



Индексы потребительских цен в Германии

Доклад перед чиновниками Государственной
инспекции по контролю за ценами Украины
Семинар Общества InWEnt 6.3.2007 в Бонне
(www.inwent.org)

Структура

1. Национальный индекс потребительских цен

- 1 Основные факты, 2. Детали по организации сбора данных,
3. Детали касательно взвешивания (потребительская корзина)
4. Дискуссия касательно методов (актуальные проблемы)
5. Родственные индексы (ЕНІ, рестораны, Телеком, почтовые сборы)

2. Федеральное и земельное ведомства

Разделение труда между федеральным и земельными правительствами касательно индекса потребительских цен

1. Требования Конституции,
2. Дискуссия касательно реформ (опции) 3. Кооперационная модель

3. Гармонизированный индекс потребительских цен

1. Цель и значение, 2. Принципиальные замечания касательно метода, формулы индекса, 3. Существенные концепции и нормы

Две книги на русском языке

<http://www.von-der-lippe.org/publikationen.php>

Доклад о гармонизированном индексе потребительских цен (ГИПЦ): Текст для скачивания на немецком и английском языках

<http://www.von-der-lippe.org/downloads1.php>

Статьи и презентационные слайды по теме "**Федеральная система официальной статистики**", отдельно рассматриваемая здесь по просьбе участников: файлы для скачивания 3, доклады 9 и 17

1.1 Основные данные касательно национального индекса потребительских цен (ИПЦ) – ч. 1 -

Индексы потребительских цен (ИПЦ)

Национальный ИПЦ

Гармонизированный ИПЦ (ГИПЦ)

Цель	измерение инфляции, компенсационный масштаб (оговорки, согласно которым цены определяются в зависимости от изменений цен на золото), устранение колебаний цен народнохозяйственного баланса
Периодичность	ежемесячно, цены на середину месяца, арендные ставки ежеквартально
Правовые основы	Закон о ценовой статистике, Федеральный закон о статистике, постановления ЕС касательно гармонизированного ИПЦ
Товары и услуги	товары широкого потребления (продукты питания, одежда), аренда жилища, потребительские товары длительного пользования, услуги отечественная концепция (внутренняя, не общегосударственная)
Сбор данных о ценах	560 сборщиков ценовой информации в избранных магазинах, частично также главные статистические данные из других источников
Взвешивание	потребительская корзина посредством опроса домохозяйств; также народнохозяйственный баланс

1.1 Основные данные касательно национального индекса потребительских цен (ИПЦ) – ч. 2 -

Формула

Laspeyres

$$P_{0t}^L = \frac{\sum_i p_{it} q_{i0}}{\sum_i p_{i0} q_{i0}} = \sum_{i=1}^{i=n} \frac{p_{it}}{p_{i0}} \frac{p_{i0} q_{i0}}{\sum_i p_{i0} q_{i0}} = \sum m_{it} g_i$$

Проблемы выбора

Ни на одной из стадий никакого случайного выбора

Веса g_i

Ценовые показатели m_{it}

1. Общины	Все группы, всего 188 общин
2. Единицы сбора данных	Единицей наблюдения является акт покупки, наблюдение ведётся на \approx 40.000 пунктах, которые отчитываются (репрезентативно для всех видов магазинов)
3. Товары Случаи продаж	Потребительская корзина, насчитывающая около 750 позиций Среди них конкретные ценовые представители ежемесячно около 350.000 случаев продаж (цены за штуку) Агрегация посредством элементарных индексов при помощи формулы Laspeyres

1.1 Основные данные касательно национального индекса потребительских цен (ИПЦ) – ч. 3 -

Предыдущие базисные года	1962, 1970, 1976, 1980, 1985, 1991, 1995, 2000
Перерасчеты	с каждым новым базисным годом новая потребительская корзина и переделка выборочных проверок
Другие индексы	ценовые данные также применены для ИПЦ (индекса розничных цен) и ГИПЦ
Структура	перечнем товаров является COICOP
Типы домохозяйств	ранее наряду с индексом потребительских цен для всех частных домохозяйств также индексы для специальных типов домохозяйств →
Регионализация	специальные индексы для некоторых федеральных земель; ранее также отдельные индексы для старых и новых федеральных земель; отсутствие результатов по городам (по решению Федерального конституционного суда)
Публикации, актуальность	результаты: предварительные, окончательные для Федерального правительства; сообщения для прессы, Интернет, FS 17 (R. 7), данные экономической статистики
Точность	расчёт с одним знаком после запятой
Источник ошибок	отбор, корректирование качества

1.1 Основные данные касательно национального индекса потребительских цен (ИПЦ) – ч. 4 -

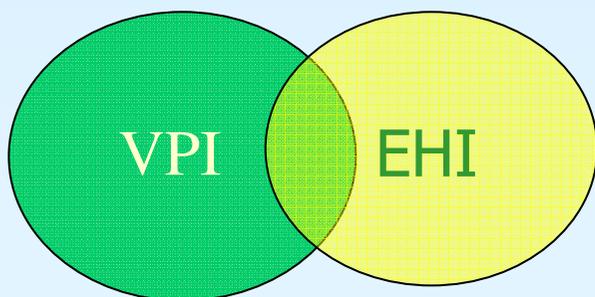
Данные статистики
потребительских цен

ИПЦ

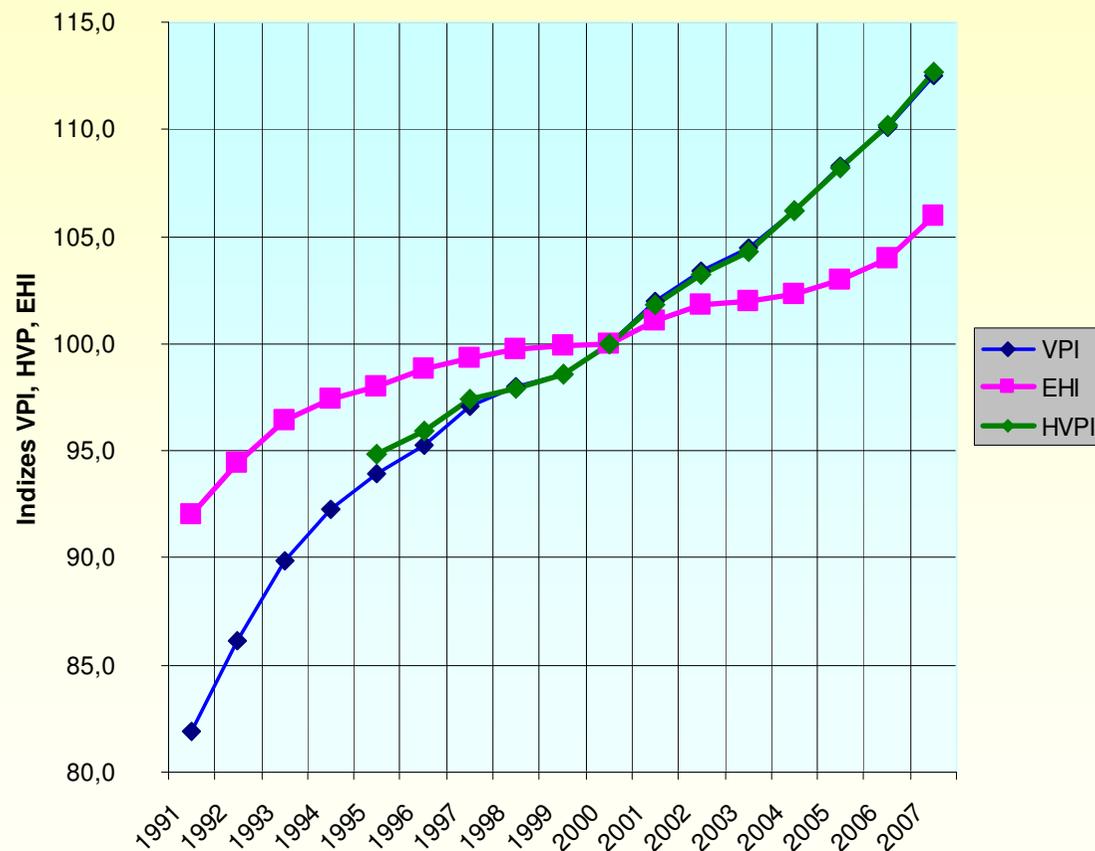
ГИПЦ

ИРЦ

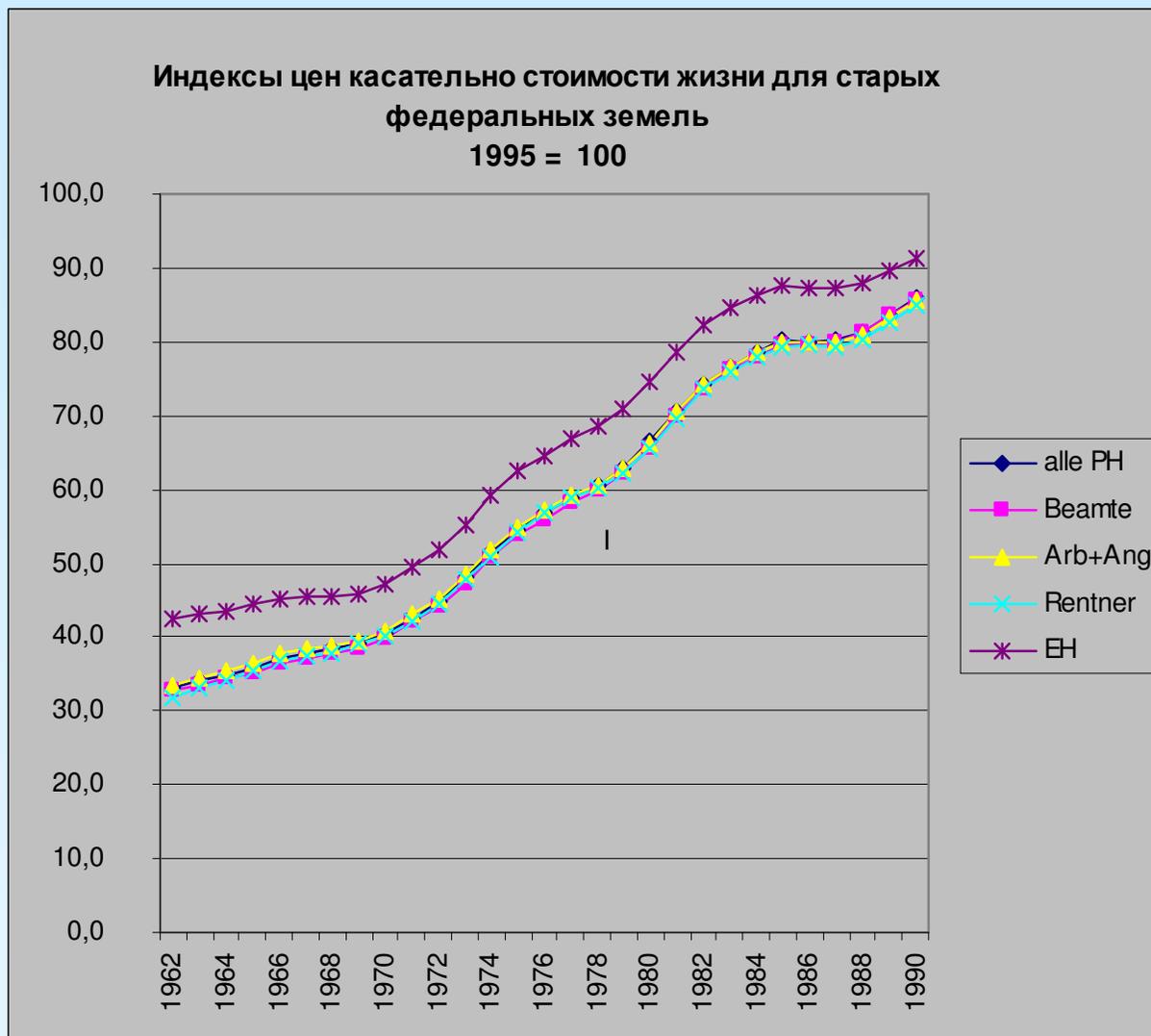
ГИПЦ отличается от ИПЦ
главным образом из-за
неучитывания в
собственности стоимости
аренды жилья



Потребительские цены 2000 = 100 ГИПЦ на другой базе
статистических расчётов



1.1 Основные данные касательно национального индекса потребительских цен (ИПЦ) – ч. 5 -

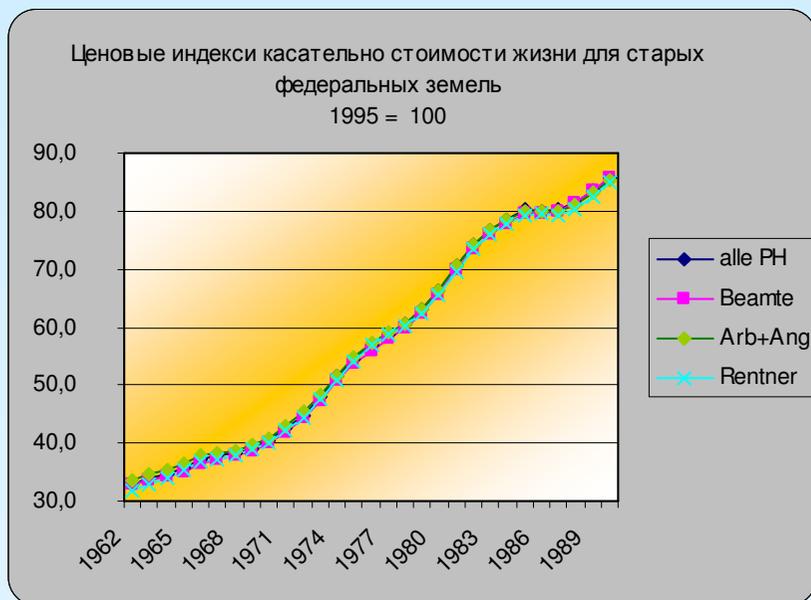


С внедрением индексной системы 2000 = 100 отказались от расчёта ИПЦ для специальных типов домохозяйств и отдельного расчёта для старых и новых федеральных земель

EN (или ENI) индекс розничных цен, фрагмент изображения увеличен →

1.1 Основные данные касательно национального индекса потребительских цен (ИПЦ) – ч. 6 -

Даже с применением иного масштаба отличия лишь незначительные



1.1 Основные данные ч. 7 (классификация индекса согласно COICOP)

COICOP Classification of Individual Consumption by Purpose – Классификация индивидуального потребления по целям

Названия главных групп		Доля в взвешивании
01 Продукты питания	Food, nonalcoholic beverages	103,35
02 Алкоголь, напитки, табак	Alcoholic. bev. and tobacco	36,73
03 Одежда, обувь	Clothing and footwear	55,09
04 Жилище, вода ...	Housing, water, electricity...	302,66
05 Обстановка жилища	Furnishings, household equipm.	68,54
06 Гигиена, забота о здоровье	Health	35,46
07 Транспорт	Transport	138,65
08 Связь	Communication	25,21
09 Свободное время, развлечения	Recreation and culture	110,85
10 Образование	Education	6,66
11 Гостиницы, общественное питание	Restaurant and hotels	46,57
12 Другие товары и услуги	Miscellaneous goods & serv.	70,23

1.2. Детали касательно организации сбора данных

- Сбор данных о ценах касательно 2/3 потребительских расходов децентрализованным образом (земельными ведомствами), касательно 1/3 централизованным образом (позиции Z) около 560 сборщиков данных о ценах
- Ступенчатая система
К (3 крупных городов): 646 позиций, 74% потребительской корзины
G (11 средних городов): 204 позиций, 47% потребительской корзины
A (7 малых городов): 109 позиций, 37% потребительской корзины
- Сборщики данных о ценах заполняют "маятниковые перечни": стремление к чистому сравнению цен и репрезентативности
(постоянная корзина цен, но гибкость, когда определённый магазин или товар отсутствуют) также и корректирование качества как правило децентрализованным образом
- Отдельные сообщения невзвешенным образом усредняются
- Результаты земель взвешенным образом усредняются до федерального результата

1.3. Детали касательно взвешивания -1 -

- Выборочные наблюдения доходов и потребления (EVS)
Текущие обследования домохозяйств (LWR)
Оба типа бюджетного опроса с добровольным предоставлением сведений
Предварительная дифференциация по результатам EVS,
окончательная дифференциация по результатам LWR
- Схема взвешивания актуализуется каждые 5 лет
(дискуссия о цепных индексах)
Веса при HVPI необходимо актуализировать по меньшей мере в отношении цен соответственно в конце года
- Проблема своевременного привлечения новых товаров
- Планирование: взвешивание также и в отраслях предприятий

1.3. Детали касательно взвешивания (опрос домохозяйств) -2 -

	EVS	LWR
Периодичность	каждые 5 лет; 1962/63, 68, 73, 78, 83, 88, 93, 98, 03, 08	ежегодный сбор данных, подвыборка EVS (ранее самостоятельный сбор данных)
Опрошенные домохозяйства	почти 62.000 частных домохозяйств, выборка по группам	почти 8.000 частных домохозяйств (ранее заданные типы домохозяйств)
Признаки	все доходы и расходы, чистый доход домохозяйств, потребительские товары длительного пользования, жилищная ситуация, имущество и долги	
Составные процесса сбора данных	четыре части: вводное интервью и приложение к нему, книга записей домашних расходов (с записями предыдущих подсчетов) и журнал записей уточненных подсчетов	общие данные (соответствует вводному интервью) и книга записей домашних расходов (должна вестись соответственно на протяжении одного квартала) Также и здесь журнал из двух частей
Проведение	организационная и техническая подготовка, а также централизованный оценочный анализ осуществляется Федеральным статистическим ведомством, привлечение домохозяйств и проведение (опрос) осуществляются земельными статистическими ведомствами	

1.4.1 Дискуссия касательно методов (обзор)

- Дальнейшее развитие системы ценовых индексов
Услуги, индекс цен на здания
- Взвешивание по типам магазинов
- Корректирование качества
- Проживание в собственности и учёт арендной платы
собственный дом или квартира, которые используются самим собственником
- Теоретические дискуссии (Boskin, COLI и COGI)
- Реальная инфляция (core inflation)
- Воспринятая (субъективная) инфляция (частота покупок)
- Учёт основных и оборотных средств фирм (asset inflation)
- Региональные сравнения покупательной способности

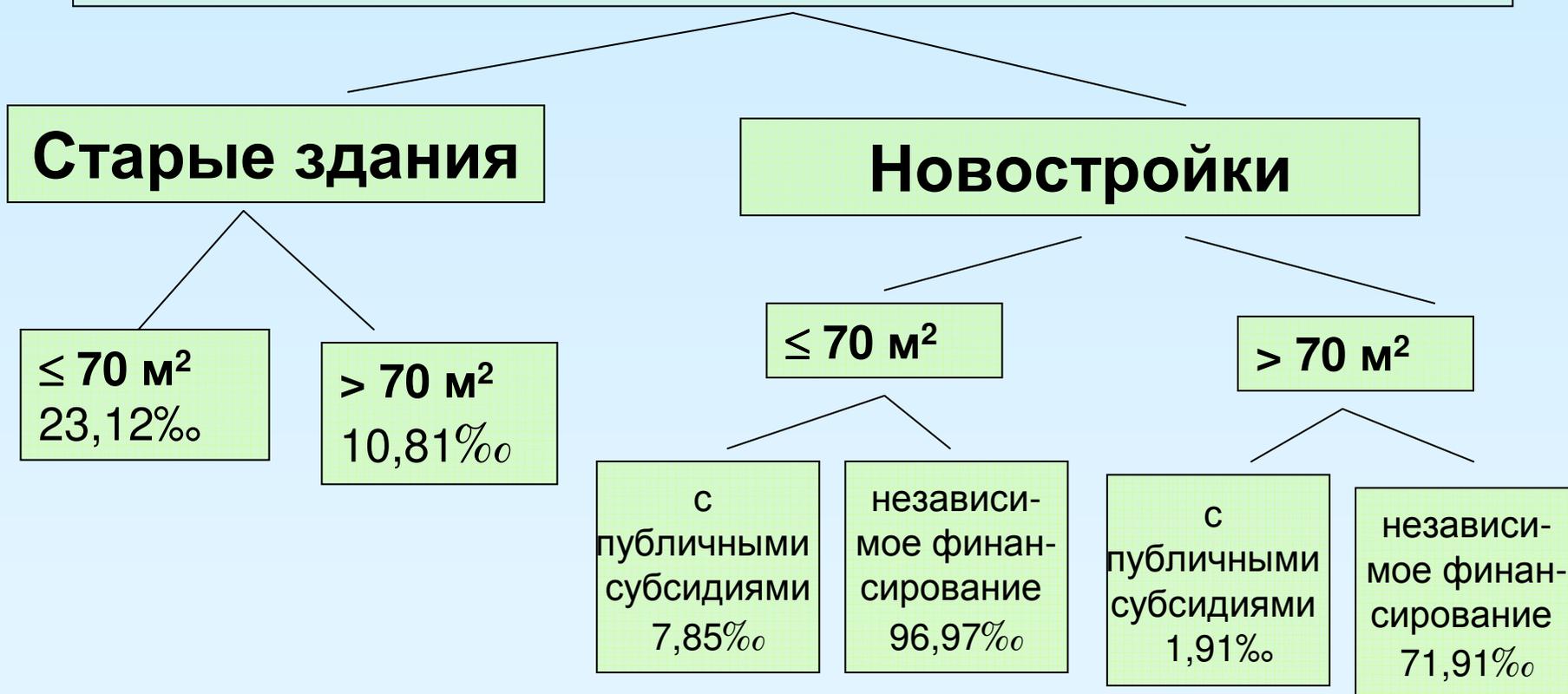
1.4.2 Система индексов Федерального статистического ведомства (ФСВ)

Отрасль экономики	Закупочные цены (Input)	Цены производителей (Output)
Сельское и лесное хозяйство	индекс закупочных цен на средства сельскохозяйственного производства	индекс цен производителей сельскохозяйственной продукции индекс цен производителей продукции лесного хозяйства
Реальный сектор экономики	индекс цен поступления товаров	индекс цен производителей промышленной продукции (в сбыте на отечественном рынке)
Строительная отрасль*		индекс цен на сооружения индекс цен на готовые здания индекс цен на содержание
Торговля, общественное питание и гостиничное хозяйство		индекс оптовых цен индекс розничных цен индекс цен в сфере общественного питания и гостиничного хозяйства
Частные домохозяйства	индекс потребительских цен	(возможные индексы тарифов и заработка)
Внеэкономическая деятельность*	индекс импортных цен, индекс средней стоимости импорта	индекс экспортных цен, индекс средней стоимости экспорта

* собственно функциональное размежевание

Применение данных таблицы индексов квартирной аренды

Типы квартир арендной статистики в ИПЦ



1.5 Другие родственные индексы

- **Индекс потребительских цен (ЕНІ)**
530 рядов цен с ИПЦ, без услуг, дифференцированные по отраслям экономики, весами являются объёмы оборота по результатам опроса предприятий розничной торговли (теперь также включая автосалоны и заправки)
- **Индекс цен для общественного питания и гостиничного хозяйства**
- **Услуги почты**
ежемесячный сбор данных от фирмы "Deutsche Post AG", цены на письма и транспортные услуги (около 80 рядов), централизованный сбор данных в Федеральном статистическом ведомстве, в основном из общедоступных документов
- **Телекоммуникационные услуги**
Опрос 21 фирмы в отрасли телекоммуникации, около 2000 рядов, в основном из общедоступных источников; централизовано в Федеральном статистическом ведомстве
- **Индекс цен производителей услуг**

2.1 Федеральное и земельные ведомства; действующее конституционное право

Основной закон знает четыре формы административной компетенции

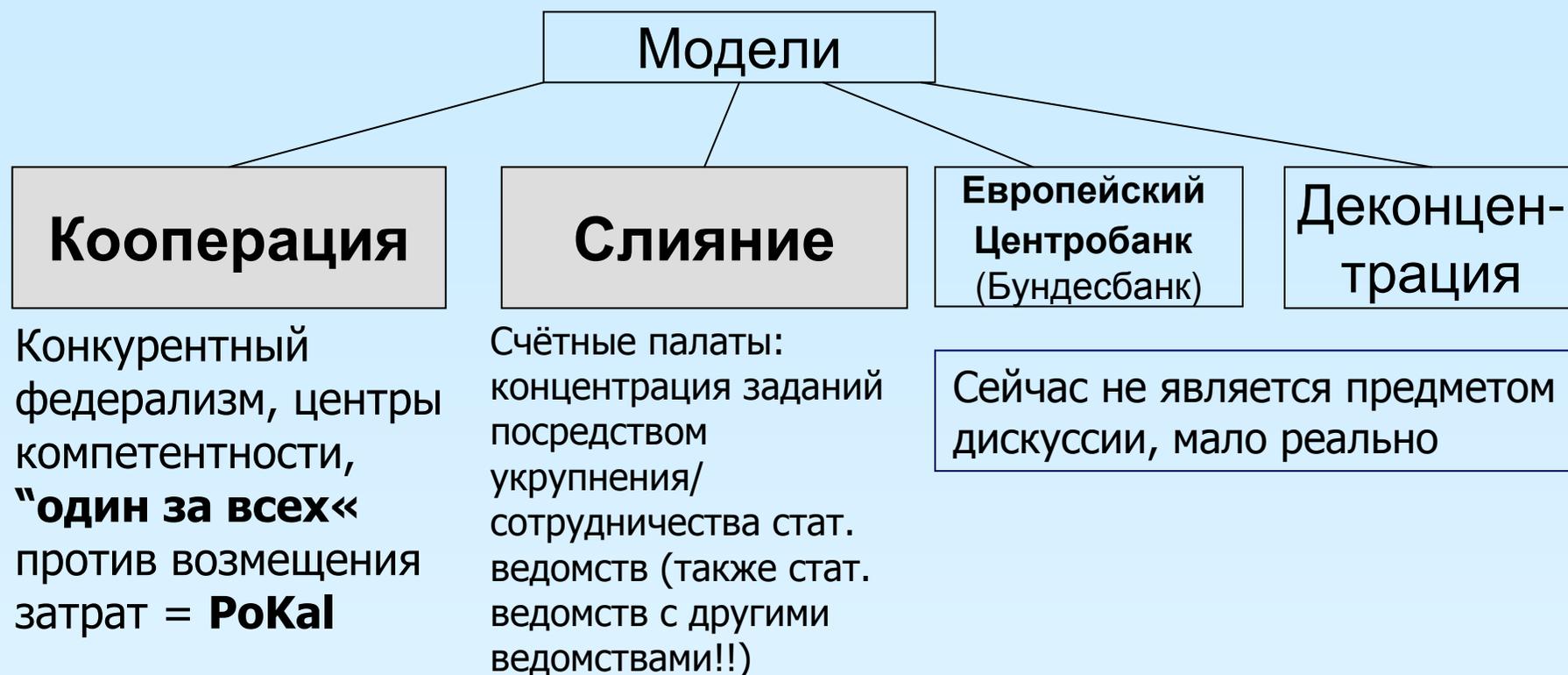
Администрация земель		Федеральная администрация	
собственные полномочия	делегированные полномочия	делегированные полномочия	полномочия в отношении федеральных органов (самоуправление)
LE	LA	BE	BU*
Ст. 30,83,84 Основного закона Статистические ведомства федеральных земель	Ст. 85 Основного закона Федеральное ведомство автомобильного транспорта, автостреды	МИД, Федеральная пограничная служба	Бундесбанк , Федеральное агентство труда

* Публично-правовые организации и заведения; "Statistik Österreich" с 2000 года публично-правовое заведение, более не "центральное ведомство"

LE означает **самостоятельные** земельные ведомства: федеральные законы (статистика для потребностей **Федерального правительства**) "в качестве **собственного дела**"

(а не "по поручению Федерального правительства", как в случае земельных ведомств)

2.2 Опции касательно реализации политики формирования хозяйственного устройства и процессуальные опции



Модель децентрации

в связи с тем, что чисто земельной статистики почти нет, земельные статистические ведомства могли бы стать значительно меньшими (практично ликвидированы)

Два вида разделения труда

		Темы					
Федеральные земли		1	2	3	4	5	6
	A		■				
	B	■	■	■	■	■	■
	C		■				
	D		■				

Идеальный тип земельного статистического ведомства

к этому как модель **слияния** (двух земель, двух ведомств), так и **кооперационная** модель (РоКал) **не** подходит

Двое за всех

2.3 принцип при разделении труда вряд ли ещё можно понять - 2 -

Осуществление сбора данных при составлении статистики **ОПТОВЫХ ЦЕН**

в Гамбурге, Бремене, Сааре, Берлине и Мекленбурге-Передней Померании	Федеральное статистическое ведомство
во всех остальных федеральных землях децентрализованные и централизованные процессы сбора данных при составлении статистики касательно подоходного налога	соответствующее земельное статистическое ведомство

децентрализ. статистика
касательно
подоходного налога
каждые 3 года

централиз. статист.
ежегодник
с 2001 г. (отчетный год)

Этот пример также интересен благодаря существованию общедоступного (микро-) банка данных

3.1 Гармонизированный индекс потребительских цен (ГИПЦ, НИПР) цели

- С 1997 г., до того 1995, 1996 временный индекс
- Целевая функция денежной политики Европейского Центробанка (ЕЦБ) $< 2\%$
принадлежит к Principal European Economic Indicators (PEEI)
- Критерий конвергенции - стабильность уровня цен – для вступления в экономический и валютный союз
На первом плане измерение инфляции. В меньшей степени индекс задуман в качестве меры компенсации,
- Национальные ИПЦ согласно гармонизованным методам (параллельные расчёты, различные агрегации)
все страны Европейского союза (а также Норвегия и Исландия)
Европейский **валютный союз** (зона-евро) – VPI - EWU
Европейский союз (Европейский **союз** в целом) – Европейский ИПЦ
Индекс потребительских цен для Европейского **экономического пространства** – ИПЦ -EWR
- Не общеевропейская потребительская корзина, среднее значение индексов с национальными потребительскими корзинами

3.2 ГИПЦ принципиальные замечания в отношении методики

- Цепной индекс, потребительские корзины, отбор товаров и вес земель являются переменными и актуализируются ежегодно или в текущем порядке
- Не существует общеевропейской потребительской корзины, среднее значение индексов с национальными потребительскими корзинами
- Индекс был внедрён постепенно (сначала временный индекс, текущее расширение сферы, охваченной потреблением)
- Особенности проблемы: страховки, затраты на здравоохранение и образование, туризм
- Все методические вопросы индекса урегулированы при помощи предписаний, обязательных для выполнения

3.3 ГИПЦ важные концепции и нормы – ч. 1* -

A = Регламент Совета (Council Regulation), B = Регламент Комиссии (Commission Regulation)

A 2494/95
23rd Oct.
1995

Основоположный регламент Ради (A) defines aim, comparability; timetable, procedure etc. of harmonization but no details of compilation of indices

B 1749/96 of
9th Sept.
1996

inclusion of **newly significant goods and services** (NSGS), minimum standards for the procedures of **quality adjustment** (for example automatic linking was banned), minimum standards for sampling and for the prices used, formula for **elementary aggregates**
missing observations

B 2454/97 of
10th Dec.
1997

minimum standards for the **quality of HICP weights**

- defines a maximum age of weights (7 years) and,
- requires an annually checking of "critical" weights

* См. Peter v. d. Lippe, *Index Theory and Price Statistics*, 2007, Table 6.1.2

3.3 ГИПЦ важные концепции и нормы – ч. 2 -

A 1688/98 of
20th July 1998

Geographic and population coverage of the HICP, defines use of domestic concept
inclusion of people in institutional households

B 2646/98 of
9th Dec. 1998

Treatment of tariff prices in the HICP; defines obligation of respondents to provide structural information of tariffs and data related to consumption pattern to the NSOs.

B 1617/99 of
23rd July 1999

Treatment of insurances in the HICP; defines use of service charges for calculation of weights and use of gross premiums for compilation of prices

A 2166/99 of
8th Oct. 1999

Treatment of goods and services in the education, health and social protection services in the HICP, decides which reimbursements should be deducted from the "price", how to handle "income related" prices (or reimbursements)

3.3 ГИПЦ важные концепции и нормы – ч. 3 -

B 2602/2000
17th Nov. 2000

Price reductions/discounts (they should be taken into account when they are attributable to the purchase of an individual good/service, non-discriminatory [available to all potential consumers], known to the buyer, claimable and their impact on quantities purchased is substantial)

B1920/2001
28th Sept.
2001

Treatment of Financial Services in the HICP and of prices for services depending on the volume of transactions (service charges proportional to transaction values): prices should be defined as proportions, multiplied by the value of a representative unit transaction; flat rates should be included, interest like charges and interest payment are excluded.

Кроме того, различные "Guidelines", например, касательно обращения с сезонными товарами, акциями распродажи, экстремальными ценами и т.д.

