

Analisi delle differenze dovute ai comportamenti delle imprese e alla destagionalizzazione degli indicatori

Carmela Pascucci

Direzione Centrale delle Statistiche Congiunturali

*Una lettura integrata delle indagini congiunturali sull'industria e sui servizi
ISTAT - 25 giugno 2015*

STRUTTURA DELLA PRESENTAZIONE

- DIFFERENZE CONCETTUALI FRA GLI INDICATORI
- IMPATTO SUGLI INDICATORI DELLE DIFFERENZE DEI COMPORTAMENTI DELLE IMPRESE
 - produzione e fatturato industriale a confronto
- DESTAGIONALIZZAZIONE
- FOCUS SUL FATTURATO

PRODUZIONE E FATTURATO: ELIMINAZIONE DEL FATTORE PREZZO (1)

- L'indice della produzione industriale è un indice di quantità;
- L'indice del fatturato è un indice di valore;
- Per confrontarli occorre eliminare dall'indice del fatturato la componente di prezzo:
 - si dividono gli indici di fatturato per i corrispondenti indici di prezzo al massimo dettaglio possibile (generalmente 3 cifre Ateco/CPA);
 - si aggregano gli indici a 3 cifre per ottenere gli indici di livello superiore.

PRODUZIONE E FATTURATO: ELIMINAZIONE DEL FATTORE PREZZO (2)

- Si deflaziona il fatturato interno di ogni singolo gruppo ATECO con il corrispondente indice dei prezzi del mercato interno;
- Si deflaziona il fatturato estero di ogni singolo gruppo ATECO con il corrispondente indice dei prezzi sul mercato estero;
- Il tutto è effettuato a parità di dominio, eliminando quindi i gruppi Ateco/CPA non comuni fra le indagini sul fatturato e sulla produzione industriale.

LE TIPOLOGIE DEI PRODOTTI RILEVATE DALL'INDAGINE SUI PREZZI

- **L'indagine sui prezzi deve** rilevare i prezzi dei beni fabbricati in serie, perché per i beni unici non è possibile osservare l'evoluzione nel tempo del relativo prezzo;
- **Non rileva** i prezzi dei beni fabbricati su commessa, perché per questa tipologia di beni il prezzo non è espressione di una vendita effettivamente avvenuta sul mercato;
- **Non rileva** i prezzi dei beni venduti a unità locali della stessa impresa o a imprese dello stesso gruppo, perché il prezzo in questi casi non è relativo a una vendita reale sul mercato.

Bene unico e fabbricazione su commessa

- L'esclusione di produzioni su commessa fa riferimento a particolari tipologie di beni i cui cicli di produzione sono generalmente lunghi.
- Il prodotto fabbricato su apposito progetto del cliente è necessariamente un bene unico.
- Esempio sono i grandi macchinari ed impianti, tipici dell'industria pesante dove la commessa è effettuata sulla base di un progetto esclusivo di fabbricazione.

ESCLUSIONE DI ALCUNI PRODOTTI DALL'INDAGINE DEI PREZZI (1)

- Il regolamento esclude l'obbligatorietà della rilevazione per alcuni codici della CPA
 - 2446 - Combustibili nucleari
 - 254 - Armi e munizioni
 - 301 - Navi e imbarcazioni
 - 303 - Aerei e veicoli spaziali
 - 304 - Veicoli militari da combattimento
 - 383 - Prodotti del recupero dei materiali

ESCLUSIONE DI ALCUNI PRODOTTI DALL'INDAGINE DEI PREZZI (2)

Indice dei prezzi alla produzione dei prodotti industriali rilevati

	Gen-2015	Feb-2015	Mar-2015	Apr-2015
Ateco 2007				
CL: fabbricazione di mezzi di trasporto	102.7	102.6	102.2	102.3
29: fabbricazione di autoveicoli, rimorchi e semirimorchi	103.7	103.5	103.0	103.1
291: fabbricazione di autoveicoli	105.3	105.3	104.7	104.7
292: fabbricazione di carrozzerie per autoveicoli, rimorchi e semirimorchi	105.3	105.4	105.7	105.7
293: fabbricazione di parti ed accessori per autoveicoli e loro motori	100.7	100.3	100.1	100.2
2931: fabbricazione di apparecchiature elettriche ed elettroniche per autoveicoli e loro motori	100.3	98.2	97.6	97.6
2932: fabbricazione di altre parti ed accessori per autoveicoli e loro motori	100.7	100.6	100.4	100.5
30: fabbricazione di altri mezzi di trasporto	99.0	99.1	99.2	99.2
301: costruzione di navi e imbarcazioni	96.5	96.5	96.5	96.5
3012: costruzione di imbarcazione di diporto e sportive				
302: Costruzione di locomotive e di materiale rotabile ferroviario
303: fabbricazione di aeromobili, di veicoli spaziali e dei relativi dispositivi				
309: fabbricazione di mezzi di trasporto nca	99.0	99.2	99.5	99.4
3091: fabbricazione di motocicli (inclusi i motori)	95.4	95.5	95.4	95.2
3092: fabbricazione di biciclette e veicoli per invalidi	105.0	105.3	106.4	106.3
3099: fabbricazione di altri mezzi di trasporto nca	102.7	102.7	102.6	102.9

INDICE DI PRODUZIONE E INDICE DI VOLUME DEL FATTURATO – DIFFERENZE

- **FATTORI ECONOMICI:**

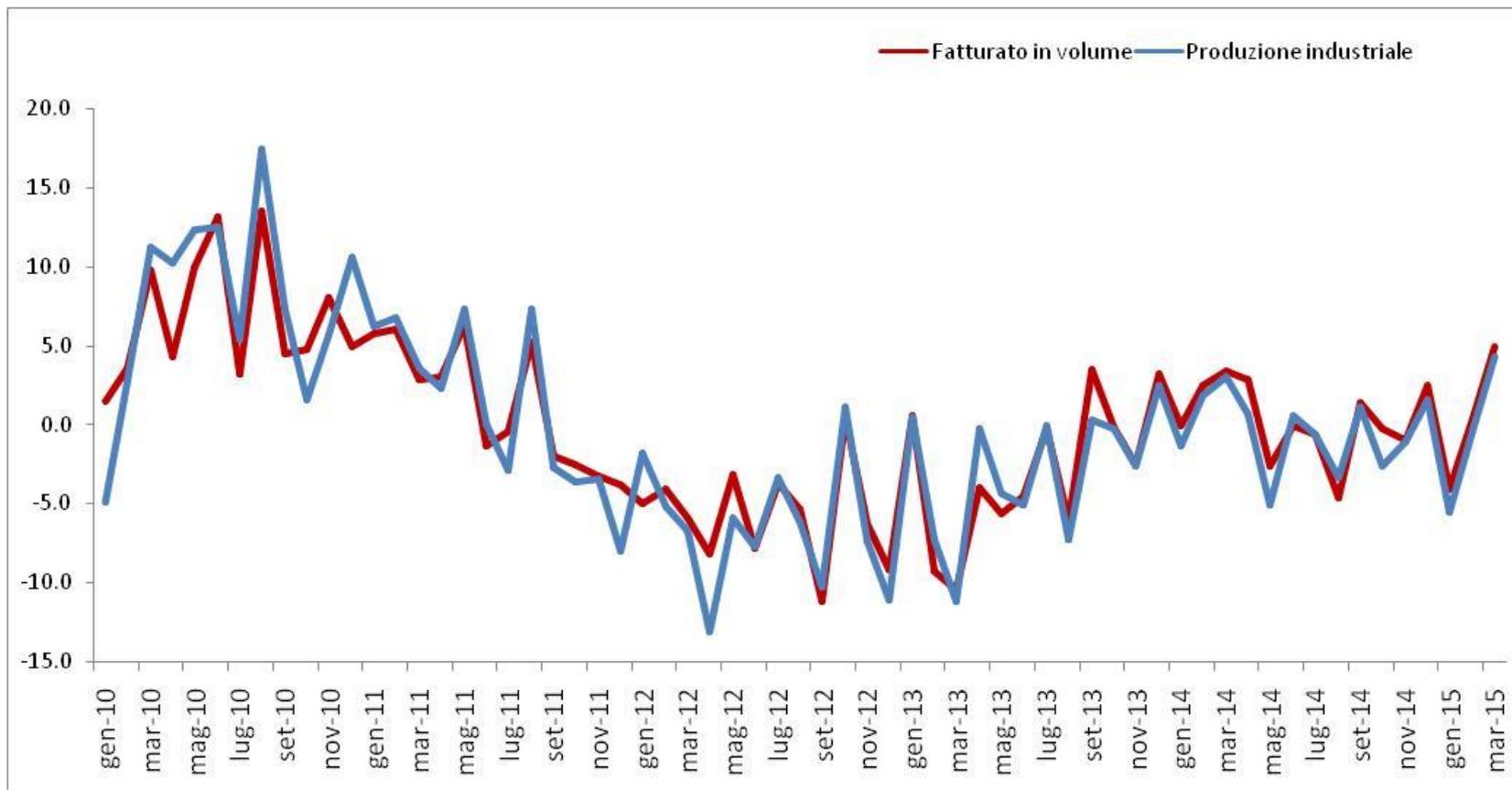
- ricorso alle scorte;
- presenza di prodotti diversi rispetto a quelli caratteristici dell'Ateco di appartenenza dell'impresa che possono avere andamenti diversi sul mercato;
- presenza di servizi commerciali, di vendita di prodotti collaterali come i prodotti di scarto o energetici;
- delocalizzazione all'estero di fasi del processo produttivo;
- effettuazione di lavorazioni per conto terzi;
- processi a lungo ciclo di lavorazione con fatturazione a stato avanzamento lavori e produzione continua.

- **FATTORI STATISTICI**

INDICE DI PRODUZIONE E INDICE DI VOLUME DEL FATTURATO

A livello aggregato la maggior parte delle differenze fra i due indici si compensano

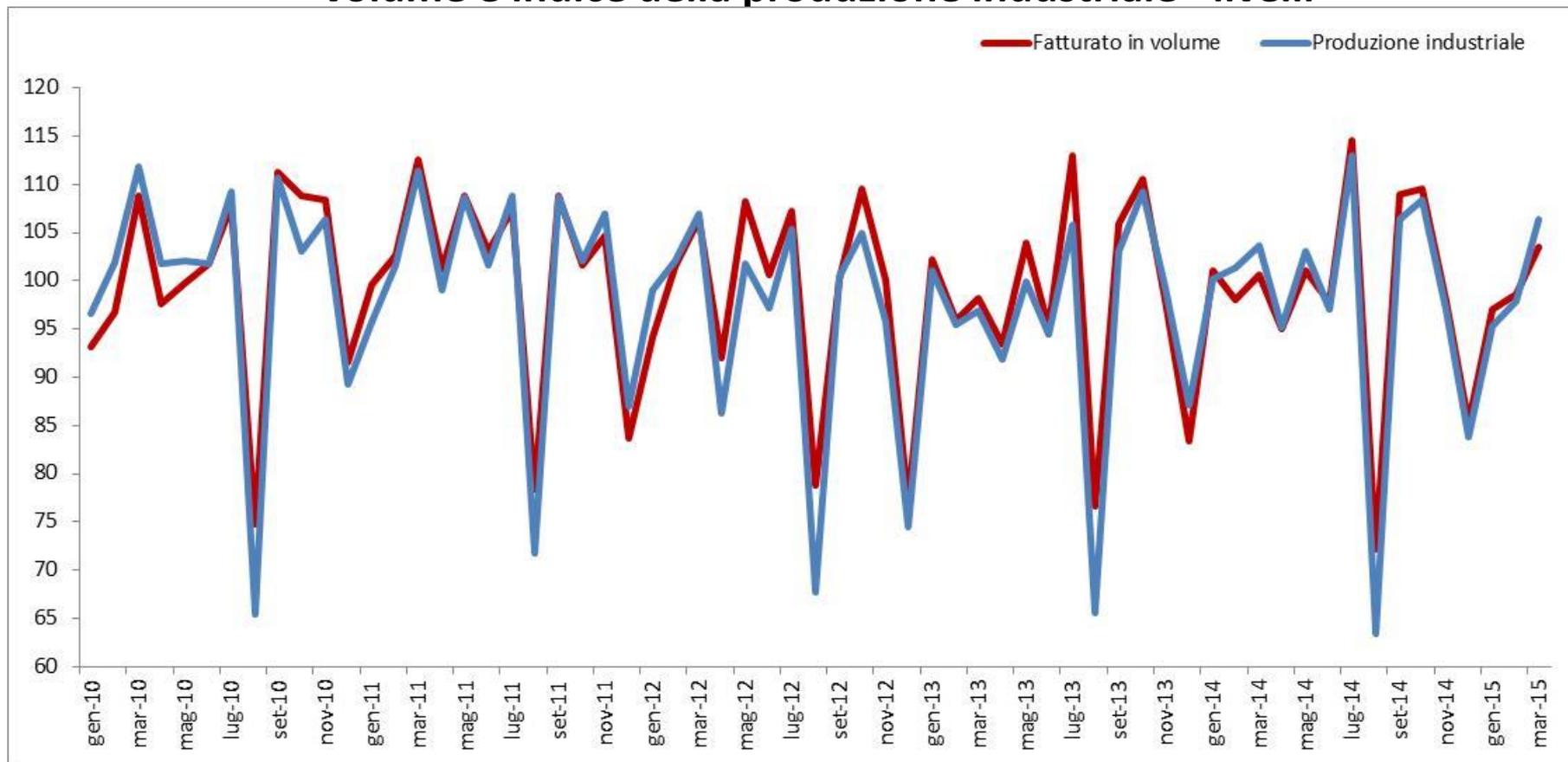
Settore manifatturiero: confronto fra indice del fatturato in volume e indice della produzione industriale – variazioni tendenziali su dati grezzi



INDICE DI PRODUZIONE E INDICE DI VOLUME DEL FATTURATO

In alcuni settori, già a livello di gruppo le differenze fra i due indici si compensano (1)

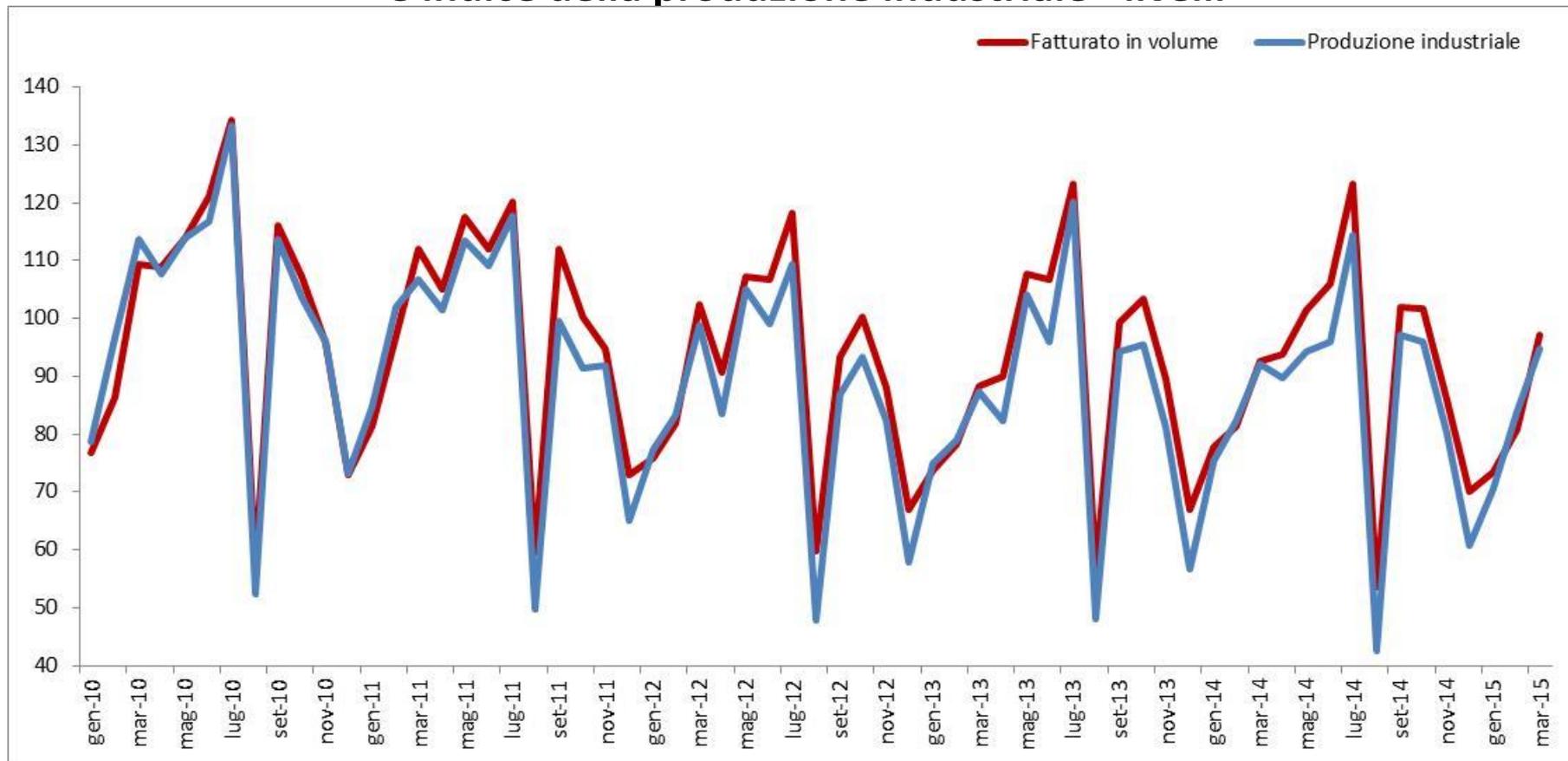
Fabbricazione di articoli di carta e cartone: indice del fatturato in volume e indice della produzione industriale - livelli



INDICE DI PRODUZIONE E INDICE DI VOLUME DEL FATTURATO

In alcuni settori, già a livello di gruppo le differenze fra i due indici si compensano (2)

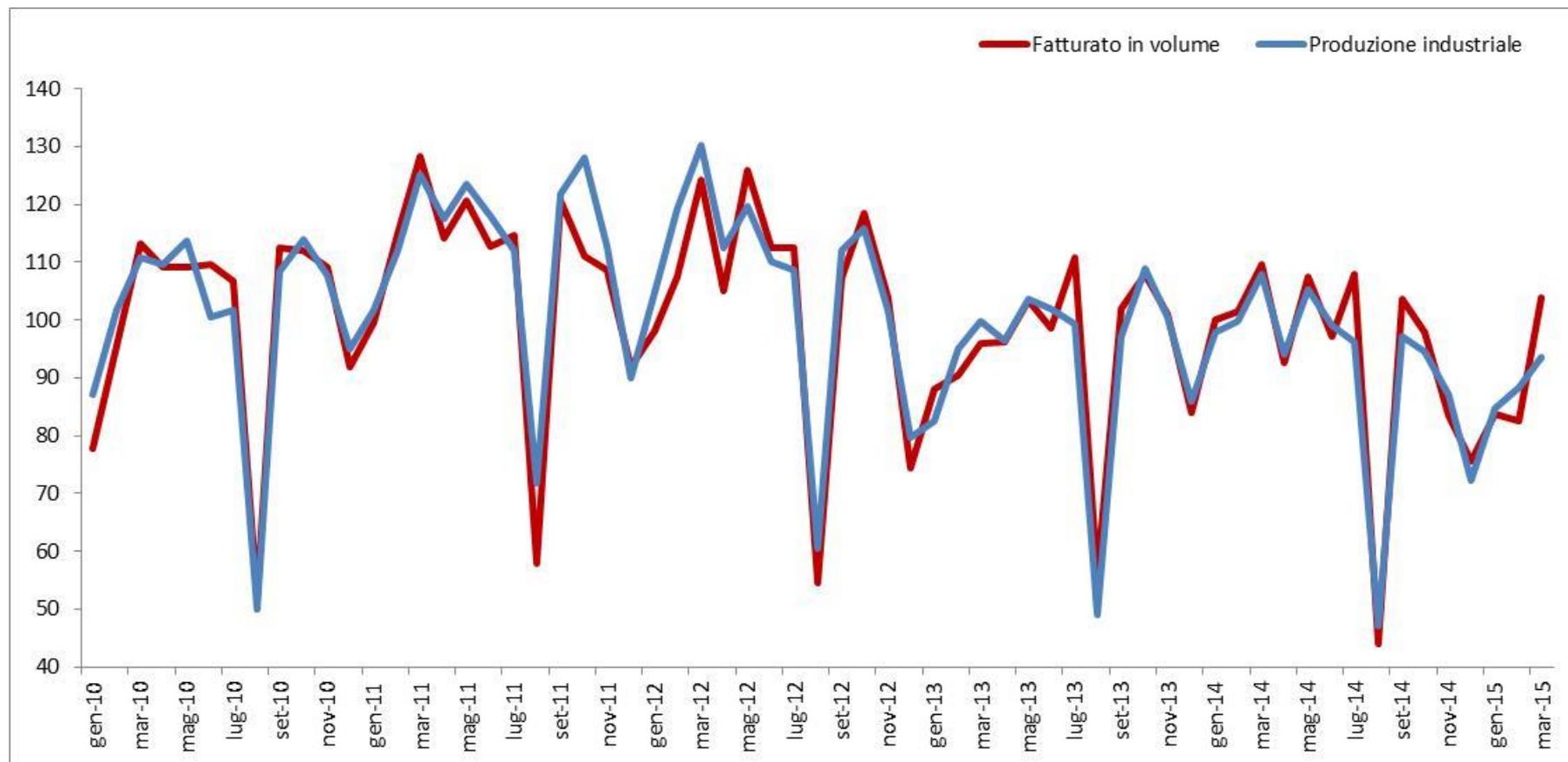
Fabbricazione di pitture, vernici e smalti: indice del fatturato in volume e indice della produzione industriale - livelli



INDICE DI PRODUZIONE E INDICE DI VOLUME DEL FATTURATO

In alcuni settori, già a livello di gruppo le differenze fra i due indici si compensano (3)

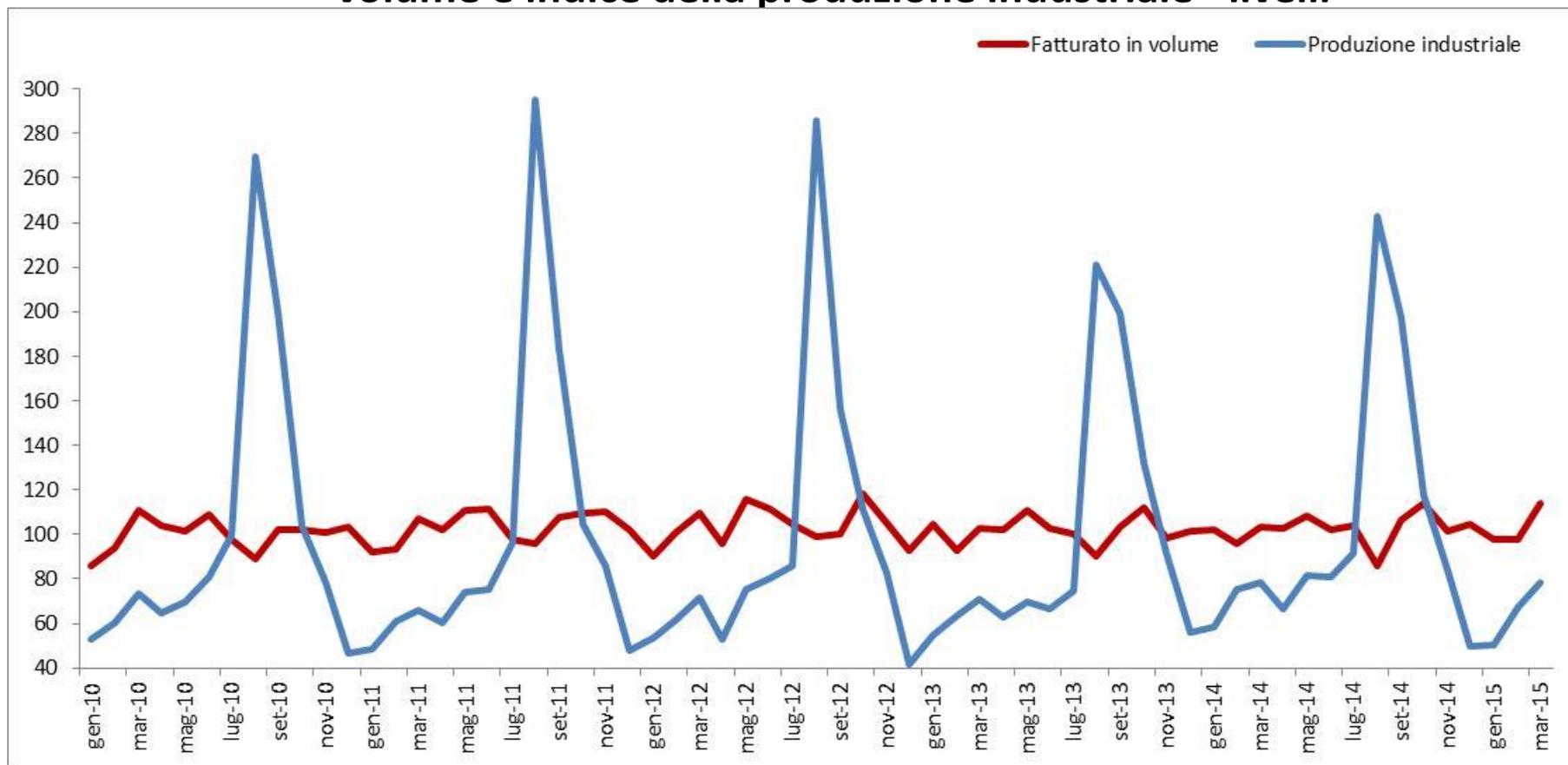
Siderurgia: indice del fatturato in volume e indice della produzione industriale - livelli



INDICE DI PRODUZIONE E INDICE DI VOLUME DEL FATTURATO

Mentre in alcuni settori le cause dei differenti andamenti sono chiaramente identificabili: **EFFETTO SCORTE**

Lavorazione e conservazione di frutta e ortaggi: indice del fatturato in volume e indice della produzione industriale - livelli

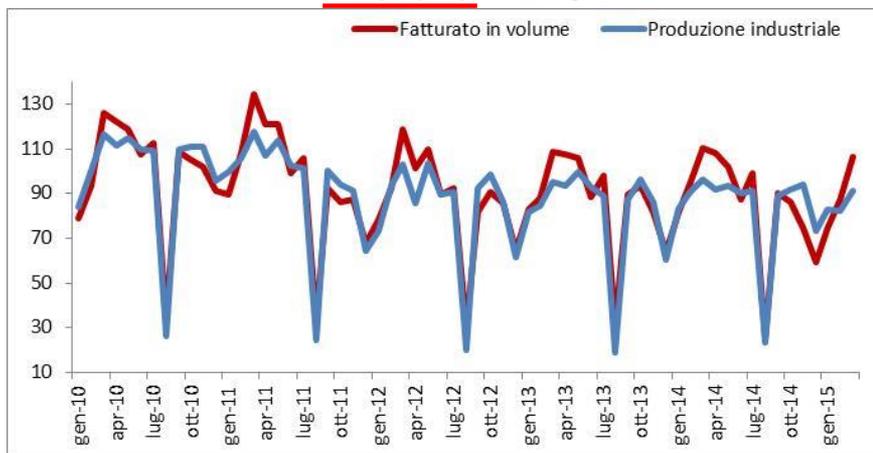


INDICE DI PRODUZIONE E INDICE DI VOLUME DEL FATTURATO

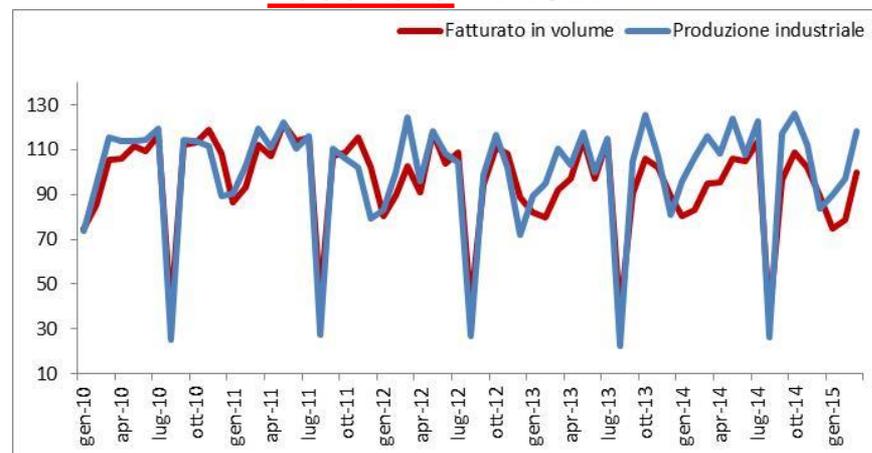
Mentre in alcuni settori le cause dei differenti andamenti sono

chiaramente identificabili: **MIX DI PRODOTTI (1)**

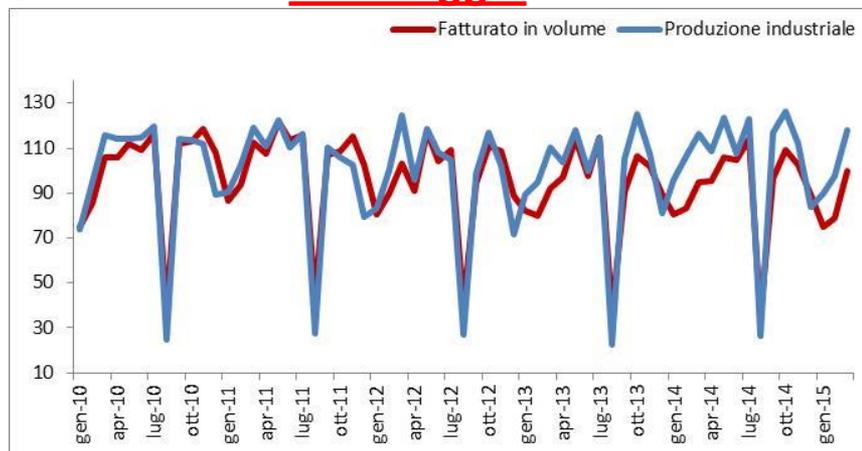
Filatura - livelli



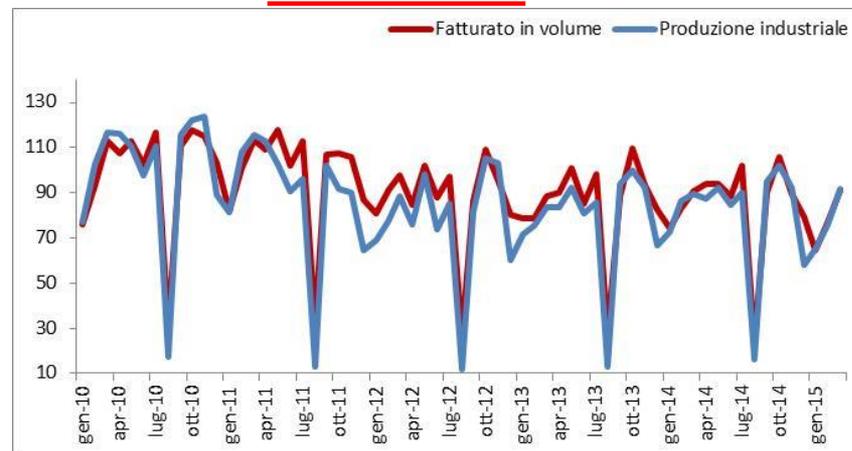
Tessitura - livelli



Finissaggio - livelli



Altro tessile - livelli

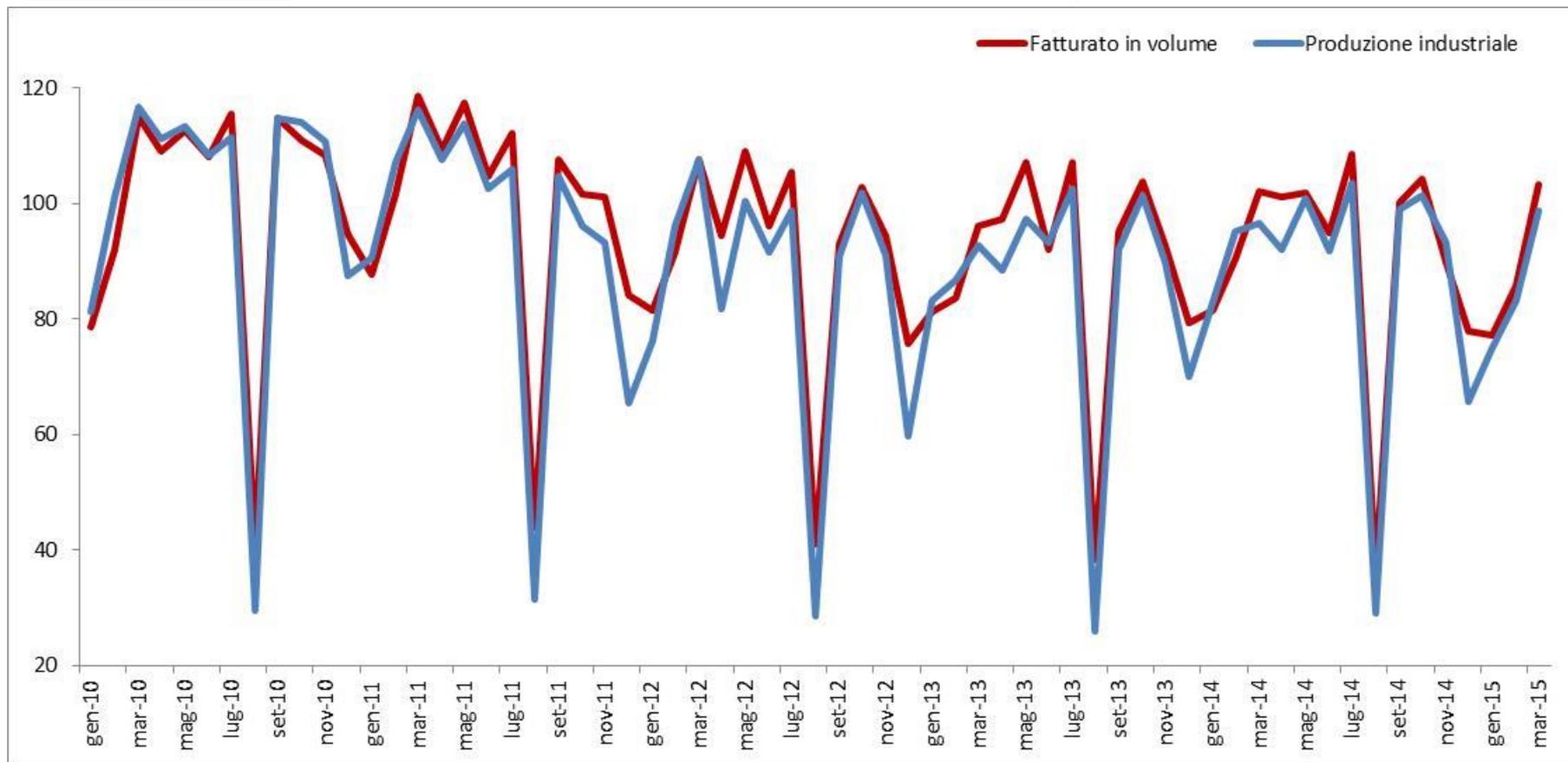


INDICE DI PRODUZIONE E INDICE DI VOLUME DEL FATTURATO

Mentre in alcuni settori le cause dei differenti andamenti sono chiaramente identificabili: **MIX DI PRODOTTI (2)**

Aggregando al livello superiore l'effetto mix di prodotti si compensa

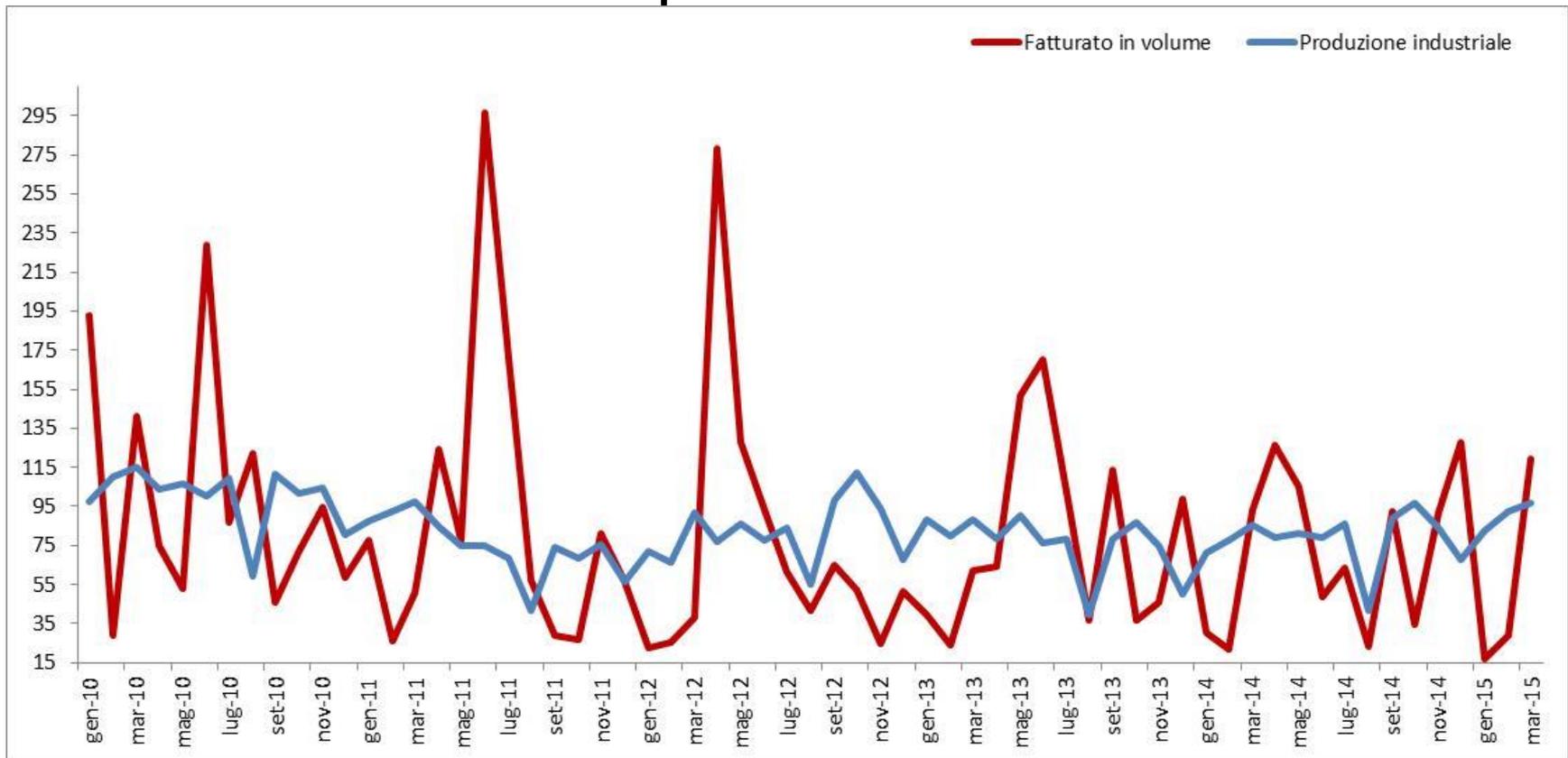
Industrie tessili: indice del fatturato in volume e indice della produzione industriale - livelli



INDICE DI PRODUZIONE E INDICE DI VOLUME DEL FATTURATO

Mentre in alcuni settori le cause dei differenti andamenti sono chiaramente identificabili: **EFFETTO LUNGO CICLO DI LAVORAZIONE**

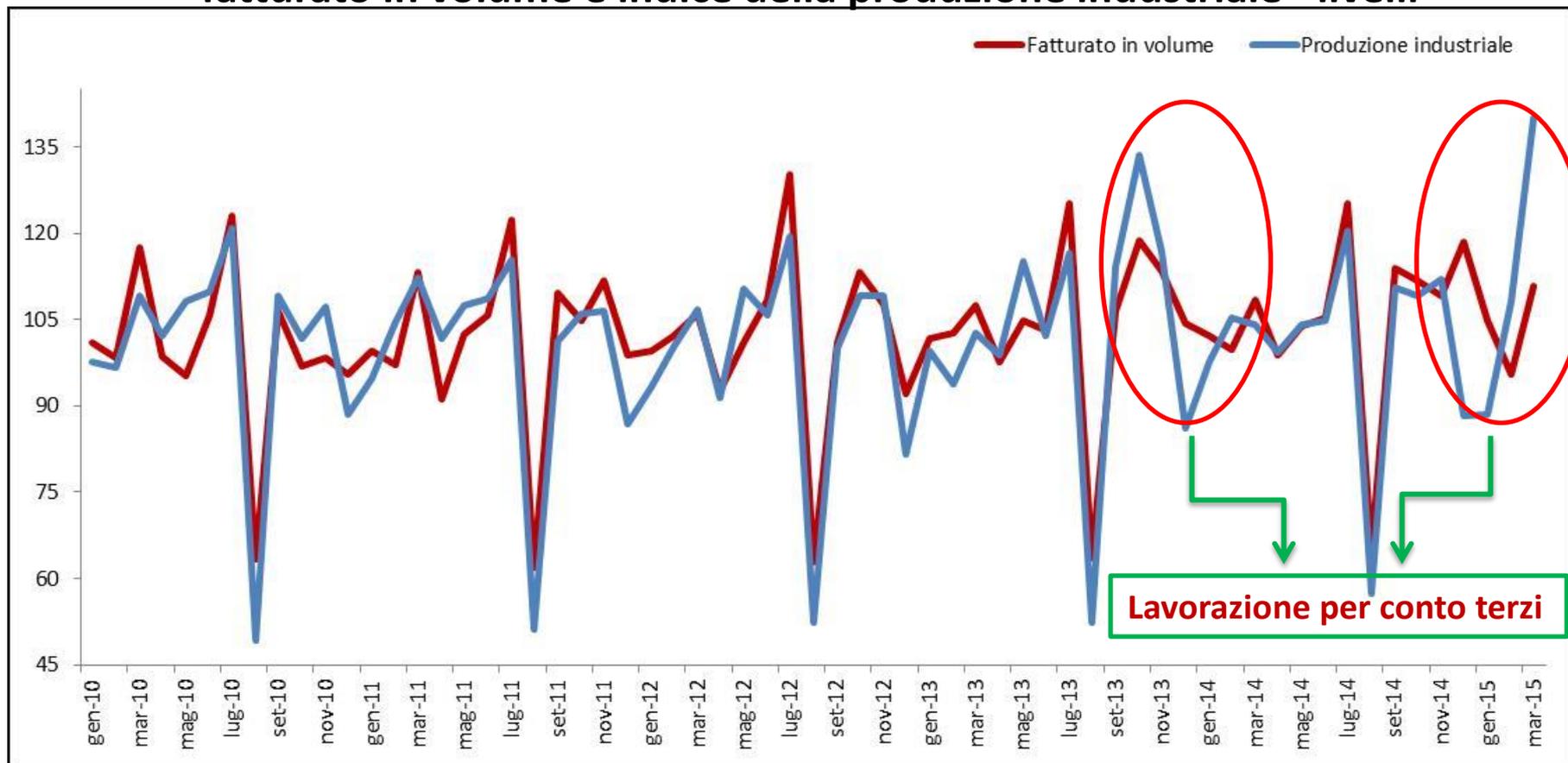
Costruzione di navi e imbarcazioni: indice del fatturato in volume e indice della produzione industriale - livelli



INDICE DI PRODUZIONE E INDICE DI VOLUME DEL FATTURATO

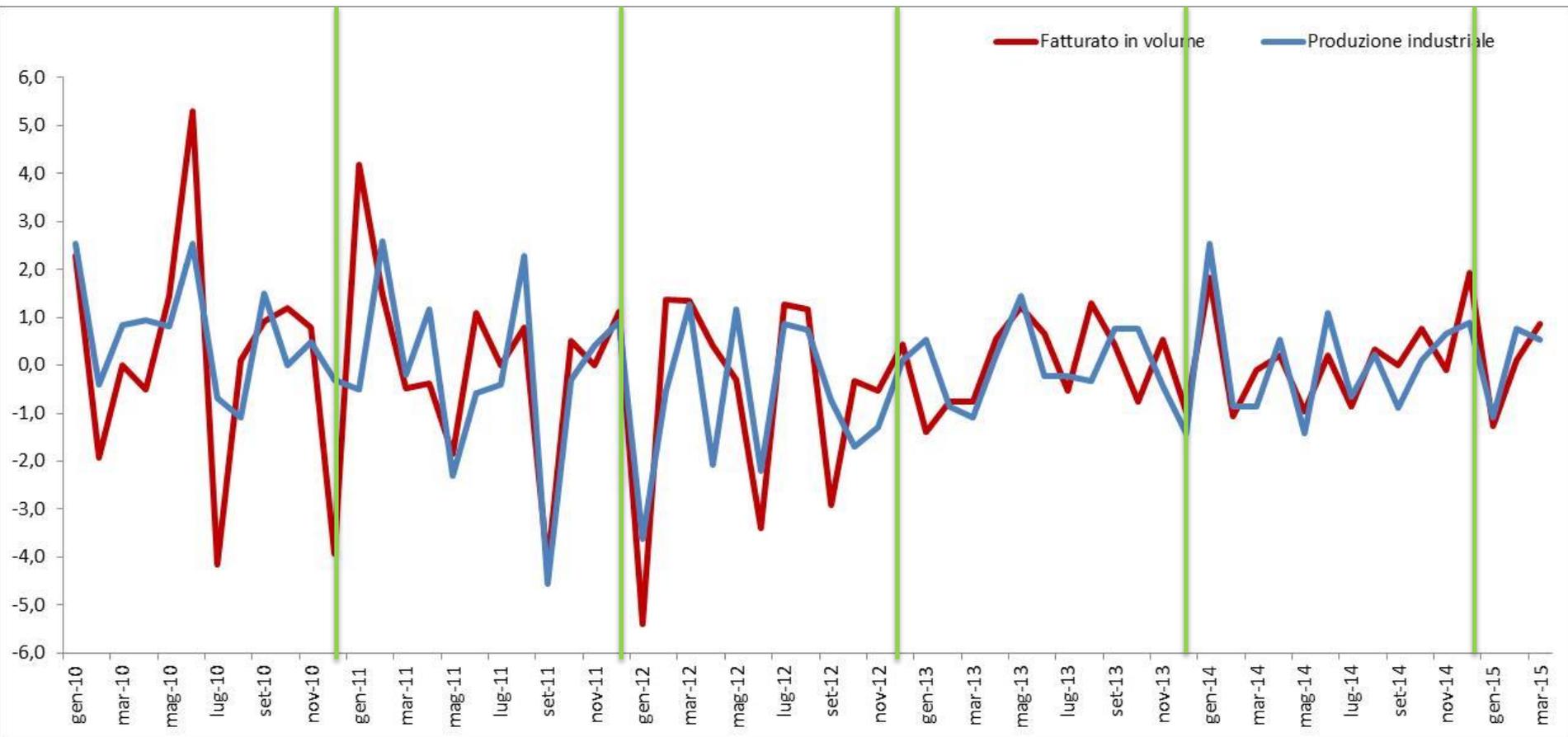
In alcuni casi - quando si ipotizza di essere in presenza di un dato anomalo - occorre verificare l'informazione micro, contattando l'impresa

Fabbricazione di medicinali e di preparati farmaceutici: indice del fatturato in volume e indice della produzione industriale - livelli



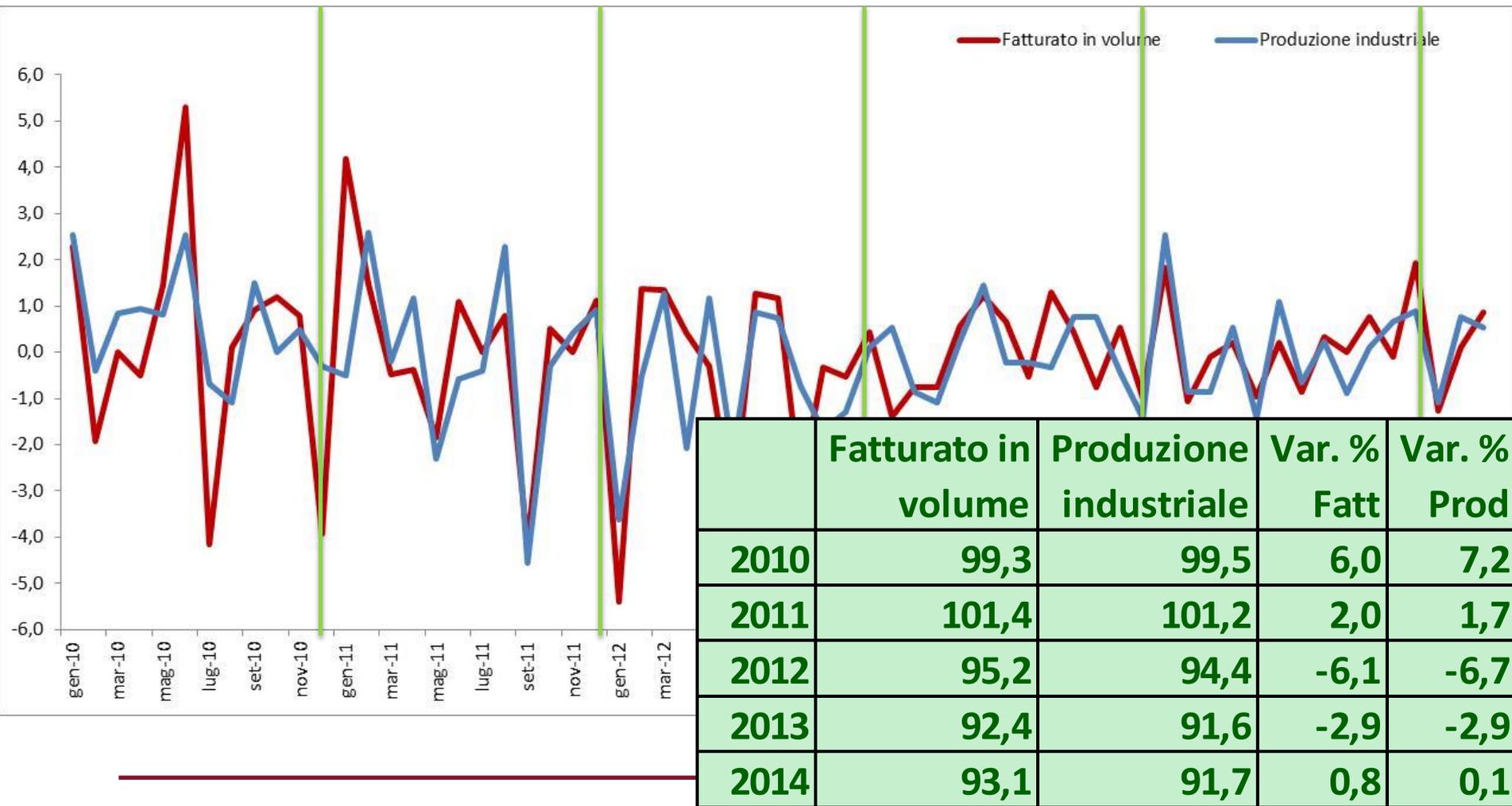
Produzione e fatturato: destagionalizzazione

Settore manifatturiero: confronto fra indice di volume del fatturato e indice della produzione industriale - variazioni congiunturali- dati destagionalizzati



Produzione e fatturato: destagionalizzazione

Settore manifatturiero: confronto fra indice di volume del fatturato e indice della produzione industriale - variazioni congiunturali- dati destagionalizzati



Produzione e fatturato: destagionalizzazione

PRODUZIONE: METODO DIRETTO

- gli indici della produzione industriale sono **trattati separatamente** per ciascun settore di attività economica, raggruppamento principale di industrie e per l'indice generale;
- gli indici più aggregati non sono calcolati come sintesi dei dati destagionalizzati riferiti ai livelli inferiori di classificazione;
- solo gli indici relativi ai **beni di consumo** vengono corretti per gli effetti di calendario e destagionalizzati separatamente per le componenti durevole e non durevole, ottenendo poi il totale come media ponderata.

FATTURATO: METODO INDIRETTO

- gli indici vengono destagionalizzati **separatamente** sia per il fatturato del mercato interno, sia per quello estero a livello di raggruppamenti principali di industria;
- il fatturato totale è ottenuto come **sintesi**.

Produzione e fatturato: destagionalizzazione

Approccio diretto

quando?

- le serie componenti presentano modelli stagionali simili;
- non esistono vincoli additivi tra serie componenti e aggregato.

La coerenza interna tra aggregato e serie componenti non è rispettata



possibilità di avere *fuori range*

Approccio indiretto

quando?

- le serie componenti hanno diverse caratteristiche
- le serie componenti hanno peso diverso e variabile nel tempo sull'aggregato
- importanza dei vincoli additivi

La coerenza interna tra aggregato e serie componenti è sempre rispettata

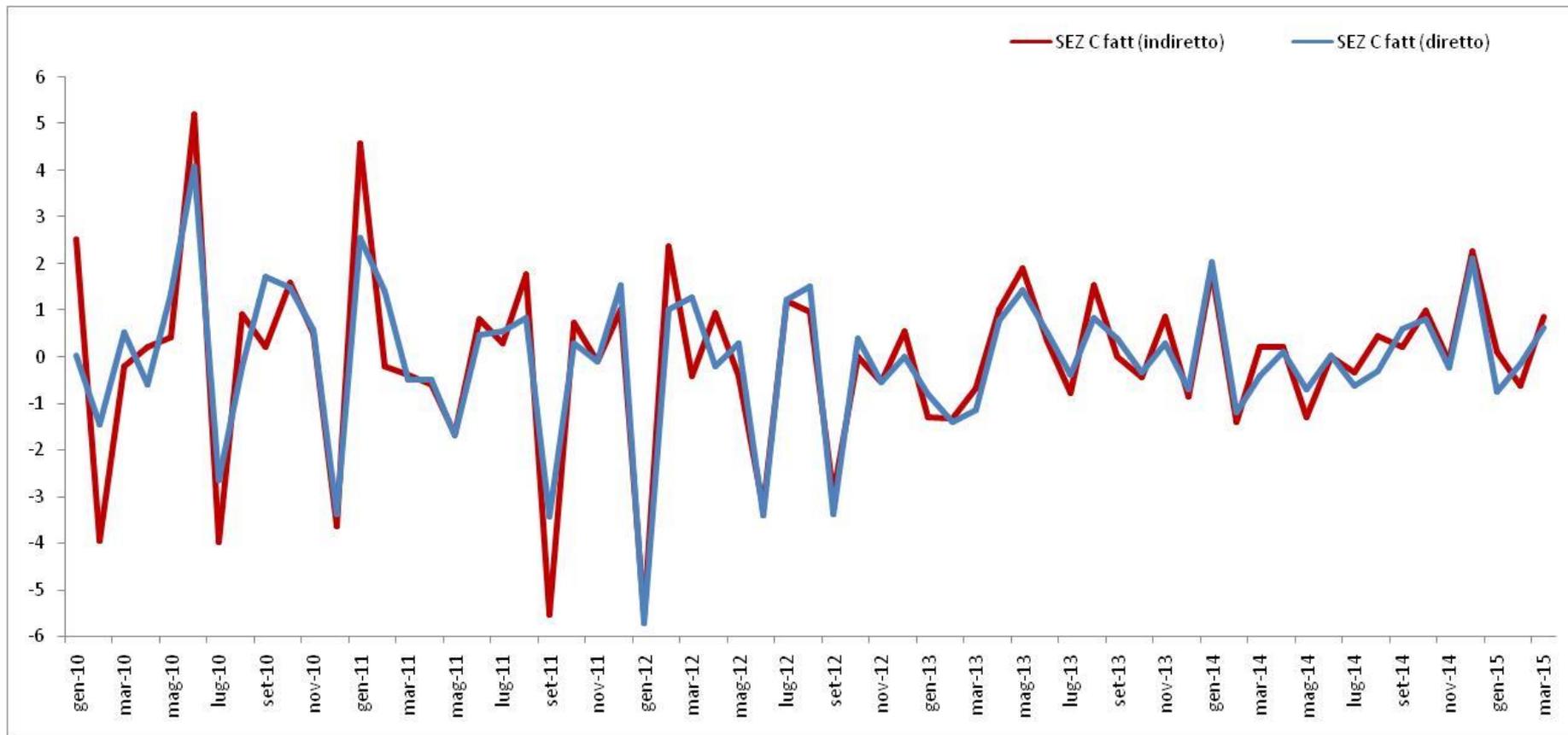


Gli indici *ribasati* non sono additivi:
necessità di ridefinire il sistema dei pesi

Approccio diretto-indiretto

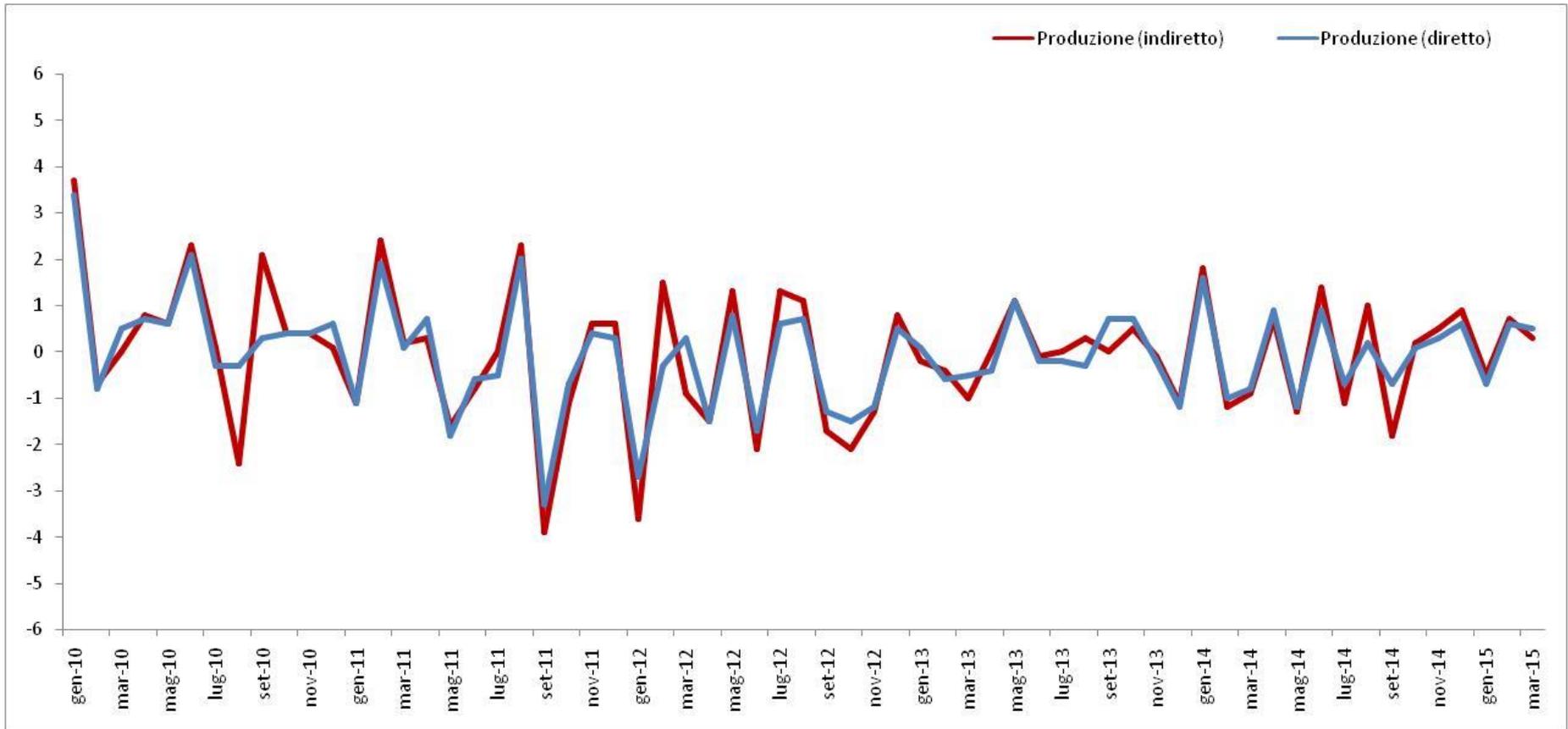
L'approccio indiretto tende a generare variazioni congiunturali di maggiore ampiezza:

Settore manifatturiero del Fatturato (base 2010 =100) - variazioni congiunturali



Approccio diretto-indiretto

Indice generale produzione industriale (base 2010 =100) - variazioni congiunturali



Fatturato e assetto organizzativo delle imprese

La demografia di impresa e i cambiamenti nelle strategie aziendali hanno un effetto diretto sulla rilevazione del fatturato

- Demografia: gli 'eventi' legati alla demografia di impresa possono avere effetti sulla misurazione dell'indice non legati a fattori economici ma solo a riorganizzazioni aziendali. L'andamento dell'indice deve essere 'sterilizzato' dalle conseguenze di tali modifiche puramente organizzative.
- Cambiamenti nelle strategie aziendali: gli effetti devono essere identificati e verificati per essere certi di non essere in presenza di errori di rilevazione. L'andamento dell'indice deve tenerne giusto conto.

Fatturato e demografia di impresa: cessazione per trasferimento

Nel caso di cessazione di un'impresa che effettua il trasferimento dell'attività ad una nuova si procede con l'inclusione della nuova impresa nel campione, ciò nel caso essa risulti in campo di osservazione per numero di addetti e per tipologia di attività economica

Fatturato e cambi di strategia aziendale: lavorazione conto terzi

Una delle modifiche delle strategie aziendali che ha il maggior impatto sulla misurazione del fatturato dell'industria è il passaggio da impresa produttrice 'diretta' a impresa che effettua lavorazioni per conto terzi, producendo cioè beni per i quali non è proprietaria né delle materie prime, né del prodotto finito. In questi casi l'impresa manifatturiera presta il solo servizio di lavorazione e non vende direttamente il prodotto lavorato sul mercato.

Fatturato e lavorazione conto terzi

Il fenomeno della lavorazione per conto terzi diventa sempre più rilevante e comporta necessariamente un forte salto nei livelli dei fatturati delle imprese coinvolte



Si passa dalla fatturazione del prodotto finito venduto direttamente agli utilizzatori finali alla fatturazione del solo servizio di lavorazione



Questo fenomeno comporta una discrepanza fra il fatturato che subisce una forte riduzione e la produzione che può rimanere stabile.

Lavorazione conto terzi: per committenti esteri

In molti casi, la fatturazione diretta agli utilizzatori finali avveniva verso clienti residenti sul territorio nazionale, mentre la fatturazione del servizio di lavorazione avviene verso clienti non residenti



Rilevante modifica dei livelli e inversione del peso relativo del fatturato interno ed estero



Questo fenomeno comporta una discrepanza fra fatturato estero ed esportazioni, perché i prodotti lavorati per committenti esteri sono contabilizzati come fatturato estero ma possono non essere esportati

Fatturazione verso rappresentanti fiscali



Gli indici del fatturato interno e non interno richiedono che il fatturato sia suddiviso secondo la prima destinazione del prodotto in base al cambiamento di proprietà (vi siano o no corrispondenti movimenti fisici dei beni attraverso le frontiere). **La destinazione è determinata dalla residenza del terzo che ha acquistato i beni e i servizi.** Il mercato interno è costituito dai terzi residenti nello stesso territorio nazionale dell'unità d'osservazione. (Regolamento (CE) N. 588/2001)

Esportazioni attivate da non residenti

Numero di esportatori non residenti e relativo valore esportato: valori in milioni di euro e quote percentuali sul totale delle esportazioni

2004			2007			2010			2012		
		% su									
Num.	Valore	Tot exp									
87	524	0,2	253	1.594	0,4	241	1.590	0,5	257	2.817	0,8

Fonte: Annuario statistico Istat-ICE, anni vari

GRAZIE PER L'ATTENZIONE