



МИНЭКОНОМРАЗВИТИЯ РОССИИ
ФЕДЕРАЛЬНАЯ СЛУЖБА ГОСУДАРСТВЕННОЙ СТАТИСТИКИ
(РОССТАТ)

П Р И К А З

14 сентября 2022 г.

№ 632

Москва

Об утверждении Официальной статистической методологии расчета показателей «Индекс предпринимательской уверенности», «Индикатор делового климата» и «Индекс деловых барьеров»

В соответствии с подпунктом 5.2 Положения о Федеральной службе государственной статистики, утвержденного постановлением Правительства Российской Федерации от 2 июня 2008 г. № 420, приказываю:

утвердить прилагаемую Официальную статистическую методологию расчета показателей «Индекс предпринимательской уверенности», «Индикатор делового климата» и «Индекс деловых барьеров».

Руководитель



С.С. Галкин

**ОФИЦИАЛЬНАЯ СТАТИСТИЧЕСКАЯ МЕТОДОЛОГИЯ
расчета показателей «Индекс предпринимательской уверенности»,
«Индикатор делового климата» и «Индекс деловых барьеров»**

I. Общие положения

1. Официальная статистическая методология расчета показателей «Индекс предпринимательской уверенности», «Индикатор делового климата» и «Индекс деловых барьеров» (далее – Методология) разработана в целях совершенствования научно обоснованной методологии статистического учета деловой активности в промышленности и внедрения в статистическую практику рекомендаций, представленных в научно-исследовательской работе по теме: «Совершенствование методологии обследования деловой активности организаций промышленности и развитие публикаций его результатов».

2. Методология базируется на методологических принципах, изложенных в международных рекомендациях, разработанных под эгидой Организации экономического сотрудничества и развития (ОЭСР), ООН, Евростата (Handbook on Economic Tendency Surveys, United Nations, 2015, UNECE. Guidelines on Producing Leading, Composite and Sentiment Indicators. – Geneva: United Nations, 2019, OECD. Business Tendency Surveys. A Handbook, OECD, 2003 и прочее).

3. Расчет индексов деловой активности производится в целях формирования официальной статистической информации, предусмотренной позициями 1.18.8, 1.19.13, 1.20.7 Федерального плана статистических работ на федеральном уровне ежемесячно.

4. Единица измерения показателей – процент.

II. Основные понятия и определения

5. Для целей настоящей Методологии используются следующие понятия и определения:

Баланс – разница между взвешенными долями респондентов, отметивших позитивные и негативные ответы. Используются для обобщения ответов на многовариативные вопросы в обследованиях бизнеса и потребителей.

Взвешивание – приписывание каждому респонденту весового коэффициента, отражающего относительную важность учета его высказывания по сравнению с высказываниями других респондентов.

Весовой коэффициент для целей данной Методологии рассчитывается как произведение среднесписочной численности работников данного предприятия и выборочного веса этого предприятия в слое.

Выборочный вес – коэффициент, используемый для вычисления среднего значения (средневзвешенного) элемента в совокупности.

Индекс предпринимательской уверенности (далее – ИПУ) – качественный показатель, позволяющий по ответам руководителей организаций о прогнозе выпуска продукции, остатках и спроса на нее охарактеризовать экономическую деятельность организаций.

Индикатор делового климата (далее – ИДК) – качественный показатель, характеризующий изменения агрегированных показателей (уровень и изменение спроса (портфеля заказов) на внутреннем рынке, изменение спроса (портфеля заказов) на внешнем рынке, изменение и перспективы выпуска продукции, изменение экономической ситуации). Рассчитывается для мониторинга текущей деловой ситуации и прогнозирования краткосрочных событий.

Индекс деловых барьеров (далее – ИДБ) – качественный показатель, отражающий совокупные предпринимательские оценки факторов, лимитирующих деятельность предприятий и обусловленных наиболее значимыми социально-экономическими эффектами текущих рисков и вызовов.

Такие факторы дополняют производственные оценки и характеризуют различные аспекты динамики производственной активности (особенно кризисной), включающие, в том числе, влияние спроса, выпуска, общей экономической ситуации, а также внутренней и внешней неопределенности, с которой сталкиваются предприятия.

Компоненты – временные ряды экономических показателей, которые проявляют опережающий характер относительно поворотных точек справочного ряда данных.

Медиана слоя – значение признака, находящееся в середине ранжированной (упорядоченной по возрастанию или убыванию) совокупности (слоя).

Метод главных компонент – метод, основанный на определении минимального числа факторов, вносящих наибольший вклад в дисперсию данных.

Слой (страта) – подсовокупность, сформированная на основе одного или более критериев классификации. Множества подсовокупностей не содержат общих единиц и вместе исчерпывают всю совокупность.

Факторный анализ – процедура, с помощью которой множество переменных, относящихся к имеющимся наблюдениям, сводят к меньшему количеству независимых влияющих величин, называемых факторами. Факторный анализ классифицирует признаки (переменные), описывающие наблюдение.

Фактор – латентная (скрытая) переменная, конструируемая таким образом, чтобы можно было объяснить корреляцию между набором имеющихся переменных.

JDemetra+ – программное обеспечение, являющееся инструментом для сезонной корректировки показателей, разработанное в соответствии с Рекомендациями Евростата (European Statistical System (ESS) guidelines on seasonal adjustment, European Union, 2015).

Statistical Package for the Social Sciences (SPSS) – программное

обеспечение, представляющее собой статистический пакет для обработки и анализа данных (далее – SPSS).

III. Источники информации

6. Источники информации:

форма федерального статистического наблюдения № 1-ДАП «Обследование деловой активности организаций добывающих, обрабатывающих производств, осуществляющих обеспечение электрической энергией, газом и паром; кондиционирование воздуха» (далее – форма № 1-ДАП);

статистический регистр Росстата.

IV. Методика расчета показателей

7. Расчет показателей ИПУ, ИДК и ИДБ производится по организациям (юридическим лицам), не относящимся к малому предпринимательству, в целом по Российской Федерации. ИПУ рассчитывается по видам экономической деятельности в соответствии с приложением (гр. 3), показатели ИДК и ИДБ – в целом по разделам ОКВЭД2 В, С, D, в процентах (с одним знаком после запятой).

8. Порядок расчета показателей ИПУ, ИДК и ИДБ следующий:

- 1) редактирование полученных первичных статистических данных;
- 2) взвешивание ответов респондентов;
- 3) расчет долей ответов;
- 4) расчет балансов оценки;
- 5) сезонная корректировка балансов оценки;
- 6) расчет показателей.

1. Редактирование полученных первичных статистических данных

9. Для проведения корректных расчетов в совокупности первичных статистических данных по всем организациям должно присутствовать значение показателя «Среднесписочная численность работников», являющегося одним из элементов весового коэффициента.

10. В качестве основного источника информации по данному показателю используется информационный ресурс ФНС России, размещенный на официальном сайте ФНС России: <http://www.nalog.ru/ru/opendata> в формате открытых данных в соответствии с приказом ФНС России от 29 декабря 2016 г. № ММВ-7-14/729@ «Об утверждении сроков и периода размещения, порядка формирования и размещения на официальном сайте Федеральной налоговой службы в информационно-телекоммуникационной сети «Интернет» сведений, указанных в пункте 1.1 статьи 102 Налогового кодекса Российской Федерации» (зарегистрирован Минюстом России 24 января 2017 г., регистрационный № 45378) и передается в статистический регистр Росстата на федеральном уровне ежегодно в августе.

11. В целях расчетов по настоящей Методологии пропущенные данные заполняются значениями медианы слоя.

При этом медиана (Me_i) предварительно ранжированных объектов слоя рассчитывается по формулам:

1) если в ранжированном слое нечетное количество объектов:

$$Me_i = x_{\frac{n+1}{2}}, \quad (1)$$

где:

i – номер слоя в соответствии с графой 2 приложения;

n – число элементов в слое;

$x_{\frac{n+1}{2}}$ – элемент в слое с номером $\frac{n+1}{2}$;

2) если в ранжированном слое четное количество объектов, то медиана рассчитывается как среднее значение двух элементов ранжированного ряда с номерами $\frac{n}{2}$ и $\frac{n+1}{2}$ в соответствии с формулой

$$Me_i = \frac{x_{\frac{n}{2}} + x_{\frac{n+1}{2}}}{2}. \quad (2)$$

Полученные при расчете данные медианы вменяются для каждого пропущенного значения в слое.

2. Взвешивание ответов респондентов

12. Для распространения на генеральную совокупность выборочных статистических данных деловой активности обследуемых организаций (варианты ответов: «более чем достаточный», «достаточный», «недостаточный», «увеличение» «улучшение», «повышение»), «без изменений», «уменьшение» («ухудшение», «снижение») используется коэффициент распространения (Kr_{ori}).

Коэффициент распространения рассчитывается по формуле:

$$Kr_{ori} = Ch_{ori} * Vh_{ornewi} , \quad (3)$$

где:

Ch_{ori} – среднесписочная численность работников организации, человек;

Vh_{ornewi} – скорректированный выборочный вес организации в i -м слое.

Скорректированный с учетом числа ответивших организаций (принявших участие в обследовании) выборочный вес организации (Vh_{ornewi}) рассчитывается по формуле:

$$Vh_{ornewi} = \frac{N_i}{n_{otvi}} , \quad (4)$$

где:

N_i – число организаций в i -м слое генеральной совокупности, единиц;

n_{otvi} – число ответивших организаций в i -м слое, единиц.

Каждый указанный ответ организации по всем показателям формы № 1-ДАП взвешивается на коэффициент распространения по формуле:

$$VOt_{kj} = Ot_{kj} * Kr_{ori} , \quad (5)$$

где:

VOt_{kj} – взвешенный в k -м виде ответа организации на вопрос формы по j -й категории;

Ot_{kj} – индикатор ответа организации на вопрос формы по j -й категории и k -му виду ответа (индикатор указанного вида ответа = 1 (в случае наличия ответа); в случае отсутствия ответа = 0 (взвешивание не производится);

j – временные категории, $j=1,5$:

- 1) уровень текущего месяца;
- 2) в текущем месяце относительно фактического объема производства;
- 3) изменения в текущем месяце по сравнению с предыдущим месяцем;
- 4) перспективы изменения в следующие 3 месяца;
- 5) перспективы изменения в следующие 6 месяцев;

k – вид ответа, $k=1,6$:

- 1) «более чем достаточный»;
- 2) «достаточный»;
- 3) «недостаточный»;
- 4) «увеличение» («улучшение», «повышение»);
- 5) «без изменений»;
- 6) «уменьшение» («ухудшение», «снижение»).

3. Расчет долей ответов

13. Для расчета балансов оценок t -му показателю формы № 1-ДАП (кроме показателей: «Перспективы развития организации», «Использование производственных мощностей», «Обеспеченность организации имеющимся спросом (портфелем заказов)», «Основные факторы, ограничивающие рост производства организации») рассчитываются доли взвешенных ответов респондентов ($DVot_{kij}$) по видам ответов («более чем достаточный», «достаточный», «недостаточный», «увеличение» («улучшение», «повышение»), «без изменений», «уменьшение» («ухудшение», «снижение»)).

Доля положительных и отрицательных ответов рассчитываются по формуле:

$$DVot_{ij} = \frac{\Sigma Vot_{(kp/ko)ij}}{\Sigma Vot_{ij}} * 100\%, \quad (6)$$

где:

$Vot_{(kp/ko)ij}$ – сумма взвешенных положительных/отрицательных ответов по i -му виду деятельности j -й временной категории;

$V0t_{ij}$ – сумма взвешенных ответов по i -му виду деятельности, j -й временной категории.

4. Расчет балансов оценки

14. Балансы оценки являются обобщенным выражением мнений респондентов об уровне и динамике показателей деловой активности.

15. На основе балансов оценок показателей рассчитываются ИПУ, ИДК, ИДБ, характеризующие состояние предпринимательского поведения в изучаемом секторе экономики.

16. Балансы оценки рассчитываются по 15 следующим показателям:

- 1) численность занятых в организации;
- 2) спрос на продукцию (портфель заказов): на внутреннем рынке;
- 3) спрос на продукцию (портфель заказов): на внешнем рынке;
- 4) выпуск продукции в натуральном выражении;
- 5) запасы готовой продукции;
- 6) оценка изменения собственной конкурентной позиции: на внутреннем рынке;
- 7) оценка изменения собственной конкурентной позиции: на внешнем рынке;
- 8) обеспеченность производственными мощностями с учетом текущего спроса (портфеля заказов) на ближайшие 6 месяцев;
- 9) цены на сырье и материалы;
- 10) цены на реализуемую продукцию;
- 11) собственные финансовые средства;
- 12) бюджетные финансовые средства;
- 13) кредитные и заемные финансовые средства;
- 14) оценка изменения прибыли;
- 15) оценка общей экономической ситуации на предприятии.

Расчет балансов осуществляется по формуле:

$$B_{tj} = DV0t_{kp} - DV0t_{ko} , \quad (7)$$

где:

B_{tj} – баланс оценки по t -му показателю, $t = 1, 15$, и j -й временной категории, в процентах;

$DV0t_{kp}$ – доля взвешенных ответов респондентов, указавших один из благоприятных вариантов k -го вида ответа по временной категории, в процентах, $kp = 1, 5$:

- 1) «более чем достаточный»;
- 2) «увеличение»;
- 3) «улучшение»;
- 4) «повышение»;
- 5) «благоприятная»;

$DV0t_{ko}$ – доля взвешенных ответов респондентов, указавших один из неблагоприятных вариантов k -го вида ответа по временной категории, в процентах, $ko = 1, 6$:

- 1) «недостаточный»;
- 2) «уменьшение»;
- 3) «недостаточно»;
- 4) «снижение»;
- 5) «ухудшение»;
- 6) «неудовлетворительный».

5. Сезонная корректировка балансов оценки

17. Сезонная корректировка балансов оценки осуществляется ежемесячно с помощью JDemetra+. Исключение сезонного фактора осуществляется алгоритмом TRAMO/SEATS (без учета национального календаря, с обнаружением выбросов), встроенным в качестве модуля в программное обеспечение JDemetra+.

18. Сезонной корректировке подлежат следующие показатели:

спрос на продукцию (портфель заказов) на внутреннем рынке – уровень в текущем месяце;

спрос на продукцию (портфель заказов) на внутреннем рынке – изменение в текущем месяце по сравнению с предыдущим месяцем;

спрос на продукцию (портфель заказов) на внешнем рынке – изменение в текущем месяце по сравнению с предыдущим месяцем;

выпуск продукции в натуральном выражении – перспективы изменения в следующие три месяца;

выпуск продукции в натуральном выражении – изменение в текущем месяце по сравнению с предыдущим месяцем;

запасы готовой продукции – уровень в текущем месяце;

общая экономическая ситуация на предприятии – изменение в текущем месяце по сравнению с предыдущим месяцем.

19. Модель сезонного сглаживания определяется в январе один раз в год. Параметры модели фиксируются на весь год. Ежемесячно при поступлении новых данных происходит обновление коэффициентов модели сезонного сглаживания.

20. Ежемесячно проводится анализ текущей модели сезонного сглаживания. В случае резкого изменения значений временного ряда (изменения характера сезонности) может быть принято решение об изменении модели.

21. Показатели «Основные факторы, ограничивающие рост производства организации в текущем месяце» не проходят сезонную корректировку.

6. Расчет показателей

6.1. Показатель «Индекс предпринимательской уверенности» (ИПУ)

22. ИПУ рассчитывается отдельно по каждому виду деятельности в соответствии с графой 3 приложения по формуле:

$$IPU_i = \frac{BSV_y + BV_p - BZ_y}{3}, \quad (8)$$

где:

IPU_i – индекс предпринимательской уверенности по i -му виду деятельности, в процентах;

BSV_y – баланс спроса на продукцию (портфель заказов) на внутреннем рынке по фактическому уровню текущего месяца, в процентах;

BV_p – баланс выпуска продукции в натуральном выражении по перспективе изменения в следующие 3 месяца, в процентах;

BZ_y – баланс запасов готовой продукции по фактическому уровню текущего месяца, в процентах.

6.2. Показатели «Индикатор делового климата» (ИДК) и «Индекс деловых барьеров» (ИДБ)

23. Показатели ИДК и ИДБ рассчитываются в целом по разделам ОКВЭД2 в соответствии с приложением, в процентах (с одним знаком после запятой).

Показатели рассчитываются по методу главных компонент по формуле:

$$y_{it} = \lambda_{i1}F_{1t} + \dots + \lambda_{ij}F_{jt} + u_{it}, \forall i \in [1; I], \quad (9)$$

где:

y_{it} – стандартизированная наблюдаемая переменная (баланс мнений относительно показателя i) в момент времени t , в процентах;

λ_{ij} – коэффициент регрессии фактора j для оцениваемой переменной i ;

F_{jt} – значение общего фактора j в момент времени t ;

u_{it} – специфическая компонента переменной i в момент времени t ;

I – число анализируемых показателей (для ИДК = 6; для ИДБ = 5);

j – число общих факторов (ненаблюдаемых переменных, которые объединяют информацию).

24. Коэффициент регрессии (λ_{ij}), значение общего фактора (F_{jt}) и специфическая компонента (u_{it}) оцениваются в программном обеспечении SPSS методом главных компонент факторного анализа на основе исходных данных.

25. В расчете используются следующие переменные:

1) для показателя «Индикатор делового климата»:

$i = 1$ – фактический уровень спроса (портфеля заказов) на внутреннем рынке, в процентах;

$i = 2$ – изменение в текущем месяце по сравнению с предыдущим месяцем спроса (портфеля заказов) на внутреннем рынке, в процентах;

$i = 3$ – изменение в текущем месяце по сравнению с предыдущим месяцем спроса (портфеля заказов) на внешнем рынке, в процентах;

$i = 4$ – изменение в текущем месяце по сравнению с предыдущим месяцем выпуска продукции в натуральном выражении, в процентах;

$i = 5$ – перспективы изменения выпуска продукции в натуральном выражении, в процентах;

$i = 6$ – изменение в текущем месяце по сравнению с предыдущим месяцем общей экономической ситуации в организации, в процентах.

2) для показателя «Индекс деловых барьеров»:

$i = 1$ – фактор «недостаточный спрос на продукцию предприятия на внутреннем рынке», в процентах;

$i = 2$ – фактор «неопределенность экономической ситуации», в процентах;

$i = 3$ – изменение в текущем месяце по сравнению с предыдущим месяцем спроса (портфеля заказов) на внутреннем рынке (с обратным знаком), в процентах;

$i = 4$ – изменение в текущем месяце по сравнению с предыдущим месяцем выпуска продукции в натуральном выражении (с обратным знаком), в процентах;

$i = 5$ – изменение в текущем месяце по сравнению с предыдущим месяцем общей экономической ситуации в организации (с обратным знаком), в процентах.

Приложение
к Официальной статистической
методологии расчета показателей
«Индекс предпринимательской уверенности»,
«Индикатор делового климата» и «Индекс
деловых барьеров», утвержденной приказом
Росстата от 14.09.2022 № 632
(Справочно)

ПЕРЕЧЕНЬ
видов экономической деятельности на основе Общероссийского
классификатора видов экономической деятельности (ОКВЭД2)
(для расчета показателей ИПУ, ИДК, ИДБ)

№ п/п	№ слоя	Код по ОКВЭД2	Наименование вида экономической деятельности
1	2	3	4
1		В	Добыча полезных ископаемых
2	1	05	Добыча угля
3	2	06	Добыча сырой нефти и природного газа
4	3	07	Добыча металлических руд
5	4	08	Добыча прочих полезных ископаемых
6	5	09	Предоставление услуг в области добычи полезных ископаемых
7		С	Обрабатывающие производства
8	6	10	Производство пищевых продуктов
9	7	11	Производство напитков
10	8	12	Производство табачных изделий
11	9	13	Производство текстильных изделий
12	10	14	Производство одежды
13	11	15	Производство кожи и изделий из кожи
14	12	16	Обработка древесины и производство изделий из дерева и пробки, кроме мебели, производство изделий из соломки и материалов для плетения
15	13	17	Производство бумаги и бумажных изделий
16	14	18	Деятельность полиграфическая и копирование носителей информации
17	15	19	Производство кокса и нефтепродуктов
18	16	20	Производство химических веществ и химических продуктов
19	17	21	Производство лекарственных средств и материалов, применяемых в медицинских целях
20	18	22	Производство резиновых и пластмассовых изделий

№ п/п	№ слоя	Код по ОКВЭД2	Наименование вида экономической деятельности
21	19	23	Производство прочей неметаллической минеральной продукции
22	20	24	Производство металлургическое
23	21	25	Производство готовых металлических изделий, кроме машин и оборудования
24	22	26	Производство компьютеров, электронных и оптических изделий
25	23	27	Производство электрического оборудования
26	24	28	Производство машин и оборудования, не включенных в другие группировки
27	25	29	Производство автотранспортных средств, прицепов и полуприцепов
28	26	30	Производство прочих транспортных средств и оборудования
29	27	31	Производство мебели
30	28	32	Производство прочих готовых изделий
31	29	33	Ремонт и монтаж машин и оборудования
32		D	Обеспечение электрической энергией, газом и паром; кондиционирование воздуха
33	30	35	Обеспечение электрической энергией, газом и паром; кондиционирование воздуха