



Межгосударственный статистический комитет
Содружества Независимых Государств
(Статкомитет СНГ)



Построение внераундовых оценок паритета покупательной способности валют

А.Е.Косарев

Заместитель Председателя Статкомитета СНГ

Совещание статистических служб стран СНГ по национальным счетам
г. Минск
6-7 апреля 2016 г.



Проблема экстраполяции ППС



Оценки паритета покупательной способности валют (ППС) официально рассчитываются для базового года каждого раунда.

Широкий круг пользователей – правительства стран, международные организации, исследовательские круги – остро нуждаются в ежегодных оценках ППС.

Различные международные организации косвенным путем рассчитывают **вне раундовые оценки ППС** для тех лет, для которых отсутствуют результаты официальных раундов. Эти оценки **вменяются странам**.



Основу любой экстраполяции ППС составляет корректировка ППС базового года «0» на соотношение дефляторов в году «t»:

$$PPP_{ext}(t) = PPP(0) * DEF_{nat}(t/0) / DEF_{bas}(t/0)$$

$DEF_{nat}(t/0)$ – дефлятор в национальной валюте, год t относительно года 0

$DEF_{bas}(t/0)$ – дефлятор в базовой валюте, год t относительно года 0



2 подхода к экстраполяции ППС (1 / 2)



1) «СВЕРХУ ВНИЗ»:

- сначала экстраполируется ППС на самом высоком уровне агрегации – ВВП, по соотношению дефляторов ВВП;
- затем ППС для отдельных элементов ВВП, по соотношению соответствующих дефляторов или индексов цен;
- далее ППС для элементов ВВП корректируются таким образом, чтобы сумма этих элементов равнялась ВВП.

достоинства: простота расчета, оперативность; базовый показатель – дефлятор ВВП, в котором уже отражены все изменения в экономике.

недостатки: ???



2) «СНИЗУ ВВЕРХ»:

- сначала экстраполируются ППС для элементов наиболее низкого уровня дезагрегации, по соотношению индексов цен;
- затем суммируются элементы на основе экстраполированных ППС и рассчитывается ППС для ВВП в целом (который, как правило, не совпадает с ППС, рассчитанным для ВВП методом 1).

достоинства: более детальное обоснование экстраполированных ППС.

недостатки: сложность расчета; затруднительно обеспечить необходимое качество всех индексов цен и весов для экстраполяции на низшем уровне.



С момента публикации официальных результатов очередного раунда сопоставлений, в котором **базовым годом становится год «t»**, полученная ранее для него **экстраполяционная оценка ППС утрачивает силу** и заменяется на значение ППС по результатам раунда.

После этого бывшие экстраполяционные оценки ППС для периода **между годом «0» и годом «t»** корректируются на основе интерполяции:

$$PPP_{int}(i) = PPP_{ext}(i) * (PPP(t) / PPP_{ext}(t)) ^ (i/t) \quad i = 1, \dots, t-1$$

$PPP_{int}(i)$ – интерполяционная оценка ППС для года i

$PPP_{ext}(i)$ – экстраполяционная оценка ППС для года i

$PPP(t)$ – официальное значение ППС в году t по итогам раунда сопоставлений



Примеры по странам СНГ



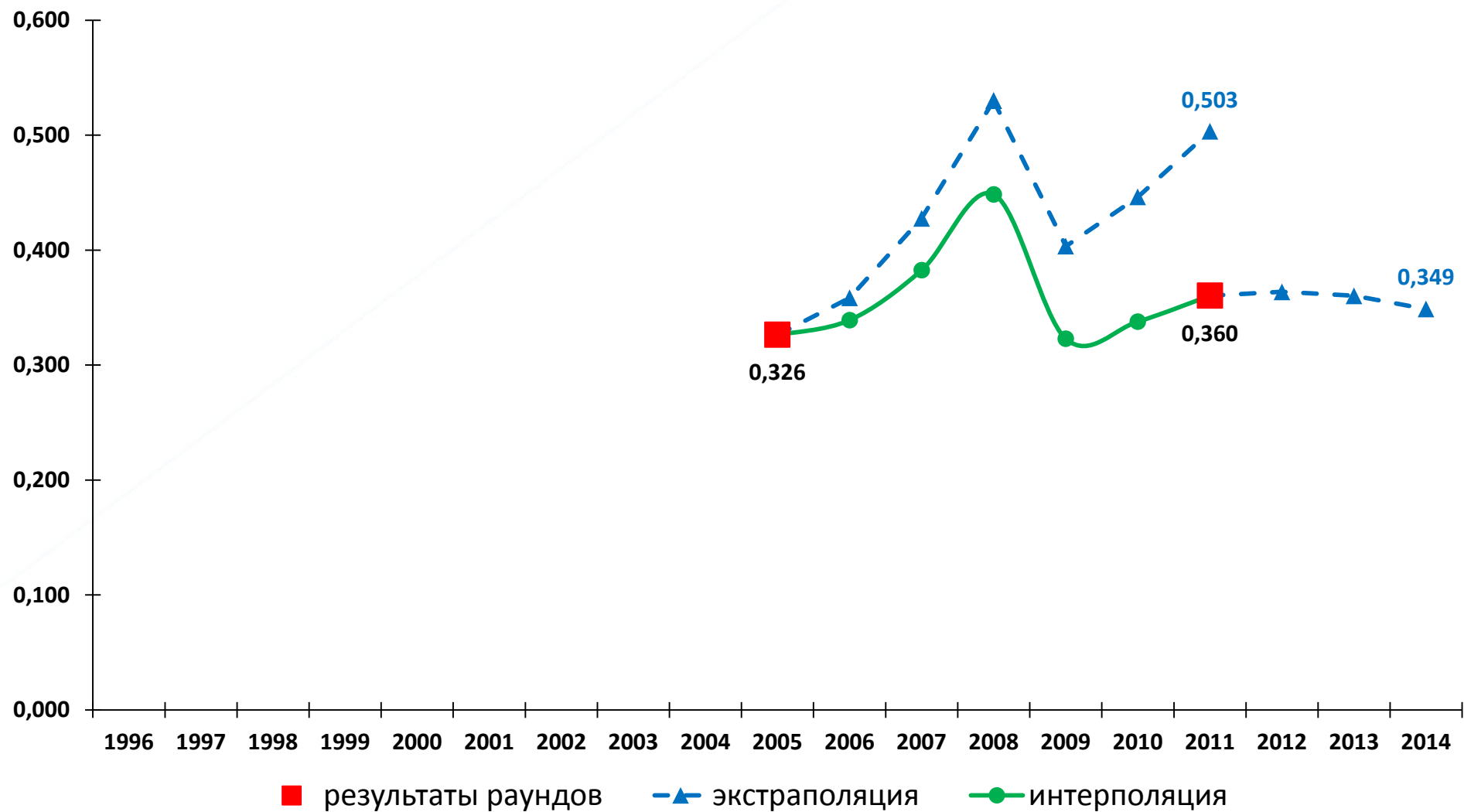
На следующих слайдах представлены примеры экстраполяции и последующей интерполяции ППС для стран СНГ, принимавших участие в международных сопоставлениях.

Расчеты выполнены на основе официальных опубликованных данных.

Экстраполяционные оценки рассчитаны по методу 1 «сверху вниз».

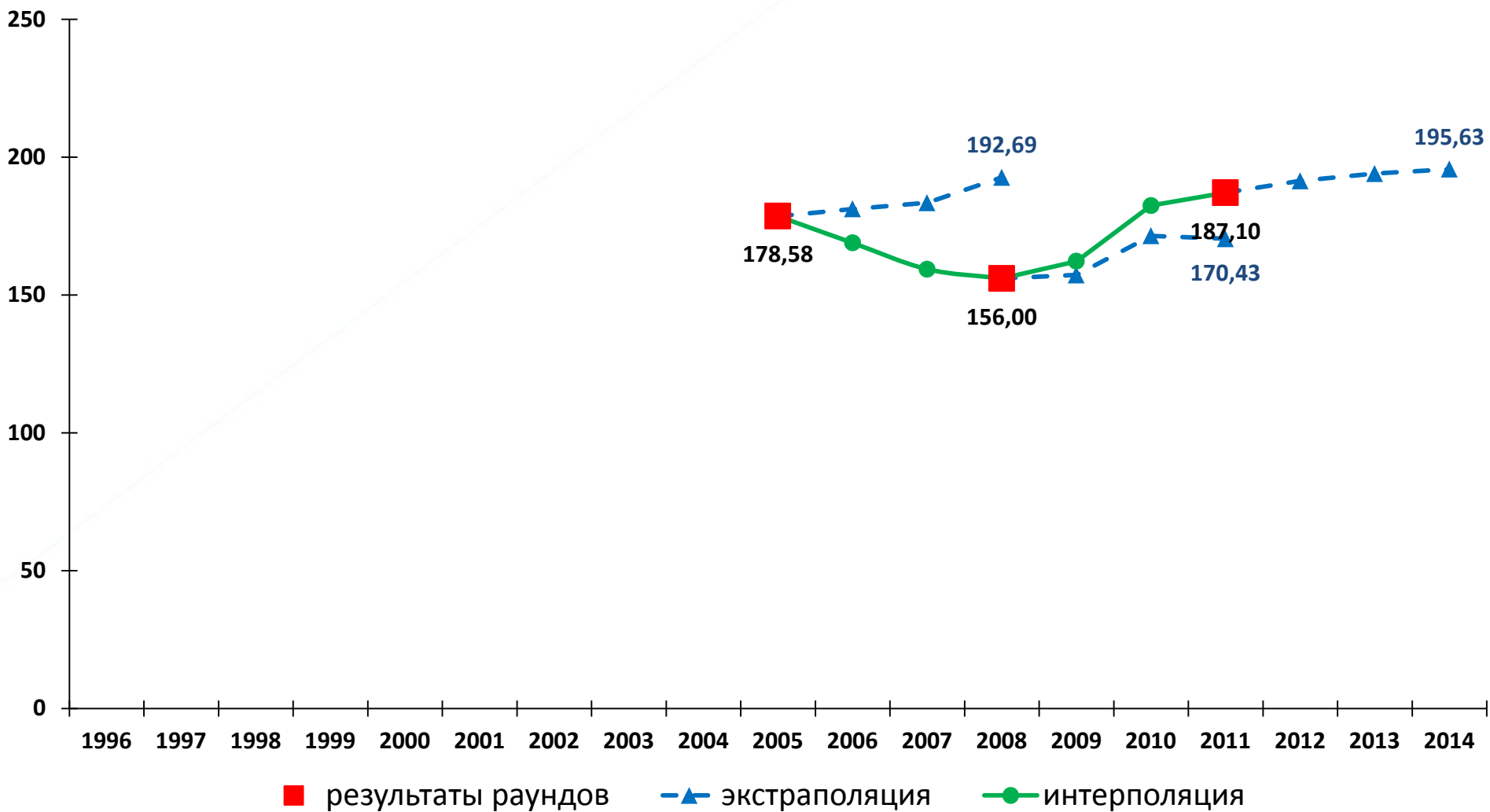


ППС AZN/USD



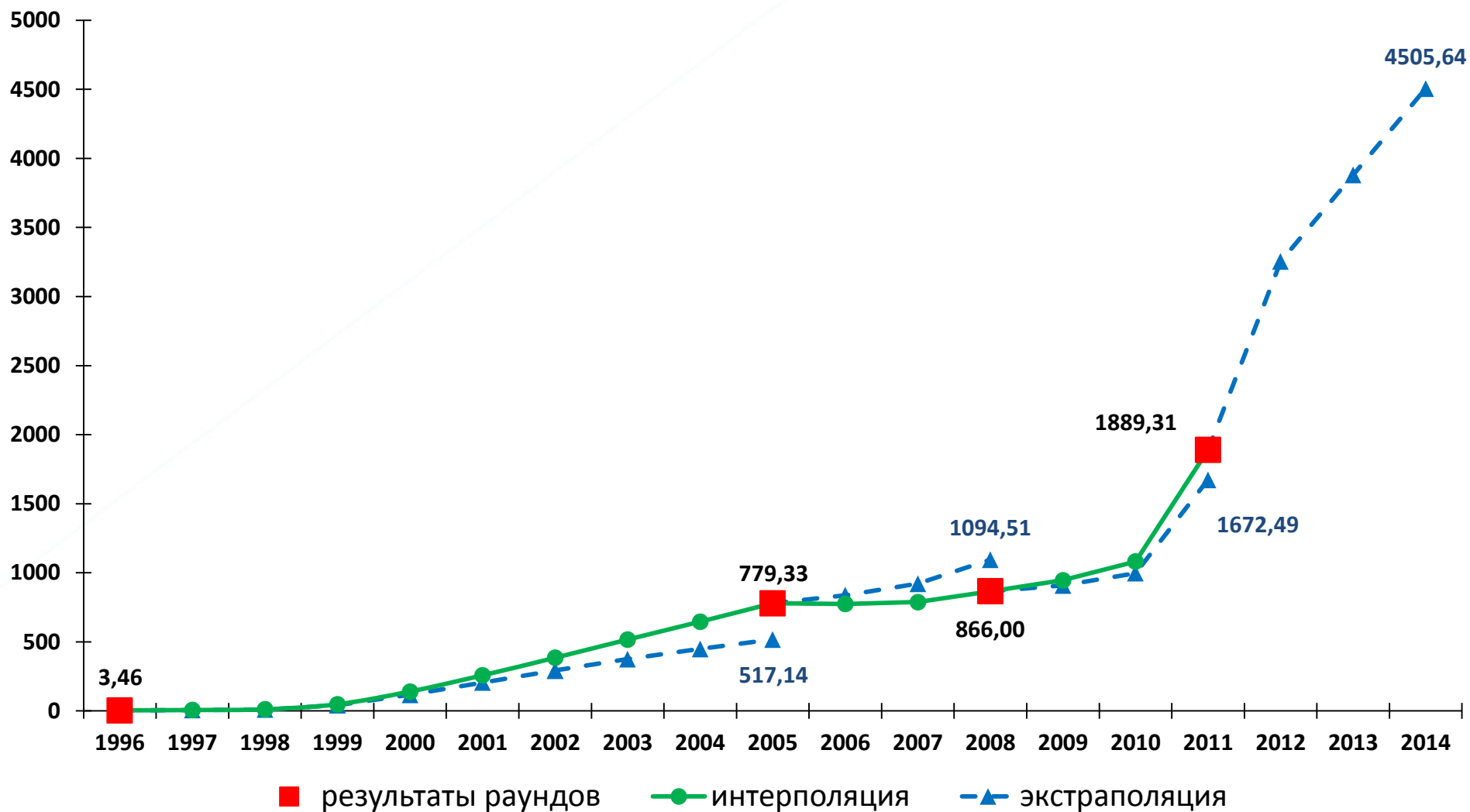


ППС AMD/USD



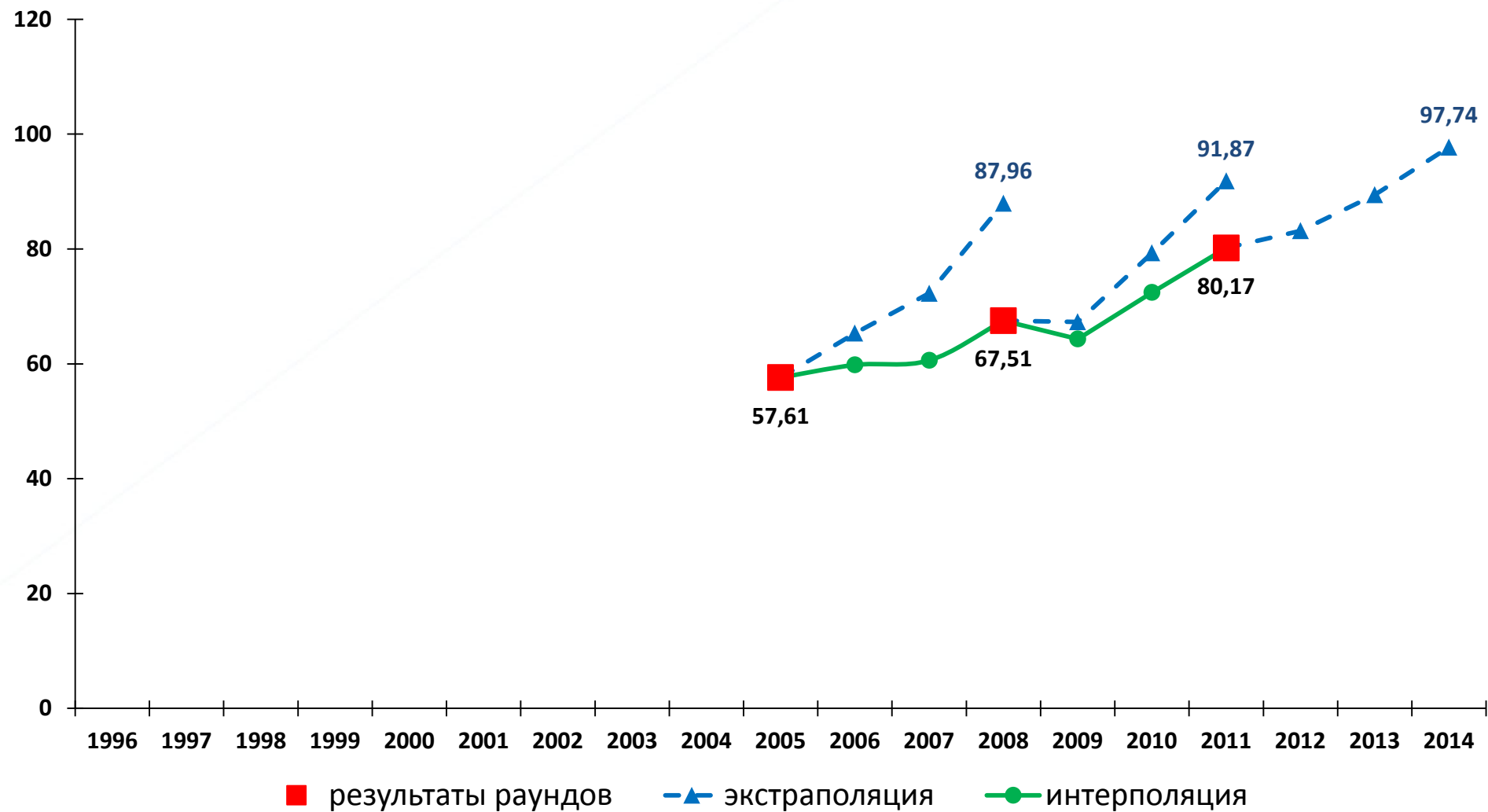


ППС BYR/USD



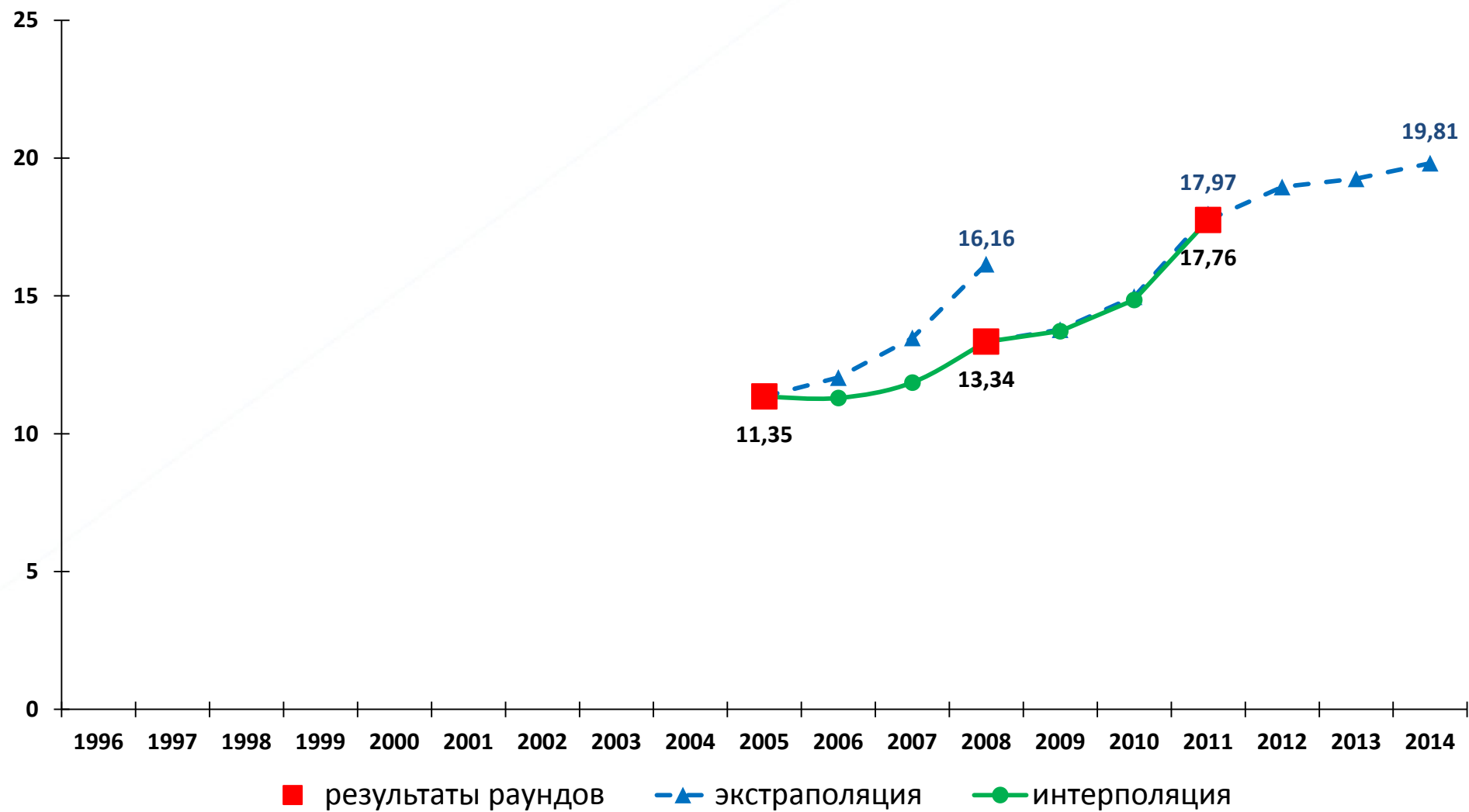


ППС KZT/USD





ППС KGS/USD

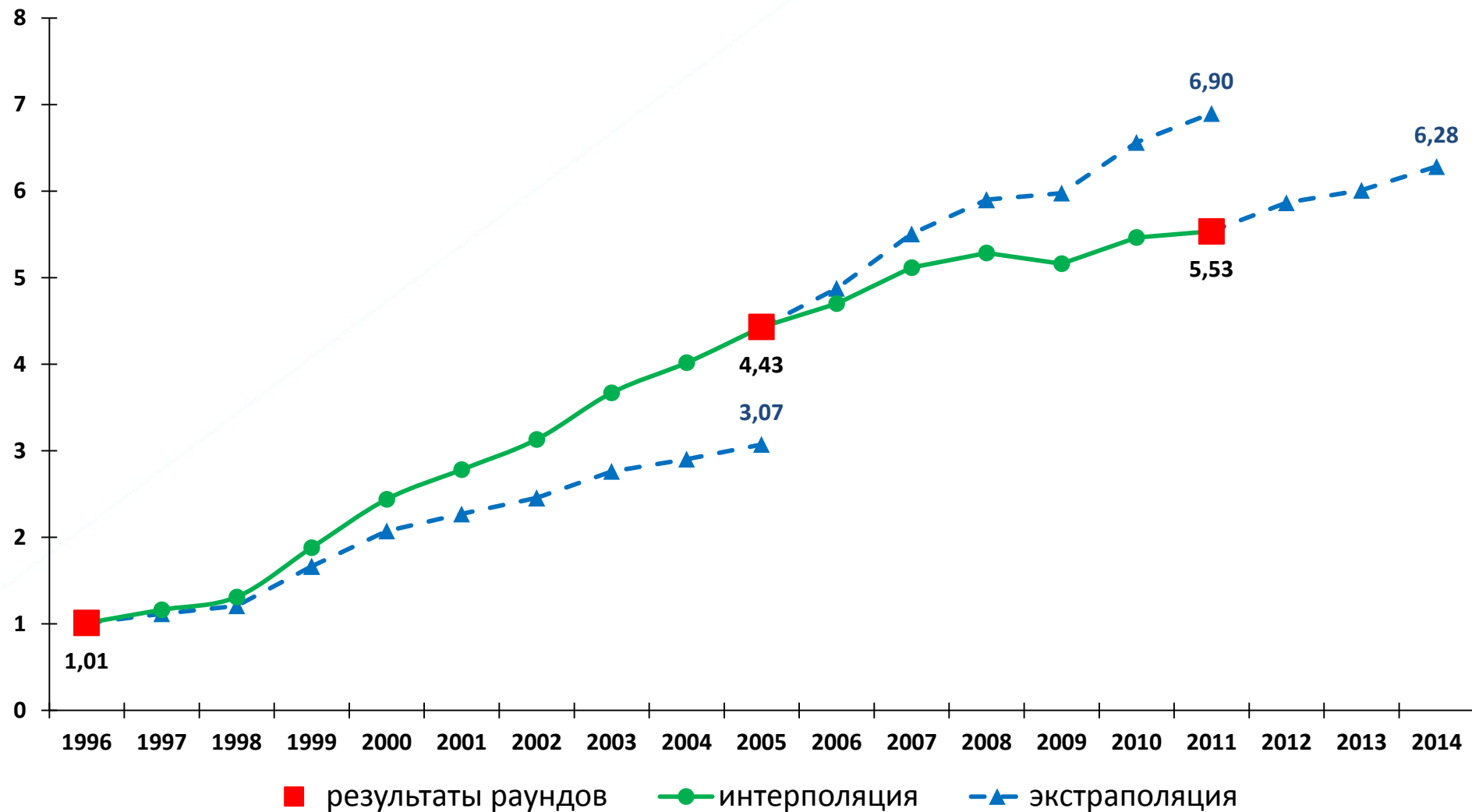




Молдова

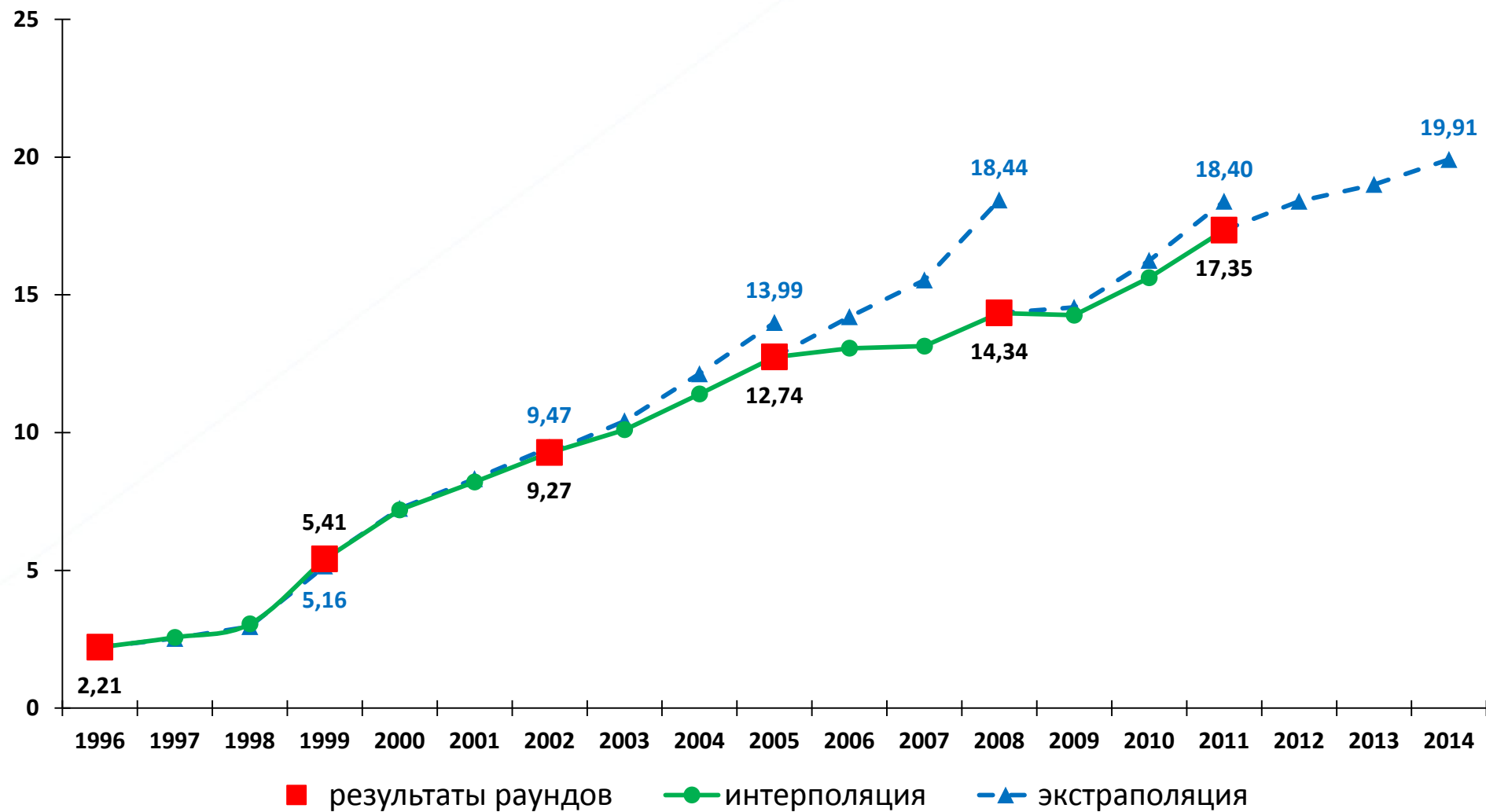


ППС MDL/USD





ППС RUR/USD

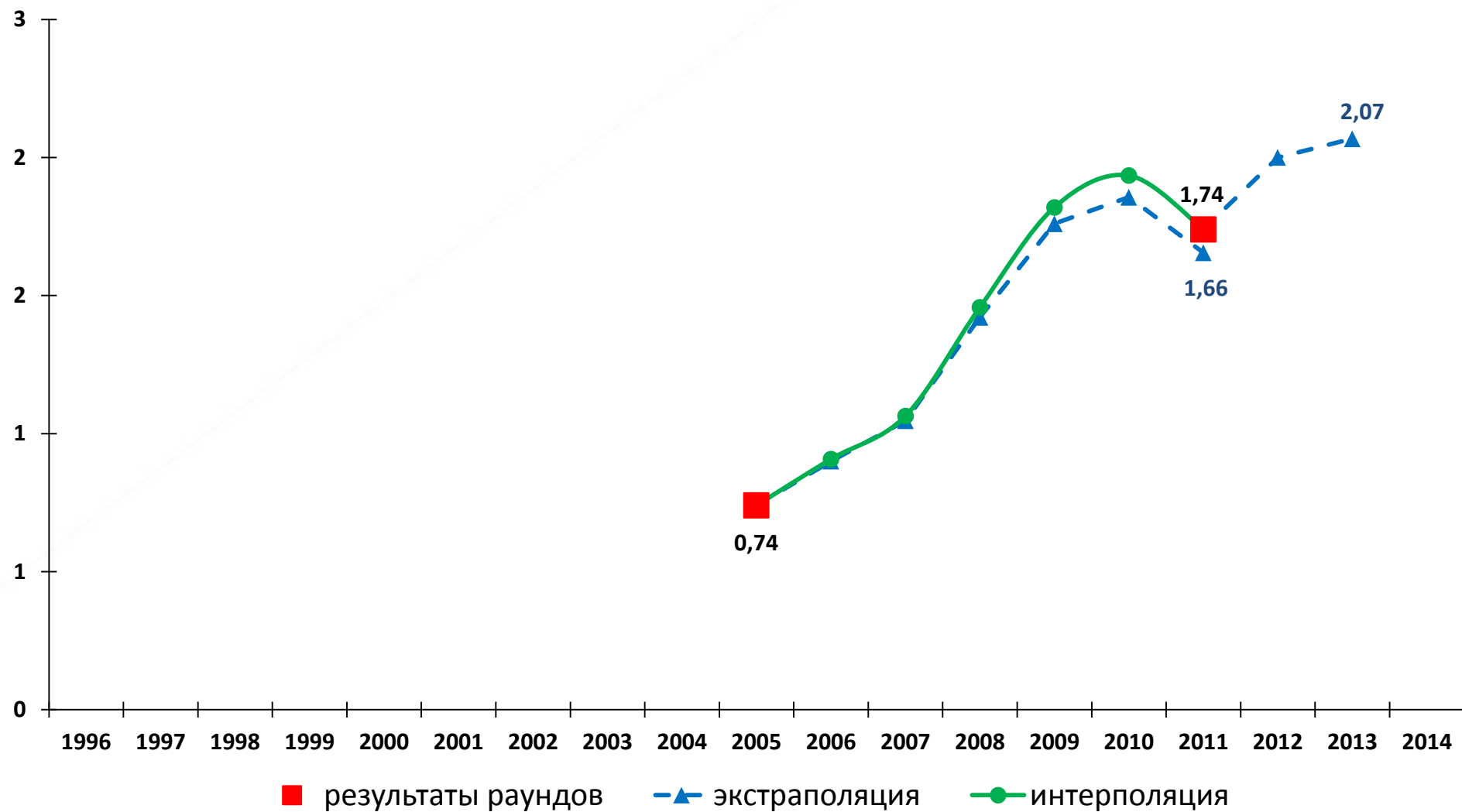




Таджикистан



ППС TJS/USD





Решение о проведении расчетов и (или) публикации экстраполяционных и интерполяционных оценок ППС принимает национальная статистическая служба.

Технически любая национальная статистическая служба может поручить проведение расчетов по согласованной методологии Статкомитету СНГ.



Спасибо