



Европейская экономическая комиссия

Конференция европейских статистиков

Группа экспертов по индексам потребительских цен

Двенадцатая сессия

Женева, 26 мая - 28 мая 2014

Пункт 2 предварительной повестки дня

Обновление руководства по ИПЦ 2004

Аналитическая записка о возможном обновлении Руководства по ИПЦ 2004

**Подготовлено Межсекретариатской рабочей группой по
статистике цен (МРГСЦ)**

Резюме

В докладе обсуждается возможное обновление *Руководства по индексу потребительских цен*. Теория и практика были опубликованы в 2004 году. В докладе поднимается вопрос, есть ли необходимость в обновлении Руководства по индексу потребительских цен, какие вопросы должны быть приняты во внимание при возможном обновлении, и как обновление может быть организована. Участником предоставляется возможность поделиться своим мнением по поводу обновления Руководства по индексу потребительских цен и представить свои комментарии и предложения по возможному обновлению.

I. Введение

1. *Руководство по индексу потребительских цен: Теория и практика*, опубликованное в 2004 году, содержит подробную информацию и объяснения, а также описание методологии построения индекса потребительских цен (ИПЦ) вместе с описанием соответствующих концептуальных и теоретических основ. Руководство является крупным достижением в объединении и консолидации знаний и опыта, как исследователей, так и производителей статистических данных.

2. За последние десять лет *Руководство по ИПЦ 2004 года* широко использовалось статистическими службами, и был приобретен большой опыт, благодаря полезности руководства и реализации рекомендованных методов. В этот же период появились новые методы и приемы, были разработаны новые источники и методы сбора данных, и повысились требования пользователей. В такой ситуации представляется важным узнать мнения участников заседания Группы экспертов по индексам потребительских цен, проводимого в 2014 г., о необходимости и характере возможного обновления Руководства по ИПЦ 2004 года.

3. Раздел 2 содержит общую информацию о Руководстве по ИПЦ 2004 года и соответствующих рекомендациях. В разделе 3 приводится краткое обсуждение необходимости обновления и того, какие вопросы следует принять во внимание при обновлении. Раздел 4 содержит краткое описание того, как может быть организована работа по обновлению Руководства. В заключительном разделе 5 перечислены некоторые вопросы, по которым требуется обратная связь от участников заседания.

II. Предыстория

4. Руководство по ИПЦ 2004 года представляет собой значительный пересмотр предыдущей публикации *«Индексы потребительских цен: Руководство МОТ»*, вышедшей за 15 лет до этого, в 1989 году. Руководство по ИПЦ 2004 года предназначено для использования как развитыми, так и развивающимися странами. Оно предлагает обширную информацию о базовой экономической и статистической теории, объединяет знания и опыт аргументированным и строгим образом и предоставляет подробные практические рекомендации по процедурам построения ИПЦ. В руководстве также рассматривается ряд областей, которые ранее не были описаны, и уточняются некоторые основные понятия. Примерами являются подробные рекомендации по проведению корректировок цен на изменение качества товаров, а также указания по применению формул индексов, в частности, использование индексов Янга и Лоу. Таким образом, руководство явилось большим шагом вперед в области построения индексов потребительских цен и проложило путь для совершенствования практики и проведения дальнейшей исследовательской работы.

5. Параллельно с подготовкой окончательного варианта Руководства по ИПЦ 2004 года, был разработан проект Резолюции Международной Конференции Статистиков Труда (МКСТ) в отношении индексов потребительских цен. Резолюция

была принята на 17-ой *Международной конференции статистиков труда* в 2003 году¹. Резолюция и руководство согласуются и дополняют друг друга.

6. В 2009 году Руководство по ИПЦ 2004 было дополнено *Практическими указаниями по производству индексов потребительских цен*. Указания составлены в качестве дополнительного практического справочника к Руководству по ИПЦ 2004 года; внимание сосредоточено на более практических вопросах и нуждах статистиков в развивающихся странах. К тексту прилагался CD-ROM с иллюстративными расчетами и набором слайдов презентации, предназначенных для обучения на местах.

7. Руководство по ИПЦ 2004 года согласуется по стилю, структуре, терминологии и методологии с Руководством по индексу цен производителей (ИЦП) (2004), и Руководством по индексам экспортных и импортных цен (ИЭИЦ) (2009). Руководство по ИПЦ 2004 года издается на арабском, китайском, английском, французском, японском, испанском и русском языках, а Практические указания 2009 года выпущены на английском, французском и испанском языках.

8. Руководства по ИЦП, ИПЦ, ИЭИЦ, Практические указания и - совсем недавно - *Справочник по индексам цен на жилую недвижимость* (ИЦЖН) (2013) были произведены под эгидой Межсекретариатской рабочей группы по статистике цен (МРГСЦ), созданной в 1998 году. Техническое задание для МРГСЦ было одобрено Статистической Комиссией ООН в 1999 году, а общими целями являлись разработка международных стандартов и рекомендаций в области статистики цен, документирование принципов наилучшей практики и содействие их осуществлению. В члены МРГСЦ входят Евростат, Международная организация труда (МОТ), Международный валютный фонд (МВФ), Организация экономического сотрудничества и развития (ОЭСР), Европейская экономическая комиссия Организации Объединенных Наций (ЕЭК ООН) и Всемирный банк. Участие в работе Группы открыто, по приглашению, для специалистов, в том числе из статистических служб и научных кругов.

III. Есть ли необходимость в обновлении Руководства по ИПЦ 2004 года?

9. В этом разделе мы сначала обобщим полученные отзывы о полезности Руководства по ИПЦ 2004 года. Далее будут приведены основные мотивы для инициирования обновления.

A. Отзывы о Руководстве по ИЦП 2004 года

10. В 2007 году МРГСЦ попросила МОТ и ЕЭК ООН провести опрос среди специалистов, занимающихся расчетом ИПЦ в национальных статистических службах (НСС), и среди ограниченного числа основных пользователей ИПЦ о полезности и полноте Руководства по ИПЦ 2004 года. Для этого в июне 2007 года был разослан глобальный вопросник. Было получено в общей сложности 104 ответа,

¹ http://www.ilo.org/global/statistics-and-databases/standards-and-guidelines/resolutions-adopted-by-international-conferences-of-labour-statisticians/WCMS_087521/lang--en/index.htm.

охватывающих 92 страны, 86 из которых поступили из служб, занимающихся расчетом индексов ².

11. В целом составители сочли Руководство по ИПЦ 2004 года очень полезным. 94% сочли практические главы 1-13 "полезными" или "очень полезными". 87% нашли теоретические главы 15-23 "полезными" или "очень полезными". Составителям напрямую был задан вопрос о балансе между теорией и практикой: 35% сочли баланс хорошим, в то время как 65% ответили, что больше места должно быть уделено практическим вопросам. Результаты по каждой главе приведены в Приложении 1, вместе с полученными предложениями по вопросам, которые должны быть включены в будущие версии этого руководства или быть освещены в дополнительных справочных публикациях.

12. В ответ на потребность в более широком рассмотрении практических вопросов, были опубликованы Практические указания по построению индексов потребительских цен 2009 года.

Б. Мотивация для обновления

13. Большая часть материалов для Руководства по ИПЦ 2004 года была подготовлена в период с 1999 по 2003 год. С тех пор в статистических службах и исследовательском сообществе был приобретен полезный опыт по использованию методов, представленных в Руководстве по ИПЦ 2004 года, но в то же время появились новые методы и приемы. Источники данных значительно улучшились, начиная с конца 1990-х годов: сегодня гораздо большая доля информации о ценах собирается из электронных источников и/или с помощью электронных средств, в том числе при помощи получения данных из Интернета и более широкого использования сканирования. Наличие новых источников данных влияет не только на использование выборочных методов, но и на то, как проводятся расчеты ИПЦ. Потребности пользователей также продолжали развиваться, что приводит к росту спроса на подробные и высококачественные ряды ИПЦ, к повышению требований к своевременности данных, их международной сопоставимости, к лучшему документированию и распространению информации.

14. По мнению МРГСЦ обновление Руководства по ИПЦ 2004 года даст возможность рассмотреть и принять во внимание опыт, накопленный в результате использования данного руководства, а также изменения в методах расчета, источниках данных и потребностях пользователей. Обновление также предоставит возможность для выработки более ясных, а в некоторых случаях - более жестких рекомендаций и практических советов там, где это может быть полезно.

15. В связи с этим при обновлении Руководства по ИПЦ 2004 года можно принять во внимание следующие вопросы:

- а) Предоставление более четких и в некоторых случаях более директивных рекомендаций там, где результаты исследований и методических разработок и практический опыт позволяют это сделать, например, для расчета индексов на низких и высоких уровнях агрегирования, обработки данных о ценах на сезонные продукты, использования единичных стоимостей и дальнейшей

² Результаты опроса включены в *Report on the 2007 International Survey on the Usefulness of the Consumer Price Index Manual*, представленном на совместном заседании ЕЭК ООН / МОТ в мае 2008 года. Доступны по адресу: <http://www.unece.org/stats/documents/2008.05.cpi.html>.

разработки методов для включения в ИПЦ оценок по жилым помещениям, занимаемым владельцами.

- b) Некоторое сокращение материала, объем которого, судя по опыту, был не пропорционален его аналитическому и практическому использованию.
- c) Новые требования к высокочастотным и своевременным экономическим показателям, особенно в период экономического и финансового кризиса, вызывающие необходимость дальнейшего рассмотрения вопросов расчета индексов и использования данных для получения предварительных (flash) оценок ИПЦ и использования более актуальных весов, в том числе для разработки практических рекомендаций по изменению базисного периода;
- d) Наличие электронных источников ежемесячных или даже более частых ценовых данных, включая данные сканирования и веб-харвестинга; рассмотрение результатов методологических исследований в связанных областях и - учитывая разнообразие методов, используемых статистическими службами - рекомендации по их применению для расчета индексов;
- e) Изменение информационной среды, связанное с распространением статистических данных через Интернет, и рекомендации по использованию передового опыта при документировании и обеспечении прозрачности данных.

16. Рекомендации и практические советы должны быть основаны на разумных методах, согласованных на международном уровне и обеспечивающих хорошие результаты. В обновленном руководстве меньше внимания должно уделяться деталям из теоретических глав Руководства по ИПЦ 2004 года. Оно должно включать такие детали только в случае необходимости, однако изложение, объяснения, концепции и методы должны быть основаны на теории, по мере необходимости.

17. Общей целью обновления является предоставление четких рекомендаций и практических указаний для специалистов, занимающихся расчетом ИПЦ в национальных статистических службах, для поддержки улучшения качества и надежности ИПЦ и обеспечение большей международной сопоставимости индексов. Ключевые национальные показатели для ИПЦ в разных странах рассчитываются в соответствии с различными определениями и методологиями. Наличие более четких, согласованных в международном масштабе определений и методологии построения ИПЦ, будет способствовать повышению качества и улучшению международной сопоставимости национальных оценок ИПЦ, которые будут отвечать потребностям пользователей и позволят улучшить оценки агрегатов по областям.

18. Обновление не предполагает внесения фундаментальных или всеобъемлющих изменений, которые потенциально могли бы помешать прогрессу, достигнутому в результате применения Руководства по ИПЦ 2004 года. Тем не менее, есть необходимость разработать вопросы, которым в недавнее время было уделено внимание аналитиков; использовать уроки, извлеченные НСС и международными организациями, которые предоставляют Техническое содействие и проводят обучение, в отношении упущений, сильных и слабых сторон некоторых методов построения индексов, изложенных в руководстве. Также стоит учитывать изменяющуюся информационную среду и новые источники данных и договориться о более жестких стандартах, где это возможно и целесообразно.

19. Обновление Руководства по ИПЦ 2004 года потребует значительных ресурсов на национальном и международном уровне. В следующем разделе изложены предложения того, как может быть организована эта работа.

IV. Организация работы по обновлению Руководства по ИПЦ 2004 года

20. При проведении обновления Руководства по ИПЦ 2004 года следует принять текущую версию в качестве отправной точки в концептуальном, методологическом и практическом смыслах и придерживаться процедур и методов, использованных при обновлении других крупных статистических справочников, таких как *Система национальных счетов* и *Платежный баланс*.

21. МРГСЦ, в соответствии с ее техническим заданием, отвечает за контроль над организацией обновления руководств по статистике цен. В случае принятия решения об обновлении Руководства по ИПЦ 2004 года, МРГСЦ предлагает создать группу технических экспертов (ГТЭ-ИПЦ) для этой работы. ГТЭ-ИПЦ должна функционировать под эгидой МРГСЦ, которой она будет докладывать. Группа должна состоять из признанных экспертов из стран, организаций, научных кругов и членов МРГСЦ. Это соответствует схеме организации работы, когда проводилось обновление Руководства МОТ по ИПЦ 1989 года до текущей версии Руководства по ИПЦ.

22. ГТЭ-ИПЦ будет назначать авторов ответственных за рассмотрение и, при необходимости, переработку существующих глав, чтобы, при необходимости, сокращать или расширять существующий текст; вводить новые темы; убирать избыточные части; и придерживаться более предписывающего тона, где это возможно и целесообразно. Проект обновленной версии Руководства будет предоставлен национальным статистическим службам, заинтересованным пользователям и экспертам для замечаний с использованием специального веб-сайт. Кроме того, будут проведены различные презентации на международных конференциях. Поправки будут внесены на основе полученных замечаний.

23. Формальная процедура консультаций для утверждения пересмотренного Руководства по ИПЦ еще нуждается в дальнейшем рассмотрении и обсуждении.

V. Необходимость обратной связи

24. МРГСЦ хотела бы получить мнения участников заседания Группы экспертов по индексам потребительских цен 2014 года по следующим вопросам:

(a) Есть ли необходимость в обновлении Руководства по ИПЦ? Обновление Руководства потребует значительных ресурсов, и МРГСЦ не хотела бы следовать этим курсом, если нет широкого консенсуса в отношении желательности проведения обновления.

(b) Следует ли стремиться к разработке директивных рекомендаций в обновленной версии, там, где это возможно и целесообразно? Какие области будут наиболее подходящими для директивных рекомендаций?

(c) Есть ли конкретные темы, которые следует рассмотреть в обновленной версии? Это могут быть темы уже затронутые в руководстве, но требующие лучших объяснений; или темы, не включенные в версию 2004 года.

(d) Сколько теоретического материала должно быть включено в обновленную версию руководства, и как его следует преподнести? Руководство по ИПЦ 2004 года включает некоторые в основном практические главы (главы 4-13) и некоторые в основном теоретические главы (главы 15-23). Должна ли быть сохранена

такая структура, или, следует, например, включать теоретический материал только в соответствующие главы?

(е) Если будет решено проводить обновление, согласны ли вы, что МРГСЦ должно организовать эту работу путем создания ТЭГ-ИПЦ?

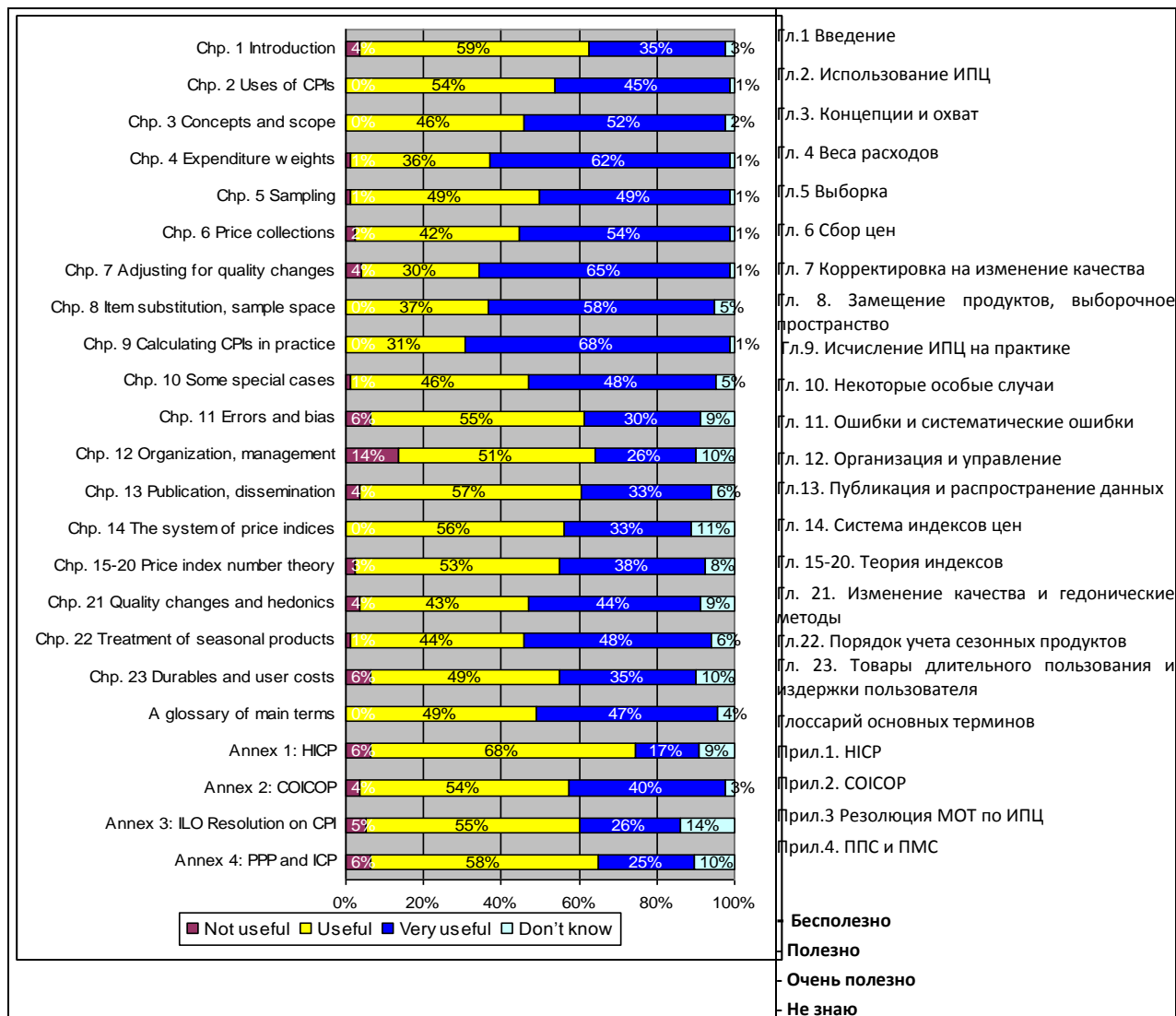
25. Комментарии по другим вопросам в равной степени приветствуются и поощряются.

26. Письменные замечания и предложения должны быть отправлены по адресу STDPricesForEver@oecd.org.

Приложение I

Рисунок 1

Насколько полезными считаете вы главы руководства?



1. Респондентов также попросили предложить темы, которые должны быть включены в будущие версии руководства и/или рассмотрены в дополнительных справочниках. Были предоставлены следующие предложения:

- a) Чистые индексы цен;
- b) Измерение базовой инфляции;
- c) Индексы цен на рынке жилья ;
- d) Страхование;
- e) Точность расчета ИПЦ и связанные вопросы по выборке / статистике;

- f) Построение весов расходов и их качество;
- g) Проведение ОБДХ с использованием дневников;
- h) Использование гедонических методов корректировки цен на качество;
- i) Метод агрегирования, выбор формулы расчета элементарных индексов;
- j) Показатели качества ИПЦ;
- k) Интеграция ПМС и ИПЦ;
- l) Обзор необходимых шагов для расчета ИПЦ;
- m) Более подробное обсуждение того, как организовать инициацию цен и как получить релевантные ценовые наблюдения, основанные на подробных спецификациях;
- n) Использование индекса в качестве дефлятора и краткосрочного показателя;
- o) Обстоятельства, при которых неслучайная выборка может быть полезна;
- p) Пример определения оптимального размера выборки и оценки дисперсии выборки;
- q) Связь между выборкой и корректировкой на качество;
- r) Фиксированные и переменные веса;
- s) Примеры порядка учета конкретных продуктов, таких как мобильные телефоны и услуги;
- t) Новые методы сбора данных, использование данных сканирования и организационные и управленческие аспекты, связанные с этими новыми методами;
- u) Дополнительные детали о различиях между временем приобретения, временем оплаты и временем потребления услуги;
- v) Порядок учета сниженных цен (например купить 2 получить 1 бесплатно, купоны на скидку, специальные скидки в непиковые часы);
- w) Примеры изменений цен на товары и услуги, ранее предоставлявшиеся бесплатно;
- x) Мониторинг изменений цен в параллельных рынках (легальных и нелегальных), контролируемые или субсидированные цены;
- y) Более подробная информация об увязке временных рядов.