



---

统计委员会

第四十八届会议

2017年3月7日至10日

临时议程\* 项目4(g)

供参考的项目：金融统计

机构间金融统计工作队的报告

秘书长的说明

按照经济及社会理事会第 2016/220 号决定和以往的惯例，秘书长谨转递机构间金融统计工作队的报告，该报告提交统计委员会供其参考。

请委员会注意这份报告。

---

\* E/CN.3/2017/1。



## 机构间金融统计工作队的报告

### 一. 引言

1. 1992年，机构间金融统计工作队(金融统计工作队)<sup>1</sup>在统计委员会主持下设立，于1998年再次召集，负责协调改进外债和国际储备数据方面的工作，关注方法的合理性、透明度、数据的及时性和可用性。金融统计工作队致力于制定方法标准，促进外债和公共部门债务统计数据的可用性。已向委员会于2015年3月举行的届会提交了关于金融统计工作队工作方案的报告。本报告介绍了自上次报告以来开展的工作的最新情况，并概述了国际货币基金组织(基金组织)于2016年3月17日和18日在华盛顿特区主办的金融统计工作队会议上商定的工作方案。金融统计工作队的工作方案将继续受益于其各成员之间的合作、协调和持续努力，这是其成功的关键。

### 二. 债务数据的可用性

#### A. 世界银行季度外债统计数据库

##### 中期外债统计战略

2. 成立于2015年中期的外债统计工作组于2015年12月以及2016年6月和9月举行了视频会议。在2015年12月的视频会议上，工作组探讨了世界银行季度外债统计元数据调查问卷和根据债务证券估值依据编列外债统计表格情况，在2016年6月和9月会议视频会议上，工作组则重点讨论了中期外债统计战略的执行情况。

3. 在2016年金融统计工作队会议期间，基金组织与世界银行协商，提议讨论一项中期战略，以进一步改善国家参与、数据可用性和外债统计的一致性。拟议的中期外债统计战略包括四个主要目标：(a) 增加报告经济体，主要是增加参加强化数据公布通用系统的国家数量；(b) 增加数据粒度，主要针对数据公布特殊标准(特殊标准)用户和特殊标准增强版用户；(c) 扩大数据源范围，同时确保数据所有权仍然归各国所有；(d) 提高最终用户和数据汇编者对季度外债统计的认识。会议决定，负责实施中期战略的主要机构是外债统计工作组。

4. 为了让越来越多的强化数据公布通用系统经济体参与季度外债统计数据库，基金组织在外债统计工作组视频会议上通报了针对西非和中非17个法语经济体

---

<sup>1</sup> 机构间金融统计工作队的成员有国际清算银行、英联邦秘书处、欧洲中央银行、欧盟统计局、国际货币基金组织(基金组织)、经济合作与发展组织(经合组织)、巴黎俱乐部秘书处、联合国贸易和发展会议(贸发会议)以及世界银行。金融统计工作队由基金组织统计部担任主席，每年举行一次会议。

的新的能力发展项目，其中大部分经济体目前不向季度外债统计数据库报告。该项目的工作计划有关键目标，作为国际投资头寸倡议的一部分，将促进参与季度外债统计数据库。为了支持该工作计划，世界银行正在从借方报告制度和季度外债统计数据库收集这 17 个国家的信息；贸发会议和英联邦秘书处还将提供从自己债务记录系统中收集的关于这些国家的信息。世界银行(通过其借方报告制度)以及英联邦秘书处和贸发会议(提供各自的债务记录系统)将继续协助各国改善季度外债统计报告。

5. 在提高数据库的数据粒度方面，外债统计工作组正在分享用户关于哪些季度外债统计表最为重要以及哪些要素需要放在优先位置的意见。基金组织将在今后几个月努力确定基金组织经济学家使用季度外债统计数据情况，包括确定哪些表使用得最多。欧洲中央银行也将开始报告欧元区的净外债头寸数据。

### 数据可用性

6. 2014 年 10 月，世界银行与基金组织协作，根据《2013 年外债统计：汇编者和用户指南》(2013 年《外债统计指南》)和《国际收支与国际投资头寸手册》第六版启动了新的季度外债统计数据库。<sup>2</sup> 季度外债统计数据库包括两个数据库：一个是使用数据公布特殊标准的国家外债数据库(数据公布特殊标准/季度外债统计数据库)，一个是参加数据公布通用系统的国家外债数据库(数据公布通用系统/季度外债统计数据库)。截至 2016 年 10 月，共有 123 个经济体报告季度外债头寸数据，其中 76 个向特殊标准/季度外债统计数据库报告，47 个向通用系统/季度外债统计数据库报告。特殊标准用户数量有了增加。目前，所有 63 个特殊标准用户，以及 11 个特殊标准增强版用户、欧元区和新西兰报告特殊标准要求的特殊标准/季度外债统计数据库表 1(外债头寸毛额)所需数据。没有新的经济体参与通用系统/季度外债统计数据库。目前，110 个通用系统参与者中有 47 个(43%)向通用系统/季度外债统计数据库报告。值得注意的是，其中 33 个还报告特殊标准规定的通用系统/季度外债统计数据库表 6(外债头寸毛额)所需数据。因此，现在在 100 多个经济体按照特殊标准要求，向季度外债统计数据库报告季度外债。

7. 关于采用《2013 年外债统计指南》和《国际收支与国际投资头寸手册》第六版的进展情况，67 个经济体依据这些指南，向特殊标准/季度外债统计数据库报告，32 个经济体向通用系统/季度外债统计数据库报告。<sup>3</sup>

8. 报告包含补充信息的季度外债统计数据库鼓励表格和补充表格的经济体数量正在增加，但仍有取得进一步进展的充分空间。截至 2016 年 10 月，37 个经济

<sup>2</sup> 见 <http://datatopics.worldbank.org/debt/home>。

<sup>3</sup> 为了维护涵盖连贯一致的历史性数据的单个综合数据库，世界银行利用一般转换规则，将以《2003 年外债统计指南》和《国际收支与国际投资头寸手册》第五版为依据报告的数据转换为以《2013 年外债统计指南》和《国际收支与国际投资头寸手册》第六版为依据的数据。

体报告特殊标准/季度外债统计数据库关于外债头寸毛额的表 2 所需数据；外币和本国货币债务；<sup>4</sup> 15 个经济体报告关于外币外债毛额的表 2.1 所需数据；12 个经济体报告关于外债头寸毛额：短期尚未到期债务的表 3.1 所需数据。在对更详细的债务寸头数据的兴趣日益浓厚的情况下，报告关于外债头寸毛额的补充分析资料特别有用。<sup>5</sup>

### 季度外债统计元数据调查问卷

9. 世界银行编制了季度外债统计元数据调查问卷，在 2015 年 12 月外债统计工作组会议上分享了这一问卷以征求意见，进行了讨论。为季度外债统计/特殊标准和季度外债统计/通用系统单独编制了元数据调查问卷，并于 2016 年 2 月发送给报告机构。在 2016 年 6 月举行的外债统计工作组会议上，世界银行介绍了结果和拟议的元数据最新情况——包括使数据库中的订正政策更为鲜明以便传播。

10. 根据金融统计工作队会议商定的结果，现在世界银行的季度外债统计债务数据门户网站根据其债务证券的估值编列各国情况。在季度外债统计/特殊标准数据库下的跨国表格中创建了表 1 的各子表(<http://datatopics.worldbank.org/debt/qeds>)，这些子表列示以市场价值、票面价值、市场/名义混合价值或其他估价方法衡量债务证券的国家的的外债头寸毛额。

## B. 季度公共部门债务统计数据库

11. 季度公共部门债务统计数据库是世界银行、欧盟统计局、经合组织、英联邦秘书处、贸发会议和基金组织协作努力的成果，包括以票面价值计算的公共部门债务头寸毛额的数据。关于中央政府的数据是必须提供的，而关于一般政府等所有其他政府领域的的数据，则是在自愿基础上提供。最低要求是按工具类型报告中央政府债务头寸数据。

12. 截至 2016 年 11 月，82 个经济体向季度公共部门债务数据库提供了数据，其中 70 个经济体报告了中央政府 2015 年第一季度至 2016 年第二季度之间的数据，62 个经济体报告了一般政府此期间的数据，32 个经济体报告了非金融公共部门在此期间的数据。<sup>6</sup> 只有 27 个经济体报告了整个公共部门的数据。国际清算银行、英联邦秘书处、欧洲中央银行、欧盟统计局、基金组织、经合组织、贸发会议和世界银行的代表组成的公共部门债务统计工作组正在促进联合数据库

<sup>4</sup> 通用系统/季度外债统计数据库还包括一张列示公共部门和公共部门保障的私营部门外币/本国货币外债表格。目前，30 个经济体（其中 64%使用通用系统报告）报告外币/本国货币明细。

<sup>5</sup> 关于这一点，为了支持分析货币不匹配和流动性风险，20 国集团数据差距倡议第二阶段包括一项关于国际投资头寸的建议（建议二.10），其中强调报告关于国际投资头寸的补充分析信息，说明外部资产和负债的货币组成情况，并报告尚未到期债务的数据。

<sup>6</sup> 应当指出，所有列出的国家都报告了 2015 年第一季度之前的数据。例如，自 2000 年第一季度以来，有 25 个国家的数据可用。

的持续开发。该工作组促进各国际组织的一致性，促进讨论与公共部门债务统计相关的关键问题，并促进就这些问题建立共识。该小组的主要工作之一是采用矩阵法，列示债务数据，进一步提高通过季度公共部门债务数据库传播的公共部门债务毛额数据的透明度(这种方法根据 D1-D4 汇总法对涵盖的债务进行分类，<sup>7</sup> 根据 GL1-GL5 汇总法对部门债务进行分类)。其中还列入了向用户解释各种概念的说明。世界银行和经合组织也在处理元数据以进一步提高数据库的透明度。

13. 自融统计工作队上次会议以来，公共部门债务统计工作组于 2016 年 6 月和 9 月举行了两次会议，并商定了 2017 年 3 月(机构间金融统计工作队下一次会议的时间)之前的工作方案。根据金融统计工作队上一次会议上提出的建议，英联邦秘书处、贸发会议、世界银行和基金组织设立了一个国家介入小组，截至 2016 年 11 月，该小组举行了三次会议。尽管已经为国家介入小组商定了基本业务，但由于资金不确定，尚未制定任何工作方案。因此，只是协调了当前的工作方案。根据最近一次公共部门债务统计工作组会议的结果，经合组织和欧盟统计局正在进行讨论，探讨改用通过欧盟统计局备选办法完成季度公共部门债务报告的备选办法。还商定了一些与对手方信息有关的季度公共部门债务传播改进措施。在为用户提供在线出版物解释债务和净债务的各种定义方面取得了进一步进展。这些问题将在公共部门债务统计工作组的下次会议上进一步讨论，一份关于净债务的文件草案将提交金融统计工作队批准。

14. 为了加强公共部门债务统计的透明度和跨国一致性，金融统计工作队继续核可和支持全面覆盖一般政府的债务工具，并且特别强调尚未报告的经济体，并将其作为提高公共部门债务统计方面财政透明度的基准。这与其他举措和优先事项一致，包括 20 国集团数据差距倡议第二阶段建议 16(之前为数据差距倡议第一阶段中的建议 18)的标准模板和一般政府债务毛额的特殊标准增强版类别。

### C. 联合外债中心<sup>8</sup>

15. 2015 年，世界银行提交了由国际清算银行、基金组织、经合组织和世界银行设立的联合外债中心编制的债权人/市场表。<sup>9</sup>该表的改进部分包括：(a)在债券方面，以协调投资组合调查数据替换国际清算银行国际债务证券数据，此后，将国际清算银行数据转移到补充信息表中；(b) 为协调投资组合调查的债券数据增添短期和原始到期数据组成部分；(c) 以伯尔尼联盟的短期保险贸易融资替换经合组织的官方贸易信贷。在 2016 年金融统计工作队会议期间，世界银行提出了改进联合外债中心网站的建议，以使其更加方便用户。世界银行在 2016 年 6 月分享了提议的新的联合外债中心网站，以征求意见，预计新网站将在 2016 年底推出。

<sup>7</sup> 包括区域债务概念 (D2A)。

<sup>8</sup> 联合外债中心网站于 2006 年 3 月启动，旨在为综合性外债统计提供一站式资源。

<sup>9</sup>该表编列 200 多个经济体以信贷人/市场为来源的外债和若干外国资产数据。信贷人/市场数据以所涉四个机构为来源，可查阅：[错误!超链接引用无效。](#)

### 三. 能力建设

16. 基金组织继续提供技术援助,以提高汇编和传播外债统计数据的能力。基金组织还通过培训课程继续宣传《2013 年外债统计指南》。2016 年 2 月,在华盛顿特区举办了为期两周的外债统计课程,来自基金组织 39 个成员国的官员参加了培训。<sup>10</sup>基金组织还于 2016 年 5 月在华盛顿特区开设了跨境头寸统计新课程,其中包括外债统计工作和国际账户内不同数据集的联系,39 个经济体的官员参加了培训。这个新的为期两周的培训课程还在新加坡基金组织区域培训研究所(2015 年 11 月)举行,2015 年 12 月在墨西哥拉丁美洲货币研究中心—和斯洛文尼亚金融卓越中心举办为期一周的课程。

17. 作为当前工作的一部分,基金组织还在公共部门债务领域提供培训援助和举办培训课程。培训援助活动是在为期 18 个月的区域项目背景下开展的,目的是改善目标东南欧成员国(阿尔巴尼亚、波斯尼亚和黑塞哥维那、科索沃、马其顿和塞尔维亚)的政府财政和公共部门债务统计。<sup>11</sup>此外,基金组织定期举办公共部门债务统计培训和讲习班;2015 年 11 月在老挝人民民主共和国举办了一次国内讲习班,2016 年 7 月在阿克拉与西非金融和经济管理研究所一起为西非经济和货币联盟举办了一次类似讲习班。<sup>12</sup>

18. 英联邦秘书处和贸发会议还通过会议、区域讲习班和针对具体国家的活动,在编制和传播债务统计数据方面向各国提供支助。

19. 在过去一年里,英联邦秘书处组织了两次关于通过使用英联邦秘书处债务记录和管理系统汇编和传播债务统计数据的培训讲习班。一次是与东部和南部非洲宏观经济和金融管理研究所联合举办的,来自 10 个东部和南部非洲国家的 29 名债务管理人参加了该讲习班,另一次是与东加勒比中央银行联合举办的,来自 15 个加勒比国家的 37 名债务管理人参加了讲习班。英联邦秘书处还于 2015 年 10 月在莱索托与东部和南部非洲宏观经济和金融管理研究所联合举办的基金组织债务统计课程中介绍了英联邦秘书处债务记录和管理系统软件。

20. 英联邦秘书处通过一个国家特派团,协助坦桑尼亚联合共和国桑给巴尔提高债务数据质量,提供的协助包括安装最新版本的英联邦秘书处债务记录和管理系统,在桑给巴尔财政部提供培训和建立公共债务数据库。塞浦路斯、缅甸和大不列颠及北爱尔兰联合王国皇家代理银行在 2016 年采用了英联邦秘书处债务记录和管理系统。英联邦秘书处发布了英联邦秘书处债务记录和管理系统版本 2 服务包 2(V2SP2),以应对用户的需求。新版本中增加的重要功能包括:(a) 增加了负债管理办法,包括提前还款和快速付款;(b) 增强了灵敏度分析;(c) 改进了仪表

<sup>10</sup> 自 2005 年以来每隔一年在基金组织总部举办一次外债统计课程。

<sup>11</sup> 该项目于 2014 年 11 月开始,由瑞士政府和经济事务国务秘书供资。

<sup>12</sup> 计划将在 2017 财年剩余时间举办更多讲习班,例如在约旦(为伊拉克官员)和巴林举办讲习班。

板设施；(d) 订正了通用系统/季度外债统计数据库模板；(e) 支持新的世界银行借方报告制度统计数据 and 元数据交换目的代码；和(f) 改进了报告功能。

21. 2015 年 8 月至 2016 年 7 月期间，贸发会议与东部和南部非洲宏观经济和金融管理研究所协作，组织了一次区域讲习班，并在阿尔巴尼亚、乍得、科特迪瓦(2)、加蓬、印度尼西亚、伊朗伊斯兰共和国、尼加拉瓜、菲律宾和赞比亚等国开展了 10 次国内培训活动，目的是加强汇编和传播债务统计数据方面的能力。这些讲习班利用债务管理和金融分析系统关于债务验证、债务统计和债务组合分析的能力建设课程，这有助于传播与《2013 年外债统计指南》和《公共部门债务统计：编者和用户指南》相关的最新标准。

22. 贸发会议在阿尔巴尼亚和摩尔多瓦共和国两国财政部以及印度尼西亚银行安装了最新的债务管理和金融分析系统第六版，其中纳入了《2013 年外债统计指南》和《公共部门债务统计指南》推出的方法标准。贸发会议还定期更新和向全世界 41 个用户机构发布债务管理和金融分析系统第六版的新版本。最新版本极大地便利了提交报告，特别是向季度外债统计和公共部门债务统计数据库提交报告，以及提交票面和市场价值报告。

#### 四. 机构间金融统计工作队今后的工作方案

23. 在关于方法的工作完成和债务数据库建立后，2016 年 3 月金融统计工作队会议上商定的 12 个月工作方案中的主要活动重点是讨论和实施中期战略，解决数据差距及改进季度外债统计和公共部门债务数据库的国家覆盖范围。实施中期战略的主要机构是外债统计工作组和公共部门债务统计工作组，此项工作高度依赖加强机构间协作，以实现目标，同时减少报告机构的负担。

24. 外债统计工作组已着手拟定任务和适当的时间表，以实现季度外债统计中期外债统计战略的四项目标。工作方案还包括传播季度外债统计元数据和改进联合外债中心网站。

25. 除现有培训援助方案外，季度公共部门债务数据库中期战略还将重点关注数量有限的几个国家，以鼓励提交报告，改进数据质量。英联邦秘书处、基金组织、贸发会议和世界银行建立了一个国家介入小组，以期提高季度公共部门债务数据库的国家覆盖面。公共部门债务统计工作组将继续编制共同的季度公共部门债务统计模板，以协调公共部门债务数据的收集工作。欧盟统计局和经合组织将继续重点帮助成员国改进数据质量。

#### 五. 机构间金融统计工作队的下次会议

26. 金融统计工作队成员机构将于 2017 年 3 月 21 日和 22 日在德国法兰克福的欧洲中央银行举行下次会议。