

Таким образом, приходится констатировать, что такая крайне сложная задача, как исследование природы индексов, их содержательной, качественной стороны, не нашла своего решения и в современный период. По единодушному мнению индексологов в настоящее время индексный метод не имеет достаточно надежного теоретического обоснования и, поэтому, исследования в данной области остаются по-прежнему очень актуальными.

Литература:

1. Аллен Р. Экономические индексы Пер. с англ.- М.: Статистика, 1980.-256с.
2. Казинец Л.С. Теория индексов - М.: Госстатиздат, 1963.-352 с.
3. Frisch R. Annual survey of general economic theory: the problem of index numbers //Econometrica.-1936.- № 1.- P.1-38.
4. Samuelson P.A., Swamy S. Invariant economic index numbers and canonical duality: survey and synthesis //American Economic Review.-1974.-№4, P.566-593.

Резюме

Исследуется экономическая теория индексов и ее разновидность: теория «истинных» индексов стоимости жизни. Дается критический анализ теоретико-методологических основ названной теории. Показаны недостатки некоторых концептуальных положений данной теории.

Ключевые слова: индексный метод, теория лимитов, формулы, экономическая теория индексов, индексы стоимости жизни.

Summary

In this article the economic theory of index numbers and its modification - the theory of “true” cost-of-living index numbers - are studied. Critical analysis of theoretical and methodological bases of the given theory is provided. The drawbacks of some conceptual foundations of the theory are pointed out.

Key words: indices method, limit theory, formula, economic theory of index numbers, cost-of-living indices

УДК 338-501

ОБ «ИДЕАЛЬНОЙ» ИНДЕКСНОЙ ФОРМУЛЕ И. ФИШЕРА

С.В.Андреев

Частное учреждение образования Белорусский институт правоведения,
г. Гродно, Республика Беларусь

Вся история развития теории индексов связана с поиском наилучшей, в определенном смысле, индексной формулы. Хотя распространено мнение, что, строго говоря, такой формулы вообще не существует, да и само это понятие является предметом постоянных споров.

В этих поисках и спорах, пожалуй, центральное место занимает формула И. Фишера.

«Идеальный» индекс цен И.Фишера имеет вид:

$$I_p = \sqrt{\frac{\sum p_1 q_0}{\sum p_0 q_0} \cdot \frac{\sum p_1 q_1}{\sum p_0 q_1}} \quad (1)$$

Здесь p_0 – цены, а q_0 – объем продукции для базисного периода; p_1 и q_1 , соответственно, цены и объем продукции для отчетного периода.

В основе «идеальной» формулы Фишера лежат индексы Ласпейреса и Пааше. Этот новый индекс образуется как средняя геометрическая при помощи «скрещивания» двух индексов, построенных на основе взвешивания цен, один раз по базисному, другой раз по отчетному объему продукции.

В литературе слово «идеальная» всегда берется в кавычки, для чего есть достаточно причин, о которых речь пойдет ниже. Однако формула (1) действительно остается в известной мере образцовой, поскольку дает наилучшие индексные числа и несет печать глубокого, осмысленного подхода к конструированию индекса.

Анализ научных публикаций показывает, что «идеальная» формула сконструирована не Фишером, а английским статистиком Боули в 1899 году. Затем в одной из публикаций ее привел Уолш. Фишер же предложил лишь название – «идеальная», однако формула (1) в 1921 году стала «идеальной» формулой Фишера в результате ошибки Пирсона. По этому поводу И.Фишер в 1922 году сделал следующее замечание «...предложенный мною термин «идеальная» наиболее приемлем. Но, если должно быть использовано мое имя, то надо также использовать имя Уолша, или имена Уолша и Пигу» [1, с.89]. Однако, в дальнейшем Фишер настолько всесторонне исследовал 134 индексные формулы, что «идеальная» формула стала ассоциироваться с его именем.

На протяжении более 100 лет различные рецензенты формулу защищали, критиковали или даже подвергали суровым нападкам. Вначале было больше критики. Формулу считали искусственной, абстрактной. В последние десятилетия в отношении к формуле, наоборот, больше позитива. Например, П. Кевеш в [2] полагает, что экономическое содержание формулы Фишера лучше, чем у формул Ласпейреса и Пааше. Р. Ален [3] вообще считает ее «идеальным звеном, которое мы ищем» и строит на ее основе свою индексную концепцию.

Между тем ряд авторов и по сей день считают, что «идеальный» индекс Фишера имеет ряд серьезных недостатков. В то же время, критические замечания по поводу формулы Фишера (в дальнейшем они

выделены в тексте) сами выглядят уязвимыми для критики. Представляется интересным прокомментировать наиболее распространенные из них.

1) *Формула Фишера дает двойное усреднение: через систему взвешивания и путем извлечения квадратного корня.*

Но почему это недостаток? В вычислительной математике сплошь и рядом используется вообще многократное усреднение, и каждое следующее усреднение только делает формулу более точной.

2) *Формула «мутант» лишена конкретного экономического содержания, поскольку ее нельзя представить как отношение двух экономических осмысленных величин.*

Это совершенно не так. Числитель и знаменатель дроби представляют собой характеристику состояния цен, усредненную по количеству за период между ситуациями «0» и «1». Здесь трудно не согласиться с приведенным выше мнением П.Кевеша. Не бесспорным выглядит лишь использование геометрической формы усреднения.

3) *По «идеальной» формуле нельзя вычислить абсолютные приросты стоимости, обусловленные движением цен и изменением объема продукции. Т.е. разность между числителем и знаменателем «идеального» индекса не покажет никакой реальной экономики (или потерь) потребителей из-за изменения уровня цен.*

Сказанное в п.2) вроде бы свидетельствует об обратном.

4) *Индекс Фишера представляет собой симбиоз формул Ласпейреса (Вирста) и Пааше (Мана), поэтому при расчете индекса остается неясным вопрос: что вычисляем? Индекс цен? Нет. Индекс продукции? Тоже нет. Скорее всего, индекс стоимости. Но тогда по данной формуле индекс цен и индекс продукции вычислить нельзя.*

Это именно индекс цен. Формулы Ласпейреса и Пааше дают индекс цен. Нет никаких оснований отказывать в этом и вполне адекватной их комбинации.

5) *«Идеальная» формула Фишера имеет даже больше недостатков в сравнении с другими, поскольку, имея свои собственные, она вобрала в себя отрицательные качества индексов Ласпейреса (Вирста) и Пааше (Мана).*

Отрицательные качества индексов Ласпейреса и Пааше не так уж значительны. (Не случайно эти формулы широко используются). К тому же нет никаких оснований утверждать, что «идеальная» формула вобрала в себя те и другие. Скорее она их частично устраняет за счет взаимной компенсации. Что же касается ее собственных недостатков, то, в свете сказанного выше, не очень понятно, в чем они состоят.

Конечно, восторженное отношение Р.Аллена к «идеальной» формуле несколько преувеличено, но оно и далеко не лишено оснований.

Представляется интересным сравнить с «идеальной» формулой другие комбинации индексов Ласпейреса и Пааше, но это уже тема отдельного исследования.

Литература:

1. Фишер И. Построение индексов./ Пер. с англ.- М: Изд. ЦСУ СССР, 1928-464с.
2. Кевеш П. Теория индексов и практика экономического анализа.- М: Финансы и статистика, 1990-279с.
3. Аллен Р. Экономические индексы./ Пер. с англ. – М: Статистика, 1980-256с.

Резюме

Статья посвящена рассмотрению Формулы И.Фишера, длительное время занимающей центральное место в поисках наилучшей индексной формулы.

Дается анализ ее достоинств, признаваемых в последнее время большинством авторов, Приводится история ее возникновения и последующего критического рассмотрения.

Основное внимание уделено анализу критических замечаний в адрес формулы, высказываемых некоторыми авторами до настоящего времени, которые, однако, и сами уязвимы для критики.

Ключевые слова: «идеальная» формула Фишера.

Summary

This article is devoted to the question of I. Fisher formula. This subject takes the most important place among the best Index formula.

The analysis of the Index formula advantages is given here, they are taken into the consideration by the majority of the modern authors. The history of development of the Index formula and its further critical investigation are given in the article.

The new attention is paid to some critical remarks from the authors who made them earlier but these remarks themselves could be criticized.

Key words: Fishers “ideal” formula.

УДК: 631.15:65011.4:633.63:631.563(476.6)

ТЕНДЕНЦИИ РАЗВИТИЯ МИРОВОГО РЫНКА САХАРА

Е.И. Чернушевич

УО «Гродненский государственный аграрный университет»
г. Гродно, Республика Беларусь

Сахарная отрасль занимает важное место в экономике многих стран. Сахар производят более 120 и потребляют около 190 стран и территорий. Из них свыше 50 полностью зависят от импорта, но их