

Distr.
GENERAL

CES/AC.49/1999/20
26 August 1999

RUSSIAN
Original: FRENCH

**СТАТИСТИЧЕСКАЯ КОМИССИЯ и
ЕВРОПЕЙСКАЯ ЭКОНОМИЧЕСКАЯ
КОМИССИЯ**

**МЕЖДУНАРОДНАЯ ОРГАНИЗАЦИЯ
ТРУДА**

КОНФЕРЕНЦИЯ ЕВРОПЕЙСКИХ СТАТИСТИКОВ

Совещание по индексам потребительских цен
(Женева, 3-5 ноября 1999 года)

**ПЕРЕСМОТР ШВЕЙЦАРСКОГО ИНДЕКСА ПОТРЕБИТЕЛЬСКИХ ЦЕН 2000 ГОДА:
ОСНОВНЫЕ МЕТОДОЛОГИЧЕСКИЕ И ТЕХНИЧЕСКИЕ ИЗМЕНЕНИЯ**

Документ представлен Федеральным статистическим управлением
Швейцарии*

Резюме

В настоящее время проводится полный пересмотр швейцарского индекса потребительских цен (ИПЦ). Его использование начнется с новой базы сравнения в 2000 году. Параллельно с анализом концептуальных и технических принципов ведется тщательное изучение целей ИПЦ с уделением повышенного внимания потребностям пользователей. Нами была избрана концепция построения модульной системы индексов, состоящей из центрального модуля (ИПЦ 2000) и дополнительных модулей. Что касается ИПЦ 2000, то для его расчета мы будем использовать формулы цепного индекса Ласпейреса и среднего геометрического на уровне базисного агрегирования. Кроме того, существенно будет усовершенствована система регистрации цен. Мы планируем производить расчет следующих дополнительных модулей: индекс тарифов взносов по страхованию на случай болезни, социально-экономических индексов, согласованного индекса потребительских цен (СИПЦ), а также модулей, в большей степени ориентированных на концепцию стоимости жизни.

* Автор: г-жа Коринн Бекер, Отдел экономики и цен.

I. Определение целей и общей направленности индекса потребительских цен

Контекст пересмотра 2000 года

1. ИПЦ, в соответствии с используемым до настоящего времени определением, является единственным показателем среднего изменения уровня цен на потребительские товары и услуги в Швейцарии. Будучи инструментом, призванным выполнять различные функции, он должен отвечать одновременно потребностям государственных органов, Национального банка, социальных партнеров, предприятий и общественности. С одной стороны, он используется в качестве базы для определения направленности экономической политики Швейцарии, а с другой стороны, для индексации заработной платы и рентных выплат. Кроме того, он используется в качестве дефлятора номинальных величин.
2. В своей нынешней форме ИПЦ более не обеспечивает оптимального удовлетворения потребностей пользователей, которые четко заявили о своем желании иметь в наличии инструменты измерения роста цен, способные выполнять многочисленные другие функции, чем те, которые призван выполнять индекс потребительских цен. Формула "единого" индекса, используемая до настоящего времени, уже не вызывает единодушного одобрения.
3. Кроме того, проводимая на международном уровне дискуссия по вопросам измерения динамики стоимости жизни позволила четко выявить три основных недостатка индекса потребительских цен и определить присущие ему систематические отклонения. Для выяснения того, применимы ли эти критические замечания также и к швейцарскому ИПЦ, и если да, то в какой степени, Федеральное статистическое управление (ФСУ) поручило трем независимым экспертам провести критический анализ швейцарского ИПЦ и разработать рекомендации, направленные на повышение его общего качества. Выводы этих экспертов в значительной степени согласуются с выводами, сделанными ФСУ.

Цели и общая направленность пересмотра 2000 года

4. С учетом нынешнего контекста необходимо ответить на вопросы о том, следует ли сохранять принцип единственного индекса или, напротив, создать несколько инструментов измерения роста цен, отвечающих требованиям определенных видов использования, должен ли швейцарский индекс потребительских цен являться индексом стоимости жизни, каким образом учесть сформулированные требования при одновременном сохранении транспарентности индекса. В рамках пересмотра 2000 года мы определили следующие основные направления деятельности:
- ФСУ должно продолжать рассчитывать показатель глобального повышения цен, способный удовлетворять потребности различных пользователей (речь, в частности, идет о ИПЦ 2000);
 - его построение должно опираться на концепцию индекса потребительских цен, а не индекса стоимости жизни;

- в целях более полного удовлетворения потребностей пользователей мы планируем создать модульную систему индексов, включающую в себя центральный модуль (ИПЦ 2000) и дополнительные модули. Модульность этой системы будет заключаться в использовании различных схем взвешивания, типовых корзин, формул расчета, а также концепций измерения цен;
- центральный модуль ИПЦ 2000 призван измерять общую динамику повышения цен и опираться на те же общие принципы, что и ИПЦ 1993 года. Однако он будет отличаться от последнего по ряду методологических аспектов: в качестве примеров можно упомянуть о формулах цепного индекса Ласпейреса и среднего геометрического; расширении типовой корзины за счет включения в нее некоторых товаров и услуг, не охватываемых ИПЦ 1993 года, таких, как различные виды страхования частных лиц, финансовые услуги, бывшие в употреблении товары; а также иной методике учета услуг по комплексному туристическому обслуживанию и проживанию;
- дополнительные модули, которые планируется создать, должны отвечать конкретным потребностям и обеспечивать получение значимой дополнительной информации; правила использования этих методов должны быть четко определены и делимитированы.

Таблица 1: Иллюстрация модульной системы индексов и видов ее использования

Модули:	Основные функции:
Индекс потребительских цен (центральный модуль)	Измерение инфляции Дефлирование статистических рядов динамики Индексация
Социально-экономические индексы	Анализ Социальная политика и политика доходов Дефлирование Индексация
Согласованный индекс потребительских цен (Европейского союза)	Международные сопоставления

<i>Индекс стоимости жизни (ограниченный и расширенный)</i>	Анализ Социальная политика (Индексация) <u>1/</u>
--	---

5. Создание такой всесторонней системы не может быть завершено к 2000 году. Целью проводимого в настоящее время пересмотра является скорее определение теоретических и методологических контуров системы и определение применительно к ИПЦ концептуальных изменений, которые должны быть осуществлены.

II. Пересмотр центрального модуля "ИПЦ"

6. Среди многочисленных предлагаемых усовершенствований два заслуживают особого внимания: реформирование системы регистрации цен и изменение методов расчета на верхнем уровне агрегирования и уровне базисного агрегирования.

Система регистрации цен: переход от системы регистрации на уровне коммун к профессиональной системе

7. С мая 1993 года и до настоящего времени регистрация цен осуществляется служащими коммун. Коммуны с учетом низкого уровня оплаты этих операций, малого объема времени, которым располагают их служащие, в целом проделали весьма доброкачественную работу. Недостатки нынешней системы регистрации цен обусловлены в большей степени организацией регистрации в целом, чем качеством работы индивидуальных регистраторов. К наиболее важным недостаткам можно отнести следующие:

- *Данная система страдает отсутствием координации и методологического единообразия между районами регистрации. Методы учета изменений в ассортименте и корректировки на качество являются различными в зависимости от района, в то время как существующие проблемы носят более или менее схожий характер. Даже если регистраторы должны следовать определенным правилам, они обладают определенной свободой действий. Преимущество данного метода заключается в обеспечении гибкой системы регистрации, однако при этом присутствует значительный риск субъективности. Совершенствование системы предусматривает прежде всего согласование практических методов.*

1/ Функция индексации индекса стоимости жизни на настоящий момент носит лишь теоретический характер. Данный модуль планируется в первую очередь использовать в аналитических целях.

- *Процедуры контроля качества, осуществляемые на местах, являются недостаточными.* Ежегодные беседы, проводимые с коммунальными регистраторами, и регулярные телефонные контакты с ними не позволяют обеспечить требуемый уровень качества. Эти процедуры должны быть интенсифицированы и дополнены проверками на местах.
- *Регистрация цен должна в большей степени осуществляться непосредственно в торговых точках.* В настоящее время определенное число вопросников рассылается по почте, заполняется по телефону или раздается, а затем собирается в торговых точках. Эти методы, даже если и позволяют сэкономить время, являются неадекватными.
- *Обучение регистраторов не носит достаточно интенсивного характера.*

8. Для повышения качества регистрации цен планируется поставить данную систему на более профессиональную основу за счет использования одного из следующих трех вариантов:

- **Вариант 1: "Улучшение существующей системы регистрации цен".** Данный вариант является осуществимым только в том случае, если большинство коммунальных регистраторов четко заявят о своей готовности продолжать данную деятельность, если они согласятся обеспечить требуемый уровень качества и если они будут более строго соблюдать установленные директивы и "правила игры". В свою очередь ФСУ берет на себя все расходы по оплате регистрации цен на уровне коммун.
- **Вариант 2: "Внешний субподряд на регистрацию цен".** Данный вариант предусматривает заключение договора на регистрацию цен с одним из институтов опроса общественного мнения, обладающим опытом в этой области.
- **Вариант 3: "Смешанная система".** Этот последний вариант представляет собой компромисс между двумя предыдущими решениями. Он был разработан по следующей причине: четыре района регистрации цен самостоятельно рассчитывают свои индексы потребительских цен (Базель, Женева, Цюрих и Берн) и желают продолжить сотрудничать с ФЦУ в деле регистрации цен. Данный вариант предусматривает возможность продолжения сотрудничества с этими четырьмя районами, в которых регистрация цен уже поставлена на профессиональную основу, и использовать внешний субподряд для регистрации цен в двенадцати других районах, гарантируя при этом надлежащую координацию деятельности.

9. Все эти три варианта, характеризующиеся различными уровнями качества и объемом расходов, призваны существенно повысить качество результатов регистрации цен. Вариант "внешнего субподряда", несомненно, является решением, которое обладает наибольшим и преимуществами в силу возможности делегирования ряда функций, таких, как подготовка необходимых кадров (частично), контроль качества и обработка данных (ввод и

кодирование). В то же время данный вариант является, без всякого сомнения, и самым дорогостоящим. При выборе одного из этих трех вариантов необходимо стремиться найти оптимальное соотношение между объемом затрат и уровнем качества.

10. Перед тем как принять решение, нам необходимо дополнительно уточнить некоторые вопросы. На настоящий момент мы еще не можем окончательно определить форму нашей новой системы регистрации цен.

Методы расчета: цепной индекс Ласпейреса и среднее геометрическое

11. Использование этих двух методов расчета позволит скорректировать в определенной степени вызванное замещением систематическое отклонение как внутри категорий расходов, так и между ними.

12. **Формула среднего геометрического** по сравнению с другими методами расчета, используемыми для базисного агрегирования и параллельно для учета замещения на дезагрегированном уровне, обладает следующими двумя дополнительными преимуществами: с одной стороны, она менее чувствительна к крайним значениям и обеспечивает относительную точность расчетов по однородным категориям расходов; с другой стороны, она обладает свойством транзитивности, которое имеет чрезвычайно важное значение в контексте сцепления.

13. Однако применение на практике этого среднего может быть сопряжено с проблемами при измерении некоторых видов деятельности. По сути его свойства и вытекающие из них экономические послышки требуют, чтобы продукты, включенные в определенные категории расходов, являлись взаимозаменяемыми. Хотя в целом швейцарский рынок является конкурентным, либерализация еще не коснулась некоторых сфер деятельности. В частности, речь идет о секторах энергоносителей, здравоохранения, общественного транспорта и почтовых услуг. Эластичность замещения в этих секторах приближается больше к нулю, чем к единице, вследствие чего использование среднего геометрического по этим категориям расходов может привести к занижению роста цен.

14. При расчете индекса по этим категориям расходов мы заменили ныне используемую формулу среднего соотношения цен средним геометрическим и проанализировали различия между полученными результатами. Занижение, вызванное применением среднего геометрического, на практике оказалось весьма малым, даже незначительным. С учетом этого его использование будет расширено на все категории расходов, включенные в состав типовой корзины. При определении структуры типовой корзины на самом подробном уровне мы попытаемся обеспечить максимальную по возможности однородность первичных групп расходов с целью сведения до минимума вероятности занижения.

15. Использование **цепного индекса Ласпейреса**, одной из особенностей которого является ежегодное обновление весов и содержания типовой корзины, позволяет повысить репрезентативность структуры потребления домохозяйств в индексе. Для получения необходимой информации с 2000 года планируется начать проведение ежегодного

обследования доходов и потребления домохозяйств. Помимо улучшения репрезентативности, содержания и весов типовой корзины цепной индекс Ласпейреса позволяет более часто и регулярно проводить замену методологических приемов.

16. К сожалению, цепной индекс Ласпейреса обладает не только преимуществами. К его хорошо известным недостаткам относятся проблемы аддитивности, отхода от концепции чистого изменения цен и риск возникновения систематических отклонений, вызванных циклическими и сезонными колебаниями цен. Однако мы считаем, что ежегодное обновление содержания типовой корзины и структуры весов является одним из важных условий повышения значимости индекса потребительских цен и что в целом преимущества данной формулы значительно перекрывают ее недостатки.

17. Сцепление будет производиться ежегодно в декабре начиная с декабря 2001 года.

III. Определение дополнительных модулей

18. В среднесрочной и долгосрочной перспективе мы планируем производить расчет ряда различных индексов, призванных выполнять конкретные функции: измерение влияния динамики взносов по страхованию на случай болезни на реальные доходы домохозяйств и на стоимость жизни; измерение темпов роста цен для различных групп населения; определение влияния использования "превосходных" формул индексов на темпы инфляции; измерение роста цен в соответствии с правилами расчета Согласованного индекса потребительских цен Европейского союза; определение величины "истинного" индекса стоимости жизни и практических возможностей приближения к нему.

19. Все эти вопросы, несомненно, известны, однако ответы на них не столь уж очевидны. Пояснения, касающиеся большинства из вышеописанных модулей, являются лишь первой попыткой их теоретического определения; до начала их расчета необходимо еще проделать значительный объем работы.

Индекс тарифов взносов по страхованию на случай болезни

20. Взносы по обязательному страхованию на случай болезни представляют собой трансферты домохозяйств органам социального страхования и, следовательно, не относятся к индивидуальному потреблению в соответствии с концепцией национальных счетов. Для общественности и более конкретно рантье, профсоюзов и ассоциаций потребителей такое исключение является непонятным. Действительно, каким образом можно объяснить им причину данного исключения в условиях, когда взносы по обязательному страхованию на случай болезни в последние несколько лет постоянно возрастают, что ведет к сокращению бюджетов домохозяйств и доли доходов, направляемой ими на потребление.

21. Мы всегда выступали и будем выступать против любых изменений, затрагивающих характер индекса потребительских цен. Однако мы считаем, что предоставление

дополнительной информации в форме модуля может являться важным источником данных для измерения реальной покупательной способности получаемых доходов и для формирования политики в области доходов.

22. С учетом этого мы намерены производить расчет индекса тарифов взносов по страхованию на случай болезни, внедрение которого запланировано на 2000 год. Методика использования данного модуля и его увязки с ИПЦ с целью приближения к концепции стоимости жизни будет определена позднее. Это, в частности, будет являться одним из главных компонентов модуля "индекс стоимости жизни с расширенной корзиной".

Социально-экономические индексы

23. Идея, на которую опирается создание этих модулей, заключается в том, что темпы изменения цен являются неодинаковыми для различных групп населения. Некоторые группы домохозяйств характеризуются особой структурой потребления и покупательскими привычками, вследствие чего фактическое повышение цен для них может отличаться от показателя прироста ИПЦ.

24. Расчет социально-экономических индексов требует в идеале определения специфических типовых корзин и схем взвешивания, а также выборки торговых точек и наименований товаров и услуг. На первом этапе мы ограничимся использованием отличной структуры весов, если только она будет значительно отличаться от весов, используемых в центральном модуле. Эти социально-экономические индексы в первую очередь будут касаться рантье и неполных семей.

Модули, рассчитываемые с помощью "превосходных" формул индекса

25. В среднесрочной перспективе планируется приступить к расчету так называемых "превосходных" индексов Торнквиста или Фишера, главным образом в аналитических целях, а также исходя из планов создания в будущем модуля "индекс стоимости жизни". Их расчет может производиться только ретроспективно с учетом того, что эти формулы требуют весов за текущий период.

26. Данный модуль будет отличаться от ИПЦ 2000 только формулами расчета и структурой весов, при том что другие методологические компоненты остаются схожими. Это позволит также определить вызванное замещением систематическое отклонение на верхнем уровне агрегирования.

Согласованный индекс потребительских цен (СИПЦ) Европейского союза

27. Темпы инфляции являются одним из ключевых показателей для оценки нашей конкурентоспособности и проведения валютно-денежной политики Национальным банком

Швейцарии. Хотя Швейцария не входит в состав Европейского союза, она поддерживает с ним весьма тесные отношения. Следовательно, она должна располагать инструментом измерения динамики цен, опирающимся на общие методы и приемы.

28. Фундаментальные различия между швейцарским ИПЦ и СИПЦ касаются уровней географического (обследуемое население) и демографического (учитываемые типы домохозяйств) охвата. СИПЦ опирается на внутреннюю концепцию, в то время как швейцарский ИПЦ - на национальную концепцию. Таким образом, для расчета СИПЦ нам необходимо будет пересмотреть концепцию взвешивания, что потребует внесения следующих изменений:

- включение расходов, осуществляемых резидентным населением за границей
- включение расходов нерезидентов в Швейцарии
- включение потребительских расходов лиц, проживающих в институциональных домохозяйствах (пансионаты, студенческие общежития и т.д.).

29. Методологические и технические изменения, внесенные в центральный модуль ИПЦ 2000, являются первым шагом в направлении согласования. Несмотря на это и помимо расширения охвата, расчет модуля СИПЦ потребует внесения других многочисленных изменений, несомненно, меньших по масштабу, чем пересмотр концепции измерения, но тем не менее довольно значимых, в соответствии с правилами и директивами Евростата. В качестве примеров можно упомянуть о периодичности регистрации цен и методике досчета. По этим причинам и по мотивам финансового характера внедрение СИПЦ не может быть осуществлено ранее 2002-2003 годов.

Модули "индекс стоимости жизни" (ИСЖ)

30. Приближение к концепции стоимости жизни требует, помимо использования "превосходных" формул индекса, измерения цен в соответствии с концепцией потребления и расширения типовой корзины с целью включения расходов, носящих обязательный характер, таких, как взносы по страхованию на случай болезни и косвенные налоги.

31. Мы считаем, что речь следует вести о существовании не единого индекса стоимости жизни, а нескольких таких индексов, каждый из которых опирается на отличную переменную. Для построения этого дополнительного модуля мы отобрали две переменные, а именно расходы на индивидуальное потребление и доходы.

- ИСЖ, опирающийся на концепцию расходов на индивидуальное потребление, призван измерять повышение цен. Его охват является идентичным охвату ИПЦ.

- ИСЖ, опирающийся на концепцию доходов, призван измерять динамику располагаемого дохода домохозяйств. В его охват включены расходы по трансфертам, представленные, в частности, модулем "индекс взносов по страхованию на случай болезни".

32. Построение идеального индекса стоимости жизни, включающего в себя все теоретически необходимые компоненты, не является нашей главной целью. Речь идет скорее о поэтапном приближении к этой концепции, причем первый этап будет заключаться в определении наиболее соответствующего метода для включения взносов по страхованию на случай болезни.

33. В качестве заключения ниже приводится рисунок, иллюстрирующий общую структуру, которая отнюдь не является окончательной, системы, которую мы хотели бы создать, а также основные методологические изменения по каждому модулю.

Рис. 1. Модульная система индексов и основные методологические изменения по каждому модулю

