

Distr.: General
9 December 2013
Arabic
Original: English

المجلس الاقتصادي والاجتماعي



اللجنة الإحصائية

الدورة الخامسة والأربعون

٤-٧ آذار/مارس ٢٠١٤

البند ٤ (ل) من جدول الأعمال المؤقت*

بنود للعلم: المؤشرات الاقتصادية القصيرة الأجل

الإحصاءات الاقتصادية القصيرة الأجل

تقرير الأمين العام

موجز

أعدّ هذا التقرير وفقاً لمقرر المجلس الاقتصادي والاجتماعي ٢٠١٣/٢٣٥. ويصف التقرير المبادرات المشتركة بين شعبة الإحصاءات التابعة لإدارة الشؤون الاقتصادية والاجتماعية، والمكتب الإحصائي للجماعات الأوروبية، المضطلع بها بالتعاون مع هيئة إحصاءات كندا وهيئة إحصاءات إيطاليا وهيئة إحصاءات هولندا ودائرة الإحصاءات الحكومية بالاتحاد الروسي، لتنفيذ برنامج العمل الدولي المتعلق بالإحصاءات الاقتصادية القصيرة الأجل الذي اعتمده اللجنة الإحصائية في دورتها الثانية والأربعين. واللجنة مدعوة إلى أن تحيط علماً بهذا التقرير.

* E/CN.3/2014/1



الرجاء إعادة استعمال الورق

090114 191213 13-60953 (A)



أولاً - التوصيات التي قدمتها اللجنة الإحصائية

١ - في الدورة الثانية والأربعين للجنة الإحصائية، المعقودة في الفترة من ٢٢ إلى ٢٥ شباط/فبراير ٢٠١١، قامت اللجنة، في مقرها ١٠٧/٤٢ (انظر E/CN.3/2011/24، الفصل الأول - باء)، بما يلي:

(أ) وافقت على برنامج العمل المقترح لإحصاءات القصيرة الأجل المتعلقة بالتقديرات السريعة، والمؤشرات المركبة للدورات الاقتصادية، والدراسات الاستقصائية للتوجهات الاقتصادية، ونماذج البيانات، والمؤشرات التحليلية، والهيكلي الإداري المقترح؛

(ب) طلبت أن تؤخذ مقتضيات الحسابات القومية والنظام الإحصائي الوطني وغير ذلك من الترتيبات الإدارية الوطنية في الاعتبار عند تنفيذ برنامج العمل، وطلبت أيضاً أن يولى الاهتمام الواجب لمسألة تحسين البيانات المصدرية؛

(ج) شجعت الدول الأعضاء على أن تنشئ مستودعات مركزية وطنية للبيانات باستخدام معايير تبادل البيانات الإحصائية والبيانات الفوقية على أساس طوعي، وفقاً لنموذج البيانات المقترح والمقبول دولياً، وذلك لكفالة الاتساق مع المبادئ التوجيهية الدولية، وأعربت في الوقت نفسه عن ضرورة إجراء مزيد من المشاورات مع الدول الأعضاء والتحلي بالمرونة عند تحديد الإطار الزمني اللازم لإنشاء مستودعات البيانات المذكورة؛

(د) نوهت بما قامت به المؤسسات الدولية والإقليمية من عمل لتقديم الإرشادات بشأن تجميع المؤشرات الاقتصادية القصيرة الأجل، وحثت شعبة الإحصاءات التابعة لإدارة الشؤون الاقتصادية والاجتماعية على التعاون الوثيق في عملها مع تلك المؤسسات في إعداد البرنامج المتعلق بالإحصاءات الاقتصادية القصيرة الأجل، بغرض تحقيق الاتساق على صعيد الممارسات؛

(هـ) شجعت الدول الأعضاء على المشاركة في التقييمات العالمية المتعلقة بالتقديرات السريعة والمؤشرات المركبة للدورات الاقتصادية، وعلى تقديم ممارساتها المتبعة في تجميع واستخدام المؤشرات الاقتصادية القصيرة الأجل إلى شعبة الإحصاءات لكي تدرجها في قاعدة معارف الإحصاءات الاقتصادية على موقعها الشبكي؛

(و) طلبت إلى شعبة الإحصاءات أن تعين مستشاراً إقليمياً لمساعدة البلدان في مجالي التدريب وبناء القدرات اللازمين للبرنامج الدولي للإحصاءات القصيرة الأجل وأن تعمل بشكل وثيق مع اللجان الإقليمية في هذا المجال؛

(ز) طلبت إلى شعبة الإحصاءات أن تقدم تقريراً إلى اللجنة، في الوقت المناسب، يتضمن برنامج عمل مفصلاً للإحصاءات الاقتصادية القصيرة الأجل، يسلط الضوء على الموارد اللازمة للبرنامج والقيود التي تحد من تنفيذه.

ثانياً - الإجراءات المتخذة

٢ - نظرت اللجنة الإحصائية، في دورتها الثانية والأربعين، في مسألة وضع برنامج عمل دولي بشأن الإحصاءات الاقتصادية القصيرة الأجل، في إطار استجابة إحصائية منسقة للتصدي للأزمة الاقتصادية والمالية. ويتضمن البرنامج الدولي أربعة مواضيع هي: المؤشرات المركبة للدورات الاقتصادية، والدراسات الاستقصائية للتوجهات الاقتصادية، والتقديرات السريعة، ونماذج البيانات والمؤشرات التحليلية. ووافقت اللجنة، في جملة أمور، على إعداد أدلة عن تلك المواضيع بهدف توفير التوجيهات والممارسات الجيدة والمبادئ المتسقة لمساعدة الدول الأعضاء على تجميع إحصاءات قصيرة الأجل يمكن مقارنتها دولياً، والإبلاغ عن تلك الإحصاءات.

٣ - ويجري العمل على قدم وساق في إعداد الأدلة المتعلقة بالمواضيع المذكورة أعلاه، وتضطلع به أفرقة عاملة أنشئت لهذا الغرض تحت إشراف فريق توجيهي معني بالإحصاءات القصيرة الأجل. ويضم الفريق التوجيهي هيئة إحصاءات كندا، والمكتب المركزي للإحصاء بهولندا، ودائرة الإحصاءات الحكومية بالاتحاد الروسي، وشعبة الإحصاءات، والمكتب الإحصائي للجماعات الأوروبية. وترد أدناه مناقشة للتقدم المحرز فيما يتعلق بكل من هذه المواضيع.

ألف - المؤشرات المركبة للدورات الاقتصادية

٤ - تعد المؤشرات المركبة للدورات الاقتصادية مهمة في حد ذاتها لأنها تعالج الشواغل المتصلة بتقييم التغيرات في الأنشطة الاقتصادية في الأجل القصير، إلى جانب كونها جزءاً لا يتجزأ من نظام الإنذار المبكر من حيث تقديم المعلومات عن حدوث فترات الازدهار والركود الاقتصادي وتوقيت تلك الفترات.

٥ - ويهدف برنامج العمل المتعلق بالمؤشرات المركبة للدورات الاقتصادية إلى توفير أفضل الممارسات والمبادئ المتسقة المتعلقة بتجميع تلك المؤشرات والإبلاغ عنها، وهو يشمل نتيجتين هما (أ) إعداد دليل عن المؤشرات المركبة للدورة الاقتصادية، (ب) حصر الممارسات القطرية المتعلقة بالمؤشرات المركبة للدورات الاقتصادية من خلال إجراء تقييم عالمي.

٦ - ويضم الفريق العامل المكلف بإعداد دليل المؤشرات المركبة للدورة الاقتصادية كلاً من المكتب المركزي للإحصاء بهولندا، والمكتب الإحصائي للجماعات الأوروبية،

ومجلس المؤتمر، وشعبة الإحصاءات. ويتولى المكتب المركزي للإحصاء هولندا قيادة الفريق العامل. ويهدف الدليل إلى توفير توجيهات إحصائية بشأن المبادئ المتسقة التي يتعين تطبيقها في صياغة المؤشرات المركبة للدورة الاقتصادية، والمعايير التي يتعين الالتزام بها في جمعها وعرضها. ومن المتوقع أن لا تقتصر الجهات المستفيدة من الدليل على هيئات النظم الإحصائية الوطنية المعنية بتجميع المؤشرات المركبة للدورة الاقتصادية أو التي تطمح إلى عمل ذلك فحسب، بل أن تشمل أيضاً الهيئات الإحصائية المعنية بجمع الإحصاءات الاقتصادية القصيرة الأجل وإنشاء مجموعات البيانات التي تُستخدَم ضمن عناصر البيانات اللازمة لإنشاء المؤشرات المركبة. ويُتَظَر أيضاً أن يكون الدليل بنفس القدر من الأهمية للإحصائيين الرسميين في البلدان النامية.

٧ - ومن المتوقع أن يعمل التوجيه الوارد في الدليل على مساعدة المكلفين بتجميع البيانات الإحصائية على إعداد مؤشرات مركبة للدورات الاقتصادية بطريقة قابلة للمقارنة تمكن من إجراء مقارنات دولية موثوقة للأداء والسلوك الاقتصادي باستخدام أفضل الممارسات الدولية. وبالإضافة إلى ذلك، فإنه سيساعد البلدان التي تخطط لإنشاء نظام أكثر شمولاً للتدابير المتعلقة بالدورات الاقتصادية ليس عن طريق توفير الأسس المنهجية لتجميع بيانات الدورات الاقتصادية أو دورات النمو الاقتصادي فحسب، بل أيضاً بإعطاء توجيهات عملية بشأن فرادى الخطوات والعناصر التي تنطوي عليها عملية التجميع. وعلاوة على ذلك، سيلبي الدليل احتياجات منتجي الإحصاءات القصيرة الأجل ومستخدمي المؤشرات التحليلية من خلال تعريفهم بالطرائق والتقنيات الإحصائية المطبقة في إنشاء المؤشرات المركبة.

٨ - ويتألف الدليل من ٢٥ فصلاً. ويرد في المرفق الأول مخطط عام لمشروح للدليل يتضمن عناوين الفصول ومحتوياتها. وأصبحت المسودات الأولى متوافرة لجميع الفصول تقريباً، ويُتَظَر أن يكون مشروع الدليل جاهزاً في أوائل عام ٢٠١٤ للتشاور بشأنه على الصعيد العالمي، وأن يوضع في صيغته النهائية بنهاية عام ٢٠١٤.

٩ - وخلال المشاورات العالمية المتعلقة بالدليل، ستُجرى دراسة استقصائية للممارسات القطرية المتبعة في تجميع وتعميم المؤشرات المركبة للدورات الاقتصادية، بهدف توسيع نطاق ما هو قائم بالفعل من ممارسات في هذا الصدد. وسيساعد التقييم العالمي أيضاً على استعراض جودة المؤشرات المركبة للدورات الاقتصادية (سيشار إليها فيما بعد باسم المؤشرات المركبة الدورية).

باء - الدراسات الاستقصائية للتوجهات الاقتصادية

١٠ - توفر الدراسات الاستقصائية للتوجهات الاقتصادية معلومات نوعية لا يمكن جمعها باستخدام الأساليب الإحصائية الكمية. وقد ثبت أنها وسيلة غير مكلفة لتوليد معلومات آنية عن التطورات الاقتصادية القصيرة الأجل يمكن اعتبارها عنصراً قيماً مكملاً لنظام الإحصاءات الكمية. وهي تعد أيضاً كجزء لا يتجزأ من نظام للإنذار المبكر إذ أنها توفر معلومات عن حدوث فترات الازدهار والكساد الاقتصادي وتوقيت تلك الفترات.

١١ - ويهدف برنامج العمل المتعلق بالدراسات الاستقصائية للتوجهات الاقتصادية إلى توفير أفضل الممارسات والمبادئ المتسقة التي يتعين اتباعها لإجراء دراسات استقصائية للتوجهات الاقتصادية من حيث اختيار العينات، وتصميم الاستبيانات، وأسئلة الدراسة، وتنفيذ الدراسة، وتجهيز البيانات، وتعميم النتائج، واستخدام المؤشرات المركبة للتوجهات الاقتصادية. ويشمل البرنامج إنجزاً واحداً هو دليل الدراسات الاستقصائية للتوجهات الاقتصادية.

١٢ - ومن أجل إعداد دليل الدراسات الاستقصائية للتوجهات الاقتصادية، شكّل فريق عامل يضم مكتب الإحصاءات الوطني بإيطاليا، ومنظمة التعاون والتنمية في الميدان الاقتصادي، والمعهد الاقتصادي السويسري بزيوريخ (KOF-ETH Zürich)، والمجلس الوطني للتنسيق الإحصائي في الفلبين، والمكتب المركزي للإحصاءات بهولندا، وشعبة الإحصاءات. ويتولى مكتب الإحصاءات الوطني بإيطاليا قيادة الفريق العامل. ويجري العمل على قدم وساق لإعداد الدليل. وقد أسهم أعضاء الفريق العامل في صياغة الفصول وفي استعراض إسهامات أقرانهم. وتولت المفوضية الأوروبية ومكتب الإحصاء الوطني الفرنسي أيضاً مراجعة مسودات فصول الدليل. وأخذ الفريق العامل في اعتباره، في سياق إعداد الدليل، المبادئ التوجيهية الموجودة بشأن هذا الموضوع، المستمدة في المقام الأول من المفوضية الأوروبية ومنظمة التعاون والتنمية في الميدان الاقتصادي. ويوسع الدليل الجديد نطاق المبادئ التوجيهية الحالية حتى تشمل المزيد من القطاعات الاقتصادية ويركز صراحة على احتياجات البلدان النامية في إدارة الدراسات الاستقصائية للتوجهات الاقتصادية. وسيستعين الدليل كذلك بطائفة واسعة من التجارب والخبرات، وسيحدد ممارسات المواءمة التي تركز بوجه خاص على مواءمة قوائم الأسئلة بحسب النشاط الاقتصادي.

١٣ - ومن المتوقع أن يشكل هذا الدليل مجموعة المبادئ التوجيهية المقبولة دولياً التي يمكن تطبيقها على جميع البلدان وعلى الأنشطة الاقتصادية المتعددة. وسيكون مفيداً للمنظمات الإحصائية الوطنية التي تجري بالفعل أو تعتزم إجراء دراسات استقصائية للتوجهات الاقتصادية، كما سيفيد مستعملي الإحصاءات. وسيوفر الدليل توجيهات بشأن تنظيم

عمليات الدراسات الاستقصائية للتوجهات الاقتصادية وتجهيز البيانات المستمدة منها وتحليلها. كما سيساعد الدليل المستعملين بشأن مجالات تطبيق الدراسات الاستقصائية للتوجهات الاقتصادية على حالات الاقتصاد الكلي، كما يعطي توجيهات بشأن تعميم نتائج الدراسات الاستقصائية. والغرض من الدليل هو تلبية احتياجات مستعملي المؤشرات التحليلية عن طريق تعريفهم بالأساليب والتقنيات الإحصائية المستخدمة في إجراء الدراسات الاستقصائية للتوجهات الاقتصادية والمتعلقة بالمؤشرات المركبة للتوجهات الاقتصادية.

١٤ - وترد في المرفق الثاني التفاصيل المشروحة للدليل الذي يتألف من ١٠ فصول. وأصبحت المسودة الأولى متوفرة لجميع الفصول، ويُنتظر أن يكون مشروع الدليل جاهزاً في أوائل عام ٢٠١٤ للتشاور بشأنه على الصعيد العالمي، وأن يوضع في صيغته النهائية بنهاية عام ٢٠١٤.

جيم - التقديرات السريعة

١٥ - التقديرات السريعة التي هي عبارة عن المؤشرات التي يمكن توفيرها في غضون فترة فاصلة قصيرة نسبياً، وهي مهمة في حد ذاتها لأنها تعطي التقدير الرسمي الأول للتغيرات في الأنشطة الاقتصادية في الأجل القصير. وتُعرف هذه المؤشرات بأسماء مختلفة بحسب الفترة المنقضية من وقت إجراء التقديرات حتى توافر البيانات، مقابل الفترة المرجعية للنشاط المقرر أن تقيسه. فعلى سبيل المثال، تُعرف التوقعات (forecasts) بأنها التقديرات التي تُجرى قبل بداية أي فترة مرجعية (ثلاثة أشهر مثلاً)، وتُعرف التقييمات الآنية (nowcasts) بتلك التي تُجرى في غضون الفترة المرجعية المعنية، أما التقديرات العاجلة (flash estimates) فتُجرى بعد نهاية الفترة مباشرة أو بعدها بفترة قصيرة حين تكون المعلومات المصنفة ما زالت غير مكتملة.

١٦ - وتُجمَع التقديرات السريعة (أي التقييمات الآنية، والتقديرات العاجلة، والتقديرات المسبقة/الأولية) بصفة منتظمة في عدد من البلدان، وأصبحت منتجاً إحصائياً مرجعياً لكثير من المؤسسات الإحصائية. ويؤكد الاهتمام المتزايد الذي توليه وسائل الإعلام ومقررو السياسات للتقديرات السريعة أهمية الدور الذي تؤديه تلك التقديرات في توفير تقدير مبكر لمؤشرات الاقتصاد الكلي الرئيسية القصيرة الأجل.

١٧ - ويهدف برنامج العمل المتعلق بالتقديرات السريعة إلى وضع مبادئ توجيهية إحصائية دولية بشأن أفضل الممارسات والمبادئ المتسقة المتبعة في تجميع التقديرات السريعة لمؤشرات الاقتصاد الكلي الرئيسية والإبلاغ عنها. ويشمل برنامج العمل ثلاثة نواتج هي: (أ) مسرد المصطلحات، (ب) دليل التقديرات السريعة، (ج) حصر الممارسات القطرية المتعلقة بالتقديرات السريعة من خلال إجراء تقييم عالمي.

١٨ - ومن المتوقع أن يسهم مسرد مصطلحات التقديرات السريعة في استجلاء الأنماط المختلفة لتلك التقديرات وأغراضها وخصائصها، وأن يرسى فهماً مشتركاً للتقديرات السريعة. وهو موجه للخبراء الإحصائيين الرسميين ومستعملي مؤشرات الاقتصاد الكلي الرئيسية القصيرة الأجل، ويتوقع منه أن يقدم مصطلحات متسقة. وتم الانتهاء من تجميع مسرد المصطلحات المتعلقة بالتقديرات السريعة، وتم الانتهاء تقريباً من تنفيذ موقع "Statistics Explained" على الموقع الشبكي للمكتب الإحصائي للجماعات الأوروبية، مع أنه لا تزال هناك حاجة إلى إقرار الصفحات الأخيرة حتى يتسنى إدخالها في سلسلة التعميم. ورغم أن مسرد المصطلحات منتج قائم بذاته، فإنه سيُرفق أيضاً كضميمة للدليل التقديرات السريعة.

١٩ - ومن أجل صياغة دليل التقديرات السريعة، أنشئ فريق عامل يضم المكتب الإحصائي للجماعات الأوروبية، وشعبة الإحصاءات، والمكتب المركزي للإحصاء بهولندا، والمكاتب الإحصائية الوطنية في جنوب أفريقيا وسنغافورة والمكسيك. ويتولى المكتب الإحصائي للجماعات الأوروبية قيادة الفريق العامل.

٢٠ - ومن المتوقع أن يوفر هذا الدليل توجيهات إحصائية دولية تستند إلى أفضل الممارسات والمبادئ المتسقة المتعلقة بتجميع التقديرات السريعة والإبلاغ عنها. وسيكون الدليل مفيداً بصفة خاصة للمسؤولين الرسميين القائمين على تجميع البيانات الإحصائية ولمستعمليها، كما يحدد أساليب عملية وملائمة لتجميع البيانات والقضايا المتصلة بها، مستعيناً في ذلك بطائفة عريضة من التجارب والخبرات. وقد استفادت عملية إعداد الدليل من التطورات النظرية والعملية التي حدثت مؤخراً في هذا المجال. ويهدف الدليل إلى مساعدة المكلفين بتجميع البيانات الإحصائية على إعداد تقديرات سريعة للمؤشرات الاقتصادية الكلية الرئيسية القصيرة الأجل بطريقة قابلة للمقارنة، باستخدام أفضل الممارسات الدولية. كما يرمي إلى مساعدة البلدان التي تخطط لإنشاء نظام أكثر شمولاً لتقديرات مؤشرات الاقتصاد الكلي الرئيسية على نحو لا يقتصر على توفير الأسس المنهجية المتبعة في تجميع التقديرات السريعة فحسب، بل أيضاً بإعطاء توجيهات عملية بشأن فرادى الخطوات والعناصر التي تنطوي عليها عملية التجميع.

٢١ - ويرد في المرفق الثالث مخطط مشروع للدليل الذي يتألف من ١٢ فصلاً. ويجري العمل حالياً على صياغة الدليل. ونظراً لأنه لا توجد مبادئ توجيهية بشأن هذا الموضوع ولأن الممارسات القطرية ما زالت في مرحلة التطوير، من المتوقع أن تتوفر المسودة الأولى للدليل بحلول الربع الثاني من عام ٢٠١٤ للتشاور بشأنها على الصعيد العالمي، وأن يوضع في صيغته النهائية بنهاية عام ٢٠١٤.

دال - نموذج البيانات والمؤشرات التحليلية

٢٢ - يركز برنامج العمل المتعلق بنموذج البيانات والمؤشرات التحليلية على استحداث نموذج مقبول دولياً للبيانات والبيانات الوصفية للمؤشرات الاقتصادية القصيرة الأجل لأغراض مراقبة الاقتصاد الكلي، والإنذار المبكر بجوانب الضعف الاقتصادي والمالي، وكشف نقاط التحول في الدورات الاقتصادية. ويتكون نموذج البيانات الذي اعتمده اللجنة الإحصائية من ثلاثة مستويات: يتألف المستوى الأول من الحد الأدنى المطلوب من المؤشرات الاقتصادية القصيرة الأجل التي تتسم بأهمية استراتيجية ومتاحة على نطاق واسع؛ ويتألف المستوى الثاني من مؤشرات قصيرة الأجل هامة من المنظور التحليلي ومتاحة على نطاق أضيق؛ أما المستوى الثالث، فيتألف من مؤشرات قصيرة الأجل لها أهمية على الصعيد الوطني بالنظر إلى هيكل الاقتصاد ككل. ويرد نموذج الإحصاءات الاقتصادية قصيرة الأجل في المرفق الرابع.

٢٣ - ويشمل برنامج العمل على منجزات ثلاثة هي: (أ) نموذج بيانات مقبول دولياً مع بيانات وصفية مرجعية مقابلة، (ب) ودليل إحصائي لنموذج البيانات المقبول دولياً وهيكل البيانات الوصفية، (ج) وقاعدة معلومات مستكملة بشأن الإحصاءات الاقتصادية.

٢٤ - وينبغي أن تراعي الصيغة النهائية لاستعراض هيكل نموذج البيانات والبيانات الوصفية في مستوياته الثلاثة آخر المستجدات في المبادرات الدولية الأخرى (مثل المؤشرات العالمية الرئيسية لبلدان مجموعة العشرين) من أجل التوصل إلى نهج شامل لنموذج البيانات والبيانات الوصفية المقبول دولياً، بصرف النظر عن مستوى التنمية في البلد.

٢٥ - وتم إنشاء فريق عامل يتكون من المكتب الإحصائي للجماعات الأوروبية وشعبة الإحصاءات والمكتبين الإحصائيين الوطنيين في البرازيل والهند لإعداد الدليل الإحصائي لهيكل نموذج البيانات والبيانات الوصفية المقبول دولياً. وتتولى شعبة الإحصاءات رئاسة الفريق العامل. وسيشرح الدليل الإحصائي الأوصاف المنهجية لفرادى المؤشرات الاقتصادية القصيرة الأجل واستخدامها. كما سيشرح الخصائص الإحصائية والتحليلية للمؤشرات الاقتصادية القصيرة الأجل، وأهميتها في تفسير النشاط الاقتصادي وعلاقتها بمجموعة متكاملة من الإحصاءات الاقتصادية القصيرة الأجل للحسابات القومية الفصلية والبيانات المكونة لها. ويهدف الدليل إلى مساعدة القائمين على تجميع المؤشرات ومستعملها. وسيضمن وصلات مفيدة تحيل إلى مواد مرجعية لتقديم عروض أكثر تفصيلاً. والمشروع الأول للدليل متوفر الآن، ومن المتوقع أن يكون جاهزاً للمشاورات واسعة النطاق في أوائل عام ٢٠١٤، على أن يُنجز في نهاية العام.

هاء - استكمال قاعدة المعلومات بشأن الإحصاءات الاقتصادية

٢٦ - إن استكمال قاعدة المعلومات بشأن الإحصاءات الاقتصادية هو عمل مستمر ينطوي على إدراج المنهجيات والممارسات القطرية الجديدة والمستكملة.

ثالثا - العمل المستقبلي

٢٧ - ستُدعى البلدان إلى إعداد تقارير عن مبادراتها الرامية لإنشاء مراكز بيانات مركزية لها منفذ وحيد إلى النظام الإحصائي الوطني استنادا إلى نموذج البيانات المقبول دوليا للمؤشرات الاقتصادية قصيرة الأجل. ومن المتوقع أن تغطي الممارسات القطرية الجوانب التي تتعلق بالحوكمة وآليات التنسيق على الصعيد المؤسسي، وبتقييم مدى توفر المؤشرات الاقتصادية قصيرة الأجل ونوعيتها، وباختيار الهياكل الأساسية التقنية المصممة لتبادل البيانات والبيانات الوصفية.

٢٨ - وقد برزت مبادرات إقليمية تعمل من أجل بناء القدرات في البلدان بهدف وضع برنامج لتجميع الإحصاءات الاقتصادية قصيرة الأجل. وتقوم اللجنة الاقتصادية والاجتماعية لآسيا والمحيط الهادئ بتنفيذ برنامج إقليمي عن الإحصاءات الاقتصادية في آسيا والمحيط الهادئ للدول الأعضاء في المنطقة من أجل تطوير القدرة على إنتاج مجموعة أساسية من الإحصاءات الاقتصادية، بما في ذلك المؤشرات الاقتصادية قصيرة الأجل، بما يتواءم مع المعايير الدولية الحالية. أما اللجنة الاقتصادية والاجتماعية لغربي آسيا فهي بصدد تنفيذ مشروع حساب التنمية عن المؤشرات الاقتصادية قصيرة الأجل وذلك لتعزيز القدرات الإقليمية للدول الأعضاء في هذا المجال بصورة خاصة، وفي مجال الإحصاءات الاقتصادية والحسابات القومية بصورة أعم.

٢٩ - وستُدرس الخبرات المرتبطة بهذه الجهود الإقليمية، وقد تكون بمثابة أساس لوضع مبادئ توجيهية تستخدمها مناطق أخرى تخطط للقيام بعمليات مماثلة.

٣٠ - لم يكن بالإمكان تعيين مستشار أقاليمي لتمثل وظيفته في مساعدة البلدان في التدريب وبناء القدرات اللازمة لتنفيذ البرنامج الدولي للإحصاءات قصيرة الأجل والعمل بشكل وثيق مع اللجان الإقليمية في هذا المجال، وذلك بسبب نقص الموارد.

رابعا - الاستنتاجات

٣١ - واللجنة مدعوة للإحاطة علما بهذا التقرير.

المرفق الأول

دليل المؤشرات المركبة الدورية

جدول المحتويات

الفرع ١: مقدمة وتعريف

الفصل ١: مقدمة ولحمة عامة عن الدليل

يقدم الفصل الأول لحمة عامة مقتضبة عن التعاريف الرئيسية للدورات الاقتصادية ومؤشراتها، مرفقة بوصف لتصنيفات توقيت الدورات الاقتصادية (التمييز بين المؤشرات المبكرة والمتزامنة والمتأخرة). وتلي ذلك مناقشة موجزة لفائدة المؤشرات المركبة الدورية في عمل المحللين، ووضعي السياسات، وصانعي القرار في قطاع الأعمال التجارية والقطاع غير الربحي ومزاياها وعيوبها؛ وتكاليف وفوائد مشاركة المؤسسات الإحصائية المباشرة في تجميع المؤشرات المركبة الدورية؛ ولحمة موجزة عن الدليل.

الفصل ٢: تاريخ موجز لقياس الدورة الاقتصادية وتحليلها

يعرض هذا الفصل النظريات البديلة للتقلبات الدولية، بما في ذلك النظريات الخارجية والداخلية. كما ينبغي إدراج تصنيف للحركات الدولية بسحب مدتها وخصائصها الأساسية. وينبغي كذلك تضمين هذا الفصل استحداث أدوات للرصد الدولي، بدءاً من النهج البيانية البحتة إلى المقاييس البسيطة والمعقدة. ويجب أن ينتهي الفصل ٢ بمناقشة لأعمال برنيز ومنتشل وعرض لنهج المكتب الوطني للبحوث الاقتصادية الذي انبثق من عملهما في رصد الدورات الاقتصادية. وينبغي ذكر نهج منسكي الذي وُضع في خمسينيات القرن الماضي باقتضاب، ويقوم هذا النهج على دورة النمو (وكذلك أعمال منتز في أواخر ستينيات القرن الماضي والتي تلتها أعمال كلاين ومور).

الفصل ٣: تعاريف وتصنيفات المؤشرات

يقدم هذا الفصل تعاريف واضحة للمؤشرات المركبة ويصنفها بدءاً بالتمييز فيما بين المؤشرات المبكرة والمتزامنة والمتأخرة، التي أتى الفصل ١ على ذكرها بشكل عام.

ويصنف هذا الفصل المؤشرات بحسب ما يلي:

- الهدف (توقع الدورات الاقتصادية أو نقاط التحول أو معدلات النمو)

- نوع البيانات المستخدمة (بيانات نوعية حصراً، أو بيانات كمية حصراً، أو بيانات مختلطة، أو استخدام المتغيرات المالية أو عدم استخدامها، أو استخدام بيانات غير ملموسة من قبيل مؤشرات المشاعر، أو مؤشرات المناخ أو مؤشرات الانتشار مقابل استخدام البيانات الكمية)
 - مخطط التجميع (تجميع موضوعي، أو تجميع قائم على أساليب غير معيارية أو معيارية أو شبه معيارية)
 - النهج والأدوات الإحصائية المستخدمة لإجراء عملية التقدير وانتقاء البيانات (نهج برنز ومنتشل التقليدي، والمؤشرات المستندة إلى العوامل والمكونات الرئيسية؛ والمؤشرات المستندة إلى سلسلة زمنية، والمؤشرات المستندة إلى الارتداد)
- ومما أن هذا الفصل يرمي إلى عرض الإطار العام للمؤشرات وتقديم لمحة عامة عن أنواعها المختلفة، فلن يحتوي على تفاصيل تقنية كثيرة عن هذه المؤشرات وسيكتفي بشرح بسيط للعناصر الحداثية أو التحفيزية لمساعدة المستعملين (والمنتجين) على فهمها بصورة أفضل. وستقدم التفاصيل في الفصول اللاحقة بحسب قائمة المحتويات. وسيعرض الفصل أيضاً أمثلة بسيطة جداً.

الفرع ٢: متطلبات البيانات

الفصل ٤: توافر البيانات وتواترها وتقنيات التعديل

يبحث هذا الفصل في المسائل المتصلة بالبيانات: البيانات الناقصة، والبيانات غير المتوافرة بالوتيرة المنشودة، والبيانات غير المباشرة، ومسائل التحول، أي التعديلات الفصلية والتقويمية، والانكماش، والمسائل المتعلقة بالفترة الزمنية التي تغطي البيانات المعنية أي الحساب الرجعي. ويجب أن يعرض هذا الفصل الشروط الأساسية التي ينبغي توفرها في البيانات لاستحداث نظم للمؤشرات واستخدامها. ويناقش الفصل كذلك الصعوبات التي تواجهها المؤسسات الإحصائية في استيفاء هذه المتطلبات، وسبل تحطّي تلك الصعوبات.

الفرع ٣: تقنيات انتقاء المتغيرات والنماذج

الفصل ٥: لمحة عامة

يعطي هذا الفصل المعنون "تقنيات المتغيرات والنماذج" لمحة عامة عن الموضوع الذي نوقش في الفرع ٣ ووصفاً لهيكل الفصول الواردة في هذا الفرع. ويبحث في مسألة تحديد المتغيرات الأكثر فائدة لرصد حركة الدورات الاقتصادية والتنبؤ بها؟

الفصل ٦: استعراض تقنيات انتقاء المتغيرات والنماذج البارامترية واللابارامترية

يصف هذا الفصل بأسلوب تعليمي النهج البديلة البارامترية، وشبه البارامترية واللابارامترية لانتقاء المتغيرات والنماذج. وبما أن تقنيات الانتقاء تؤدي دورا حاسما في استحداث المؤشرات المركبة (المتغيرات والنماذج)، فينبغي أن يكون هذا الفصل شاملا للغاية في عرض فائدة كل تقنية من هذه التقنيات. ولذلك، يجب إدراج تحليل مقارن للتقنيات البديلة يعرض نقاط ضعفها وقوتها، ويبين كذلك مزاياها وعيوبها.

وستعرض بعض الأمثلة التي تتعلق تحديدا باستحداث المؤشرات المركبة لتكون بمثابة توجيه عملي عند استخدام هذه التقنيات.

الفصل ٧: مقارنة بين مجموعات البيانات غير المتماثلة الكبيرة والصغيرة

يصف هذا الفصل طريقة العمل مع مجموعات البيانات غير المتماثلة الكبيرة والصغيرة لاستحداث مؤشرات دورية مركبة.

الفرع ٤: مؤشرات قياس الحركات الدورية

الفصل ٨: ملحة عامة

يتضمن هذا الفصل ملحة عامة عن الموضوع الذي يناقشه هذا الفرع ووصفا لهيكل فصوله. وتبحث فصول هذا الفرع في طريقة قياس الحركات الدورية بمساعدة المؤشرات المركبة.

الفصل ٩: نهج منظمة مجلس المؤتمر

يصف هذا الفصل النهج الذي تتبعه منظمة مجلس المؤتمر إزاء استحداث مؤشرات دورية مركبة. ويصف كذلك بوضوح مبررات اختيار الدورة المرجعية، ونهج انتقاء المتغيرات، وخطة التجميع، وما إلى ذلك. ويقدم الفصل أيضا أوجه الشبه والاختلاف الرئيسية بين هذا النهج ونهج المكتب الوطني للبحوث الاقتصادية، ويبحث في آخر التغيرات والتحسينات التي اقترحت بعد الأزمة الاقتصادية والمالية العالمية.

وتستخدم أمثلة من المؤشرات الموجودة التي نشرتها منظمة مجلس المؤتمر لبلدان غير الولايات المتحدة الأمريكية في عرض استحداث هذه المؤشرات خطوة خطوة وإظهار إمكانية تكييفها بحسب السمات الاقتصادية لكل بلد.

الفصل ١٠: طرق التجريد من الاتجاه: مقارنة بين الطرق البارامترية واللابارامترية والطريقة ذات المتغير الواحد والطريقة المتعددة المتغيرات

يصف هذا الفصل أهم إجراءات التجريد من الاتجاه واستخراج العنصر الدوري باستخدام المرشحات. كما يتضمن تصنيفا واضحا للنهج، ووصفا جليا لعمل كل طريقة وعرضا لمزاياها وعيوبها الرئيسية. ويتطرق الفصل للمشاكل المتعلقة بتقدير نقطة النهاية التي تميز بعض الطرق المقترحة، وكذلك سبل حل تلك الصعوبات في نهاية المطاف.

وثمة مشاكل إضافية يناقشها هذا الفصل أيضا، ترتبط باختيار طول الحزمة ونطاق بارامتر التمهيد والمطابقة بين المرشحات غير المحدودة والمرشحات المحدودة. وينبغي توعية المستعملين بالفرق بين الاعتماد على تعريف تحديدي محض للدورة والاعتماد على تعريف احتمالي لها، وسمات الأساليب المرتبطة بكل منهما. كما ينبغي مناقشة نموذج العناصر المهملة، كإطار مرن لاستحداث الاتجاه والدورة، من خلال دمج نهج تحديدي محض ونهج احتمالي محض في نهج يستند إلى البيانات بصورة تامة وذلك من أجل بلوغ أفضل تعريف لتلك العناصر.

وتُستخدم أمثلة لفتح الباب أمام مناقشة نتائج استخدام مختلف الطرق ومختلف الأطر لمرشّح معين (مرشّح هودريك - بريسكوت) على سبيل المقارنة.

الفصل ١١: نهج منظمة التعاون والتنمية في الميدان الاقتصادي

سيتضمن هذا الفصل بالتفصيل وصفا لعملية استحداث المؤشرات المبكرة المركبة. ويجب أن يذكر مبرر اختيار الدورة المرجعية بوضوح وأن يشرح النهج المتبع في اختيار المتغيرات وكذلك طرق التجريد من الاتجاه وخطة التجميع. ويعرض هذا الفصل أوجه الاختلاف وكذلك أوجه الشبه الأساسية عن النهج الأولي، بالاستناد إلى ما يسمى حوارزمية اتجاه المتوسط المحلي، هذا بالإضافة إلى أحدث التحسينات المنهجية، بما في ذلك تلك التي تلت الأزمة الاقتصادية والمالية العالمية.

وسوف تُستخدم الأمثلة المستمدة من المؤشرات المبكرة الموجودة لبعض الدول الأعضاء كأساس لوضع دليل لاستحداث المؤشرات المبكرة المركبة خطوة خطوة، يُظهر إمكانية تكييف المؤشرات بحسب السمات الاقتصادية لكل بلد.

الفصل ١٢: نهج ستوك وواتسن

يقدم هذا الفصل وصفا لنهج ستوك وواتسن لاستحداث المؤشرات المركبة الدورية.

الفرع ٥: مؤشرات كشف نقاط التحول

الفصل ١٣: لمحة عامة

يتضمن هذا الفصل لمحة عامة عن الموضوع الذي يناقشه هذا الفرع ووصفا لهيكل الفصول، ويتطرق لمسألة كيفية استخدام المؤشرات لتحديد نقاط التحول في الأعمال التجارية وفي دورات النمو وكشفها. وسوف تناقش هذه اللوحة العامة أيضا خوارزمية براي - بوشان القائمة على نهج المكتب الوطني للبحوث الاقتصادية. ويناقش الفصل الأخير أيضا عملية توقع نقاط التحول.

الفصل ١٤: النماذج البديلة للمؤشرات المركبة لنقاط التحول

يقدم الفصل لمحة عامة عن التقنيات غير الخطية البديلة المتاحة القائمة على السلاسل الزمنية وعمليات الارتداد، فضلا عن تقنيات الارتداد الثنائي (الاحتمالية، واللوغاريتمية) اللازمة لوضع مؤشرات مركبة لنقاط التحول (لكن في عجلة شديدة نظرا لأن الموضوع سيجري تحليله بشكل متعمق في فصل آخر). وسوف يجري إيضاح القيمة المضافة لاستخدام التقنيات غير الخطية بدلا من الخطية في هذا المجال بالتحديد. وسوف تناقش بوضوح مزايا وعيوب كل نهج مع التركيز بصفة خاصة على العلاقة التبادلية بين عنصر الوقت والموثوقية وخطر توجيه إشارات خاطئة.

كما تعالج في هذا الفصل المشاكل المتصلة بالسبل المثلى لتحديد العتبة، عند الاقتضاء، واستخدام قاعدة رقابية لمنع ورود إشارات خاطئة أو الحد منها. ولن يُشار إلى المشاكل المتعلقة باختيار الدورة أو الدورات المرجعية إلا بشكل هامشي نظرا لأنها ستعالج بتفصيل أكبر في فصول أخرى. وستقدم بعض الأمثلة التوضيحية؛ إلى جانب مقارنات بين نموذج ماركوف للتحويل ونموذج عتبة الاستثارة الذاتية الذاتي الارتداد.

الفصل ١٥: المؤشرات المركبة لكشف نقاط التحول في إطار (ABCD)

يتناول هذا الفصل وصفا لتعاريف وخصائص الدورات البديلة ويناقش بإيجاز المشكلة المتعلقة باختيار الدورة المرجعية اللازمة لوضع مؤشرات لنقاط التحول. كما يعرض ميزة رصد عدة أنواع من الدورات معا باستخدام نهج (ABCD) أو النسخة المطولة منه ($\alpha AB\beta CD$). ويرد أيضا وصف النظامين بشيء من التفصيل في شكل بياني. ويتناول الفصل بإيجاز عملية التأريخ التقليدية التي تستند أساسا إلى طرق حسابية غير بارامترية في التأريخ، مع وصف موجز للطريقة الحسابية المقترحة. وسيكون التركيز الرئيسي على استخدام مثل هذا التأريخ كأداة للمقارنة، بين مواصفات بديلة تاريخية وآنية لمؤشرات

نقاط التحول المتطابقة. ويناقش في الفصل، وضع مؤشرات نقاط التحول لأنواع مختلفة من الدورات مع التركيز في المقام الأول على تحديد مجموعة البيانات المناسبة؛ وتقنيات الاختيار المتباينة؛ واختيار النماذج؛ وتقييم النماذج؛ ومعايير تقييم المؤشرات. وتعالج أيضا مشكلة تحويل البيانات، وعدد النظم ونظام الترجيح المستخدم في وضع المؤشرات المركبة. وعلى النقيض من ذلك، سيجري تناول المشاكل المتصلة بتعريف العتبات واستخدام القواعد الرقابية بشكل طفيف، حيث ستعالج باستفاضة أكبر في فصول أخرى. وأخيرا، سيتضمن الفصل أيضا عرضا لنماذج متعددة المتغيرات تتعامل بشكل متزامن مع دورات أكثر تحديدا على نحو يكفل التسلسل المنطقي الآلي لنقاط التحول. وسوف تستخدم حالة المؤشرات المركبة لنقاط التحول في منطقة اليورو كمثال رئيسي لتوجيه القارئ على مدار الفصل. وسيقدم مزيد من الأمثلة إذا اقتضت الحاجة لتعزيز النطاق العام لهذا الفصل. ويمكن أن تدور الأمثلة حول وضع مؤشرات مركبة لنقاط التحول في بعض الدول الأعضاء في الاتحاد الأوروبي، وربما أيضا خارج الاتحاد الأوروبي.

الفصل ١٦: نهج الاحتمالات واللوغاريتمات

يناقش الفصل بالتفصيل استخدام تقنيات الارتداد لوضع مؤشرات لنقاط التحول. ويركز الفصل أساسا على نهج الاحتمالات واللوغاريتمات لكن يمكن أن ترد أيضا إشارة إلى تقنيات الارتداد. ويناقش هذا الفصل أيضا كيفية استخدام هذه النماذج الثنائية الارتداد للتنبؤ بنقاط التحول وقت حدوثها فعليا. وستدرس الخصائص الرئيسية لهذين النهجين، وكذلك المزايا والعيوب المقارنة للنهج القائمة على السلاسل الزمنية. وستطرح أمثلة لبيان كيفية وضع المؤشرات ودورها في التعرف على نقاط التحول.

الفرع ٦: مؤشرات قياس النمو الاقتصادي

الفصل ١٧: لمحة عامة

يقدم الفصل لمحة عامة عن الموضوع المطروح في هذا الفرع مع وصف لبنية فصوله. ويتناول هذا الفرع النهج المختلفة لاستخدام المؤشرات المركبة من أجل قياس النمو الاقتصادي والتقلبات الاقتصادية.

الفصل ١٨: نماذج تستند إلى عامل ناقل ذاتي الارتداد: المؤشرات المبكرة الآلية

يقدم هذا الفصل ما يشار إليه عادة باعتباره نهج "المؤشرات المبكرة الآلية" ويعرض بالتفصيل الهدف من هذا المؤشر، ومرحلي الاختيار المتغير والتقدير. وسيناقش أيضا تمديد

حالة المتغيرات المتكاملة في مجموعة البيانات. وسيساعد استخدام بعض الأمثلة في تبيان خطوات وضع المؤشرات وتصوير فائدة هذا النهج.

الفصل ١٩: النماذج التي تعتمد على عامل اتساع النطاق

يصف هذا الفصل على نحو مفصل نهج وضع المؤشرات الرئيسية المركبة استناداً إلى نموذج يعتمد على عامل اتساع النطاق. ويشمل الوصف النهج المسمى (Eurocoin) ومتغيراته والتطور الذي أدخله المصرف المركزي الأوروبي عليه على مدى الأعوام القليلة الماضية. وترد أيضاً إشارات إلى تطبيقات أخرى لهذا النهج مثل التطبيق الذي اعتمده المفوضية الأوروبية في أوائل العقد الأول من الألفية الجديدة. وسيتضمن هذا الفصل تحليلاً للأساس المنطقي لهذا النهج وبيانا لمزاياه وعيوبه بالمقارنة مع النهج الأخرى التي تستند إلى نماذج تعتمد على عاملي الحجم الصغير أو المتوسط أو على تقنيات الارتداد. وستبين الأمثلة كيفية عمل مختلف التقنيات في إطار هذا النهج بشكل عملي.

الفصل ٢٠: الارتداد والمكونات الرئيسية والنماذج التي تعتمد على عامل الحجم الصغير

يتضمن هذا الفصل وصفاً لعملية وضع مؤشرات مركبة للنمو بالاستناد إلى نماذج الارتداد. ويعرض بصفة خاصة نهج الاختيار المتغيرة ولوغاريتماتها (زاوية الارتداد الصغرى، على سبيل المثال)، فضلاً عن نماذج الارتداد البديلة التي تعتمد على الارتداد لسد الفجوات أو الارتداد المرتبط بعامل ما. وستقدم أيضاً نماذج للناقلات ذاتية الارتداد ويركز الفصل على المؤشرات التي تعتمد على نماذج صغيرة الحجم/متوسطة الحجم (ترد النماذج الواسعة النطاق في فصل آخر). ولن يتم التطرق إلى ما يسمى نماذج المؤشرات المبكرة الآلية مثل نماذج كامبا منديز وويل لأنها سبق أن نوقشت في فصل آخر. وسيجري التطرق أيضاً إلى معايير التقييم والاختبارات. وستقدم أمثلة تعتمد على الناتج المحلي الإجمالي في منطقة اليورو وبعض الدول الأعضاء لتوضيح مختلف النهج. ومن الممكن أن يتم إكمالها ببعض الأمثلة من بلدان غير أوروبية حال توفرها.

الفرع ٧: التحقق

الفصل ٢١: لمحة عامة

يقدم الفصل لمحة عامة عن الموضوع المطروح في هذا الفرع مع وصف لبنية فصوله. ويركز هذا الفرع على سؤالين وهما ما هو مدى فائدة المؤشرات المركبة؟ وما هي أفضل النهج لتقييم المؤشرات المركبة؟

الفصل ٢٢: إنشاء قواعد بيانات آنية وفائدتها

المسائل الأساسية المرتبطة بإنشاء قاعدة بيانات آنية، وفائدة قاعدة البيانات الآنية في التحقق من المؤشرات المركبة الدورية ستكون موضوع هذا الفصل.

الفصل ٢٣: محاكاة آنية

يصف هذا الفصل كيفية إجراء تجربة آنية للتحقق من المؤشرات المركبة الدورية؛ ويتطرق لدراسة قواعد البيانات القديمة والتجارب شبه الآنية.

الفصل ٢٤: التحقق بواسطة المؤشرات المتأخرة أو غير ذلك من المعلومات الخارجية

يناقش هذا الفصل استخدام الهيكل المتقدم - المطابق - المتأخر للتحقق من المؤشرات؛ واستخدام السلاسل الزمنية القائمة وغيرها من المعلومات التاريخية لنفس الغاية.

الفرع ٨: المبادئ التوجيهية لوضع المؤشرات المركبة الدورية

الفصل ٢٥: المبادئ التوجيهية لوضع المؤشرات المركبة الدورية

يناقش هذا الفصل أفضل الممارسات لوضع المؤشرات المركبة الدورية.

ويقدم دليلاً تنفيذياً لوضع مختلف أنواع المؤشرات المركبة الدورية خطوة خطوة.

المرفق الثاني

دليل الدراسات الاستقصائية المعنية بالتوجهات الاقتصادية

قائمة المحتويات

١ - مقدمة

١-١ الأهداف الرئيسية للدليل

٢-١ البيانات النوعية: خصائص الإحصاءات الاقتصادية وموقعها في النظام

٣-١ استخدام الدراسات الاستقصائية المعنية بالتوجهات الاقتصادية

٤-١ عملية الدراسة الاستقصائية

٥-١ المخطط العام للدليل

٢ - إجراء الدراسات الاستقصائية المعنية بالتوجهات الاقتصادية: النطاق والتصنيفات

١-٢ نطاق الدراسات الاستقصائية المعنية بتوجهات الأعمال التجارية

- التغطية القطاعية

- التغطية الإقليمية

- المبادئ الأساسية للأسئلة

٢-٢ نطاق الدراسات الاستقصائية المعنية بتوجهات المستهلكين

٣-٢ قائمة التعاريف

٣ - تصميم الاستبيان

١-٣ الاعتبارات العامة

١-٣-١: الدراسات الاستقصائية المعنية بتوجهات الأعمال التجارية

والمستهلكين: الاختلافات الرئيسية

٢-١-٣ صياغة الأسئلة

٣-١-٣ اختيار الموضوع والقطاعات

٤-١-٣ المقياس

- ٥-١-٣ الفترة المرجعية
- ٦-١-٣ الموسمية
- ٧-١-٣ معلومات هيكلية عن المستجيبين للاستقصاء
- ٨-١-٣ الاختبارات السابقة للاستبيان
- ٢-٣ مثال على استبيان منسق
- ١-٢-٣ الدراسات الاستقصائية المعنية بتوجهات الأعمال التجارية التي تجرى بوتيرة شهرية
- ٢-٢-٣ الدراسات الاستقصائية المعنية بالتوجهات التجارية التي تجرى بوتيرة فصلية
- ٣-٢-٣ الدراسات الاستقصائية المعنية بالتوجهات التجارية التي تجرى بوتيرة نصف سنوية
- ٤-٢-٣ الدراسات الاستقصائية المعنية بتوجهات المستهلكين التي تجرى بوتيرة شهرية وفصلية
- ٤ - الدراسات الاستقصائية المعنية بتوجهات المستهلكين: إطار الاستقصاء، وتصميم العينات، وعملية التقدير**
- ١-٤ مقدمة
- ٢-٤ عينة الدراسة الاستقصائية المعنية بتوجهات المستهلكين
- ١-٢-٤ إطار الدراسة الاستقصائية
- ٢-٢-٤ أخذ عينات احتمالية مقابل عينات غير احتمالية
- ٣-٢-٤ جوانب تصميم العينات (معايير الاختيار، والتوزيع)
- ٤-٢-٤ المزيد عن العينات
- ٥-٢-٤ حجم العينة
- ٣-٤ إجراءات التقدير والدقة
- ١-٣-٤ ترجيحات العينة (الاحتمالات) (عكس احتمالية الاختيار)
- ٢-٣-٤ ترجيحات السكان

٤-٣-٣ الخطأ في أخذ العينة وأثره على التصميم

٥ - الدراسات الاستقصائية المعنية بتوجهات الأعمال التجارية: تصميم العينات وإجراءات التقدير

١-٥ مقدمة

٢-٥ إطار الدراسة الاستقصائية

٣-٥ اختيار الوحدات

٤-٥ تصميم العينات

١-٤-٥ الاختيار البسيط للعينات عشوائيا

٢-٤-٥ تقسيم العينات العشوائية إلى شرائح

١-٢-٤-٥ لماذا التقسيم إلى شرائح؟

٢-٢-٤-٥ كيفية التقسيم إلى شرائح؟

٣-٢-٤-٥ توزيع الوحدات على الشرائح

١-٣-٢-٤-٥ التوزيع النسبي

٢-٣-٢-٤-٥ توزيع نيمنان Neyman

٣-٢-٢-٤-٥ ملاحظة أخيرة على حجم العينة - قاعدة ال ٣٠

٣-٤-٥ تصميم العينة (الاحتمالية بالنسبة إلى الحجم)

٥-٥ استقصاءات الأفرقة .

٦-٥ المقدرين ومدى دقتهم

٦ - جمع البيانات

١-٦ جمع البيانات: وضع الاستراتيجية

١-١-٦ جمع البيانات الأولية

٢-١-٦ استراتيجية جمع البيانات: أسلوب الاستقصاء والاتصالات مع المستجيبين

٣-١-٦ وضع محددات لتصميم عملية جمع البيانات

٢-٦ تصميم عملية جمع البيانات

١-٢-٦: ما قبل الاستقصاء: الأعمال التحضيرية والاتصالات

٢-٢-٦ العمل الميداني: جمع البيانات

٣-٢-٦ تدابير تعزيز الاستجابة

٣-٦ تنظيم جمع البيانات

١-٣-٦ تدريب القائمين بالتعداد

٢-٣-٦ المرافق التقنية والوثائق

٧ - إدارة مصادر الأخطاء التي لا تتصل بأخذ العينات

١-٧ الأخطاء التي لا تتصل بأخذ العينات

١-١-٧ أخطاء التغطية

٢-١-٧ أخطاء القياس والتجهيز

٣-١-٧ عدم الاستجابة

٢-٧ معالجة عدم الاستجابة

١-٢-٧ معدلات الاستجابة المرجحة وغير المرجحة

٢-٢-٧ افتراض القيمة

٨ - تجهيز بيانات الدراسات الاستقصائية المعنية بالتوجهات

١-٨ تقسيم الأسئلة المتعددة الاختيارات إلى سلاسل زمنية

١-١-٨ مقدمة

٢-١-٨ إحصاءات التوازن

٣-١-٨ مؤشرات النشر

٤-١-٨ النهج الاحتمالي وغيره من الأساليب

٥-١-٨ الأسلوب الذي يسند إلى أنماط ردود فرادى الشركات

٦-١-٨ نهج "التصنيف"

٢-٨ التعديلات الموسمية

١-٢-٨ الأنماط الموسمية في بيانات استطلاع الرأي

٢-٢-٨ المبادئ العامة للتعديلات الموسمية في بيانات الاستقصاءات المعنية بتوجهات الأعمال التجارية والمستهلكين

٣-٢-٨ الحلول المعتمدة على نطاق واسع لإجراء تعديلات موسمية

المرفق

٩ - تعميم البيانات ونشرها

١-٩ البيانات الفوقية

١-١-٩ إطار أخذ العينات

٢-١-٩ العينة

٣-١-٩ معدلات الاستجابة

٤-١-٩ معالجة عدم الاستجابة

٥-١-٩ الترجيح

٦-١-٩ التغطية القطاعية

٧-١-٩ التواتر الدوري

٨-١-٩ الطريقة الميدانية

٢-٩ إجراءات النشر

١-٢-٩ أنواع المستعملين

٢-٢-٩ معايير الجودة

٣-٢-٩ الجدول الزمني للإصدار

٤-٢-٩ أشكال النشر

١-٤-٢-٩ النشرات الصحفية

٢-٤-٢-٩ تقارير المحللين

٩-٢-٤-٣ التقارير الخاصة

٩-٢-٤-٤ الرسوم البيانية والجداول وقواعد البيانات

٩-٢-٤-٥ الموقع الشبكي

٩-٢-٥ السرية

٩-٢-٦ التنقيحات

١٠ - استخدام نتائج الدراسات الاستقصائية المعنية بالتوجهات

١-١٠ مستعملو بيانات الدراسات الاستقصائية

٢-١٠ الاستفادة من بيانات الدراسات الاستقصائية

١-٢-١٠ المؤشرات المركبة للدورات الاقتصادية

١-٢-٢ التنبؤ باستخدام بيانات الدراسات الاستقصائية

١-٢-٣ أدوات الرؤية

١-٢-٤ ثقة المستهلكين، وتحليل سياسات الاقتصاد الكلي، والدورات الاقتصادية

١-٢-٥ أساليب الاقتصاد القياسي البالغ الصغر

المرفق الثالث

دليل التقديرات السريعة

المحتويات

التقديرات السريعة: الإطار المفاهيمي والعملي؛ والمبادئ التوجيهية

الفرع الأول: مسائل عامة

الفصل ١: مقدمة: أهداف التقديرات السريعة وتعريفها، وتكاليفها، وفوائدها

سيناقش الفصل أهمية تقديم معلومات اقتصادية لواضعي السياسات، وصانعي القرارات، والمحللين في الوقت المناسب. وسيقدم أيضا مسألة المفاضلة بين حسن التوقيت والدقة وسيحدد مزايا التقديرات السريعة وعيوبها. وسيناقش أيضا المسألة المتمحورة حول التقديرات السريعة باعتبارها وسيلة لتقديم معلومات آنية كلما عجزت عملية الإعداد العادية عن استيفاء الشروط المتعلقة بحسن التوقيت. وسيقدم الفصل في الأخير نظرة عامة عن الدليل.

الفصل ٢: وضع نظام للتقديرات السريعة: منتجات مختلفة لأغراض مختلفة

سيقدم الفصل التقديرات السريعة على أنها تشكل مجموعة مترابطة من المنتجات الإحصائية التي يمكن التعرف عليها بوضوح من حيث التقنيات الإحصائية المستخدمة ومجموعة المعلومات التي تدخل فيها، وما إلى ذلك. وسيستند الفصل في المقام الأول إلى النتائج الواردة في مسرد التقديرات السريعة؛ بيد أنه بالرغم من أن المسرد (المقدم في مرفق) سيعطي وصفا يتسم بطابع رسمي أكبر لمختلف المنتجات، فإن الفصل نفسه سيقدّم نظام التقديرات السريعة على نحو غير تقني وتجميعي وسهل الفهم.

الفصل ٣: التنبؤ بالحالة المستقبلية والراهنة لتغيرات الاقتصاد الكلي: استعراض منهجي

سيقدم هذا الفصل استعراضا منهجيا مطولا لتقنيات التنبؤ بالحالة المستقبلية والراهنة، بما في ذلك آخر التطورات. وسيكون هذا الفصل ذا طابع تقني وسيتضمن محتوى إحصائيا واقتصاديا قويا.

الفرع الثاني: الجوانب الرئيسية للتقديرات السريعة

الفصل ٤: المفاضلة بين حسن التوقيت والموثوقية: منظور وكالة إحصائية

سيقدم هذا الفصل بالتفصيل المفاضلة بين حسن التوقيت والدقة. وسيناقش عملية جمع المعلومات التي تضطلع بها إحدى الوكالات الإحصائية ويربطها بدرجة دقة التقديرات. ومن الناحية النظرية، وبحلول نهاية الفترة المرجعية التي يقاس خلالها متغير اقتصادي معين، يبدأ توافر المعلومات تدريجياً، ويفترض أن يزداد مقدار تلك المعلومات مع مرور الزمن. ومن الممكن، في مراحل مختلفة بعد انتهاء الفترة المرجعية، ربط مختلف تقديرات المتغير التي يتم الحصول عليها على نحو مشروط والتي تتسم بدرجات مختلفة من الدقة، بالمعلومات المتاحة.

الفصل ٥: نُهج اختيار المتغيرات، وبنية مجموعات المعلومات ومختلف أنواع التقديرات السريعة

سينصب التركيز في هذا الفصل على بنية ومحتوى مجموعة المعلومات المستخدمة من أجل استخلاص أنواع متعددة من التقديرات السريعة. وسيناقش الفصل القيود التي تميز مختلف مجموعات المعلومات. ومن المفترض على سبيل المثال، أن تكون التقديرات الآنية مبنية على مجموعة معلومات لا يمكن أن تشمل متغيرات تعتبر مقبولة من أجل التنبؤ بالحالة الراهنة. وسيتم تقديم عدة أمثلة لتوضيح هذه النقطة على نحو أفضل. وفي الجزء الثاني، سيقدم الفصل تقنيات لاختيار المتغيرات، يمكن أن تكون مفيدة عند الحاجة إلى الحد من أبعاد حيز المتغيرات و/أو تحديد المتغير أو مجموعة المتغيرات الأنسب من أجل استخدامها.

الفصل ٦: اختيار النموذج، ومواصفات النموذج، والأنواع المختلفة للتقديرات السريعة

يعتبر تحديد النموذج الإحصائي عنصراً رئيسياً آخر يميز بين مختلف أنواع التقديرات المختلفة. وسيقدم الفصل النماذج الإحصائية الأنسب لإنتاج نوع معين من التقديرات السريعة. ففي حالة التقديرات الآنية على سبيل المثال، ينبغي أن يكون النموذج الإحصائي المختار مائلاً، قدر الإمكان، للنموذج المستخدم في عملية الإنتاج العادية، بينما يمكن، في حالة التنبؤ بالحالة الراهنة، استخدام مجموعة متنوعة أوسع من النماذج (نماذج الارتداد، ونماذج السلاسل الزمنية، إلخ). وسيقدم الجزء الثاني من الفصل تقنيات اختيار النموذج، التي ستكون مفيدة بوجه خاص في تحديد النموذج الأنسب للتمييز بين النماذج المتنافسة.

الفصل ٧: نماذج التواترات المتباينة والتقديرات السريعة

سيقدم هذا الفصل نظرة عامة عن أحدث التقنيات التي تتيح وضع نماذج للبيانات المتاحة بتواتر مختلف. وستناقش مزايا وعيوب مختلف التقنيات. وسيناقش الفصل أيضا فوائد التقديرات السريعة المرتبطة بإمكانية وضع نماذج للبيانات المتاحة بتواتر مختلف.

الفصل ٨: المزج بين تقنيات التنبؤ بالحالة المستقبلية والتقديرات السريعة

في الحالة التي يكون فيها من الممكن تحديد النماذج المتنافسة، التي تستند إلى مختلف المواصفات و/أو المتغيرات، والتي يتبين أنها قادرة على إنتاج تقديرات جيدة، يمكن القيام بتحسين نتائج التنبؤ بالحالة المستقبلية من خلال المزج بين نتائج هذه النماذج. وجرى اقتراح عدة تقنيات مختلطة للتنبؤ بالحالة المستقبلية في المؤلفات ذات الصلة للتعامل مع مجموعة متنوعة من الحالات العملية. وعلاوة على ذلك، وفي إطار بايزي (وفق قاعدة بايز الإحصائية للاستنباط)، يمثل المزج بين تقنيات التنبؤ بالحالة المستقبلية الوسيلة الأكثر موثوقية لإعداد تنبؤات الكثافة. وسيتضمن الفصل نظرة عامة عن مختلف تقنيات المزج، التي تتراوح ما بين التقنيات الكلاسيكية والأكثر تطوراً.

الفصل ٩: المقارنة بين النهج العام والنهج المفصل لبناء التقديرات السريعة

سيقدم هذا الفصل مزايا وعيوب استخلاص تقديرات سريعة على مستوى عام والبدء من معلومات قطاعية مصنفة. وسيركز هذا الفصل أساساً على الحالة الجغرافية؛ وسيعرض ما يسمى بالنهج المباشر وغير المباشر والمختلط بالتفصيل. وستناقش أحدث التقنيات مثل نموذج الارتداد الذاتي الترابطي العالمي. وسيكون الفصل ذا أهمية خاصة في سياق بناء التقديرات السريعة للمجاميع الإحصائية الأوروبية والمجاميع التي تتجاوز المستوى الوطني (تشمل مثلاً مجموعة العشرين ومجموع منظمة التعاون والتنمية في الميدان الاقتصادي) وبالنسبة للبلدان التي لها نظام إحصائي يتسم بدرجة عالية من اللامركزية على الصعيد الإقليمي.

الفصل ١٠: تقييم نوعية التقديرات السريعة

سيؤكد هذا الفصل أهمية تعزيز تقييم نوعية التقديرات السريعة. وبما أن التقديرات السريعة تشكل منتجا يختلف عن التقديرات العادية، فهي تحتاج إلى عملية مخصصة ينبغي أن تخضع لتقييم موحد للنوعية. وعلاوة على ذلك، ينبغي أن يستند قرار نشر التقديرات السريعة على فترة محاكاة طويلة بما فيه الكفاية (يمكن أن تتم في الزمن الحقيقي). وأخيراً،

ينبغي رصد تنقيحات التقديرات السريعة باستمرار لاكتشاف الانحراف المحتمل أو غير ذلك من أنماط العمل المنهجية.

الفرع الثالث: مسائل محددة

الفصل ١١: مسائل عرض البيانات

بما أن التقديرات السريعة هي من المنتجات المختلفة عن التقديرات العادية، فإنه يجب على الوكالات الإحصائية أن تولي عناية خاصة للتمييز بوضوح بين التقديرات السريعة والتقديرات العادية لتجنب وقوع أي سوء فهم أو التباس لدى المستعملين. وسيناقش الفصل الطرق التي يتم بها تقديم التقديرات السريعة ونشرها، فضلا عن ضرورة وجود قواعد واضحة للتنبيه بالأخطاء في ما يتعلق بالتقديرات السريعة. وعلاوة على ذلك، سيؤكد الفصل على الحاجة إلى شفافية التقديرات السريعة، مما يؤدي إلى توافر ملفات مفصلة للبيانات الوصفية وإلى جعل جميع الدراسات المنهجية والتجريبية ذات الصلة ببناء التقديرات السريعة في متناول الجمهور.

الفصل ١٢: المبادئ التوجيهية للتقديرات السريعة

سيقدم الفصل نوعا من الدليل المفصل خطوة خطوة لتجميع مختلف أصناف التقديرات السريعة.

المرفقات

المسرد (المكتب الإحصائي للجماعات الأوروبية)

ثبت المراجع

المرفق الرابع

نموذج البيانات للإحصاءات الاقتصادية القصيرة الأجل

وصف المؤشرات	المستوى	التواتر الدوري
المجموعة ١: الحسابات الوطنية		
١-١ الحسابات الوطنية الفصلية: التقديرات العاجلة المتعلقة بالنتائج المحلي الإجمالي	١	فصليا
٢-١ الحسابات الوطنية الفصلية: الإصدار الكامل للنتائج المحلي الإجمالي		
١-٢-١ الإنفاق	١	فصليا
٢-٢-١ الإنتاج	١	فصليا
٣-٢-١ الدخل	٢	فصليا
٣-١ الحسابات القطاعية الفصلية	٣	فصليا
المجموعة ٢: الإنتاج ورقم الأعمال		
١-٢ مؤشر الإنتاج في ما يتعلق بالصناعة، حسب الشعب الرئيسية (التعدين، والصناعة التحويلية، والكهرباء، والمياه، إلخ.)	١	شهريا
٢-٢ مؤشر الإنتاج في ما يتعلق بالبناء	٢	شهريا
٣-٢ مؤشر رقم أعمال تجارة التجزئة حسب الشعب الرئيسية	٢	شهريا
٤-٢ مؤشر رقم أعمال الصناعة حسب الشعب الرئيسية	٢	شهريا
٥-٢ مؤشر رقم أعمال الخدمات الأخرى حسب الشعب الرئيسية (باستثناء الخدمات المالية والخدمات غير التجارية)	٢	شهريا
٦-٢ مؤشر الطلبات الجديدة للصناعة حسب الفئة الرئيسية لتصنيف الصناعات الدولي الموحد (للفئات التي تعمل بناء على الطلب)	٣	شهريا
٧-٢ مؤشر الطلبات الجديدة من أجل البناء (رخص البناء أو المساكن الجديدة)	٢	شهريا
٨-٢ إنتاج السلع الأساسية (حسب أهميتها بالنسبة للبيانات القطرية بشأن إنتاج السلع الأساسية ومؤشرات النشاط الاقتصادي الأخرى)	٣	شهريا
المنتجات الزراعية		
المعادن		
عمليات التسجيل/المبيعات الجديدة للسيارات		
عمليات التسجيل/المبيعات الجديدة للمركبات التجارية		
السياح الوافدون		
المجموعة ٣: مؤشرات الأسعار		
١-٣ مؤشر أسعار الاستهلاك	١	شهريا
٢-٣ مؤشر أسعار الإنتاج	١	شهريا
٣-٣ مؤشر أسعار الاستيراد	١	شهريا
٤-٣ مؤشر أسعار التصدير	١	شهريا

وصف المؤشرات	المستوى	التواتر الدوري
الجموعة ٤ : مؤشرات سوق العمل		
١-٤ البطالة	١	فصليا
٢-٤ معدل البطالة	١	فصليا
٣-٤ مجموع العمالة وحسب النشاط الاقتصادي	١	فصليا
٤-٤ معدل الأجر للساعة	٢	فصليا
٥-٤ ساعات العمل	٢	فصليا
الجموعة ٥ : مؤشرات القطاعات الخارجية		
١-٥ الصادرات والواردات (من السلع والخدمات)	١	شهريا
٢-٥ وضع الاستثمار الدولي، حذد الأرصدة والعناصر	٢	فصليا
٣-٥ أصول الاحتياطي الرسمي	١	شهريا
٤-٥ الدين الخارجي (حسب القطاع، والاستحقاق، والعملية الأجنبية)	١	فصليا
الجموعة ٦ : مؤشرات القطاع المالي		
١-٦ الأصول الأجنبية الصافية للمصرف المركزي	١	شهريا
٢-٦ الإقراض المحلي للمصرف المركزي	١	شهريا
٣-٦ الأموال الاحتياطية للمصرف المركزي	١	شهريا
٤-٦ الأصول الأجنبية الصافية لشركات الإيداع	١	شهريا
٥-٦ الإقراض المحلي لشركات الإيداع	١	شهريا
٦-٦ الالتزامات النقدية العامة لشركات الإيداع	١	شهريا
٧-٦ بيان ميزانية الشركات المالية الأخرى، وأصولها والتزاماتها حسب القطاع	٢	شهريا
٨-٦ أرباح الشركات المالية	٢	فصليا
٩-٦ ديون الشركات المالية	٢	شهريا
١٠-٦ مؤشرات أخرى، حسب أهميتها: القروض المتعثرة لشركات الإيداع، ونسب كفاية رأس المال، ومؤشرات أخرى عن الاستقرار المالي، إلخ.		
الجموعة ٧ : المؤشرات العامة للقطاع الحكومي		
١-٧ الإيرادات	١	شهريا
٢-٧ المصروفات	١	شهريا
٣-٧ الرصيد التشغيلي الصافي (= الإيرادات - المصروفات)	١	شهريا
٤-٧ الاقتناء الصافي للأصول غير المالية	٢	فصليا
٥-٧ النفقات	٢	فصليا
٦-٧ الإقراض الصافي/الاقتراض الصافي (= الإيرادات - المصروفات)	٢	فصليا
٧-٧ إجمالي الديون	٢	فصليا

وصف المؤشرات	المستوى	التواتر الدوري
الجموعة ٨: مؤشرات قطاع الأسر المعيشية		
١-٨ الدخل المتاح للأسر المعيشية	٢	فصليا
٢-٨ مدخرات الأسر المعيشية	٢	فصليا
٣-٨ ديون الأسر المعيشية	٢	فصليا
٤-٨ مؤشرات أخرى حسب أهميتها: الدخل المتاح، وخدمة الدين، ومدفوعات أصول الدين، وديون الأسر المعيشية، إلخ.		
الجموعة ٩: مؤشرات قطاع الشركات غير المالية		
١-٩ أرباح الشركات غير المالية	٣	فصليا
٢-٩ ديون الشركات غير المالية	٣	فصليا
٣-٩ مؤشرات أخرى حسب أهميتها		
الجموعة ١٠: مؤشرات الأسواق المالية		
١-١٠ أسعار الفائدة، حسب أهميتها: معدلات أسواق الأموال القصيرة والطويلة الأجل وأسواق السندات	١	شهريا
٢-١٠ أسعار صرف العملات، حسب أهميتها: الأسواق الفورية والأسواق الآجلة	١	شهريا
٣-١٠ سعر الصرف الاسمي والفعلي الحقيقي	١	شهريا
٤-١٠ مؤشرات سوق الأسهم	١	شهريا
٥-١٠ مؤشرات أخرى حسب أهميتها: الفروق بين معدلات الإقراض والإيداع، وسعر الصرف الأعلى - الأدنى المتداول بين المصارف؛ إلخ.		
الجموعة ١١: مؤشرات سوق العقارات		
١-١١ مؤشر أسعار العقارات السكنية	٢	فصليا
٢-١١ مبيعات المنازل الجديدة	٣	شهريا
٣-١١ مبيعات المنازل القائمة	٣	شهريا
الجموعة ١٢: الشعور تجاه الاقتصاد		
١-١٢ ثقة المستهلكين	٢	شهريا
٢-١٢ ثقة الأعمال التجارية	٢	شهريا
٣-١٢ المؤشرات المركبة للدورات الاقتصادية		
١-٣-١٢ المؤشر المتقدم	٣	شهريا
٢-٣-١٢ المؤشر الموازي	٣	شهريا
٣-٣-١٢ المؤشر المتخلف	٣	شهريا