

Совместное совещание ЕЭК/МОТ по
индексам потребительских цен
(Женева, 26-28 мая 2014 года)

Методологические основы измерения базовой инфляции в государствах-членах Содружества Независимых Государств (СНГ)

Записка Межгосударственного статистического комитета Содружества Независимых Государств (Статкомитет СНГ)

Резюме

В настоящем документе приводится информация о методологических основах расчета базовой инфляции статистическими службами государств-членов Содружества Независимых Государств (СНГ). В докладе описаны как общие подходы при расчете базовой инфляции, так и отдельные особенности ее определения в практике национальных статистических служб стран СНГ.

Введение

В настоящее время статистика цен располагает достаточно представительной системой показателей, отражающих ценовую ситуацию на потребительском рынке. Основным показателем в этой системе является индекс потребительских цен (ИПЦ).

Учитывая, что индекс потребительских цен не является универсальным показателем, который можно применять для характеристики отдельных факторов влияния изменения цен на благосостояние населения и экономику страны, разработана система дополнительных индексов цен, позволяющая получать ответы на конкретные вопросы о динамике цен на потребительском рынке.

Для исключения возможностей использования тех или иных индексов цен не по целям, для которых они были разработаны, каждый индекс цен должен иметь соответствующее наименование. При этом наименования индексов цен должны соответствовать терминологии, принятой в мировой статистической практике, что позволяет исключить неправильную интерпретацию отдельных индексов цен, их межстрановую сопоставимость и, как следствие, введение в заблуждение пользователей статистической информации.

1. Базовая инфляция в системе индексов потребительских цен

Статистика цен в странах Содружества развивается как системная модель, основанная на единых методологических принципах, ориентированная, в первую очередь, на удовлетворение потребностей пользователей, в то же время направленная на применение международных стандартов, и обеспечивающая статистической информацией, используемой в экономическом анализе и прогнозе. Методологической основой статистики потребительских цен служит «Руководство по индексу потребительских цен: теория и практика» (издано Международной организацией труда, Международным Валютным Фондом, Организацией экономического сотрудничества и развития, Статистическим бюро Европейских сообществ, Европейской экономической комиссией, Организацией Объединенных Наций, Всемирным банком, 2007 год), адаптированное с учетом особенностей экономик стран СНГ.

В настоящее время в большинстве стран СНГ создана и достаточно успешно развивается система показателей, характеризующая динамику цен на потребительских рынках отдельных стран Содружества Независимых Государств.

Такая система включает в себя, помимо индекса потребительских цен в целом, дополнительные групповые индексы цен. В частности, для более детального изучения динамики потребительских цен разрабатываются индекс потребительских цен на товары, индекс потребительских цен на продовольственные товары, индекс потребительских цен на непродовольственные товары, индекс потребительских цен на услуги, система других (более дезагрегированных), индексов цен.

Наряду с вышеназванными видами групповых индексов цен осуществляется построение **базового индекса потребительских цен (БИПЦ) или базовой инфляции.**

Кроме того, осуществляется расчет индекса потребительских цен на товары и услуги населению, не вошедшие в перечень товаров и услуг, используемый при расчете базовой инфляции.

Индекс потребительских цен (ИПЦ) характеризует изменение во времени общего уровня цен на товары и услуги, приобретаемые населением для непроизводственного потребления. Он измеряет отношение стоимости фиксированного набора товаров и услуг в ценах текущего периода к его стоимости в ценах предыдущего (базисного) периода.

В отличие от ИПЦ базовая инфляция (БИПЦ), являясь одним из составляющих индекса потребительских цен (ИПЦ), исключает краткосрочные неравномерные изменения цен под влиянием отдельных факторов, которые носят административный, событийный, а также сезонный характер.

Показатель базовой инфляции дает возможность оценить инфляционную динамику с минимизацией эффектов шоков предложения, сезонных колебаний цен, их административного регулирования на отдельные товары.

Среди наиболее известных методов расчета базовой инфляции можно отметить наиболее распространенные, некоторые из которых используют отдельные страны СНГ. Эти индексы цен используются, как дополнительные к официально применяемым в статистической практике:

- метод исключения переменного перечня товаров (услуг)-представителей;
- метод исключения постоянного перечня товаров (услуг)-представителей;
- метод текущего среднего;
- метод усеченного среднего;
- метод медианной инфляции и др.

В странах СНГ базовая инфляция рассчитывается большинством национальных статистических служб. Среди известных методов расчета базовой инфляции большинством национальных статистических служб стран СНГ был избран метод исключения из индекса потребительских цен постоянного перечня товаров (услуг) -представителей. Применяемая

методология в основном базируется на исключении сезонных товаров и услуг, цены на которые административно регулируются, а также бензина и отдельных видов топлива. Этот метод является одним из традиционных в мировой статистической практике. Его преимуществами являются возможность обеспечения сопоставления временных рядов индексов цен, а также их доступность для понимания общественностью.

В то же время в некоторых странах Европы, учитывая особенности жизни населения, при определении базовой инфляции исключаются платежи по ипотечным кредитам, за энергоресурсы и большая часть расходов, связанных с владением жильём.

2. Основные методологические принципы расчета базовой инфляции в государствах-членах СНГ

Целью расчета показателя базовой инфляции является выявление наиболее устойчивой динамики цен, не подверженной резким изменениям на потребительском рынке под влиянием спроса и предложения товаров и услуг, влиянию сезонного фактора, а также административному воздействию органов власти на процессы ценообразования.

К показателю базовой инфляции применяются те же требования, как и к другим статистическим показателям. Базовая инфляция должна быть максимально информативна, иметь стабильную методологию на определенном длительном периоде времени, ее расчеты необходимо проводить одновременно со всей системой индексов потребительских цен и они должны базироваться на одной и той же первичной информационной базе.

Базовая инфляция должна быть в идеале несмещенной относительно ИПЦ на среднесрочных и долгосрочных временных интервалах. Если средний темп базовой инфляции сильно отличается от официальной инфляции на большом временном промежутке, то это означает, что не только временные шоки, но и часть тренда были отфильтрованы.

Таким образом, мера базовой инфляции может некорректно предоставлять информацию для целей монетарной политики. Кроме этого, существенные и долгосрочные различия между значениями показателей базовой и официальной инфляции могут привести к потере доверия экономических

агентов к мере базовой инфляции из-за психологических эффектов, как индикатору инфляционной динамики, даже если смещение предсказуемо.

Построение базовой инфляции основывается на следующих основных этапах:

- формирование перечня товаров (услуг) - представителей;
- формирование структуры весов;
- расчет базовой инфляции.

Расчет базовой инфляция (БИПЦ) осуществляется на основании набора потребительских товаров и услуг, используемого для построения сводного индекса потребительских цен за исключением отдельных товарных групп и видов товаров и услуг, цены на которые в основной массе регулируются, а также в значительной степени подвержены воздействию сезонного фактора.

Исходя из вышеперечисленных критериев, из общего перечня **продовольственных товаров** исключается, как правило, плодоовощная продукция, так как колебания цен на нее имеют ярко выраженный сезонный характер и в течение всего года существенно влияют на индекс потребительских цен (ИПЦ), как в сторону его понижения, так и повышения.

Из группы **непродовольственных товаров** в расчет базовой инфляции не включается топливо (включая бензин), так как динамика цен на отдельные его виды, помимо сезонного фактора, подвержена административному воздействию.

Из группы **платных услуг населению** исключаются те их виды, формирование цен на которые осуществляется, как правило, под влиянием административных решений органов власти (отдельные услуги пассажирского транспорта, услуги связи, практически все виды жилищно-коммунальных услуг, отдельные виды услуг правового характера, банков, ритуальные услуги и др.). При этом в каждой стране такой перечень может отличаться с учетом ряда факторов как экономического, так и социального характера

Следует заметить, что в список наиболее волатильных и сезонных товаров и услуг всегда попадают овощи и фрукты и, за редким исключением, топливо и электроэнергия. Для значительного количества стран топливо и электроэнергия являются товарами, цены на которые регулируются. Таким

образом, можно выделить наиболее популярные товары и услуги, исключаемые из корзины ИПЦ при расчете базовой инфляции в порядке убывания популярности:

- продукты питания (в особенности овощи и фрукты);
- услуги, цены на которые подвержены административному воздействию;
- топливо.

Даже при наличии доминирующей методики расчета базовой инфляции в странах СНГ, существуют различия в деталях реализации данного подхода, что связано с особенностями экономики, уровнем вмешательства государства в процесс формирования цен в отдельных странах.

При этом основным принципиальным условием расчета базовой инфляции является разработка постоянного перечня товаров и услуг, влияние изменения цен на которые ежемесячно исключаются из официального индекса потребительских цен (ИПЦ).

Ниже приведена краткая характеристика наборов товаров и услуг, участвующих в расчетах базовой инфляции отдельных национальных статистических служб стран СНГ (на основе опубликованных методологических пояснений по расчету базовой инфляции).

Страна	Методологические принципы расчёта базовой инфляции (БИПЦ)
Азербайджан	Рассчитывается методом исключений сезонных товаров и услуг, цены на которые административно регулируются (коммунальные платежи, услуги транспорта, связи, банковские услуги и др.), топливо.
Армения	Рассчитывается методом исключения товаров, цены на которые выросли на мировых рынках, или рост цен был обусловлен погодными условиями (например, в отдельные годы расчет проводился с исключением цен на коммунальные услуги, или без сельскохозяйственных продуктов, рост цен на которые был результатом плохой погоды).

	Методологические принципы расчёта базовой инфляции (БИПЦ)
Беларусь	<p>Рассчитывается методом исключения некоторых продуктов питания, овощей, фруктов, табачных изделий, отдельных социально значимых лекарственных средств, бензина автомобильного, топлива дизельного, услуг жилищно-коммунального хозяйства, медицинских услуг, почтовой связи, абонентной платы за основной телефон, услуг высшего образования, ритуальных услуг, расходов по содержанию детей в дошкольных учреждениях и др.</p>
Казахстан	<p>Рассчитывается методами исключения из фиксированного перечня товаров (услуг) ИПЦ отдельных его составляющих (фрукты и овощи, бензин и уголь, дизельное топливо, жилищно-коммунальные услуги, железнодорожный транспорт, связь,). Одновременно рассчитывается базовая инфляция с использованием метода исключения ценовых изменений из ранжированного ряда составляющих ИПЦ (по пять максимальных и минимальных, по восемь процентов максимальных и минимальных, все, кроме одного, находящегося в середине ряда). Эти методы применяются для аналитических и прогнозных целей. Применение рассмотренных методов, реализуемых в комплексе, образуют эффективную систему показателей, отражающих монетарное «поведение» инфляции.</p>
Кыргызстан	<p>Из группы «Пищевые продукты и безалкогольные напитки» исключаются молоко и плодоовощная продукция, цены на которые подвержены влиянию сезонного фактора, а также сахар. Из группы «Алкобольные напитки и табачные изделия» исключаются отдельные виды алкогольных напитков и табачных изделий, динамика цен на которые подвержена административному воздействию. Из группы непродовольственных товаров и услуг исключаются горюче-смазочные материалы, отдельные виды материалов для содержания и ремонта жилых помещений, электроэнергия, газ и прочие виды топлива, услуги пассажирского транспорта, связи и другие услуги, цены на которые регулируются.</p>

	Методологические принципы расчёта базовой инфляции (БИПЦ)
Россия	Расчёт производится методом простых исключений - исключаются плодоовощная продукция, топливо (включая бензин), услуги, формирование цен на которые осуществляется по решению соответствующих органов власти (отдельные услуги пассажирского транспорта, услуги связи, банков, правового характера, ритуальные услуги).
Таджикистан	Рассчитывается методом исключений сезонных продуктов, коммунальных платежей, услуг транспорта, ритуальных услуг и др., топлива.
Туркменистан	Данные и методология не публикуются.
Узбекистан	Данные и методология не публикуются.
Украина	Используется метод исключения из индекса потребительских цен постоянного перечня товаров (услуг)-представителей. Из перечня исключаются сезонные товары, продукты питания, подвергнутые интенсивной обработке, услуги, цены на которые административно регулируются.

В качестве весов для построения базовой инфляции используется структура потребительских расходов населения, разработанная на основе обследования бюджетов домашних хозяйств за базовый (в большинстве стран – предыдущий) год с исключением весов тех компонентов набора товаров и услуг, которые не участвуют в указанном расчете. Структура потребительских расходов домашних хозяйств отражает распределение перечня статей по видам использования в заданный временной период. При этом нормализация взвешивания осуществляется таким образом, чтобы сумма компонентов при включении в расчет показателя базовой инфляции должна составлять также 1 (или 100%). В результате такой процедуры каждому наименованию товаров (услуг), изменение цен на которые участвуют в расчетах базовой инфляции, придается дополнительный вес.

Расчет базовой инфляции осуществляется, как и расчет ИПЦ в целом, в соответствии с **формулой Ласпейреса к предыдущему месяцу:**

$$I_{t/t-1} = \frac{\sum_{j=1}^n p_{j,o} q_{j,0} * i_{j,t/d}}{\sum_{j=1}^n p_{j,0} q_{j,0} * i_{j,t-1/d}}$$

где:

- $I_{t/t-1}$ – базовый индекс потребительских цен и тарифов по группе товаров (услуг);
- $p_{j,o} q_{j,o}$ – доля расходов домашних хозяйств на приобретение товара (услуги)-представителя (вес базисного периода);
- $i_{j,t/d}$ – индекс цен (тарифов) по товару (услуге)-представителю отчетного месяца к декабрю предыдущего года;
- $i_{j,t-1/d}$ – индекс цен (тарифов) по товару (услуге)-представителю предыдущего месяца к декабрю предыдущего года;
- t – текущий период;
- $t - 1$ – предыдущий период;
- n – количество товаров (услуг).

3. Заключение

Использование базовой инфляции в качестве операционного индикатора для проведения монетарной политики накладывает серьезные ограничения на методику расчета соответствующей меры инфляции.

Информация о базовой инфляции должна быть доступна не позднее опубликования данных об официальном индексе потребительских цен. Методика расчета базовой инфляции должна позволять оперативно и достоверно предоставлять информацию об инфляционной динамике. Таким образом, метод расчета базовой инфляции должен быть простым и достоверным. Своевременность также важна при использовании базовой инфляции для объяснения монетарной политики экономическим агентам. Базовая инфляции на основе метода исключения может быть рассчитана одновременно с ИПЦ, что, в частности, и определяет приоритет данной методики.

Базовая инфляция в году Т в стране N

прирост, в процентах

	К предыдущему месяцу					
	июль	август	сентябрь	октябрь	ноябрь	декабрь
Индекс потребительских цен	0,17	0,24	0,19	0,27	0,52	0,66
Базовая инфляция без учета роста цен на:						
фрукты и овощи, бензин и уголь	0,21	0,34	0,44	0,34	0,48	0,61
фрукты и овощи	0,20	0,34	0,43	0,40	0,48	0,61
фрукты и овощи, жилищно-коммунальные услуги, железнодорожный транспорт, связь, бензин, дизельное топливо и уголь	0,21	0,29	0,54	0,41	0,49	0,63
Базовая инфляция исключая ценовые изменения:						
по пять максимальных и минимальных	0,15	0,21	0,26	0,26	0,40	0,66
по восемь процентов максимальных и минимальных	0,14	0,19	0,23	0,24	0,34	0,49
все, кроме одного находящегося в середине ряда	0,03	0,10	0,14	0,16	0,22	0,36