаторов, и обсуждаются возможности и риски, с которыми сталкиваются НСУ при составлении и публикации ОКПИ.

В. Сформулировать практические и оперативные рекомендации для НСУ по вопросам подготовки ОКПИ

21. Руководящие принципы содержат стратегические и оперативные рекомендации в отношении составления и публикации ОКПИ. Для этого в них включены типология ОКПИ и рекомендации в отношении возможных этапов и методов составления ОКПИ. Кроме того, в Руководящих принципах указаны проблемы и трудности, встречающиеся при составлении и распространении ОКПИ, даются рекомендации по вопросам обеспечения качества на основе принципов официальной статистики и рассматриваются вопросы, связанные с обеспечением международной сопоставимости. Руководящие принципы не содержат подробных методологических рекомендаций. Вместо этого приводятся ссылки на существующие справочники и пособия, например справочники и пособия ОЭСР, Евростата и СОООН¹, где содержатся методологические и технические рекомендации.

С. Предложить вниманию НСУ примеры передовой практики в целях расчета ОКПИ

22. В Руководящие принципы включена подборка примеров передовой практики составления и распространения ОКПИ с описанием источников данных, методов составления и различных вариантов распространения.

IV. Обзор Руководящих принципов

23. Документ состоит из семи глав и приложений. С каждой главой можно ознакомиться отдельно, но для этого следует хорошо представлять себе основные концепции, которые освещаются в главе 2. В различных главах Руководящих принципов и приложениях к ним приводятся примеры передового опыта на национальном и международном уровне.

24. В главе 2 представлена типология ОКПИ. В ней определяются и разъясняются различные виды индикаторов и приводятся примеры их основных видов. Главное внимание в рамках типологии уделено психологическим и композитным индикаторам. В обоих случаях проводится различие между индикаторами с базовым рядом данных и индикаторами без базовых рядов данных. Опережающие индикаторы рассматриваются не в качестве отдельной группы показателей, а как подгруппа композитных и психологических индикаторов.

25. В главе 3 рассматривается роль НСУ в подготовке ОКПИ для удовлетворения потребностей пользователей с соблюдением принципов официальной статистики. В этой главе обсуждаются проблемы, с которыми сталкиваются НСУ при разработке ОКПИ, даются рекомендации в отношении сотрудничества с пользователями и заинтересованными сторонами и по вопросам, касающимся обеспечения качества, и описываются различные стратегии, применяемые НСУ при подготовке ОКПИ. В ней также анализируются вероятные сильные и слабые стороны, возможности и угрозы, которые следует принимать во внимание национальным статистическим управлениям, занимающимся подготовкой ОКПИ.

26. В главе 4 представлены психологические индикаторы. Основное внимание в этой главе уделяется отдельным психологическим индикаторам с проведением различия между экономическими и социально-экономическими психологическими индикаторами. После освещения плюсов и минусов обеих групп индикаторов представлены процедуры составления показателей и их анализ, включая сопоставление с базовыми рядами данных. При этом вкратце рассматриваются и вопросы, касающиеся международной сопоставимости.

¹ В частности, на *Руководство по построению композитных показателей* (OECD, 2008) и *Руководство по циклическим композитным индикаторам* (EU & UNSD, 2017a).

27. В главе 5 содержится обзор композитных экономических индикаторов. В ней представлены наиболее широко используемые модели для композитных экономических индикаторов и рекомендации в отношении их составления. В данной главе особо выделяются преимущества и недостатки/риски композитных экономических индикаторов, а также проблемы и трудности, о которых НСУ следует помнить при их составлении. Проводится различие между *циклическими* и *структурными индикаторами*. В ней в сжатом виде поэтапно изложен порядок расчета циклического композитного экономического индикатора на основе *Руководства по построению композитных показателей* (OECD, 2008) и *Руководства по циклическим композитным индикаторам* (EU & UNSD, 2017a).

28. Глава 6 посвящена композитным социально-экономическим индикаторам. В ней содержится справочная информация и освещаются некоторые отличия от композитных экономических показателей, рассмотренных в главе 5. Кроме того, в этой главе изложены основные этапы построения композитного социально-экономического индикатора: создание концептуальной модели индикатора; выбор параметров и индикаторов; обработка данных; многофакторный анализ, нормализация данных, взвешивание и агрегирование; и валидация. Дополнительные трудности в процессе построения обсуждаемых социально-экономических индикаторов возникают в силу агрегирования по различным параметрам и отсутствия базовых рядов данных и общей единицы измерения (подобно денежным единицам в случае экономических показателей).

29. В главе 7 обсуждаются вопросы передачи информации о ОКПИ и их распространения, что рассматривается в качестве стратегически важного фактора успеха. В ней приводится перечень конкретных проблем, связанных с распространением ОКПИ, и даются рекомендации в отношении выхода на группы пользователей и методов представления показателей в верном контексте и в соответствии с принципами официальной статистики.

30. В документе имеются приложения. В приложении А содержатся рекомендации в отношении сопоставления экономических психологических показателей с их базовыми рядами данных, которые служат дополнением к главам 4 и 5. В приложениях В–Н приведены подробные примеры подготовки опережающих, композитных и психологических индикаторов в Италии, Мексике, Нидерландах, Турции и Швеции.

V. Темы для будущей работы и исследований

31. Особое внимание в Руководящих принципах уделяется практическим рекомендациям странам, занимающимся составлением ОКПИ или рассматривающим возможность проведения этой работы. В ходе подготовки проекта Руководящих принципов Целевая группа отметила ряд тем, которые было бы целесообразно положить в основу дальнейшей работы и исследований. Эти темы перечислены и кратко освещаются ниже.

A. Обмен опытом и передовыми методами работы между странами

32. Для многих статистических служб ОКПИ являются совершенно новой сферой, и в разрезе подготовки этих индикаторов страны находятся на разных уровнях развития. Поэтому важно продолжать обмен опытом и передовой практикой между странами и организациями по тематике как вопросов концептуального и методологического порядка и проблем статистических измерений, так и трудностей, возникающих при передаче информации об ОКПИ. С этой целью было бы полезно организовывать международные семинары или рабочие совещания для обмена опытом и передовой практикой в области ОКПИ и их составления, в идеальном варианте по конкретным темам (например, по теме «Экономические и социально-экономические показатели»). Полезную роль могли бы также сыграть специальные рабочие совещания и семинары для стран с менее развитыми статистическими системами.

В рамках обмена опытом следует рассмотреть возможность создания веб-сайта с архивом актуальных для стран материалов.

В. Сравнительный анализ страновой практики

33. Методы и практика составления ОКПИ существенно различаются в разных странах. Полезно было бы провести сравнительный анализ, чтобы получить представление о том, какие НСУ или другие организации выпускают соответственно ОКПИ какого рода и какие методы и способы при этом используются. Такой обзор помог бы при выявлении передовой практики, а также областей, в которых применяются различные методы и в которых в конечном счете целесообразно было бы разработать дополнительные рекомендации.

С. Разработка системы статистических показателей для оценки благополучия

34. Существует ряд систем показателей оценки благосостояния, включая, например, разработанный в ОЭСР индекс лучшей жизни. Однако они увязываются с самыми различными политическими целями или конкретными задачами. Было бы полезно разработать чисто статистическую систему с композитным индикатором благополучия, на которую смогут опираться и ссылаться НСУ, приступая к работе по подготовке композитного индикатора благополучия. Эта система должна включать предложение в отношении концептуальной модели определения благополучия с указанием возможных параметров такого индикатора и возможных отдельных индикаторов по каждому параметру. Для каждого индикатора можно было бы предусмотреть рекомендации в отношении определений, источников данных и методов расчета. В рамках данной системы следует также дать рекомендации в отношении установления весов и агрегирования параметров и индивидуальных показателей.

Д. Социальный капитал и благополучие

35. В последние годы большой интерес вызывают вопросы социального капитала и методов его измерения, о чем свидетельствует, например, проект ОЭСР по измерению социального капитала с созданием банка данных по соответствующим вопросам. Концепции социального капитала и благополучия частично совпадают. Было бы полезно уточнить взаимосвязь между ними и проследить, например, какие показатели могут использоваться для составления подборок данных как по социальному капиталу, так и по благополучию.

Е. Использование источников данных

36. НСУ могут не проявлять желания заниматься подготовкой ОКПИ из-за отсутствия средств, необходимых для разработки этих показателей и обеспечения их составления на постоянной основе. Ввиду этого целесообразно было бы изучить возможности использования потенциальных источников данных, включая существующие реестры, обследования, массивы больших данных и другую имеющуюся в Интернете информацию, а также методы использования информации из различных источников для выпуска ОКПИ. В рамках этой работы полезно было бы также обсудить возможности упрощения используемых в рамках обследований вопросников и сокращения дорогостоящих собеседований.

Ф. Международная сопоставимость и ЦУР

37. Некоторые ОКПИ будут в полной мере отвечать своему назначению лишь в случае их международной сопоставимости (особенно в контексте благополучия и

развития). Таким образом, особое внимание, возможно, следует уделить вопросу стандартизации опережающих, композитных и психологических индикаторов и их интеграции в официальную статистику, а также обеспечению их сопоставимости. Это является одним из базовых критериев ОКПИ, используемых для оценки достижения ЦУР (например, психологических индикаторов: показателя 2.1.2 по шкале восприятия отсутствия продовольственной безопасности; показателя 5.6.1 по вопросам участия женщин в принятии решений о сексуальных отношениях, применении противозачаточных средств и обращении за услугами по охране репродуктивного здоровья, показателя 10.3.1 о доле лиц, сообщивших, что они лично подвергались преследованиям и дискриминации, и показателя 16.1.4 о восприятии безопасности; соответствующий пример приведен во вставке 7.3)². Кроме того, имеются показатели ЦУР третьего уровня, которые требуют оценки на индивидуальной основе.

Г. Другие темы

38. Полезно было бы проработать на международном уровне и ряд более конкретных тем, например с их обсуждением в ходе совещаний или рабочих совещаний, которые, возможно, будут проводиться в будущем. Эта тематика включает в себя широкий круг методологических и практических вопросов, в том числе, например, разработку психологических показателей для сферы услуг; ход достижения показателей; изучение методов ранжирования порядковых (качественных) переменных; практические и оперативные рекомендации для оказания странам помощи в подготовке ОКПИ; и вопросы, касающиеся передачи информации об ОКПИ и их использования.

² Полный перечень показателей с их описанием см. <https://unstats.un.org/sdgs/metadata/>.