

RECENZJE

PETER VON DER LIPPE

INDEX THEORY AND PRICE STATISTICS,
Peter Lang Publishing, 2007, s. 572

Książka *Teoria indeksów i statystyka cen (Index Theory and Price Statistics)*, wydana ostatnio przez światowego eksperta w dziedzinie mierzenia inflacji i statystyki cen Profesora Petera von der Lippe, wypełnia lukę w obszernej i skomplikowanej materii aktualnego stanu wiedzy w tym obszarze. Ten doskonały podręcznik łączy matematyczną teorię indeksów z jej praktycznym zastosowaniem w statystyce publicznej. Autorowi w znakomity sposób udało się zintegrować teorię i praktykę, mimo oczywistej rozbieżności pomiędzy wyrafinowanymi i złożonymi modelami matematycznymi a praktycznymi problemami, coraz trudniejszymi do zrozumienia bez szerokiej wiedzy i doświadczenia.

Książka stanowi wprowadzenie do aksjomatycznych, mikroekonomicznych i stochastycznych rozważań w odniesieniu do indeksów. Posługując się umiarkowanie zaawansowanym aparatem matematycznym, Autor podsumowuje wiele aktualnych dyskusji dotyczących metodologicznych i metodycznych wad i zalet poszczególnych indeksów. Omawia indeksy cen towarów i usług konsumpcyjnych, indeksy cen dóbr produkcyjnych, indeksy wartości czy indeksy łańcuchowe używane w statystyce publicznej. Książka stanowi ważny, interesujący przegląd szerokiego spektrum problemów z zakresu nowoczesnej teorii indeksów i jej zastosowań w mierzeniu inflacji, deflacji agregatów makroekonomicznych, doboru próbki i uwzględniania zmian jakości produktów i usług w mierzeniu poziomu cen oraz wielu innych, ważnych, choć niekiedy kontrowersyjnych zagadnień.

Można śmiało powiedzieć, że opisywana książka profesora Petera von der Lippe jest pierwszym a przede wszystkim po prostu *normalnym* podręcznikiem, czyli książką przyjazną dla czytelnika, obejmującą przede wszystkim klasyczne zagadnienia. To oznacza, że stanowi ona zrozumiałe i wszechstronne wprowadzenie, zwłaszcza przydatne dla praktyków statystyki publicznej.

Recenzent ma nadzieję, że również szerokie grono czytelników, studentów i badaczy, uzna tę książkę za przydatne i użyteczne wprowadzenie do nadspodziewanie interesującego działu statystyki.

Pierwszy rozdział, poświęcony wprowadzeniu i elementarnym zagadnieniom teorii indeksów, jest zdominowany przez rozważania matematyczne i skupia się głównie na założeniach i wyprowadzaniu wzorów (formuł) indeksów z uwzględnieniem formalnych aspektów stosowalności, przydatności i dyskusji własności. Natomiast w praktycznym zastosowaniu statystyki cen pojawiają się zupełnie inne problemy, przede wszystkim prawidłowa konstrukcja koszyka dóbr oraz systemu wag, uwzględnienie zmian jakości itp. Autor stara się połączyć matematyczną teorię z praktycznymi rozwiązaniami stosowanymi w urzędach statystycznych i ministerstwach. W efekcie uzyskał zrównoważone wprowadzenie, uwzględniające oba punkty widzenia: teorię indeksów i praktykę statystyki publicznej. Następnym takiego podejścia jest przedstawienie umiarkowanie zaawansowanego aparatu matematycznego zarówno w pierwszym rozdziale jak i w całej książce.

Drugi rozdział szczegółowo przedstawia i analizuje kompletną listę podejść dyskutowanych w teorii indeksów. Podjęto w nim próbę zaprezentowania przeglądu aktualnego stanu wiedzy teoretycznej z uwzględnieniem szerokiego spektrum formuł indeksów (w tym również takich, które nie są wykorzystywane w praktyce publicznej statystyki cen). Ze względu na fakt ciągłego poszukiwania przez badaczy nowych formuł na wyliczanie ogólnych indeksów, Autor prezentuje jedynie aktualny stan wiedzy teoretycznej. Autor uznał za bezcelowe wyliczanie wszelkich formuł, jakie kiedykolwiek zostały zaproponowane. W zamian stara się zaprezentować uporządkowany, czytelny i zrównoważony przegląd, możliwie jak najbardziej kompletny.

Rozdział trzeci opisuje aksjomaty i przedstawia kolejne formuły indeksów. Podstawowym zamysłem Autora w tym rozdziale było szczegółowe przedstawienie interpretacji aksjomatów, zależności pomiędzy różnymi aksjomatami, sposobów doboru aksjomatów stosowanych przez teoretyków do tworzenia *systemów aksjomatów* a także zaprezentowanie kolejnych formuł indeksów i *podejść*. Autor deklaruje, że książka jest poświęcona głównie funkcjom cen, także ilościowemu (nie wartościowemu) sformułowaniu formuł indeksowych. Dodatkowo uwzględnia fakt, że teoria aksjomatów jest do pewnego stopnia ograniczona do dwuwartościowych porównań czasowych.

Rozdział czwarty omawia praktyczne problemy pomiaru cen i tworzenia systemów indeksów używanych w statystyce publicznej. Zdaniem Autora teoria indeksów jest często krytykowana, gdyż skupia się na wyborze odpowiedniej formuły indeksu, podczas gdy w praktycznym zastosowaniu statystyki cen ważniejsze jest rozwiązanie innych (bardziej praktycznych) problemów. Dlatego też Autor podejmuje dyskusję nad ogólnymi metodologicznymi i metodycznymi zagadnieniami statystyki cen i praktycznymi problemami w odniesieniu do najważniejszych indeksów cen. W polemice uwzględniony jest również wątek identyfikacji roli statystyki publicznej w życiu ekonomicznym i społecznym. Wyniki i wnioski wypływające z statystyki cen mają istotne znaczenie dla wielu ludzi, nie tylko w odniesieniu do szacowania kosztów utrzymania, ale również w podejmowaniu decyzji w biznesie czy administracji, a także w prowadzeniu polityki monetarnej.

Rozdział piąty – deflacja i agregacja, identyfikuje dwa cele tworzenia indeksów cen: po pierwsze do mierzenia zmian typu *rok do roku* w poziomie poszczególnych cen, po drugie do *deflacji* agregatów. Ogólne formuły indeksów nie są w stanie w równym stopniu odpowiadać obu tym celom. Dlatego należy traktować te dwa główne zastosowania indeksów (mierzenie poziomu cen i deflacja agregatów) jako dwa odrębne zagadnienia teorii indeksów. Niektóre matematyczne własności funkcji indeksów, między innymi *zgodność agregacyjna* i *zgodność strukturalna* mają szczególne znaczenie w kontekście deflacji. W rozdziale przedstawione są międzynarodowe rekomendacje dotyczące deflacji określonych agregatów makroekonomicznych. Wprowadzenie do metod deflacji skupia się na pokazaniu celu deflacji oraz opisie możliwych do zastosowania metod.

W rozdziale szóstym, Autor kontynuując rozważania z rozdziału piątego, przechodzi do przedstawienia indeksów poziomów cen i indeksów wartościowych, stosowanych w statystyce publicznej. Można uznać, choć nie bezdyskusyjnie, że najbardziej znanymi indeksami cen używanymi w praktyce statystyki publicznej są: indeks cen towarów i usług konsumpcyjnych (CPI), indeks cen dóbr produkcyjnych (PPI) oraz indeksy cen w handlu zagranicznym (XPI dla eksportu i MPI dla importu). W przypadku handlu zagranicznego, jak również w przypadku płac i wynagrodzeń, możliwy jest wybór metody indeksu poziomu cen lub indeksu wartościowego (ceny jednostki wartości oferowanej w produkcie lub usłudze). Cały rozdział jest poświęcony zagadnieniu stosowania indeksu CPI i ogólnym problemom mierzenia inflacji, stosowania indeksu PPI oraz różnicom między indeksami opartymi o poziom cen a indeksami wartościowymi. Oprócz indeksów cen towarów i usług konsumpcyjnych (CPI) wprowadzony został również i przedyskutowany zharmonizowany indeks cen towarów i usług konsumpcyjnych (HICP). Indeks CPI jest dobrze znanym instrumentem pozwalającym na mierzenie inflacji jak również uzyskiwanie *deflatorów*.

W rozdziale siódmym opisane są indeksy łańcuchowe. W miarę zapoznawania się z argumentami wspierającymi podejście łańcuchowe, Autor deklaruje swój wzrastający sceptycyzm dla tych metod. Autor przedstawia rozważania innych badaczy wskazujące na przewagę indeksów łańcuchowych wraz polemikę podważającą te argumenty. Podaje również przegląd najważniejszych własności indeksów łańcuchowych, które są podstawą do opowiedzenia się za bądź też przeciw podejściu łańcuchowemu. Przedstawione są ogólne uwagi odnośnie kilku przykładów spornych argumentów, poparte wykazem (domniemanym) zalet indeksów łańcuchowych w porównaniu z tradycyjnymi (bezpośrednimi) formułami indeksów. Rozdział siódmy książki jest w istocie krytyką indeksów łańcuchowych, która nie doczekała się jeszcze (przychylnej) uwagi w literaturze przedmiotu.

Józef Dziechciarz

PETER VON DER LIPPE
TEORIA INDEKSÓW I STATYSTYKA CEN (*INDEX THEORY AND PRICE STATISTICS*)

- I. Wprowadzenie i elementarne zagadnienia teorii indeksów
 - 1.1 Podstawowe zagadnienia statystyki cen i indeksów cen
 - 1.2 Indeksy nieważone
 - 1.3 Indeksy Laspeyresa i Paaschego
- II. Metodyka teorii indeksów
 - 2.1 Przegląd teorii indeksów i różne *podejścia*
 - 2.2 Podejście Irvinga Fishera i testy rekursywne (reversal)
 - 2.3 Podejście stochastyczne w teorii indeksów cen
 - 2.4 Elementy ekonomicznej teorii indeksów
 - 2.5 Indeksy łańcuchowe i podejście gałęziowe, wprowadzenie
 - 2.6 Modele addytywne, formuły indeksów Stuvela i Banerjee
- III. Aksjomaty i dalsze formuły indeksów
 - 3.1 Podejście aksjomatyczne, niektóre twierdzenia i aksjomaty podstawowe
 - 3.2 Aksjomaty podstawowe i ich interpretacja
 - 3.3 Systemy aksjomatów
 - 3.4 Indeks logarytmiczny I: indeks Cobba-Douglasa i indeks Tornqvista
 - 3.5 Indeks logarytmiczny II: indeks Vartia
 - 3.6 Indeksy perfekcyjne i Najlepszy Nieobciążony Liniowy Indeks Theila (BLU)
- IV. Pomiar cen i systemy indeksów w statystyce publicznej
 - 4.1 Tworzenie systemu ustalania cen i indeksów cen w statystyce publicznej
 - 4.2 Uwzględnienie zmian jakości w statystyce cen
 - 4.3 Dobór próbki w statystyce cen
- V. Deflacja i agregacja
 - 5.1 Wprowadzenie do metod deflacji
 - 5.2 Deflacja w ujęciu ilościowym, agregacja i podwójna deflacja
 - 5.3 Ujednolicenie metod deflacji w Europie
 - 5.4 Idealny (ideal) indeks Fishera daleki od doskonałości
- VI. Indeksy cen i indeksy wartości w statystyce publicznej
 - 6.1 Indeks cen towarów i usług konsumpcyjnych (CPI) i zharmonizowany indeks cen towarów i usług konsumpcyjnych (HICP) w Europie
 - 6.2 Kontrowersyjne zagadnienia w mierzeniu inflacji
 - 6.3 Indeks cen dóbr produkcyjnych (PPI)
 - 6.4 Indeksy cen i indeksy wartości, handel zagraniczny i indeksy ważne
- VII. Indeksy łańcuchowe
 - 1.1 Argumenty wspierające podejście łańcuchowe
 - 1.2 Własności indeksów łańcuchowych