

ЭКОНОМИЧЕСКИЕ ИНДЕКСЫ



ТЕМА: ЭКОНОМИЧЕСКИЕ ИНДЕКСЫ

1. Понятие и классификация индексов
 2. Индивидуальные и общие индексы
 3. Агрегатные и средние индексы
 4. Выбор базы и весов индексов
 5. Индексы структурных сдвигов
 6. Индексы-дефляторы
- 

ПОНЯТИЕ И КЛАССИФИКАЦИЯ ИНДЕКСОВ

Индекс – это относительный показатель, который выражает соотношение величин какого-либо явления во времени, в пространстве или сравнение фактических данных с любым эталоном (план, прогноз, норматив и т.д.)

ИНДЕКСНЫЙ МЕТОД ПРИМЕНЯЕТСЯ ДЛЯ РЕШЕНИЯ СЛЕДУЮЩИХ ЗАДАЧ:

- ✓ для изучения изменения явлений во времени;
 - ✓ для проведения пространственных сравнений;
 - ✓ для характеристики степени выполнения плана;
 - ✓ для характеристики степени влияния структурных изменений.
- 

КЛАССИФИКАЦИЯ ЭКОНОМИЧЕСКИХ ИНДЕКСОВ

- ✓ степени охвата явления;
- ✓ база сравнения;
- ✓ вид весов (соизмерителя);
- ✓ форма построения;
- ✓ характер объекта исследования;
- ✓ объект исследования;
- ✓ состав явления;
- ✓ период исчисления.

ПО СТЕПЕНИ ОХВАТА ЯВЛЕНИЯ

Индивидуальные индексы – служат для характеристики изменения отдельных элементов сложного явления.

Для измерения динамики сложного явления, составные части которого непосредственно несоизмеримы (изменения физического объема продукции, включающей разноименные товары, индекса цен акций предприятий региона и т.п.), рассчитывают **сводные, или общие, индексы.**

ПО БАЗЕ СРАВНЕНИЯ

Динамические индексы – отражают изменение явления во времени (например, индекс цен на продукцию в 2005 г. по сравнению с предыдущим годом).

Динамические индексы бывают базисными и цепными.

Территориальные индексы – применяются для межрегиональных сравнений. Большое значение эти индексы имеют в международной статистике при сопоставлении показателей социально-экономического развития различных стран.

ПО ВИДУ ВЕСОВ

Вес индекса – это величина служащая для целей соизмерения индексируемых величин.

Система базисных индексов – это ряд последовательно вычисленных индексов одного и того же явления с постоянной базой сравнения.

Система цепных индексов – это ряд индексов одного и того же явления, вычисленных с меняющейся от индекса к индексу базой сравнения.

В ЗАВИСИМОСТИ ОТ ФОРМЫ ПОСТРОЕНИЯ

Агрегатный индекс – сложный относительный показатель, который характеризует среднее изменение социально-экономического явления, состоящего из несоизмеримых элементов.

Средний индекс – это индекс, вычисленный как средняя величина из индивидуальных индексов.



ПО ХАРАКТЕРУ ОБЪЕКТА ИССЛЕДОВАНИЯ

- **ИНДЕКСЫ КОЛИЧЕСТВЕННЫХ ПОКАЗАТЕЛЕЙ;**
- **ИНДЕКСЫ КАЧЕСТВЕННЫХ ПОКАЗАТЕЛЕЙ.**

ПО ОБЪЕКТУ ИССЛЕДОВАНИЯ

- производительности труда,
 - себестоимости,
 - физического объема продукции,
 - стоимости продукции
 - цены и т.д.
- 

ПО СОСТАВУ ЯВЛЕНИЯ

Индекс постоянного (фиксированного) состава —

это индекс, исчисленный с весами, зафиксированными на уровне одного и какого-либо периода, и показывающий изменение только индексируемой величины.

Индекс переменного состава — это индекс, выражающий отношение средних уровней изучаемого явления, относящихся к разным периодам времени.

ПО ПЕРИОДУ ИСЧИСЛЕНИЯ

- годовые,
- квартальные,
- месячные,
- недельные.

ИНДИВИДУАЛЬНЫЕ ИНДЕКСЫ.

Индивидуальные индексы – это относительные показатели, которые отражают результат сравнения однотоварных явлений.

Индекс физического объема - показывает, во сколько раз возрос (уменьшился) выпуск какого-либо одного товара в отчетном периоде по сравнению с базисным, или сколько процентов составляет рост (снижение) выпуска товара.

$$i_q = \frac{q_1}{q_0}$$

ИНДИВИДУАЛЬНЫЕ ИНДЕКСЫ

Индекс цен - характеризует изменение цены одного определенного товара в текущем периоде по сравнению с базисным.

$$i_p = \frac{P_1}{P_0}$$

Индекс товарооборота. - показывает, во сколько раз изменился товарооборот по какому-либо товару в текущем периоде по сравнению с базисным, или сколько процентов составляет рост (снижение) товарооборота. где q_1 - количество проданного товара в отчетном периоде;

$$i_{pq} = \frac{P_1 q_1}{P_0 q_0}$$

q_0 - количество проданного товара в базисном периоде.

p_1 - цена отчетного периода;

p_0 - цена базисного периода.

ОБЩИЕ ИНДЕКСЫ

Согласно *синтетической концепции* общие индексы выражают относительное изменение сложных (разнотоварных) явлений, отдельные части или элементы которых непосредственно несоизмеримы, и поэтому индексы – показатели синтетические.

В *аналитической теории* индексы трактуются как показатели, необходимые для измерения влияния изменения составных частей, компонентов, факторов сложного явления на изменение уровня этого явления.

ОБЩИЕ ИНДЕКСЫ

Общим индексом называется относительный показатель, характеризующий изменение сложного явления, состоящего из элементов, не поддающихся непосредственному суммированию.

ОБЩИЕ ИНДЕКСЫ

Индекс физического объема продукции -

показывает во сколько раз изменилась стоимость продукции в результате изменения ее объема, или сколько процентов составил рост (снижение) стоимости продукции из-за изменения ее физического объема

$$I_q = \frac{\sum p_0 q_1}{\sum p_0 q_0}$$

Индекс себестоимости продукции - показывает во сколько раз изменились издержки производства продукции в результате изменения себестоимости продукции, или сколько процентов составил рост (снижение) издержек производства продукции из-за изменения ее себестоимости.

$$I_z = \frac{\sum z_1 q_1}{\sum z_0 q_1}$$

ОБЩИЕ ИНДЕКСЫ

Индекс цен - показывает во сколько раз изменилась стоимость продукции в результате изменения цен, или сколько процентов составил рост (снижение) стоимости продукции из-за изменения цен.

$$I_p = \frac{\sum p_1 q_1}{\sum p_0 q_1}$$

Индекс товарооборота – показывает во сколько раз возросла (уменьшилась) стоимость продукции, или сколько процентов составил рост (снижение) стоимости продукции в текущем периоде по сравнению с базисным.

$$I_{pq} = \frac{\sum p_1 q_1}{\sum p_0 q_0}$$

АГРЕГАТНЫЕ И СРЕДНИЕ ИНДЕКСЫ

Агрегатный индекс – это сложный относительный показатель, который характеризует среднее изменение социально-экономического явления, состоящего из несоизмеримых элементов.

Числитель и знаменатель агрегатного индекса представляют собой сумму произведений двух величин, одна из которых меняется (индексируемая величина), а другая остается неизменной в числителе и знаменателе (вес индекса).

Индексируемой величиной называется признак, изменение которого изучается (цена товара, курс акций, количество проданных товаров и т.д.).

Вес индекса – это величина, служащая для целей соизмерения индексируемых величин.

Средний индекс – это индекс, вычисленный как средняя величина из индивидуальных индексов.

Средний арифметический индекс тождествен агрегатному индексу, если весами индивидуальных индексов будут слагаемые знаменателя агрегатного индекса. Только в том случае величина индекса, рассчитанного по формуле средней арифметической, будет равна агрегатному индексу.

ВЫБОР БАЗЫ И ВЕСОВ ИНДЕКСОВ

Системой индексов называется ряд последовательно построенных индексов. Такие системы характеризуют изменения, происходящие в изучаемом явлении в течение исследуемого периода времени.

Система используется при изучении динамики социально-экономических явлений за некоторый интервал времени, включающий более двух периодов времени.

Система базисных индексов – это ряд последовательно вычисленных индексов одного и того же явления с постоянной базой сравнения, т.е. в знаменателе всех индексов находится индексируемая величина базисного периода.

Система цепных индексов – это ряд индексов одного и того же явления, вычисленных с меняющейся от индекса к индексу базой сравнения.

ПОСТОЯННЫЕ И ПЕРЕМЕННЫЕ ВЕСА

Система индексов с постоянными весами – называется система сводных индексов одного и того же явления, вычисленных с весами, не меняющимися при переходе от одного индекса к другому.

Система индексов с переменными весами – представляет собой систему сводных индексов одного и того же явления, вычисленных с весами, последовательно меняющимися от одного индекса к другому.

ИНДЕКСЫ СТРУКТУРНЫХ СДВИГОВ

Индексом переменного состава – называется индекс, выражающий отношение средних уровней изучаемого явления, относящихся к разным периодам времени.

Индекс переменного состава отражает изменение не только индексируемой величины, но и структуры совокупности.

Индекс постоянного (фиксированного) состава – это индекс, исчисленный с весами, зафиксированными на уровне одного какого-либо периода, и показывающий изменение только индексируемой величины.

Индекс структурных сдвигов – это индекс, характеризующий влияние изменения структуры изучаемого явления на динамику среднего уровня этого явления.



ИНДЕКСЫ-ДЕФЛЯТОРЫ

Дефлятор – это коэффициент, переводящий значение стоимостного показателя за отчетный период в стоимостные измерители базисного.

Индекс-дефлятор рассчитывается как отношение фактической стоимости продукции отчетного периода к стоимости продукции, структура которой аналогична структуре отчетного периода, но определенная в ценах базисного года.