

METODOLOGÍA PARA LA ELABORACIÓN DE LOS ÍNDICES DE VALOR UNITARIO: UNA APLICACIÓN AL COMERCIO EXTERIOR DE CASTILLA-LA MANCHA

DATOS BÁSICOS

Autor: Irene Riobóo Lestón

Título: Metodología para la elaboración de los Índices de Valor Unitario: Una aplicación al comercio exterior de Castilla-La Mancha

Director: José María Montero Lorenzo

Universidad y fecha de lectura: Universidad de Castilla-La Mancha, 24 de octubre de 2007

Palabras clave: Comercio exterior, importaciones, exportaciones, deflatores, índices de precios, índices de valor unitario

Clasificación JEL: B41, C43, C81, E31, F10

Acceso al documento completo: solicitudes al autor, irene.rioboo@uclm.es

RESUMEN

El análisis del comercio de toda área geográfica exige la disponibilidad de datos lo más exactos posibles de dicha realidad, datos que permitan alcanzar correctas conclusiones útiles para la adopción de decisiones. En este sentido los esfuerzos realizados en las últimas décadas a niveles nacional y supranacional hacen que nos encontremos en una situación aceptable, siendo el espacio regional el más deficitario y, por tanto, el más necesitado de estudios en profundidad para alcanzar unos niveles equiparables a los anteriores que permitan análisis equivalentes y faciliten la realización de estudios comparativos.

Dada la fuerte interdependencia de las economías, la relevancia del sector exterior ha puesto de manifiesto la necesidad prioritaria de disponer de series en términos reales para las importaciones y exportaciones. Ello se ha abordado mediante la utilización de deflatores de las series originales, cuya importancia en el marco teórico se ha visto ratificada con la creación al efecto de destacables grupos de investigación vinculados fundamentalmente al Fondo Monetario Internacional.

Entre los principales deflatores del comercio exterior los Índices de Valor Unitario (IVUs) constituyen la alternativa predominante en el momento actual. A nivel europeo, Eurostat elabora mensualmente este indicador para los países de la Unión. A nivel nacional los IVUs son obtenidos para España por el Ministerio de Economía y Hacienda, siendo Galicia y Andalucía las únicas Comunidades que disponen de sus propios IVUs de forma periódica, elaborados por los correspondientes institutos de estadística regionales.

En este trabajo se estableció como objetivo general prioritario la obtención de deflatores del comercio exterior para la determinación de los flujos de importaciones y exportaciones de Castilla-La Mancha en

términos reales, superando así la dificultad que representa la correcta interpretación de los mismos sin el aislamiento del efecto precios. A tal efecto se ha llevado a cabo una revisión pormenorizada de todo el proceso en sus perspectivas tanto teórica como práctica, lo que abarca desde sus inicios en la teoría general de los números índices, hasta la metodología específica de los propios IVUs.

Tras un primer esfuerzo centrado en el estudio y determinación de la más correcta forma de deflactar las series originales, compatibilizando diversos criterios (tanto estadísticos como económicos) de disponibilidad de datos y comparabilidad de economías, se optó por la elaboración de los IVUs para nuestra Comunidad. Ello ha supuesto una extensa labor tanto para garantizar la bondad de los datos utilizados como de adaptación de la metodología a la realidad de Castilla-La Mancha.

Esta metodología específica para Castilla-La Mancha, principal aportación empírica de este trabajo de investigación, supone una aportación al conocimiento en profundidad de su sector exterior, con sus peculiaridades y limitaciones, cuestión fundamental para proponer y adoptar en cada caso las soluciones óptimas para lograr la mejor de las aproximaciones a los verdaderos valores. Adicionalmente, permite la comparabilidad de los resultados obtenidos con los disponibles en otros contextos geográficos, mejorando sustancialmente el conocimiento de la posición relativa de esta región.

La disponibilidad de los IVUs para Castilla-La Mancha, ha permitido obtener su comercio exterior en términos reales, logrando así una profundización y más correcta explicación del comportamiento tanto de sus importaciones como de las exportaciones, es decir, posibilitando una visión más precisa de este sector.

ÍNDICE

Introducción y objetivos

Primera parte

Capítulo 1. El sector exterior de Castilla-La Mancha. Hacia una correcta valoración

- 1.1. Una aproximación empírica al concepto de comercio exterior
- 1.2. Dimensión del sector exterior de Castilla-La Mancha. Evolución reciente
- 1.3. Necesidad de deflactores
- 1.4. Deflactores nacionales versus deflactores regionales

Segunda parte

Capítulo 2. Teoría de los números índices. Aspectos generales

- 2.1. Concepto y clasificación de los números índices
 - 2.1.1. Índices complejos sin ponderar
 - 2.1.2. Índices complejos ponderados
- 2.2. Enfoque axiomático
- 2.3. Índices de precios de Laspeyres, Paasche y Fisher
- 2.4. Índices en cadena

Capítulo 3: Deflactores del comercio exterior: Posibles alternativas

- 3.1. Valoración del comercio exterior a precios constantes

3.2. Deflatores del comercio exterior

3.2.1. Precios reales de importación y exportación

3.2.2. Índices de Valor Unitario del comercio exterior

3.2.3. Índices de Precios de la Producción ajustados

3.2.4. Precios ajustados de las exportaciones de un país extranjero

3.3. Índices de Valor Unitario versus índices de precios

3.3.1. Limitaciones de los Índices de Valor Unitario respecto a los Índices de Precios

3.3.1.1. Definición de los productos

3.3.1.2. Definición del valor

3.3.1.3. Obtención de los datos

3.3.2. Ventajas de los Índices de Valor Unitario respecto a los Índices de Precios

3.3.2.1. Fuente de datos exhaustiva

3.3.2.2. Bajo coste de producción

3.3.2.3. Transacción real de precios

3.3.3. Valoración final

Capítulo 4: Consideraciones básicas sobre los Índices de Valor Unitario

4.1. Referencia histórica

4.2. Axiomática

4.3. Sesgo del valor unitario

4.4. Agregación de los Índices de Valor Unitario

Tercera parte

Capítulo 5: Los deflatores del comercio exterior en el contexto internacional

5.1. Consideraciones previas

5.2. Criterios generales utilizados en la obtención de los deflatores del comercio internacional

5.3. Metodología de Eurostat

Capítulo 6: Los deflatores del comercio exterior en el contexto nacional

6.1. Reseña histórica

6.2. Actual metodología nacional

6.3. Deflatores regionales

Cuarta parte

Capítulo 7: Índices de Valor Unitario de Castilla-La Mancha

7.1. Introducción

7.2. Fuente de información

7.3. Cases elementales y valores unitarios

7.4. Criterios de selección de clases elementales

7.4.1. Criterio permanencia temporal

- 7.4.2. Criterio de tamaño muestral suficiente
- 7.4.3. Criterio volumen de comercio significativo
- 7.4.4. Criterio homogeneidad respecto al valor unitario
- 7.4.5. Criterio de cobertura

7.5. Clases elementales seleccionadas

7.6. Clases elementales no seleccionadas

7.7. Índices agregados y su cobertura

7.8. Aplicación informática

Capítulo 8: Exploración de los principales resultados obtenidos

Conclusiones y futuras líneas de investigación

Bibliografía

Apéndices

Apéndice I. Unidades suplementarias

Apéndice II. Codificación de los países en el año 2000

Apéndice III. Clases elementales observadas en 2000

Apéndice IV. Clases elementales seleccionadas

Apéndice V. Índices de Valor Unitario de las exportaciones totales

Apéndice VI. Índices de Valor Unitario de las exportaciones hacia la Unión Europea

Apéndice VII. Índices de Valor Unitario de las exportaciones hacia países no pertenecientes a la Unión Europea

Apéndice VIII. Índices de Valor Unitario de las importaciones totales

Apéndice IX. Índices de Valor Unitario de las importaciones desde la Unión Europea

Apéndice X. Índices de Valor Unitario de las importaciones desde países no pertenecientes a la Unión Europea

Apéndice XI. Código implementado

BIBLIOGRAFÍA RECOMENDADA

Aguado, M.J., (1998), “Los nuevos índices de valor unitario base 1995”, *Síntesis de Indicadores Económicos*, abril, XVII-XXVIII, Dirección General de Previsión y Coyuntura, Ministerio de Economía y Hacienda, Madrid.

Dirección General de Política Económica, (2001), *Metodología de los índices de valor unitario de comercio exterior. Base 1995*, Ministerio de Economía, Madrid.

Eurostat, (2005), *Calculation of unit value indices based on external trade data (NICE application)*, Luxembourg.

Instituto Galego de Estatística, (2007), *Índices de Valor Unitario encadenados*, Xunta de Galicia, Santiago de Compostela.

Moral, E., Dávila, M.A. y Martín, E., (1999), *Los índices de valor unitario para medir el comercio exterior de Andalucía en términos reales*, Instituto de Estadística de Andalucía, Sevilla.