

Mot mer samordnade revideringar i ekonomisk statistik

Sammanfattning

Antalet revideringar som gör i månads- och kvartalsstatistik varierar kraftigt. I alla undersökta statistikgrenar görs en preliminär publicering snarast efter periodens utgång och en mer fullständig i samband med nästa månads/kvartals publicering av preliminära data.

I några statistikgrenar gör inga fler revideringar före en eventuell anpassning till motsvarande årsdata eller nästa generalrevidering. I andra statistikgrenar fortsätter man att revidera för de ändringar som rapporteras och för de korrigeringar och felaktigheter som uppdagas under kommande månader. Några statistikgrenar revideras planmässigt upp till 24 månader.

I den genomförda begränsade studien av revideringarnas frekvens och storleksordning visas:

- att revideringarna oftast är små,
- att revideringarna efter första revideringstillfället nästan alltid är försumbara,
- att betydande fel ibland uppdagas, även efter första revideringstillfället, och att beslut om en extra revidering då bör tas.

I det senaste fallet bör i framtiden revidering formellt beslutas och därefter genomföras.

De planmässigt genomförda revideringarna av månads- och kvartalsstatistik bör inskränkas till revidering av de preliminära data presenterade snarast efter periodens slut till de mer fullständiga som presenteras i samband med nästa periods preliminära data.

Vid senare upptäckt av felaktighet(er) som är av sådan storleksordning att slutsatser baserade på statistiken i fråga kan bli påverkade, bör en extra revidering beslutas och genomföras.

Denna revidering bör formellt beslutas och användarna skall uppmärksammas om att en extra revidering genomförts.

Denna ansats kan också användas då stor förändring upptäcks för en undergrupp av intresse. Vägning mot behovet av samordning bör dock ske i detta fall.

Planerade revideringar, utöver revideringen från preliminära data till mer fullständiga vid nästa periods publicering, genomförs vid:

- anpassning till motsvarande data på årsbasis (eventuellt för månadsstatistik i något fall också till kvartalsdata) och
- anpassning till nya aktiviteter, nomenklatur, klassificeringar mm. – de så kallade generalrevideringarna.

Generalrevideringarna bör alltid samordnas för ekonomisk primärstatistik, NR och FIR.

Bakgrund

Den ekonomiska statistiken resultat används i allt större omfattning i sammanhang där resultat från en statistikprodukt sätts i relation till resultaten från en eller flera andra statistiskprodukter. Förbättrad jämförbarheten i publicerad ekonomisk statistik blir därför allt viktigare.

Förbättrad jämförbarheten är dock inget som lätt kan uppnås. Statistiska enheter, populationer, klassificeringar och variabeldefinitioner och ibland också urvalen har samordnats, men ekonomiska analyser hämmas ändå av de skillnader som kvarstår.

Bland de kvarstående skillnaderna finns de skillnader som uppstår då revideringar av primära och sekundära statistikprodukter som används tillsammans genomförs vid olika tidpunkten.

Samordning av revideringar i tid och över statistikprodukter kan minska problemen vid sam användning av flera statistikprodukter i analyser och vid produktion av sekundära statistikprodukter.

Internationellt pågår också diskussioner om hur differenserna i redovisningen av utlandstansaktioner i nationalräkenskaperna respektive i betalningsbalansen skall kunna minskas. En betydande del av differensen antas bero på olikheter i reviderings-praxis inom nationalräkenskaperna respektive betalningsbalans.

Bland de mått och steg som kan övervägas är:

- Tidsmässig samordning av revideringar i primär statistik, NR och FIR.
- Vilken storlek av revideringen skall ha för att fördelen av att göra en revidering skall anses vara större än den nackdel som en ändring i sig innebär.
- Schemalagda generalrevideringar för både primära och sekundära statistikprodukter.

Revidering endast när det behövs.

Om det framkommit att en publicerad statistik är felaktig och felet är av den storleksordningen att slutsatser baserade på den publicerade statistiken respektive på den korrigerade statistiken kan antas bli olika, då bör en

korrigerad version publiceras snarast och data i databaserna rättas. Denna revidering bör formellt beslutas och regler för detta bör utformas.

Detta gäller också då senare inkomna svar medför att resultatet påverkas till den grad att slutsatserna som dras kan bli avvikande.

Om information fås om mindre fel, fel i storleksordning som ryms inom osäkerhetsmarginalen, kan korrigeringen av den eller dessa senareläggas och tas om hand vid nästa revideringstillfälle. Detta gäller också för situationen då svar inkommit i efterhand men medtagande av dessa svar innebär en ändring som ryms inom osäkerhetsmarginalen.

Revideringar som beror på ändrade standarder och nomenklaturer kan planeras och bör också genomföras koordinerat för all ekonomisk statistik. Detta kommer att kräva större extra resurser under revideringstillfällena, men olägenheten att ha skilda data för samma variabel för en och samma period i skilda statistikgrenarna minskar eller bortfaller helt genom insatsen.

Månads och kvartalsstatistik anpassas vanligen till den årliga statistikens nivå och förändring, när årliga statistiken blir tillgänglig. Det betyder att detta kan sker mer än ett år efter det år data avser. För att få mer rättvisande värden under mellantiden används ibland också ett skattat värde för att få en tidigare anpassning till årliga statistikens nivå och förändring.

Kan vissa revideringar undvikas?

Avseende månads och kvartalsstatistik

Preliminär snabbstatistik och slutligt resultat för månaden/kvartalet.

Ett av huvudkraven från användare av månads- och kvartalsstatistik är att en första publiceringen måste tas fram snabbt. Detta för att informationen är en färskvara och nyttan av den minskar ju senare den kommer. Till denna preliminära publicering har inte alla svar hunnit komma in, inte heller har alla kontroller som kan göras hunnit genomföras.

Den första revideringen kan sägas vara att byta ut de snabba preliminära data till mer genomarbetade slutliga data med alla kontroller gjorda och alla svar för perioden i fråga mottagna.

Reviderade data för en period presenteras vanligen i samband med nästa periods första preliminära publicering. Denna revidering bör inte ändras väsentligt.

De revideringar som görs under senare perioder berör färre uppgifter och ändringarna är av mindre storleksordning. Endast i undantagsfall faller ändringen utanför osäkerhetsintervallen för respektive statistikgren.

De enstaka gånger då större brister upptäcks, bör dessa brister åtgärdas genom att en revidering beslutas och genomförs.

En huvudregel kan vara att månads- och kvartalsstatistiken regelmässigt revideras till perioden efter och därefter låses tills anpassningen till årsvärdena eller till nästa generalrevision. I samband med anpassning till årsvärdena eller vid nästa generalrevision kan de mindre ändringar som framkommit efter senaste revidering tas om hand.

Men regeln att om en statistik är missvisande till den grad att felaktiga slutsatser inte kan uteslutas, och information om hur den kan korrigeras finns, då skall korrigeringen också genomföras. Detta bör dock inte ske slentrianmässigt utan med tydliga och dokumenterade beslut i varje enskild fall.

Om den skissade modellen för månads- och kvartalsstatistik genomförs bortfaller över 90 % av nuvarande antal revideringstillfällen i månadsstatistik.

Hur stor kommer ändringen att vara?

En begränsad insamling av gjorda revideringarna inom månads- och kvartalsvis statistik har genomförts. Också investeringsstatistiken som samlas in tre gånger om året ingick.

Undersökningen av månadsserierna.

De undersökta månadsserierna förutom detaljhandelsindex (DHI) revideras från en månad till nästa ett antal gånger, medan DHI revideras endast från första publiceringen av preliminära data till de definitiva publicerade nästa månad. Detta görs i samband med publiceringen av nästa månads preliminära data.

Följande månatliga seriers revideringar för 14-16 månader har samlats in:

- 1.import av varor,
- 2.export av varor,
- 3.industriproduktionsindex (IPI),
- 4.industrins leveranser,
- 5.industrins order och
- 6.detaljhandelsindex (DHI).

För utrikeshandelns och industristatistikens serier har följande variabler beräknats:

- revideringen av varje månadsvärde vid publicering av månadsvärdena för månaderna 1 till 5 efter, samt det genomsnittliga revideringen för alla månadsvärden vid publicering av månaderna 1 till 5 efter.
- differenserna mellan månadens uppgift vid första månaden efter och vid fem månader efter den första publiceringen och det genomsnittliga värdet av dessa differenser,
- differenserna mellan det lägsta och det högsta värdet för en månads uppgift, av värdena för månaderna ett till fem efter första publiceringen och det genomsnittliga värdet av dessa differenser och
- differenserna mellan det lägsta och det högsta värdet för en månads uppgift, av värdena för månaderna två till fem efter första publiceringen, och det genomsnittliga värdet av dessa differenser.
- andelen revideringar över de fem perioderna som har varit enbart uppåt, enbart neråt eller gått åt båda hållen.

Målsättningen har varit att mäta hur i genomsnitt förhållandet mellan den första preliminära publiceringen och de fem publiceringarna därefter ser ut.

Fel som upptäcks och är av sådan storleksordning att statistiken blir missvisande rättas snarast och behöver också i fortsättningen att bli åtgärdade snarast efter upptäckt. Därför har serierna rensat från de enstaka stora revideringar som förekommit. Av de drygt 100 publiceringstillfällen har fyra uteslutits på grund av att revideringen har varit så betydande att en extra revidering bör göras även i framtiden enligt detta förslag. I import av varor har de betydande revideringarna av värdet för september 2005 och revideringen av uppgiften för juli månads 2005 som genomfört i oktober 2005 uteslutits ur jämförelsen, i IPI har revideringar av augusti till december 2006 genomförd i januari 2007 uteslutits (anpassning till årsdata) och i DHI har värdet för januari 2007 uteslutits då det berodde på ett fel i använd formel.

Då alla serier åsätts lika vikt är revideringen i genomsnitt från den preliminära publiceringen till publiceringen månaden efter:	0,39 %,
revideringen för från en månad efter till två månader efter:	0,18 %,
från två månader efter till tre månader efter:	0,14 %,
från tre månader efter till fyra månader efter:	0,09 %
och för fyra månader efter till fem månader efter:	0,10 %.

Detta då alla revideringar, oberoende av tecken för respektive månad, summerats och divideras med antalet månader vi haft uppgifter för. Det redovisade värdet påverkar därför revideringen maximalt med dessa procenttal. I de flesta fallen finns både revideringar uppåt och neråt och då blir påverkan på de publicerade uppgifter lägre.

Den genomsnittliga differensen mellan värdet som redovisas månaden efter och värdet som redovisas 5 månader efter ger en antydning om vilken grad av revideringar som inte skulle vara medräknade om endast revidering från första till andra publiceringen skulle bli regel. I studien av de fem månatliga statistikgrenarna var differensen 0,25 %.

Revideringar som gjorts för respektive månadsvärde under de fem revideringsmånader innehöll för:

65% av månadsvärdena revideringar både uppåt och neråt, för
18% endast revideringar uppåt och för
17% endast revideringar neråt.

Den genomsnittliga differensen mellan lägsta och högsta värdet i serierna för en månads uppgift var 0,34 %.

Skillnaden mellan värdet månaden efter och fem månader efter var för
55% av värdena positiv, i
30% av värdena negativ och för
15% var värdena identiska.

Mina slutsatser av undersökningen av månadsserierna är:

- Att revideringarna efter revideringen till månaden efter är små och ryms inom felmarginalen. Därför bör endast revideringen till månaden efter genomföras planerligt.
- Att antalet extra revideringar blir mycket begränsat, troligen närmare för varje 20-de månad än för varje 10-de månad.
- Att ändringen kommer att innebära viss kostnadsminskning.

Undersökningen av kvartalsserierna

Undersökningen inkluderade också kvartalsvis statistik över lagerstockvärdet för industrin, export och import av tjänster, omsättningen inom tjänstesektorn och kvartalsutfallet för kommuner.

Lagerstockvärdet för industrin reviderades endast från första preliminära publiceringen till nästa kvartal då definitiva data publicerades i samband med publiceringen av nästa kvartals preliminära värden.

Kvartalsstatistiken över export och import av tjänster reviderades i en tredjedel av fallen med belopp över 1 procent.

Omsättningen i tjänstehandel presenteras endast för 5-siffriga branschgrupper och revideras i vissa fall upp till fem år bakåt, mest för omklassning av företag när felaktigheten upptäckts och utrikeshandeln med tjänster som också har revideringar 6 till 11 kvartal bakåt.

Kvartalsutfallet för kommuner utgör grundmaterial för kvartalsberäkningarna i NR och publiceras inte och någon totalsiffra att göra beräkningar på finns inte att tillgå.

Någon ingående analys av materialet har inte kunnat genomföras eftersom omklassningar och stora ändringar i tidigare lämnade uppgifter är för frekventa. För export av tjänster var medelvärdet för förändringen till nästa kvartal för de fyra kvartalen 2006 0,95 % och för import av tjänster 0,43 % och utan någon tydlig tendens att minska över tiden.

Extra revideringar kan förutses bli mer frekvent förekommande i dessa statistikgrenar.

Ekonomisk månads- och kvartalsvis statistik används förutom i makroekonomiska sammanhang även för andra ändamål.

Förutom i makroekonomiska sammanhang används ekonomisk månads- och kvartalsstatistik även för uppdragsproduktion avseende olika branscherna och varugrupperns produktion, export och import etc. I dessa användningar kan de revideringar som görs efter revideringen till månaden efter vara betydande för de mindre bransch- och varugrupperna.

Då 2/3 av revideringarna i undersökningen var av slaget där revideringarna av aggregatet gick både uppåt och neråt är det ändå svårt att peka ut det sist reviderade värdet som det mest plausibla.

För total räknade data som utrikeshandeln med länder utanför EU kommer data som blivit tillgängliga senare att förbättra värdet men storleksordningen av revideringarna minskar klar här också.

De revideringar som bör göras bör kunna tas om hand genom formellt beslutade och dokumenterade revideringar i respektive fall.

Nationalräkenskaperna och primärstatistik.

Kvartalsvis nationalräkenskaper sammanställs för alla kvartal. För första, tredje och fjärde kvartalet publiceras resultaten inom 70 dagar efter kvartalsslutet. För andra kvartalet sammanställs en preliminär version inom 40 dagar medan den ordinarie kvartalspublikationen kommer först efter ca 75 dagar efter kvartalsslutet.

NR:s uppgifter om de olika delområden är inte direkt jämförbara med motsvarande uppgifter i primärstatistiken eftersom NR ofta behöver göra tillägg och korrigeringar för att få data som svarar mot NR:s krav och definitioner. Vid sammanställningen konsistensprövas också uppgifterna från olika källor. Om tillgängliga data inte ger en samstämmig bild av den ekonomiska utvecklingen måste justeringar vidtas i NR. Definitionsskillnader mellan NR och primärstatistik finns bland annat för utrikeshandeln och för företagens investeringar.

Vid den första sammanställningen av NR för respektive kvartal finns endast de första preliminära sammanställningarna av utfallen för detta kvartal. Detta medför att vid nästa kvartals beräkning måste också omräkning ske av föregående kvartal med de reviderade värdena för föregående kvartal. Om sedan primärstatistiken inte revideras mer före anpassning till den årliga statistiken, då borde det bli lättare att minska antalet revideringarna av tidigare kvartal också i NR.

De årliga primärstatistikerna publiceras delvis som preliminära data, ibland för en delmängd av uppgiftslämnare eller för en delmängd av variabler och som delvis endast som definitiva årsutfallet för hela undersökningen.

Årliga Nationalräkenskaper sammanställs 11 månader efter årsslutet i en preliminär version och 23 månader efter årsslutet i en definitiva version. Vid sammanställningen av den preliminära versionen finns inte all årlig statistik tillgänglig som definitivt årsutfall och preliminära årsvärden måste användas för dessa delar. Vid sammanställningen av definitiva årsutfallet är alla primärstatistikens definitiva data tillgängliga. Efter det definitiva årsutfallet bör den årliga statistiken och årliga NR endast revideras inom ramen för planerade generalrevideringarna. Även årlig statistik revideras om betydande brister upptäcks efter publicering.

Generalrevideringarna

Strukturen av aktörer och av de transaktioner som genomförs ändras över tiden. Detta medför att definitioner, klassificeringar och grupperingar i statistiken måste anpassas till dessa förändringar. Internationella nomenklaturer, klassificeringar och handböcker ändras genom internationella beslut. I samband med ikraftträdande genomförs generalrevideringar som då också har till uppgift att överbrygga brotten i tidserierna.

Men även synen på hur saker och ting skall klassificeras och konteras ändras över tiden. Ändringar i administrativa regler påverkar också möjligheterna att få statistiska grunddata. Dessa glidande ändringar ger också upphov till att generalrevideringar behöver göras från tid till annan.

Hur dessa revideringar skall läggas tidsmässigt kan diskuteras. Planlagda revideringar, t.ex. genomförda var tredje år, har en klar fördel. Planeringen av resurser mm för att genomföra revideringarna blir enklare. Jag tror också att revideringar med fixa intervall och annonserade i god tid före skulle underlätta för användarna.

En skiss för mer samordnade revideringar

För månads- och kvartalsvis statistik kommer planmässigt uppgifterna att revideras från första till andra presentationen. Den andra presentationen sker tillsammans med presentationen av nästa periods första data.

Nästa planmässiga revidering kommer då årets månads respektive kvartals data anpassas till det slutliga årsutfallet. Detta sker då årsdata blir tillgängliga för respektive statistik.

Därefter kommer revideringar av månads och kvartalsdata att behöva göras endast inom ramen generalrevideringarna.

Årsvis statistik kommer att revideras från preliminära resultat till slutliga resultat för de statistikgrenar som presenterar preliminära resultat. Därefter endast inom ramen för generalrevideringarna för de statistikgrenar som berörs.

All statistik revideras också då fel av sådan storlek upptäcks att slutsatser baserade på presenterad statistiken kan be missvisande. Dessa revideringar kräver då ett konkret beslut om att revideringen skall genomföras.

Andra faktorer som påverkar

Att undvika skilda nivåer och skilda utvecklingstal i primärstatistik och NR bör vara ett mål liksom att undvika differenser mellan statistikgrenar som mäter samma skeende. Samordning av revideringar i dessa fall bör därför också vara ett mål.

Det skulle betyda att revideringar för en period bör införas inom primärstatistik och NR samtidigt för samma period. Data för första kvartalet året X kommer att presenteras i början av juni. Vid den tiden kommer det slutliga värdet för första kvartalet att vara tillgängligt i månadsvis statistik men för kvartalsvis primärstatistik kommer med stor sannolikhet endast preliminära värden vara publicerade.

Ett alternativ är att basera de preliminära kvartalsberäkningarna i NR endast på preliminära data. I detta fall kommer månadsvis statistik att ha slutliga värden publicerade före NR:s publicering av de preliminära värdena.

Ett tredje alternativ är att basera de preliminära beräkningarna på de bästa data som är tillgängliga vid beräkningstillfället (som det görs idag). I detta fall kommer NR att utnyttja bästa tillgängliga data, slutliga värden för statistiken per månad och preliminära värden för statistiken per kvartal.

Ett liknande problem kommer att finnas i årlig statistik. En del av primärstatistiken har sina definitiva värden klara till den första preliminära beräkningen av årlig NR, men inte alla statistikgrenar klarar detta. Så från någon eller några primärstatistik produkter kommer preliminära skattningar att användas.

Att preliminära data, med sina brister, skiljer sig åt mellan primärstatistik och NR bör nog vara ett mindre problem än om slutliga data skiljer sig åt. En regel för samordning kan gälla fullt ut för slutliga resultaten medan i preliminära resultat användning av mer tillförlitliga data bör få förtur.

Bilaga: Grunddata för månadsstatistik som ingick i undersökningen