

ВЫСШАЯ ШКОЛА ЭКОНОМИКИ  
НАЦИОНАЛЬНЫЙ ИССЛЕДОВАТЕЛЬСКИЙ УНИВЕРСИТЕТ  
ПРИ УЧАСТИИ ВСЕМИРНОГО БАНКА  
И МЕЖДУНАРОДНОГО ВАЛЮТНОГО ФОНДА

---

# **XII МЕЖДУНАРОДНАЯ НАУЧНАЯ КОНФЕРЕНЦИЯ ПО ПРОБЛЕМАМ РАЗВИТИЯ ЭКОНОМИКИ И ОБЩЕСТВА**

В четырех книгах

*Ответственный редактор  
Е.Г. Ясин*

# **1**



---

Издательский дом  
Высшей школы экономики  
Москва, 2012

УДК 330.101.5(063)  
ББК 65.012  
Д23

*Идеи и выводы авторов не обязательно отражают  
позиции представляемых ими организаций*

ISBN 978-5-7598-0951-7 (кн. 1)  
ISBN 978-5-7598-0950-0

© Оформление. Издательский дом  
Высшей школы экономики, 2012

## СО Д Е Р Ж А Н И Е

### **МИРОВОЙ ЭКОНОМИЧЕСКИЙ КРИЗИС И ПЕРСПЕКТИВЫ МОДЕРНИЗАЦИИ В РОССИИ**

Ясин Е.Г.

Сравнение уровня и образа жизни населения России  
в 1929–2009 гг. .... 11

Кудрин А.Л.

Важнейшие факторы модернизации экономики ..... 30

Бальцерович Л.

Необходимость радикальных рыночных реформ ..... 39

Гурнев С.М.

Посткризисное развитие глобальной экономики ..... 48

May В.А.

Риски и вызовы социально-экономического развития страны ..... 57

Алексашенко С.В.

Сценарии и альтернативы макроэкономической политики ..... 62

### **КАЧЕСТВО И ОБРАЗ ЖИЗНИ: ИЗМЕНЕНИЕ ВО ВРЕМЕНИ И ПРОСТРАНСТВЕ**

Кузьминов Я.И.

Направления развития образования в России..... 75

Фурсенко А.А.

Задачи, стоящие перед образованием..... 88

Sassen S.

A Savage Sorting of Winners and Losers:  
When Complexity Produces Brutality ..... 99

### **МАКРОЭКОНОМИКА И ЭКОНОМИЧЕСКИЙ РОСТ**

Гурвич Е.Т., Прилепский И.В.

Внешние и внутренние факторы кризисного спада производства ..... 111

Куранов Г.О.	
Потенциалы, составляющие и источники экономического роста .....	124
Гурвич Е.Т.	
Природная рента и мягкие бюджетные ограничения .....	134
Кузнецова О.С.	
Проведение денежно-кредитной политики в монетарном союзе в условиях неопределенности .....	144
Ларин А.В., Новак А.Е.	
Ошибки прогнозов инфляции в России: шоки или политика? .....	157
Веселов Д.А.	
Ловушка бедности в странах, экспортирующих природные ресурсы .....	169
Тамилина Л.В.	
Специфика влияния институтов на экономический рост в условиях перехода к рынку .....	181
Натхов Т.В., Полищук Л.И.	
Распределение талантов и качество институтов .....	191
 <b>ГРАЖДАНСКОЕ ОБЩЕСТВО И ДЕМОКРАТИЯ</b>	
Мерсиянова И.В.	
Повседневные практики гражданского общества в образе жизни россиян .....	207
Туманова А.С.	
Гражданское общество и его адаптивные возможности в кризисных условиях .....	217
Никовская Л.И., Якимец В.Н.	
Анализ оценок представителями гражданского общества и власти состояния публичной политики в регионах России .....	225

Левин М.И., Шилова Н.В., Фреер М.Л.

О моделях ксенофобии и межнациональной розни..... 234

Мерсиянова И.В., Пахомова Е.И., Якимец В.Н.

Роль доверия к госслужащим во взаимодействии  
гражданского общества и государства..... 241

Подъячев К.В.

Современная политология о взаимодействии власти  
и общества: теоретическое осмысление и значение  
для российской политики ..... 252

Солодова И.И.

Потенциал корпоративной благотворительности  
в развитии местных сообществ: существующие  
ограничения ..... 261

Зубарева Д.С.

Социальный капитал и дорожное движение:  
дороги и власти, которые мы выбираем..... 272

Ермишина А.В.

Моделирование социального капитала в жилищной  
самоорганизации ..... 283

Какабадзе Ш.Ш., Звягина Н.А.

Добровольный отказ гражданских общественных  
объединений от статуса юридического лица: новые риски  
и новые возможности ..... 291

Беляева Н.Ю., Карастелев В.Е.

Формы гражданского участия гражданских объединений  
в публичной политике..... 302

Задорин И.В., Зайцев Д.Г.

Вопросы идентификации и самоидентификации  
«гражданских объединений» ..... 311

## ДЕМОГРАФИЯ

Шитова Ю.Ю., Шитов Ю.А.

Количественные оценки взаимосвязи потоков маятниковой  
трудовой и безвозвратной миграций в Подмоскowie..... 323

Вакуленко Е.С., Мкртчян Н.В., Фурманов К.К.

Межрегиональная миграция в России: моделирование связи  
с социально-экономическими индикаторами и влияние фактора  
расстояния..... 334

Тындик А.О.

Индивидуальные истории образования и рождения первого ребенка  
в разных поколениях мужчин и женщин в России ..... 339

Рождественская Е.Ю.

Отцовство: либеральный тренд от отца к папе?..... 349

Орлов А.Ю.

Демографические исследования этноассимиляционных процессов..... 358

Niculescu-Aron I., Mihaescu C., Caplescu R.

Do Romanian People Still Want Babies? Recent Aspects Regarding  
the Natality Behaviour as a Component of a New Mode of Life ..... 367

Mihaescu C., Niculescu-Aron I., Caplescu R.

Recent Evidence in Couple Formation in Romania:  
Shifting Towards the Western Model?..... 378

Agadjanian V., Dommaraju P., Nedoluzhko L.

Diverging Economic Fortunes and Fertility Dynamics in Central Asia:  
Kazakhstan and Kyrgyzstan Compared..... 390

Агаджанян В., Зотова Н.А.

Социальная уязвимость и сексуальные риски женщин-мигрантов  
из Средней Азии в Москве ..... 404

Пальян З.О.

Рождаемость в контексте естественного воспроизводства населения  
Украины: статистический аспект..... 414

## **РЫНКИ ТРУДА**

Cook L.J.

Russian Labor: The Puzzle of Quiescence ..... 427

Смирных Л.И.

Нестандартные трудовые договора: опыт российских предприятий ..... 435

Гимпельсон В.Е., Зудина А.А.

Неформальный сектор в России: динамика, структура,  
детерминанты ..... 444

## **КАЧЕСТВО ГОСУДАРСТВЕННОГО УПРАВЛЕНИЯ**

Иванов А.Е.

Государственный заказчик на конкурентном рынке ..... 461

Ерёмина А.В., Зороастрова И.В.

Эмпирический анализ факторов сговора  
на рынке государственных закупок ..... 473

Маслова Н.С., Кузнецова И.В.

Оценка рисков как институт управления обеспечением  
государственных нужд ..... 482

Дерман Д.О., Цыганков Д.Б.

Сравнительный анализ внедрения инструментов оценки  
регулирующего воздействия в России и СНГ ..... 491

Патокина О.А., Хаймур Э.Г.

Алгоритм передачи на аутсорсинг административно-управленческих  
процессов органами исполнительной власти ..... 500

Нисневич Ю.А.

Коррупция как фактор снижения конкурентоспособности  
государства: сопоставительно-институциональный анализ ..... 511

Ниненко И.С.

Декларации о доходах, об имуществе и обязательствах  
имущественного характера публичных должностных лиц.  
Применение в России и в мире ..... 521

Церкасеvич Л.В.

Коррупция в Швеции: проблемы идентификации и измерения ..... 531

## БАНКИ И ФИНАНСЫ

Tlekhugov N.V., Kush K.F., Stolyarov A.I.

Methods for Detection of Non-typical Transactions.  
Application for Russian Stock Market ..... 541

Теплова Т.В., Шутова Е.С.

Сопоставление мер риска для объяснения доходности  
инвестирования на локальных фондовых рынках  
переходных экономик ..... 553

Ersel H.

Economic Requirements of Macroprudential Regulation ..... 563

Белоусова В.Ю.

Анализ влияния макросреды на эффективность издержек  
российских банков..... 575

Glushkova E., Vernikov A.

Does State Ownership of Banks Hinder Financial Development  
and Economic Growth in Emerging Markets? ..... 579

Sokolov V.

Tracing the Impact of Central Bank Liquidity Infusions  
on Financially Constrained Banks: Evidence from a Natural  
Experiment ..... 589

Головань С.В., Карминский А.М., Пересецкий А.А.

Сопоставление рейтинговых шкал агентств на основе  
эконометрического анализа рейтингов российских банков ..... 600

Слепухина Ю.Э.

Управление инвестиционным потенциалом  
в российском страховом бизнесе: традиции, инновации  
или неиспользованные возможности роста? ..... 614

Lingelbach D.

Paradise Postponed? Venture Capital Emergence  
in a Transition Economy ..... 624

Берзон Н.И., Мезенцев В.В.

Применение структурных и редуцированных моделей  
для оценки кредитных дефолтных свопов на российские компании ..... 633



**МИРОВОЙ  
ЭКОНОМИЧЕСКИЙ  
КРИЗИС  
И ПЕРСПЕКТИВЫ  
МОДЕРНИЗАЦИИ  
В РОССИИ**

---



Е.Г. Ясин  
Национальный исследовательский  
университет «Высшая школа экономики»

# **СРАВНЕНИЕ УРОВНЯ И ОБРАЗА ЖИЗНИ НАСЕЛЕНИЯ РОССИИ В 1929–2009 ГГ.**

Стенограмма выступления

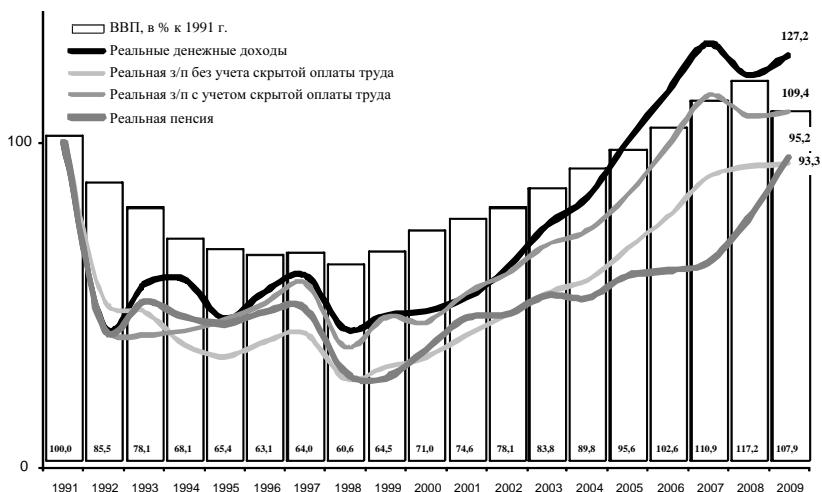
---

В конце 2010 г. мы получили предложение от журнала «Эксперт» выполнить работу на указанную тему, а вместе с ним уже выполненный расчет по определенному методу, который целесообразно было проводить на предмет состоятельности. Работа предстояла неординарная, но интересная. И мы рискнули. Этот текст – сокращенное изложение итогового доклада, который я представляю на конференции. Полный текст был роздан участникам.

Живя в большой стране, мы не замечаем тех изменений, которые постоянно происходят вокруг нас. Но спустя 20 лет ты оглядываешься и представляешь себе, что чего-то не было, что-то есть совершенно новое, что-то появилось у нас, а что-то – в других странах, и есть то, что в других странах уже было, а у нас только появилось. Вы понимаете, что это серьезное дело и игнорировать эти различия нельзя. Второе – это статистические ограничения: несопоставимость советской и российской статистики, недостаточная надежность, связанная, в частности, со сменой в этот период экономических систем, и прочее. Со всем этим нам приходилось считаться. Дальше я бы хотел сказать, что для того, чтобы обеспечить полноту картины работы «Эксперта», которая касалась только в основном текущего потребления, мы сделали еще несколько расчетов, которые позволили нам убедиться в том, что результаты наших коллег близки к истине. Мы рассмотрели три разных метода оценки динамики текущего потребления.

На рис. 1 представлена оценка динамики показателей по реальным денежным доходам. Этот расчет был выполнен Лилией Николаевной Овчаровой из Независимого института социальной политики (НИСП). Это весьма основа-

тельная работа. Мы уверены: то, что можно было сделать с этим материалом, они сделали качественно. Реальные доходы – это хорошо, но они денежные, и вы понимаете, что здесь включаются все погрешности, которые возникают в связи с построением цепных индексов, которые никогда не бывают точными, если их берут больше чем за пять лет. Если при этом еще была гиперинфляция или состояние, близкое к ней, то рассчитывать на качество данных нельзя. Тем не менее мы попробовали. Второй расчет – это расчет текущего потребления по методу системы национальных счетов. Он был выполнен нашим замечательным специалистом, асом в национальных счетах, Алексеем Николаевичем Пономаренко, который, в свое время, выполнил реконструкцию системы национальных счетов в СССР с 19960-х до 2000-х годов. Реальные денежные доходы здесь даются с учетом скрытой зарплаты, без учета скрытой зарплаты, а также приводятся реальные пенсии и динамика ВВП. В конце концов мы видим, что заметно больше ВВП, реальные денежные доходы росли быстрее и достигли к 2009 г. 127% по сравнению с 1990 г. Третий – это как раз метод, который применили в «Эксперте», это оценка изменения покупательной способности среднегодового дохода по набору товаров и услуг. О нем ниже. Я предъявляю некоторые данные, которые касаются этих трех методов.



**Рис. 1.** Динамика ВВП, реальных денежных доходов, заработной платы и пенсий, 1990 г. = 100%

Источник: расчеты Л.Н. Овчаровой, НИСП.

Я прошу обратить внимание на данные, которые касаются фактического конечного потребления домашних хозяйств. В самые тяжелые годы трансфор-

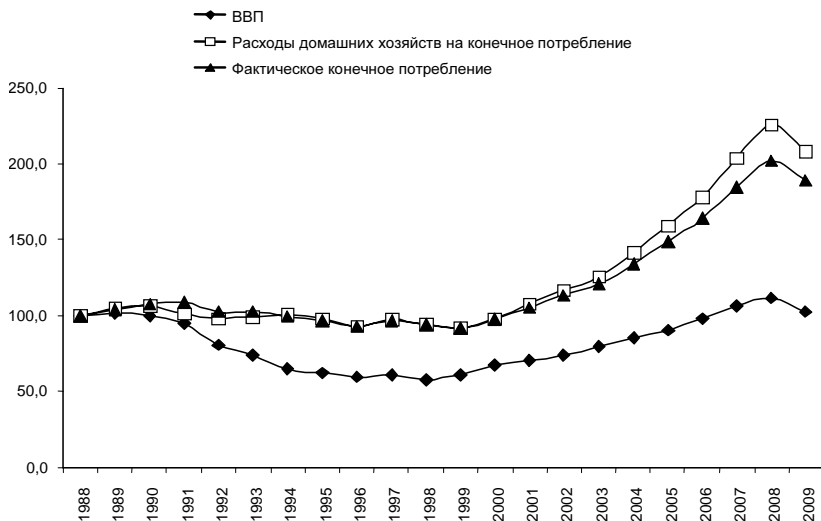
мационного кризиса все равно фактическое конечное потребление домашних хозяйств (согласно данным, которыми оперировал Алексей Николаевич) не падало ниже 92–94% от уровня 1988 г. (см. табл. 1). Это объясняется тем, что в национальных счетах учитываются неденежные доходы, которые отсутствуют в первом расчете. Там был очень крутой спад, здесь этого спада не было.

**Таблица 1.** Динамика важнейших макроэкономических показателей потребления населения России (1988 год = 100)

Годы	Динамика абсолютных значений показателей			Динамика показателей в расчете на душу населения		
	ВВП	расходы домашних хозяйств на конечное потребление	фактическое конечное потребление домашних хозяйств	ВВП	расходы домашних хозяйств на конечное потребление	фактическое конечное потребление домашних хозяйств
1988	100,0	100,0	100,0	100,0	100,0	100,0
1989	101,5	105,3	104,1	100,8	104,6	103,4
1990	99,8	106,6	107,6	98,9	105,6	106,7
1991	94,8	101,2	109,3	93,8	100,1	108,1
1992	81,0	98,2	102,8	80,1	97,0	101,6
1993	74,0	99,4	102,4	73,2	98,2	101,2
1994	64,5	100,5	99,5	63,9	99,6	98,6
1995	62,0	97,8	96,9	61,4	96,9	96,0
1996	59,8	93,0	93,1	59,3	92,3	92,4
1997	60,6	97,7	96,7	60,4	97,3	96,3
1998	57,4	94,3	94,1	57,3	94,2	94,0
1999	61,1	91,6	91,8	61,2	91,7	92,0
2000	67,2	98,3	97,2	67,6	99,0	97,9
2001	70,6	107,6	105,2	70,9	108,1	105,7
2002	73,9	116,8	113,6	74,6	117,8	114,6
2003	79,3	125,8	121,3	80,4	127,5	122,9
2004	85,0	141,5	134,0	86,6	144,2	136,6
2005	90,4	158,7	148,4	92,6	162,6	152,0
2006	97,9	178,1	164,1	100,7	183,3	168,9
2007	106,2	203,6	184,6	109,7	210,3	190,7
2008	111,7	225,6	202,2	115,6	233,4	209,2
2009	102,9	208,2	189,2	106,5	215,6	195,9

Источник: расчеты А.Н. Пономаренко на основе СНС.

Поэтому мы получаем картину, которая изображена на следующем графике (рис. 2). Мы видим: самая нижняя линия – это ВВП, дальше идут расходы домашних хозяйств на конечное потребление, которые фактически не изменяются в самые критические годы, а затем после 2000 г. резко устремляются вверх именно благодаря тому, что население в значительной степени опиралось на натуральное потребление, на личные подсобные хозяйства.



**Рис. 2.** Динамика ВВП, реальных расходов домашних хозяйств на конечное потребление и фактического конечного потребления, 1990 г. = 100%

*Источник:* расчеты А.Н. Пономаренко.

Теперь я хочу обратить внимание на следующее обстоятельство. Думаю, сказала привычка нашего населения жить в чрезвычайных обстоятельствах, рассчитывая только на себя. Данные в табл. 2 говорят о том, что произошло довольно существенное изменение структуры валового общественного продукта и участия в нем населения. Почему могло такое случиться, что, скажем, доходы населения или уровень благосостояния росли быстрее, чем рос валовый внутренний продукт? Объясняется это, прежде всего, тем обстоятельством, что существенно выросли расходы на конечное потребление и сократились уже в период кризиса валовые накопления. На предыдущем пленарном заседании отмечали то обстоятельство (в частности, Сергей Алексашенко), что для быстрого роста необходима норма накопления хотя бы 25%, а в тех странах из 13, которые добились удвоения ВВП в течение 10 лет, почти всюду норма накопления

была выше – 30% и больше. У нас произошел обратный процесс: валовые накопления в 1989 г. составляли 31%, а в 2009 г. – 19%, для круглого счета, по разным оценкам, мы сегодня имеем уровень накопления где-то 18–20%. Надо сказать, что сопоставление этих цифр с соответствующими показателями большинства развитых стран показывает, что у нас примерно одинаковые показатели. С другой стороны, мы видим, что расходы домашних хозяйств выросли с 45 до 53% ВВП. Такова доля конечного потребления в настоящее время. Это довольно существенное изменение в структуре потребления.

**Таблица 2.**                      Изменение структуры ВВП России, %

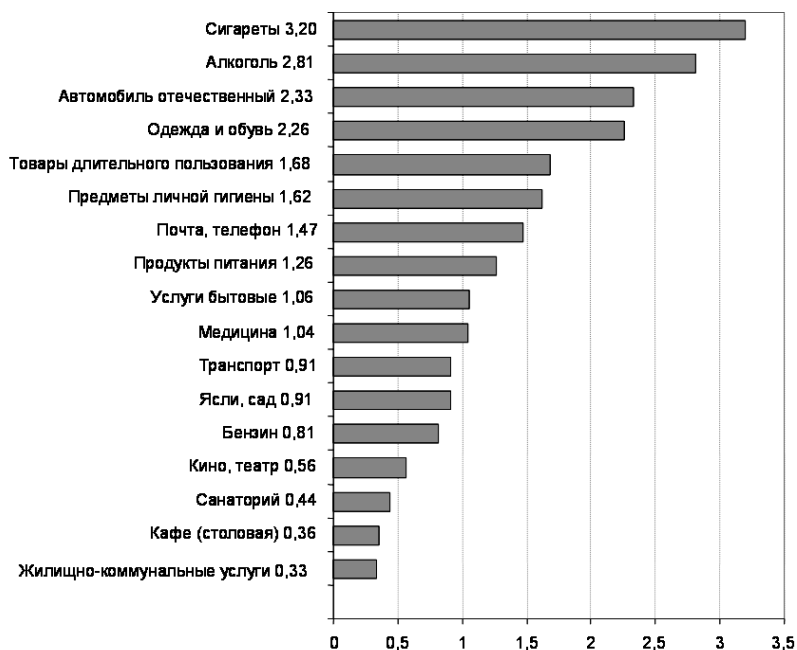
	1989 г.	2009 г.
ВВП	100	100
Расходы на конечное потребление	67	74
в том числе:		
расходы домашних хозяйств	45	53
государства и некоммерческих организаций	23	21
Валовое накопление	31	19
Чистый экспорт	2	7

Сейчас идут дискуссии на эту тему. Не так давно Владислав Леонидович Иноземцев написал статью, в которой он высказал точку зрения, что Россия продает свое будущее и что мы должны были бы иметь гораздо более высокую норму накопления. Мне кажется, что это утверждение не соответствует действительности. Ситуация, насколько я понимаю, иная. Население Советского Союза и Советской России долгое время жило при таком режиме, который регламентировал его потребление, его накопления, развернуться по части того, чтобы каким-то образом серьезно регулировать свое потребительское поведение, мы не могли. Когда такая возможность представилась, она выразилась, прежде всего, с выбором продуктов, который стал доступным в условиях рыночной экономики. Пускай это касалось не всех товаров, но все-таки появилась какая-то доступность для вариаций. На мой взгляд, рост потребления был неизбежен. С другой стороны, Россия в условиях рыночной экономики переходит, если не перешла уже, к иному инвестиционному режиму. Советский инвестиционный режим состоял в том, что нужно тратить как можно больше на накопления, а какова эффективность этого накопления – не так важно. Мы брали в основном объемами.

В настоящее время ситуация изменилась. Первое следствие этого изменения мы видим – это сокращение доли накопления. Сейчас ставится задача, и в предыдущей версии Стратегии-2020 ставилась задача повысить накопление до 25%. Я не знаю, как можно этого добиться, это нужно очень сильно стимулировать людей, они должны идти на какие-то лишения, учитывая нынешний уровень потребления и отрицательную ставку процента по депозитам. Так что это задача не из простых. Только если повышать объемы государственных и предпринимательских инвестиций. Вторая половина задачи – повышение эффективности накопления – по ряду причин не достигнута. Мы имеем довольно плохие показатели эффективности накопления. Встает вопрос, что при этих эффективности и норме накопления мы больших темпов экономического роста в будущем можем вообще не достигнуть. Но факт остается фактом: мы существенно повысили уровень потребления, расходов домашних хозяйств на конечное потребление, в том числе за счет снижения уровня накопления. Так что дело не только в ценах на нефть. Это показали наши сопоставления. Можно сказать, мы имеем экономику расточительного потребления.

Теперь два слова относительно того, какой метод предложен «Экспертом». На самом деле метод известен, но в России его никто, кажется, не пробовал. Суть его заключается в том, чтобы обойти задачи сопоставления данных по всей цепочке переходного периода, трансформационного кризиса, затем восстановительного роста, взять только конечные точки и посмотреть, какова доступность рыночных товаров и услуг с точки зрения того, сколько и чего можно сегодня купить на среднедушевой доход. Методика расчета: были взяты цены на 133 товара и услуги за 1990 и 2008 гг., сопоставлены официальные статистические данные по среднедушевому доходу за эти же годы. По каждому из товаров были подсчитаны индексы покупательной способности, сколько можно купить товаров по соответствующим ценам за соответствующий период. Потом было проведено взвешивание. Итоговое значение индекса покупательной способности среднедушевого дохода было получено на уровне 145%. На рис. 3 приведены данные, которые характеризуют изменение покупательной способности среднедушевого дохода за период 1990–2008 гг. по видам потребительских благ и услуг. Мы видим, что это картина довольно пестрая, но в целом по продуктам питания это примерно такая же величина, близкая к тому, что подсчитал Независимый институт социальной политики.





**Рис. 3.** Индексы изменения покупательной способности среднедушевого дохода за период 1990–2008 гг. по видам потребительских благ и услуг

Таким образом, изменение текущего потребления домашних хозяйств России по трем методам, о которых я говорил, приведено в табл. 3. Первый метод – метод реальных денежных доходов. Расчет показал рост на 27,2%. Второй метод – метод системы национальных счетов, где добавлялись натуральные расходы. Общий рост за период – 209,2%. Мы не настаиваем, это был пример из трех методов. Мы взяли за основу тот результат, который предложили наши коллеги по сравнению покупательной способности и среднедушевого дохода – 145% за 1990–2008 гг. Дальше возник вопрос, можем ли мы опереться на эти данные и доложить Вам, не вызовет ли это определенных сомнений? Сомнения могут быть. Думаю, что наша задача заключалась не столько в том, чтобы предложить истину в последней инстанции, а поставить задачу и предложить некоторый приближенный метод ее решения. Будет желание – каждый сможет продолжить эту работу.

**Таблица 3.**

Изменения текущего потребления домашних хозяйств России в 1989–2009 гг. по трем методам

	Рост в % к исходному году
Метод реальных денежных доходов	127,2
Метод системы национальных счетов	209,2
Метод оценки покупательной способности среднего дохода	145,0

В табл. 4 представлено среднегодовое потребление основных продуктов питания в натуральном выражении. Мы видим, что по некоторым товарам произошли довольно существенные изменения, например, молоко и молочные продукты: снижение потребления с 396 до 256 кг. При этом сегодня уровень потребления молочных продуктов в России примерно такой же, как в Соединенных Штатах Америки. Чем объяснялись такие большие цифры 1989 г. по молоку и молочным продуктам, сказать трудно. Лично у меня есть опасение относительно отчетности, тогда было в моде завышать отчетность, показывать более высокие цифры. Сейчас не понятно, потому что тогда потребление молока считалось не потому, сколько люди купили, вернее, какой спрос они предъявили, а сколько сбыли; а сейчас считают в соответствии со спросом – люди больше, чем им нужно, не покупают. Примерно та же картина с яйцами. С рыбой и рыбопродуктами у нас ситуация намного лучше, чем в Соединенных Штатах. Тоже странно, хотя и сейчас такая картина сохраняется.

**Таблица 4.**

Среднегодовое потребление основных продуктов питания

	Россия		США	
	1989 г.	2009 г.	1989 г.	2004 г.
Мясо и мясопродукты в пересчете на мясо (без сала и субпродуктов)	69	73,5	113	120
Молоко и молочные продукты (включая животное масло) в пересчете на молоко	396	256,2	263	266
Яйца, шт.	309	211	229	256
Рыба и рыбопродукты в товарном весе	21,3	20,3	12,2	11
Сахар	45,2	31,4	28	28
Хлебные продукты (хлеб и макаронные изделия в пересчете на муку, мука, крупа, бобовые)	115	99,3	100	90
Картофель	106	67,1	57	64
Фрукты и ягоды	35	63,9	95	121

Кроме того, мы решили сделать несколько более общий расчет, учесть те факторы, которые до сих пор даже не пытались сопоставлять. Речь идет, в-первых, о некоторых нерыночных услугах, прежде всего это образование и здравоохранение. Они были бесплатны, по крайней мере, так считалось. Сейчас они в значительной степени стали платными. Во-вторых, речь идет о жилье, о доступности жилья, которая также обычно не сопоставлялась при оценках уровня жизни. Это фактические данные, которые были взяты из статистики и не подвергались каким бы то ни было преобразованиям с учетом изменяющихся цен.

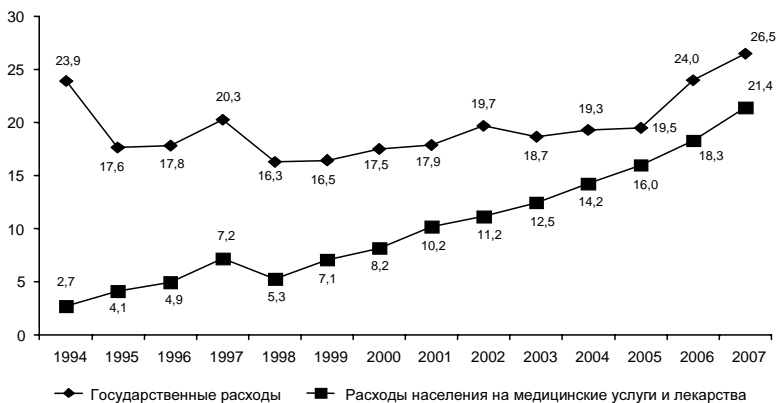
Про образование я не буду долго распространяться, на этой сессии будет большой доклад Ярослава Ивановича Кузьмина, но вот некоторые данные, которые считал Григорий Андрушак (см. рис. 4). Они показывают, как изменились относительные затраты на одного обучающегося к среднегодовой заработной плате в экономике. Начальный год по РСФСР – 1986 г., 2008 г. – это за счет бюджетных средств России. Вы видите здесь данные по видам образования. Довольно существенный, в особенности на высшее образование, рост расходов. Это в расчете на одного обучающегося к среднегодовой заработной плате.



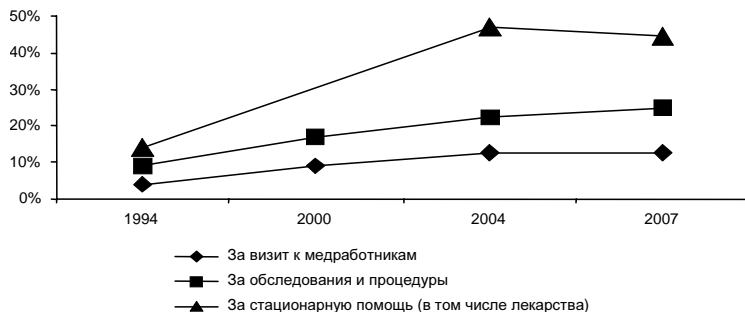
**Рис. 4.** Относительные затраты на одного обучающегося (к среднегодовой заработной плате в экономике)

Теперь о здравоохранении. Ситуация тоже довольно сложная. Я не буду подробно останавливаться на этих вещах, завтра будет сессия, на которой будет

обсуждение тех работ, которые выполнялись в процессе подготовки этого доклада. Там будет подробный доклад Игоря Михайловича Шеймана о здравоохранении, будет доклад Овчаровой. Вы сможете разобраться более основательно. Итак, вот данные соотношения динамики государственных и частных расходов на здравоохранение в ценах 1994 г. (см. рис. 5). Вы видите, что в эти годы непрерывно росла доля частных расходов на услуги здравоохранения. На рис. 6 из работы Шеймана и Шишкина приводятся данные относительно того, сколько граждане, нуждающиеся в медицинской помощи, платят за визит медработникам, за обследования, процедуры, за стационарную помощь. Все эти годы расходы росли, кроме платы за стационарную помощь, которая начала падать с 2004 г. Представлены динамика государственных и частных расходов на здравоохранение, доля пациентов, плативших за различные виды медицинской помощи в частном порядке, из своего кармана, притом что у нас медицинская помощь считается бесплатной.



**Рис. 5.** Государственные и частные расходы на здравоохранение в ценах 1994 г., млрд руб.



**Рис. 6.** Доля пациентов, плативших за различные виды медицинской помощи в 1994–2007 гг.

Теперь последняя часть, которая также исключительно важна, это расчет доступности жилья, выполненный Институтом экономики города. Итоговое значение индекса доступности жилья составило в 2009 г. 57% по сравнению с 1989 г., т.е. доступность жилья оказалась существенно ниже, чем в 1989 г.

Я также приведу результаты подсчета сводного индекса благосостояния. Мы придумали такой показатель из тех расчетов, которые выполнили по отдельным разделам, в том числе по изменению покупательной способности среднедушевого дохода (это текущая характеристика текущего потребления). Алексей Николаевич Пономаренко провел оценку доступности индивидуальных нерыночных услуг – образования и здравоохранения. Далее приведены характеристики выполненных им расчетов для построения сводного индекса благосостояния. В табл. 5 мы видим, что здесь индекс текущего потребления – 1,45, индекс расходов на нерыночные индивидуальные услуги (образование и здравоохранение) – 0,93, индекс доступности жилья – 0,57. Сводный индекс благосостояния, который мы получили как основной итог нашей работы, составляет 1,32. Повышение уровня благосостояния за 20 лет произошло примерно на 32%. Я не сказал бы, что это много даже с учетом того, что кризис был очень сильный. Тем не менее общий итог такой – он позитивный, но не очень большой. Я бы сказал, как стартовая площадка для дальнейшего развития – это неплохо, как итог в сравнении с другими странами – особенно хвастаться нечем. Хотя надо отметить, что мы пережили глубочайшую ломку. Кроме того, мы имели в виду и то обстоятельство, что для характеристики благосостояния населения необходимо также учесть некоторые дополнительные факторы, в том числе состояние рынка труда.

**Таблица 5.** Сводный индекс благосостояния и его составные части

Показатель	Содержание	Значение	Удельный вес фактора
Индекс изменения покупательной способности среднедушевого дохода	Изменение покупательной способности среднедушевого дохода в части приобретения рыночных товаров и услуг	1,45	0,8
Индекс расходов на нерыночные индивидуальные услуги	Изменение реальных расходов государства и некоммерческих организаций на нерыночные индивидуальные услуги	0,93	0,15
Индекс доступности жилья	Изменение покупательной способности среднедушевого дохода в части приобретения жилья и нового строительства	0,57	0,05
Сводный индекс благосостояния	Средневзвешенная величина из указанных выше индексов	1,32	

Рисунок 7 показывает одну любопытную характеристику нашего рынка труда, которая уже давно исследуется нашими сотрудниками – это Владимир Ефимович Гимпельсон и Ростислав Исаакович Капелюшников, – которые выявили, что у нас очень мало меняется занятость и отработанное время, но довольно сильно меняется заработная плата. Во время кризиса занятость почти не менялась, но довольно существенно менялась заработная плата – она падала. То, что редко можно увидеть в других странах, у нас происходит. И это своеобразный способ регулирования рынка труда, потому что всюду он регулируется посредством приема и увольнения, у нас это делается в основном иным способом. Притом авторы отмечают, что происходит довольно большое, интенсивное обновление работников – увольняются, поступают на новую работу, но при этом заработная плата меняется, а численность занятых почти нет. На рис. 8 мы видим эту картину, и, надо сказать, она до сих пор не изменилась. Вот здесь еще одно ее представление: за все истекшие годы сопоставляется индекс занятости и индекс реальной заработной платы.

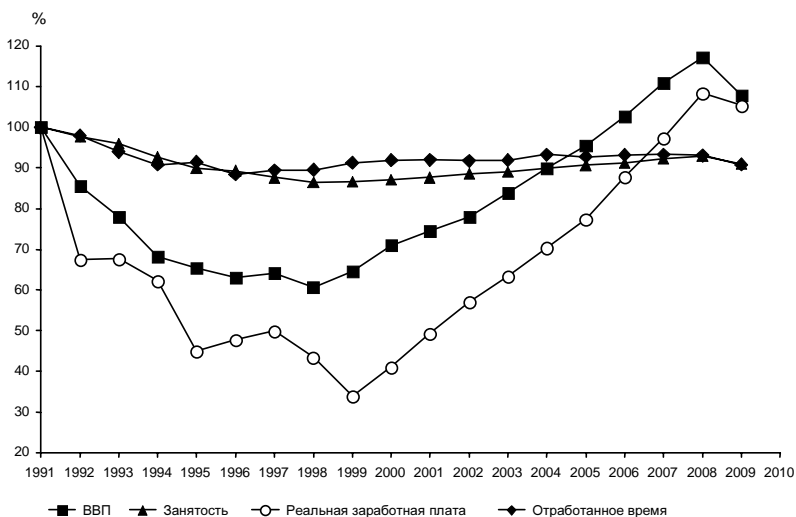
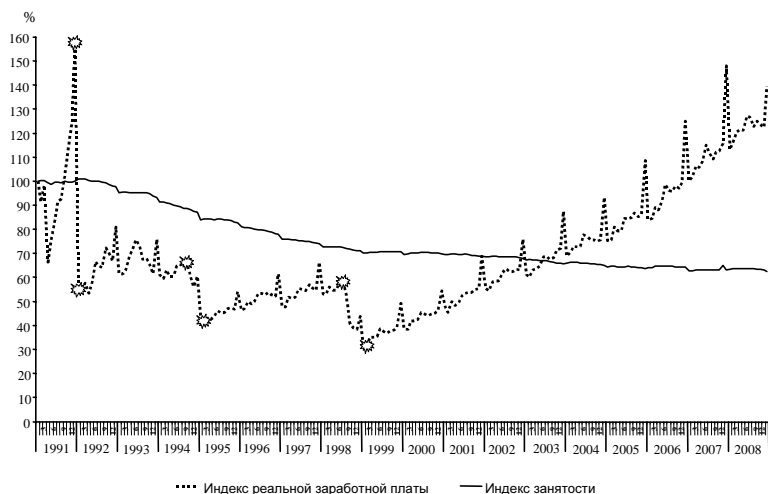
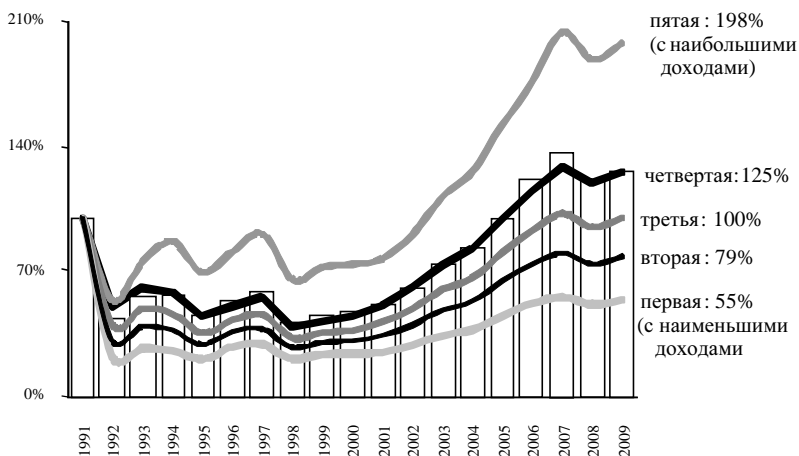


Рис. 7. Рынок труда. Занятость и заработная плата



**Рис. 8.** Динамика занятости и заработной платы, месячные индексы, 1991–2009 гг.

Теперь одна из заключительных и очень важных картин. Дело в том, что те данные, которые мы вам представили, эти сводные расчеты относятся к населению в целом. Наши оценки показывают, что применительно к населению в целом, если не дополнять эти данные расчетами, которые характеризуют ситуацию по разным слоям населения, различающимся по материальному положению, мало какие выводы можно сделать. На рис. 9 мы видим, что по сравнению с 1991 г. существенно выросли доходы только высшего квинтиля, самых богатых 20% населения, их доходы удвоились. Повысили свое благосостояние люди, относящиеся ко второму сверху квинтилю, их доход в среднем поднялся на 25%. Третий квинтиль вышел только на 100% уровня 1991 г. Второй квинтиль вышел на 79%, а первый, самый низкий, квинтиль вышел на уровень 55% уровня 1991 г. Отсюда вывод такой, что примерно 40% населения России в 2009 г. имели уровень жизни ниже, причем довольно существенно, чем в 1990 г. Положение среднего, третьего, квинтиля не изменилось. Только верхние 40% достигли успеха. Это я считаю критическими цифрами, они оттеняют определенным образом наши предыдущие расчеты и говорят серьезно о том, что нужно решать проблемы повышения доходов нижних слоев населения.



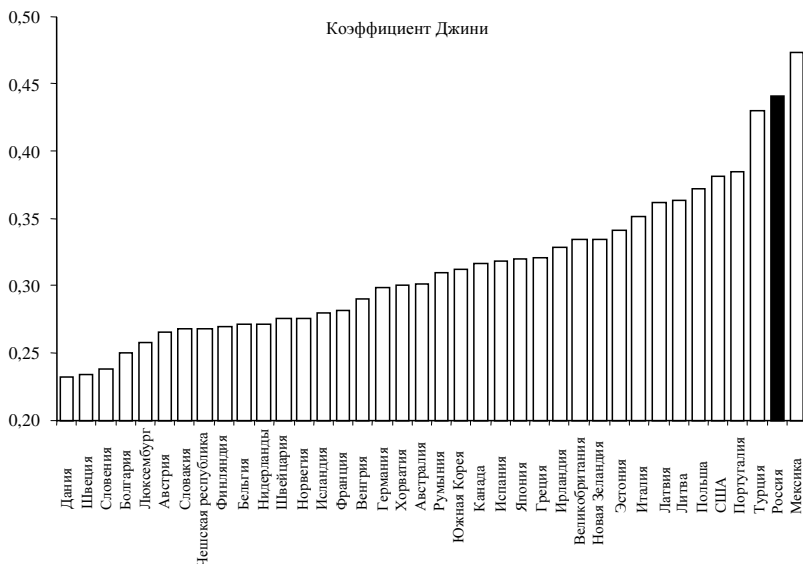
**Рис. 9.** Динамика реальных денежных доходов по 20-процентным доходным группам, 1991–2009 гг., %

Речь идет не только о понятных рассуждениях относительно необходимости инвестиций, роста производительности и т.д., это само собой. Но я хочу обратить ваше внимание, что наибольшая часть бедняков приходится на сотрудников бюджетного сектора, который финансируется государством, прежде всего это работники здравоохранения, работники образования, культуры и т.д. Из тех производственных, обрабатывающих отраслей, которые имеют меньший уровень оплаты труда, это только сельское хозяйство, текстильная и швейная промышленность. Во всех остальных заработки существенно выше. С моей точки зрения, необходимы какие-то серьезные меры по политике доходов, которые бы снизили накал ситуации по части неравенства. Я так думаю, что решить проблему повышения уровня доверия у российского населения по отношению к властям и государству без того, чтобы каким-то образом решить эту проблему, невозможно. Есть неравенство, которое мотивировано накоплением происходящих изменений: большая часть достижений рыночной экономики достается относительно меньшинству, большей части населения эти коврижки не достаются, поэтому добиться какого-то изменения невозможно. Я это говорю, сопровождая свои слова следующими дополнениями. Я сам убежденный либерал и считаю, что должен работать рыночный механизм. Но наступает такой момент, когда у каждого либерала появляется здравый смысл и он понимает, что просто теоретические соображения, если вы отдаете себе отчет, что за этим стоит, должны быть переосмыслены. В данном случае у меня твердое убеждение, что такого рода переосмысление необходимо. И господину Кудрину, который



сегодня был у нас на сессии, я сказал, что придется повышать бюджетные расходы на здравоохранение и на образование, еще на какие-то вещи, которые сегодня образуют анклав бедности, составляя тяжелую проблему для страны. У меня такое ощущение, что у нас две страны – одна страна довольная, которая уже знает, что такое рыночная экономика, поездки за границу, покупки с большим выбором товаров в хороших магазинах. И другая страна, в которой люди живут хуже, чем они жили раньше. У меня такое впечатление, что есть определенная ситуация, на которую нужно реагировать. Оставлять дело дальше так, как оно было раньше, невозможно.

Далее – это коэффициент Джини (рис. 10). Здесь выступал Лешек Бальцевич, по-моему, он говорил о том, что в европейских странах таких показателей по неравенству, как в Мексике, не бывает. Так вот, я должен сказать, что последняя колонка – это Мексика, а перед ней Россия. Я знаю еще одну страну после Мексики – это Бразилия, там просто зашкаливает, еще больше, чем у нас. Но у нас тут тоже не такое завидное положение, нужно принимать какие-то меры.



**Рис. 10.** Коэффициент Джини в середине 2000-х годов

Последняя табл. 6, которую я вам хочу показать, характеризует общий итог и наше сопоставление средних показателей по паритету покупательной способности с Соединенными Штатами Америки. Вот ВВП на душу населения,

последний показатель – 40% в 2009 г. Честно говоря, я не очень верю в этот показатель, но так получилось. Что касается фактического конечного потребления на душу населения, то последние данные – это 28% – относятся к 2005 г. Вот что мы получили в результате этих расчетов.

**Таблица 6.**

Индексы физического объема экономики России по ППС, % (США = 100%)

	1988 г.	1993 г.	1999 г.	2002 г.	2005 г.	2009 г. [I кв.]
ВВП на душу населения	37	20	18	22	25	40
Фактическое конечное потребление на душу населения	22	17	15	16	28	–

Что мы можем сказать в итоге? Я бы обратил внимание на то обстоятельство, что если говорить о стране в целом, то ничего ужасного нет. Россия в среднем по большинству показателей уровня жизни находится на вполне приличном уровне по сравнению с большинством стран своего уровня развития, она имеет показатели хуже, чем страны OECD, но довольно приличные. Сказать так, что здесь происходит какая-то катастрофа, нельзя. Пока нельзя. Можно сказать, что недоволен своим положением прежде всего бизнес, наверное, у него есть для этого основания. Дальше возникает вопрос, что нужно все-таки решать проблемы, связанные с неравенством, принимая какие-то серьезные меры на государственном уровне и имея в виду просто снижение разрыва между бедными и богатыми. С моей точки зрения, прежде всего, за счет существенного повышения финансирования образования и здравоохранения. Тем самым мы также поменяем минимальные ставки на рынке труда, которые равняются на минимальные ставки бюджетной системы. Это может быть чревато всплеском инфляции, не знаю. Но, с моей точки зрения, мы должны действовать таким образом: повышение зарплаты должно сопровождаться введением определенных платежей, которые сегодня делаются за счет государства, точнее, за счет дефицита государственного бюджета. Я имею в виду пенсионные взносы, затем взносы на медицинское страхование, ипотечные кредиты. Есть целый ряд платежей, которые сегодня изъяты вообще из бюджета семьи, и вся система носит тот же характер, как и при советской власти. Я бы сказал так: стойловое содержание скота, т.е. люди получают только то, что нужно на пропитание и одежду. А нужно сделать так, чтобы все в этом отношении имели примерно равные условия. Поэтому если вы создаете встречные финансовые потоки, вы просто раздвигаете границы рыночных отношений. Там, где у вас сегодня

нерыночные отношения еще остаются, они там должны стать рыночными. Это мои догадки, которые я предлагаю для размышления. Спасибо.

**Л. Якобсон:** доклад Евгения Григорьевича и его соавторов, думаю, будет еще очень долго обсуждаться, не только завтра на конференции. Я уверен, что появилось очень много вопросов, желание прокомментировать. Я сам вижу вопросы в диапазоне от методики расчета до вопросов о том, насколько либеральны те выводы, которые сделал Евгений Григорьевич, но мы не можем дать возможность задать все возникшие вопросы.

**Вопрос из зала:** изучая уровень и образ жизни, учитывали ли вы соотношение источников доходов в формировании реальных денежных доходов населения? Ведь это соотношение тоже говорит об образе жизни. Заработная плата, прибыль и прочее.

**Е. Ясин:** конечно, мы видели, но специально этот вопрос не исследовали. Скажем, расчеты, которые производили в Независимом институте социальной политики. Там специально эти расчеты уже многие годы ведутся так, что делается расчет заработной платы с учетом скрытой части, без учета скрытой части. Учитывается пенсия, учитываются другие виды доходов. Это азы.

**Реплика из зала:** если мы говорим о новом образе жизни в России...

**Е. Ясин:** я, конечно, могу придумывать на ходу, но мы договорились так, что мы не берем промежуточные итоги, мы берем то, что можем сопоставить. В данном случае сопоставлять источники доходов мы не имели возможности. Что есть, то есть.

**С. Винокуров, журнал «Вопросы экономики»:** у меня вопрос о сопоставимости. Корректно ли сравнивать провальный 2009 г. с 1989 г. или 1990 г., они тоже не очень хорошие были, но не до такой степени. При этом, мне кажется, если бы сравнивали показатели 2010 г., то все они были бы в вашу пользу и намного лучше.

**Е. Ясин:** спасибо. Дело в том, что мы были ограничены во времени, и данных 2010 г., когда мы уже заканчивали расчеты, не было. Что касается 2009 г., то лично мое убеждение заключается в том, что там никакого большого провала не было, это было просто проседание на степень перегрева экономики в предшествующие годы, на уровень порядка 7–8% снижения. Для такого периода и для такого сравнения это не имело большого значения.

**Л. Якобсон:** я так понял вопрос, это скрытая заявка на продолжение исследования.

**К. Подъячев:** ваш доклад очень интересен, и выводы, которые вы делаете, необычайно полезны для понимания того, где сейчас находится Россия. Вы совершенно правильно говорите, что Россия по своим показателям отстает от США, но является средней страной, не катастрофической, не провальной, а средней страной. Между тем в публичном дискурсе, в СМИ, в обществе в целом господствуют две тенденции: либо какое-то великодержавное, мессианское надувание щек, либо катастрофические, апокалипсические предсказания. В чем, на Ваш взгляд, причина этого противоречия между реальной ситуацией и такой катастрофой в головах?

**Е. Ясин:** я высоко ценю Ваше понимание нашей позиции, потому что мы не хотели надувать щек, мы хотели дать представление о том, как выглядит ситуация на самом деле. Это некое приближение, сказать, что все точно, я не могу. Но лучше знать такую картину, чем не знать ничего. Теперь что касается двух тенденций. Это же очевидно. Одни недовольны, а другие хотят сказать: «А чего Вы недовольны? На самом деле тут все неплохо, мы тут хорошо управляем». Поэтому такие противоречивые тенденции.

**Л. Якобсон:** спасибо. Завтра будет возможность продолжить обсуждение этого доклада. Я еще раз хочу высказать догадку (я уверен, что она верна), это будет не последнее обсуждение, составные части доклада очень интересны, как и следствия, из него вытекающие.

**Реплика из зала:** Вы рассказывали о показателях жизни, это все были показатели по факту. Мы знаем, что будущее экономики определяется не только нашим фактическим положением, но и нашими ожиданиями. Про ожидания никаких слов сказано не было. Скажем, продолжительность жизни очень сильно упала, впрочем, как и количество населения. По этим причинам, как упоминалось раньше, многие уезжают за рубеж, включая меня. Прокомментируйте, пожалуйста, не текущее состояние, а насколько изменились ожидания о будущем экономики, о том, как все будет в будущем – лучше, хуже.

**Е. Ясин:** я тогда должен вернуться к вопросу, который чуть раньше задавал Кирилл Подъячев. О различиях в объективном состоянии экономики, да и общества. И об общественных настроениях, о публичном дискурсе. В настоящее время общественные настроения скорее отрицательные. Это значит, что и ожидания относительно будущего скорее отрицательные, пессимистические.

Когда я говорю об общественных настроениях, я имею в виду, если хотите, не общество, а общественность. Это не элита, общественность шире элиты. Но и не общество. Это круг людей, в котором в основном формируется общественное мнение. Вот в этом кругу ожидания скорее пессимистические. Я думаю, они мотивированы, в основном, тем, что важные проблемы развития страны не решаются, что господствующие порядки препятствуют их решению и возможности для изменения этих порядков не предусматриваются. Имеет место потеря перспективы. Это политическая проблема. Типа того, что предстоят выборы и никто не надеется на то, что способен что-то изменить.

Но в то же время у нас есть работающая рыночная экономика, созданная в «лихие девяностые», она обеспечивает какое-то нормальное развитие страны без вмешательства государства. Но для одушевляющей перспективы нужно большее, нужна политика, генерирующая надежды. Этого нет. Произойдут изменения в политике, и настроения начнут меняться.

# ВАЖНЕЙШИЕ ФАКТОРЫ МОДЕРНИЗАЦИИ ЭКОНОМИКИ

Стенограмма выступления

---

Говоря о модернизации российской экономики, надо, наверное, говорить шире – о модернизации общества, поскольку только действенные общественные институты способны обеспечить стабильность и необходимые условия для работы. Только они создадут в экономике необходимый объем доверия и инвестиций. Инвестиции следуют за доверием, они позволят модернизировать российскую экономику.

Буду говорить достаточно тезисно. Попытаюсь сопоставить уроки кризиса с тем, что нам нужно сделать. Этот кризис был особый, кризис глобальной экономики. Мы впервые проходим кризис, когда настолько глубоко и по очень многим факторам связана ситуация в разных странах. Мы все оказались больше чем когда-либо раньше увязаны одними рынками, взаимными потоками капитала, взаимными связями в общей торговле. Наиболее чувствительным оказалось падение экспорта, например, для таких стран, как Германия, Япония, Россия в том числе. Очень серьезным последствием кризиса стали перетоки капиталов. Россия оказалась одной из тех стран, которые их максимально прочувствовала на себе. Мы имели перед кризисом 80 млрд долл. притока капитала за один год. А в момент кризиса в 2008 г. – отток на 130 млрд долл. Всю нашу финансовую систему опрокинул в 1998 г. отток 10 млрд долл., а в 2008 г. мы смогли «переварить» отток 130 млрд долл. и противостоять шоку.

Какова ситуация сегодня? Мы имеем глобальные дисбалансы, и их нужно уменьшать, предотвращать, профилактировать. Эти дисбалансы проявляются в разных формах. Чтобы потом не переживать шоки от их устранения болезненно и долго, надо координировать усилия многих государств по предотвращению возможных новых кризисов. Если каждая страна начнет себя защищать индивидуально в виде введения ограничений на потоки капитала, мы получим уменьшение инвестиций в глобальной экономике и затормозим общий мировой рост. Если мы начнем защищать себя импортными пошлинами в момент кризиса то-

варных рынков, а это имело место недавно – как развитые, так и развивающиеся страны, как США, так и Россия оказывали помощь своим промышленным секторам, пытались перевести спрос на свои товары, – то мы усилим кризис в других государствах, которые рассчитывают на наши рынки. Таким образом, в период кризиса одной из самых серьезных угроз было введение масштабных протекционистских мер. Все страны друг друга уговаривали не вводить их. Поэтому что это просто по нарастающей создавало новые кризисные ситуации. Эти иллюстрации привожу для того, чтобы показать, что мы должны создать глобальные институты регулирования.

Какие проблемы, на мой взгляд, будут оказывать максимальное влияние на мировую экономику в ближайшие годы? Китай. Насколько квазирыночная экономика Китая со стимулированием своего спроса за счет преимуществ квазигосударственных инвестиций и квазигосударственных ресурсов сумеет удержать свой рост, не создать пузырей, которые уже создаются, не создать сотни миллиардов долларов неэффективных инвестиций, которые уже случились? Не станет ли Китай новым источником рисков для мировой экономики? Насколько я вижу, китайское руководство осознает это, предпринимает меры, пытается снизить опасность пузырей на своих рынках, снизить объем неэффективных инвестиций, идет на снижение темпов экономического роста. В ближайшие годы ставит цель снизить темпы роста до 8%, а в конце текущего десятилетия – до 6%, при этом существенно повысив эффективность инвестиций.

На втором месте ситуация в Соединенных Штатах с точки зрения внутреннего дефицита, который не укладывается в график снижения, обещанный американской администрацией. Как быть с политикой количественного расширения денег, поддерживающих американскую экономику, но в то же время создающих избыток ликвидности на мировых рынках и приток спекулятивных средств на рынках развивающихся стран? В России мы сейчас наблюдаем отток капитала, но уже в этом году можем получить приток. Только спекулятивного капитала, капитала краткосрочного, связанного с высокими ценами на нефть и укреплением рубля. Так что, мы сможем говорить о притоке, но не того качества, которого нам хотелось бы, не означающего, что у нас улучшился инвестиционный климат, о котором очень четко сказал Президент РФ в своем выступлении недавно.

Возвращаясь к ключевым проблемам, назвал бы также риски долгового рынка в Европе, генерированные рядом стран. С точки зрения рисков государственных ценных бумаг опасность пока остается. Неспроста Евросоюз пошел на существенные меры по увеличению своего стабилизационного фонда.

А в мировом масштабе сегодня совершенно очевидно, что усилий МВФ как организации, которая должна помогать государствам в условиях таких кризисов платежного баланса, внешних или долговых шоков, сейчас уже недостаточно. Даже с учетом мер «Двадцатки» по увеличению до 600 млрд долл. специального фонда, так называемого «нового соглашения о заимствовании», в котором и Россия участвует в размере минимум 15 млрд долл. Евросоюз создал свой стабилизационный фонд, в котором МВФ имеет свое участие. Но и этого на данный момент может оказаться недостаточно.

Есть высокие цены на нефть, которые могут притормозить рост мировой экономики, есть другие элементы кризиса. Мы должны понимать, что мир еще «переваривает» дисбалансы, они, в основном, не устранены. Мы видим это в разных странах на разных примерах, так что нам необходимо создавать международные регуляторы. В начале февраля встречались министры финансов «Большой двадцатки» и договорились о расширении перечня показателей, по которому будут анализироваться экономики стран. Раньше, допустим, США не считали приемлемым для себя, чтобы их международный институт оценивал, давал правдивую прямую оценку состояния экономики и рекомендации. Сегодня мы об этом договорились. И Китай сегодня готов, чтобы организации, созданные на межправительственной основе, оценивали его экономику и ее дисбалансы, давали рекомендации. Это большой шаг, мы договорились о прозрачности и о рекомендациях, которые будем давать. Мы этого долго добивались.

Среди показателей, которые являются индикаторами состояния экономики, наиболее сложно было получить согласие на введение такого, чтобы в случае превышения сальдо текущего счета платежного баланса больше чем на 4% ВВП страна должна соответственно укреплять свою валюту. А в случае отрицательного сальдо текущего счета можно ослаблять курс. Получение существенного положительного сальдо без проведения гибкой валютной политики будет создавать, на взгляд экспертов, искусственное преимущество за счет курсов. На такие меры было сложнее всего согласиться Китаю. Но Китай сегодня согласился с этим индикатором и готов в этом ключе работать. Другие индикаторы добавились в момент дискуссии в феврале: торговое сальдо и баланс бюджета, госдолг и долг частного сектора. Это индикаторы, которые стали ключевыми для анализа экономик друг друга. Мы договорились о механизме перекрестного анализа, которому будет подвергнута и Россия.

На прошлой неделе я был в городе Нанкине в Китае. Там президент Франции открывал семинар высокого уровня по обсуждению вопросов новой архитектуры мировой финансовой системы. В целом позиции еще расходятся. Огра-



ничиваться ли достижением последних двух лет – прозрачностью, рекомендациями, на которые теперь все согласны? Или мы готовы пойти дальше? Вводить элементы санкций за невыполнение. Сегодня это еще не вполне надежно работает даже рамках Маастрихтского соглашения. Европейцы решили существенно усилить контроль и ввести ограничения и санкции, чтобы не создавать новых ситуаций, как в Греции или Ирландии. Будет ли новый Маастрихт создаваться в более глобальном масштабе? Не все страны готовы сегодня поделиться частью своего суверенитета, готовы подчиняться, нести финансовую и экономическую ответственность за следование этим индикаторам. Будем ли мы расширять полномочия МВФ, давать ему соответствующий мандат, дополнять МВФ другими международными организациями для выполнения этой роли, какие это будут санкции? На этот счет мы пока не договорились, не готовы пока ведущие страны, прежде всего США, подвергаться такому регулированию международных наднациональных структур. Это то, что называют «мировым правительством», до этого еще далеко. Но движение медленно, небольшими шажками идет в этом направлении.

В Нанкине также обсуждалось, будет ли мировая валютная система мультивалютной. Будет ли много резервных валют или мы должны сконцентрироваться вокруг нескольких? Решения пока нет. Французы, председательствующие в «Большой двадцатке», выдвигают идею расширения влияния СДР. Но я полагаю, что СДР не может быть мировой валютой. СДР, вообще-то, – условная единица, которая как бы эмитируется МВФ. А дальше должна найтись любая страна с конвертируемой валютой, которая на время выкупит эти права и тем самым предоставит реальную обращающуюся на рынке и используемую в торговле валюту для того, чтобы другие государства воспользовались ею. Но это как бы некие права заимствования, и я сомневаюсь, что эта необеспеченная активами соответствующей экономики, не котируемая на свободном рынке материя может вырасти в другую валюту. Пока не вижу факторов, которые позволили бы это сделать. Мы можем говорить об СДР как о некоем дополнительном механизме резервов в период кризиса. Это некая страховка, которая должна быть сбалансирована, а страны должны иметь возможность выкупить ее в необходимый момент для предоставления экономике уже реальных денег. Считаю, что пока мы будем жить в мире доллара, евро, йены.

Сегодня Китай рассматривает возможность ускорения перехода к конвертируемости своей валюты. Это означает, что Китай кроме снятия ограничений на валютные операции должен ввести свободное движение капитала. А Китай пока к этому не готов в полной мере. Дальнейшая либерализации китайской экономики, расширение рыночных институтов, свободное движение капитала –

именно эти элементы создадут конвертируемость юаня. Это не делается в течение одного-двух лет, это потребует значительно большего времени. Раньше я говорил о примерно 10 годах. Но если это будет делаться последовательно, то, возможно, хватит и 5–7 лет.

В Нанкине французы предложили включить юань в число валют, из которых состоит корзина СДР. Это, конечно, не меняет роли юаня в мировой экономике, но для валюты, включаемой в СДР, существует требование быть конвертируемой. А юань пока неконвертируемый. Николя Саркози в Нанкине предложил 2–3 года, за которые Китай пройдет свой путь к конвертируемости. Это хороший сигнал, сигнал о том, что Китай готов двигаться в этом направлении. Я своим выступлении на семинаре в Нанкине предложил определить какой-то переходный период для такого движения, но он должен быть очень понятным, очень четким. Это не может быть аванс без очень понятных обязательств. И в виде исключения, в связи с тем, что китайская экономика большая и все хотят сегодня стимулировать Китай к ее дальнейшему развитию, к гибкости курса, то, наверное, на этот переходный период Китай тоже может войти в корзину валют СДР. Но, повторяю, пока это вопрос нерешенный.

Мы также обсуждали роль рубля в этой корзине, возможность вхождения рубля в корзину. В отношении рубля такая же приблизительно процедура, к нам также предъявляется требование конвертируемости. И рубль стал конвертируемым 1 июля 2006 г. Но у нас есть другие недостатки. Есть главный фундаментальный показатель, который отличает нашу экономику и отличает качество нашей экономики от многих других – высокая инфляция. Даже во многих странах третьего мира инфляция ниже. Развитые государства, как правило, имеют в своей экономической политике таргетирование инфляции. Мы еще недостаточно нацелили нашу экономику на низкую инфляцию. Еще подчеркну, низкая инфляция – это не только справедливое ценообразование, это справедливое распределение усилий и вознаграждение за свои усилия. Инфляция все это съедает. Съедает стоимость активов, стоимость зарплат. Это как бы квазианалог, это несправедливое перераспределение ВВП между отраслями. Инфляция мешает справедливому перераспределению ВВП, меняет стимулы, меняет ориентиры. В этой сфере мы играем не в первой лиге, я бы даже сказал, не во второй с такой инфляцией. У нас есть много других проблем, которые нам приходится решать. Одна из основных причин инфляции – наша зависимость от нефти, неспособность справиться, особенно в последние годы, с напором нефтедолларов. У нас количество денег в обращении растет не в связи с потребностями экономики, а в связи с приходом дополнительной порции нефтедолларов, которые от нас не зависят. Наша задача – сладить с этими ресурсами, создать институты,

которые четко бы их ограничивали, обеспечивали предсказуемость на нашем рынке для всех инвесторов.

Таким институтом в свое время стал Стабилизационный фонд, Резервный фонд. Он создавался по правилам. Были четкие правила сколько из налогов от нефти и газа будет зарезервировано, а сколько пойдет на расходы. Это правило не заработало в полной мере, но оно создавало четкий ориентир на ближайшие годы для всех инвесторов, работающих на наших рынках. Сейчас на период кризиса мы остановили действие этого правила. Скажу банальность. Наша зависимость от нефти преодолевается, в первую очередь, применением снова правила использования нефтегазовых ресурсов через частичное их сбережение. И соответствующее правило должно вводиться законом. Есть примеры успешных стран, которые ввели это правило и получили бурный рост. Норвегия, где ни один нефтедоллар не будет использоваться внутри страны. Норвегия, нефтяная страна, не использует вообще доходы от нефти в расходах своего бюджета. Не использует ни одного доллара от нефти. Она накапливает фонд, который превысил 100% ВВП. Размещает его на мировых рынках и живет на проценты от этого размещения. Чили, самая успешная латиноамериканская страна, у которой в конституции записано, как использовать доходы от добычи, в этом случае, меди. Для нашей страны, нашей зависимости нужно создавать законодательный механизм регулирования использования доходов от нефти. Для нас это обязательно. Если мы в этом году все же восстановим это правило, пусть в модифицированном виде, то создадим базовую, фундаментальную предпосылку для дальнейшего снижения нашей зависимости.

Назову несколько факторов, которые, на мой взгляд, позволили бы нам перейти к созданию условий для частных инвестиций, их существенного увеличения на базе развития рыночных институтов. На первое место поставил бы в экономической политике инфляцию. Это нас отличает принципиально от всех стран, которые имеют успех в модернизации. Второе – создание правил для использования нефтегазовых доходов. Далее, долгосрочная финансовая устойчивость как рынков, так и бюджетной системы. Когда мы задумаемся, правильно ли используем ресурсы, то следующий элемент – институт эффективности бюджетных расходов. Мы утвердили программу повышения бюджетной эффективности. Ее, признаюсь, очень трудно внедрять. Это не просто изучение того, за сколько мы должны строить километр дороги. Бюджетная эффективность начинается с правильного определения приоритетов и правильного ведения стратегического планирования, какие задачи мы ставим и как распределяем на них ресурсы. Затем прохождение всех необходимых экспертных процедур, в том числе общественных, по выявлению конкретных целей и механизмов их достижения.

Мы часто принимаем решения быстро, спонтанно. Нам кажется, что сейчас дадим денег и задача будет решена. Думаю, мы не создали до конца механизм выявления целей бюджетной политики и адекватных механизмов их достижения. Нам придется решить, где должно, а где не должно работать государство, не финансировать или не субсидировать какие-то конкурентные отрасли. А где наоборот, предоставлять свои услуги в виде строительства дорог или другой необходимой инфраструктуры, необходимой для бизнеса. У нас эта граница до конца четко не проведена. Мы – страна с очень большими государственными субсидиями в экономику целого ряда отраслей. Если мы начнем этим заниматься, то пойдем структуру, которую должен иметь бюджет. То есть распределять между различными задачами всегда ограниченные ресурсы.

Мы должны будем определить структуру и определить до конца задачи пенсионной системы, провести пенсионную реформу. Мы только что проводили, казалось бы, эту реформу. Были повышены пенсии, несколько модернизировано понятие базовой пенсии, страховой, трудовой. Была проведена модернизация, повышены ставки налогов, точнее, налог превратился в страховые сборы, был передан сбор этих средств от налоговой системы пенсионному фонду. У нас даже внутри Правительства полномочия по ведению страховых сборов переданы от Министерства финансов Министерству здравоохранения и социального развития. Было много, казалось бы, сделано. Но, пожалуй, не было сделано важнейшего. Не была создана бюджетная сбалансированность пенсионной системы, являющаяся гарантией сохранения достойной пенсии и ее увеличения. Решение принималось достаточно ответственно, увеличивались обязательства, увеличивались страховые взносы. Сейчас, спустя некоторое время, пенсионные обязательства оставлены прежними. Их надо индексировать темпами выше инфляции по действующему закону. А страховые взносы предложено снизить, модернизируя саму ставку и шкалу регрессии, с которой уплачиваются эти взносы. В целом поддерживаю это решение. Президент РФ предложил в своем выступлении снизить ставку за счет увеличения шкалы. До какой величины, где будет эта шкала? Если мы сделаем ее миллион, а меньше миллиона не думаю, что это будет иметь смысл, то такая модернизация перекроет, по крайней мере, большую часть выпадающих доходов. Это просто уменьшение налогового бремени, перемещение на те предприятия, где более высокие заработанные платы. Но это, безусловно, справедливо. Это нефтегазовый сектор, финансовый сектор, примерно 20% зарплат в транспорте, 20% – в переработке и в торговле примерно тоже 20% – случайные совпадения цифр, – которые выходят за имевшуюся шкалу 463 тыс. руб. Наверное, это разумно, но это не снижение бремени в целом для экономики, это снижение для одних предприятий и повышение для других,

мы должны это понимать. Когда мы проведем эту модернизацию, не скажу, что мы остановимся на цифре миллион. Это зависит от комплексного предложения, может это будет 1,5 миллиона или выше. Сюда попадает большая часть заработных плат.

Кстати, «Деловая Россия» предлагала модернизировать эту ставку в своих письмах в Правительство, снижая ставку страховых взносов, фактически отменяя вообще регрессию. То есть вводя постоянную шкалу для всех заработанных плат. Знаю, что даже в «Деловой России» не все поддерживали это предложение. Не все находятся в этой зоне налогообложения. На кого-то увеличится нагрузка. Но даже эти меры не перекроют выпадающие объемы, если ставку уменьшать примерно до той, которая была до введения. Это означает, что мы просто увеличим дефицит пенсионной системы.

Несбалансированность пенсионной системы предложено покрывать за счет сокращения других расходов. Тогда повышение дефицита пенсионной системы будет оплачиваться за счет сокращения исполнения других бюджетных задач. Президент РФ также предлагает повышать эффективность бюджетных расходов, снизив на 15% стоимость контрактов, сохраняя при этом натуральный объем и качество продукции. В настоящий момент ключевым инструментом, который позволяет это делать, является 94-й ФЗ. Но пока мы не доработаем этот закон, пока его не введем, чиновник не сможет реально через эти инструменты улучшить эффективность тендеров, снизить качество и цену. Пока эта практика не заработает, у нас в общем-то нет достаточных административных рычагов, чтобы прийти и предложить просто снизить цену на товар, но одновременно поставить нам столько же. Такого правового механизма у чиновника сегодня нет, и реализация этого пункта будет очень сложна. Она требует фундаментальной работы и времени и в ближайшее время не может являться в полной мере резервом для замещения снижения ставок страховых взносов. Она не сможет в полной мере заработать до начала следующего года. Тем не менее в этом направлении нужно работать.

Я серьезно задержался на пенсионных вопросах. Дальше идет налоговая система, не буду здесь долго говорить. Являюсь сторонником нейтральных налоговых систем, т.е. выступаю против создания громадного количества льгот при высоких налогах. Поддерживаю создание равных возможностей и установление единых ставок даже для разных отраслей. Исключения могут быть, но они должны быть ограничены, должна быть четко доказана эффективность применения таких изъятий. Сейчас очень много изъятий не работает или они создают искажения.

Всегда был сторонником того, что НДС является стабильным налогом. Сейчас НДС повышается в ряде стран. С 1 января этого года в Великобритании повысился с 17,5 до 20% одномоментно. Одновременно уменьшается налог на прибыль на 2% с 1 апреля и с 2015 г. еще на 3%, увеличивая нагрузку на НДС как на более стабильный нейтральный налог. Понятно, что налог на прибыль сегодня более мобилен с точки зрения создания центров прибыли и ее ухода, в том числе через офшоры.

Среди факторов, способствующих модернизации, назову и конкуренцию. Уже много о ней говорилось, участие государства в капитале и регулировании рынка должно быть существенно уменьшено. В этом смысле нам очень много нужно сделать. Структура бюджета должна быть максимально подчинена созданию инфраструктуры для бизнеса, а не субсидированию самого бизнеса.

Среди ключевых вопросов – реформа госуправления. Эффективность самого госуправления часто является причиной многих проблем. В свое время Маргарет Тэтчер в стране, где чиновник был самой неуважаемой личностью, пришла к выводу, что нужно проводить очень серьезную административную реформу. Более 10 лет проходила эта модернизация, и даже через 10 лет примерно 20% министерств не были реформированы. Это большой и серьезный процесс. Тэтчер создала в итоге новую систему управления – уважаемую, эффективную, которая в свою очередь возродила экономику Великобритании.

Важнейшим фактором модернизации является также доверие к правительству и к его политике. Если правительство принимает решение по налогам, а через год его меняет, если принимает решение по страховым выплатам и тут же его модернизирует, это не создает доверия к политике. Предприниматель должен понимать цели, заявленные правительством, быть уверенным, что если правительство ответственно заявило о создании определенных условий, то оно создаст эти условия и будет во что бы то ни стало придерживаться заявленных принципов.

Завершая, хочу сказать, что предвыборный период всегда очень сложен. Вынужден всегда об этом говорить. В условиях, когда мы генерируем новые политические задачи, в том числе финансовые обязательства, мы можем нарушить другие наши обязательства, связанные строгим балансом бюджета, строгим правилом использования нефтегазовых доходов. Тем самым достигнув одних важных целей, мы не достигнем других, более фундаментальных. Например, если мы отойдем от целей снижения инфляции и снова провалимся в этой сфере, то потеряем доверие на много лет вперед. Банки и инвесторы станут закладывать эти риски вперед. Ставку, которая платится за риск, нужно будет снижать потом много лет. Отступление один раз на время может создать недоверие надолго.

# НЕОБХОДИМОСТЬ РАДИКАЛЬНЫХ РЫНОЧНЫХ РЕФОРМ

Стенограмма выступления

---

Я не буду говорить о шоковой терапии, не люблю это выражение, предпочитаю термин «радикальные реформы». Несколько замечаний именно по поводу реформ, начиная с различных начальных условий и различных политических условий. Прежде всего, реформа – это изменение в системе институтов страны. Институты отличаются по фундаментальным признакам, например, по концентрации политической власти. Есть ли разделение политической власти или оно отсутствует? Каковы правила преемственности в политике – демократические выборы, телефонное право? Наконец, каково верховенство закона? Четвертое. Каков режим прав собственности? Что можно сказать о частном предпринимательстве – является ли оно регулируемым или свободным? Шестое. Каково налоговое бремя правительства? Это основные аспекты устройства страны.

Можно создать несколько типологий. Социализм – это недемократическое устройство по своим основам. Существует большое количество смешанных и переходных вариантов. Я думаю, было бы правильно разграничить основные типы реформ. С одной стороны, они могут быть либеральными, но в любом случае они призваны снизить политическую власть в стране. Приватизация призвана снизить политическую власть. Налогообложение нацелено на снижение затрат. Вот такие виды реформ. С другой стороны, коллективные реформы, такие как национализация, установление политической зависимости судебных органов, увеличение налоговой нагрузки государства. Есть два различных направления. Почему мы все время говорим о необходимости рыночных реформ или о необходимости либерализации? Я думаю, что существуют две основные причины. Прежде всего, все коллективные системы не успешны. Они могут приносить выгоды правительству, но не обществу в целом. Под такими коллективными системами я имею в виду социализм и другие системы с большой концентрацией власти. Я не знаю ни одной страны с таким строем, которая бы была успешна с точки зрения экономики. Это первое, что приводит нас к необходимости искать реформы по либерализации. Во-вторых, почему возникла

госпожа Тэтчер в Великобритании? Была ли действительно необходимость в реформах? Потому что реформы, нацеленные на коллективизацию, проводились и до госпожи Тэтчер. Это была национализация, усиление регулирования, увеличение расходов. Очень сильные профсоюзы, что в конце концов привело к экономическому кризису, который повлек за собой реформы госпожи Тэтчер. Рыночные реформы стали следствием предыдущих антирыночных реформ. Если вы хотите объяснить рыночные реформы, необходимо обосновать модель, выявить предыдущие установки. Не только рынок предопределяет необходимость реформ.

Если посмотреть в более долгосрочной перспективе, мы увидим различные изменения. Это не постоянные флуктуации, но это изменения в институциональной системе, даже в свободных обществах. Основной вопрос, который остается открытым, это каким образом создать хорошую систему, хорошую с точки зрения обеспечения роста. Для нас это очень большая задача. Второй большой вопрос: как из плохой системы создать хорошую? Я думаю, что есть два подхода к этому вопросу реформирования. Первый я бы назвал экономическими реформами. Второй – это политико-экономические реформы. Оба подхода являются важными. Каков должен быть комплект реформ при наборе определенных условий, чтобы достичь процветания, снизить дефициты и снизить коррупцию? Существуют различные ответы и различные наборы мер. Нет одного лекарства от всех болезней. Нам необходимо адаптировать лечение к диагнозу. Например, в Ирландии в конце 1980-х годов назрела необходимость проведения небольшого комплекта реформ, потому что не было гиперинфляции, существовала частная собственность, существовала открытая экономика, но она была не очень успешной. Почему? В конце 1980-х в Ирландии существовала только одна экономическая болезнь – это налоговый дисбаланс, большие расходы и большой бюджетный дефицит. 15 лет был очень успешный рост, а потом наступил кризис, который частично они создали сами. Необходима очень хорошая структура для экономических действий.

У нас 20–25 лет назад задачи были гораздо обширнее. Мы должны были обеспечить стабильность, дерегуляцию. Было необходимо создать независимые от государства институты. То есть пакет необходимых реформ был действительно огромен. Экономические реформы с учетом начальных условий определяют, что необходимо сделать для достижения заявленных целей, таких как рост, стабильность, низкая инфляция и т.п. Политический аспект реформ объясняет, какие факторы привели к появлению плохих систем. Какие факторы предопределяют экономические реформы, какие факторы предопределяют успешность или неуспешность экономических реформ? Потому что можно попробовать при-



нять меры, но эффект будет обратным ожидаемому. Существует связь между экономическими и политическими реформами. Можно сказать, что если пакет реформ создан удачно, повышается вероятность его влияния на политические реформы, но это не всегда так. Реформы нужно защищать, реформы нужно отстаивать, потому что в любом обществе существуют силы, которые отстаивают негативные тенденции, в любом обществе, даже в США. Поэтому необходимо иметь дополнительные механизмы, которые будут защищать достигнутые результаты. Что, как правило, подвергается очень массивным нападкам? Это налоговая система, это государственные расходы. Особенно это было заметно после Второй мировой войны в хорошие годы. Бедность государства и бедность населения не может являться объяснением для больших государственных расходов, наоборот, при росте экономики растут и государственные расходы. С учетом общего направления, если необходимо внедрить контроль над ценами, вы хотите снизить эффективность роста, – национализируйте, формально либо неформально. Если вы хотите увеличить коррупцию, дайте больше полномочий бюрократии. Если вы хотите увеличить цену, снижайте конкуренцию, блокируя экспорт либо предоставляя дополнительные льготы отдельным направлениям деятельности, такие как монопольные права или дополнительная защита, что дискриминирует права конкурентов.

Существует очень большой набор вариантов, как убить экономические реформы. С другой стороны, существует такой же длинный список того, что необходимо сделать, чтобы улучшить экономическую ситуацию. Несмотря на все разговоры о приватизации, нет никаких отрицательных показателей частной собственности. Необходимо деполитизировать право частной собственности. Политизированная частная собственность не работает, она неэффективна. Нет никакой замены рыночной конкуренции. Без увеличения рыночной конкуренции ни одна из стран не может модернизироваться. Говоря о модернизации, не упоминая об увеличении безопасности прав частной собственности, без конкуренции мы ни к чему не придем. Посмотрите на частный сектор, посмотрите на Америку, на него тоже нельзя опираться. Это тоже чистая пропаганда. Необходимы и государственные институты. Мы знаем, как бороться с безработицей, нам необходимо сделать рынок более гибким. Негибкий рынок, такой как в Испании, в конце концов разломится и приведет к росту безработицы. Безработица тоже очень часто обсуждается, там очень много разнообразных и не всегда правильных мнений. Потому что безработица обсуждается теми людьми, которые считают себя профессиональными экономистами.

Очень многие, особенно политики, говорят, что кризис был вызван проблемами на рынке. Может быть, это интуитивное понятие. Если у вас насморк,

вы не должны винить свой нос за насморк. Существует достаточно большое количество исходных причин, включая снижение процентных ставок Федеральным резервным банком, которое было поддержано Европейским центральным банком. Кроме того, мы знаем, что это было связано с выдачей кредитов тем людям, которые их не заслуживали. Это были островки социализма в капиталистических странах. В Германии существуют земельные банки, которые не являются частными учреждениями. Посмотрите, куда их привел кризис. В Испании есть «са́жас», тоже не частные банки, посмотрите на их будущее, на их проблемы. Мы не можем винить только рынок.

Я не очень оптимистично отношусь к варианту возможного предотвращения финансовых кризисов в будущем. Такие инструменты управления и финансовой политики создают другие пузыри, включая российский нефтяной пузырь.

Думаю, что я и вас уже запутал в отношении экономических и политических реформ. Что делать в этом случае? Если ранее проведенные рыночные реформы не сработали, это в основном связано с недостатком знаний либо с недостатком политической воли. Один из основных инструментов, которые относятся к экономическим и политическим реформам, почему такая неэффективная система существует такое длительное время. Второй вопрос: что объясняет иногда успех рыночных экономик? Чтобы ответить, необходимо обратиться к вопросу изначального политического режима. Нельзя абстрактно обсуждать экономические реформы, не касаясь политической ситуации. Существует большое количество политических режимов, в основном, можно выделить два. Первый – неэффективные демократии, там, может быть, и проводятся выборы, но они несвободные. Второй вариант – это эффективная демократия. В первой группе есть большое разнообразие политических режимов – от Сингапура до Зимбабве. Что это значит? Это показывает роль личности. В недемократических режимах существует концентрация политической власти, и очень важно, кому принадлежит эта власть. Анализ недемократических режимов должен включать в себя участие психологов. Не думаю, что диктатор – это такой интересный предмет для изучения, но их роль очень значима и очень важна. Мы не можем игнорировать роль личности в истории, потому что политика не изменится, пока не изменится личность.

Поэтому существует два варианта изменения неэффективной демократии. Прежде всего это изменение самого режима или переход с неэффективной на эффективную экономику. Первый тип изменений. Надо сказать, что все равно надо делать все, что от вас зависит, потому что если вы не будете ничего делать, у вас ничего и не получится. Люди, которые проводят реформы, это очень смелые,

очень мужественные люди. Если вы будете мужественны, но у вас не будет хорошей организации, то у вас тоже ничего не получится. Мужество, смелость и хорошая организация – это ключ. Есть разные инструменты – больше политической власти, меньше политической власти, парламентский режим, президентская система. Почему плохие системы продолжают существовать? Если мы будем искать общий ответ на этот вопрос, то в первую очередь нужно будет упомянуть привычку к системным выгодам, которые создаются плохими системами, т.е. за счет увеличения расходов. Развивается привычка к получению льгот, которые распределяются. Греция – это крайний случай такой политики. В какой-то степени эта проблема существует и в других странах. Почему нельзя сократить расходы? Вы можете брать займы, у вас может быть поток средств, как в странах, которые добывают нефть и газ, пока не кончается этот поток нефтяных средств, то вы можете быть очень щедрым. Если мы посмотрим на Грецию, Ирландию, Испанию, то увидим, что вместо того чтобы исправлять ситуацию, они продолжают тратить и тратить. В Испании был банковский кризис, в Греции особенно это было заметно.

Есть и другие факторы. Среди ключевых – откладывание проблем на потом и легкомысленное расходование государственных средств. Очень много мифов о коллективизме, то, что называется бесплатным завтраком, и защита слабых. Это ментальность социальных бюрократов. Я сейчас расскажу вам анекдот. Приезжает делегация из бывшего Советского Союза в Америку, они видят полки магазинов, на которых стоят бутылки с кока-колой, бананы. Они говорят: «Кто отвечает за поставку кока-колы, бананов?». Невозможно, чтобы безличные рыночные силы имели такие проблемы. Этот менталитет сохраняется. Многие не верят, что президент не должен отвечать за поставки продовольствия или за поставки хлеба. Они не верят в существование безличных рыночных сил, рыночного механизма, который обеспечивает такой приток товаров. Есть такой миф о хорошей системе социализма. Нужно разделить рабочую неделю, поделить рабочие места – это было так и во Франции, когда они установили 40-часовую рабочую неделю, для того чтобы все французы получили работу. Конечно, вы вините капитализм во всех бедах, но не сравнивая капитализм с другими системами. Обычно вы сравниваете это с каким-то идеалом, затем выходит, что самая лучшая система оказывается плохой. Есть очень много мифов. Предприниматели обычно не любят конкуренцию, поэтому они стараются блокировать процесс либерализации. Или такие, которые смотрят на себя как на получателей и пользователей государства всеобщего благосостояния. Есть еще обожествление государства, т.е. государство должно стоять над обществом, это божество. Такое обожествление сохраняется в некоторых государствах. Вы смот-

рите на бюрократов, на чиновников, на политиков и начинаете обожествлять государственных служащих, это какая-то массовая шизофрения. Итак, непонимание того, что все льготы и дотации сопряжены с определенными расходами.

Но зачем нужны радикальные рыночные реформы в демократическом государстве? Многие попадают в ловушку дисбаланса. Иногда случается кризис, тогда наступает время для принятия экстраординарных политических мер. Люди понимают, что это нужно действительно сделать, они не критикуют. Они продолжают обожествлять государство, вмешательство государства, считают, что государство может все исправить. Здесь я должен сказать, что гораздо лучше проводить реформы до кризиса, не дожидаясь кризиса, потому что сам по себе кризис – достаточно неприятная вещь. Кризис может привести к различным социальным потрясениям, обнищанию населения и т.д. Я должен также сказать, что не каждый кризис приводит к рыночным реформам. Если люди считают, что кризис произошел по причине плохого режима, например, социализма, из-за чрезмерной политизации общества, то они будут поддерживать рыночные реформы, так, как это произошло в странах Восточной Европы. Люди почувствовали на себе, что такое социализм, может быть, не понимая до конца. Но бывают ситуации, когда люди неправильно понимают причины, приведшие к кризису, и винят в этом рыночные силы. Например, Аргентина. Аргентина провела широкомасштабные рыночные реформы в 1990-х годах, после этого произошел кризис. Какова была реакция общества? Во всем виноват рынок, во всем виновата реформа. Да, были масштабные реформы, но эти реформы не смогли убрать все узкие места, они не смогли справиться со всеми проблемами. Многие провинции настаивали на том, чтобы центр перераспределял блага в их пользу. После того как произошел шок, все эти слабые места выплыли наружу. Каково же было заключение? Ваш пакет реформ был плохим, он не справился с проблемами, поэтому произошел кризис. В результате они неправильно интерпретировали рыночные реформы.

**Е.Г. Ясин:** спасибо за доклад. Два вопроса.

**Вопрос из зала:** у меня два вопроса. Не могли бы вы подробнее рассказать о ситуации в Китае? С одной стороны, у них есть концентрация власти, с другой стороны – успешные экономические реформы и динамичная и свободная предпринимательская атмосфера, 400 млн людей, которые уже не являются бедными. Является ли этот случай исключительным к тому, что вы упомянули? Второе. Постсоветские страны. Меня особенно интересует ваше отношение к Казахстану, это тоже авторитарное государство, с концентрацией политической

власти, с отсутствием свободы слова. С другой стороны, в Казахстане наблюдается макроэкономическая стабилизация, развитие предпринимательства. Как вы оцениваете перспективы для таких стран, как Казахстан? Действительно ли их экономика обречена из-за недостатка политической власти?

**Л. Бальцерович:** очень хороший вопрос. Китай не изменил политическую систему, но изменил экономическую ситуацию, она началась с развалом маоистского правительства, что было связано и с гуманитарной катастрофой, и с экономической, потому что Культурная революция унесла тысячи жизней. Экономическая катастрофа была связана с тем, что Китай не влился в мировую экономику, он потерял 30–40 лет. Потом они начали в определенном смысле рыночные реформы, эффективно деколлективизируя сельское хозяйство, это было открытие навстречу внешнему миру. Кроме того, они внедрили некоторые квазиправа частной собственности. В течение 30 лет это происходит. Почему Китай достиг таких результатов, такого роста? Прежде всего, это не исключение. Можно привести примеры Южной Кореи и Тайваня. Второе. В Китае существовали дополнительные механизмы, которые не существовали в России. Когда люди сравнивают Китай и Россию, они не учитывают значительной разницы в начальных условиях. В Китае, который был недоразвитой, сельскохозяйственной страной, сельское хозяйство было легко деколлективизировать, просто разделив землю, не было сельскохозяйственного оборудования, надо было просто поделить землю. Это была квазиприватизация, которая включила миллионы людей, это привело к огромному росту, который в свою очередь стал стимулом для других реформ, чего не произошло ни в России, ни в Чехии, где сельское хозяйство было незначимым для экономики государства и находилось на субсидии. Китай и Вьетнам в какой-то степени показывают, что рыночные реформы возможны при неэффективной демократии, но они очень ограничены. Они ограничены отсутствием равенства перед законом, нормальной судебной системы. Я считаю, что для нормальной судебной системы необходима нормальная политическая система. Другим ограничением является несвобода создания ассоциаций, т.е. самоорганизации профессиональных союзов, профессиональных организаций. При отсутствии таких профессиональных организаций люди зависят от государства. Если государство работает неэффективно, возникают проблемы. То есть свобода создания союзов является одной из основ. Казахстан я не могу сейчас обсуждать. Это показывает, что, действительно, личность в недемократических экономиках играет значительную роль, но лучше все-таки полагаться на неличностные и на объективные факторы, а не на субъективные.

**Вопрос:** поскольку мы говорим о реформах, в любой демократии для достижения успеха необходимо обеспечивать участие значительных масс людей, т.е. большое количество общественности должно участвовать и в реформах, и в инвестициях. Когда вы говорите о рыночных реформах, рыночный спрос зависит и от потребительского индекса, и от распространения продуктов на рынке. Рыночный спрос является определяющим показателем увеличения производительности, увеличения импорта, увеличения экспорта, увеличения инвестиций и их направления. Работа в направлении увеличения производства тех продуктов, которые пользуются спросом на рынке. Это является одним из показателей эффективности инвестиций, потому что капиталовложения мы делаем не для инвестиций как таковых, а для повышения качества продуктов на рынке. Должны ли мы защищать инвесторов и инвестиции на международном или на национальном уровне? Инвесторы вкладывают средства, и они должны быть уверены в том, что их средства будут в безопасности и они получат прибыли. В вашем выступлении один из критериев, которые вы назвали для реформ, это массовые выгоды для людей, т.е. мы можем также сослаться на эффективность инвестиций и на необходимость защиты инвестиций. Поэтому вопрос к вам: как обеспечить защиту инвестиций при проведении реформ? С двух сторон – и для инвестора, и для принимающей стороны. Инвесторы должны быть защищены законом, если кризис либо квазикризис происходит, мы задаемся вопросом: как обеспечить защищенность инвестиций? Вы говорите о частных инвестициях. В данном случае кто нуждается в защите?

**Л. Бальцерович:** с одной стороны, необходима эффективная государственная система, которая обеспечит защиту всех видов собственности. Если псевдогосударство, как на Гаити, вы никакой защиты не получите. Во многих странах существуют такие союзы предпринимателей, которые не только не защищают, но, наоборот, грабят. Необходимо также защищать частных инвесторов от государственной бюрократии, от коррупции. Если существуют псевдогосударства, которые не могут защитить инвесторов от обычных уголовников, кроме того, поддерживают коррупцию, мы не можем говорить о защищенных инвестициях. Нам прежде всего необходима эффективная государственная машина. Мы также говорили о рынке, рыночном спросе. В бедных странах необходимо концентрироваться на вопросах поставок на рынки.

**Вопрос:** ваше отношение к небольшим государствам также относится к тому, что государство не должно предоставлять гарантии по депозитам вкладчикам?

**Л. Бальцерович:** это эмпирический вопрос. Я знаю большое количество эмпирических исследований на эту тему, которые показывают, что если вы гарантируете депозиты большого объема, вы снижаете уровень рыночной дисциплины. Это было предпринято Рузвельтом, потом распространилось по всему миру. Всемирный банк выступает против гарантирования депозитов. Я согласен, что должно быть определенное дерегулирование для того, чтобы подержать рыночную дисциплину. Это первый пункт, с которого можно начать.

**Е.Г. Ясин:** добавлю. Нужно учитывать еще одну проблему, которая будет активно обсуждаться на нашей конференции, это проблема культуры, в особенности тогда, когда речь идет о Казахстане или странах Восточной Азии, мы сталкиваемся с тем, что рыночная экономика функционирует в определенной культурной среде. При определенных обстоятельствах культурная среда помогает (как мы это видим в Сингапуре или других странах Восточной Азии), в других она не содействует. Во всяком случае, мы сталкиваемся иногда с авторитарной политикой, опирающейся на определенные национальные традиции, не преодоленные моменты в истории, это оказывает свое воздействие и должно приниматься во внимание. Я так подозреваю, что если бы господин Назарбаев сейчас начинал бы с развития демократии, то у него вряд ли что-то хорошее получилось. Но это вопрос спорный. Я просто призываю к тому, чтобы те люди, которым интересны эти вопросы, обратились к нашим секциям.

# ПОСТКРИЗИСНОЕ РАЗВИТИЕ ГЛОБАЛЬНОЙ ЭКОНОМИКИ

Стенограмма выступления

---

Я не буду говорить о перспективах развития российской экономики, не буду говорить об уроках кризиса, о неэкономических вопросах, не потому, что считаю их неважными – думаю, другие выступающие поговорят об этом. Я полностью согласен с Алексеем Кудриным и Лешекком Бальцеровичем, что очень важно принимать во внимание и социальные, и политические, и даже психологические аспекты экономических процессов. Но хотел бы остановиться на следующих вопросах. Во-первых, описать посткризисное развитие глобальной экономики, чтобы задать контекст, в котором существует и будет развиваться российская экономика. Затем объяснить, почему, с моей точки зрения, именно сейчас очень хороший момент для того, чтобы обсуждать и принимать долгосрочные решения, касающиеся российской экономики. Я перечислю вопросы, на которые, с моей точки зрения, надо ответить, и попробую сформулировать ответы, которые мне кажутся наиболее своевременными, и те решения в области экономической политики, которые необходимо принять.

Итак, что происходит в глобальной экономике? С одной стороны, глобальный экономический кризис закончился, с другой стороны, понятно, что посткризисный рост будет медленнее, чем докризисный рост. Возникает понимание новой нормали, возникает понимание того, что докризисный рост был неустойчивым, его нельзя поддержать в посткризисном мире. В частности, накопленные долговые обязательства, очевидно, приведут к тому, что фискальные обязательства будут перебалансированы, и, таким образом, рост будет более медленным. Самое главное, что, хотя в краткосрочной перспективе для России внешнеэкономическая конъюнктура выглядит хорошей и даже слишком хорошей, в том числе и из-за событий на Ближнем Востоке, в том числе и из-за ужасной трагедии в Японии, надо понимать, что риски в мировой экономике сохраняются, и на протяжении следующих десяти лет эти риски так или иначе материализуются. Алексей Кудрин уже много говорил об этом. Во-первых, действительно не понятно, что будет с долговым бременем, с суверенным дол-



гом в Соединенных Штатах и в Европе. Понятно, что эти долги в существующем режиме нельзя выплатить, необходимо какое-то чудо или необходима реструктуризация долга. Если этого не случится, то совершенно не ясно, как будут выплачены долги Соединенных Штатов и отдельных европейских стран. По всей видимости, придется снижать расходы и повышать налоги, что не может не сказаться на темпах роста экономики.

Во-вторых, есть риски и в развивающихся странах. Мы привыкли к тому, что развивающиеся страны растут, растут неостановимо и устойчиво. Но это не обязательно будет продолжаться. Все ключевые развивающиеся страны на протяжении ближайших десяти лет так или иначе столкнутся с проблемами. Эти проблемы наверняка возникнут не сразу, но они обязательно возникнут. В Китае обязательно встанет вопрос о политической децентрализации и либерализации, как это будет происходить – совершенно не понятно. В Бразилии обязательно встанет вопрос, связанный с перераспределением доходов. Бразилия практически становится развитой страной на горизонте десяти лет, развитых стран с таким уровнем неравенства, как сейчас в Бразилии, не бывает. И это означает, что нас ждут какие-то новые социальные модели, новые социальные контракты в Бразилии, и не обязательно Бразилия сможет расти так же быстро. Напротив, в Индии, в стране с достаточно развитой и устойчивой демократией, возникают вопросы о необходимости больших государственных инвестиций, инвестиций в инфраструктуру. Как это сделать в такой бедной стране? В отличие от Китая, где есть централизация власти, в Индии это сделать гораздо труднее. Не ясно, каким образом Индия решит эти вопросы. Я уже не говорю о Южной Корее, которой придется потратить много сил, времени и ресурсов на интеграцию с Северной Кореей. В этом смысле я бы хотел сказать, что совсем не очевидно, что экономический рост в развивающихся экономиках будет быстрым. Более того, совершенно не очевидно, что события на Ближнем Востоке приведут к повышению цен на нефть. В краткосрочной перспективе это так, но что будет дальше – совершенно не понятно. Как мы знаем, периоды высоких цен на нефть приводят к тому, что ускоряются инвестиции в альтернативные технологии и в новые месторождения, которые сначала кажутся дорогими и неподъемными, но эти новые источники энергии вдруг выходят на передний край, и цены на энергоносители могут даже снижаться. В этом смысле на протяжении ближайших десяти лет вероятность того, что Россия столкнется с трудными внешнеэкономическими условиями, очень высока.

Поэтому необходимо понимать, каким образом мы можем подойти к этому рубежу с более конкурентоспособной экономикой, чем мы имеем сегодня. И сейчас самый подходящий момент для обсуждения этих проблем. Почему?

Потому что в краткосрочной перспективе все хорошо. Для реформ есть деньги. Есть и понимание того, что сегодняшняя система неустойчива и нежизнеспособна в долгосрочной перспективе. Я процитирую тогдашнего президента Владимира Путина, который выступал с программной речью 8 февраля 2008 г. перед тем, как он оставил пост президента. Выступая перед Госсоветом, он так сформулировал свою точку зрения на долгосрочные перспективы России. Относительно инерционного сценария, т.е. сценария, при котором ничего не изменится, он сказал так: «Следуя этому сценарию, мы не добьемся необходимого прогресса в повышении качества жизни российских граждан. Более того, не сможем обеспечить ни безопасность страны, ни нормальное ее развитие, подвергнем угрозе само ее существование». Если сегодняшний премьер-министр так видит долгосрочные риски страны, то, наверное, и его сторонники, и его оппоненты и во власти, и вне власти с ним будут согласны. Соответственно эти изменения действительно назрели и необходимы. В то же время пока новый кризис не наступил, остается согласиться с профессором Бальцеровичем, что сегодня очень удобное время для обсуждения этих изменений и для реализации этих изменений.

Ключевые вопросы, на которые нужно ответить, таковы. Нужен ли нам быстрый экономический рост? Возможен ли быстрый экономический рост в сегодняшней России? Откуда возьмется этот экономический рост? На предприятиях какой формы собственности? На предприятиях какого размера? На предприятиях каких отраслей? За счет чего будет осуществлен этот самый экономический рост? Следующий ряд вопросов – это какие решения необходимо принять для того, чтобы эти механизмы роста заработали.

Если экономического роста не будет, то Россия не сможет сократить отставание от развитых стран, поэтому рост для решения стоящих перед Россией социально-экономических вопросов, конечно, необходим. Возможен ли он? В мире есть не так много, но достаточно примеров стран, которые, находясь на таком же уровне развития, как Россия сегодня, продолжали расти достаточно быстрыми темпами, более быстрыми, чем Россия растет сегодня. В первую очередь все говорят о примере Южной Кореи, которая, находясь на таком же уровне, на котором Россия находится сегодня, росла темпами 6% в год в течение еще десяти лет. В этом смысле нельзя сказать, что есть какие-то неразрешимые проблемы. Другое дело, что у России есть много трудностей, и если их не решить, то, конечно, этот экономический рост ниоткуда не возьмется. Поэтому я бы хотел поговорить о целом ряде вопросов, отдельные из них абсолютно банальны, но, мне кажется, некоторые из этих банальностей недостаточно часто повторяются.

Где найти новые источники роста? Надо сказать, что большинство докризисных источников роста исчерпаны, все эффективные мощности загружены, дешевой рабочей силы больше нет. В этом смысле очевидно, что новый рост возьмется только из инвестиций, а для инвестиций нужен инвестиционный климат. Президент Медведев в своей речи на Санкт-Петербургском экономическом форуме очень четко сформулировал, что сколько бы мы ни создавали госкомпаний и госкорпораций, но модернизацию российской экономики проведут частные компании. В этом смысле, конечно, нельзя решить проблемы, которые стоят перед Россией, без проведения нового раунда масштабной приватизации (безусловно, не ограничиваясь продажей миноритарных пакетов, а передав в частные руки контроль над ключевыми командными высотами российской экономики). Приватизация сегодня необходима не только с фискальной точки зрения, но и с точки зрения решения экономических и политико-экономических проблем. Мы знаем, что в производственных секторах частные предприятия более эффективны – конечно, если это деполитизированные частные предприятия, и если их права собственности защищены, и если есть эффективная конкурентная политика. Кроме того, мы знаем, что если не будет частной собственности, то не будет и политических групп интересов, которые будут защищать реформы, создание конкуренции, прав собственности и т.д.

Часто задают вопрос, не стоит ли отложить приватизацию? Мне кажется, что сегодня, когда цены на нефть и, соответственно, на все российские активы очень высоки, на самом деле очень удачный момент для проведения приватизации. Потом, когда цены на нефть, на газ, на другие ресурсы упадут, вдруг окажется, что российские активы стоят гораздо дешевле и за счет приватизации по крайней мере фискальные проблемы будет решить трудно. Кроме того, если бюджет получит от приватизации существенные средства, то это обеспечит и легитимность прав собственности новых владельцев.

Важно ли для роста развитие малого бизнеса? Безусловно, да, но не стоит забывать и про большой бизнес. Известно, что ответ на вопрос о том, какие формы бизнеса способствуют росту, зависит от стадий экономического роста. Если экономика находится далеко от передового края производительности, то важнее перенимать новые технологии, и в этом случае важнее большие компании или даже группы компаний – им легче создавать эффект экономии от масштаба и решать проблемы координации. Если экономика находится близко к переднему краю, то необходимы инновации, которые легче осуществлять в малых компаниях. В некоторых отраслях Россия серьезно отстает, в некоторых – находится достаточно близко к передовому краю. Поэтому важно создавать стимулы и для большого, и для малого бизнеса.

Следующий вопрос об отраслях, в которых будет экономический рост. Часто говорят, что в нефтяном, в нефтегазовом секторе экономического роста больше не будет и что существует так называемое ресурсное проклятие, что Россия слишком сильно зависит от цен на нефть, и поэтому у России будут большие проблемы. На самом деле, нефтяное проклятие, наверное, существует, но, наверное, его не следует упрощать. Нефтяное проклятие существует не на нефтяных месторождениях и даже не на валютных рынках. Нефтяное проклятие существует в головах лиц, принимающих решения, в головах политиков. Нефтяное проклятие – это те самые легкие деньги, которые заставляют задумываться о краткосрочных перспективах и не думать о том, что необходимы изменения, которые сделают экономику конкурентоспособной в долгосрочной перспективе. В то же время нефтяной сектор сам по себе – это очень высокотехнологичный сектор, который предъявляет спрос и на человеческий капитал, и на инновации. Мировые лидеры в области нефтедобычи и нефтепереработки – это очень высокотехнологичные компании. В этом смысле не стоит думать, что России нужно специально задушить свой нефтяной сектор. Более того, у нас есть серьезная опасность того, что если мы не изменим налогообложение нефтяного сектора, то добыча нефти будет снижаться уже на горизонте ближайших пяти лет, и это означает, что нас ждут серьезные фискальные проблемы. В этом смысле возникает вопрос: что же делать? Здесь тоже есть пространство для маневра. Когда нефтяные лоббисты говорят о том, что давайте снизим налоги сейчас, тогда мы гораздо больше налогов заработаем во второй половине 2010-х годов, правительство, конечно, отвечает, что деньги нужны сейчас тоже. Какой ответ на этот вопрос? Ответ очень простой. Если снизить налоги на нефтяной сектор сегодня и создать стимулы для инвестиций, очевидно, что это приведет к повышению капитализации нефтяных компаний. У правительства есть нефтяные компании. Соответственно, если сегодня снизить налоги на нефтяной сектор, правительство может вернуть эти деньги, приватизировав свои нефтегазовые активы (но не миноритарные пакеты акций, а крупные).

Вторая возможность – это взаимодействие с мировыми лидерами в области нефтегазового бизнеса, потому что у России есть много месторождений, где нужны самые современные технологии. Здесь, как уже сказал Президент Медведев на прошлой неделе, необходимы изменения в законе «О стратегических отраслях». То же самое нужно сделать и в газовом секторе. Опять-таки приятнее всего думать, что цены на газ будут такими же высокими, как цены на нефть. Но реальность меняется. Сегодня в Америке цены на газ и цены на нефть ведут себя совершенно по-разному, потому что есть сланцевый газ. И теперь и в Европе, и в Азии начинается процесс, когда цены на газ отвязываются от цен на

нефть. Этот фактор играет все более важную роль и в некоторых других регионах мира просто потому, что газовый рынок постепенно интегрируется за счет того, что есть сжиженный газ. В этом смысле пока цены на газ высокие, пока есть эффект от атомной трагедии в Японии и ближневосточных волнений, наверное, стоит задуматься о том, чтобы продать некоторые активы «Газпрома», потому что потом это будет сделать труднее, потом это принесет нам меньше денег. Не нужно бояться, что это подвергнет риску энергетическую безопасность России, потому что до тех пор, пока российское государство контролирует газопроводы и терминалы сжиженного газа, конечно же, российское правительство сохранит полный контроль над газовым рынком.

Далее вопрос о снижении налогов, о котором говорил Алексей Кудрин. В принципе, в такой коррумпированной экономике снижение налогов – это не панацея. Если права собственности не защищены и весь бизнес у вас может отобрать чиновник, то снижение налогов увеличивает взятки, снижение официальных налогов повышает коррупционные налоги. В этом смысле, конечно, снижение налогов не может заменить плохой инвестиционный климат. Но ситуация с 34-процентным налогом существенно отличается. Дело в том, что сейчас это уже вопрос существования целых категорий бизнеса. Неслучайно мы наблюдали большой отток капитала в IV квартале 2010 г. и в I квартале 2011 г. Наверное, это тоже связано с тем, что предприниматели не видели никакой перспективы продолжать бизнес. Когда бизнес поставлен на грань выживания, высокие налоги уже способствуют распространению коррупции, потому что бизнес не может платить 34-процентный налог, он уходит в тень, тем самым став жертвой дополнительных коррупционных вымогательств. В этом смысле, мне кажется, снижать налоги придется. Откуда взять деньги? Очевидно, нужно продавать все ненужное – нужно продавать государственные активы.

Следующий вопрос. Мы много говорили сегодня о доверии к правительству. Есть ключевая мера, которую необходимо предпринять – нужно выполнить свои обязательства перед инвесторами в электроэнергетике. Мы продали генерирующие активы за большие суммы денег. Теперь мы обманули инвесторов, которые рассчитывали, что смогут заработать эти деньги на рынке. Наверное, инвесторы, которые будут инвестировать в следующую волну приватизации, зададут вопрос: а не обманут ли нас каким-нибудь образом еще? Очевидно, что эти обязательства необходимо выполнять в том числе и для того, чтобы мы, включив в розетку прибор, получили электричество через пять лет или через десять лет. Очевидно, что это приведет к серьезным последствиям с точки зрения социального спокойствия. Тут опять-таки не надо бояться того, что нам придется повышать адресные социальные субсидии.

Шаг, который восстановил бы доверие бизнеса и инвесторов – это вступление в ВТО. Вступление в ВТО уже стало притчей во языцех. Десять лет назад мы знали, что вступим в ВТО через 1,5 года. Пять лет назад мы знали, что вступим через 1,5 года. И опять мы знаем, что вступим в следующем году. На самом деле вступление в ВТО важно само по себе, но оно важно и с точки зрения того, что правительство и президент придерживаются своих обязательств и следуют выбранному курсу. Кроме того, вступление в ВТО полезно и для того, чтобы обеспечить механизм защиты инвесторов. ВТО – это не механизм улучшения инвестиционного климата, тем не менее целый ряд правил ВТО помогают и иностранным, и российским инвесторам жить спокойно. Также, если говорить о том, чтобы помочь самым бедным россиянам – наверное, самый большой налог на бедных россиян, помимо инфляции (о ней я тоже скажу), это таможенные пошлины на еду и лекарства, – то снижение таможенных пошлин – это самый простой способ адресных социальных субсидий. Надо понимать, что сегодня бедные, пожилые и больные россияне платят в пользу промышленных лоббистов большие деньги.

Кроме того, таможенные пошлины на многие продукты – это и налог на инновационные отрасли. Каждый рубль таможенных пошлин – это рубль удорожания трудовых ресурсов. Поэтому ИТ-компании в Томске или Новосибирске, которые нанимают российских программистов, вынуждены платить им большую зарплату, тем самым они проигрывают конкуренцию белорусским и индийским компаниям.

Еще один вопрос – это источник инвестиций. Конечно, главный источник инвестиций – это развитие финансовой системы. Одно из достижений последних пять лет – быстрый рост банковской и финансовой системы. Тем не менее, Россия отстает по развитию финансовой системы от стран с сопоставимым уровнем дохода. Конечно же, этот рост будет продолжаться. Да, он сопряжен с огромными рисками. Потому что в системе, в которой существуют госбанки и у госбанков есть так называемые мягкие бюджетные ограничения, всегда есть соблазн дать побольше рискованных и дешевых кредитов, потому что госбанки знают, что если они обанкротятся, за них заплатит Министерство финансов. Более того, Министерство финансов доказало, что оно это сделает, во время прошлого кризиса. Многие скажут, что в других странах то же самое предпринимали правительства, в том числе и западные правительства, но с одной огромной разницей. В российских госбанках поддержка со стороны государства не сопровождалась сменой менеджмента компании. Российские госбанки получили вливание капитала и продолжили жить так же хорошо. В американских банках вливание капитала сопровождалось увольнением менеджмента. В этом смыс-

ле один из уроков кризиса, к сожалению, заключается в том, что госбанки в России – не совсем конкурентная модель финансового института. Очевидно, это необходимо изменить.

Теперь об инфляции. Мы привыкли к тому, что 8% – это низкая инфляция. На самом деле это беспрецедентно высокий уровень для такой развитой страны, как Россия. Конечно, бывают эпизоды гиперинфляции, конечно, бывают эпизоды кризиса, но для нормального состояния 7–8% – это достаточно высокая инфляция. Заметьте, что хотя сегодня объявлен коридор 6–7% на 2011 г., все аналитики говорят о том, что хорошо бы удержать инфляцию в диапазоне ниже 10%. Но и 6–7% – это высокая инфляция.

Почему это важно? Потому что при такой высокой и изменчивой инфляции, тем более при инфляции, предсказать которую невозможно, развитие финансового сектора замедлено и затруднено. Кроме того, не стоит говорить и о становлении международного финансового центра, если мы не можем выполнить свои обязательства по снижению инфляции. Не говоря уже о том, что, конечно, инфляция – это налог на самых бедных. С одной стороны, я только что говорил, что нужно так или иначе повышать цены на электричество, наверное, придется повышать цены на многие товары и услуги, но речь идет, конечно, о повышении относительных цен. За счет вполне развитых, существующих у ЦБ инструментов денежной политики можно справиться с общим уровнем цен даже при повышении некоторых относительных цен.

Следующий момент – это то, что высокая инфляция мешает и реформе пенсионной системы. Правильно говорят многие специалисты, что сегодняшняя пенсионная система не жизнеспособна. Действительно, через десять лет дефицит пенсионной системы будет слишком большим. Но нельзя сегодня построить накопительные элементы пенсионной системы просто потому, что в России отсутствуют долгосрочные инструменты инвестиций. Главный показатель этого – это цены на жилье. Действительно, сегодня единственный инструмент долгосрочных сбережений – это недвижимость. Именно поэтому в недвижимость инвестируются все сбережения. Конечно, это ненормально, неразумно и несправедливо. Ведь недвижимость – это рискованный, неликвидный актив и недоступный нижнему среднему классу и бедным. Для того чтобы создать эти долгосрочные инструменты инвестиций, нужно сделать многое – и начать со снижения инфляции.

Если России удастся решить проблему развития финансовой системы – снижение инфляции, улучшение регулирования, приватизация госбанков, – то тогда есть целый ряд примеров, когда финансовое развитие способствует эконо-

мическому росту. Финансы становятся доступными и предприятиям, и населению, что создает спрос и на услуги, и на строительство жилья. Опять-таки, несмотря на огромное строительство жилья в последние годы, Россия по-прежнему существенно отстает от стран с сопоставимым уровнем дохода, примерно в 1,5 раза от стран Восточной Европы. Даже если мы будем строить самыми ударными докризисными темпами, даже если мы будем строить 60 млн кв. м в год, мы все равно доберемся до уровня Польши или Чехии или Словакии только через 10–15 лет. В этом смысле, конечно, финансовая система крайне необходима, потому что без развития в той или иной степени жилищного кредитования строительство жилья не будет пользоваться спросом.

Тем не менее, как я уже сказал, несмотря на все эти вызовы, есть и повод для оптимизма. Вокруг есть много стран, которые и в худших начальных условиях смогли решить все эти проблемы. Главное – не вводить себя в заблуждение, не думать, что это будет легко. Я перечислил только некоторые вызовы, только некоторые проблемы, которые надо решить. Я уверен, что мои коллеги будут говорить о других проблемах. Без осознания того, насколько большая у нас повестка дня, насколько много изменений, реформ нужно сделать, конечно, никакого устойчивого экономического роста мы не добьемся.



В.А. Мау

Российская академия народного хозяйства и государственной службы при Президенте РФ

# РИСКИ И ВЫЗОВЫ СОЦИАЛЬНО- ЭКОНОМИЧЕСКОГО РАЗВИТИЯ СТРАНЫ

Стенограмма выступления

---

Современная повестка политики вообще и экономической в особенности является, по моему мнению, предметом достаточно широкого консенсуса в экспертном сообществе. Однако особенно важно выявить и четко сформулировать риски и вызовы, которые представляются на сегодня критически значительными для социально-экономического развития страны. И на этой основе можно назвать некоторые принципиальные направления, по которым надо двигаться. Подчеркну, ключевые вызовы являются сегодня не экономическими, а социальными, демографическими и политическими.

На первое место я бы поставил вопрос о перспективах экономического роста при снижающейся численности населения страны. Исключительно интересный для экономиста вопрос, поскольку экономическая история не знает феноменов устойчивого экономического роста при снижении численности населения. Хотя из того, что этого не было в экономической истории, не следует, что этого не может быть в принципе. Встает вопрос о механизмах, о том, что мы должны сделать – найти механизм экономического роста при снижении численности населения или найти способы роста численности населения, чтобы поддержать экономический рост? Этот вопрос при всей его банальности не тривиален, он требует теоретического и практического ответа.

Еще один критически важный вопрос, который я бы тоже поставил на первое место, – это «*exit strategy*» – бегство элиты из страны. Бегство прямое и бегство через поколение, через обучение детей за границей, очевидная стратегия отъезда и невозврата. Причем мы должны понимать, что в отличие от 25-летней давности, которую большинство из нас застало, мы живем в условиях, когда изменить страну проживания легче, чем изменить страну, в которой ты живешь – трансакционные издержки отъезда гораздо ниже, чем издержки по преобразованию страны. Это очень серьезный вызов, с которым мы тоже не знаем, как справиться, который тоже должен быть на повестке обсуждения. Кстати, отток капитала, о котором мы много говорим, во многом связан с этим.

Это не бегство капитала 1990-х годов, когда переводили за границу миллиарды долларов. Если посмотреть, какой капитал утекал за последний год, то это небольшие порции в несколько миллионов долларов, в значительной мере из регионов. Это совершенно другой феномен, это политика, становящаяся макроэкономикой.

Третий фактор, на который я бы обратил внимание, – это быстро размывающаяся конкурентная ниша России на глобальном рынке товаров. Вообще одна из проблем, которую мы должны пересмотреть в нашей экономической политике, – это уход от стереотипа экономической политики, сложившейся на волне кризиса 1998 г. и его преодоления. В частности, мы в течение последних десяти лет были справедливо убеждены в том, что сдерживание укрепления курса рубля стимулирует импортозамещение. События последних лет показывают, что курсовой политикой можно стимулировать импортозамещение при паритетах покупательной способности в 20–30%. Когда курс национальной валюты достигает 50–60% паритета, возникает дилемма – или уронить курс в разы, что невозможно по социальным и политическим соображениям, или понять, что больше курсовой политикой вы не можете стимулировать спрос. Это требует очень существенного пересмотра экономической модели, перехода (пользуясь терминологией 1970–1980-х годов) от экономики спроса к экономике предложения, того перехода, который реально произошел с переходом от кейнсианства к рейганомике. А это представляет собой существенно другую модель. Мы живем не в мире, как он сложился после 1998 г. Мир и с глобальным кризисом, и с ростом российской экономики существенно изменился. Отсюда размывается конкурентная ниша России. Как становится известно, бедные страны производят товары для бедных, богатые страны – для богатых. Товары для бедных производятся в Китае, Индии и Средней Азии, товары для богатых – в Великобритании, Франции, Германии. Это значит, что возникает очень серьезный вопрос: где конкурентна Россия помимо ТЭК? Наверное, в секторе услуг. Но есть ли это конкурентная ниша? Или Россия становится своеобразной постиндустриальной страной с абсолютным доминированием сектора услуг? Это тоже вопрос, на который предстоит ответить.

Четвертый комплекс вопросов тоже понятен – это коррупция. Здесь есть два обстоятельства, на которые обычно не обращают внимание. Во-первых, в наших условиях коррупция становится фактором негативного отбора, аналогичного неуплате налогов в 1990-е годы. Что представляла собой проблема уплаты или неуплаты налогов в 1990-е годы? Это была серьезная институциональная ловушка. Если говорить на марксистском языке, общественно необходимые, т.е. конкурентные, издержки формировались теми, кто не платит на-

логи. Таким образом, неуплата налога была не источником дополнительной прибыли, а необходимым условием существования бизнеса. В аналогичную ловушку мы попадаем сейчас с коррупцией, когда вовлеченность в коррупционные схемы не есть возможность получить дополнительную льготу, а условие существования бизнеса, и это существенно трансформирует и микроэкономику, и политэкономию. Отсюда эти выводы: если снижаются налоги, то куда идет рента.

Следующий вопрос – зависимость от внешнеэкономической конъюнктуры, от факторов, которые находятся вне контроля российского правительства и российского общества. В этом смысле тот переход, который мы сделали от экономики, основанной на идеологии резервного фонда, к экономике расходования доходов от благоприятной экспортной конъюнктуры, очень опасен. Если посмотреть на график цены на нефть в постоянных ценах, то сейчас они находятся на том же уровне, на каком они были в 1979–1980 гг. Последующая история понятна: никто не может строить политику исходя из того, что в отличие от начала 1980-х гг. на этот раз повезет и цены не пойдут вниз. Это очень ненадежно. Отсюда возникают риски бюджетного кризиса. Бюджетный кризис при высоких ценах на нефть – это то, что мы знаем, это то, что мы проходили, это является очень серьезным фактором риска.

Наконец, последний риск, он скорее послекризисный, но для нас он и после кризиса 2008 г., и после системного кризиса предыдущих 15–20 лет, – это проблема большого государства. Проблема большого государства – государства, которое претендует на то, что оно может все решить, оборотной стороной этой проблемы является трансляция на большие компании. Это проблема, которая по-английски называется «*moral hazard*», которую по-русски можно назвать проблемой приватизации прибыли и национализации убытков. Уроки кризиса пока негативны, они показывают, что большими и с долгами быть лучше, чем маленькими и эффективными. Лучше и по политическим, и по экономическим причинам. Как говорится, продолжая известную фразу Кейнса, что если ты должен 1000 фунтов банку и ты не можешь заплатить, это твоя проблема, если ты должен миллион фунтов банку, это проблема банка. Этот кризис показал, что если ты должен миллиард долларов банку и не можешь заплатить, это проблема вашего правительства. Это серьезный искажающий фактор и для макро-, и для микроэкономической политики.

Несколько пунктов позитивной повестки, которые вытекают из того, о чем я сказал. Суть состоит в переходе от экономики спроса, прежде всего бюджетного спроса, к экономике предложения.

Прежде всего, вопрос о принципах государственной бюджетной политики. Ускоренная модернизация предполагает снижение, а не рост бюджетной на-

грузки к ВВП. Наши аргументы в пользу роста бюджетной нагрузки основаны, во всяком случае в экономической теории, на работах А. Гершенкродова о том, что страны, проводившие ускоренную индустриализацию, имели более высокую нагрузку бюджета расширенного правительства к ВВП, чем страны-пионеры. В то же время опыт большинства стран, которые успешно решали задачи догоняющего развития в постиндустриальном мире (их немного, но они есть), говорит о том, что, как правило, это страны с гораздо более низкой нагрузкой, чем самые развитые. Это естественно в условиях крайней непредсказуемости технологических, политических и иных тенденций. В этом смысле, если переходить на инструментальный уровень, нам необходимо восстановление профицитного бюджета, введение понятия структурного бюджетного дефицита, т.е. дефицита при средних многолетних ценах на нефть, а вовсе не дефицита при тех ценах на нефть, которые складываются на рынке сейчас.

Валютная политика должна быть благоприятной для инвестиционного процесса. Надо понять, что сдерживание курса рубля не играет той роли, которую оно играло десять лет назад, и что высокая инфляция, которая является следствием политики сдерживания курса рубля, гораздо более вредна для экономики с точки зрения процентных ставок, с точки зрения инвестиционного климата, чем это казалось еще пять лет назад. В этом смысле подавление инфляции в рамках политического цикла до 3–5% представляется критически важным, с поправкой, разумеется, на то, что будет в других странах мира. В данном случае, если вы посмотрите историю подавления инфляции в США между 1980 и 1984 гг., вы увидите, как это укладывается даже в четырехлетний политический цикл.

Важна глубокая структурная трансформация отраслей человеческого капитала, прежде всего пенсионной системы и здравоохранения. Мы продолжаем дискутировать об этих отраслях в терминах индустриального общества. Мы продолжаем обсуждать пенсию как необходимость заплатить человеку, отстоявшему у станка с какого-то возраста, и здравоохранение для человека, который лечится, когда заболел. В нашем обществе, к счастью, нет уголовного наказания за тунеядство, человек может сам решать, когда ему работать, когда не работать, в этом смысле не забота государства указывать конкретно пенсионный возраст и когда человеку лечиться. То есть структура нашего спроса на пенсионное обеспечение и здравоохранение существенно отличается от структуры традиционных индустриальных обществ, не говоря уже о том, что нынешние пенсионные модели были построены для общества, в котором средняя продолжительность существенно ниже пенсионного возраста, а вовсе не для общества, в котором пенсионный возраст существенно ниже средней продолжительности жизни. Это не проб-

лема в чистом виде бюджетного кризиса, потому что если считать до 2020 г. и не держаться за коэффициент замещения на уровне 37%, как сейчас, то бюджет мы более или менее вменяемо проходим. Мы должны понимать, что проблема пенсионная не есть проблема фискальная, это не проблема, где взять деньги, а проблема, как организовать пенсионное обеспечение в обществе, гораздо более индивидуальном, а не коллективном, как оно было раньше. Вообще, если не говорить об этом долго, реформа отраслей социальной сферы должна основываться на понимании того, что и здравоохранение, и образование, и пенсионное обеспечение становятся более индивидуальными, более полагающимися на частные, а не только на государственные деньги, глобальными (в смысле возможности выбора врача, университета, отчасти и пенсии в развитом мире) и непрерывными. И лечение, и образование, и даже (потенциально) пенсионное обеспечение могут быть непрерывными.

Среди других принципов, конечно, нужно сказать об открытости экономики и необходимости поставить анализ проблем Таможенного союза и ВТО в контексте дальнейших шагов по направлению к ОЭСР и политически ставить вопрос о едином экономическом пространстве с ЕС. Это дает очень важную, очень внятную не только макроэкономическую, но, прежде всего, институциональную перспективу развития страны.

Особо следует обсудить реформы политические и правоприменительные, нацеленные на защиту прав собственности, развитие конкуренции и т.д. Мы уже несколько лет живем в условиях, которые я бы назвал падающей предельной производительностью экономического законодательства, т.е. когда каждое новое улучшение экономического законодательства становится все менее осмысленным в условиях данной правоприменительной практики. В моем понимании это и было бы реальным переходом от экономики спроса к экономике предложения.

# СЦЕНАРИИ И АЛЬТЕРНАТИВЫ МАКРОЭКОНОМИЧЕСКОЙ ПОЛИТИКИ

Стенограмма выступления

---

Наверное, это последний год, когда можно поговорить о кризисе. Все выступавшие сказали, что кризис позади, кризис прошел, и мировая, и российская экономики успешно восстанавливаются. Несомненно, острая фаза кризиса давно прошла, но практически во всех странах возникли новые проблемы, в какой-то мере они даже более сложные и более тяжелые, чем были ранее. Тем не менее резкое падение мировой экономики, которое вызвало потрясения в политических структурах, действительно, осталось позади. И в этой ситуации очень важно сделать правильные выводы, извлечь уроки из всего случившегося. Ведь для хорошего ученика получение двойки за контрольную работу – это повод разобраться в том, что ты сделал не так, в том, что ты не понял. Мне кажется, что сейчас правительства всех развитых стран активно этим занимаются – и в Англии, и в Америке, и во Франции, и т.д. В ОЭСР, МВФ и Мировом банке активно обсуждают, что же произошло, почему произошло, какие меры надо принять, чтобы не допустить повторения событий, которые потрясли весь мир два с половиной года назад. Выпускаются законы и доклады. Принимаются специальные требования к Федеральной резервной системе, которая впервые в своей истории раскрывает информацию о тех банках, которые получили кредиты. Все понимают, что надо разобраться в том, что произошло. Поэтому очень важно сделать то же самое и для России. Сегодня для этого есть последняя возможность, потому что в следующем году мы будем говорить о новом политическом цикле, о новом правительстве, о новых ожиданиях.

Россия упала в мировом кризисе сильнее всех из стран «двадцатки», в Европе сильнее нас упали только Украина и Латвия. Глубина кризиса, в которую провалилась российская экономика, была обусловлена сочетанием многих внешних, внутренних факторов, объективных, субъективных. Бессмысленно валить всю ответственность на внешние обстоятельства. Да, цена на нефть – очень важный фактор, но нужно привыкать, что она волатильна; нужно создавать компенсирующие механизмы. Но были ошибки субъективные, были ошибки, кото-

рые делали российские власти. Мне кажется, что эти ошибки обошлись очень дорого, они внесли существенный вклад в падение экономики, о них нельзя молчать и их нужно анализировать.

В первую очередь это несбалансированная макроэкономическая политика, которая вылилась в перегрев экономики. Не секрет, что высокие темпы роста, которые наблюдались в последние годы перед кризисом, концентрировались в неторгуемых секторах. Товарная инфляция была высокой, цены активов и недвижимости росли еще быстрее, фондовый рынок бил все рекорды. И, собственно говоря, власти смотрели на это сквозь пальцы. Правительству нравились высокие темпы роста, и оно отказывалось обсуждать какие-либо проблемы, говоря, что никакого перегрева в экономике нет. В значительной мере перегрев экономики финансировался внешним корпоративным долгом. Россия в 1998 г. столкнулась с кризисом государственного внешнего долга, в 2008 г. российская экономика столкнулась с кризисом корпоративного внешнего долга. Это явление для мировой экономики не новое, многие страны с этим сталкивались в последние тридцать-сорок лет. И сегодня нужно понимать, глядя, как российские компании вновь пытаются вырваться на рынок внешних заимствований, что этот урок, похоже, не выучен, что у нас есть все шансы еще раз попасть в ту же самую яму.

Самая тяжелая проблема, проявившаяся в период кризиса, это провалы банковского надзора. Спасение российской банковской системы (неважно, плохих банков, хороших банков) обошлось нашей экономике очень дорого, собственно говоря, на это ушли основные ресурсы, потраченные государством в период кризиса. Россия оказалась единственной страной с развивающейся экономикой среди стран-членов «двадцатки», которая спасала свою банковскую систему. Этим не занимались ни Китай, ни Бразилия, ни Аргентина, ни Индия, это делала только Россия. На поддержку ликвидности российской банковской системы было выделено почти 11,5% ВВП, в принципе величина, сопоставимая с тем, что выделялось в таких странах, как США, Великобритания, Германия, Швейцария. Поддержка ликвидности, наверное, необходима, с этим спорить тяжело, потому что когда банковская система сталкивается с оттоком капитала, который измеряется 8–10% ВВП в течение квартала, центральные банки обязаны на нее реагировать. Но гораздо опаснее выглядит тот факт, что на рекапитализацию банковской системы и спасение банков-банкротов Россия потратила почти 5,5% ВВП, это примерно в 2 раза больше, чем в среднем развитые страны-члены группы «двадцатки». Столько денег на спасение банковской системы, сколько выделяла Россия, не выделяла практически ни одна страна. Финансовый сектор в России производит примерно 4% ВВП. Вот считайте, что в те-

ние кризиса государство рефинансировало всю банковскую систему, ей дали столько, сколько она производит в течение года. В этом, наверное, залог ее успеха после кризиса – банковская система зарабатывает огромные прибыли в этом году и в прошлом году.

В России был реализован достаточно большой пакет фискального стимулирования, который оказался в 1,5 раза выше, чем в среднем в странах «двадцатки». Для развитых стран было 3,5% ВВП, для развивающихся – 3,8%. Россия по масштабам бюджетной поддержки сопоставима с Китаем и Южной Африкой, правда, заметно уступает Южной Корее и Саудовской Аравии. При всем при этом наш пакет фискального стимулирования был очень своеобразным, очень концентрированным. Анализ его структуры показал, что из совокупной величины пакета фискального стимулирования объемом 2,1 трлн руб. примерно четверть напрямую получили нефтяники (500 млрд руб.). Главным образом, это было снижение налогов для нефтяного сектора, который, видимо, по мнению российских властей, в наибольшей степени пострадал в период кризиса. При этом нефтяная промышленность даже в самые тяжелые кризисные месяцы не снижала объемов производства. В то время как страны-члены ОПЕК снижали поставки нефти, снижали добычу нефти, Россия наращивала экспорт нефти. И вот этому сектору была предоставлена основная помощь, причем немедленно, осенью 2008 г.

Второй момент, на который хочется обратить внимание, это так называемые антикризисные расходы бюджета 2009 г., общая величина которых составила 1,2 трлн руб. Почему-то считается, что именно на эту сумму были реализованы дополнительные расходы бюджета. Это неправда, это очередной миф. Для того чтобы сформировать антикризисный пакет в бюджете 2009 г., который был утвержден Думой в октябре 2008 г., на 545 млрд были сокращены инвестиции. Вообще смысл фискального стимулирования состоит либо в снижении налогов, либо в повышении бюджетных расходов с тем, чтобы замещать выпадающий частный спрос. Так вот, в России во время кризиса, для того чтобы профинансировать практически половину программы фискального стимулирования, государство сократило инвестиции, но при этом не было перераспределения средств из одного инвестпроекта в другой. За счет сокращения инвестиций правительство реализовывало программы поддержки предприятий, запутавшихся в долгах, реализовывало программу предоставления им бюджетных гарантий. В результате, по нашим оценкам, непосредственно новый государственный спрос в антикризисном бюджетном пакете составил 190 млрд руб. То есть из бюджета 2009 г. вычеркнули расходы на 545 млрд руб., из которых на аналогичные цели пошло только 190 млрд руб. А основную часть, примерно



четверть фискального пакета, сопоставимую с тем, что получили нефтяники, из бюджета получил опять-таки финансовый сектор. Эти два сектора съели половину фискального пакета.

Несомненно, восстановление экономики могло бы быть гораздо более интенсивным, более быстрым, если бы государство по-другому тратило свои ресурсы или хотя бы просто снижало налоги для всей экономики. Цена кризиса для России оказалась очень большой. Падение экономики было чрезвычайно интенсивным: в IV квартале 2008 г. российская экономика падала со скоростью 15% годовых, в I квартале 2009 г. – 20% годовых. Темпы падения были действительно катастрофическими. На графике показано, как могла бы развиваться российская экономика, если бы ее тренд – 6% в год, что ниже, чем докризисные 8% – продолжался. Видно, что разрыв между сегодняшним фактическим и таким квазипотенциальным уровнем составляет более трех лет. Это и есть цена кризиса для России – потерянные три года.

Сегодня российская экономика находится на уровне конца 2007 г. – начала 2008 г., и пока нельзя сказать, что она уверенно восстанавливается. Росстат сообщил о четырехпроцентном росте в прошлом году, но, во-первых, это был рост от точки максимального падения, и, во-вторых, странный подъем вверх произошел в IV квартале 2010 г. Если верить Росстату, то получается, что российская экономика, простояв на одном уровне II и III кварталы 2010 г., в IV квартале совершила неимоверный рывок со скоростью более 11% годовых. Так быстро она росла один только раз – в IV квартале 2007 г. Я верю в экономические чудеса, но в такие чудеса, когда посткризисный рост концентрируется в пределах одного квартала, поверить тяжело. Похоже, что мотор российской экономики сломался, и пока он далек от восстановления. Ясно, что на докризисный максимум середины 2008 г. Россия выйдет к концу этого года или к началу следующего, 3–3,5 года российская экономика потеряла.

Переходя к разговору о перспективах восстановления быстрого экономического роста в России, следует ответить на вопрос: а можно ли говорить о том, что до кризиса в российской экономике существовала очевидная модель роста, что все докризисное десятилетие существовал единый мотор экономического роста? Действительно, период с 1999 по 2008 гг. можно назвать экономическим чудом – российская экономика росла в среднем со скоростью чуть меньше 7% в год, что, в принципе, является замечательным результатом. Рост с такой скоростью означает, что экономика удваивается в объеме за десять лет. Но, по моему мнению, в эти десять-одиннадцать лет драйверы роста были разные, они заставляют поделить этот период на три различающихся между собой отрезка.

Период 1999–2001 гг. – это трансформационный рост после структурных реформ начала 1990-х годов, который был подкреплен дешевым рублем в результате девальвации 1998 г. Соответственно, в это время рост материализовался в секторах, ориентированных на спрос населения, в импортозамещении; вообще, обрабатывающая промышленность была двигателем роста, давая примерно половину прироста ВВП в этот период. Понятно, что трансформационный рост не закончился ни в 2001 г., ни в 2011 г., он будет продолжаться еще длительное время. Трансформационный рост – это вечное понятие, потому что сфера услуг в России будет бурно развиваться. Да и структура экономики во всем мире меняется, соответственно, она будет меняться и в России. Тем не менее значимые эффекты этой фазы роста за пределами 2001 г. обнаружить уже очень тяжело.

На смену этому пришел очень благоприятный для российской экономики период 2000–2005 гг., который мы назвали «плоды приватизации». В этот момент частные инвесторы, которые получили российские активы в середине 1990-х годов, поняли, что даже самые тяжелые экономические потрясения и неоднократные смены правительства не приводят к политическим катаклизмам, не приводят к смене собственности, не приводят к переделу собственности. И с 2000 г. начался бурный рост в сырьевых отраслях, что неудивительно, потому что именно там легче было зарабатывать прибыль. Именно там сконцентрировались наиболее энергичные, предприимчивые, сильные предприниматели, трансформировавшиеся в эффективных собственников, которых искали все 1990-е годы. Хотя нельзя недоучитывать влияние начавшегося с 2001 г. подъема мировых цен на нефть и вслед за этим цен на металлы, результаты деятельности сырьевых секторов в этот период впечатляют. Производство нефти за эти пять лет увеличилось на 50% в физическом выражении. При этом что добыча газа, где доминирующей компанией в этот период был государственный «Газпром», выросла на 10%. Производство металлов – черных и цветных – в этот период времени практически по всем направлениям выросло на 25–30% в физическом выражении. Рост экономики не ограничивался, конечно, сырьевыми отраслями, потому что они генерировали спрос на продукцию других отраслей, в том числе на машиностроение, которое неплохо развивалось в этот период времени. Все закончилось, как известно, с делом ЮКОСа. Инвестиционные циклы в отраслях более длинные, и те инвестиционные проекты, которые начинались в 2003 г., заканчивались в 2004–2005 гг. Но уже с 2005 г. сырьевика перестали быть той силой, которая тянула экономику вперед.

На смену этой фазе роста пришла новая. Дорогая нефть, укрепление российского бюджета, расплата по внешнему долгу привели к тому, что Россия

резко повысила свой кредитный рейтинг, российским банкам и компаниям стали охотно давать займы. На 1 января 2005 г. корпоративный внешний долг составлял 100 млрд долл., на 1 июля 2008 г. он превысил 500 млрд долл. Это были не прямые инвестиции, а, в основном, кредиты и портфельные инвестиции. В этой ситуации экономический рост не мог не проявиться, потому что существенная часть денег шла на финансирование жилищного сектора, на финансирование потребительского кредитования, на развитие сетевых структур как в торговле, так и в сфере обслуживания. Однако из мировой истории хорошо известно, чем такие бумы заканчиваются, хотя кризисы всегда случаются неожиданно. В какой-то момент рынки перестают верить экономике, перестают давать ей деньги займы, и экономика рушится, потому что ей нужно срочно расплачиваться по ранее взятым обязательствам. То же самое произошло и в России осенью 2008 г.

Можно ли сегодня всерьез надеяться на какой-то из этих трех драйверов в грядущую десятилетку? Думается, что нет. Похоже, все эти факторы роста, которые работали на протяжении тучных лет, исчезли. Нужно искать новые, которые смогут обеспечить темпы роста, как минимум, не ниже, чем у мировой экономики в целом (порядка 5% в год) или смириться с нынешним положением дел. Насколько велика разница? Для ответа на этот вопрос были прорисованы два сценария. Первый получил название «Бег на месте», второй – «Прыжок тигра».

Что такое «Бег на месте»? Это сохранение нынешних «правил игры» – имитация улучшений в экономической политике, имитация активной законодательской деятельности, забота первых лиц государства об инвестиционном климате, за которым ничего не происходит, при этом сохранение и, может быть, даже рост бюрократической ренты, которая ведет к падению эффективности бизнеса и усилению оттока капитала. Собственно говоря, все это отчетливо наблюдается с середины 2010 г. В этой ситуации государство, чтобы показать свою эффективность, будет реализовывать приоритетные проекты, которые привлекают общественное внимание – это и Сочи, и чемпионат мира по футболу. Для того чтобы их профинансировать и одновременно повысить оборонные расходы и удержать макроэкономическую стабильность, предлагается сокращать расходы, связанные с будущим страны. Сокращать расходы на инвестиции в образование, на инвестиции в здравоохранение, на науку. Никакие социальные и экономические последствия такой политики не проявятся ни через год, ни через два. Но через пять лет мы увидим, что качество российского образования упало еще сильнее, что здравоохранение будет непрерывное, но только платное: если у вас есть деньги, то вы будете их непрерывно тратить на

эти цели. Государственное здравоохранение будет разрушаться, потому что в него не будут вкладывать деньги.

Что такое «Прыжок тигра»? Это в первую очередь быстрое и резкое снижение инфляции, об этом сегодня много говорилось, но, боюсь, российское правительство все-таки ставит недостаточно амбициозные цели. В современной российской экономике цель достижения трехпроцентной инфляции, что считается нормальным в мире, вполне реальна. Да, при этом нужно отказаться от индексирования тарифов на газ и электроэнергию с тем, чтобы финансовое положение «Газпрома» не улучшалось каждый год только за счет повышения внутренних цен на газ. Да, на это надо идти, потому что только этим мы можем заставить «Газпром» повышать свою эффективность, а энергетические компании – снижать издержки. России для прыжка вперед нужны сильные институты, отказ от коррупции, открытие экономики, рост конкуренции – обо всем этом много говорилось. Что еще важно? Российское население привыкло, что с ростом нефтяных цен потребление растет. Это приводит к тому, что производительность труда в России растет медленнее, чем рост реальных доходов населения, чем рост реальной заработной платы. Страна в очередной раз продает нефтяные доходы, а политика развития не может опираться на такую парадигму. России нужно существенно повышать объем инвестиций. В мире было не очень много примеров стран, которые на протяжении поколения (это примерно 25 лет) росли со скоростью 7% и выше. Таких случаев было 13. Соответствующий анализ успехов этих стран проведен усилиями Всемирного банка и специальной группы международных экспертов. Выяснилось, в частности, что ни в одной из этих стран уровень инвестиций не был ниже 25% ВВП. Вообще говоря, у большинства было 30% и выше. Россия инвестирует 21% ВВП, что не оставляет возможности для быстрого роста. Чем этот разрыв можно закрыть? Вряд ли возможно потребовать существенных жертв от населения – давайте потреблять меньше, не 50% ВВП, а 40%. Пожалуй, невозможно на треть сократить бюджетные расходы. Единственным спасением для России является приток прямых иностранных инвестиций.

Что может стать критерием перехода российской экономики к такому сценарию? Думается, что рост несырьевого экспорта может быть ключевым индикатором для оценки успешности российской модернизации. Сегодня несырьевой экспорт составляет 15% от общей суммы российского экспорта. Если на протяжении 20 лет несырьевой экспорт будет расти на 25% в год каждый год, то к 2030 г. заметно снизится зависимость российской экономики от сырьевых рынков и повысится устойчивость платежного баланса. Вот как это выглядит.

Экономике нужно время на разгон, и через 6–7 лет темпы роста начинают ускоряться. Доля несырьевого экспорта начинает расти, и через 20 лет достигает практически половины, чуть меньше, 45%. Сальдо счета текущих операций без учета топлива и сырья выходит с уровня минус 22% ВВП на приличные минус 10%, что говорит о резком повышении устойчивости платежного баланса. Доля нефтегазовых доходов в доходах федерального бюджета снижается с нынешних 44 до 22%, т.е. примерно вдвое. Это и есть тот самый «Прыжок тигра», на который мы можем рассчитывать.

Казалось бы, 25% ежегодного роста – это очень много. Да, но в последние пять лет российский несырьевой экспорт рос со скоростью 15%. В принципе, нужно чуть-чуть добавить – чуть-чуть инвестиций, чуть-чуть новых технологий, чуть-чуть менеджерских кадров. Куда? В какие сектора? Где будет концентрироваться рост и на каких предприятиях? Думается, этим вопросом точно не надо заботиться. Бизнес сам решит, где ему будет выгодно расти. В современном мире угроза закрытия конкурентной ниши для российской экономики, которая с трудом составляет 2,5% мирового ВВП, – это мифическая угроза. Если российскому бизнесу дать свободу, если с него снять бюрократическую нагрузку, снять коррупционную нагрузку и улучшить инвестиционный климат, то он сам найдет, что производить, как производить, куда и кому продавать.

Сегодня очень много говорилось о модернизации или даже о воссоздании институтов. И, действительно, ключевым фактором для перехода к «Прыжку тигра» является изменение институтов, изменение инвестиционного климата. В рамках нашей работы мы попытались оценить, сколько стоят России плохие институты. Для этого была взята база данных IMD по 51 стране, которая содержит оценки качества институтов, и стандартный набор макроэкономических показателей, характеризующих экономический рост в 2000–2009 гг. В результате получилась устойчивая и ярко выраженная зависимость с линейной регрессией. Хотя мы и столкнулись с хорошо известным парадоксом: хорошие институты обычно существуют в странах с более высоким уровнем развития, а страны с более высоким уровнем развития обладают менее высокими темпами роста, мы компенсировали его влияние через учет фактора заработной платы.

Наши оценки показывают, что на каждый пункт (а всего их десять) повышения индекса качества институтов примерно на 0,5% ускоряется темп роста. Кроме того, были построены две альтернативные модели экономического роста, которые учитывали влияние как уровня развития институтов, так и динамики изменения качества институтов на динамику ВВП. Модель, которая оценивала качество институтов, дает схожую оценку – 0,3% на каждый пункт изменения

индекса качества институтов. Модель, которая оценивала динамику изменений, дала более противоречивые результаты. С одной стороны, прямая зависимость составляет 1,1, но при этом наблюдается очень высокая волатильность у разных стран и на разных временных промежутках.

Мы считаем, что полученные нами результаты позволяют уверенно говорить о том, что высокое качество институтов ведет в долгосрочной перспективе к более высоким темпам роста. А улучшение институтов, особенно если оно достигается резко, может дать взрывной эффект на коротком интервале времени.

Остается совсем маленький вопрос: как этого можно добиться? Здесь я хочу вступить в полемику с Сергеем Гуриевым, выступавшим ранее. Он сконцентрировался на различных аспектах экономической политики. Мне же кажется, что на сегодня у России в экономической политике нет вопросов, на которые еще не даны ответы. Если собрать экспертов, которые работают в известной 21 группе, в ИНСОРе или где-то еще, и спросить, что нужно делать в экономике, то разброс мнений будет не очень велик. Могут быть различия в нюансах, в налоговых ставках, в пенсионном возрасте – нужно/не нужно, повышать/не повышать. Но в конечном итоге обо всем этом сегодня можно достаточно быстро договориться. Проблема в том, что сегодня в России все основные проблемы носят политический характер. Это и борьба с коррупцией, и независимость суда, и произвол бюрократии. Это иллюзия, что у страны есть время подождать с выбором. Сергей Гуриев назвал нынешние дни благоприятным периодом, сказав, что у нас есть время на постепенные, неспешные реформы, пока нефтяные цены высокие. Я же убежден, что времени уже нет. Россия с каждым днем отстает все больше и больше от других стран. Все индексы конкурентоспособности и прочие – они относительные. Даже если в России что-то меняется к лучшему, но медленнее, чем в других странах, это означает, что Россия проигрывает в конкурентной гонке, теряет свое место в мировой экономике. Если мировая экономика растет на 5%, а Россия будет расти на 4% в год, то это означает, что доля российской экономики в мире будет снижаться. Конечно, хорошо быть большой страной с ядерными ракетами, но если ее экономическая доля составляет 2,5% ВВП, а через 10 лет она будет 2% ВВП, вряд ли это кого-то обрадует.

Повторюсь, и вопросы борьбы с коррупцией, и вопросы верховенства права и равенства всех перед законом, и создания работоспособной бюрократии, и обеспечения равных условий конкуренции – все это политические вопросы, которые нужно решать сегодня. А для решения политических вопросов

нужна или очень сильная политическая воля руководства (многие согласны, что политическая воля проявляется, как правило, в периоды кризиса; тяжело рассчитывать на то, что она проявится ни с того ни с сего, когда экономика внешне находится в хорошем состоянии), или нужна политическая конкуренция, которой в России сегодня нет, и пока на этом поле никаких изменений не предвидится.

Если нет ни того, ни другого, то при всем сегодняшнем благополучии российская экономика может оказаться в печальном состоянии уже к тому самому магическому 2020 г., о котором мы сегодня рассуждаем.





**КАЧЕСТВО И ОБРАЗ  
ЖИЗНИ: ИЗМЕНЕНИЕ  
ВО ВРЕМЕНИ  
И ПРОСТРАНСТВЕ**

---



Мы сегодня обсуждали варианты экономической политики на ближайшие 10 лет. Как нам представляется, одним из ключевых вызовов развития экономики России и других стран является образование. Значимость этого вызова нередко недооценивают. Вместе с тем широкая общественность привыкла к таким заклинаниям, как «образование – это самое главное», «образование – это то, что нам нужно». Я попробую посмотреть на ситуацию с другой стороны: образование – это огромный вызов, который может породить огромные проблемы в экономике и обществе, и уже порождает их (наряду с этим оно, конечно, представляет собой и позитивный вызов).

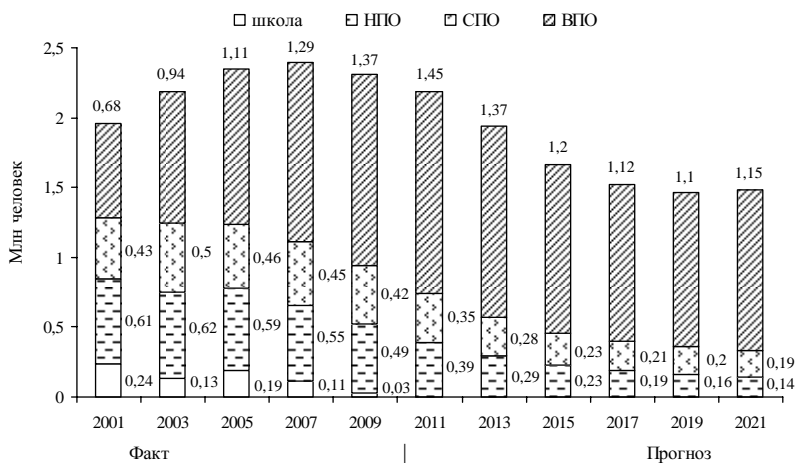
Традиционно экономисты рассматривают образование как отрасль, которая создает и общественные, и частные блага. При этом, чем ближе мы к школе, к тому, что называется *junior college*, тем больше значение общественного блага. В школе закладываются базовые навыки общения людей друг с другом, и все заинтересованы в том, чтобы встречающиеся на улице люди могли коммуницировать, не представляли друг для друга опасности.

Профессиональное образование, наоборот, считается в экономической теории доменом частного блага, поскольку оно формирует человеческий капитал – способность человека зарабатывать определенными профессиональными компетенциями. Именно с профобразованием увязывается так называемая образовательная премия (разница в заработках человека с высшим образованием и не получившего этого образования), которая служит измерителем человеческого капитала.

В России система образования имеет серьезнейшую структурную проблему. Наша школа слишком короткая для того, чтобы создать общественное благо, дать общее образование. Обучение длится всего 11 лет: мы поздно начинаем и очень рано заканчиваем. Российские дети выходят из школы в 17, а иногда и в 16 лет. Если мы посмотрим на развитые страны, то там люди учатся еще

1 или 2 года, как минимум. То, что у нас процесс обучения в школе недолог, имеет определенные негативные последствия. В обществе востребовано продвинутое общее образование – информатика, иностранный язык, презентационные навыки, высшая математика, основы экономики и права – так называемые предметы социализации. Особенность российской системы, сложившаяся за последние 25 лет, заключается в том, что у нас люди получают эти элементы общего образования в рамках профобразования. Причем эти составляющие критически важны для социального успеха.

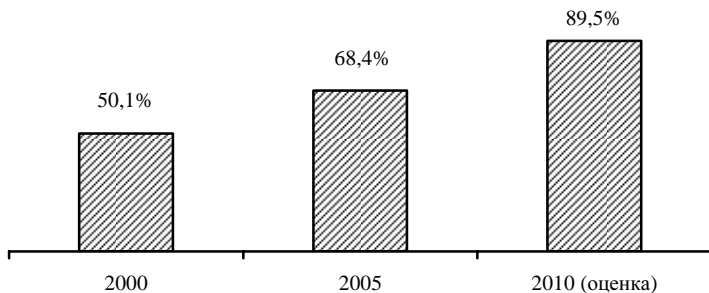
С начала 2000-х годов сильно изменилась структура потоков поступающих. В 2001 г. на рынок труда из вузов выходило 680 тыс. человек, почти столько же из системы начального профессионального образования, чуть меньше из техникумов – 430 тыс. человек. Эта картина достаточно близка к тому, что было в предыдущие годы. Но уже в 2009 г. произошли серьезные изменения. Резко уменьшился приток на рынок труда из системы НПО и практически удвоился приход людей из вузов.



**Рис. 1.** Выход выпускников образовательных учреждений на рынок труда, млн человек

Сегодня охват молодежи высшим образованием в стране настолько высок, что нам впору говорить о массовом или даже всеобщем высшем образовании. Доля зачисленных в вузы в возрастной когорте 17 лет сегодня составляет 86–87%. Еще 10 лет назад речь шла о 50%. Люди не обязательно сразу поступают в университеты: некоторые идут в техникумы, после чего сразу или через некоторое время перетекают в вузы. К тридцати годам все они выходят на рынок

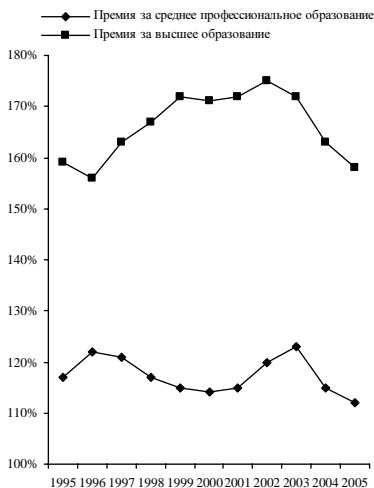
труда с высшим образованием. Это абсолютно невиданная ситуация для любой развитой страны.



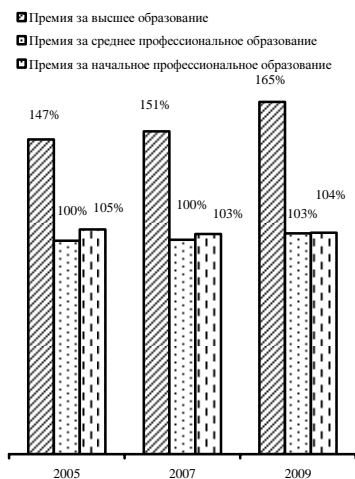
**Рис. 2.** Охват молодежи высшим образованием (отношение зачисленных в вузы к численности населения в возрасте 17 лет)

С одной стороны, столь ажиотажный спрос провоцируют сами выпускники школ и их родители. По нашим измерениям, которые проводил Фонд «Общественное мнение», 88% родителей выбирают высшее образование для своих детей. С другой стороны, российские работодатели предпочитают сотрудников с высшим образованием на любых должностях. Самое дикое, что даже при найме разнорабочего предпочтение будет отдано кандидату с вузовским дипломом.

Повышенный интерес к вузовскому диплому отчасти можно объяснить отдачей от высшего образования. В развитых странах премия за высшее образование составляет порядка 50–80%, в среднем 60–65%. В России в 1990-е годов и в начале 2000-х годов была относительно низкая премия за высшее образование. Это связано с тем, что значительная часть интеллигенции работала на предприятиях, которые не имели спроса, но продолжали существовать. За последние годы, когда завершился первый этап реструктуризации экономики, отдача от высшего образования быстро выросла. Теперь она находится на среднемировом уровне. На этом фоне премия за начальное и среднее профессиональное образование практически равна нулю. Если по данным РМЭЗ она колеблется в районе 10% (что в три раза меньше, чем в других странах), то по данным Росстата премия за НПО и СПО составляет всего 3–4%, т.е. на уровне статистической погрешности. Фактически выходит, что человек, который решает не получать высшего образования, избирает для себя тупиковую социальную траекторию.



По данным Российского мониторинга экономики и здоровья населения



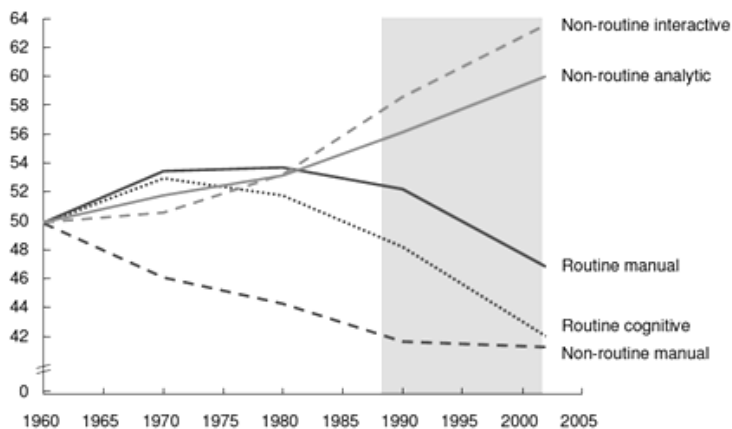
По данным Росстата

**Рис. 3.** Премиа за высшее образование (отношение заработной платы работников с профессиональным образованием соответствующего уровня к заработной плате работников со средним (общим) образованием в 1995–2009 гг.)

Мы попытались сделать прогноз, как будет выглядеть рынок труда через несколько лет, опираясь на тенденции, которые уже складываются в системе. По нашим расчетам, если мы не откроем все вентили для миграции, то 43% рынка труда к 2020 г. придется на людей с высшим образованием. Напомним, что еще недавно их доля составляла 25%. Понятно, что рынок не сможет так быстро создать большое количество рабочих мест для этих людей, и они будут иметь сложности с трудоустройством. Тем не менее массовое предпочтение высшего образования имеет рациональную основу.

В известном исследовании OECD «Skill profile of jobs» в разных видах работы измерили долю рутинных операций: ручных, умственных, креативных, аналитических, связанных с коммуникациями. Выяснилось, что доля нерутинных навыков за 45 лет в мире выросла на 15%, а рутинный сектор сократился примерно на 8–10%. В длинном цикле мы можем считать, что рутинные операции, чисто исполнительский труд вытесняются. Конечно, такого рода данные не позволяют нам утверждать, что в ближайшие 30–40 лет экономика любой развитой страны сможет обойтись без исполнителей как низкой, так и высокой

квалификации, связанных с рутинными операциями, но в среде экспертов широко обсуждаются последствия такого сценария для рынка труда. Это дефицит исполнителей.



**Рис. 4.** Рациональная основа «предпочтения высшего образования»: страны ОЭСР

Фактически Россия присоединилась к клубу образованных богатых стран, которые импортируют людей, работающих руками. Сегодня на 70 млн трудоспособного населения, включенного в рынок труда, по разным оценкам, у нас приходится от 6 до 8 млн временных или постоянных мигрантов. Подавляющее большинство из них как раз занимают места исполнителей с базовой квалификацией.

Но есть и другая проблема – дефицит квалификации исполнителей. Если образовательная премия за среднее профессиональное образование останется на текущем уровне (а это и есть производство квалифицированных исполнителей), то Россия будет вытесняться даже с собственного рынка, не говоря о перспективах выхода на другие рынки с нашей обрабатывающей промышленностью или с интенсивным сельским хозяйством. Невозможно силой мысли сделать конкурентоспособными наши предприятия – там нужно работать руками, иметь культуру труда и производственную дисциплину.

Вместе с тем мы имеем другой вызов – это вызов квалификации. По мнению работодателей, уровень подготовки выпускников вузов стремительно ухудшается. Значительная доля руководителей считает, что они могут взять человека после любого учебного заведения, но при условии, что серьезно вложатся в его

дополнительное обучение. Сами учащиеся отмечают низкую полезность знаний и навыков, полученных в учебных заведениях.



**Рис. 5.** Собираются ли студенты вузов работать по специальности?

Самая низкая полезность знаний и навыков отмечена у тех, кто работает в машиностроении, сельском хозяйстве, легкой и пищевой промышленности. Это базовые сектора советской экономики, которые у нас выжили.

Мы не только имеем избыток людей с высшим образованием, но и недостаток исполнителей. Рынок труда трудоизбыточен по отношению к работникам бюджетной сферы и к работникам предприятий на так называемом базовом контракте, к выпускникам вузов с общим высшим образованием, которые мало что умеют, но претендуют на чистую работу и достаточно высокий доход. Одновременно он трудонедостаточен по отношению к высококвалифицированным специалистам и работникам тяжелого физического и монотонного труда.

С конца 1970-х годов начал формироваться социальный стереотип, что карьера через техникум и ПТУ – удел низкосоциализированных, тех, кто плохо учился в школе. Это разительно отличается, например, от ситуации, с которой мы можем столкнуться в странах ЕС, где карьера высококвалифицированного



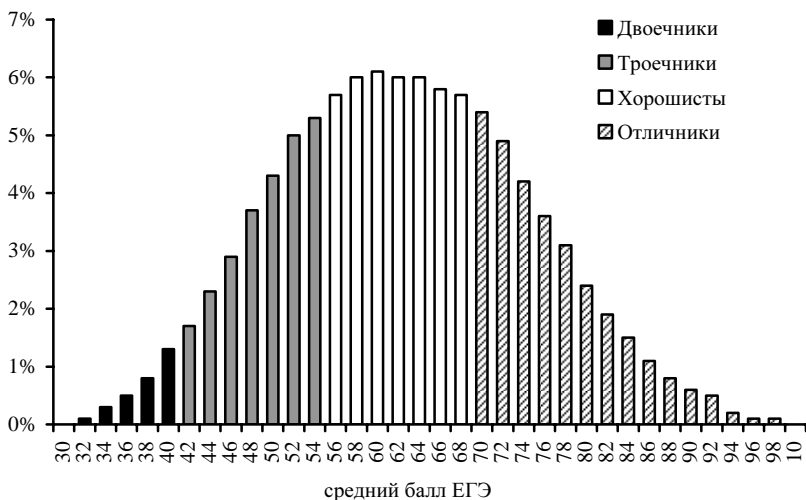
исполнителя обладает достаточно высоким социальным престижем, гарантирует высокий доход. В общем, нет особого социального разрыва между девушкой, которая выбрала университетское образование, и ее парнем, который стал авто-слесарем. В России эти люди просто относятся к разным социальным стратам, и это уже не только экономическая, но и социальная проблема.

Общество давно использует сложившуюся жесткую структуру вузов как механизм своей обязательной социализации. Люди востребуют высшее образование как благо, которое дает базовые социальные навыки и диплом. Исследование Ростислава Капелюшника и Владимира Гимпельсона показывает, что у нас до 20–30% людей с высшим образованием, например инженеров, работают на должностях, не требующих никакого высшего образования по определению. Это явный дауншифтинг. Но эти люди получают премию за факт наличия у них высшего образования: плюс 10–15% по сравнению с теми, кто такого образования не имеет. Я бы назвал это социальной премией, премией за социализацию. Такого рода ситуация, воспроизводясь, отвлекает огромные ресурсы из нашего образования и не дает возможности сосредоточить их на ключевых участках, где нам действительно необходимо обеспечить повышение качества образования.

В то же время значительная часть студентов не готова к освоению сложных профессиональных квалификаций в вузе. На основе данных, полученных в ходе мониторинга качества приема в высшие учебные заведения, мы можем судить об уровне подготовки поступающих на бюджетные места очной формы обучения. Примерно 40% первокурсников – это люди, которые по профильным предметам в школе имели два-три балла. Есть очень высокая вероятность того, что эти люди не смогут освоить необходимые профессиональные компетенции.

Зачислять людей с глубокой тройкой по физике и математике на места, где предстоит изучать высшую математику и сопромат – это очень высокий риск для общества. Последствия могут быть достаточно опасными. Фактически мы можем говорить о возникновении псевдообразования за счет бюджета в целом ряде российских вузов. Отличников – тех, кто набрал больше 70 баллов из 100 по ЕГЭ – совсем мало на металлургии, их нет вообще на авиа- и ракетостроении, на технологических машинах и оборудовании. Зато красная зона – получивших на ЕГЭ до 40 баллов – на тех же самых технологических машинах составляет 70%. Это серьезная проблема, к которой можно спокойно относиться, если мы заранее согласны, что эти люди, получив достаточные социальные навыки в вузе, пойдут работать секретарями в приемную или менеджерами торгового зала. Но это дорогое образование. В самое ближайшее время нам необхо-

димо предложить модели выхода из сложившейся ситуации, чтобы Россия сохранила конкурентоспособность в сфере образования.



**Рис. 6.** Уровень подготовки поступающих в вузы (на бюджетные места очной формы)

Еще одна проблема – это мигранты. Для них характерен низкий технический уровень производства и психология временного работника. У них, как правило, нет стимулов к инвестициям в себя и повышению квалификации. Таким образом, растущая часть рынка труда оказывается вне системы профессионального образования, вне системы целенаправленного воздействия общества. Используя дешевый труд мигрантов, мы остаемся на крайне низком, неконкурентоспособном уровне качества услуг и производства. Опыт показывает, если мы можем жить в домах и ездить по дорогам, которые построили мигранты, потому что у нас нет выбора, то мы не можем распространить такого же рода миграционную модель даже на производство одежды. Мы уже вытеснены с этого рынка.

Мы имеем дело с парадоксом структуры. Предприятиям нужны квалифицированные рабочие и другие исполнители: 60% предприятий, опрошенных Высшей школой экономики, заявили, что у них большой дефицит квалифицированных рабочих. 20% предприятий отметили нехватку инженеров, в то время как у нас огромное перепроизводство инженеров по отношению к тем, кто реально входит в экономику. Есть дефицит квалифицированных экономистов и юристов, что совсем уже дико: у нас экономисты и юристы составили практически половину выпуска системы высшего образования. Такого нет ни в одной

стране мира. При этом нет дефицита офисных исполнителей, работников с базовым общим образованием, тех, кого мы называем офисным планктоном.

Что мы предложили бы изменить? Первая дилемма – можно ли устранить псевдообразование или псевдовуз, сохранив при этом возможность высшего образования для каждого? Попытка резко сократить прием на программы высшего образования, на мой взгляд, России явно не подходит. У нас настолько сильна социальная потребность в получении высшего образования как обязательного элемента социализации человека, что никто из известных политических деятелей, оказавшись в кресле президента России, не смог бы решиться на такой шаг. Позиция невмешательства также неприемлема, потому что к 2020 г. это приведет к накоплению примерно 20% людей с высшим образованием, устойчиво не находящихся привлекающей их работы. Такой сценарий опасен и социально, и политически и очень затратен экономически.

На наш взгляд, наилучшее решение данной проблемы – прикладной бакалавриат. Это модель, которая существует практически во всех развитых странах, где есть большой спрос на высшее образование. Ее преимущество в том, что, отучившись два года в вузе, человек может выбрать, что его больше привлекает – конкретная прикладная карьера квалифицированного исполнителя или академическая траектория. Прикладной бакалавриат – это своего рода открытая модель, оставляющая возможность для каждого человека использовать тот социальный лифт, которым обязано быть образование. Обучившись прикладным квалификациям и выйдя на рынок труда прикладным бакалавром, человек в любой момент может возобновить обучение и снова встать на академическую траекторию.

С 2001 г. доля выпускников не высших образовательных учреждений на рынке труда стремительно сжимается. Это абсолютно иррационально для экономики. Если мы перейдем на модель прикладного бакалавриата, то сможем существенно исправить сложившуюся ситуацию. Да, проблема все равно будет довлеть над нашей экономикой: останется высокой доля людей, которые, невзирая ни на что, будут развиваться по траектории академического высшего образования, отрицая любую работу руками. Но это будет уже не 80, а 55%. С этой пропорцией экономика может справляться.

Исполнители базовой и средней квалификации сейчас составляют 35% рынка труда. По нашей оценке, их доля к 2020 г. сократится примерно до 25%, к 2030 г. – до 20%. Как минимум половина этой группы – временные работники-мигранты. Нам надо с этим смириться, потому что никаких вариантов – ни демографических, ни социальных, ни образовательных – у нас просто нет. Нам

необходимо организовывать предварительное обучение в странах происхождения трудовых мигрантов. Мы должны вкладываться в программы их обязательной социализации: курсы русского языка, основ российской культуры и правовых знаний.

Следующая страта – это квалифицированные исполнители. Это программисты, системные администраторы, бухгалтеры, продавцы-консультанты, это квалифицированные рабочие, водители автобусов и т.д. – люди без которых мы не проживем. Они занимают примерно треть рынка – эта доля, по всей видимости, такой и останется. Их подготовка должна проходить на базе прикладного бакалавриата. Для этого необходимо включить колледжи в состав вузов. Предстоит создание учебных центров профессиональных квалификаций, государственно-общественной системы профессиональных квалификаций и профессиональных экзаменов. Эта система будет нужна и для следующей страты – специалистов с высшим образованием.

Специалисты с высшим образованием – это примерно 20% рынка труда. Думаю, что доля будет расти. К этой группе относятся люди с очень высокой квалификацией. Это интеллигенты, но их работа все-таки не креатив сам по себе, а контроль над регламентами. Это очень важная часть образованного класса, и мы должны видеть, что эти люди постепенно вытесняют чистых исполнителей. Обучение специалистов такого уровня должно проходить в прикладном бакалавриате и прикладной магистратуре. То есть мы должны наряду с академически ориентированной магистратурой создавать прикладную магистратуру, которая будет давать конкретные профессиональные компетенции.

Наконец, необходимо формирование креативного класса. Его участники очень разные – это исследователи, преподаватели, врачи, предприниматели, креативные менеджеры, художественная интеллигенция, аналитики, люди, которые работают в сфере массовых коммуникаций. По благоприятному прогнозу, их доля вырастет с 15 до 25% к 2030 г.

Исторический шанс нашей родины связан с тем, чтобы вырастить конкурентоспособный на международном уровне креативный класс. Значительные усилия в этом направлении уже предпринимаются государством. Министерством образования и науки отобраны ведущие вузы, созданы первые исследовательские университеты. Система олимпиад пока еще только развивается, но она должна дойти до младших классов, чтобы захватить новым смыслом обучение в школе сколько-нибудь проявивших талант и способности. Система бизнес-инкубаторов, инновационных парков вроде бы тоже есть, но пока что она ограничивается технологическими инновациями. Ей предстоит распространиться и на

социальные, и на экономические инновации, и на так называемые мягкие технологии. Необходимо поддерживать новые проекты, молодых предпринимателей и фрилансеров. Еще одна задача, которая стоит перед нами – это развитие стратегии «импорта мозгов». Здесь позиции России очень слабые. Отдавая свои мозги, мы практически не участвуем в импорте. Нам необходимо противостоять эмиграции, создавать такие условия, при которых наиболее талантливые выпускники наших вузов оставались бы в России.

Организационная перестройка системы профессионального образования мыслится в одном из вариантов так. К 2020 г. бакалавриат должен стать практически общедоступным и охватывать 80% выпускников школ. Я не думаю, что мы этот уровень когда-либо превзойдем, потому что есть чисто медицинские ограничения помимо социальных. При этом не меньше 20% возрастной когорты (лучше, если это будет 25%) должен занимать прикладной бакалавриат, который даст дополнительный шанс получить реальную квалификацию и найти заработок. Не меньше 40% – общий бакалавриат, он тоже должен иметь развилку на академический и прикладной. И несколько меньше 20% должен занимать бакалавриат исследовательских университетов и художественных вузов. Для этого нам придется укрупнить узкопрофильные вузы и ликвидировать так называемое ведомственное образование, сформировав университеты широкого профиля.

Очень важным направлением является вытеснение псевдообразования и образования низкого качества. Для этого можно предложить ряд конкретных мер, например, передать филиалы государственных вузов в состав региональных университетов, потому что они окормливаются одними и теми же преподавателями, которые бегают между ними. Нам нельзя забывать, что половина наших студентов – это заочники. Мы не имеем права оставлять их вне фокуса политики. Поэтому есть предложение создать 5–6 национальных открытых университетов, которые обеспечивали бы необходимое качество заочного образования с государственной поддержкой и вытеснили бы благодаря более высокому качеству те псевдовузы, которые контролируют значительную часть этого рынка.

**Н.Ю. Гарифуллина, Петрозаводский государственный университет:**  
Ярослав Иванович, у меня вопрос, связанный с программой прикладного бакалавриата. С сентября, т.е. со следующего учебного года, начинается эксперимент по введению программы прикладного бакалавриата. На конкурсной основе были отобраны учебные заведения, причем принимать участие в этом конкурсе имели право учреждения среднего профессионального образования и ву-

зы, у которых есть лицензия на реализацию образовательных программ СПО. Значит ли то, что вы говорили, что в ближайшее время или произойдут какие-то изменения в нормативно-правовой базе, или, может быть, они уже произошли, и прикладной бакалавриат станет законной частью любого университета?

**Я.И. Кузьминов:** лучше на этот вопрос ответит министр образования и науки. Как ректор Высшей школы экономики я могу сказать, что, мы не участвуем в этом эксперименте, но мы с Центральным банком России создали прикладной бакалавриат по обучению сотрудников Центрального банка, и он успешно работает второй год. Ничто не мешает вузам не строиться в очередь за государственной поддержкой, а сделать рациональные движения, посмотрев на рынок труда, который вокруг, посмотрев, что очень важно, на уровень студентов, которые претендуют на образование. Если студенты имеют, как я уже показывал, достаточно низкие академические результаты, но при этом хотели бы продолжать обучение, мне кажется, одна из важных опций – это предоставление им траектории прикладного бакалавриата. Это гораздо более корректный и честный по отношению к этим людям элемент стратегии вуза. Насколько я понимаю, Андрей Александрович, у нас нет никаких ограничений для вузов, которые могут создавать у себя прикладной бакалавриат.

**А.А. Фурсенко:** я могу сказать, что 49 учреждений – 33 техникума и 16 вузов – участвуют в программе. Мы вносим предложения в новые нормативные акты, определенные шаги надо сделать. На основе этого эксперимента, я думаю, мы сможем предложить программы для всей высшей школы. Более того, у нас есть поручение Председателя Правительства о том, чтобы проработать более активно создание научно-образовательных кластеров, реализуя не только объединение каких-то вузов, но и реализуя присоединение к ним техникумов, в первую очередь тех, кто хочет и готов реализовывать программы прикладного бакалавриата. При этом интересно, что большая часть этих программ нацелена как раз на научно-техническую сферу. Если не ошибаюсь, по экономике и по педагогике есть, но они составляют менее 20%.

**Вопрос:** скажите, пожалуйста, в вашем исследовании рассматривался ли следующий аспект? Лица, которые идут за высшим образованием, рассматривают высшее образование не как обязательную ступень социализации, а как необходимое средство социальной мобильности? Как мне представляется, лица, которые идут за высшим образованием, это выходцы не из самых высоких страт.

**Я.И. Кузьминов:** это выходцы из всех страт нашего общества. На мой взгляд, социализация и выбор социальной мобильность есть одно и то же.

**А.А. Фурсенко:** можно я добавлю? Те, кто высокого статуса, учатся за границей. Коллеги, в нашем образовании огромное количество мифов. Один из них, что значительное число детей известных и обеспеченных родителей учатся за границей. За границей, действительно, люди зачастую получают дополнительное образование, они поступают в бизнес-школы, но базовое образование в подавляющем большинстве случаев они получают здесь. Я это могу сказать, встречаясь, общаясь с их родителями, общаясь с детьми, которые учатся, не во всех университетах, но есть несколько десятков университетов, в которые достаточно высокий конкурс, в том числе из людей из самых социально высоких, если так можно сказать, слоев населения.

**Вопрос:** когда разрабатывалась программа прикладного бакалавриата, учитывались ли запросы реального сектора экономики?

**Я.И. Кузьминов:** знаете, запросы реального сектора экономики явились основной причиной вообще выдвижения этой концепции.

**А.А. Фурсенко:** могу сказать, что по металлургии большой объем прикладного бакалавриата, причем, как правило, эти программы реализуются рядом с металлургическими комбинатами и именно с подачи работодателей. Я вижу ваше скептическое отношение, у нас есть достаточно серьезные сомнения в том, что вообще что ни делается, делается с пользой для дела. Могу сказать, что «Северсталь», «Магнитка» предлагают эти программы. Я допускаю вполне, что есть искусственно созданные программы, в том числе прикладного бакалавриата, думаю, что в процентном отношении их гораздо меньше, чем искусственных программ высшей школы.

**Л.И. Якобсон:** мне очень нравится, что все доклады, которые сегодня прозвучали, имеют научную обоснованность – не было просто такого, чтобы говорилось о мнениях, всюду был очень солидный исследовательский материал, и вместе с тем заостренность, дискуссионность. Значит, они не забудутся, будут обсуждаться. Вопросы задать можно будет на сессиях, на круглых столах, которые регулярно в Высшей школе проводятся.

Тема нашей сессии – «Качество и образ жизни: изменение во времени и пространстве». Начну с того, что попытаюсь ответить на вопрос, что такое вообще качество нашей жизни и в чем оно заключается сегодня.

Одной из важнейших составляющих высокого качества жизни является востребованность человека. Востребованность человека, с одной стороны, должна быть внешней, со стороны экономики и общества. Это означает, что человек находит себе работу, которая его удовлетворяет и которой он удовлетворяет, он востребован обществом и чувствует себя в обществе комфортно. С другой стороны, и это очень важно, человек должен быть востребован сам собой, быть самодостаточным. Только в этом случае он может жить в мире с самим собой. Это тема достаточно сложная, я к ней еще вернусь, но без этого говорить о качестве жизни человека невозможно.

Начну с востребованности экономикой. Абсолютно ясно, что надо сделать человека востребованным не только в экономике сегодняшней, но и в экономике завтрашней. Как экономика выглядит сегодня, как она меняется, какой она будет завтра и к чему мы должны готовить людей? Вот какие вопросы стоят перед системой образования.

Отличительная черта современной экономики характеризуется высокой скоростью изменений. Смена технологических укладов и экономических запросов происходит настолько быстро, что зачастую люди не успевают к ним адаптироваться. Но мы не можем под каждый новый запрос подготовить новых людей, мы все-таки должны их переучивать. И это одна из черт новой экономики.

Второй момент. Новая экономика становится не только межотраслевой, она становится надотраслевой. Это означает, что время, когда можно было всю жизнь отработать на своей «узенькой делянке», прошло. Современные «делянки» ограничены не только в пространстве, они ограничены во времени. Запрос на ваши компетенции, умения и навыки может закончиться на протяжении вашей активной профессиональной жизни, причем закончиться неоднократно. Когда я начинал свою работу в науке, одной из самых востребованных была специальность «оператор ЭВМ». Я думаю, что некоторые из присутствующи-



щих помнят эту специальность, но далеко не все. Сегодня такой профессии в прямом смысле нет.

Третья черта новой экономики, к которой надо быть подготовленным, – это социальная ориентированность экономики. Это может нравиться или не нравиться, но сегодня экономика все больше и больше социально ориентирована. Жесткие капиталистические системы, о которых мы читаем в книжках, не существуют в чистом виде. Любая экономическая система сегодня ориентирована на человека, и она должна считаться с проблемами социальной жизни. Об этом, кстати, в той или иной мере говорилось в предыдущих докладах: насколько важна социальная сфера и насколько опасно нарушать социальную ориентированность.

Таким образом, одна из задач, стоящих перед образованием – не только готовить людей к конкретным задачам, но научить людей максимально адаптироваться к быстрым изменениям. Пока это не совсем получается. Я думаю, что вы сами знаете, что адаптация происходит медленно.

Если говорить о востребованности со стороны общества, мне кажется, что один из самых главных запросов общества – это необходимость в социализированных людях, в людях, которые умеют жить в обществе, умеют работать в коллективе, в команде, причем не только умеют, но и хотят это делать. Это очень важный запрос, и он не всегда выполняется. Более того, есть проблема аутизма, есть проблемы, связанные с негативными последствиями использования Интернета, когда живое общение заменяется общением виртуальным, и не важно, кто на другом конце провода – живой человек или некий искусственно созданный образ. На мой взгляд, это достаточно опасные тенденции, которые создают абсолютно новую реальность, опасный тренд развития общества.

Говоря о том, в чем заключается качество жизни, мы неизбежно приходим к качеству образования. Качество образования также как и качество жизни определяется тем, насколько общество, работодатель, обучающийся удовлетворены результатом, удовлетворены тем, как их подготовили. На самом деле качество жизни и качество образования – коррелирующие, если не тождественные понятия. Поэтому запросы и требования к образованию и к изменениям жизни связаны друг с другом. У нас к образованию всегда есть претензии, но у нас и к качеству жизни бывают претензии: мы редко бываем довольны, удовлетворены жизнью, которая нас окружает, мы хотим большего. Еще более остро это проявляется в отношении общества к качеству образования.

Я могу сказать, что в целом через средства массовой информации, через политиков общество всегда недоволено качеством образования. Это было во

все времена, по крайней мере, из той литературы, которую мы читали, мы знаем, что от Древней Греции до наших дней образование всегда ругали, всегда ругали молодежь и говорили, что все не так. Сегодня ситуация катастрофически усугубилась. Почему?

Образование в принципе инерционно и консервативно. В этом есть свой плюс, так как оно является переходным инструментом от предыдущих поколений в поколения следующие, это передача исторической памяти. Именно за счет инерционности и консервативности эта передача происходит, именно за счет этого, вообще говоря, человечество имеет определенную память, преемственность. И именно эти качества образования вступают в противоречие с возрастающим темпом смены технологий, общественных отношений. Если раньше изменения внешней среды происходили достаточно медленно для того, чтобы мы могли это осознать и соотнести с передачей опыта, с передачей кода, то сегодня зачастую мы перестали успевать.

Поэтому сегодня стратегия образования поменялась принципиально. Еще не так давно хорошее образование давалось на всю жизнь, сегодня принципиально образование должно происходить в течение всей жизни. Концепция непрерывного образования «Life Long Learning» предполагает, что человек учится всю жизнь, поднимаясь с одной ступеньки на другую. Именно поэтому вводится система уровневого образования. При этом мы должны понимать, что разница между разными уровнями весьма условна. Этапы образования не являются чем-то застывшим, они точно не являются чем-то жестко сформированным. Вообще на современные вызовы можно отвечать при условии, что людям нравится учиться. Если с самого детства человеку нравится учиться, нравится сам процесс, то в этом случае он способен ответить на вызовы времени и встроиться в быстро меняющееся общество. Если человеку хочется где-то остановиться и сказать, что «хватит, дальше я буду только пользоваться», то запаса знаний будет достаточно на 3–5 лет и возникнет мощная неудовлетворенность. В этом случае качество жизни резко ухудшается, потому что человек, который понимает, что он отстает от требований, от запросов, что он должен все время догонять (не опережать, а догонять!), живет с внутренним дискомфортом.

Поэтому система, при которой в образовании главной целью должно быть удовольствие от того, что вы учитесь и узнаете что-то новое, является определяющей для того, чтобы обеспечить нормальное качество жизни. Перемены должны нравиться. Есть такое восточное проклятие: не дай тебе бог родиться в век перемен. Мы должны от этого уходить и реагировать на перемены с удовольствием. Это единственная возможность обеспечить качество жизни.

Возвращаюсь к внутренней востребованности. Внутренняя востребованность – это самодостаточность, ощущение своего статуса. Но статус зачастую вступает в противоречие с компетенциями, со знаниями, с содержанием. В последние годы одна из бед образования (причем не только российского, а общемирового) состоит в чрезмерном сосредоточении на статусности. Диплом престижного университета у нас, «Лига плюща» в Америке, клубный пиджак более важен, чем то, как ты учился и какие знания ты получил.

Кроме того, есть противоречие между статусом «изобретателя» и статусом «пользователя». Что сегодня происходит в очень многих странах? Равноправие академической и прикладной карьеры. Я могу привести в пример Швейцарию, хотя есть ряд и других стран, но в Швейцарии, это, пожалуй, наиболее ярко выражено. Абсолютное равноправие академической и технологической карьеры – и там, и там вы можете добраться до очень высокого статуса, но эти карьеры принципиально разные. У тех, кто работает по регламентам, все равно нет рутинной работы, регламенты сложные. В каком-то смысле инжиниринг – это работа по очень серьезным регламентам, которые меняются. В этом плане задача общества выстроить этот альтернативный статус и предъявить его как статус достойный, который не хуже чем статус «изобретателя-креативщика».

Все перечисленное серьезно ставит вопрос о существенной модернизации образования. Тут возникает огромная проблема. Любая реформа, любая модернизация образования, если она не является абсолютно популистской, а значит, абсолютно бесполезной, – потому что любая популистская реформа фиксирует то, что уже есть, она фиксирует то, что нравится большинству, – будет встречена в штыки, потому что затрагивает интересы очень многих, но при этом она абсолютно необходима, учитывая все те вызовы, которые перед нами стоят.

Я сказал, что, может быть, главная задача, которая стоит перед образованием, сделать так, чтобы людям нравилось учиться, чтобы они умели учиться. Я думаю, что в условиях изменений абсолютно необходимо готовить людей к тому, чтобы на каждом этапе жизни и образования они умели выбирать и брать на себя за это ответственность. Выбор не может быть сделан один раз в жизни. На это нацелены новые траектории образования, когда мы увеличиваем количество уровней. На это нацелены новые стандарты, которые мы сегодня предлагаем и в школе, и в вузах. На это нацелена вся воспитательная работа. Люди должны выбирать, брать на себя ответственность за этот выбор. Это тоже является задачей образования.

**Л.И. Якобсон:** я бы обратил внимание на то, что Андрей Александрович представил себя как бюрократа, а я представил его как физика. Он на самом

деле действительно привлек наше внимание к философии и гуманитарной составляющей того, что мы сейчас обсуждаем. Вроде бы мы говорим об экономических проблемах. Вообще когда-то конференция, 12 лет назад, была о модернизации экономики, потом появилось слово «общество». Действительно, гуманитарная, социально-психологическая составляющая, когда мы говорим об образовании, и не только о нем, имеет ключевое значение. Очень хорошо, что в конце сегодняшнего пленарного заседания мы об этом сказали. Вопросы.

**Вопрос:** я готов подписаться под тем, о чем вы говорили. Более того, я так или иначе реализую эти образовательные идеи, о которых вы сказали, в том числе на себе. Каким образом сочетается эта идеальная картина с тем типом доминирующей культуры, которая нас окружает? Я имею в виду и коррупцию, и бесправие, и преимущество авторитарной культуры и в госуправлении, и в бизнесе. Каким образом этого достичь с вашей точки зрения как человека, занимающего позицию управленца? Каковы политические риски? Каким образом добиться того, чтобы эти замечательные идеи получили воплощение?

**А.А. Фурсенко:** я думаю, это не столько вопрос политических рисков, сколько готовности брать на себя ответственность за определенные решения. Я могу коротко перечислить, что сделано реально за время, когда я нахожусь во главе министерства.

Мы сделали существенный шаг к более объективной оценке качества образования. Первый шаг – это ЕГЭ. Я знаю, как много разговоров о нем идет. И могу сказать с точки зрения статистики из самых разных мест и регионов, а это достаточно просто делается, математически анализируя результаты ЕГЭ, насколько и где результаты ЕГЭ не соответствуют истинным знаниям. Несмотря на все недостатки, скачок по сравнению с тем, что было до этого, очень существенный. Мы действительно сдвинулись в сторону более объективной оценки и более справедливой оценки качества образования.

Второе. Мы начали структурировать систему высшей школы. У нас возникла группа ведущих вузов, до этого были программы поддержки инновационного развития. Я могу сказать, что все эти решения принимались на основе достаточно сложных, но прозрачных и, с моей точки зрения, весьма объективных процедур отбора, в которых принимали участие достойные люди – это были некоррупционные процедуры. Если вы интересовались системой, как отбирались исследовательские университеты, как отбирались до этого программы инновационного развития, то вы, наверное, знаете, что в той степени, в какой можно организовать абсолютно объективный конкурс – а его нигде нельзя ор-

ганизовать абсолютно объективно, потому что все равно экспертная оценка присутствует, – эти конкурсы были проведены. Это важно не только потому, что мы отобрали лидеров, но и потому, что мы отобрали их честно, мы действительно отобрали лидеров, которые признаны сообществом.

Тот же самый подход был реализован в школьном образовании. Национальный проект, несмотря на все свои ограничения, позволил все-таки выделить достаточно серьезную референтную группу учителей, которые признаны учительским сообществом как лучшие. Я не могу сказать, что все лучшие учителя попали в эту группу. Точно так же я не могу сказать, что там нет ни одного учителя весьма средненького. Но все-таки баланс лучших учителей и лучших школ, которые поддержаны, среди победителей и среди тех, кто не поддержан, абсолютно разный. По крайней мере все оценки убеждают в том, что в целом ситуация выглядит именно так.

Третье. Мы изменили подход к стандартам. Это принципиальное изменение. Впервые мы ушли в стандартах от программ, по которым никогда нельзя было достичь согласия просто по той причине, что они были чисто вкусовые, один видел программу одним образом, другой – по-другому. Мы перешли к документам, в которых формулируется, что человек должен знать, в каких условиях его должны учить, какова структура программ на основе стандартов. Насчет условий – это принципиальный момент, потому что сегодня появился юридически значимый инструмент, заставляющий изменять условия обучения и в школах, и в учреждениях профобразования.

Наконец, последние конкурсы по поддержке науки в вузах, при которых победители были отобраны в достаточно серьезной конкурсной процедуре, проведенной на основе очень жесткой экспертизы, причем с подключением российских и иностранных экспертов. Были отобраны ведущие ученые, которые приехали в наши вузы, получили соответствующую поддержку, чтобы создать научные лаборатории. Мы поддержали научные исследования в вузах, дав деньги не вузам, а тем предприятиям, тому бизнесу, который заказывает реальные работы и берет ответственность за их внедрение. Это определенный шаг для того, чтобы превратить вузы из чисто образовательных институтов в научно-образовательные центры.

Я мог бы еще о некоторых вещах сказать, но я считаю, что все эти шаги, которые могут быть по отдельности рассмотрены как некоторая флуктуация, рассмотренные вместе, создают определенный тренд. Этот тренд, на наш взгляд, потихоньку начинает работать, он начинает выстраивать всю систему немножко по-другому. Это долгая история. Никаким указом, законом изменить систему

образования, ту, которая нам не нравится, на ту, которая нам нравится, невозможно. Тем более, я повторяю, любые изменения встречаются достаточно жесткое противодействие, зачастую от людей, которые осознанно не хотят, они лично заинтересованы в том, чтобы ничего не менялось, но в большей степени от тех людей, которые боятся перемен, потому что далеко не всегда перемены ведут к лучшему. В принципе считают, что надо что-то менять, при этом в каждом конкретном случае предпочитают все оставить как есть, потому что они уже приспособились, потому что они понимают, как с этим бороться. Тем не менее мы потихоньку двигаемся, выбирая ту скорость изменений, которую мы можем себе позволить для того, чтобы не сломать то, что сегодня уже существует.

**Л.И. Якобсон:** мне кажется, о таких вещах надо говорить подробно. Я не могу не сказать вот о чем. Очень распространено представление, о том, что в России вообще не возможны честные конкурсы. Наверняка все здесь с ним сталкивались, я имею в виду не только наших коллег из России, но и наших гостей. Поэтому даже там, где нет нарушений, их ищут и предполагают. А вот конкурсы, о которых говорит Андрей Александрович, очень широко обсуждались в образовательном сообществе, не все были довольны. Но мне, например, ни разу не приходилось сталкиваться с мнением, что здесь что-то манипулировалось. Видите, культура – тоже не инвариант, можно двигаться против течения и двигаться вполне успешно, это течение изменяя.

**Вопрос:** пользуясь возможностью, от лица очень большого количества преподавателей, а я преподаватель МГУ, я знаю преподавателей технических вузов, с удовольствием задам вопрос. Все что здесь происходит, в конце концов упирается в качество преподавателей. Недаром Ярослав Иванович их отнес к высшей категории. Настоящие преподаватели учатся всю жизнь и переучиваются, на них лежит главная ответственность. Тогда, извините, пожалуйста, почему в том блестящем сообщении, которое нам сделал Евгений Григорьевич, сказано, что именно категория работников высшей школы оказалась в положении, когда их зарплата за последние 20 лет не увеличилась, а если честно сказать, то и уменьшилась. Это создает жутчайшую проблему старения преподавателей, особенно в технических вузах. Просто непонятно, как будут реализованы все эти программы, если не изменится что-то с оплатой труда преподавателей.

**А.А. Фурсенко:** Евгения Григорьевича, к сожалению, не слышал, но верю, что он так и сказал. Зарплаты надо увеличивать однозначно. И система образования, и наука сегодня в стране сильно недофинансированы, я с этим тоже со-

гласен. Я бы сказал другое. Производительность работы в этих сферах оставляет желать лучшего. Думать о том, что мы сегодня в эту систему должны влить вдвое больше денег и все изменится в лучшую сторону, это довольно сильное заблуждение. Именно поэтому я считал и сейчас считаю, что надо не только увеличивать финансирование, но и менять систему оплаты труда. Я знаю зарплаты разных профессоров в разных вузах, они очень сильно отличаются друг от друга. 20–30 тыс. – это не вся правда про всех преподавателей. Я против того, чтобы делили зарплату: вот это оклад, вот это надбавка за степень, вот это внебюджет. Зарплата в вузе – это все те деньги, которые получает преподаватель, работая в этом вузе. Все деньги, которые он получает за преподавание, за проведение научных исследований, за какие-то дополнительные работы, которые он делает, оставаясь преподавателем и научным работником. Я считаю некорректным, когда преподаватель, который работает в 5–6 филиалах и набирает в целом достаточно заметную сумму, при этом везде объясняет, что у него зарплата нищенская.

**Я.И. Кузьминов:** он бежит с лекции на лекцию и вообще недоступен для студентов, для консультаций, потому что ему некогда, и книжки ему некогда почитать. Мы же с вами знаем такого рода преподавателей, их, к сожалению, довольно много.

**А.А. Фурсенко:** то, что сегодня происходит, это в каком-то смысле движение в сторону увеличения оплаты. Увеличение финансирования научных исследований вузов, это попытка помочь вузам получить не только бюджетное, но и внебюджетное финансирование. При этом еще раз хочу повторить, и бюджетная поддержка должна увеличиваться. Она сегодня де-факто будет увеличиваться. В каком смысле? У нас за ближайшие 2–3 года количество студентов уменьшится на 25–30%. Это ничья не вина, это проблема демографии. Поскольку, я точно знаю, никаких планов сократить финансирование высшей школы нет, более того, есть даже соображение, как его увеличивать, то это означает, что финансирование на одного студента увеличится. Если мы будем сохранять оптимальное соотношение количества студентов и преподавателей, то это означает, что автоматически увеличится оплата преподавателя.

Мы для этого должны пройти через очень сложные социальные проблемы, найти возможность для преподавателей, которые оказываются недозагруженными, получить дополнительную работу. Я считаю, что мы недооцениваем такой важный фактор, как обучение взрослых людей. Я не зря говорю о том, что мы все время ставим вопрос об обучении в течение всей жизни, это должно быть

оплачиваемо, причем частично из бюджета, а частично за счет населения. Этот рынок сегодня существует, и в значительной степени он удовлетворяется некавалифицированными людьми. Этот рынок касается очень большого количества как гуманитарных, так и технических дисциплин. Причем люди, помимо того, что хотят повышать свою квалификацию, чтобы добиться большего успеха в работе, они хотят получить дополнительные знания для себя, чтобы быть удовлетворенными внутренне. Это касается и изучения гуманитарных предметов, и изучения языков, и изучения информационных технологий, и много чего еще. Это вопрос, который сегодня мы, может быть, не обсуждали, но я хочу сказать, что мы должны искать новые рынки труда для преподавателей. Квалифицированные преподаватели на это готовы. Я думаю, что это один из путей привлечения дополнительных средств в сферу образования. Это тема большая, философская, можно и дальше о ней говорить. Идея понятна.

**Вопрос:** скажите, пожалуйста, довольны ли вы работой структур РАН? Эффективны ли они для нашей экономики? Целесообразно ли их финансировать в том объеме, в котором они получают финансирование? Будет ли их реформа? Вы говорили о том, что мы классифицируем вузы, выделяя по каким-то критериям. Может, начать еще и реформу РАН?

**А.А. Фурсенко:** во-первых, у нас академии наук, в том числе Российская академия наук, это независимые структуры, которые в соответствии с законодательством живут независимо. Они никоим образом не подчиняются министерству. Это первое.

Второе. Российская академия наук, как, впрочем, и вузовская система, весьма неоднородна. Есть очень сильные институты, есть очень сильные специалисты. Есть специалисты не очень сильные, а есть и слабые. У нас некоторое время тому назад было принято постановление правительства, которое принималось очень непросто, это постановление, связанное с оценкой эффективности работы научных организаций. По этому постановлению сейчас был пройден первый этап оценки, Российская академия наук тоже провела оценку ряда своих институтов. При этом мы договорились, что методика оценки единая, наше министерство имеет право получить результаты и обобщить эту методику. Я думаю, что мы вместе с Академией наук благодаря объективным критериям, объективной методике, а там высказаны четкие критерии – от индекса цитирования до уровня работ, сможем оценить, какие институты сильнее, какие слабее. Думаю, что это подтолкнет Российскую академию наук, что определенные шаги по усилению сильных институтов и, может быть, по реорганизации сла-



бых, как это написано в постановлении, будут сделаны. Мы готовы оказывать всяческую поддержку и помощь в этих изменениях.

Я считаю, очень во многом потенциал Академии не в полной мере востребован, в частности образовательный потенциал не востребован в полной мере. В то же время я хочу сказать, что финансирование Академии наук, так же как и всей остальной науки, недостаточно. Наряду с определенными модернизационными процессами мы должны думать и о том, чтобы поддержать более существенно и дать больше денег в те институты и тем сотрудникам, которые показывают хорошие результаты. Другое дело, что эти процессы должны происходить одновременно. Мы должны структурировать систему (кстати, как и то, что мы делаем с вузами) и одновременно поддерживать лучших и поддерживать достаточно серьезно.

**Я.И. Кузьминов:** добавлю к тому, что сказал Андрей Александрович. Академия наук – большая, не очень эффективная на сегодняшний день структура. Но Российская академия наук – один из немногих секторов нашего общества, где осуществляется реальное профессиональное самоуправление. К этому тоже можно предъявлять претензии, говорить, что только академики и члены-корреспонденты всем рулят, а научных сотрудников никто не слушает. По-разному люди к этому относятся, но это реально самоуправляющаяся структура. Я считаю, что общество должно поддерживать и оберегать Академию наук. У нас огромный дефицит устойчивых самоуправляющихся структур в стране. А выразить свое отношение к тем или иным неэффективностям у государства и общества есть возможность, публично что-то сказать, ограничив финансирование, какие-то условия выставив, но не посягая на то, чтобы через голову академиков Академию наук реформировать. А то мы все дореформируем до состояния Павла I. Еще один тезис Андрея Александровича я бы хотел поддержать и развить. Понимаете, Академия наук в советское время, когда я в ней работал, это был огромный исследовательский университет. Через систему Академии наук проходили в несколько лет десятки тысяч молодых ученых, кто стажером-исследователем работал, кто аспирантуру проходил. В общем, через эту систему протекали многие люди. Эту функцию Академия наук в значительной степени потеряла. Если мы сейчас говорим о том, что надо бы восстановить образовательную функцию РАН, это в первую очередь исследовательский университет на базе ее ведущих институтов, аспирантский университет, но это должно быть востребованным, вот эта деятельность должна получить финансирование от государства в первую очередь. Это была очень важная функция.

**Л.И. Якобсон:** пора подводить итог. У нас очень удачное пленарное заседание, от него естественным образом пролегли дорожки к целому ряду сюжетов, которые сегодня специально не обсуждались, но будут обсуждаться на секциях. Это и проблема науки и инноваций, и проблема самоорганизации и гражданского общества, проблемы собственно политические. Хочу закончить приглашением еще раз участвовать.

S. Sassen  
The Committee on Global  
Thought, Columbia University

# A SAVAGE SORTING OF WINNERS AND LOSERS: WHEN COMPLEXITY PRODUCES BRUTALITY<sup>1</sup>

Стенограмма выступления

---

As the cold war was coming to an end, a new struggle began. Following a period of Keynesian-led relative redistribution in developed market economies, the US became the point actor for a radical reshuffling of capitalism. The Keynesian period brought with it an active expansion of logics that valued people as workers and consumers. The current phase of advanced capitalism does not. In the last two decades there has been a sharp growth in the numbers of people that have been expelled, numbers far larger than the newly incorporated middle classes of countries such as India and China. I use the term «expelled» to describe a diversity of conditions: the growing numbers of the abjectly poor, of the displaced in poor countries who are warehoused in formal and informal refugee camps, of the minoritized and persecuted in rich countries who are warehoused in prisons, of workers whose bodies are destroyed on the job and rendered useless at far too young an age, able-bodied surplus populations warehoused in ghettos and slums. My argument is that this massive expulsion is actually signaling a deeper systemic transformation that has been documented in bits and pieces but not quite narrated as an overarching dynamic that is taking us into a new phase of global capitalism.

Here I examine three issues. First I briefly examine what got us to this point. Next I discuss a new profit logic that can thrive on the devastations produced by the dominant logic of the last two decades: the repositioning of what had been constructed as national sovereign territory as *land* for sale on the global market. This is land in Africa, Central Asia and Latin America that is being bought by rich investors and rich governments to grow food, to access underground water tables, and to access minerals and metals. The third examines what can be seen as a global extension of financial mechanisms that have till now been confined to the US which have

---

<sup>1</sup> This is based on a larger study «Expulsions: A Savage Sorting of Winners and Losers» (forthcoming 2010) and «A Savage Sorting of Winners and Losers: Contemporary Versions of Primitive Accumulation». *Globalizations*. March–June 2010. Vol. 7. Nos. 1–2. P. 23–50.

as a key feature the possibility of massive financial profit off the backs of modest income households.

## **Designing complex instruments for elementary extractions**

Two profound shifts stand out beginning in the 1980s. One is the ascendance of finance: while traditional banking is about selling money you have, finance is about selling money you do not have. To do this, finance needs to invade non-financial sectors to get the grist for its mill. And no instrument is as good for this as the derivative. The result was that by 2005 the (notional) value of outstanding derivatives was US\$630 trillion, which is 14 times global GDP. This is not unprecedented in our western history. But it is a major transformation compared to the Keynesian period, which was marked by the vast expansion of material economies: mass manufacturing and mass- building of infrastructures and suburbs.

The second major shift is the material development of growing areas of the world into extreme zones for key economic operations: the global outsourcing of low-wage manufacturing, services and clerical work to low-wage areas and the active world-wide making of global cities as strategic spaces for advanced economic functions – the Dubai's built from scratch and the often brutal renovating of central areas in older cities.

The growing weight of this financial logic also explains why the latest financial crisis has affected the economies of the richest countries more than past financial crisis of the last two decades, of which we have had several. Further it explains the co-presence of both an enormous growth of personal wealth since the 1990s and the fact that much of the job growth and national income growth of the in-between periods had been wiped out by the end of 2009. At the end of two decades of wild financialization, we find a zero growth economy in most of the rich countries, especially the US, the UK and Japan. More generally, the world has more poverty, more inequality, more concentration of wealth, and more devastated economies in the Global South.

What is next?

## **When the land is more valuable than the people and enterprises on it**

Inside capitalism itself we can characterize the relation of advanced to traditional capitalism as one marked by extraction and/or destruction. At its most ex-

treme this can mean the immiseration and exclusion of growing numbers of people who cease being of value as workers and consumers. But it also means that traditional petty bourgeoisies and traditional national bourgeoisies cease being of value. This is part of the current systemic deepening of capitalist relations. One brutal way of putting it is to say that the natural resources of much of Africa and good parts of Latin America and Central Asia count more than the people on those lands count as consumers and as workers. When this happens we have left behind earlier forms of capitalism which thrived on the accelerated expansion of prosperous working and middle classes. Maximizing consumption by households was a critical dynamic in that period; and it is today in the so-called emergent economies of the world.

Today, after twenty years of a particular type of advanced capitalism, we confront a human and economic landscape marked by a double dynamic.

On the one hand, there is a mix of conditions that are being coded as a growing surplus of people and a growing expanse of territory that is devastated – by poverty and disease, by so-called civil wars, by dysfunctional governments due to acute corruption, high indebtedness, extreme inability to address peoples' needs. These conditions are present to some extent also in the developed countries, but they take on extreme forms in the less developed world. We can add some other worldwide trends, notably the increasingly degraded use of people – as sex workers, as workers who are not just used, but used-up in extreme work situations and then discarded, of people merely as providers of body organs, and so on. There is a rapid, often active making of surplus populations – people displaced by proliferating armed conflicts in Sub-Saharan Africa, sharp increases in the numbers of prisoners in the US and a several other Global North countries, displaced people of all sorts assembled in refugee camps managed by the international humanitarian system (at best) financed by the taxpayers of the world.

On the other hand, territory is systemically repositioned in growing parts of the Global South as representing not nation-states but «needed» resources. The devastations briefly described above, especially in the global south, in combination with the implementation of restructuring programs by the IMF and the World Bank, have had multiple effects. Here I am particularly focused on one, which I see as central in the new phase of advanced capitalism that is taking off after the financial crisis that exploded in 2008. It is that this mix of processes has had the effect of «reconditioning» the terrain represented by these countries for an expansion of advanced capitalism, including its explicitly criminal forms.

The simplest way to illustrate this is through some of the numbers about the accelerating acquisition of mostly poor countries' land by foreign investors and

governments. It is not the first time in modern times: this is a recurrent dynamic which tends to be part of imperial realignments. China's acquiring of mines in Africa is linked to its rise as a global power. Britain, France, the US and others all did this in their early imperial phases, and in many cases have owned vast stretches of land in foreign countries for hundreds of years. But each phase has its particularities. One key feature of the current period is that unlike past empires, today's world consists largely of nation-states recognized as sovereign, no matter how feeble this sovereign power is in many cases. Rather than imperial grab, the mechanism is foreign direct investment (among others).

The International Food Policy Research Institute (IFPRI 2009) finds that between 15 and 20 million hectares of farmland in poor countries have been subject to transactions or talks involving foreigners from 2006 to 2008<sup>2</sup>. The Oakland institute (2011) finds that this has now reached 70 million hectares by early 2011. That is the equivalent of a fifth of all the farmland of the European Union. Putting a conservative figure on the land's value, IFPRI calculates that these deals are worth US\$ 20 to 30 billion. This is ten times the emergency package for agriculture recently announced by the World Bank and 15 times more than the US government's new fund for food security. While there is no comprehensive data, there are a number of studies (e.g. though the IFPRI data are probably the most detailed). The contractual formats under which this land is acquired include direct acquisitions and leasing. A few examples signal the range of buyers and of locations. Africa is a major destination for land acquisitions. South Korea has signed deals for 690000 hectares and the United Arab Emirates (UAE) for 400000 hectares, both in Sudan. Saudi investors are spending \$100m to raise wheat, barley and rice on land leased to them by Ethiopia's government; they received tax exemptions and export the crop back to Saudi Arabia<sup>3</sup>. China secured the right to grow palm oil for biofuels on 2,8 m hectares of Congo, which would be the world's largest palm-oil plantation. It is negotiating to grow biofuels on 2m hectares in Zambia. Perhaps less known than the African case is the fact that privatised land in the territories of the former Soviet Union, especially in Russia and Ukraine, is also becoming the object of much foreign

---

<sup>2</sup> Worth noting that this happens at a time when The Economist index of food prices rose 78%; soya beans and rice both soared more than 130%. Meanwhile, food stocks slumped. In the five largest grain exporters, the ratio of stocks to consumption-plus-exports fell to 11% in 2009, below its ten-year average of over 15%. Beyond price, trade bans and crises pose a risk even to rich countries that rely on food imports.

<sup>3</sup> On the other side, the World Food Programme spends \$116m to provide 230000 tons of food aid between 2007 and 2011 to the 4,6m Ethiopians it estimates are threatened by hunger and malnutrition. This co-existence in a country of profiting from food production for export and hunger famines, with the taxpayers of the world providing food aid, is a triangle that has repeated itself over the post-WW2 war decades.

acquisition. In 2008 alone, these acquisitions included the following: a Swedish company, Alpcot Agro, bought 128000 hectares in Russia; South Korea's Hyundai Heavy Industries paid \$6,5 m for a majority stake in Khorol Zerno, a company that owns 10000 hectares in eastern Siberia; Morgan Stanley bought 40000 hectares in Ukraine; Gulf investors are planning to acquire Pava, the first Russian grain processor to be floated on the financial markets to sell 40% of its landowning division, giving them access to 500000 hectares. Also less noticed than the African case is that Pakistan is offering half a million hectares of land to Gulf investors with the promise of a security force of 100000 to protect the land.

These developments are part of a larger combination of trends. On the one hand there is the immediate fact of how the global demand for food, partly fed by the half million strong new middle classes of Asia, has meant that there are profits to be had in food and land<sup>4</sup>. We now have a global market for land and food controlled by large firms and some governments, and it has been a growth sector throughout the financial crisis. Under these conditions pricing is a controlled affair. Secondly, there is the ongoing demand for metals and minerals of all sorts and a whole new demand for metals and minerals hitherto not much exploited as their demand comes from the more recent developments in the electronics sector. Africa, much less densely populated and built up than other parts of the world, has become a key destination for investments in mining. Thirdly, the growing demand for water and the exhaustion of underground water tables in several areas of the world. Fourth, and least noted perhaps, is the sharp decline in foreign direct investment in manufacturing in Africa, also signaling the repositioning of territory. In South Africa and Nigeria, Africa's top two FDI recipients accounting for 37 per cent of FDI stock in Africa in 2006, have had a sharp rise in FDI in the primary sector and a sharp fall in the manufacturing sector<sup>5</sup>. This is also the case in Nigeria, where foreign investment in oil has long been a major factor: the share of the primary sector in inward FDI stock stood at 75 per cent in 2005, up from 43 per cent in 1990. Other African countries have seen similar shifts. Even in Madagascar, one of the few, mostly small, countries where manufacturing FDI inflows increased in the 1990s, this increase was well below that of the primary sector<sup>6</sup>.

---

<sup>4</sup> Between the start of 2007 and the middle of 2008, The Economist index of food prices rose 78%, including over 130% for soya beans and rice. This price increase is sharply higher than the fall to 11% (from the ten-year average of 15%) in the ratio of stocks to consumption-plus-exports in 2009 for the five largest grain exporters (The Economist, May 23, 2009).

<sup>5</sup> The share of the primary sector (which includes prominently mining and agriculture) in inward FDI stock increased to 41 per cent in 2006, up from 5 per cent in 1996; in contrast, the share of the manufacturing sector almost halved to 27 per cent from 40 per cent over that period (UNCTAD 2008).

<sup>6</sup> For comprehensive data see United Nations Conference on Trade and Development (UNCTAD) World Investment Directory Volume X Africa (New York: United Nations, 2008).

Elsewhere (2010) I develop these issues at length and argue that the extraction of value from the global south and, in particular, the implementation of restructuring programs at the hands of the IMF and the World Bank, have had the effect of «re-conditioning» the terrain represented by these countries for an expansion of advanced capitalism, including its explicitly criminal forms. The buying of vast stretches of land in Africa and Central Asia to use for offshore agriculture, extraction of underground water, and access to metals and minerals, is an easier operation for the currently dominant investors and governments if they have to deal with weakened and/or corrupt governments and local elites, and disempowered citizens.

## **Expulsions in the global north**

By the beginning of the new millennium, the sharp acceleration of financial value compared to actual GDP was generating an acute demand for securities backed by actual assets. It is in this context that even low-grade mortgages on modest homes became grist for the financial mill in the US. This combination of poor quality debt and modest assets is probably the least attractive investment for finance. But mortgages on modest homes was one of the few under-financialized sectors in the US economy; the financializing of regular mortgages and of consumer loans had already been in place for two decades, so what was left was at the margins – low grade mortgages, school loans, and such. As the demand for asset-backed securities grew, so did the use of sub-prime mortgages to build asset-backed securities.

There is one feature about the resultant mortgage instrument which is critical for its potential spread to the global market of 2 billion middle and lower income households. It is also a feature often overlooked in explanations of the crisis, and especially in common notion that it was the irresponsible buyers of these mortgages who should have known that they could not pay for them. This feature is the de-linking of potential profits for the mortgage-sellers and investors from the consumer's capacity to pay the mortgage. It took a complex set of innovations to make possible a very elementary de-linking. Whether the buyer of the mortgage could pay the monthly installments mattered less than signing on at least 500 such buyers. Each of these mortgages could then be sliced into multiple fragments, each of these fragments bundled up with high-grade debt that was not asset backed, and generate an «investment product» that could then be sold as an *asset*-backed security to investors – mission accomplished.

Thus the foreclosure crisis that exploded in 2007 was not a crisis for financial investors. It was a crisis for the millions of middle- and working class families, most



of whom we now know had been signed on under false pretenses; now they could not pay their mortgages and lost everything, including the little they had had before they took on the mortgage. Fifteen million households have now lost their home to foreclosures, which is more than the total population of the Netherlands. Millions of them now live in tents.

For high-finance, these millions of foreclosures in 2006 and 2007 created a crisis of confidence: The foreclosures were a signal that something was wrong but give the complexity of the bundled instruments, it had become impossible to identify the toxic component. The value involved, a mere US\$ 300 billion, could not have brought down the financial system. There is a profound irony in this crisis of confidence: the brilliance of those who make these financial instruments became the undoing of a large number of investors (besides the undoing of the modest-income families who had been sold these mortgages). The toxic link was that for these mortgages to work as assets for investors, vast numbers of mortgages were sold regardless of whether these home-buyers could pay their monthly fee. The faster these mortgages could be sold, the faster they could be bundled into investment instruments and sold off to investors. Overall, subprime mortgages more than tripled from 2000 to 2006, and accounted for 20% of all mortgages in the US in 2006. This premium on speed also secured the fees for the sub-prime mortgage sellers and reduced the effects of mortgage default on the profits of the sub-prime sellers. In fact, those sub-prime sellers that did not sell off these mortgages as part of investment instruments went bankrupt eventually, but not before having secured fees from the home-buyers.

Sub-prime mortgages can be valuable instruments to enable modest-income households to buy a house. But what happened in the US over the last few years was an abuse of the concept. The small savings or future earnings of modest-income households were used for the sole purpose of developing a financial instrument that could make profits for investors even if those households went bankrupt. In an increasingly globalized world the good and the abusive uses of this instrument will proliferate.

The aggressive sale of subprime mortgages to those unable to pay for them becomes clear in the microcosm that is New York City. Whites, who have a far higher average income than all the other groups in New York City, were far less likely to have subprime mortgages than all other groups. Thus 9,1 percent of all Whites who got mortgages got subprime mortgages in 2006 compared with 13,6 percent of Asians, 28,6 percent of Hispanics, and 40,7 percent of Blacks. While all groups had high growth rates, if we consider the most acute period, 2003 to 2005, it more than

doubled for Whites, but tripled for Asians and Hispanics, and quadrupled for blacks. Most of these households have lost their homes to foreclosure, and many of the neighborhoods have become devastated urban spaces.

**Table.** Rate of Conventional Subprime Lending by Race, New York City 2002–2006, %

	2002	2003	2004	2005	2006
White	4,6	6,2	7,2	11,2	9,1
Black	13,4	20,5	35,2	47,1	40,7
Hispanic	11,9	18,1	27,6	39,3	28,6
Asian	4,2	6,2	9,4	18,3	13,6

*Source:* Furman Center for Real Estate & Urban Policy, 2007.

We can use several diverse bodies of data to detect the potential global market for these instruments, and hence the potential for devastating households, neighborhoods and more. A comparison of the value of all residential mortgage debt (from high to low-quality mortgages) as a ratio of national GDP across countries shows sharp variations. To some extent, the variation in this value is a function of timing. It is well above 100% of GDP in the US, the UK, Australia, and several European countries, notably 145% in Switzerland. Here, the housing market has long been private and, importantly, the financial system is highly developed on a broad range of fronts. Thus the incidence of mortgages is both high and widespread in terms of the variety of financial circuits it encompasses. Central to this story is the difference between the value of housing loans as a ratio to GDP and the growth rate of such loans. Thus, the former is very low in countries with young housing markets, such as India and China, where it stands at 10%. In contrast, in more mature markets in Asia this value can be much higher – standing at 60% in Singapore, and 40% in each Hong Kong and Taiwan – but the growth rate is much lower. Between 1999 and 2006, the average annual growth of housing loans in India and China was extremely high, certainly above the growth of other types of loans. Both these countries each have new middle classes of about 200 million each, and hence rapidly growing housing markets; they are, thus, at the beginning of a new phase of economic development. If we consider the particular financial innovations of concern in this chapter – moderate and low-income households’ mortgages and subprime mortgages – then we can see how attractive the Indian and Chinese residential mortgage market becomes.

While residential mortgage capital is growing, it needs to be situated in a larger financial landscape. Thus even though mortgage finance measured as a ratio to GDP is high in countries such as the US and the UK, the total value of financial assets is far higher. As indicated earlier, the ratio of finance as a whole to US GDP is 450%, as it is for the UK. The other story, then, is the extent to which finance has found mechanisms for raising its revenue that have little direct connection to the material economy of countries. In this regard, the securitizing of residential mortgages can be seen as a powerful instrument for the further financial deepening of economies.

Finally, a further way of understanding the potential market for mortgages is from the perspective of respectively a country's financial/banking system and a country's households. For the first, we can use data on the share of residential mortgages in a country's total loans. For instance, the share of residential loans to total loans in «emerging markets» ranges from 9% in Russia and 13% in Poland to 20% in South Africa, with most countries in between these two. In the developed countries it varies enormously. The low end is the 17% in Germany and several other EU countries. The highs are in the US 40%, in Canada 60%, in Australia 50%, in Norway 60%, and so on. In other words, there is a potential for residential loans to gain share in total loans from the perspective of the financial and banking systems. Some of this growth may well take the shape of subprime mortgages, with its attendant risks for modest-income households and the added leveraging it brings into the financial system.

As for households, there has been rapid growth over a very short period of time in the ratio of household debt to personal disposable income. For instance, to take cases with high increases, in emerging markets, in the Czech Republic this ratio jumped from 8% in 2000 to 27% by 2005, in Hungary from 11% to 39%, in South Korea from 33% to 68%; in mature markets these ratios went from 83% to 124% in Australia, from 65% to 113% in Spain, and from 104% to 133% in the US. These are high growth rates and they indicate the potential for growth among countries with high increases in these years as well as among those with low rates of increase. An indication of the dynamic character of this market to become globalized is the fact that in some of these countries, much of this debt is foreign-owned. This holds for economies as diverse as, for instance, Poland, Hungary and Romania, where, respectively 35, 40 and 42% of this household debt is foreign-owned.

Conclusion: a logic of expulsions.



# **МАКРОЭКОНОМИКА И ЭКОНОМИЧЕСКИЙ РОСТ**

---



# ВНЕШНИЕ И ВНУТРЕННИЕ ФАКТОРЫ КРИЗИСНОГО СПАДА ПРОИЗВОДСТВА

---

Глобальный экономический кризис 2008–2009 гг., спровоцированный проблемами в финансовой системе развитых стран, привел к беспрецедентному в послевоенной истории падению производства: снижение мирового ВВП в 2009 г. составило 0,6% (а при расчете на основе рыночных курсов валют – 2,0%). Рост мировой экономики существенно замедлился уже в 2008 г. (до 3,0% по сравнению с 5,2% в 2007 г.). Одновременно резко сократились потоки товаров и капитала между странами. Объем международной торговли сократился в 2009 г. на 10,7%, чистый приток капитала в развивающиеся страны упал в 2008–2009 гг. в 3,5 раза.

Уникальность кризиса заключается также в том, что он охватил практически весь мир: падение производства по итогам 2009 г. было зафиксировано в половине стран (91 из 183, входящих в базу данных Обзора мировой экономики МВФ [World Economic Outlook, 2010], тогда как в 2007 г. таких стран было всего три), рост замедлился в 2009 г. по сравнению с предкризисным 2007 г. в 166 из 183 стран. При этом динамика производства в 2008–2009 гг. характеризовалась высокой межстрановой вариацией.

Выраженная дифференциация стран по масштабам кризисного спада дала толчок исследованию возможных причин наблюдаемых различий. Если на первом этапе изучения кризиса экономисты ставили задачу выделить общие факторы, определившие спад мировой экономики, то в приведенной выше серии работ применяется другая логика. Авторы пытаются выяснить, по каким показателям страны, испытывавшие наибольший спад, отличались от стран, где спад оказался относительно слабым. При этом в число анализируемых переменных могут включаться как параметры экономики, так и характеристики экономической политики, что позволяет оценивать эффективность ее различных вариантов. Количественные параметры построенных уравнений позволяют сравнить

между собой значимость различных каналов распространения кризиса. Полученные результаты могут иметь и практическое значение: они показывают, какие переменные необходимо контролировать, чтобы снизить глубину будущих кризисов, и как сказываются на устойчивости экономики различные варианты экономической политики.

Настоящая работа вносит вклад в рассматриваемую проблематику по нескольким направлениям. Это одно из первых исследований, где используются данные о ВВП за 2009 г., выпущенные после его завершения, что позволило применить несколько иной показатель кризисного спада. Качество некоторых полученных в настоящей работе моделей превосходит ранее опубликованные варианты. Наконец, построенные уравнения используются для обсуждения факторов спада российской экономики, анализ которых позволяет дать рекомендации по экономической политике в посткризисный период с точки зрения повышения устойчивости развития экономики.

Потенциальные факторы дифференциации кризисного спада можно разделить на несколько групп, относящихся к разным каналам потенциального влияния кризиса: а) торговый канал, б) финансовый канал, в) дисбалансы в экономике, г) режим экономической политики. *Торговый канал* включает объемные и ценовые шоки, а также индикаторы, отражающие уязвимость экономики к подобным шокам (например, отношение экспорта к ВВП). Размеры *финансового шока* (т.е. сокращение доступности кредитования) определяются сочетанием нескольких категорий факторов: 1) общим сокращением трансграничных потоков капитала, 2) протеканием кризиса в данной стране, 3) экзогенными характеристиками финансовой системы и экономики в целом, не связанными с ходом кризиса. Нас, очевидно, интересуют только факторы третьей группы. К их числу в основном относятся показатели состояния экономики накануне кризиса, определяющие финансовую устойчивость страны, ее «запас прочности» перед возможными шоками. В частности, к данной группе переменных можно отнести: сальдо счета текущих операций, внешний долг в разных определениях (полный, внешний, краткосрочный), золотовалютные резервы, рост фондового рынка («пузыри» на фондовом рынке создали условия для резкого сокращения стоимости ценных бумаг, используемых как обеспечение кредитов, соответственно падение фондовых рынков привело к снижению кредитования), валовой приток капитала, чистая внешняя инвестиционная позиция, степень финансового развития страны, финансовая открытость экономики и другие.

Что касается *дисбалансов в экономике*, общепризнано, что одним из источников кризиса стала проводившаяся во многих странах экспансионистская



макроэкономическая политика, проявившаяся в кредитной накачке, быстром росте внешней задолженности, появлении пузырей на фондовом рынке и рынке недвижимости и т.д. Накопленные перед кризисом дисбалансы могут влиять на спад производства несколькими способами. Во-первых, избыточный внутренний спрос (перегрев экономики) рано или поздно неизбежно приводит к его последующей коррекции. И чем сильнее «раздут» спрос, тем большей, при прочих равных, оказывается коррекция. Во-вторых, работы по анализу причин международного финансового кризиса показали, что одно из центральных мест среди таких причин занимал чрезмерный рост кредитного рычага. Чем больших значений он достиг в какой-то стране в предкризисный период, тем большая коррекция требовалась для его возвращения к нормальным значениям. В-третьих, значительный бюджетный дефицит или государственный долг указывают на необходимость коррекции государственного потребления и/или трансфертов, в то время как профицит и накопленные резервы свидетельствуют о том, что правительство имеет возможность смягчить последствия кризиса, компенсируя сокращение частного спроса снижением налогов либо увеличением государственных расходов. В рассматриваемых работах данная группа факторов включала: размер кредитного рычага, бюджетный баланс, государственный долг, темпы инфляции, динамику кредитования в предкризисный период, динамику роста фондового рынка.

Наконец, *режим экономической политики*, используемый накануне и во время кризиса, во многом определяет, с одной стороны, масштаб накопленных макроэкономических рисков, а с другой стороны, способность экономики адаптироваться к кризисным шокам. Важнейшими являются такие характеристики экономической политики, как режим обменного курса (можно ожидать, что использование плавающего курса позволяет экономике лучше адаптироваться к внешним шокам), использование режима таргетирования инфляции (предполагающего большую гибкость курсовой политики), качество регулирования финансовой системы (включая нормативные ограничения на финансовые риски, качество пруденциального надзора, требования к прозрачности финансовых институтов и т.п.).

Разумеется, предложенная нами классификация факторов условна, кроме того, некоторые из них действуют по нескольким каналам. Однако их структуризация необходима для дальнейшего обсуждения качественных выводов из полученных результатов.

После выявления и классификации факторов спада проводилось исследование их значимости и влияния на кризисный спад. При этом в качестве основ-

ного индикатора кризисного спада мы использовали разность между фактическими средними темпами роста в 2008–2009 гг. и темпами роста, прогнозировавшимися МВФ до начала активной фазы кризиса (для 2008 г. – прогноз от апреля 2007 г., для 2009 г. – прогноз от апреля 2008 г.). Данная переменная, как представляется, имеет важные преимущества перед другими ранее рассматривавшимися показателями кризиса, поскольку позволяет учесть следующие важные обстоятельства: 1) к моменту начала кризиса различные страны находились на различных стадиях экономического цикла (во многих странах наблюдался перегрев экономики). В то же время в 2008 г. важную роль еще играла инерционная динамика (корреляция темпов роста с ростом за 2007 г. или со средними показателями за 2005–2007 гг. составила 0,53); 2) различные группы стран характеризует разная стандартная скорость и волатильность роста производства. Так, для развитых стран типичны меньшие значения этих показателей.

На первом этапе делалась попытка выявить факторы спада для наиболее широкой выборки стран. При этом коэффициенты при *сальдо счета текущих операций*, *доля экспорта в ВВП и ВВП на душу населения оказывались значимы и имели ожидаемый знак* (табл. 1, М1). Значимого влияния режима обменного курса и ограничений на потоки капитала в столь большой выборке не обнаруживалось, а качество объяснения дифференциации кризисного спада не могло быть признано удовлетворительным ( $R^2 = 0,10$ ). В связи с этим из выборки были исключены небольшие экономики с объемом ВВП в 2007 г. менее 3 млрд долл. (в основном, это беднейшие страны Африки и карликовые государства Карибского бассейна). В некоторых из предшествующих исследований также исключались страны с низкой душевой или суммарной величиной ВВП [How did Emerging... 2010]. Были добавлены такие объясняющие переменные, как отклонение роста в странах – торговых партнерах и отношение частного внешнего долга к ВВП (рассматривались также спецификации с краткосрочным долгом и полным внешним долгом, однако в этом случае коэффициенты оказывались менее значимыми, а качество объяснения – худшим). Результаты приведены в табл. 1 (М2). Как видно, все коэффициенты имеют ожидаемый знак, за исключением душевого ВВП, потерявшего значимость после исключения беднейших стран, которые в среднем слабее пострадали от кризиса; рост в странах – торговых партнерах и отношение долг/ВВП высокосignификанты; выявить значимое влияние политики обменного курса и ограничений на приток капитала по-прежнему не удается. Объясняющая сила модели значительно улучшилась (при сохранении лишь переменных первой спецификации  $R^2$  повысился бы до уровня 0,18).

Таблица 1.

## Результаты регрессий на широких выборках

	Спецификация	
	M1	M2
	все страны	все страны без малых и беднейших
Доля экспорта в ВВП	-1,747** (0,880)	-1,874* (1,059)
Сальдо текущего счета	6,071** (2,460)	5,136 (3,821)
Подушевой ВВП	-0,028*** (0,010)	0,007 (0,014)
Фиксированный курс	0,131 (0,447)	0,024 (0,559)
Фиксированный курс* дамми для экспортеров нефти		0,176 (1,209)
Дамми ограничений на потоки капитала		0,263 (0,497)
Частный долг/ВВП		-0,675*** (0,220)
Рост в торговых партнерах		0,878*** (0,270)
Константа	-2,090*** (0,579)	2,521* (1,514)
Число наблюдений	172	109
$R^2$	0,10	0,37

*Примечание.* Стандартные ошибки приведены в скобках; «\*\*\*», «\*\*», «\*» – значимость коэффициента на уровне 1, 5 и 10% соответственно.

Устойчивость результатов по модели M2 проверялась с использованием альтернативных зависимых переменных – роста в 2008–2009 гг. или в 2009 г. за вычетом среднего роста в 1995–2007 или 2005–2007 гг. Во всех этих спецификациях коэффициенты при переменных, значимых в исходной спецификации, сохраняли знак; в двух случаях ограничения на потоки капитала становились значимыми (с ожидаемым знаком); доля объясняемой вариации оказывалась несколько большей ( $R^2 = 0,41 \div 0,43$ ). Это показывает, что вариант определения размеров кризисного спада, используемый нами в качестве основного, труднее поддается моделированию.

При анализе факторов спада оправданным представляется дальнейшее сужение выборки вследствие ее неоднородности. Например, большинство раз-

вивающихся стран, как известно, в отличие от развитых, практически без последствий пережили начальную фазу кризиса благодаря относительной изолированности их финансовых систем от проблемных активов. В активной фазе кризиса значительное число развивающихся стран пострадало от ухудшения условий торговли, в то время как для подавляющего большинства развитых наблюдалось их улучшение. Подобные отличия в данных действительно прослеживаются: например, при ограничении спецификации (2) на подвыборку развитых стран прежде значимые коэффициенты оказываются незначимыми (за исключением коэффициента при внешнем долге, который, впрочем, также теряет значимость при исключении из подвыборки Ирландии). В связи с этим в дальнейшем анализ проводился отдельно для развитых и развивающихся стран (включая страны с формирующимися рынками); дополнительно рассматривается группа стран-экспортеров углеводородов.

Расчеты, направленные на выявление основных факторов спада для развитых стран, привели, в основном, к отрицательным результатам: помимо частного долга и дамми-переменной фиксированного курса прочие переменные (в том числе долг государственного сектора и бюджетный дефицит, которые, как можно было бы ожидать, могли повлиять на потенциальный размер антикризисных мер и тем самым на величину спада) оказались незначимыми, по крайней мере, при двух возможных спецификациях зависимой переменной. Объясняющие качества модели, использующей значимые переменные, невысоки с учетом небольшого объема подвыборки ( $R^2 = 0,30$ ). В дальнейшем подробно описываются более содержательные результаты в подвыборке развивающихся стран.

Выборка развивающихся стран включала 149 экономик. При ее изучении к рассмотренным ранее переменным были добавлены: изменения условий торговли, прирост кредитования в предкризисный период, инфляция в 2007 г., баланс бюджета. Данные переменные оказывались незначимыми в «большой» выборке, однако в связи с особенностями распространения кризиса в развивающихся странах можно было ожидать, что для этой выборки некоторые из них окажутся значимыми. Априори можно было ожидать, что страны, менее пострадавшие от падения цен на сырье, испытали меньший спад. Страны с более высоким приростом кредитования (возможный признак перегрева экономики), скорее, должны были испытать более сильный спад. Коэффициент инфляции как негативная характеристика предкризисной макроэкономической стабильности должен быть отрицательным, а при балансе бюджета – положительным.

При проведении расчетов выяснилось, что введение новых переменных негативно сказывается на значимости некоторых ранее использованных пере-

менных, в частности, сальдо текущего счета. Вероятно, это связано с существенной отрицательной корреляцией между этой переменной и приростом кредитования ( $-0,47$ ): во многих странах дефицит счета текущих операций отражал значительный приток иностранного банковского капитала, стимулировавшего кредитование. Также незначимым (или слабо значимым в некоторых спецификациях) оказывается отношение экспорта к ВВП.

Устойчиво значимыми во всех регрессиях, а также при использовании альтернативных спецификаций зависимой переменной, оказались: долг частного сектора, прирост кредитования и рост торговых партнеров. Изменение условий торговли оказывалось слабо значимым при одних и слабо незначимым при других вариантах зависимой переменной, при этом коэффициенты всегда имеют ожидаемый знак и устойчивы к добавлению новых регрессоров. Указанные четыре переменные в итоге были выбраны в качестве базовых факторов спада (табл. 2, модель М3). Соответствующая модель далее обозначается как «базовая».

Выявить на рассмотренной подвыборке стран зависимость спада от режима курсовой политики, в отличие от результатов, полученных в работе [Berkmen et al., 2009], не удастся (табл. 2, модель М4). Не нашла подтверждения также гипотеза о том, что страны, налагающие ограничения на потоки капитала, меньше пострадали от кризиса. Влияние докризисной инфляции незначимо (этот результат не зависит от спецификации зависимой переменной).

Как и в ряде предшествующих работ, мы сочли целесообразным рассмотреть выборку с исключенными странами – экспортерами углеводородов. Объясняющие свойства модели при этом заметно улучшились. Показатель  $R^2$  возрос до 0,57, что не может быть объяснено лишь снижением размеров выборки до 66 стран<sup>1</sup>.

Таким образом, по результатам построения ряда регрессий для развивающихся стран нами были выделены факторы, устойчиво значимые во всех моделях, а также при использовании альтернативных спецификаций зависимой переменной. Ими оказались долг частного сектора, прирост кредитования и рост торговых партнеров. Изменение условий торговли было слабо значимым при одних и слабо незначимым при других вариантах зависимой переменной, при этом коэффициенты всегда имеют ожидаемый знак и устойчивы к добавлению новых регрессоров. Указанные четыре переменные в итоге были выбраны как базовые факторы спада; соответствующая модель далее обозначается как «базовая».

---

<sup>1</sup> При построении моделей М3–М5 часть нефтедобывающих стран не включалась в выборку из-за недостатка необходимых данных.

Таблица 2.

Результаты регрессий для развивающихся стран

	Спецификация		
	М3	М4	М5
	развивающиеся страны	развивающиеся страны	развивающиеся страны без нефтедобывающих
Частный долг/ВВП	-4,599** (1,778)	-4,968** (1,893)	-6,898*** (2,010)
Краткосрочный долг/ВВП			
Рост торговых партнеров	0,470** (0,199)	0,417* (0,213)	0,314 (0,218)
Прирост кредитования	-5,215** (2,474)	-6,112** (2,734)	-4,461* (2,433)
Изменение условий торговли	2,003 (1,378)	1,768 (1,686)	0,651 (1,894)
Фиксированный курс		0,827 (0,617)	
Ограничения на потоки капитала		-0,620 (0,568)	
Баланс бюджета		-0,018 (0,078)	
Инфляция		-0,002 (0,073)	
Константа	-1,033 (1,489)	-0,883 (1,855)	-0,138 (2,001)
Число наблюдений	78	74	66
$R^2$	0,49	0,50	0,57

*Примечание.* Стандартные ошибки приведены в скобках; «\*\*\*», «\*\*», «\*» – значимость коэффициента на уровне 1, 5 и 10% соответственно.

Сопоставление базовой модели с уравнениями, полученными в предшествующих работах, показывает, что, как и в работе [How did Emerging... 2010], мы построили регрессию, в которой все три основных канала представлены значимыми факторами. При этом наш вывод относится к выборке из 78 развивающихся стран, тогда как аналогичный результат МВФ – к более однородной и малочисленной выборке из 41 страны с формирующимися рынками. Несмотря на это, наша модель значительно лучше объясняет дифференциацию размеров спада, имея  $R^2 = 0,49$  по сравнению с  $R^2 = 0,29$  в указанной статье.

Полученные результаты позволяют оценить роль отдельных факторов в межстрановой вариации спада, рассчитав произведение коэффициента при каж-

дой переменной на ее стандартное отклонение. Оказывается, что *наибольший вклад вносит частный внешний долг (1,0 п.п.); рост торговых партнеров объясняет 0,8 п.п., а прирост кредитования – 0,7 п.п. вариации (составляющей на данной подвыборке 3,1 п.п.)*. Торговый канал оказывается здесь значимым, хотя и не доминирующим фактором дифференциации размеров кризисного спада по странам.

Полученная базовая модель позволяет также разложить величину кризисного спада (а не его вариацию, как выше) по отдельным каналам с учетом как размеров различных шоков, так и их влияния на производство. В целом по всем странам торговый канал объясняет 65% спада, тогда как на долю финансового канала и предкризисных дисбалансов приходится 22 и 13% соответственно. Другие выводы мы получим, если посмотрим, чем в рамках модели объясняется отличие худшего дециля стран от всей выборки: финансовый и торговый каналы объясняют примерно по 40% наблюдаемой разницы, а дисбалансы – оставшиеся 20%.

Таким образом, ключевой общий вывод нашего исследования состоит в том, что *кризисный спад определялся комплексом факторов, относящихся к трем основным каналам (финансовому, торговому и накопленным дисбалансам) и имевших сопоставимое воздействие на производство*.

Применительно к динамике российской экономики анализ факторов, включенных нами в базовую модель, позволяет сделать вывод, что глубокий спад производства в нашей стране был закономерным.

*Финансовые факторы.* Частный внешний долг на конец 2007 г. составлял 261,4 млрд долл. (20,2% ВВП, что значительно выше медианного по выборке значения – 11,2% ВВП), притом что на конец 2003 г. он составлял лишь 76,7 млрд долл. Дефицит счета текущих операций (очищенный от «избыточных» нефтегазовых экспортных доходов) составил 5,6% ВВП. Описанная выше модель изменения притока капитала на основании этих данных предсказывает падение ВВП на 5,5 п.п. В действительности оно составило 11,0 п.п. в связи с наличием ряда специфичных для России факторов (в частности, существенной прямой зависимости от цен на нефть и их изменений, а также курсовой политики, проводимой Центральным банком).

*Торговые факторы.* Спад в странах – торговых партнерах России составил 6,9%. Стоит отметить, однако, что фактический экспорт в физическом выражении снизился лишь на 4,7%. В отличие от стран, экспортирующих преимущественно продукцию обрабатывающей промышленности, основным негативным шоком для России оказался шок условий торговли (ухудшение которых составило в IV квартале 2008 г. по сравнению со II кварталом 33,8%).

*Факторы экономической политики.* Можно заключить, что в предкризисный период не были предприняты необходимые меры для предотвращения перегрева экономики. Например, Россия была одной из немногих нефтедобывающих стран, в которых государственные расходы в 2003–2007 гг. росли в процентах ВВП. Ненефтяной дефицит бюджета составил в 2007 г. 5,2% ВВП. Курсовая политика, наряду с либерализацией счета операций с капиталом в 2006 г., способствовала росту притока волатильного краткосрочного капитала и нарастанию валютных дисбалансов. Объем кредитования вырос с 16,8 до 37,8% ВВП в 2003–2007 гг. (с учетом падения притока капитала рассмотренная выше модель предсказывает падение темпа роста отношения кредиты/ВВП в размере 2,4 п.п.; реальное падение составило 2,5 п.п.).

Падение производства в России наблюдалось в течение трех последовательных кварталов: с IV квартала 2008 г. – по II квартал 2009 г. Оно началось позже, чем в большинстве развитых и ряде развивающихся (в основном, восточноевропейских) стран, что до определенного момента позволяло говорить о России (и о формирующихся рынках в целом) как об «острове стабильности». Действительно, объем зарубежных «плохих» активов на балансах российских банков был невелик; роль зарубежных игроков в российской банковской системе (в отличие, например, от стран Балтии) была также невелика. В этих условиях продолжался приток капитала на формирующиеся рынки (для России он сохранялся вплоть до июля 2008 г.) и рост цен на энергоносители. Однако после банкротства банка Lehman Brothers в сентябре 2008 г. склонность инвесторов к риску резко снизилась, их ожидания по поводу перспектив развивающихся рынков сменились на негативные, что привело к «бегству в качество», сложностям в рефинансировании внешнего долга, падению сырьевых цен. В результате Россия оказалась в ряду ключевых формирующихся рынков (Бразилия, ЮАР, Турция), где падение ВВП началось в IV квартале 2008 г.

Очевидными непосредственными источниками спада для России послужили торговый шок и остановка притока капитала. Действительно, цены на нефть в IV квартале 2008 г. упали на 52,5%, что привело к снижению экспортных доходов (и соответственно прибыльности в ТЭК) и доходов бюджета, негативно повлияло на потребительские ожидания и ожидания инвесторов, стало дополнительным фактором оттока капитала. Остановка притока капитала была тем более болезненной, что за счет внешних средств в предкризисные годы обеспечивалась значительная часть инвестиций и все возрастающая часть потребления. Принятие российскими компаниями избыточных валютных рисков в условиях квазификсированного номинального курса не позволило провести



быструю девальвацию и смягчить последствия кризиса для экспортно-ориентированных отраслей, и так пострадавших от снижения спроса.

Посмотрим, как соотносятся Россия и другие страны по всем показателям, игравшим существенную роль в падении производства (табл. 3). Если сравнивать Россию с выборкой развивающихся стран, то наша страна по двум параметрам (размеры внешнего долга и сокращение объема внешнего спроса) находится между медианой выборки и 10% аутсайдеров, по предкризисному росту кредитования находится близко к аутсайдерам, а по изменению условий торговли – значительно превосходит их.

**Таблица 3.** Значения факторов спада для России и других стран

Факторы	Россия	Полная выборка стран		Развивающиеся страны		Нефтедобывающие страны	
		медиана	среднее по 10% аутсайдеров	медиана	среднее по 10% аутсайдеров	медиана	среднее по 20% аутсайдеров
Частный внешний долг/ВВП, %	20,2	11,6	96,0	8,5	37,4	8,0	10,3
Рост торговых партнеров, %	-6,9	-5,2	-8,2	-5,1	-8,7	-5,1	-5,2
Изменение условий торговли, %	-33,8	-1,4	-13,4	-2,8	-16,6	-41,6	-43,7
Предкризисный рост кредитования, п.п.	16,8	6,9	22,0	5,4	17,2	5,6	3,7

Расчеты вклада различных факторов показывают, что более 2/3 спада в России связано с торговым шоком. Это соответствует позиции многих экспертов (см., например: [Blanchard, Das, Faruqee, 2010]), считающих, что ведущую роль в спаде российской экономики сыграло резкое ухудшение условий торговли.

На основе анализа факторов спада могут быть сформулированы следующие рекомендации.

*Торговые факторы.* Необходимо повысить диверсификацию экспорта по товарным группам и регионам. Несмотря на слабое падение физических объемов поставок, из-за эффекта условий торговли номинальный экспорт из России снизился в большей степени, чем у стран-экспортеров более высокотехнологичной продукции. Это указывает на невыгодность сохранения сырьевой ориентации, несмотря на наличие более устойчивого спроса. Преимущества гео-

графической диверсификации хорошо иллюстрируют примеры двух латиноамериканских стран – Чили и Мексики. Во внешней торговле Чили по состоянию на 2009 г. 14 стран имели доли в экспорте, превышающие 2%; тогда как доли лишь двух стран (США и Канады) в экспорте Мексики составляли выше 2%. По итогам кризиса, падение ВВП в Чили в 2009 г. составило 1,6%, а в Мексике – 6,5% (отклонение от прогноза роста составляет –3,7 и –5,4% соответственно).

*Курсовая политика.* Следует повысить гибкость курсовой политики (что отчасти уже сделано Центральным банком). Несмотря на то, что в настоящей работе не удалось показать значимого влияния курсовой политики на спад, увеличение волатильности номинального курса ослабляет приток спекулятивного капитала и накопление внешнего долга, тем самым смягчая потенциальные последствия «внезапной остановки».

*Денежно-кредитная политика.* Проведение эффективной и прозрачной монетарной политики, направленной на сглаживание циклов, способно смягчить последствия кризиса. В работе [How did Emerging... 2010] было также показано, что страны, таргетирующие инфляцию, меньше пострадали от кризиса.

*Жесткий мониторинг финансовой системы* и, в частности, притока капитала. В случае избыточного роста кредитования или роста притока капитала, не обусловленного фундаментальными факторами, необходимо рассматривать возможности повышения резервных требований. Применение контрциклических капитальных требований также является одной из потенциальных мер, реализация которой, однако, требует сбалансированного подхода с учетом риска замедления кредитования. Кроме того, возможно ограничение чрезмерных внешних заимствований компаний с государственным участием.

*Налогово-бюджетная политика* должна вносить свой вклад в устойчивое развитие, не создавая при этом условий для перегрева экономики. Необходимо сдерживать рост расходов на основе консервативного бюджетного планирования и возобновить действия строгих бюджетных правил. Помимо повышения уровня макроэкономической стабильности, жесткая фискальная политика дополнительно способствует снижению притока краткосрочного капитала [Global Financial Stability Report, 2010] и ослаблению реального курса [Arezki, Ismail, 2010].

При выполнении этих рекомендаций Россия в будущем (в случае очередного финансового кризиса), возможно, окажется уже не в числе аутсайдеров, а в числе лидеров.

## Литература

*Arezki R., Ismail K.* Boom-bust Cycle, Asymmetrical Fiscal Response and the Dutch Disease: IMF Working Paper WP/10/94. 2010.

*Berkmen P., Gelos G., Rennhack R. et al.* The Global Financial Crisis: Explaining Cross-Country Differences in the Output Impact: IMF Working Paper WP/09/280. 2009.

*Blanchard O., Das M., Faruqee H.* The Initial Impact of the Crisis on Emerging Market Countries: Brookings Papers on Economic Activity. Spring. 2010.

Global Financial Stability Report. IMF, 2010.

How did Emerging Markets Cope in the Crisis? IMF, 2010. (<http://www.imf.org/external/np/pp/eng/2010/061510.pdf>)

World Economic Outlook. IMF, 2010.

# ПОТЕНЦИАЛЫ, СОСТАВЛЯЮЩИЕ И ИСТОЧНИКИ ЭКОНОМИЧЕСКОГО РОСТА

---

Потенциалами назовем те модусы состояния системы, которые в своей непроявленной форме суть возможности развития системы, а их проявление выражается в формировании действующих сил и мотивов ее развития. Импульс есть форма проявления потенциала как состоятельная реакция на конкретную ситуацию, в которой находится система.

В соответствии с общей теорией развитие системы подчиняется основному закону:  $\Delta(U) = \nabla \Phi$ , т.е. изменение интегрального показателя развития (эволюции) системы по величине и направлению пропорционально градиенту совокупного потенциала.

Данный закон является обобщением на теорию систем произвольной природы известного физического закона

$$\Delta(M\vec{V}) = \nabla \Phi,$$

т.е. изменение произведения меры инерции и вектора направления-скорости движения (импульса) системы по величине и направлению пропорционально градиенту действующего потенциала.

Совокупный потенциал может быть разложен по составляющим: долгосрочный, определяющий основную тенденцию развития, среднесрочные (общие и более частные) и краткосрочные потенциалы-импульсы. Их природа, реализация и последствия, естественно, различны.

Наиболее устойчивый долгосрочный потенциал создается человечеством и идейными лидерами страны (философской, научной и политической элитой). Он формирует долгосрочную тенденцию – тренд развития системы.

К долгосрочным потенциалам можно также отнести импульсы, отвечающие за формирование и развитие технологических укладов кондратьевского типа. Так, кондратьевская волна, связанная с информатизацией и электрониза-

цией общества в 1985–2005 гг., обеспечивала, по оценке, до 0,5 п.п. ежегодного роста американской экономики в этот период.

Среди основных факторов, формирующих среднесрочные импульсы, можно выделить:

- инновации в технологиях и продукции, происходящие как спонтанно, под влиянием внешних и внутренних шоков и вызовов, так и более регулярно под воздействием устойчивой потребности, создаваемой, например, кондратьевской волной;
- реализация крупных инвестиционных проектов;
- смена потребительских интересов (например, в результате насыщения или в связи со сменой поколений) и формирование потребительских ожиданий.

Каждый из импульсов, отвечающий за начало активизации проявления потенциала, порождает некоторый метаэкономический процесс, который, консолидируя сопутствующие силы и процессы, развивается по определенной логике. Он имеет собственную инерцию, которая определяет ритм цикла, и продолжается до тех пор, пока не исчерпает свои потенциальные возможности.

Часто указанные факторы и импульсы переплетаются и взаимодействуют друг с другом. Так, вызванные ближневосточными конфликтами всплески нефтяных цен в 1973 и 1982 гг. индуцировали технологические волны энергосбережения, которые выразились в создании новой технологической базы американской экономики и в ускорении ее темпов роста на 0,5–0,7 п.п. ВВП во второй половине 1970-х и середине 1980-х годов. Одновременно ценовой кризис 1982 г. кумулировался с нижней фазой инвестиционного цикла, приходящейся на 1980–1982 гг. Отсюда W-образная форма кривой этого кризиса.

Наиболее явные циклы, выделенные нами по динамическим рядам послевоенной американской экономики, в порядке спада объясняемой ими части дисперсии исходного ряда имеют следующие характерные периоды: 10 лет (инвестиционный цикл), 5 лет (модельный), 16–17 (потребительский), 34–38 (кондратьевский). Циклы, вызванные шоками нефтяных цен, могут демонстрировать и другие характерные периоды.

Таким образом, экономический процесс в целом представляется как сумма долгосрочного тренда, определяемого действием долгосрочного потенциала, и совокупности циклов, порождаемых различными импульсами (действием частных потенциалов) в различные периоды времени:

$$\Delta(M\vec{V}) = \nabla\Phi + \sum_i \nabla\varphi_i. \quad (1)$$

Интересы и силы, представляющие частные потенциалы, могут консолидировать заметную часть системы. Консолидация выражается в уменьшении меры инерции системы и, как следствие, в соответствии с (1) – в ускорении движения по градиенту частного потенциала.

Но импульс не захватывает всю систему, и градиент его потенциала  $\phi$  по направлению не совпадает с градиентом долгосрочного потенциала  $\Phi$ . Поэтому при существенных отклонениях от основного тренда системы в соответствии с принципом Ле Шателье возникает возвращающая сила. Она тем мощнее, чем больше отклонение от основной тенденции:  $F = -kx$ . Поскольку в соответствии с основным законом  $m\ddot{x} = F$  возникает циклический колебательный процесс  $m\ddot{x} = -kx$ , которому удовлетворяет функция  $x = A \sin \omega t$ .

Период колебания  $T$  пропорционален  $\sqrt{m}$ , т.е. масштабы и инерционность процессов определяют их длительность:

$$T = 2\pi\sqrt{m/k},$$

где  $m$  – масса (инерция) системы,  $k$  – коэффициент жесткости системы.

Определенную часть (от 1/3 до 1/2) цикла составляет достаточно важный, латентный (подготовительный) подпериод, в течение которого на основе взаимодействия (консолидации) проявивших себя в этот период сил формируется доминирующая структура, количественные и качественные характеристики циклического процесса. Затем происходит постепенное расслоение пакета сил и нарастание заложенных в доминирующей структуре противоречий, которые не могут разрешиться доминирующей структурой (поскольку ей имманентно присущи). Они разрешаются действием возвратных сил, что воспринимается как реакция, кризис или спад. Вместе с тем разрешение противоречий расширяет поле для действия новых сил (проявления нового потенциала) и создания нового импульса для развития.

Сформировавшаяся амплитуда цикла может в последующем подавляться за счет вязкости и турбулентности системы, что особенно заметно в периоды депрессий и кризисов.

Методология спектрального анализа применительно к рядам экономической динамики должна включать в себя комбинацию двух принципов: формальный принцип фильтрации или последовательного выделения гармоник, объясняющих максимум дисперсии анализируемого ряда, должен дополняться историческим подходом, который исходит из понимания, что импульс возникает в какой-то момент (период) времени, например, по одной из указанных

выше причин и затем вводит экономический процесс в определенный ритм изменений с характерным размахом и периодом, зависящим от масштаба захвата и распространения импульса.

Приведем только некоторые комментарии, поясняющие масштабность и соответственно длительность выявленных циклических процессов:

- обновление наиболее мобильной части основного капитала и модельного ряда продукции охватывает примерно до 10% затрагиваемого экономического процесса и происходит достаточно быстро – примерно через 5 лет (малый инновационный цикл);

- обновление основного капитала (инвестиционный цикл) захватывает около 20% валового продукта и более продолжительный период времени – примерно 9–10 лет (в России – около 12 лет). Инвестиционный цикл является основным и объясняет до 20% дисперсии ряда. Лаговая часть цикла составляет до 3–4 лет. Нижние фазы этого цикла коррелируют с кризисами американской экономики в 1980–1982, 1991, 2001, 2009 гг.;

- смена поколений потребительских интересов требует уже большего времени – 16–18 лет. В послевоенное время произошла смена трех поколений потребительских интересов: повышение материального достатка после ограничений военного времени; увлечение мобильной и бытовой техникой и автомобилями; увлечение IT, электроникой, Интернетом и недвижимостью. Может быть, это также связано со сменой молодежных поколений: молодые люди начинают серьезно и состоятельно реализовывать свои потребительские интересы в 20–25 лет и удовлетворяют их примерно к 40 годам, а дальше начинается уже новый цикл интересов, и их диктует уже новое поколение в возрасте 20–25 лет. Латентный период цикла – формирование потребительских интересов у нового поколения происходит в возрасте от 12 до 18 лет;

- потенциал новых технологических укладов (идей) требует для полной своей реализации 34–36 лет. Причина такой длительности цикла не до конца ясна. Возможно, она связана с тем, что полная реализация уклада требует деятельности поколения ученых: молодые ученые увлекаются новыми научными и техническими идеями примерно в 21–24 года и окончательно «истощаются» к 55–60 годам. При этом латентный период – от первого, романтического увлечения молодых людей наукой в возрасте 12–14 лет и до формирования ученого, готового самостоятельно реализовать свои идеи в 26–30 лет, – занимает около 12–16 лет.

Последняя кондратьевская волна, прошедшая по всему миру в конце XX в. (она почти затронула Россию, занятую перестройкой и трансформационны-

ми реформами), обеспечила переход всего мира на информационные технологии и электронизацию основных процессов в быту и экономике. Активная часть этой волны завершилась к середине первого десятилетия XXI в.

Предыдущая волна была связана с атомными и ракетно-космическими технологиями и волею истории существенно затронула Россию, но у нее был богатый латентный период с научными исследованиями физических школ Л. Ландау, П. Капицы, И. Тамма и ракетостроительной школы Н. Тихомирова и Ф. Цандера, плюс использование достижений европейских физиков школы Н. Бора и В. Гейзенберга.

Активная фаза новой волны, которая ожидается с начала 2020-х годов, будет связана, по-видимому, с медициной, био- и нанотехнологиями, новой энергетикой и развитием творческого человеческого потенциала. Подготовка стран к каждой новой волне, как показал опыт трех предшествующих волн, требует 15–20-летнего научного и организационного подготовительного (латентного) периода. Вероятно, он не может быть короче, поскольку форсирование и реванш в фундаментальной науке без создания соответствующей научной и технологической среды обычно не приводят к устойчивому успеху. Это самый ответственный период цикла, пропуск которого приводит к неготовности научно-организационной почвы впитать распространяющуюся энергию (эманацию) научно-технической волны, что равносильно либо пропуску самого цикла, либо вхождению в заведомо догоняющий режим развития. Этот подготовительный период с начала XXI в. уже проходят большинство развитых стран мира.

Политические и гуманитарные идеи требуют для своей реализации периодов другой продолжительности (некоторые из них кратны 17-ти и 34–36-летним интервалам).

Основной потенциал социалистических идей был реализован в активной фазе примерно за 70 лет. Реализация заняла четыре 17-летних подпериода (1917–1934–1952–1968–1985 гг. – годы взятия власти, установления вертикали власти, кульминации власти, ее консервации (застой и начало разложения) и, наконец, сдача власти – переход к другой идее). Она попутно захватила две технологические волны: электрификации всей страны и использования атомных и ракетно-космических технологий. Латентный период формирования социалистической идеи занял также около 70 лет (1848–1917). Имперские идеи предполагают размах уже примерно в 150 (Великая Британия – примерно с 1759 г. (начало господства на морях) до начала XX в.) и 300 лет (2 × 150 – Двуглавая Российская Империя – 1618–1917). С начала XX в. Америка выступила



преемницей Великобритании, поэтому англо-американский цикл можно также считать двуглавым. Историки, биологи, климатологи, геофизики и астрофизики выделяют и другие циклы разной продолжительности.

Потенциалы, как общесистемные, так и частные, через действие сил (факторов) реализуются в различных составляющих (направлениях) роста. Соответственно происхождению составляющих экономического роста и их роли в дальнейшем развитии системы можно выделить:

- конъюнктурный рост, индуцированный внешними для системы или временными (не имманентно или constitutively свойственными системе) потенциалами и факторами. Они перестраивают структуру системы в интересах дальнейшей поддержки такого роста. Так, в 2003–2007 гг. конъюнктурная компонента обеспечивала до 4,5 п.п. из 7,5-процентного среднегодового роста ВВП России и перестроила структуру экономики в пользу топливно-энергетического сектора. Конъюнктурный рост при определенных условиях и целенаправленной политике по использованию создаваемых им ресурсов может частично переходить в состоятельный рост. При прекращении действия конъюнктурного фактора обычно наступает кризис или торможение развития в силу неподготовленности системы к более состоятельному или самостоятельному росту (в России кризис 2008–2009 гг. снял 14 п.п. из предшествующего 25-процентного конъюнктурного роста);

- состоятельный рост, который может реализоваться за счет:
  - мобилизации ресурсов – мобилизационный рост (за счет повышения нормы накопления, экстенсивного освоения новых месторождений, увеличения продолжительности рабочей недели, привлечения труда мигрантов);
  - последовательного изменения структуры экономики (например, в сторону менее ресурсоемкой экономики) – структурный рост;
  - роста эффективности системы через инновации и интенсификацию процессов.

Конечно, эти три составляющих роста часто пересекаются и осуществляются одновременно. Мобилизационный рост приводит к изменению структуры и может содействовать росту экономики и снижению ее энергоемкости. Например, повышение нормы накопления основного капитала на 1 п.п. приводит, при прочих равных условиях, к увеличению темпа роста ВВП на 0,3 п.п. Однако более часто мобилизационный рост не приводит к росту эффективности, а сопрягается с ее снижением, поскольку реализуется на действующей

технологической платформе (например, в советское время повышение нормы накопления до 35% привело лишь к падению эффективности капитальных вложений). Повышение эффективности осуществляется в основном не за счет мобилизационного роста.

В последнем случае конечным источником состоятельного роста является интеллектуальная и организационная деятельность, результаты которой реализуются в инновационных изменениях в технологии, продукции и организации производства.

Интеллектуальный потенциал – единственный неисчерпаемый источник развития, но он требует особого отношения, прежде всего, к наиболее молодой части общества – основным участникам латентного периода формирования кондратьевского цикла. В частности, без создания уже в ближайшие годы условий для массового увлечения молодежи наукой мы не сможем подойти подготовленными к взлету шестой кондратьевской (технологической) волны, а скорее подойдем наполовину готовыми уже к ее излету в 2030-е годы. В результате еще одна кондратьевская волна может быть упущена.

Инновационные импульсы, которые поддерживаются расходами государства и частных инвесторов, независимо от форм поддержки (закупка продукции, инвестиции в проекты, налоговые льготы и кредиты, изменение тарифов, увеличение (индексация) доходов работников и социальных групп и т.д.) воздействуют на экономику по двум направлениям: через рост спроса на продукцию и через рост производства и повышение его эффективности.

Расширение спроса на новую продукцию и ее реализация создают дополнительные доходы, использование которых расширяет спрос домашних хозяйств и инвестиции с последующим использованием возникающих доходов на потребление и реинвестирование. Спросовый мультипликатор (учитывающий также импортоспособность продукции) еще не является мультипликатором доходов по производству. Он становится таковым только после балансировки возросшего спроса и возрастающего, но отстающего от него предложения (производства). Последнее обеспечивается как за счет повышения загрузки действующих мощностей, так и за счет роста производства на мощностях, вводимых за счет реализуемых инвестиций. Наконец, остающийся разрыв между возросшим спросом и возможностями роста производства, который в первое время сохраняется из-за лаговых процессов, устраняется за счет роста цен на продукцию. Поэтому окончательный мультипликатор расходов оказывается ниже спросового.

Расчет возрастающего спроса по расходящимся кругам использования доходов и расчет потенциального роста производства за счет инвестирования в

основной капитал осуществляется на основе традиционных моделей структурно-балансового типа и производственных функций. Интерес представляют модификации производственных функций, учитывающие фактор интенсификации.

За основу примем двухфакторную производственную функцию Кобба – Дугласа

$$W_t = AK_t^{\alpha_t} L_t^{\beta_t} \quad (2)$$

с переменными эластичностями ВВП по капиталу и труду:

$$\alpha_t = \alpha_0(1 + x_t), \quad \beta_t = \beta_0(1 + y_t), \quad (3)$$

где  $\alpha_0$  и  $\beta_0$  – начальные значения эластичностей,  $x_t$  и  $y_t$  – факторы роста эластичностей  $\alpha_t$  и  $\beta_t$  соответственно.

Таким образом, в формулах (2) и (3) предполагается, что факторы интенсификации выражаются в росте отдачи от капитала и труда (в повышении эффективности использования факторов производства).

Полагаем, что основным фактором роста эффективности капитала и труда за счет инноваций являются кумулятивные вложения в инновационные и инфраструктурные секторы экономики, т.е.

$$K_t^{x_t} = I_t^\lambda, \quad L_t^{y_t} = I_t^\mu,$$

где  $\lambda$  и  $\mu$  – экзогенные числовые параметры.

Функцию (2)–(3) в предложенной спецификации можно интерпретировать как двухфакторную производственную функцию Кобба – Дугласа с капиталодобавляющим (нейтральным по Солоу) и трудодобавляющим (нейтральным по Харроду) техническим прогрессом:

$$W_t = A \left( I_t^\lambda K_t \right)^{\alpha_0} \left( I_t^\mu L_t \right)^{\beta_0}. \quad (4)$$

Если влияние вложений в инфраструктурные и инновационные секторы не распределяется в модели по факторам производства, то (4) можно переписать в виде

$$W_t = AI_t^{(\lambda + \mu\beta_0 / \alpha_0)\alpha_0} K_t^{\alpha_0} L_t^{\beta_0} = AI_t^{\rho\alpha_0} K_t^{\alpha_0} L_t^{\beta_0}. \quad (5)$$

В данной постановке модели мы отвлекаемся от действия конъюнктурного фактора и циклических колебаний, которые тоже характерны для совре-

менной экономики. Их влияние на темпы роста оценивается отдельно и затем накладывается на полученный долгосрочный тренд.

Количественная оценка параметров производственной функции (5) в условиях современной российской статистики весьма затруднительна. В настоящее время пока не существует достаточно достоверной статистики баланса основного капитала по восстановительной стоимости за длительный период времени. Он в современных исследованиях заменяется балансом кумулятивного потока инвестиций с учетом ориентировочных лагов их освоения и перехода в основные фонды и с учетом коэффициента фактического выбытия фондов, который существенно ниже установленной нормы амортизации.

Применение фактора капитала в указанной форме позволило получить примерные оценки коэффициента эластичности выпуска (ВВП) по этому фактору на уровне  $\alpha_0 = 0,4$ . Поэтому параметр  $\beta_0$  можно принять равным  $1 - \alpha_0 = 0,6$ . Калибровка модели по параметру  $\rho$  еще более затруднительна. Если использовать опыт исследований по аналогичным моделям в мировой практике, то его значение можно принять в пределах  $\rho = 0,1 - 0,15$ .

При таких значениях параметров можно показать, что в условиях инновационного сценария долгосрочного развития, разработанного Минэкономразвития России (вариант Inn2), в котором средний долгосрочный темп роста инвестиций принят на уровне 6,7% в год, а темпы роста инвестиций в инфраструктурный и инновационный комплексы приняты с опережением темпа инвестиций в целом в 1,25 раза (параметр  $h$ ), темп роста экономики, при прочих равных условиях, должен составить примерно 4,2%, в том числе за счет фактора роста эффективности – около 1,5%, или около трети общего темпа прироста.

В более общем случае, когда импульсы проходят по ряду направлений и требуется их дифференцированный учет, производственная функция (5) допускает естественное обобщение:

$$W_t = A \left( K_t \prod_{n=1}^N I_{nt}^{\lambda_n} \right)^{\alpha_0} \left( L_t \prod_{n=N+1}^{N+M} I_{nt}^{\mu_n} \right)^{\beta_0}. \quad (6)$$

Здесь наиболее сложным моментом является оценка или калибровка параметров  $\lambda_n$  и  $\mu_n$ . В первом приближении можно положить  $\lambda_n = \pi_n \cdot d_n \cdot \lambda$  и  $\mu_n = \pi_n \cdot d_n \cdot \mu$ , где  $d_n$  – доля направления  $n$  в расходах в инновационном и инфраструктурном секторе,  $\pi_n$  – его относительная (к среднему уровню) эффективность,  $\lambda$  и  $\mu$  – общий уровень влияния инвестиций в инфраструктурный и инновационный комплексы на продуктивность основного капитала и труда соответственно. Тогда вся тяжесть оценки перемещается в оценку  $\pi_n$ .

Сепарабельный вид мультипликативной функции (6) не означает, что можно оценивать чистое влияние каждого направления без учета изменения других факторов: в аддитивном представлении возникают перекрестные члены (произведения), отражающие взаимодействие факторов, которое оказывается существенным (интерференция волн).

## ПРИРОДНАЯ РЕНТА И МЯГКИЕ БЮДЖЕТНЫЕ ОГРАНИЧЕНИЯ

---

Одна из важнейших особенностей российской экономики состоит в масштабном использовании в ней природных ресурсов. Они доминируют в структуре экспорта, играют определяющую роль в формировании бюджетных доходов, изъятие природной ренты позволяет поддерживать умеренную налоговую нагрузку в других секторах. Вместе с тем как размеры ренты, так и структура ее образования и использования в российской экономике на удивление мало изучены. Одна из наиболее полных оценок размеров нефтегазовой ренты в России дана в работе [Gaddy, Ickes, 2005]. Рассматривая период с 1970 по 2005 гг., авторы приходят к выводу, что размеры ренты достигли пика (свыше 40% ВВП) в 1981 г.

Настоящая работа продолжает ранее опубликованную работу [Гурвич, Вакуленко, Кривенко, 2009], представляя детализированные оценки нефтегазовой ренты за 1999–2009 гг. К ним добавляется построение оценок «скрытой природной ренты». Это понятие относится к той части ренты, которая в результате тех или иных мер правительства не включается в цену реализации углеводородов и поэтому не увеличивает доходы ни государства (которое по закону является собственником находящихся в недрах полезных ископаемых), ни компаний, ведущих добычу.

Рассмотрим сначала первую часть природной ренты – ту, которая включена в стоимость углеводородов, и таким образом поступает поставщику.

Отдельные потоки поставок, различающиеся направлением (дальнее, ближе зарубежье или внутренний рынок) и видом продукции (нефть, нефтепродукты, природный газ) имеют разную конечную цену, объем и налогообложение. В табл.1, 2 приведены оценки структуры стоимости углеводородного сырья для важнейших потоков, на которые приходится более 90% размеров сектора. Обращает на себя внимание большая дифференциация (в один и тот же год) природной ренты, приходящейся на единицу продукции, поставляемой на разные рынки. Особенно сильно различается рента в цене газа, поставляемого в дальнее зарубежье и на внутренний рынок: в среднем за рассматриваемый период здесь сложился девятикратный разрыв! Тонна сырой нефти, поставляемой в

дальнее зарубежье, содержит в 1,5–2 раза больше природной ренты, чем тонна поставляемых на этот же рынок нефтепродуктов. Эти различия отражают как ценовую и налоговую политику правительства, создающую субсидии для производителей и потребителей углеводородного сырья, так и эффективность различных частей нефтегазового комплекса.

**Таблица 1.** Структура стоимости нефти, поставляемой в дальнее зарубежье, долл./т

	1999 г.	2000 г.	2001 г.	2002 г.	2003 г.	2004 г.	2005 г.	2006 г.	2007 г.	2008 г.	2009 г.
<i>Нефть, поставляемая в дальнее зарубежье</i>											
Природная рента	71	130	98	104	115	151	268	331	359	542	278
Изъятие ренты в бюджет	6	23	29	35	48	82	182	258	260	426	214
<i>Справочно:</i>											
Доля природной ренты в стоимости продукции, %	64	71	63	64	63	65	78	77	74	78	66
Доля природной ренты, изымаемая в бюджет, %	9	17	29	34	42	55	68	78	72	79	77
<i>Нефтепродукты, поставляемые в дальнее зарубежье</i>											
Природная рента	36	97	58	61	76	102	158	220	200	346	123
Изъятие ренты в бюджет	8	19	36	43	46	60	132	192	201	308	157
<i>Справочно:</i>											
Доля природной ренты в стоимости продукции, %	39	56	40	41	42	44	45	51	43	51	32
Доля природной ренты, изымаемая в бюджет, %	22	19	63	70	60	58	83	87	100	89	128
<i>Нефтепродукты, поставляемые на внутренний рынок</i>											
Природная рента	20	58	63	50	72	105	120	167	159	243	112
Изъятие ренты в бюджет	3	5	7	20	23	32	60	80	86	130	60
<i>Справочно:</i>											
Доля природной ренты в стоимости продукции, %	29	47	46	41	47	50	43	50	43	48	34
Доля природной ренты, изымаемая в бюджет, %	13	8	11	40	31	31	50	48	54	53	54

Таблица 2.

Структура стоимости природного газа,  
поставляемого в дальнее зарубежье,  
долл./тыс. м куб.

	1999 г.	2000 г.	2001 г.	2002 г.	2003 г.	2004 г.	2005 г.	2006 г.	2007 г.	2008 г.	2009 г.
<i>Природный газ, поставляемый в дальнее зарубежье</i>											
Природная рента	43	81	94	75	91	92	129	180	187	310	200
Изъятие ренты в бюджет	7	11	17	13	15	49	59	83	82	130	117
<i>Справочно:</i>											
Доля природной ренты в стоимости продукции, %	78	83	79	73	73	70	71	74	70	76	70
Доля природной ренты, изымаемая в бюджет, %	16	13	18	18	16	53	46	46	44	42	59
<i>Природный газ, поставляемый на внутренний рынок</i>											
Природная рента	8	7	5	8	15	19	18	22	24	45	35
Изъятие ренты в бюджет	4	6	8	8	9	5	4	5	5	5	4
<i>Справочно:</i>											
Доля природной ренты в стоимости продукции, %	64	49	29	42	53	54	42	44	38	54	49
Доля природной ренты, изымаемая в бюджет, %	53	85	175	99	63	27	25	23	22	12	12

Умножая полученные показатели на объемы поставок по каждому направлению, мы получим общие объемы добавленной стоимости и природной ренты в стоимости углеводородов. Как показывает табл. 3, суммарная величина добавленной стоимости и ренты в долларовом выражении увеличилась к 2008 г. примерно в десять раз по сравнению с 1999 г. В период кризиса эти показатели резко снизились вслед за падением мировых цен.

Отметим, что, благодаря введению прогрессивной шкалы экспортных пошлин на нефть и нефтепродукты (с максимальной ставкой 65%) и привязке ставки НДС на нефть к мировым ценам на нее, уровень изъятия природной ренты в нефтяном секторе последовательно рос, достигнув 81% в среднем в 2006–2009 гг. В отличие от этого доля природной ренты, изымаемая в бюджет в газовом секторе, на протяжении 2001–2009 гг. оставалась устойчиво низкой, колеблясь (в зависимости от изменения внутренних и внешних цен) вокруг среднего уровня 38%. Не видно серьезных экономических причин для столь радикального различия в налогообложении двух углеводородных секторов.



**Таблица 3.** Размеры нефтегазового сектора и природной ренты в стоимости углеводородов, млрд долл.

	1999 г.	2000 г.	2001 г.	2002 г.	2003 г.	2004 г.	2005 г.	2006 г.	2007 г.	2008 г.	2009 г.
<i>Добавленная стоимость</i>											
Нефтяная отрасль	23	44	40	45	61	89	135	163	183	254	145
Газовая отрасль	16	21	22	22	29	34	46	60	64	98	66
<b>НГК всего</b>	<b>39</b>	<b>64</b>	<b>63</b>	<b>67</b>	<b>90</b>	<b>123</b>	<b>181</b>	<b>223</b>	<b>247</b>	<b>352</b>	<b>211</b>
<i>Природная рента в стоимости продукции</i>											
Нефтяная отрасль	13	30	26	28	38	57	93	119	130	193	92
Газовая отрасль	12	16	15	14	20	22	28	41	41	71	42
<b>НГК всего</b>	<b>25</b>	<b>46</b>	<b>41</b>	<b>42</b>	<b>58</b>	<b>80</b>	<b>121</b>	<b>160</b>	<b>170</b>	<b>264</b>	<b>134</b>

**Таблица 4.** Размеры нефтегазового сектора и природной ренты в цене нефти и газа, % ВВП

	1999 г.	2000 г.	2001 г.	2002 г.	2003 г.	2004 г.	2005 г.	2006 г.	2007 г.	2008 г.	2009 г.
<i>Добавленная стоимость</i>											
Нефтяная отрасль	11,8	16,8	13,2	13,1	14,1	15,0	17,6	16,5	14,1	15,2	11,7
Газовая отрасль	8,0	8,0	7,3	6,4	6,8	5,7	6,0	6,0	4,9	5,9	5,3
<b>НГК всего</b>	<b>19,8</b>	<b>24,7</b>	<b>20,5</b>	<b>19,5</b>	<b>20,9</b>	<b>20,7</b>	<b>23,6</b>	<b>22,6</b>	<b>19,0</b>	<b>21,1</b>	<b>17,1</b>
<i>Природная рента в стоимости продукции</i>											
Нефтяная отрасль	6,7	11,7	8,5	8,2	8,8	9,7	12,2	12,1	10,0	11,6	7,5
Газовая отрасль	6,1	6,2	4,9	4,1	4,6	3,8	3,7	4,1	3,1	4,3	3,4
<b>НГК всего</b>	<b>12,8</b>	<b>17,8</b>	<b>13,3</b>	<b>12,3</b>	<b>13,4</b>	<b>13,5</b>	<b>15,8</b>	<b>16,2</b>	<b>13,1</b>	<b>15,8</b>	<b>10,8</b>
<i>Природная рента, изымаемая в бюджет</i>											
Нефтяная отрасль	0,8	1,9	2,6	3,5	3,9	5,1	8,6	9,5	7,7	9,4	6,5
Газовая отрасль	1,5	1,5	1,9	1,6	1,5	1,6	1,5	1,6	1,2	1,4	1,3
<b>НГК всего</b>	<b>2,3</b>	<b>3,5</b>	<b>4,4</b>	<b>5,2</b>	<b>5,5</b>	<b>6,7</b>	<b>10,2</b>	<b>11,1</b>	<b>8,9</b>	<b>10,8</b>	<b>7,8</b>
<i>Доля природной ренты, изымаемой в бюджет, %</i>											
Нефтяная отрасль	12,2	16,6	30,2	43,5	45,0	52,3	71,1	79,0	77,2	81,0	86,6
Газовая отрасль	24,3	24,9	38,8	40,1	32,9	43,1	41,1	39,2	37,7	32,9	38,4
<b>НГК всего</b>	<b>18,0</b>	<b>19,5</b>	<b>33,4</b>	<b>42,4</b>	<b>40,9</b>	<b>49,7</b>	<b>64,1</b>	<b>68,9</b>	<b>67,7</b>	<b>68,0</b>	<b>71,6</b>

Отличие второй разновидности природной ренты, которую можно назвать скрытой или нереализованной, состоит в том, что она не входит в стоимость продукции и не наблюдается непосредственно.

Скрытая рента возникает как следствие практики субсидирования производства и потребления энергии. Так, если регулируемые государством цены устанавливаются на уровне ниже «равновесного», который сформировался бы в условиях рыночной среды (т.е. при свободной конкуренции, отсутствии торговых барьеров и налоговых преференций), это равносильно предоставлению отечественным потребителям субсидии. Ее величина равна разрыву между фактической стоимостью приобретаемого углеводородного сырья и его стоимостью в «равновесных» ценах. Обратной стороной установления заниженных цен служит уменьшение стоимости продукции нефтегазового сектора, т.е. сокращение величины природной ренты по сравнению с потенциально возможной.

Первый механизм «недобора» ренты состоит в поставках газа в другие страны по заниженным ценам в соответствии с решениями правительства. В среднем за 1999–2009 гг. цены на российский газ для ближнего зарубежья составили лишь 45% от цен для дальнего зарубежья.

Второй механизм связан с установлением государством низких регулируемых внутренних цен на газ. Потери ренты находятся путем сопоставления внутренней цены с равновесной (соответствующей свободному рыночному формированию цен), которая определяется как цена экспорта за вычетом дополнительных затрат на транспортировку газа до границы [Korlow, 2009]. Согласно нашим расчетам, в среднем за рассматриваемый период фактические цены внутреннего рынка (с учетом как производственных потребителей, так и населения) составляли лишь четверть от равновесных. Для населения разрыв еще сильнее: цены приобретения в среднем были в семь раз ниже равновесных цен.

Третий механизм потери ренты запускается использованием экспортных пошлин. Их введение, по сути, представляет собой выборочное налогообложение поставок на внешний рынок, т.е. освобождение от части налогов внутренних поставок. Изъятие ренты при экспорте нефти и газа (проводимое с помощью НДС и экспортных пошлин), как показано выше, нельзя считать избыточным. Следовательно, правительство могло бы претендовать на получение такой же ренты от углеводородов, реализуемых на внутреннем рынке. Это можно осуществить, например, отменив экспортные пошлины, одновременно повысив НДС (до уровня, равного суммарной нынешней величине НДС и экспортных пошлин). Отметим, что для поставок сырой нефти в дальнее зарубежье экспортные пошлины примерно в 2,5 раза выше, чем уплачиваемый НДС. Применение экспортных пошлин обеспечивает льготный налоговый режим для внутренних поставок (уменьшая здесь рентные платежи в 3,5 раза) т.е. предоставляет производителям субсидии на такие поставки.

Наконец, еще один (четвертый) вариант потери ренты состоит в нерациональном использовании углеводородного сырья. В российской экономике таким нерациональным способом служит переработка нефти. Проведенные расчеты свидетельствуют, что *суммарная экспортная цена нефтепродуктов, получаемых в России из тонны нефти (не говоря об их внутренней цене), устойчиво ниже, чем экспортная цена этой нефти*. Если же учесть еще стоимость дополнительных расходов на переработку, то оказывается, что ее результатом становится уменьшение ренты в среднем примерно на треть от стоимости исходного сырья. Это значит, что с экономической точки зрения переработка нефти в ее нынешнем состоянии приносит стране значительные убытки. Такая парадоксальная ситуация объясняется крайней отсталостью данной отрасли. По показателю глубины переработки нефти Россия сильно отстает даже от других стран СНГ: согласно оценкам Института энергетической стратегии, среднее за 2007–2010 гг. значение этого показателя составило в России 73% по сравнению с 80% в странах Средней Азии (Казахстан, Туркменистан и Узбекистан) и 92% в странах ОПЕК и ОАПЕК (организация арабских стран-экспортеров нефти)<sup>1</sup>.

Всякая неполученная рента имеет своего донора – экономический субъект, упускающий возможную прибыль. Если потери ренты связаны с предоставлением субсидий (это происходит во всех вариантах, кроме четвертого), донор служит их источником. В случае поставки углеводородов по заниженным ценам (будь то на внутренний или внешний рынок) упускают прибыль отечественные производители. Как уже отмечалось, используя экспортные пошлины вместо более высоких значений НДС, правительство тем самым дает налоговые льготы производителям в части продукции, поставляемой на внутренний рынок. Производители затем полностью или частично доводят полученные субсидии до конечных потребителей. Таким образом, государство обычно выступает в качестве одного из доноров, а производители могут служить как донорами субсидий, так и их бенефициарами. В частности, нефтяные компании частично получали субсидии (через механизм экспортных пошлин), частично несли потери (из-за относительно низких внутренних цен и в результате переработки нефти). Ниже мы даем сальдо выигрыша и потерь нефтяного сектора.

Приведенные в табл. 5 результаты расчетов показывают, что наиболее крупные потери ренты возникают в результате субсидирования внутренних потребителей газа (как промышленных, так и бытовых). Несмотря на то, что размер таких субсидий существенно снизился (до 5,6% ВВП в 2009 г. по сравнению с примерно 11,5% ВВП в начале 2000-х годов), они остаются очень значительны-

---

<sup>1</sup> Российская бизнес-газета. 2010. 21 сентября.

ми. Следующий по величине элемент потерь ренты – переработка нефти (3,7% ВВП в 2009 г.). В 2008–2009 гг. безвозвратные потери в нефтепереработке достигли 46–49 млрд долл. Таким образом, они были сопоставимы, например, с суммарными расходами бюджетной системы на национальную экономику (составлявшими до кризиса порядка 4% ВВП). Возможность наносить стране ущерб в таких размерах (как и безубыточно поставлять на внутренний рынок относительно дешевый газ) обеспечивается сочетанием двух факторов:

- некоторого «запаса» доходности экспортных поставок, создаваемого неполным изъятием ренты в этом потоке (что помогает сохранять рентабельность, несмотря на потери);
- предоставляемых государством налоговых субсидий. В нефтяном секторе фактически действуют три режима налогообложения: а) полный (для сырой нефти, поставляемой на экспорт), б) промежуточный (для экспортируемых нефтепродуктов, где взимается сниженная экспортная пошлина – в среднем в последние годы порядка 56% от пошлины на сырую нефть), в) облегченный (для нефтепродуктов, поставляемых на внутренний рынок), где рента изымается только за счет НДС. Использование пониженных экспортных пошлин на нефтепродукты не приводит к снижению цен их реализации и, следовательно, не связано с сокращением ренты. Однако пониженные ставки изъятия ренты при экспорте нефтепродуктов делают их рентабельными, в противном случае компаниям пришлось бы отказаться от такого экспорта.

Суммарная величина скрытой ренты составила в 2009 г. 9,7% ВВП. Таким образом, по размерам она была близка к реализованной нефтегазовой ренте. В среднем за период соотношение скрытой и «явной» ренты составляло 83%, т.е. они имели сопоставимые размеры.

Политика правительства предусматривает на ближайшие годы резкое повышение внутренних цен на газ: за 2008–2013 гг. он подорожает для всех категорий потребителей в 2,8 раза (для сравнения: потребительские цены вырастут за этот период на 65%). В итоге субсидии внутренним потребителям резко сократятся. Однако при этом не предусмотрено повышение рентных платежей из газовой отрасли, таким образом, весь выигрыш от сокращения субсидий получают производители. Расчеты показывают, что результатом опережающего (по сравнению с общим уровнем цен в экономике) повышения регулируемых цен на газ станет перераспределение около 2% ВВП в пользу газовой отрасли. Как мы видели, *уровень изъятия ренты в газовой отрасли уже сейчас низок, дополнительное значительное перераспределение ренты в ее пользу представляется новым проявлением политики «мягких бюджетных ограничений»* –

компенсации отрасли слабых результатов ее деятельности. Платой за это станет существенное снижение конкурентоспособности российских производителей из-за роста их издержек.

**Таблица 5.** Итоговые расчеты потери ренты в нефтяной и газовой отраслях, % ВВП

	1999 г.	2000 г.	2001 г.	2002 г.	2003 г.	2004 г.	2005 г.	2006 г.	2007 г.	2008 г.	2009 г.
Газовый сектор											
<b>Потеря ренты – всего</b>	<b>6,6</b>	<b>11,9</b>	<b>12,8</b>	<b>8,5</b>	<b>8,3</b>	<b>5,9</b>	<b>6,9</b>	<b>7,7</b>	<b>6,1</b>	<b>7,9</b>	<b>5,9</b>
<i>Доноры:</i>											
государство	0,5	0,7	1,6	0,6	0,6	2,9	3,1	3,4	2,8	3,4	2,9
отечественные производители	6,1	11,1	11,2	7,9	7,7	3,0	3,8	4,3	3,3	4,5	3,0
<i>Бенефициары:</i>											
иностранное государства	-0,3	0,7	1,1	0,7	0,6	0,5	0,6	0,4	0,4	0,5	0,3
внутренние потребители	6,9	11,2	11,7	7,9	7,7	5,3	6,2	7,2	5,7	7,4	5,6
Нефтяной сектор											
<b>Потеря ренты – всего</b>	<b>4,5</b>	<b>5,2</b>	<b>2,8</b>	<b>3,4</b>	<b>2,5</b>	<b>2,0</b>	<b>4,3</b>	<b>3,7</b>	<b>3,7</b>	<b>4,2</b>	<b>3,8</b>
<i>Доноры:</i>											
государство	3,9	3,8	2,8	3,4	2,5	2,0	4,3	3,7	3,7	4,2	3,8
отечественные производители	0,6	1,4	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
<i>Бенефициары:</i>											
внутренние потребители	0,9	2,3	0,5	0,7	0,4	0,5	1,0	1,1	0,8	1,2	0,1
безвозвратные потери	3,7	2,8	2,3	2,8	2,0	1,5	3,3	2,6	2,9	2,9	3,7
<b>Итого потеря ренты в нефтегазовом секторе</b>	<b>11,2</b>	<b>17,1</b>	<b>15,6</b>	<b>11,9</b>	<b>10,8</b>	<b>7,9</b>	<b>11,2</b>	<b>11,4</b>	<b>9,8</b>	<b>12,1</b>	<b>9,7</b>

Наименее оправданными выглядят субсидии нефтеперерабатывающей отрасли. Установление пониженных ставок экспортных пошлин на нефтепродукты обосновывалось задачей сместить структуру экспорта от первичного сырья к обработанной продукции. Данная мера, действительно, стимулирует экспорт нефтепродуктов. Однако, как мы показали, сама задача поставлена неверно, поскольку в итоге российская экономика ежегодно теряет примерно

3% ВВП. Эта ситуация иллюстрирует важные негативные последствия субсидирования – искажая цены, оно формирует неверные оценки результатов экономической деятельности. Как государство, так и бизнес теряют возможность адекватно оценить эффективность того или иного производства или инвестиционного проекта, и соответственно их решения могут оказаться не только не оптимальными, но даже ведущими к значительным убыткам (как в случае нефтепереработки). Субсидирование здесь осуществляется за счет льготного налогообложения нефтепереработки, таким образом, данная ситуация иллюстрирует негативные последствия использования налоговых стимулов.

**Таблица 6.** Итоговые расчеты распределения суммарной нефтегазовой ренты, % ВВП

	1999 г.	2000 г.	2001 г.	2002 г.	2003 г.	2004 г.	2005 г.	2006 г.	2007 г.	2008 г.	2009 г.
<b>Нефтегазовая рента – всего</b>	<b>24,0</b>	<b>34,9</b>	<b>28,9</b>	<b>24,2</b>	<b>24,2</b>	<b>21,4</b>	<b>27,0</b>	<b>27,6</b>	<b>22,9</b>	<b>27,9</b>	<b>20,5</b>
<i>Реализованная рента:</i>											
изымает государство	2,3	3,5	4,4	5,2	5,5	6,7	10,2	11,1	8,9	10,8	7,8
остается у производителей	10,5	14,4	8,9	7,1	7,9	6,8	5,7	5,0	4,2	5,1	3,1
<i>Скрытая рента:</i>											
субсидии иностранным государствам	-0,3	0,7	1,1	0,7	0,6	0,5	0,6	0,4	0,4	0,5	0,3
субсидии внутренним потребителям нефтепродуктов и газа	7,8	13,5	12,2	8,5	8,1	5,8	7,2	8,4	6,5	8,7	5,6
безвозвратные потери в нефтеперерабатывающем секторе	3,7	2,8	2,3	2,8	2,0	1,5	3,3	2,6	2,9	2,9	3,7

На самом деле необходимо стимулировать не переработку в ее нынешнем виде, а глубокую модернизацию отрасли. Если бы правительство не использовало налоговых субсидий, то отрасль стояла бы перед выбором: отказаться от нефтепереработки (сэкономив тем самым стране 3% ВВП), либо повысить ее производительность (что принесло бы экономике еще больший выигрыш). Действующее льготное налогообложение нефтепереработки, напротив, делает модернизацию необязательной. Государство берет на себя убытки от неэффективной переработки нефти, ослабляя тем самым стимулы для перевооружения

отрасли. Использование значительной части природной ренты на субсидирование нефтепереработки создает видимость ее рентабельности даже в нынешнем виде и таким образом устраняет императив модернизации. Следовательно, *политика субсидирования фактически приводит к консервации глубокого технологического отставания нашей нефтепереработки.*

Широкое использование субсидий, по сути, означает проведение так называемой политики «мягких бюджетных ограничений», т.е. искусственное поддержание властями на плаву участников экономики, которые по рыночным законам должны быть признаны банкротами. Исследования ряда экономистов (включая Я. Корнаи, Э. Маскина и других) показали, что подобная политика снижает эффективность экономики (см., например: [Kornai, Maskin, Roland, 2003]). Субсидии могут быть целесообразны, только если они предоставляются на ограниченное время, минимально необходимое для восстановления конкурентоспособности. Причем этот срок не должен пересматриваться (такая практика также подрывает стимулы для модернизации).

*Мягкие бюджетные ограничения могут быть особенно опасны в сочетании с монопольным положением на рынке.* Иллюстрацией может служить ситуация в газовой отрасли, где (даже если не брать провальный 2009 г.) добыча выросла за 2000–2008 гг. на 12,2% (в среднем на 1,3% в год), а добавленная стоимость, по нашим оценкам, увеличилась лишь на 0,2%. Для сравнения, ВВП в целом вырос за этот период на 82% (при среднегодовых темпах 6,9%), добыча нефти на 60%, а добавленная стоимость в нефтяной отрасли на 59%.

Подводя итоги, следует подчеркнуть, что к числу главных проблем нефтегазового сектора можно отнести мягкие бюджетные ограничения в нефтеперерабатывающей и газовой промышленности, результатом чего становятся бессмысленные масштабные потери природной ренты и консервация глубокой технологической отсталости отрасли. Отказ от решения этих проблем создает серьезную угрозу конкурентоспособности российской экономики в целом.

## Литература

*Гурвич Е., Вакуленко Е., Кривенко П.* Циклические свойства бюджетной политики в нефтедобывающих странах // Вопросы экономики. № 2. 2009.

*Gaddy C., Ickes B.* Resource Rents and the Russian Economy // Eurasian Geography and Economics. 2005. Vol. 46. № 8.

*Koplow D.* Measuring Energy Subsidies Using the Price-Gap Approach. International Institute for Sustainable Development, 2009.

*Kornai J., Maskin E., Roland G.* Understanding the Soft Budget Constraint // Journal of Economic Literature. 2003. Vol. 41. Iss. 4.

# ПРОВЕДЕНИЕ ДЕНЕЖНО- КРЕДИТНОЙ ПОЛИТИКИ В МОНЕТАРНОМ СОЮЗЕ В УСЛОВИЯХ НЕОПРЕДЕЛЕННОСТИ

---

Обычным для экономической науки способом разработки оптимальной монетарной политики является ее построение в рамках конкретной модели экономики. Однако никто не может со стопроцентной точностью описать чрезвычайно сложную структуру экономики. Вследствие этого никто не может быть абсолютно уверен в предсказательной силе конкретной модели. Это утверждение отражает проблему *неопределенности относительно истинной структуры экономики*.

Возможным решением данной проблемы является поиск устойчивой к неопределенности политики, которая приводит к достаточно хорошим последствиям при любых возможных спецификациях экономической модели. Основным вопросом, на который отвечает литература по устойчивой к неопределенности политике, касается сравнения устойчивой политики и простой оптимальной для конкретной модели. Классический вывод, получивший название «консерватизм Брэйнарда», утверждает, что устойчивая к неопределенности политика менее агрессивно реагирует на шоки по сравнению с политикой, сконструированной на основе конкретной модели без учета ее неопределенности.

Среди множества работ, посвященных построению устойчивой к неопределенности политики еврозоны, часть подтверждает наличие «консерватизма Брэйнарда», часть нет. Однако все эти работы основаны на моделях Евросоюза, оперирующих исключительно агрегированными данными. Очевидно, что таким образом невозможно учесть сложные взаимодействия между гетерогенными экономиками.

В нашем анализе мы используем модель монетарного союза двух стран с микроэкономическими обоснованиями. Оценка той или иной политики осно-



вана на микрообоснованном критерии общественного благосостояния. В результате проведенного анализа мы выяснили, что основные характеристики устойчивой политики существенно зависят от одного специфического параметра – желания центрального банка разрабатывать именно устойчивую политику или от его опасений относительно ошибочной спецификации.

## 1. Базовая модель монетарного союза

В этой работе мы используем оптимизационную модель монетарного союза двух стран с жесткими ценами, описанную в работе [Benigno, 2004]. Рассмотрим монетарный союз, состоящий из двух регионов ( $H$  и  $F$ ). Население союза представляет собой единичный континуум, причем агенты из интервала  $[0, n)$  проживают в регионе  $H$ , а остальные  $[n, 1]$  – в регионе  $F$ . Мобильность населения отсутствует. В каждом регионе фискальная политика определяется независимым местным правительством. Для простоты мы предполагаем, что правительства проводят одинаковую политику. Монетарная политика определяется единым центральным банком, который выбирает значение номинальной процентной ставки.

Каждое домашнее хозяйство является одновременно продавцом одного дифференцированного продукта на монополистически конкурентном рынке и потребителем всех типов продукции, производимых в союзе. Количество товаров, производимых в регионе  $H$ , равно  $n$ , таким образом, этот параметр также обозначает экономический размер региона или долю совокупного ВВП, произведенную на территории региона  $H$ . Аналогично, экономический размер второго региона равен  $(1 - n)$ .

Производители в модели являются монополистами на рынках своего товара. Они устанавливают свои цены в соответствии с моделью Кальво. Каждый продавец с вероятностью  $1 - \alpha$  в текущем периоде сможет поменять свою цену.

Таким образом, динамика модели может быть представлена следующей системой уравнений:

$$E_t \hat{C}_{t+1}^W = \hat{C}_t^W + \rho^{-1} (\hat{R}_t - E_t \pi_{t+1}^W), \quad (1)$$

$$\hat{Y}_t^H = (1 - n) \hat{T}_t + \hat{C}_t^W + g_t^H, \quad (2)$$

$$\hat{Y}_t^F = -n \hat{T}_t + \hat{C}_t^W + g_t^F, \quad (3)$$

$$\hat{T}_t = \hat{T}_{t-1} + \pi_t^F - \pi_t^H, \quad (4)$$

$$\pi_t^H = (1-n)k_T^H (\hat{T}_t - \tilde{T}_t) + k_C^H y_t^W + \beta E_t \pi_{t+1}^H, \quad (5)$$

$$\pi_t^F = -nk_T^F (\hat{T}_t - \tilde{T}_t) + k_C^F y_t^W + \beta E_t \pi_{t+1}^F, \quad (6)$$

где  $\tilde{X}_t$  – отклонение логарифма равновесного значения переменной  $X$  при гибких ценах от стационарного состояния;  $\hat{X}_t$  – то же самое для жестких цен;  $C$  – индекс потребления;  $R$  – номинальная ставка процента;  $T$  – условия торговли между странами;  $\pi$  – уровень инфляции;  $Y$  – объем выпуска;  $g$  – объем государственных закупок;  $\rho$  – коэффициент несклонности к риску. Индексы  $F$ ,  $H$ ,  $W$  относятся соответственно к регионам  $F$ ,  $H$  и ко всему монетарному союзу в целом.

Первые три уравнения определяют отношения между потреблением, государственными закупками, разрывом ВВП, ожидаемой будущей инфляцией и номинальной процентной ставкой. Для упрощения последующих расчетов предположим, что действия фискальных властей известны заранее, т.е.  $g_{t+1}^i = E_t g_{t+1}^i$ . Тогда мы можем переписать уравнения (1)–(3) в виде (7):

$$E_t y_{t+1}^W = y_t^W + \frac{1}{\rho} [\hat{R} - E_t \pi_{t+1}^W]. \quad (7)$$

Это уравнение представляет собой стандартного вида кривую IS для валютной зоны в целом и определяет разрыв ВВП, который положительно зависит от своего будущего ожидаемого значения, от ожидаемой будущей инфляции и отрицательно – от ставки процента.

Уравнения (5)–(6) описывают совокупное предложение регионов и имеют вид новокейнсианских кривых Филлиписа. Темп инфляции в каждом регионе определяется общим для монетарного союза разрывом ВВП, ожидаемой инфляцией и условиями торговли. Уравнение (4) следует непосредственно из определения условий торговли и представляет собой динамику этой переменной, которая определяется ее прошлыми значениями и инфляцией в обоих регионах.

Таким образом, центральный банк должен устанавливать номинальную процентную ставку таким образом, чтобы максимизировать общественное благосостояние, принимая в качестве ограничения уравнения (4)–(7). Таким образом, в модели четыре впередсмотрящие переменные  $T_t$ ,  $\pi_t^H$ ,  $\pi_t^F$ ,  $y_t^W$  и одна переменная управления, инструмент центрального банка  $R_t$ .

## 1.1. Критерий общественного благосостояния

Мы предполагаем, что центральный банк является беневолянтным, т.е. старается максимизировать общественное благосостояние  $W$ , заданное как

$$W = E_0 \left\{ \sum_{t=0}^{+\infty} \beta^t w_t \right\} - \text{ожидаемая приведенная будущая средняя полезность жителя}$$

$$\text{для союза } w_t \equiv U(C_t) - \int_0^1 V(y_t(j), z_t^i) dj.$$

Аппроксимация второго порядка функции общественного благосостояния основана на работе [Beetsma, 2005] и дает следующий критерий выбора политики:

$$W = -E_0 \left\{ \sum_{t=0}^{+\infty} \beta^t L_t \right\}, \text{ где однопериодные потери задаются выражением}$$

$$L_t = \Lambda \left[ y_t^w \right]^2 + n(1-n) \Gamma \left[ \hat{T}_t - \tilde{T}_t \right]^2 + \gamma_H \left( \pi_t^H \right)^2 + \gamma_F \left( \pi_t^F \right)^2.$$

## 1.2. Калибровка

В нашей калибровке мы в основном следуем за работой [Benigno, 2004]. Так, мы выбираем значение параметра  $\eta$  равное 0,67, параметр межвременного замещения  $\beta$  равен 0,99. Степень монополистической конкуренции  $\sigma$  равна 7,66. Коэффициент несклонности к риску  $\rho$  установлен на уровне 1/6.

Кроме того, предполагаем, что  $\tilde{T}_t$  следует авторегрессионному процессу следующего вида:  $\tilde{T}_t = 0,95\tilde{T}_{t-1} + \varepsilon_t$ , где  $\varepsilon_t$  означает белый шум с дисперсией 0,0086.

Наибольшая сложность касается выбора параметра инерционности цен  $\alpha^i$ . При этом мы не следуем за работой [Benigno, 2004], где предполагалось, что эти показатели могут принимать любые значения из достаточно широкого диапазона. Напротив, наш выбор этих значений основан на оценках ценовых режимов, приведенных в исследовании [Vermeulen et al., 2007].

**Таблица 1.**

Частота изменения цен и доля страны в европейском ВВП, %

	Частота изменения цен $(1 - \alpha)^*$	Доля страны в ВВП еврозоны, %
Бельгия	0,24	4,0
Франция	0,25	22,3
Германия	0,22	34,3
Италия	0,15	17,5
Португалия	0,23	1,5
Испания	0,21	8,5
Еврозона	0,22	

\* Источник: [Vermeulen et al., 2007].

Взяв значение частоты изменения цен как прокси для вероятности изменения цен  $(1 - \alpha)$ , мы разделили все страны на две группы в соответствии со следующей схемой: если частота изменения цен меньше или равна 0,22 (среднее значение для региона), то страна входит в регион  $H$ . Если же частота выше, чем 0,22, страна является частью региона  $F$ . Таким образом, регион  $H$  состоит из Германии, Испании и Италии, а регион  $F$  – из Франции, Бельгии и Португалии.

Регион  $H$  производит примерно 70% европейского ВВП, таким образом, мы устанавливаем экономический размер этого региона на уровне 0,7. С учетом весов из табл. 1 мы полагаем, что средняя вероятность изменения цены фирмы в регионе  $H$  равна 0,17, а аналогичный показатель для региона  $F$  составляет 0,23.

Эти значения соответствуют следующим значениям параметрам модели:  $\alpha^H = 0,83$  и  $\alpha^F = 0,77$ .

### 1.3. Оптимизационная задача центрального банка

В соответствии с предложенной калибровкой мы рассчитываем численные значения основных параметров модели. Тогда задача центрального банка может быть переписана следующим образом в приведенной форме:

$$\begin{aligned}
 e_{t+1} &= 0,95e_t + \varepsilon_{t+1}, \\
 E_t(\hat{T}_{t+1} - \tilde{T}_{t+1}) &= 1,044(\hat{T}_t - \tilde{T}) - 0,01515y_t^W - 1,01\pi_t^H + 1,01\pi_t^F + 0,95e_t, \\
 E_t y_{t+1}^W &= -0,012(\hat{T}_t - \tilde{T}) + 1,04y_t^W - 4,24\pi_t^H - 1,82\pi_t^F + 6R, \\
 E_t \pi_{t+1}^H &= -0,003(\hat{T}_t - \tilde{T}) - 0,005y_t^W + 1,01\pi_t^H, \\
 E_t \pi_{t+1}^F &= 0,014(\hat{T}_t - \tilde{T}) - 0,0098y_t^W + 1,01\pi_t^F.
 \end{aligned} \tag{8}$$

Или в кратком виде:

$$\begin{bmatrix} e_{t+1} \\ E_t z_{t+1} \end{bmatrix} = A \begin{bmatrix} e_t \\ z_t \end{bmatrix} + BR + C\varepsilon_{t+1}, \tag{9}$$

где  $z_t = \begin{bmatrix} \tilde{T}_t - \hat{T}_t \\ y_t^W \\ \pi_t^H \\ \pi_t^F \end{bmatrix}$  – вектор вперёдсмотрящих переменных;  $E_t z_{t+1}$  – математическое ожидание периода  $t$  вектора этих переменных  $z$  следующего периода

да;  $A$  – это матрица размером  $5 \times 5$  соответствующих коэффициентов в (9).

$$B = \begin{bmatrix} 0 \\ 0 \\ 1 \\ 0 \\ 0 \end{bmatrix} \text{ и } C = \begin{bmatrix} 1 \\ 0 \\ 0 \\ 0 \\ 0 \end{bmatrix} \text{ показывают, что только преддетерминированная пере-}$$

менная  $e_t$  может быть подвергнута влиянию шоков.

Минимизируемая функция потерь может быть переписана в следующей форме:

$$E_0 \sum_{t=0}^{\infty} \beta^t (x'_t Q x_t), \quad (10)$$

где  $x_t = \begin{bmatrix} e_t \\ z_t \end{bmatrix}$  и  $Q$  – матрица размером  $5 \times 5$ :

$$Q = \begin{bmatrix} 0 & 0 & 0 & 0 & 0 \\ 0 & n(1-n)\Gamma & 0 & 0 & 0 \\ 0 & 0 & \Lambda & 0 & 0 \\ 0 & 0 & 0 & \gamma_H & 0 \\ 0 & 0 & 0 & 0 & 1-\gamma_H \end{bmatrix}.$$

Таким образом, задача (8) может быть переписана так:

$$\begin{aligned} \min_R E_0 \sum_{t=0}^{\infty} \beta^t (x'_t Q x_t), \\ \text{s.t. } \begin{bmatrix} e_{t+1} \\ E_t z_{t+1} \end{bmatrix} = A \begin{bmatrix} e_t \\ z_t \end{bmatrix} + BR + C \varepsilon_{t+1}. \end{aligned} \quad (11)$$

## 2. Робастный контроль

### 2.1. Неопределенность относительно истинной модели экономики

При моделировании программы поиска устойчивой политики мы используем подход, впервые примененный Хансеном и Саргентом в 2001 г., также называемый робастным контролем.

Мы предполагаем, что центральный банк имеет в своем распоряжении базовую модель экономики (8). Однако он опасается, что имеющаяся конст-

рукция может недостаточно соответствовать действительности, т.е. существует риск неправильной спецификации. Иными словами, допускаются некоторые искажения модели по сравнению с реальной экономикой.

Для того чтобы учесть наиболее вероятные искажения, мы ограничиваем анализ лишь классом альтернативных моделей, которые не могут с легкостью быть различены с помощью статистических методов. Причина, по которой мы вводим подобное ограничение, достаточно прозрачна – для существенных искажений, когда реальная экономика значительно отличается от базовой модели, нет никакого смысла принимать какие-либо решения на основе модели, которая заведомо неверна. В таком случае скорее требуется разработка не устойчивой к неопределенности политики, а новой модели.

Таким образом, задача центрального банка из программы поиска оптимальной политики в рамках базовой модели превращается в поиск политики, которая приводит к приемлемому функционированию экономики при любой реализации такого искажения. Для этой цели применяется минимаксный критерий – устойчивой к неопределенности политикой является такая, что приводит к наименьшим потерям благосостояния при наихудшей возможной реализации искажений.

Далее мы предполагаем, что искажения в модель привносятся в виде некоторых дополнительных шоков  $v_{t+s}$ , которые прибавляются к обычным статистическим ошибкам  $\varepsilon_{t+s}$  в модели (8) и генерируются неким дополнительным агентом – «недоброжелательной природой», задачей которого является максимизация потерь общества. Таким образом, поиск устойчивой политики может быть сформулирован как одновременная игра с нулевой суммой между этим доброжелательным агентом и центральным банком. Агенты одновременно принимают решения: доброжелательный агент определяет значение стратегического шока  $v_{t+s}$ , а центральный банк выбирает уровень процентной ставки.

## 2.2. Задача робастного оптимального контроля

Мы предполагаем, что должно соблюдаться следующее межвременное ограничение доброжелательной природы:

$$E_0 \sum_{t=0}^{\infty} \beta^t v_{t+1}' v_{t+1} \leq \eta, \quad (12)$$

где  $v_t$  представляет собой вектор искажений, произведенных доброжелательной природой. Кроме того,  $\eta$  – общая величина возможной ошибки спе-

цификации. Другими словами, (12) представляет собой допустимый набор искажений, обсуждавшихся ранее.

Такое представление возможного набора моделей соответствует *прямой задаче робастного контроля*, которая выглядит следующим образом:

$$\begin{aligned} \min_R \max_{\nu} E_0 \sum_{t=0}^{\infty} \beta^t (x_t' Q x_t), \\ \text{s.t.} \begin{bmatrix} e_{t+1} \\ E_t z_{t+1} \end{bmatrix} = A \begin{bmatrix} e_t \\ z_t \end{bmatrix} + BR + C (\varepsilon_{t+1} + \nu_{t+1}), \\ E_0 \sum_{t=0}^{\infty} \beta^t \nu_{t+1}' \nu_{t+1} \leq \eta. \end{aligned} \quad (13)$$

Размах возможных искажений  $\eta$  определяется опасениями центрального банка по поводу неправильной спецификации: больший страх означает большие возможности недоброжелательного агента и большие возможные отклонения базовой модели от истинной, т.е. большее значение  $\eta$ .

Также мы можем переписать программу (13) в следующей форме:

$$\begin{aligned} \min_R \max_{\nu} \sum_{t=0}^{\infty} \beta^t L_t(R, \nu), \\ \sum_{t=0}^{\infty} \beta^t D_{t+1}(\nu) \leq \eta, \end{aligned} \quad (14)$$

где  $R$  представляет собой последовательность решений центрального банка и  $\nu$  – последовательность стратегических шоков, произведенных недоброжелательной природой:  $D_{t+1}(\nu) = \nu_{t+1}' \nu_{t+1}$ .

Другой возможной формулировкой задачи робастного контроля является мультипликативная или косвенная программа:

$$\begin{aligned} \min_R \max_{\nu} E_0 \sum_{t=0}^{\infty} \beta^t (x_t' Q x_t - \theta \nu_{t+1}' \nu_{t+1}), \\ \text{s.t.} \begin{bmatrix} e_{t+1} \\ E_t z_{t+1} \end{bmatrix} = A \begin{bmatrix} e_t \\ z_t \end{bmatrix} + BR + C (\varepsilon_{t+1} + \nu_{t+1}), \end{aligned} \quad (15)$$

где  $\theta$  представляет собой набор всех возможных отклонений базовой модели от истинной экономики. Когда параметр  $\theta$  принимает небольшое значение, этот набор велик, и наоборот, когда  $\theta$  большое, возможны лишь очень ограниченные искажения.

Перепишем эту программу в таком же виде, что и (14):

$$\min_R \max_v \sum_{t=0}^{\infty} \beta^t L_t(R, v) - \theta \sum_{t=0}^{\infty} \beta^t D_{t+1}(v). \quad (16)$$

Решение обеих задач, прямой и косвенной, является аналогичным и может быть представлено в следующем виде, основанном на [Giordani, Soderlind, 2004]:

$$R_t = \left( Z_{\lambda\theta} Z_{k\theta}^{-1} \right)_R \begin{bmatrix} e_t \\ \rho_t^z \end{bmatrix}. \quad (17)$$

Выражение (17) иллюстрирует оптимальную устойчивую к неопределенности политику, которая формулируется как некоторая реакция на значения преддетерминированной переменной и теневые стоимости впередсмотрящих переменных.

### 2.3. Определение возможного набора моделей $\theta$

Следуя за работой [Dennis, 2003], мы выбираем величину этого параметра на основе задания вероятности выявления ошибки спецификации. Основная идея этого подхода заключается в том, что модели из доступного набора не могут быть легко различены на основе имеющейся информации. Иными словами, центральный банк не может с уверенностью определить, какая модель лежит в основе наблюдаемой действительности.

Первая ситуация, когда недоброжелательный агент использует все доступные ему ресурсы для воздействия на модель, называется наихудшей реализацией  $W$ . Второй случай, когда этот агент не предпринимает никаких действий, называется базовым случаем или аппроксимирующей моделью  $A$ . Следовательно, согласно этому методу, центральный банк должен быть не в состоянии различить эти модели,  $W$  и  $A$ , даже используя всю доступную информацию.

Вероятность ошибки  $\pi(\theta)$  :

$$\pi(\theta) = \Pr(L_A > L_W | W) / 2 + \Pr(L_W > L_A | A) / 2, \quad (19)$$

где  $L$  – функция максимального правдоподобия. Таким образом, первая часть выражения представляет собой вероятность принятия наихудшей реализации за базовый случай, а вторая часть показывает вероятность принятия базового случая за наихудшую реализацию.



Эта вероятность рассчитывается с помощью симуляций и зависит от параметра  $\theta$ . Таким образом, мы должны выбрать допустимую вероятность ошибки и рассчитать соответствующий размер неопределенности. Низкая  $\pi(\theta)$  означает высокий страх перед неверной спецификацией и высокое предпочтение устойчивости (или низкое значение  $\theta$ ).

## 2.4. Некоторые счетные результаты

Мы проанализировали различные варианты устойчивости политики. Результаты представлены в табл. 2.

**Таблица 2.** Параметры устойчивой к неопределенности

монетарной политики  $R_t = \left( Z_{\lambda\theta} Z_{k\theta}^{-1} \right)_R \begin{bmatrix} e_t \\ \rho_t^z \end{bmatrix}$

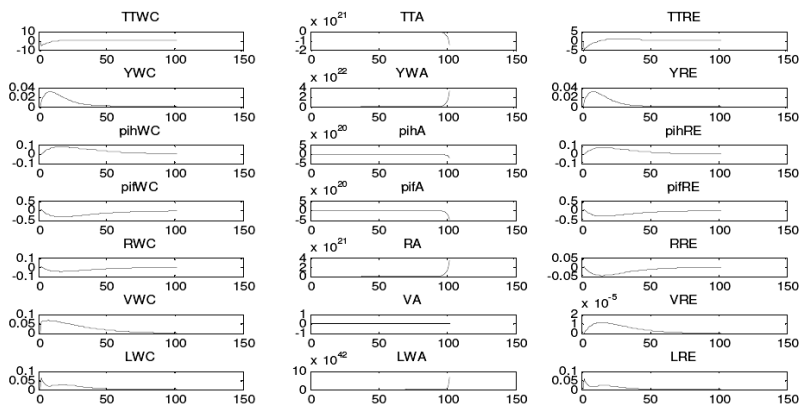
	$\theta$	$r_1$	$r_2$	$r_3$	$r_4$	$r_5$
Вероятность обнаружения ошибки						
20%	1,11	0,0025	-0,614	-29,1285	0,0394	0,1278
30%	1,8797	0,0023	-0,615	-29,1285	0,0394	0,1278
40%	1,8816	0,0022	-0,615	-29,1285	0,0394	0,1278
50%	2000	0,0020	-0,616	-29,1285	0,0394	0,1278

Наиболее важным для нас является первый коэффициент  $r_1$ , отражающий реакцию монетарной политики на изменения условий торговли. Так как именно эта переменная в модели подвержена шокам, коэффициент  $r_1$  также отражает реакцию политики на шоки. Если мы трактуем модуль соответствующего коэффициента как степень агрессивности политики, мы видим, что агрессивность реакции на шоки  $e_t$  растет при увеличении предпочтительности устойчивой политики. Это может быть объяснено следующим образом: при больших опасениях неправильной спецификации центральный банк допускает, что вероятность того, что экономический шок – это не просто статистическая ошибка, а действия недоброжелательного агента, будет выше.

Другое важное наблюдение касается направления реакции на такой шок: если происходит положительный шок условий торговли, центральный банк повышает ставки. В этом утверждении заложена прозрачная интуиция: со-

гласно (8) такой шок увеличивает инфляцию в регионе  $H$  и сокращает инфляцию во второй части союза. Однако согласно виду функции потерь центрального банка наибольшее беспокойство вызывает именно инфляция в регионе с наибольшей ценовой инертностью, т.е. в регионе  $H$ . Таким образом, оптимальной реакцией на такой шок является именно увеличение ставки процента, чтобы сократить инфляцию в регионе  $H$ .

Функции импульсного отклика на однократный единичный шок условий торговли приведены на рис. 1, где используются следующие обозначения:  $TT$  – условия торговли,  $V$  – стратегический шок,  $pih$  и  $piF$  – инфляция в регионах  $H$  и  $F$ .



**Рис. 1.** Шок условий торговли при наихудшей реализации, в базовой модели и в модели с рациональными ожиданиями без учета неопределенности

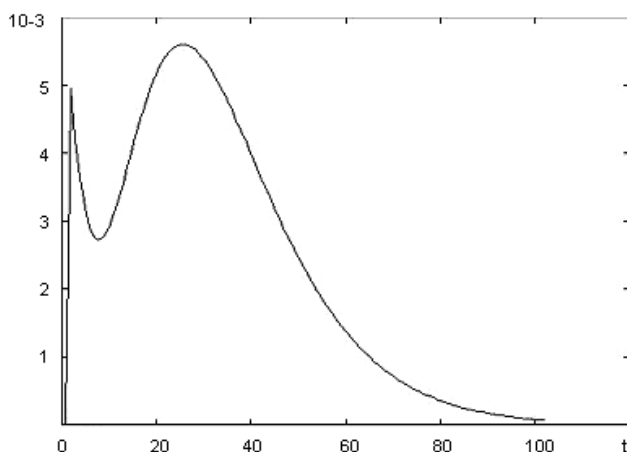
Из этих графиков видно, что недоброжелательный агент реагирует на шок добавлением некоторого стратегического шока (наихудшая реализация). Зная это, центральный банк увеличивает ставку процента. В результате происходит замедление инфляции региона  $H$ .

Результатом игры между центральным банком и недоброжелательным агентом является рост разрыва ВВП и инфляции региона  $H$ , в то время как инфляция в регионе  $F$  сокращается. Последний график первой колонки представляет потери при наихудшей реализации. Очевидно, что недоброжелательные действия провоцируют существенные потери благосостояния.

Когда недоброжелательный агент не предпринимает никаких действий, потери практически нулевые, даже если применяется устойчивая к неопреде-

ленности политика. Таким образом, центральный банк на самом деле может без негативных последствий противостоять недоброжелательному агенту.

Затем мы сравниваем устойчивую к неопределенности и простую оптимальную политику на основе общественного благосостояния. На рис. 2 изображена разница между благосостоянием при устойчивой политике и при простой оптимальной политике. Очевидно, что устойчивая к неопределенности политика приносит некоторые дополнительные выгоды по сравнению с простой оптимальной политикой, разработанной для базовой модели. Таким образом, построение именно устойчивой к неопределенности политики действительно имеет смысл.



**Рис. 2.** Увеличение общественного благосостояния при применении устойчивой к неопределенности политики

### 3. Заключение

Для микрообоснованной модели монетарного союза двух стран мы разработали устойчивую к неопределенности денежно-кредитную политику. Мы обнаружили, что чем выше допускаемая степень неопределенности, тем более агрессивно реагирует центральный банк на экономические шоки. Таким образом, «брайнардовский консерватизм» нарушается.

Существует множество возможностей расширения подобного анализа для построения денежно-кредитной политики монетарного союза. Во-первых, мы проанализировали только шоки условий торговли. Наш анализ без проблем мо-

жет быть расширен на другие экономические шоки. Во-вторых, в нашей модели отсутствует взаимодействие фискальных и монетарных властей. Влияние предпочтений центрального банка по поводу устойчивости политики на стратегическое взаимодействие монетарных и фискальных властей может быть проанализировано, например, на основе модели монетарного союза, представленной в работе [Beetsma, Jensen, 2005].

## Литература

*Beetsma R., Jensen H.* Monetary and Fiscal Policy Interaction in a Micro-founded Model of a Monetary Union // *Journal of International Economics*. 2005. 67. P. 320–352.

*Benigno P.* Optimal Monetary Policy in a Currency Area // *Journal of International Economics*. 2004. 63. P. 293–320.

*Dennis R.* Solving for Optimal Simple Rules in Rational Expectations Models // *Journal of Economic Dynamics and Control*. 2004. 28. P. 1635–1660.

*Giordani P., Söderlind P.* Solution of Macromodels with Hansen-Sargent Robust Policies: Some Extensions // *Journal of Economic Dynamics and Control*. 2004. 28(12). P. 2367–2397.

*Hansen L.P., Sargent T.J.* Acknowledging Misspecification in Macroeconomic Theory // *Review of Economic Dynamics*. 2001. 4(3). P. 519–535.

*Vermeulen S.* Price Setting in the Euro Area: Some Stylized Facts from the Individual Producer Price Data: Working Paper 111. National Bank of Belgium, 2007.

А.В. Ларин,  
А.Е. Новак  
Национальный исследовательский  
университет «Высшая школа экономики»

# ОШИБКИ ПРОГНОЗОВ ИНФЛЯЦИИ В РОССИИ: ШОКИ ИЛИ ПОЛИТИКА?

---

В работе на основе ARMAX-EGARCH-модели выполнен анализ прогнозов ежемесячной инфляции в России. Основной целью анализа является проверка гипотезы о том, является ли прогноз инструментом воздействия на ожидания агентов. В первом разделе данной работы проводится краткий анализ статистических свойств рядов инфляции и ошибок прогноза в России, во втором свойства ошибок рассматриваются в рамках ARMAX-модели. Гипотеза о влиянии корректировок прогноза на инфляцию тестируется с помощью метода максимального правдоподобия.

## Введение

В свете перехода на режим инфляционного таргетирования, осуществленного центральными банками ряда крупнейших экономик мира, в научной среде активно обсуждается вопрос эффективности вербальных интервенций. Ключевым моментом в данном вопросе является возможность влиять на ожидания агентов посредством лишь обнародования официальных заявлений представителей правительства и ЦБ.

В качестве интервенций часто рассматриваются официальные прогнозы целевых показателей монетарной политики. В России правительство ежегодно объявляет прогнозы инфляции следующего года, которые до последнего времени оказывались сильно заниженными. В качестве пусть и небесспорного, но вполне разумного объяснения данного факта можно предложить попытку сдерживать инфляционные ожидания агентов, которые в свою очередь определяют уровень инфляции в стране.

Как вербальные интервенции можно определить и прогнозы ежемесячной инфляции, объявляемые Банком России и Министерством экономического раз-

вития. В этих прогнозах не наблюдается постоянного смещения, и их трактовка не столь очевидна.

В данной работе на основе ARMAX-EGARCH-модели инфляции выполнен анализ прогнозов месячной инфляции в России. Основной целью анализа является проверка гипотезы о том, является ли прогноз инструментом воздействия на ожидания агентов. Для ответа на данный вопрос необходимо понять, пытаются ли Центральный банк или правительство компенсировать инфляционные шоки за счет корректировки прогнозов.

Рассматриваются три временных ряда: ежемесячная инфляция, официальные прогнозы Банка России и Министерства экономического развития. Выборка ограничена временным отрезком с 2002 по 2009 гг. Выбор этого временного отрезка обусловлен лишь тем, что прогнозы месячной инфляции доступны только с 2002 г.

## 1. Статистические характеристики ежемесячных прогнозов

Для эмпирической проверки гипотез используются данные прогнозов инфляции Министерства экономического развития за период с января 2002 г. по декабрь 2009 г. и инфляция, рассчитанная на основе индекса потребительских цен.

В работе рассматриваются очищенные от сезонности временные ряды инфляции и ошибок прогноза. Гипотеза о наличии единичного корня в рядах инфляции и ошибок прогнозов отвергается на однопроцентном уровне значимости, т.е. можно считать, что рассматриваемые ряды стационарны (см. табл. 1).

**Таблица 1.** Результаты ADF-теста на наличие единичного корня

	Очищенная инфляция	Ошибка прогноза
ADF test statistic	-7,52	-5,29
Critical value (1% level)	-2,59	-2,59

В табл. 2 подробно представлены свойства ошибок прогнозов. В среднем ошибка прогноза больше нуля, т.е. ежемесячный прогноз инфляции занижен в среднем на 0,015%. Однако это занижение незначимо отличается от нуля (p-value для теста на равенство среднего нулю равно 0,585). При этом макси-

мальное и минимальное значения по модулю близки к 1%, а среднеквадратичная ошибка прогноза составляет 0,27%. Учитывая тот факт, что среднеквадратичное отклонение инфляции от детерминистической компоненты (сезонность и тренд) составляет порядка 0,32%, можно сделать вывод о низкой точности прогноза стохастической составляющей инфляции.

**Таблица 2.** Описательная статистика ошибок прогноза

	Ошибка прогноза, %
Среднее	0,0153
Максимум	0,8118
Минимум	-0,9096
Стандартное отклонение	0,2739
Статистика Jarque-Bera	20,616
Jarque-Bera p-value	0,0000

## 2. Тестирование ARMAX-модели

### 2.1. Идея ARMAX-модели

Предположим, что динамика инфляции описывается новой кейнсианской кривой Филлипса:

$$\pi_t = \beta \cdot E_t \pi_{t+1} + \lambda \cdot mc_t,$$

где  $\pi_t$  – инфляция в текущем периоде;  $E_t \pi_{t+1}$  – ожидания агентов относительно инфляции следующего периода;  $mc_t$  – отклонение предельных издержек фирм от устойчивого состояния;  $\beta, \lambda$  – некоторые коэффициенты. Предположим также, что ожидания агентов рациональны и динамика предельных издержек описывается ARMA-моделью. В этом случае динамика инфляции будет так же описываться ARMA-моделью.

Далее предположим, что кроме предельных издержек на инфляцию влияет политика правительства:

$$\pi_t = a_1 \cdot \pi_{t-1} + \dots + a_p \cdot \pi_{t-p} + u_t + m_1 \cdot u_{t-1} + \dots + m_q \cdot u_{t-q} + x_t,$$

где  $u_t$  – белый шум, отражающий инфляционные шоки;  $x_t$  – воздействие политики правительства;  $a_1, \dots, a_p, m_1, \dots, m_q$  – коэффициенты модели;  $p$  и  $q$  – порядок AR и MA частей соответственно.

Очевидно, что действия правительства могут оказывать влияние на инфляцию с некоторой задержкой, например, в квартал [Svensson, 2000]. Поэтому динамику переменной  $x_t$  можно описать моделью скользящего среднего:

$$x_t = g_t + m_1^x \cdot g_{t-1} + \dots + m_q^x \cdot g_{t-q},$$

где  $m_1^x, \dots, m_q^x$  – некоторые коэффициенты, а белый шум  $g_t$  можно рассматривать как шок, отражающий действия правительства в период  $t$ . Таким образом, действия правительства в текущем периоде могут оказывать влияние как на текущую инфляцию, так и на инфляцию в будущем.

Очевидно, что на момент оглашения прогноза инфляции на следующий период правительству доступна информация о шоках и инфляции вплоть до предыдущего периода. Текущие инфляционные шоки правительство наблюдает лишь частично, либо не наблюдает вовсе. При этом можно предположить, что правительство знает, какие действия  $g_t$  оно предпримет в следующих периодах. Таким образом, можно ввести предпосылку о том, что объявляемый прогноз инфляции есть не что иное, как прогноз по ARMAX-модели на два периода вперед с учетом известной политики правительства в будущих периодах:

$$\pi_{t|t+2} = E[\pi_{t+2} | \pi_t, \pi_{t-1}, \dots, u_t, u_{t-1}, \dots, x_{t+2}, x_{t+1}, \dots],$$

где  $\pi_{t|t+2}$  – прогноз инфляции на период  $t+2$ , объявляемый в период  $t+1$ .

Ошибка такого прогноза будет выражаться следующим образом:

$$e_{t+2|t} = u_t + (a_1 + m_1) \cdot u_{t-1}.$$

В случае если правительство не пытается повлиять на ожидания агентов, ошибка его прогноза должна совпадать с ошибкой прогноза по ARMAX-модели. Предположим теперь, что правительство оглашает свои прогнозы с корректировкой на шоки прошлого периода, пытаясь компенсировать их за счет влияния на ожидания агентов:

$$\pi_{t+2|t}^f = \pi_{t+2|t} - r \cdot u_t,$$

где  $\pi_{t+2|t}^f$  – прогноз, объявляемый правительством,  $r$  – коэффициент, отражающий корректировку на шоки прошлого периода.

В этом случае ошибка прогноза будет следующей:

$$e_{t+2|t} = u_t + (a_1 + m_1 - h \cdot r) \cdot u_{t-1} + (r - h \cdot r) \cdot u_{t-2},$$

где  $h$  отражает реакцию инфляции на отклонение прогнозов правительства от прогнозов по ARMAX-модели. Предполагается, что это отклонение может влиять на ожидания агентов, которые в свою очередь влияют на инфляцию.



Запишем формулу для ошибки прогноза в общем виде:

$$e_{t+2|t} = u_t + P_1 \cdot u_{t-1} + P_2 \cdot u_{t-2}.$$

Таким образом, если правительство не корректирует свои прогнозы, должны выполняться следующие ограничения:  $P_1 = a_1 + m_1$  и  $P_2 = 0$ . Если же правительство пытается компенсировать пришедшие шоки за счет ожиданий агентов, ограничения будут нарушаться. Также используется упрощающая предпосылка о том, что правительству известны прошлые шоки и точные значения коэффициентов модели.

## 2.2. Функция правдоподобия

### 2.2.1. Плотность распределения

Так, ошибки прогноза распределены не по нормальному закону, для оценки и тестирования модели используется метод квазиравдоподобия. ARMAX-модель инфляции в операторном виде:

$$A(L) \cdot \pi_t = M(L) \cdot u_t + G(L) \cdot g_t,$$

где  $L$  – оператор сдвига, и

$$A(L) = 1 - a_1 \cdot L - \dots - a_p \cdot L^p,$$

$$M(L) = 1 + m_1 \cdot L + \dots + m_q \cdot L^q,$$

$$G(L) = 1 + m_1^x \cdot L + \dots + m_2^x \cdot L^q.$$

Обозначим AR-часть уравнения динамики инфляции через  $\tilde{\pi}_t \equiv A(L) \cdot \pi_t$ ,  $\tilde{\pi} \equiv (\tilde{\pi}_1 \dots \tilde{\pi}_T)'$  – вектор, составленный из реализаций  $\tilde{\pi}_t$ ;  $e \equiv (e_1 \dots e_T)'$  – вектор, составленный из реализаций ошибок прогноза и  $z \equiv (\tilde{\pi}' \ e)'$ . Элементы вектора составлены из шоков модели и имеют нулевое математическое ожидание. Поэтому можем записать функцию квазиравдоподобия для вектора  $z$ :

$$f(z | a_1 \dots a_p, m_1 \dots m_q, m_1^x \dots m_q^x, \sigma_u^2, \sigma_g^2) = \frac{1}{(2 \cdot \pi i)^T \cdot |\Sigma_z|^{1/2}} \cdot \exp\left\{-\frac{1}{2} \cdot z' \Sigma_z^{-1} \cdot z\right\},$$

где  $\pi i$  – число пи;  $\sigma_u^2$  – дисперсия инфляционного шока  $u_t$ ;  $\sigma_g^2$  – дисперсия шока  $g_t$ ;  $\Sigma_z \equiv E[z \cdot z']$  – ковариационная матрица вектора  $z$ . Реализации вектора  $z$  легко вычисляются при известных коэффициентах AR-части ARMAX-модели.

## 2.2.2. Условная гетероскедастичность

Как уже упоминалось выше, часто при моделировании инфляции используют модели условной гетероскедастичности. Кроме того, наличие GARCH-эффектов могло бы объяснить тот факт, что ошибка прогноза распределена не по нормальному закону.

Добавим в исходную модель эффекты, связанные с условной гетероскедастичностью шоков инфляции (предполагается, что шоки  $g_t$  являются гомоскедастичными). При максимизации функции правдоподобия используем EGARCH-модель, так как она позволяет учесть асимметричную реакцию на прошлые шоки.

Перепишем исходную модель, добавив в нее EGARCH-компоненту:

$$\log(\sigma_t^2) = \omega + \beta \cdot \log(\sigma_{t-1}^2) + \alpha \cdot \left| \frac{u_{t-1}}{\sigma_{t-1}} \right| + \gamma \frac{u_{t-1}}{\sigma_{t-1}},$$

где  $\sigma_t^2 \equiv V[u_t]$  – дисперсия шока  $u_t$  в период  $t$ ;  $\log(\cdot)$  – натуральный логарифм;  $\omega, \alpha, \beta$  – коэффициенты модели.

Для того чтобы учесть GARCH-эффекты при максимизации функции правдоподобия, на каждой итерации необходимо иметь оценки инфляционных шоков. Эти оценки можно итеративно выразить из реализаций ошибок прогноза, которые являются линейными комбинациями шоков  $u_t$ :

$$\hat{u}_t = \frac{1}{P_0} (e_{t+2|t} - P_1 \cdot \hat{u}_{t-1} - P_2 \cdot \hat{u}_{t-2}),$$

где  $\hat{u}_t$  – оценка инфляционного шока. Таким образом, для того чтобы выразить оценки шоков для каждого периода, необходимо только задать начальные оценки шоков (вне выборки)  $\hat{u}_0$  и  $\hat{u}_{-1}$ . Как и при тестировании MA-моделей, начальные оценки можно положить равными нулю.

После того как оценки шоков получены, необходимо задать дисперсию шока в первом наблюдении, для чего воспользуемся процедурой ретропроляции (*backcasting*):

$$\hat{\sigma}_0^2 = \lambda^T \cdot \hat{\sigma}^2 + (1 - \lambda) \cdot \sum_{t=0}^{T-1} \lambda^t \cdot u_{t+1}^2,$$

где  $\hat{\sigma}^2 = \frac{1}{T} \sum_{t=1}^T u_t^2$  – оценка безусловной дисперсии шоков;  $\lambda = 0,7$  – параметр сглаживания (может выбираться отличным от 0,7).

Таким образом, имея оценку начальной дисперсии и оценки инфляционных шоков, и при известных параметрах модели можно вычислить оценки дисперсии шока в каждом из наблюдений. Ковариационная матрица шума в случае наличия GARCH-эффектов будет зависеть от времени:

$$\Sigma_{ug}(t) \equiv E[u_t \cdot g_t] = \begin{pmatrix} \sigma_t^2 & 0 \\ 0 & \sigma_g^2 \end{pmatrix}.$$

### 2.2.3. Бутстрапирование стандартных ошибок

При бутстрапировании временных рядов необходимо учитывать зависимость переменных во времени. В тестируемой модели данную проблему можно обойти, используя остаточный бутстрап.

Максимизируя функцию квазиравдоподобия, находим оценки параметров модели. Затем, используя процедуру, описанную выше, получаем оценки инфляционных шоков  $\hat{u}_t$ . Аналогичным способом можно получить оценки шоков  $\hat{g}_t$ :

$$\hat{g}_t = \tilde{\pi}_t - \hat{u}_t - \dots - m_q \cdot \hat{u}_t - m_1^x \cdot \hat{g}_{t-1} - \dots - m_{q^x}^x \cdot \hat{g}_{t-q^x}.$$

Начальные оценки вне выборки опять полагаем равными нулю:

$$\hat{g}_0 = \hat{g}_{-1} = \dots = \hat{g}_{-q^x+1} = 0.$$

Таким образом, получаем два ряда оценок шоков. Далее случайным образом выбираем из каждого ряда по  $T$  шоков – получаем бутстраповскую выборку. Обозначим элементы этой выборки  $u_t^B$  и  $g_t^B$ . Далее необходимо восстановить ряды инфляции и ошибок прогноза. Ряд ошибок прогноза легко восстанавливается подстановкой шоков  $u_t^B$  в оцененное уравнение для ошибки прогноза. Далее аналогичным образом восстанавливаем ряд  $x_t^B$ , отвечающий за политику правительства. Затем, используя реальные начальные значения инфляции  $\pi_0, \dots, \pi_{-p+1}$ , итеративно восстанавливаем ряд инфляции, подставляя  $u_t^B$  и  $x_t^B$  в оцененное уравнение ARMAX-процесса.

В итоге получаем бутстраповские временные ряды инфляции и ошибок прогноза, на основе которых находим новые оценки коэффициентов модели. Далее процедура повторяется, начиная с получения оценок инфляционных шоков. Таким образом, имеем распределение оценок параметров модели, на основе которых можно вычислить стандартные ошибки оценок коэффициентов.

При тестировании модели с EGARCH-компонентой предполагалось, что все шоки распределены по нормальному закону. В этом случае можно восстанавливать ряды  $u_t^B$  и  $g_t^B$  не из оцененной выборки, а из нормального распределения с нулевым математическим ожиданием и соответствующей дисперсией.

### 2.3. Порядок ARMAX-модели

Рассмотрим исходную ARMAX-модель. Прежде всего, при тестировании необходимо определить порядки  $p$  и  $q$  уравнения динамики инфляции и порядок  $q^*$  уравнения, определяющего влияние действий правительства. Для этого предположим, что нулевая гипотеза об отсутствии корректировок прогнозов верна, и определим порядки  $p$ ,  $q$  и  $q^*$ , используя LR-тест на линейные ограничения. Найдем максимум функций квазиправдоподобия моделей, для которых выполнено  $p + q + q^* \leq 12$ . Далее сравниваем модели попарно, возможны три случая.

1. Если у этих моделей  $p + q + q^*$  совпадает, то выбираем ту, у которой максимум функции квазиправдоподобия больше.

2. Если одна модель получается из другой наложением ограничения на коэффициенты, т.е. модели являются вложенными, то используем LR-тест. Строим тестовую статистику, асимптотически распределенную по хи-квадрат распределению:

$$-2 \log \left( \frac{L_r}{L_{ur}} \right) \xrightarrow{d} \chi^2(k),$$

где  $L_{ur}$  – максимум функции квазиправдоподобия для модели с ограничением;  $L_r$  – максимум функции квазиправдоподобия для модели без ограничений;  $k$  – число ограничений на коэффициенты.

Далее значения тестовой статистики сравниваем с критическим значением (5-процентной точкой хи-квадрат распределения). И если оно превышает критическое значение, то ограничения не выполняются, и тогда выбираем модель без ограничений, иначе выбираем модель с ограничениями.

3. Если модели не являются вложенными, то мы не можем их сравнивать.

При тестировании на имеющихся данных была выбрана следующая модель:  $p = 1, q = 0, q^* = 0$ . То есть текущая инфляция зависит от инфляции в предыдущем периоде, от текущих инфляционных шоков и текущих действий правительства. Далее все результаты приведены для этой модели.

## 2.4. Результаты тестирования

Сначала рассмотрим модель, не учитывающую GARCH-эффекты. Ниже приведены результаты тестирования двух моделей (см. табл. 3). Первая модель предполагает, что правительство не корректирует свои прогнозы. Во второй модели предполагается, что правительство реагирует на шоки прошлого периода и в соответствии с этими шоками корректирует свои прогнозы инфляции, пытаясь повлиять на ожидания агентов. Коэффициент  $r$  отражает корректировку прогноза, а  $h$  показывает, как инфляция реагирует на эту корректировку. Для тестирования нулевой гипотезы об отсутствии корректировок использовался LR-тест.

Текущая инфляция положительно зависит от инфляции прошлого периода ( $a_1$  значимо больше нуля). Во-вторых, гипотеза о том, что правительство не корректирует свои прогнозы, отвергается на 5-процентном уровне значимости. При этом важно отметить тот факт, что чем больше шок предыдущего периода, тем сильнее будет занижен прогноз на будущий период ( $r_1 > 0$ ). В-третьих, текущая инфляция зависит от прогнозов правительства ( $h$  значимо больше нуля). Можно предположить, что объявляемые правительством прогнозы влияют на ожидания агентов, которые в свою очередь определяют инфляцию в текущем периоде.

**Таблица 3.** Результаты оценки ARMAX-модели

	I (без корректировок)	II (с корректировками)
$a_1$	0,369***	0,593***
$r$	–	0,349 <sup>(-)</sup>
$h$	–	0,943***
$\log(L)$	– 470,95	–466,38
$LR\text{-stat (vs. no correction)}$	–	9,14**

*Примечание.* \* означает значимость коэффициента на 1-процентном уровне значимости; \*\* – на 5-процентном уровне значимости; \* – на 10-процентном уровне значимости; (–) – значимость коэффициента не тестировалась.

Коэффициент  $h$  близок к единице. Учитывая, что инфляционный прогноз оглашается в течение месяца (а не в самом его начале), можно предположить, что корректировки прогнозов правительства влияют на ожидания агентов с коэффициентом больше единицы. Другими словами, ожидания агентов крайне чувствительны к объявляемым правительством прогнозам.

Результаты тестирования модели, учитывающей изменения дисперсии инфляционных шоков во времени, представлены в табл. 4. На панели А таблицы приведены оценки коэффициентов, определяющих динамику наблюдаемых переменных модели. На панели Б – оценки коэффициентов уравнения дисперсии инфляционных шоков. Полученные результаты подтверждают выводы, сделанные выше. На основе распределения оценки коэффициента корректировки можно сделать вывод о том, что  $r$  значимо отличается от нуля на 1-процентном уровне значимости. При этом EGARCH-эффекты оказываются значимыми, т.е. дисперсия инфляционных шоков зависит от их реализации в предыдущие периоды – чем больше прошлый шок, тем выше дисперсия текущего шока. Однако эффект асимметрии не подтверждается (коэффициент при  $|u_{t-1}|/\sigma_{t-1}$  незначим) – дисперсия одинаково реагирует на положительные и отрицательные шоки.

Также стоит отметить, что за счет корректировок прогнозов правительство компенсирует около 33% инфляционных шоков ( $r \cdot h = 0,329$ ). То есть если в текущем месяце наблюдается положительный единичный шок, то за счет занижения прогноза на  $r = 0,349$  правительство добьется снижения инфляции будущего месяца на 0,33.

**Таблица 4.** Результаты тестирования ARMAX-EGARCH-модели

	I (без корректировок)	II (с корректировками)
<b>Панель А</b>		
$a_1$	0,608 [-]	0,594*** [0,070]
$r$	–	0,355 <sup>(-)</sup> [0,086]
$h$	–	0,962*** [0,135]
$\log(L)$	–464,40	–458,57
$LR\text{-stat (vs. no correction)}$	–	11,66***
<b>Панель Б (зависимая переменная: <math>\log(\sigma_t^2)</math>)</b>		
$const$	0,257 [-]	0,272* [0,146]
$\log(\sigma_{t-1}^2)$	0,726*** [-]	0,729*** [0,114]
$u_{t-1}/\sigma_{t-1}$	0,267* [-]	0,249* [0,111]
$ u_{t-1} /\sigma_{t-1}$	–0,709 [-]	–0,650 [0,409]
$LR\text{-stat (GARCH-эффекты)}$	13,10***	15,62***

*Примечание.* В квадратных скобках приведены бутстраповские стандартные ошибки.

## Заключение

В работе были рассмотрены существующие новые кейнсианские модели ценообразования и результаты их тестирования, а также построена оригинальная модель, уделяющая внимание важной составляющей монетарной политики – официальному прогнозу инфляции. Проведен подробный анализ особенностей прогнозирования инфляции в России, исследована точность прогнозов, а также причины ошибок и различия прогнозов Банка России и Министерства экономического развития. Данное несоответствие прогнозов позволило сделать предположение о роли прогноза инфляции как инструмента политики, и о его влиянии на формирование цен фирмами в экономике. Полученный в работе результат позволяет сделать вывод, что повышение уровня цен в стране зависит не от абсолютного значения официального прогноза инфляции, а от его изменения. Чем сильнее это изменение, тем больше фирмы изменяют свои цены и тем самым оказывают большее влияние на уровень инфляции.

В данной работе проведен анализ ошибок прогнозов месячной инфляции в России. Для тестирования гипотезы об использовании прогнозов в качестве инструмента политики правительства построена ARMAX-EGARCH-модель, особенность которой заключается в том, что динамика инфляции в ней описывается ненаблюдаемой переменной. В первом подходе в качестве такой переменной рассматривается политика правительства.

На основе модели были получены следующие результаты. Во-первых, в инфляционных шоках наблюдаются эффекты условной гетероскедастичности. То есть дисперсия текущих шоков тем выше, чем больше реализации прошлых шоков в абсолютном выражении, что объясняет ненормальность распределения ошибок прогноза. Во-вторых, гипотеза об использовании инфляции в качестве инструмента политики подтверждается на 5-процентном уровне значимости. То есть если в предыдущем периоде наблюдались высокие инфляционные шоки, стоит ожидать заниженного прогноза инфляции на следующий месяц. И, в-третьих, ожидания агентов оказываются чувствительными к корректировкам инфляционных прогнозов. При этом за счет корректировок правительство компенсирует до 57% инфляционных шоков.

## Литература

*Estrella A., Fuhrer J.C.* Monetary Policy Shifts and the Stability of Monetary Policy Models // Review of Economics and Statistics. 2002. 85 (1). P. 94–100.

*Fountas F., Karanasos M., Karanassou M.* A GARCH Model of Inflation and Inflation Uncertainty with Simultaneous Feedback: Queen Mary and Westfield College, Department of Economics Working Paper № 414. 2000.

*Fritzer F., Moser G., Scharler J.* Forecasting Austrian HICP and its Components Using VAR and ARIMA Models, OeNB. Working Paper 73. 2002.

*Galbraith J.W., Zinde-Walsh V.* Autoregression-based Estimators for ARFIMA Models. CIRANO, Working Paper. 2001.

*Gali J., Gertler M., Lopez-Salido J.D.* European Inflation Dynamics // European Economic Review. 2001. 45 (7). P. 1237–1270.

*Jondeau E., Le Bihan H.* Testing for the New Keynesian Phillips Curve. Additional International Evidence // Economic Modelling. 2005. 22. P. 521–555.

*Junttila J.* Corresponding Author Contact Information Structural Breaks, ARIMA Model and Finnish Inflation Forecasts // International Journal of Forecasting. 2001. Vol. 17. Iss. 2. P. 203–230.

*Kontonikas A.* Inflation and Inflation Uncertainty in the United Kingdom, Evidence from GARCH Modeling // Economic Modelling. 2004. Vol. 21. Iss. 3. P. 525–543.

*Lack C.* Forecasting Swiss Inflation Using VAR Models // Swiss National Bank Economic Studies. 2006. № 2.

*Meyler A., Kenny G., Quinn T.* Forecasting Irish Inflation Using ARIMA Models // Central Bank of Ireland, Technical Paper. 1998.

*Quenouille M.H.* The Analysis of Multiple Time-Series. Griffin, London, Working Paper. 1957.

*Svensson L.E.O.* Open-economy Inflation Targeting // Journal of International Economics. 2000. 50. P. 155–183.



# ЛОВУШКА БЕДНОСТИ В СТРАНАХ, ЭКСПОРТИРУЮЩИХ ПРИРОДНЫЕ РЕСУРСЫ

---

В работе представлена модель эндогенного роста, которая позволяет выявить потенциальные траектории развития стран, богатых природными ресурсами. В модели предполагается, что вероятность инноваций в производственном секторе зависит от общего уровня человеческого капитала в обществе. В зависимости от первоначальных условий экономика может находиться в состоянии длительной стагнации или на траектории устойчивого роста. Модель позволяет качественно оценить воздействие природной ренты на экономическое развитие на разных стадиях развития.

## Введение

Ловушка бедности – это состояние экономики, в рамках которого существуют самоподдерживающиеся механизмы, препятствующие развитию. Термин «ловушка бедности» часто используется для описания текущего состояния стран Африки и Юго-Восточной Азии, которые испытывают длительную экономическую стагнацию, несмотря на устойчивое экономическое развитие мировой экономики в целом. В этих странах живет более 70% (1,2 млрд человек) от общего числа жителей Земли, имеющих доход, не превышающий 1 долл. в день [Azariadis et al., 2005, p. 308]. Вместе с тем ловушка бедности может характеризовать также и большинство стран, экспортирующих природные ресурсы. Из 43 стран, богатых природными ресурсами, средние темпы роста в 1970–2000 гг. не превышали 1,3% в год для 28 стран. Для сравнения, в этот период средний темп роста мировой экономики составил 3,26%<sup>1</sup>.

---

<sup>1</sup> Расчеты автора. Источник данных: World Development Indicators. Критерием принадлежности к группе стран, богатых природными ресурсами, являлось превышение 5-процентного порога отношения природной ренты к валовому национальному доходу хотя бы один раз за период 1970–2000 гг.

Свидетельства о более низких темпах роста в странах, экспортирующих природные ресурсы, приведены в многочисленных межстрановых эмпирических работах [Sachs, Warner, 2001; Isham et al., 2005; Sala-i-Martin et al., 2003; Полтерович, Попов, Тонис, 2007]. В работе [Isham et al., 2005] показано, что в странах, экспортирующих минеральные природные ресурсы, средние темпы роста в 1970–2000 гг. были существенно ниже, чем в странах, экспортирующих сельскохозяйственное сырье. Необходимо объяснить причины экономической стагнации в этих странах и возможные способы перехода от стагнации к росту.

На данный момент существуют несколько классов экономических моделей, позволяющих объяснить причины отсутствия устойчивого роста в ресурсных экономиках. Первый класс моделей описывает проблему голландской болезни при росте цен на экспортные товары на мировом рынке [Matsuyama, 1992]. Рост зарплат и реального валютного курса в экономике вредит конкурентоспособности промышленного сектора и ведет к вытеснению промышленного сектора добывающим сектором. Промышленный сектор создает положительные экстерналии в обществе, связанные с созданием и распространением новых знаний и технологий. Второй класс моделей описывает воздействие экспорта природных ресурсов на стимулы к рентоориентированному поведению [Torvik, 2002; Mehlum et al., 2006]. Наличие природного ресурса способствует переходу от производственной деятельности к поиску ренты и, таким образом, сокращает темпы роста в обрабатывающем секторе.

Данные подходы позволяют продемонстрировать различные механизмы негативного воздействия ренты от экспорта природных ресурсов на развитие экономики, однако они не всегда способны объяснить успешное развитие одних стран, экспортирующих природные ресурсы, и отсутствие развития в других странах. В частности, авторы исследования [Mehlum et al., 2006] решают данную задачу в рамках модели, в которой мера институционального качества влияет на относительную прибыльность производственной деятельности и деятельности по поиску ренты. В результате в странах с «хорошими» институтами природная рента положительно влияет на долгосрочные темпы роста, а в странах с «плохими» институтами отрицательно. В то же время данный подход фактически постулирует наличие взаимосвязи между институциональным качеством и успешным развитием экономики. При этом показатель институционального качества является экзогенной переменной.

Мы рассматриваем альтернативный вариант объяснения причин ловушки бедности в странах, богатых природными ресурсами, основанный на классе моделей, объясняющих природу ловушек бедности через взаимодействие ди-

намики человеческого капитала и технологических изменений [Azariadis et al., 1990; Redding, 1996]. В данной работе рассматривается модель эндогенного роста, в которой совокупный уровень человеческого капитала в экономике влияет на вероятность осуществления инноваций фирмами. В этом случае возникает стратегическая дополняемость решений фирмы об инвестициях в R&D и решений работников об инвестициях в образование. Возникает два устойчивых стационарных состояния, с нулевыми и с положительным темпами роста. Переход от одного стационарного состояния к другому возможен за счет изменения экзогенных параметров модели.

При появлении природного ресурса фирмы получают возможность инвестировать не только в инновационный сектор экономики, но и в добычу и экспорт природного ресурса. В этом случае уровень занятости в высококвалифицированном секторе падает и стимулы к образованию снижаются. Мы покажем, что воздействие природных ресурсов на экономику является неоднозначным в терминах ускорения (замедления) роста и будет существенно различаться для разных стадий развития экономики.

## Модель без природных ресурсов

В качестве основы для модели мы используем упрощенную версию модели созидательного разрушения [Aghion, Howitt, 1992], предложенную в работе [Aghion, Howitt, 2005]. Время является дискретным  $t = 1, 2, \dots$ . Каждый момент времени в экономике существует  $L$  работников, каждый из них наделен одной единицей труда. Рабочие делятся на квалифицированных и неквалифицированных.

### *Задача фирмы.*

Сектор производства материальных благ описывается производственной функцией

$$Y = Ax^\alpha, \quad (1)$$

где  $Y$  – валовый продукт сектора;  $x$  – промежуточный товар, используемый для производства конечного продукта;  $A$  – уровень текущей технологии, отражающий качество промежуточного продукта. Производство промежуточного продукта описывается простой производственной функцией

$$x = x_L \quad (2)$$

где  $x_L$  – количество труда, задействованного в производстве промежуточного продукта.

Существуют несколько фирм, конкурирующих на рынке производства промежуточной продукции по цене (конкуренция по Бертрану) так, что прибыль на данном рынке равняется нулю. Тогда вся выручка тратится на заработную плату. Каждая из фирм способна также нанять  $n$  единиц квалифицированного труда для создания новой инновации, повышающей качество промежуточного продукта с  $A$  до уровня  $\gamma A$ , где  $\gamma > 1$ . При найме  $n$  квалифицированных работников вероятность осуществления инновации равна

$$\lambda(H) \cdot n, \quad (3)$$

где  $\lambda(H)$  – монотонно возрастающая функция от нуля до единицы. При этом  $\lambda(0) > 0$  и  $\lim_{H \rightarrow \infty} \lambda(H) = 1$ .

Если инноватор открывает новую технологию, то он обладает рыночной властью в секторе производства более качественного промежуточного продукта. В то же время его власть ограничена присутствием других фирм, способных произвести продукт того же уровня качества, используя при этом  $\mu > 1$  единиц труда. Если  $\mu < \frac{1}{\alpha}$ , то рыночная власть инноватора не является абсолютной, и тогда максимальная цена, которую инноватор может назначить за товар, равна  $\mu w$ . Тогда прибыль инноватора на рынке равна

$$\pi = (\mu - 1)wx. \quad (4)$$

Предположим, что рыночная власть инноватора существует лишь один период, после которого все остальные фирмы смогут имитировать новую технологию и прибыль инноватора опуститься до нуля. На данном этапе модель может быть описана двумя уравнениями, одно из которых – условие равновешивания рынка труда

$$n + x = L. \quad (5)$$

Число занятых в квалифицированном (инновационном) и неквалифицированном секторах равно общему числу занятых. При этом уровень занятых в секторе инноваций не должен превышать существующее количество квалифицированной рабочей силы ( $S$ ),

$$n \leq S. \quad (6)$$

Второе уравнение отражает тот факт, что предельные выгоды от инновации должны совпадать с предельными издержками. Предельные издержки от инновации для единицы нанятого квалифицированного труда равны  $w^S$  – заработной плате квалифицированного труда.

Предельные выгоды равны прибыли от инновации с учетом вероятности ее возникновения.

$$w^S = \lambda(H)\gamma\pi. \quad (7)$$

### ***Задача домашних хозяйств.***

Предположим, что каждое домашнее хозяйство живет два периода времени и предлагает во втором периоде одну единицу труда. В первом периоде домашнее хозяйство должно делать выбор, нужно ли получать образование, для того чтобы войти в состав рабочей силы в следующем периоде. Рынки капитала совершенны, так что финансирование расходов на образование осуществляется за счет будущих доходов.

Если работник получает образование, затрачивая на него постоянную часть зарплаты ( $c$ ), то во втором периоде он может быть занят в секторе инноваций и получать зарплату  $w^S$ . Работник также может не получать образование и работать в неквалифицированном секторе во втором периоде за зарплату  $w$ .

Пусть  $\rho$  – вероятность быть занятым в квалифицированном секторе после получения образования. Тогда работник будет получать образование, если

$$\rho w_{t+1}^S - cw_t \geq w_{t+1}. \quad (8)$$

Пусть работники имеют разный уровень первоначальных навыков и затраты на образование будут различаться в зависимости от первоначальных навыков. Предположим, что распределение навыков равномерное от нуля до единицы.

Распределим всех работников равномерно от нуля до единицы. Тогда  $i$  – уровень первоначальных навыков для  $i$ -го работника. В этом случае затраты на образование для  $i$ -го работника равна  $c iw$ .

Тогда  $i$ -й работник будет получать образование, если выполняется условие

$$\rho w_{t+1}^S - cw_t i \geq w_{t+1}. \quad (9)$$

Доля работников, получающих образование ( $i$ ), определяется из следующего уравнения:

$$\rho w_{t+1}^S - cw_t i = w_{t+1}.$$

### ***Динамика вероятности успеха инноваций.***

Предположим, что уровень образования поддерживается в обществе, только если определенная доля работников ( $\delta$ ) получает образование. В противном случае уровень образования снижается. Если же образование получает доля работников, большая, чем  $\delta$ , то уровень образования растет.

$$\Delta H_{t+1} = (i_t - \delta)H_t. \quad (10)$$

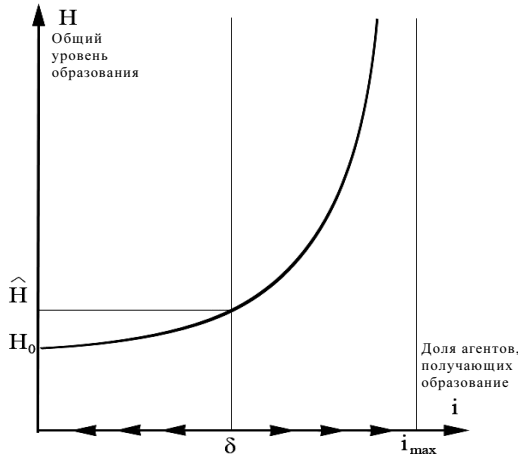
**Общее равновесие в модели.**

Тогда система уравнений, описывающих модель, выглядит как:

$$\begin{cases} \{w_t + cw_{t-1}i_{t+1} - \lambda(H_t)(\mu - 1)(1 - i_{t+1})L_{t+1}w^e_{t+1}\}i_{t+1} \leq 0, \\ w^e_{t+1} = w_t(1 + (\gamma - 1)\lambda(H_t)i_tL_t), \\ H_{t+1} = f(H_t, i_t), \\ w_t, H_t, i_t \geq 0, \\ i_t \leq 1, \\ H_{-1}, i_{-1}, w_{-1} \text{ задано.} \end{cases}$$

Первое неравенство отражает тот факт, что при положительном числе занятых в инновационном секторе выгоды от инновации для фирмы равны издержкам от инноваций. Если же выгоды меньше, чем издержки, то объем занятости в инновационном секторе равен нулю. Второе уравнение отражает ожидаемый уровень зарплаты в промышленном секторе. Третье уравнение отвечает за динамику теневой переменной  $H$ .

В рамках данной модели при заданных параметрах  $(\mu, c, \gamma)$  начальный уровень образования  $H$  определяет дальнейшее развитие экономики.



**Рис. 1.** Динамика модели без природных ресурсов

## Модель с природными ресурсами

Рассмотрим теперь модификацию модели для стран, экспортирующих природные ресурсы. Пусть в экономике появляется сектор природных ресурсов. Открытие месторождения природных ресурсов может произойти на любой стадии развития общества, как при низком, так и при высоком общем уровне образования.

Открытие нового месторождения позволяет фирмам делать выбор между вложением в повышение качества промежуточного продукта и инвестициями в добычу и экспорт природного ресурса.

Пусть сектор добычи природного ресурса описывается следующей производственной функцией:

$$Y_R = pK^\beta, \quad (11)$$

где  $Y_R$  – стоимость произведенного ресурса в единицах промежуточного продукта;  $p$  – экзогенный параметр, отражающий уровень цен на ресурс на международных рынках, размер месторождения, издержки добычи природного ресурса;  $K$  – объем физического капитала, задействованного в производстве ресурса.

Предположим, что существуют также издержки регулирования капитала такие, что фирмы не могут инвестировать в капитал более чем одну единицу в течение одного периода. Это предположение реалистично, поскольку инвестиции в природные ресурсы являются капиталоемкими и обычно занимают несколько лет. Осуществившая инвестиции фирма получает прибыль от инвестиций в следующем периоде как прирост стоимости сырья за вычетом издержек инвестирования.

Тогда прибыль от единицы инвестиций в природный ресурс равна

$$\pi^R = p(K+1)^\beta - pK^\beta - p_K = g(p, p_K, K), \quad (12)$$

где  $P_K$  – стоимость одной дополнительной единицы капитала.

Функция  $g(p, p_K, K)$  обладает следующими свойствами<sup>2</sup>:

$$g'_p > 0, \quad g'_{P_K} < 0, \quad g'_K < 0. \quad (13)$$

Мы сознательно не включаем труд в производственную функцию, поскольку добыча и экспорт природных ресурсов является капиталоемким сектором.

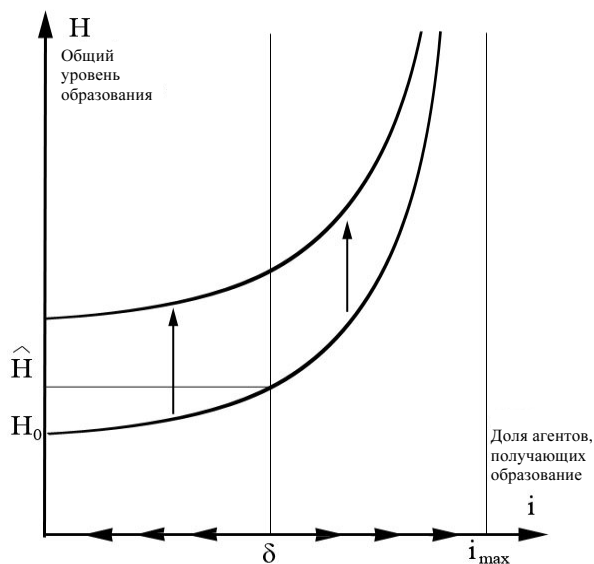
---

<sup>2</sup> Фирмы могут специализироваться не только на добыче и экспорте природного ресурса, но и на других видах непродвинутой деятельности по поиску и изытанию природной ренты. См., например, [Torgvik, 2006], где обсуждается роль «паразитирующих» предприятий.

Добавление труда в производственную функцию создаст эффект голландской болезни, когда уровень зарплат в экономике растет и обрабатывающий сектор становится неконкурентоспособным. В то же время этот механизм уже изучен и не рассматривается в данной работе.

Возможность получения прибыли от вложения в сырьевые ресурсы учитывается фирмой как альтернативный доход при принятии решения о найме квалифицированных работников и осуществлении инноваций.

Тогда уравнение (8) будет иллюстрироваться рис. 2.



**Рис. 2.** Влияние экспорта природных ресурсов на стимулы к инновационной деятельности

Рассмотрим отдельно воздействие природных ресурсов на долгосрочное развитие экономики в зависимости от текущего уровня развития.

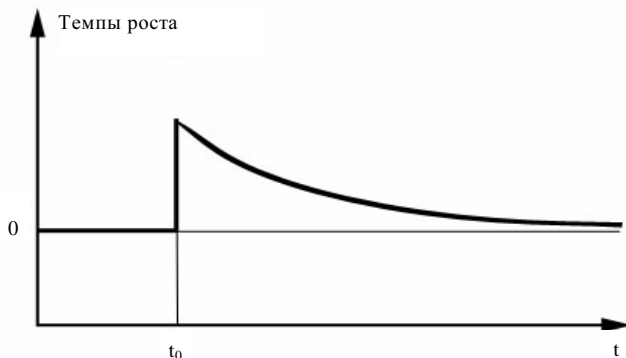
*Случай 1.* Появление природных ресурсов в экономике с низким уровнем развития.

$$H \leq H_0.$$

Наличие природных ресурсов никак не скажется на стимулах к образованию и инновациям в экономике, находящейся в ловушке развития. Доля людей, получающих образование, как была равной нулю, так и останется равной



нулю. При этом темпы роста изначально вырастут, отражая выигрыш экономики от эксплуатации природных ресурсов, но за счет убывающей предельной производительности от инвестиций в природный ресурс затем устремятся к нулю.



**Рис. 3.** Появление природных ресурсов в экономике, находящейся в ловушке роста

Такая динамика характерна для большинства современных стран, экспортирующих природные ресурсы. Для большинства ресурсных экономик периоды ускорения роста соответствуют периоду роста цен на природные ресурсы. В период роста цен на нефть и темпы роста в странах, экспортирующих природные ресурсы, в среднем возрастают с 2,5% в предыдущие 10 лет до 10%. Затем, после того как временное ускорение заканчивается, они падают до 0% в последующие 10 лет<sup>3</sup>.

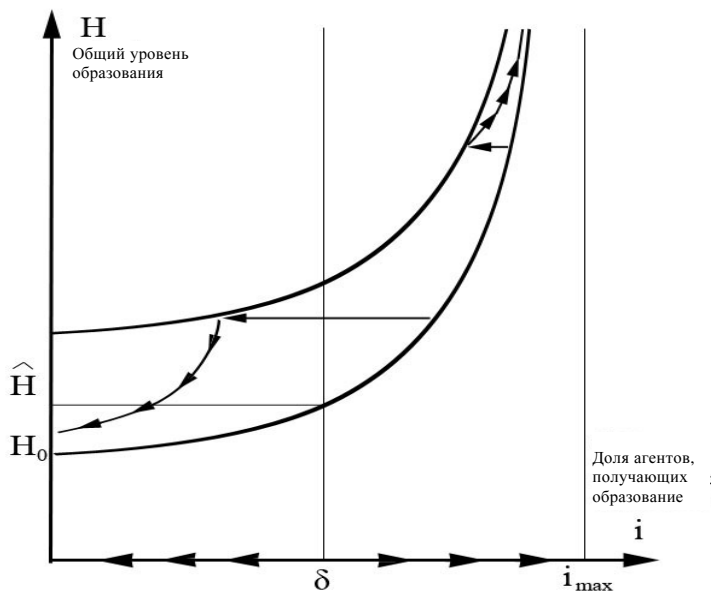
*Случай 2.* Появление природных ресурсов в экономике с высоким уровнем развития.

В экономике с относительно высоким уровнем образования появление природных ресурсов снизит спрос на высококвалифицированных рабочих и снизит стимулы получать образование. В то же время осуществление инноваций и получение образования останется выгодным. Как следствие, режим устойчивого экономического развития сохранится.

*Случай 3.* Появление природных ресурсов в экономике с промежуточным уровнем развития.

<sup>3</sup> Расчеты автора. Источник данных: Penn World Tables. 2010. Для периода роста цен на нефть (1970-е и 2000-е годы) были выделены промежутки времени, два и более лет, когда темпы экономического роста в ресурсной экономике существенно превышали предыдущие и последующие темпы роста.

В этом случае эффект появления природного ресурса или роста цен на природный ресурс, в зависимости от параметров модели, может привести к двум совершенно различным результатам.



**Рис. 4.** Воздействие природных ресурсов на дальнейшее развитие экономики

В первом случае падение доли агентов, получающих образование, будет незначительным и не скажется на общем уровне образования. По мере снижения прибыльности от инвестиций в природные ресурсы экономика вернется на предыдущую траекторию роста. При этом темпы роста не только не снизятся, но и временно ускорятся за счет добычи природных ресурсов.

Во втором случае падение доли агентов, получающих образование, приведет к смене режима экономического развития. Осуществлять инновации окажется невыгодно, и экономика скатится в ловушку развития.

## Заключение

В работе рассмотрена модель экономического роста в ресурсных экономиках, в рамках которой ресурсное богатство влияет на стимулы к осуществлению инноваций фирмами и стимулы к получению образования населением.

В модели общий уровень образования определяет положение страны: при низком уровне образования инновации не выгодны и экономика находится в ловушке роста, высокий уровень образования позволяет добиться устойчивых темпов роста, несмотря на экспорт природных ресурсов. В модели предусмотрен следующий механизм: экспорт природных ресурсов позволяет фирмам заниматься поиском ренты, а не осуществлением инноваций. Спрос на квалифицированную рабочую силу падает, стимулы получать образование снижаются. В зависимости от внешних параметров этот процесс деградации может быть постоянным и привести к стагнации.

Для стран с относительно высокими и низкими уровнями образования влияние природных ресурсов на дальнейшее развитие однозначно определено. В странах с низким уровнем образования, находящихся в ловушке бедности, темпы роста лишь временно ускоряются при появлении природных ресурсов. В странах с высоким уровнем образования появление природного ресурса незначительно влияет на стимулы к инновациям, они остаются на траектории устойчивого роста.

Для стран с промежуточными показателями общего уровня образования и общего уровня производительности экспорт природных ресурсов может привести к разным результатам – долгосрочному росту или долгосрочной стагнации. В промежуточном случае незначительные колебания основных экзогенных параметров (степени защиты прав собственности, издержек по получению качественного образования, степени конкурентности рынков, доступу к природной ренте) способны сменить режим экономического развития от стагнации к росту и от роста к стагнации.

## Литература

- Полтерович В., Попов В., Тонис А.* Экономическая политика, качество институтов и механизмы ресурсного проклятья. М.: Изд. дом ГУ ВШЭ, 2007.
- Aghion P., Howitt P.* A Model of Growth through Creative Destruction // *Econometrica*. 1992. 60. P. 323–351.
- Aghion P., Howitt P.* Growth with Quality-improving Innovations: An Integrated Framework // *Handbooks of Economic Growth*. 2005. Ch. 2.
- Azariadis C., Stachurski J.* Poverty Traps // *Handbook of Economic Growth*. 2005. Ch. 5. P. 295–380.
- Azariadis C., Drazen A.* Threshold Externalities in Economic-development // *Quarterly Journal of Economics*. 1990. 105(2). P. 501–526.
- Isham J., Woolcock M., Pritchett L., Busby G.* The Varieties of Resource Experience: Natural Resource Export Structures and the Political Economy of Economic Growth // *World Bank Economic Review*. 2005. 19 (2). P. 141–174.
- Matsuyama K.* Agricultural Productivity, Comparative Advantage, and Economic Growth // *Journal of Economic Theory*. 1992. 58(2). P. 317–334.

*Mehlum H., Moene K., Torvik R.* Predator of Prey? Parasitic Enterprises in Economic Development // *European Economic Review*. 2003. 47. P. 275–294.

*Mehlum H., Moene K., Torvik R.* Institutions and the Resource Curse // *Economic Journal*. 2006. 116(508). P. 1–20.

*Redding S.* The Low-skill, Low-quality Trap: Strategic Complementarities between Human Capital and R&D // *Economic Journal*. 1996. 106(435). P. 458–470.

*Sachs J.D., Warner A.M.* The Curse of Natural Resources // *European Economic Review*. 2001. 45(4–6). P. 827–838.

*Sala-i-Martin X., Subramanian A.* Addressing the Natural Resource Curse: An Illustration from Nigeria: NBER Working Paper 9804. 2003.

*Torvik R.* Natural Resources, Rent Seeking and Welfare // *Journal of Development Economics*. 2002. 67. P. 455–470.

*Torvik R.* Why do Some Resource-Abundant Countries Succeed While Others do not? // *Oxford Review of Economic Policy*. 2009. 25(2). P. 241–256.

# СПЕЦИФИКА ВЛИЯНИЯ ИНСТИТУТОВ НА ЭКОНОМИЧЕСКИЙ РОСТ В УСЛОВИЯХ ПЕРЕХОДА К РЫНКУ

---

Согласно теории роста, эффективные институты ускоряют экономический рост [Beck, Laeven, 2006; Lane, Rohner, 2004]. Наряду с этим большинство отечественных экономистов ссылаются на страны с переходной экономикой как пример, составляющий исключение из правил, демонстрируя тем самым, что высокие темпы экономического развития могут быть достигнуты даже в условиях слаборазвитой институциональной базы [Полтерович, 2005, 2008; Радыгин, Энтов, 2008]. Возникает, следовательно, необходимость исследовать причины существования специфической зависимости экономического роста от качества институтов в условиях перехода к рынку. Основная цель данной статьи состоит в исследовании характера искажений во взаимосвязи качества формальных институтов с темпами экономического развития, вызванных революционными институциональными преобразованиями в постсоветских странах.

## **Институты и экономический рост: обзор литературы**

В соответствии с теорией роста качество институтов предопределяет темпы экономического развития в стране. В своем большинстве исследования подтверждают эту идею, демонстрируя, что развитая демократия, эффективные права собственности или справедливая судебная система являются предпосылками для высоких темпов роста экономики [Baum, Lake, 2003; Lane, Rohner, 2004; Siddiqui, Masood, 2009]. Такие исследования, однако, базируются в большинстве случаев на эмпирике экономически развитых и развивающихся стран. Транзитивные экономики получают, тем не менее, достаточное внимание в исследованиях отечественной науки, отличительной чертой которых является обратная трактовка зависимости темпов экономического развития от качества институтов.

В отношении политических институтов демократия рассматривается как угроза для экономического развития [Радыгин, Энтов, 2008], поскольку данное политическое устройство позволяет, по мнению многих экономистов, извлечение значительной частной ренты лоббистских групп в условиях неурегулированной политической сферы [Полтерович, 2005]. При этом попытки ослабления административных принципов подвергаются значительной критике, тогда как усиление роли государства рассматривается как залог успеха институциональных преобразований [Там же].

Наряду с политическими институтами критике подвергаются также институты, имеющие непосредственное отношение к экономике: права собственности, законодательная база, независимость судебной системы и т.д. По мнению отечественных экономистов, наличие таких институтов само по себе не служит причиной для процветания экономики [Полтерович, 2008]. Акцент скорее делается на способе использования этих институтов [Полищук, 2005], что, по сути, сводится к возможности их задействования в личных интересах с целью извлечения выгод.

Более того, институциональные реформы в целом оцениваются как безрезультативные, что часто объясняется несогласованностью этих реформ с промышленной политикой [Полтерович, 2005], игнорированием национальных особенностей экономики [Ленчук, 2000], или отсутствием каких-либо попыток изменить неформальные институты постсоветского пространства [Ясин, 2003]. Институциональная основа в постсоветских странах признается также деформированной, что придает специфический характер зависимости экономического роста от качества институтов. Последнее сводится, главным образом, к утверждению о наличии институциональных ловушек [Полтерович, 2005]. Соответственно экономическое развитие рассматривается возможным даже в условиях слабо развитых институтов, в то время как их улучшение сопряжено со значительными экономическими и социальными издержками.

Существует, таким образом, своего рода расхождение во мнениях между западной и отечественной литературой в отношении понимания роли формальных институтов в экономическом развитии. С нашей точки зрения, разрешение этого противоречия становится возможным, если во внимание принимается способ формирования таких институтов. В постсоветских странах становление формальных институтов происходило посредством радикальных преобразований революционного типа. Революционный характер институциональных изменений и может, в определенной степени, объяснить специфику их влияния на темпы экономического развития.

## **Революционный способ формирования институтов и экономический рост: теоретическая модель**

Изменения в политических предпочтениях выступают отправной точкой процесса институциональной реформы революционного типа. Эти изменения вызывают необходимость адаптации экономических и социальных принципов к логике нового политического строя, что включает также создание новых формальных институтов. Как правило, государство берет на себя функции отбора и внедрения институциональной основы, являющейся, с его точки зрения, приемлемой в новых условиях. Поскольку государство не имеет надлежащего опыта с новым политическим устройством, этот процесс базируется, главным образом, на заимствовании формальных институтов у стран со схожим политическим режимом с их последующей имплантацией в национальную среду. Сам процесс построения институтов подобного рода носит вследствие этого формальный характер и может натолкнуться на две основные проблемы.

Во-первых, осуществляемый политиками процесс имплантации чуждых системе инородных институциональных элементов нередко предполагает отсутствие какого-либо анализа их совместимости с характеристиками национальной экономики. Во-вторых, возникает также несоответствие между имплантируемыми формальными институтами и преобладающими неформальными институтами (нормами поведения, представлениями о ценностях и культуре бизнеса). В результате восприятие и трактовка экономическими агентами навязываемых государством формальных институтов не всегда совпадает с изначально заложенным в них содержанием.

Революционный процесс формирования институтов имеет, таким образом, искусственный характер и отличается рядом характеристик. Во-первых, становление институтов происходит исключительно на макроуровне, при этом роль экономических агентов сведена в большинстве случаев к нулю. Во-вторых, возникает несоответствие взаимоотношений между институтами и характера экономических процессов. В-третьих, политическая сфера принимает на себя ведущую роль в процессе формирования институтов, которая сводится не только к их формализации, но также включает определение их функций, задач и принципов действия. Понимание логики становления институтов в процессе перехода к рынку позволяет выделить следующие нюансы в теории роста.

- Сформированные революционным путем институциональные элементы являются менее эффективными в регулировании деятельности экономических агентов, поскольку такой способ возникновения институтов гарантирует в меньшей степени их адекватность и соответствие превалирующим неформальным институтам и действующим принципам экономики. *Гипотеза 1: в условиях перехода к рынку темпы роста экономики нелинейно зависят от качества формальных институтов.*

- Специфической является также зависимость экономического роста от качества политической сферы. Поскольку при данном способе становления институтов институциональная основа экономики подвергается радикальным преобразованиям, эффективность экономики зависит коренным образом от способности политиков обеспечить плавный переход к новым формальным институтам. *Гипотеза 2: в условиях перехода к рынку существует тесная взаимосвязь между экономическим развитием и качеством политической сферы.*

- Революционный способ становления формальных институтов предполагает, что процесс формирования институтов осуществляется государством. Соответственно качество таких институтов находится в прямой зависимости от эффективности и профессионализма политических органов, непосредственно занимающихся их созданием. *Гипотеза 3: в условиях перехода к рынку существует тесная взаимосвязь между качеством новых (формальных) институциональных элементов и качеством политической сферы.*

## Данные и методы анализа

Для тестирования выше указанных гипотез сформирована база данных, содержащая 26 стран с переходной экономикой: Азербайджан, Албания, Армения, Беларусь, Болгария, Грузия, Венгрия, Казахстан, Киргизия, Латвия, Литва, Македония, Молдавия, Польша, Россия, Румыния, Сербия, Словакия, Словения, Таджикистан, Туркменистан, Узбекистан, Украина, Хорватия, Чехия и Эстония. Анализ охватывает данные с 1996 по 2008 гг.

Эмпирическая модель при этом принимает следующий вид:

$$Y_{it} = \alpha Y_{it-1} + \beta_0 + \beta_1 PHYSC_{it} + \beta_2 HUMC_{it} + \beta_3 SPENDING\_R\&D_{it} + \beta_4 EXPO_{it} + \beta_5 MACSTAB_{it} + \beta_6 GOVC_{it} + \beta_7 INSTITUTE_{it} + \varepsilon_{it}$$

где  $Y_{it}$  описывает экономический рост, измеряемый как годовой прирост ВВП в процентах.  $PHYSC$  отражает накопление физического капитала, измеренного годовым приростом основных фондов в процентах к ВВП.  $HUMC$  выражает накопление человеческого капитала, выраженного долей выпускников средних



школ, продолжающих обучение в вузах. *MACSTAB* описывает степень макроэкономической стабильности, измеренной годовыми темпами инфляции. *GOVC* отражает размер правительственного сектора, представленного долей государственных расходов в ВВП. Наконец, переменная *SPENDING\_R&D* содержит информацию о доле инвестиций в исследования в ВВП. Источником данных для всех переменных является электронная база данных Мирового банка.

Уровень зрелости формальных институтов экономики измеряется следующими индексами: индексами справедливости суда, исполнения контрактов, свободы ведения бизнеса, защищенности прав собственности, качества законодательной базы, коррупции. Качество политической сферы измеряется индексами контроля коррупции в законодательных органах, демократии, политической стабильности, эффективности правительства и регулятивной эффективности<sup>1</sup>.

## **Революционный способ формирования институтов и экономический рост: эмпирический анализ**

Эмпирический анализ в целом подтверждает наши гипотезы. Несмотря на то, что ряд формальных институтов (Справедливость суда, Исполнение контрактов, Свобода ведения бизнеса) являются непосредственным источником экономического развития (см. табл. 1, модели 1–3), отдельные институциональные элементы обнаруживают нелинейную взаимосвязь с темпами роста. Так, несколько иной представляется нам зависимость экономического роста от качества законодательного процесса, что, по сути, отражает качество действующих в стране законов (см. табл. 1, модели 4–5). Полученные результаты указывают скорее на наличие институциональной ловушки, поскольку нелинейность данной взаимосвязи подразумевает замедление темпов роста с улучшением качества данного института.

Эмпирический анализ указывает также, что коррупция может выступать положительным детерминантом роста экономики, подтверждая тем самым доминирующий в российской литературе тезис о положительной роли теоретически плохих институтов (модели 6–7). Дальнейший анализ, однако, позволяет

---

<sup>1</sup> Источником данных для индексов справедливости суда, исполнения контрактов, свободы ведения бизнеса, защищенности прав собственности является *Economic Freedom of the World Annual Reports*, для индексов качества законодательной базы и коррупции – *Freedom House*, для индексов политической сферы – *The World Bank Group Website*. Большие значения индексов отражают улучшение соответствующих институциональных элементов.

объяснить природу этого явления (модель 8). Ключом к разрешению загадки является одновременное включение в модель переменной качества законодательного процесса и коррупции. Коррупция при этом становится негативным детерминантом роста. Более того, если учесть пересечение этих двух переменных (модель 9), становится очевидным, что несмотря на то, что коррупция тормозит экономическое развитие, наличие коррупции в условиях неразвитого законодательного процесса может ускорить темпы экономического роста.

**Таблица 1.** Результаты регрессии качества законодательной базы на темпы экономического роста

	Модель 1	Модель 2	Модель 3	Модель 4	Модель 5	Модель 6	Модель 7	Модель 8	Модель 9
<b>Справедливость суда</b>	<b>0,352**</b>								
<b>Исполнение контрактов</b>		<b>1,645**</b>							
<b>Свобода ведения бизнеса</b>			<b>0,511***</b>						
<b>Качество законодательного процесса</b>									
Главный эффект				<b>-1,835**</b>	<b>2,564</b>			<b>-2,253**</b>	<b>-0,182</b>
Квадратичный эффект					<b>-0,538**</b>				
<b>Коррупция</b>									
Краткосрочный эффект						<b>-0,636</b>	<b>-0,381</b>	<b>1,391</b>	<b>2,618**</b>
Долгосрочный эффект ( $t - 1$ )							<b>-1,475**</b>		
<b>Пересечение коррупции и качества законодательного процесса</b>									<b>-0,402</b>
<b>GROWTH<sub>t-1</sub></b>	<b>-0,722***</b>	<b>-0,768***</b>	<b>-0,734***</b>	<b>-0,875***</b>	<b>-0,885***</b>	<b>-0,865***</b>	<b>-0,785***</b>	<b>-0,878***</b>	<b>-0,882***</b>
<b>PHYSC</b>	<b>0,533***</b>	<b>0,425***</b>	<b>0,456***</b>	<b>0,512***</b>	<b>0,514***</b>	<b>0,499***</b>	<b>0,565***</b>	<b>0,519***</b>	<b>0,513***</b>
<b>HUMC</b>	<b>0,007</b>	<b>0,007</b>	<b>0,004</b>	<b>0,003</b>	<b>0,004</b>	<b>0,007</b>	<b>0,008</b>	<b>0,003</b>	<b>0,004</b>
<b>EXROT</b>	<b>0,130***</b>	<b>0,128***</b>	<b>0,126***</b>	<b>0,118**</b>	<b>0,111**</b>	<b>0,118**</b>	<b>0,280***</b>	<b>0,045</b>	<b>0,126**</b>
<b>EXROT<sub>t-1</sub></b>	<b>0,146***</b>	<b>0,164***</b>	<b>0,176***</b>	<b>0,125***</b>	<b>0,125***</b>	<b>0,120***</b>		<b>0,152***</b>	<b>0,126***</b>
<b>SPENDING ON R&amp;D</b>	<b>1,935***</b>	<b>1,793**</b>	<b>1,789**</b>	<b>2,063***</b>	<b>2,050***</b>	<b>1,961***</b>	<b>-0,074</b>	<b>2,117***</b>	<b>2,156***</b>
<b>MACSTAB</b>	<b>-0,013***</b>	<b>-0,156**</b>	<b>-0,398***</b>	<b>0,004</b>	<b>0,011</b>	<b>-0,000</b>	<b>-0,216**</b>	<b>-0,058</b>	<b>0,001</b>
<b>MACSTAB<sub>t-1</sub></b>	<b>-0,120***</b>	<b>-0,202**</b>	<b>-0,202***</b>	<b>-0,125***</b>	<b>-0,125**</b>	<b>-0,119**</b>		<b>-0,225**</b>	<b>-0,128***</b>
<b>GOVC</b>	<b>-0,204**</b>	<b>-0,369**</b>	<b>-0,298**</b>	<b>-0,231**</b>	<b>-0,213**</b>	<b>-0,202**</b>	<b>-0,274***</b>	<b>-0,218***</b>	<b>-0,212**</b>
<i>Overall Rsq</i>	<b>0,378</b>	<b>0,389</b>	<b>0,461</b>	<b>0,365</b>	<b>0,378</b>	<b>0,316</b>	<b>0,504</b>	<b>0,512</b>	<b>0,530</b>
<i>Количество стран</i>	22	18	18	22	22	22	22	22	22
<i>Количество наблюдений</i>	111	111	111	152	152	152	152	152	152

Специфика развития переходных экономик найдена также при анализе влияния качества политической сферы на темпы роста (табл. 2). Как часто утверждается в российской литературе, политическая стабильность необходима для быстрого развития экономики, особенно в долгосрочном периоде (модель 1). Эффективность правительства в проведении экономических реформ или регулировании экономических процессов также оказывает положительное влияние на экономическое развитие (модели 2–3). Более того, темпы развития экономик зависят от уровня контроля коррупции в органах власти. Следует также отметить, что индекс демократии не обнаруживает никакой статистически значимой взаимосвязи с темпами развития, подтверждая тем самым литературу постсоветского пространства.

**Таблица 2.** Результаты регрессии индексов политической сферы на темпы экономического роста

	Модель 1	Модель 2	Модель 3	Модель 4	Модель 5
<b>Политическая стабильность</b>					
Краткосрочный эффект	<b>-0,844</b>				
Долгосрочный эффект	<b>2,580***</b>				
<b>Эффективность правительства</b>					
Краткосрочный эффект		<b>-3,246*</b>			
Долгосрочный эффект		<b>3,725**</b>			
<b>Регулятивная эффективность</b>					
Краткосрочный эффект			<b>4,309**</b>		
<b>Коррупция в органах власти</b>					
Краткосрочный эффект				<b>5,913**</b>	
<b>Индекс демократии</b>					
Краткосрочный эффект					<b>-6,898</b>
Долгосрочный эффект					<b>8,571</b>
<b>GROWTH<sub>t-1</sub></b>	-0,296***	-0,262***	-0,200***	-0,141	-0,167
<b>PHYSC</b>	0,186***	0,253***	0,191***	0,201***	0,179**
<b>HUMC</b>	-0,033	-0,051	-0,017	-0,032	0,069
<b>EXROT</b>	0,139***	0,173***	0,152***	0,139***	0,165***
<b>SAVINGS</b>	-0,017	-0,030	-0,142***	-0,152**	-0,021
<b>MACSTAB</b>	-0,167***	-0,183***	-0,249***	-0,240***	-0,315***
<b>GOVC</b>	-0,205***	-0,309***	-0,377***	-0,357***	-0,224***
<i>Sargan-тест</i>	0,965	0,901	0,991	0,990	0,898
<i>Arellano – Bond-тест</i>					
<i>1-й уровень</i>	0,236	0,067	0,661	0,286	0,498
<i>Arellano – Bond-тест</i>					
<i>2-й уровень</i>	0,498	0,358	0,507	0,886	0,864
<i>Количество стран</i>	24	24	22	22	22
<i>Количество наблюдений</i>	120	120	112	112	95

Наконец, специфика транзитивных экономик становится также очевидной при анализе влияния качества политической сферы на институциональные индексы (табл. 3). Практически во всех случаях мы получили подтверждение гипотезы 3 о том, что качество политической среды, занимающейся формированием институтов, существенно предопределяет качество таких институтов. Более того, следует подчеркнуть, что все институциональные индексы особенно чувствительны к уровню коррупции в органах власти и к качеству правительственных органов. Данные, однако, противоречат утверждению многих авторов о том, что демократия сдерживает внедрение и укрепление эффективных рыночных институтов. Напротив, демократические принципы способствуют формированию здоровой институциональной среды.

**Таблица 3.** Результаты регрессии индексов политической сферы на институциональные индексы

	Уравнение					
	справедливости суда	исполнения контрактов	свободы ведения бизнеса	прав собственности	качества законодательного процесса	коррупции
Политическая стабильность	-0,548	0,058	0,031	0,220	-0,188	0,045
Эффективность правительства	-0,702	0,355	0,807**	1,758**	0,266	0,360***
Регулятивная эффективность	0,197	0,352	1,157**	1,171**	0,196	0,637***
Коррупция в органах власти	0,151	0,515*	1,685***	1,565**	0,618***	0,522**
Индекс демократии	0,492	1,020***	0,047	0,251	0,937***	0,740***
URBAN	-0,008	-0,060***	-0,048	0,139*	0,006*	-0,020***
HUMC	-0,026***	0,042***	0,020**	0,061***	0,000	0,000
EXROT	-0,005	0,003	0,014	0,013	-0,030*	-0,025*
SAVINGS	-0,029	-0,052	0,009	0,003	0,019***	0,025***
GOVC	0,058**	-0,056***	0,073***	0,034*	-0,025***	-0,023***
<i>Rsq</i>	0,090	0,128	0,200	0,200	0,650	0,560
<i>Количество стран</i>	19	18	19	19	22	22
<i>Количество наблюдений</i>	132	54	101	123	149	149

## Выводы и рекомендации

Результаты исследования позволяют, таким образом, установить две основные специфики, характерные для постсоветских экономик. Во-первых, созданные революционным способом формальные институты обнаруживают

деформированную взаимосвязь с темпами экономического развития, обусловленную невозможностью обеспечения полного соответствия характеристик имплантируемых в национальную среду формальных институтов превалирующим в обществе неформальным институтам и характеру экономических процессов. Во-вторых, особая роль принадлежит политической сфере в условиях коренных институциональных преобразований. Ее качество предопределяет в значительной степени не только рост экономики в первых два периода, но и качество нововведенных формальных институтов.

Понимание специфики революционного способа становления институтов позволяет определить основные направления институциональных преобразований в постсоветском пространстве, дающих возможность выхода страны на траекторию эффективного экономического развития. Мы рассматриваем данный процесс как двушаговую модель реформирования. Первый шаг состоит в проведении так называемой *вертикальной модернизации*, представляющей собой радикальные преобразования в политической сфере. Минимизация коррупции в органах власти, ликвидация возможности влияния отдельных лиц на законодательный процесс в сочетании с повышением профессионализма чиновников и обеспечением политической стабильности создаст необходимые условия для роста экономики в ближайший период, а также основу для проведения институциональных реформ.

Второй шаг предполагает проведение самой институциональной реформы, опирающейся на принцип *горизонтальной интеграции*. Последнее предполагает, что преобразование институтов происходит не изолированно от экономики и экономических агентов, а, напротив, в тесном сочетании с реформированием структуры и принципов экономики, а также с продвижением новых видений и норм поведения среди главных игроков – экономических агентов. Сочетание этих реформ даст возможность устранить появление несоответствий между принципами действия новых «правил игры» и средой, в которой эта игра происходит, или актерами, принимающими непосредственное участие в ней.

## Литература

Ленчук Е. Проблемы перехода к инновационной модели развития в странах СНГ. 2000. ([http://www.econ.msu.ru/cmt2/lib/a/1158/file/Lenchuk\\_32.pdf](http://www.econ.msu.ru/cmt2/lib/a/1158/file/Lenchuk_32.pdf))

Полицук Л. Нецелевое использование институтов: причины и следствия. 2005. (<http://www.hse.ru/data/056/541/1238/>)

Полтерович В. К руководству для реформаторов: некоторые выводы из теории экономических реформ // Экономическая наука современной России. 2005. № 1 (28). С. 7–24.

*Полтерович В.* Стратегии модернизации, институты и коалиции // Вопросы экономики. 2008. № 4.

*Радыгин А., Энтов Р.* В поисках институциональных характеристик роста // Вопросы экономики. 2008. № 8. С. 4–27.

*Ясин Е.Г.* Модернизация экономики и система ценностей. 2003. (<http://www.amicable.ru/library/yasin2003.pdf>)

*Baum M., Lake D.* The Political Economy of Growth: Democracy and Human Capital // American Journal of Political Science. 2003. Vol. 47. № 2. P. 333–347.

*Beck T., Laeven L.* Institution Building and Growth in Transition Economies // Journal of Economic Growth. 2006. Vol. 11. P. 157–186.

*Lane J., Rohner D.* Institution Building and Spillovers // Swiss Political Science Review. 2004. Iss. 10. № 1. P. 77–90.

*Siddiqui D., Masood A.* Institutions and Economic Growth: A Cross-country Evidence: MPRA Paper № 19747. Munich Personal RePEc Archive. 2009.

## Введение

Многочисленные эмпирические исследования указывают на важность институтов для экономического развития [Acemoglu, Johnson, Robinson, 2001; Easterly, Levine, 2003; Rodrick, Subramanian, Trebbi 2004], однако механизмы данной связи остаются до конца неизученными. В основе таких механизмов часто лежит выбор экономических агентов между производительной или непроизводительной деятельностью (*rent-seeking*), который зависит от качества институтов. В частности, установлено, что институты влияют на производственные инвестиции, а те, в свою очередь, на экономический рост [Knack, Keefer, 1995].

В нашем исследовании такая связь распространяется на инвестиции в человеческий капитал, а именно выбор одаренной молодежью предмета изучения в высшей школе и сферы деятельности по окончании вуза. Экономический рост питается предпринимательской энергией и инновациями, а последнее, согласно работе [Murphy, Shleifer, Vishny, 1991], генерируются сравнительно немногочисленной когортой наиболее одаренных индивидов. Выбор ими поприща для приложения своих сил и идей оказывается критически важным для темпов и качества экономического роста. Лэндис [Landes, 1969] выдвинул гипотезу о том, что различия в распределении талантов стали одной из причин, по которой промышленная революция конца XVIII – начала XIX вв. началась в Англии, а не во Франции. В XX в. подобными примерами могут служить, с одной стороны, страны Латинской Америки и Африки, где слабость институтов защиты прав собственности предопределила большую долю непроизводительного сектора в структуре экономики, и успех новых индустриальных стран Юго-Восточной Азии, с другой, где институты стимулировали предпринимательскую деятельность.

В работе Баумоля [Baumol, 1990] выдвигается гипотеза о том, что «предложение» потенциальных предпринимателей, готовых создавать и внедрять

инновации, не подвержено значительным перепадам от одной страны и эпохи к другой. Вместе с тем преобладающие в обществе институты оказывают сильное воздействие на характер предпринимательской деятельности, направляя ее либо на создание производительных инноваций в классическом шumpетерианском смысле, либо на достижение успеха в борьбе за ренту. Таким образом, выбор специальности и сферы деятельности талантливой частью общества, и особенно одаренной молодежью, зависит от качества институтов и оказывает значительное воздействие на рост и, таким образом, оказывается «передаточным механизмом» между институтами и ростом.

Мы тестируем эту гипотезу, анализируя связь между индикаторами качества институтов в различных странах (в первую очередь, верховенства закона и качества государственного управления) и выбором программы обучения студентами вузов.

Эмпирическая стратегия работы выглядит следующим образом. На начальной стадии исследования мы проверяем гипотезы о связи качества институтов (в том числе государственного управления) и долей молодых людей, окончивших высшие учебные заведения по различным специальностям (по выборке из 80 стран). Мы находим, что индекс верховенства закона статистически значимо положительно коррелирует с долей выпускников естественно-научных и медицинских специальностей – чем выше индекс (выше уровень законности и правопорядка), тем больше людей выбирают данные специальности. Отрицательно индекс верховенства закона связан с долей выпускников юридических факультетов. Высота барьеров входа на рынок (количество и стоимость процедур для регистрации бизнеса) также положительно связана с долей выпускников юридических специальностей. Указанные взаимосвязи устойчивы при контроле на отраслевую структуру экономики, уровень образования, исторические и культурные переменные (такие как происхождение правовых систем), а также обеспеченность природными ресурсами и географические условия. Наш анализ подтверждает некоторые теоретические представления о связи качества институтов, структуры вознаграждения и распределения талантов в экономике [Acemoglu, 1995].

Кроме того, он заставляет по-новому взглянуть на проблемы высшего образования в России. В дебатах о модернизации российской высшей школы основное внимание уделяется проблеме качества образования, т.е. факторам, находящимся на стороне предложения. Мы обращаем внимание на неблагоприятное *спроса* на высшее образование, где непропорционально представлены, в частности, специальности государственного управления. Ключ к устранению



подобных диспропорций находится в институциональных реформах, защищающих права собственности и создающих благоприятные условия для производительных инноваций.

## Описание данных

Ключевые переменные в нашем анализе – это распределение выпускников вузов по различным специальностям. Мы используем базу данных Статистического института ЮНЕСКО<sup>1</sup>. В базе содержится информация о численности выпускников вузов в 102 странах мира и распределении выпускников по 28 специальностям. Статистический институт ЮНЕСКО осуществляет классификацию данных по единой методике, обеспечивая таким образом сопоставимость данных между странами и во времени.

Основной объясняющей переменной в нашем анализе выступает качество экономических и политических институтов. Мы пользуемся широко известной базой данных Мирового банка The Worldwide Governance Indicators. База данных содержит показатели качества институтов по шести основным разделам:

- подотчетность власти (Voice and Accountability);
- политическая стабильность и отсутствие насилия (Political Stability No Violence);
- эффективность государственного управления (Government Effectiveness);
- качество регулирования (Regulatory Quality);
- верховенство закона (Rule of Law);
- контроль за коррупцией (Control of Corruption).

Каждый показатель изменяется в диапазоне от  $-2,5$  до  $2,5$ . Кроме того, база содержит рейтинги стран по каждому из указанных индикаторов за последние 15 лет. Подробнее с методикой расчета индикаторов и составления рейтингов можно ознакомиться в работе Кауфманна и соавторов [Kaufmann, Kraay, Mastruzzi, 2010].

Индикаторы качества институтов, разработанные Мировым банком, широко используются экономистами в эмпирических исследованиях. В частности, работы, связывающие качество государственного управления, масштабы регулирования, уровень коррупции и экономический рост опирались на вышепри-

---

<sup>1</sup> UNESCO Institute of Statistics (<http://www.uis.unesco.org/>). Мы благодарим сотрудников института Чао Линн Чейна и Альберта Мотиванс за любезно предоставленные данные.

веденные индексы и находили сильную статистически значимую связь между институтами и экономическим развитием [La Porta et al., 1999; Djankov et al., 2002].

Помимо данных ЮНЕСКО и Мирового банка мы используем данные об отраслевой структуре экономики, наличии природных ресурсов, географическом положении, а также культурных и исторических корнях современных правовых институтов. Все эти переменные могут оказывать серьезное влияние на структуру вознаграждений в экономике и, следовательно, на решения молодых людей о получении той или иной специальности. Описательная статистика по основным переменным приведена в табл. 1.

**Таблица 1.**

Описательная статистика

	Среднее	Стандартное отклонение	N
Юридические специальности	6,04	4,46	84
Естественно-научные специальности	9,39	6,64	94
Медицинские специальности	10,50	6,42	94
Индекс верховенства закона (Rule of Law)	0,609	0,284	103
ВВП на душу населения	15649,6	12862,5	89
Уровень образования	42,375	26,154	84
<i>Структура экономики</i>			
Аграрный сектор, % ВВП	9,53	11,14	89
Промышленность, % ВВП	28,48	12,11	90
Услуги, % ВВП	62,04	14,70	91
<i>История и культура</i>			
Континентальное право (Civil Law) = 1	0,443	0,500	79
Доля католиков, %	34,13	38,63	79
Доля мусульман, %	19,30	35,16	79
<i>Природные ресурсы</i>			
Нефтедобывающая страна = 1	0,369	0,485	103
Доля мировых запасов золота, %	0,225	1,286	89
Доля мировых запасов серебра, %	0,517	2,422	89
Доля мировых запасов железа, %	0,372	1,962	89
Доля мировых запасов цинка, %	0,640	2,501	89
<i>География</i>			
Отсутствие выхода к морю = 1	0,190	0,395	79
Остров =1	0,143	0,352	91

Первые три строки показывают долю выпускников соответственно юридических, естественно-научных (физика, химия, биология) и медицинских специальностей от общего числа выпускников в 2009 г.<sup>2</sup> Основная объясняющая переменная – индекс верховенства закона. Мы используем рейтинг стран по данному показателю за 2009 г. Рейтинг изменяется в пределах от нуля до единицы и отражает относительное положение страны по данному показателю в мире. Средний показатель верховенства закона в нашей выборке стран 0,6 со стандартным отклонением 0,28.

## Результаты анализа

Качество институтов определяет стимулы экономических агентов к производительной деятельности. Особенно актуален вопрос о выборе сферы приложения усилий для наиболее способных молодых людей, выходящих на рынок труда, а именно выпускников высших учебных заведений.

Уравнение (1) демонстрирует нашу основную гипотезу – выбор рациональных экономических агентов между производительной и непроизводительной деятельностью определяется состоянием институциональной среды.

$$(Un)productive\ activities_i = \beta_0 + \beta_1 Rule\ of\ Law_i + \beta_2 X_i + \varepsilon_i, \quad (1)$$

где  $(Un)productive\ activities_i$  – доля рабочей силы, занятой в (не)производительном секторе экономики в стране  $i$ ;  $Rule\ of\ Law_i$  – качество государственных институтов в стране  $i$ ;  $X_i$  – вектор прочих характеристик страны  $i$ ;  $\varepsilon_i$  – влияние неучтенных факторов.

Интересующий нас коэффициент  $\beta_1$  показывает влияние институциональной среды на распределение усилий экономических агентов между производительной и непроизводительной деятельностью. В отсутствие точных данных о масштабах рентоориентированного поведения мы можем полагаться лишь на примерные оценки (прокси-показатели). В качестве показателя непродуктивной деятельности мы используем долю выпускников юридических специальностей. Продуктивную деятельность характеризуют выпускники естественно-научных и медицинских специальностей.

Необходимо отметить, что мы не склонны высказывать априорные суждения о полезности той или иной профессии для достижения общественного

---

<sup>2</sup> Для некоторых стран данные за 2009 г. недоступны. В целях увеличения количества наблюдений использовались доступные данные за ближайший год (2008 г. или 2007 г.). Мы уверены, что это не оказывает существенного влияния на результаты анализа, так как срок обучения по соответствующим специальностям не меньше четырех лет.

оптимума. Доля выпускников соответствующих специальностей является лишь характеристикой *потенциала* рентоориентированного поведения. Очевидно, что юридическое образование с равной эффективностью может служить как орудием перераспределения, так и способом защиты от него. Однако и в том, и в другом случаях усилия экономических агентов расходуются на непроизводительную деятельность, не стимулирующую инновации. В то же время профессии, связанные с естественными науками, и в особенности с медициной, оставляют намного меньше пространства для масштабной перераспределительной деятельности. Кроме того, высокая доля выпускников медицинских специальностей указывает на значительную отдачу от вложений в человеческий капитал и индивидуальную производительность работников, что, несомненно, является индикатором продуктивной общественно полезной деятельности.

Таблица 2 демонстрирует результаты оценки параметров регрессионного уравнения (1). В качестве зависимой переменной взят логарифм доли выпускников юридических специальностей. Столбец (1) показывает простую парную зависимость между зависимой переменной и индексом верховенства закона. Высокий отрицательный и статистически значимый коэффициент указывает на негативное влияние качества институтов на предпочтения молодыми людьми профессии юриста. В странах с низким качеством институтов доля выпускников-юристов больше. Снижение в рейтинге стран по качеству исполнения законов на один пункт связано с увеличением доли молодых юристов почти на 1%. Столбец (2) учитывает общую долю людей с высшим образованием в стране. Интересующий нас коэффициент практически не изменяется и сохраняет свою значимость.

Столбец (3) учитывает влияние структуры экономики. Отраслевая структура экономики оказывает значительное влияние на сравнительный размер вознаграждения работников. Мы учитываем три основных крупных сектора – сельское хозяйство, промышленность и сектор услуг. Как видно из результатов регрессии, развитый сектор услуг увеличивает долю юристов среди выпускников вузов. Это является вполне очевидным результатом, поскольку профессия юриста востребована в первую очередь в секторе финансовых, консалтинговых и прочих услуг.

Столбцы (4) и (5) учитывают влияние исторических и культурных факторов. В работах Ла Порты и соавторов показано, что происхождение правовых систем оказывает значительное влияние на функционирование институтов и экономические результаты [La Porta et al., 2008]. Мы учитываем это влияние в уравнении регрессии и находим, что в странах с континентальным правом (Civil

Law) доля выпускников-юристов выше по сравнению со странами с прецедентным правом (Common Law).

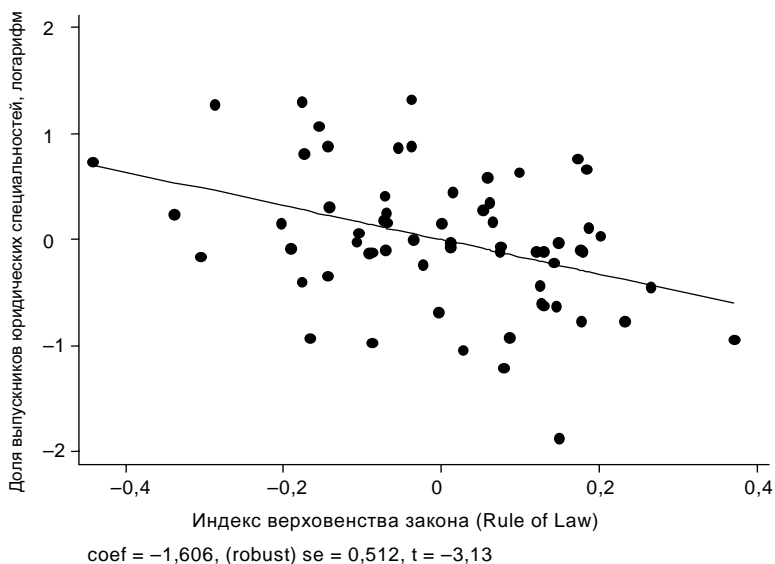
**Таблица 2.**

Качество институтов и выпускники юридических специальностей

	Логарифм доли выпускников юридических специальностей					
	(1)	(2)	(3)	(4)	(5)	(6)
Верховенство закона (Rule of Law)	-0,958*** (0,253)	-0,996** (0,478)	-1,510** (0,667)	-1,589*** (0,430)	-1,610*** (0,445)	-1,600*** (0,490)
Уровень образования		0,00126 (0,00582)	2,67e-05 (0,00619)	0,000527 (0,00462)	-0,00475 (0,00503)	-0,00366 (0,00596)
Аграрный сектор, % ВВП			0,0414 (0,0331)	0,0364 (0,0271)	0,0875*** (0,0257)	0,0863** (0,0362)
Промышленность, % ВВП			0,0266 (0,0295)	0,0351 (0,0253)	0,101*** (0,0241)	0,0985** (0,0385)
Услуги, % ВВП			0,0545* (0,0279)	0,0576** (0,0219)	0,110*** (0,0245)	0,114*** (0,0372)
Континентальное право (Civil Law) = 1				0,214 (0,224)	0,438** (0,212)	0,514* (0,267)
Доля католиков, %					-0,00246 (0,00331)	-0,00285 (0,00428)
Доля мусульман, %					-0,0123** (0,00474)	-0,0116** (0,00575)
Нефтедобывающая страна = 1						-0,170 (0,212)
Отсутствие выхода к морю = 1						0,275 (0,221)
Островное государство = 1						-0,469 (0,489)
Constant	-2,534*** (0,177)	-2,564*** (0,214)	-6,746** (2,835)	-7,090*** (2,295)	-12,28*** (2,179)	-12,55*** (3,441)
Observations	84	75	70	65	65	63
R-squared	0,093	0,081	0,217	0,263	0,389	0,445

Примечания. Стандартные ошибки по методу Уайта в скобках. \*\*\* p < 0,01; \*\* p < 0,05; \* p < 0,1.

Наконец, потенциально важными факторами могут служить обеспеченность страны природными ресурсами и географическое положение. Включение этих факторов в уравнение не изменяет наши результаты – связь институтов и доли выпускников-юристов остается статистически значимой и отрицательной. Рисунок 1 наглядно демонстрирует взаимосвязь доли выпускников юридических специальностей и качества институтов по результатам оценки уравнения (1) с учетом всех прочих факторов (столбец б).



**Рис. 1.** Качество институтов и доля выпускников юридических специальностей

Следующая спецификация оценивает взаимосвязь качества институтов и доли выпускников естественно-научных специальностей. Коэффициент при индексе верховенства закона положительный и статистически значим на уровне 1%. Таким образом, высокое качество институтов создает стимулы к приобретению естественно-научной специальности.

**Таблица 3.**

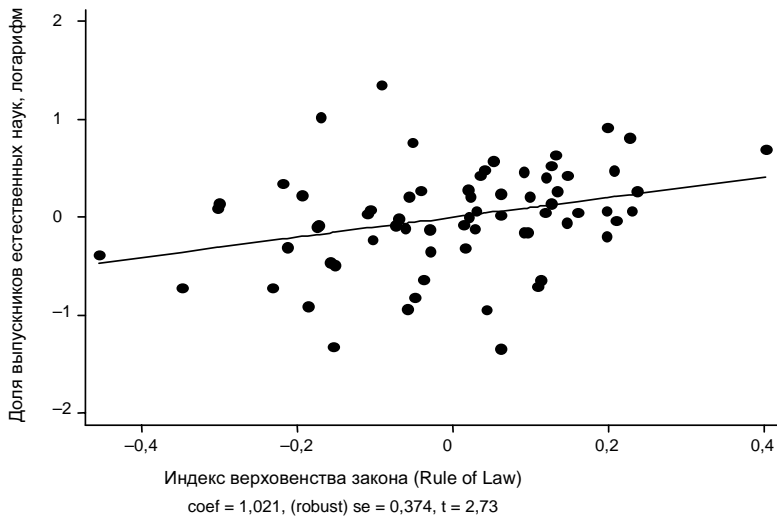
Качество институтов и выпускники естественно-научных специальностей

	Логарифм доли выпускников естественно-научных специальностей					
	(1)	(2)	(3)	(4)	(5)	(6)
Верховенство закона (Rule of Law)	0,467* (0,280)	0,974*** (0,278)	0,784** (0,385)	0,932** (0,434)	1,042*** (0,328)	1,063*** (0,373)
Уровень образования		-0,00862** (0,00344)	-0,0107*** (0,00397)	-0,00895* (0,00494)	-0,00289 (0,00497)	-0,000790 (0,00684)
Аграрный сектор, % ВВП			0,0899** (0,0417)	0,0992*** (0,0369)	0,0454 (0,0496)	0,0385 (0,0583)
Промышленность, % ВВП			0,0974** (0,0392)	0,110*** (0,0338)	0,0403 (0,0492)	0,0337 (0,0592)
Услуги, % ВВП			0,102** (0,0391)	0,110*** (0,0337)	0,0535 (0,0486)	0,0445 (0,0582)

	Логарифм доли выпускников естественно-научных специальностей					
	(1)	(2)	(3)	(4)	(5)	(6)
Континентальное право (Civil Law) = 1				0,280 (0,180)	0,0635 (0,144)	0,0621 (0,176)
Доля католиков, %					0,00303 (0,00242)	0,00411 (0,00324)
Доля мусульман, %					0,0132*** (0,00372)	0,0147*** (0,00502)
Нефтедобывающая страна = 1						-0,0886 (0,186)
Отсутствие выхода к морю = 1						0,0799 (0,199)
Островное государство = 1						0,317 (0,331)
Constant	-2,818*** (0,216)	-2,802*** (0,220)	-12,57*** (3,924)	-13,78*** (3,416)	-8,349* (4,768)	-7,708 (5,655)
Observations	90	81	76	70	70	68
R-squared	0,038	0,128	0,200	0,219	0,421	0,447

Примечания. Стандартные ошибки по методу Уайта в скобках. \*\*\* p < 0,01; \*\* p < 0,05; \* p < 0,1.

Рисунок 2 демонстрирует взаимосвязь индекса верховенства закона и выпускников естественно-научных специальностей.



**Рис. 2.** Качество институтов и доля выпускников естественно-научных специальностей

Аналогичные результаты мы получаем, когда в качестве зависимой переменной в уравнении регрессии используем долю выпускников медицинских специальностей. Высокое положение страны в рейтинге верховенства закона, при прочих равных условиях, повышает долю медиков среди выпускников высших учебных заведений.

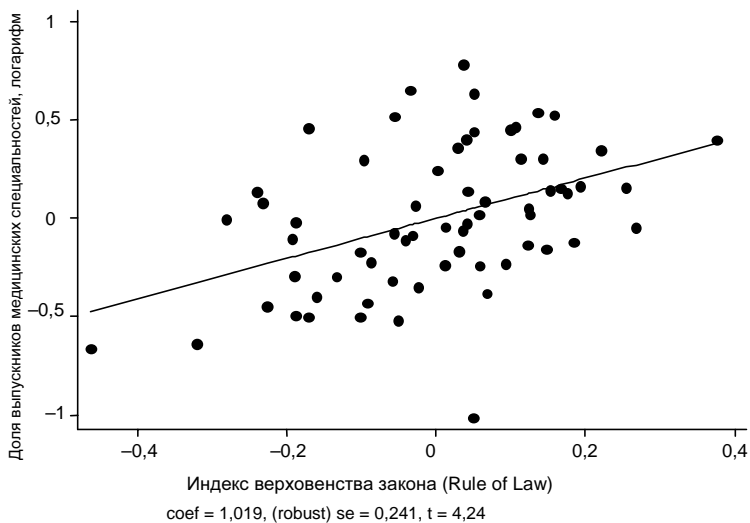
**Таблица 4.** Качество институтов и выпускники медицинских специальностей

	Логарифм доли выпускников медицинских специальностей					
	(1)	(2)	(3)	(4)	(5)	(6)
Верховенство закона (Rule of Law)	1,081*** (0,232)	0,774*** (0,235)	0,639** (0,294)	0,901*** (0,274)	0,960*** (0,246)	1,052*** (0,302)
Уровень образования		0,00667*** (0,00238)	0,00540* (0,00305)	0,00764** (0,00359)	0,00806** (0,00390)	0,00899 (0,00560)
Аграрный сектор, % ВВП			0,0686*** (0,0138)	0,0894*** (0,0117)	0,0902*** (0,0193)	0,0870*** (0,0232)
Промышленность, % ВВП			0,0737*** (0,00720)	0,0901*** (0,00757)	0,0868*** (0,0208)	0,0819*** (0,0280)
Услуги, % ВВП			0,0760*** (0,00845)	0,0863*** (0,00826)	0,0809*** (0,0188)	0,0753*** (0,0258)
Континентальное право (Civil Law) = 1				0,268** (0,118)	0,184 (0,145)	0,136 (0,170)
Доля католиков, %					0,00287 (0,00204)	0,00385 (0,00281)
Доля мусульман, %					0,000427 (0,00301)	0,00103 (0,00438)
Нефтедобывающая страна = 1						-0,0371 (0,161)
Отсутствие выхода к морю = 1						-0,0504 (0,159)
Островное государство = 1						-0,224 (0,244)
Constant	-3,018*** (0,169)	-3,115*** (0,176)	-10,44*** (0,814)	-12,11*** (0,752)	-11,81*** (1,736)	-11,34*** (2,274)
Observations	88	79	74	68	68	66
R-squared	0,241	0,367	0,430	0,468	0,488	0,535

Примечания. Стандартные ошибки по методу Уайта в скобках. \*\*\* p < 0,01; \*\* p < 0,05; \* p < 0,1.

Рисунок 3 демонстрирует эту взаимосвязь по результатам оценки спецификации в столбце (6).





**Рис. 3.** Качество институтов  
и доля выпускников медицинских специальностей

## Заключение

В экономической литературе сформировались два основных направления, объясняющих устойчивость неэффективных институтов во времени. Первое отводит основную роль политическим институтам. Утверждается, что заинтересованность властных элит в получении административной ренты создает стимулы к сохранению общественно неэффективного статус кво и блокирует экономический рост [Acemoglu, Robinson, 2008].

Второе направление объясняет устойчивость институтов влиянием культурных и исторических факторов. К примеру, в работе Табеллини на примере регионов Италии показано, что опыт свободного самоуправления способствует накоплению доверия в обществе, что, в свою очередь, положительно влияет на функционирование политических институтов [Tabellini, 2008].

Мы предлагаем третье объяснение, основанное на индивидуальных стимулах экономических агентов. Решения рациональных агентов о выборе сферы приложения усилий являются ответом на существующую структуру вознаграждений в экономике (*reward structure*), которая, в свою очередь, определяется качеством институциональной среды. Мы показали, что в странах со слабым исполнением закона и неэффективным государством поиск ренты оказывается

весьма привлекательной стратегией для молодых людей, выходящих на рынок труда. Увеличение количества борцов за ренту в еще большей степени осложняет институциональные патологии. Таким образом, устойчивости неэффективных институтов может способствовать заинтересованность не только элит, имеющих возможность менять институты к собственной выгоде, но и более широких слоев общества, не обладающих властными полномочиями, но получающих личное материальное вознаграждение от перераспределительной деятельности.

Результаты нашего анализа позволяют по-новому взглянуть на проблемы реформирования институционально незрелых экономик. Распределение талантов по устоявшейся в экономике траектории может способствовать известному в литературе эффекту обучения (*learning effect*), когда определенная норма с течением времени закрепляется в результате того, что участники обучаются выполнять ее более эффективно. К примеру, если уклонение от уплаты налогов является экономически обоснованной деятельностью, то человеческий капитал будет направлять свои усилия на совершенствование существующих и разработку новых методов уклонения [Полтерович, 1999], что еще сильнее закрепит общественно неэффективную норму.

Аналогичная ситуация возникает с нецелевым использованием институтов, когда мотивы и характер обращения к ним имеют мало общего с изначально предполагаемым назначением и смыслом [Полицук, 2008]. В силу проблем коллективного действия личные материальные стимулы могут работать на усиление перераспределительного характера экономической деятельности. Нецелевое использование институтов может устойчиво воспроизводиться потоками новых агентов, заинтересованных в сложившейся структуре вознаграждения.

## Литература

*Полицук Л.И.* Нецелевое использование институтов: причины и следствия // Вопросы экономики. 2008. № 8.

*Полтерович В.М.* Институциональные ловушки и экономические реформы // Экономика и математические методы. 1999. Т. 35. Вып. 2.

*Acemoglu D.* Reward Structures and the Allocation of Talent // *European Economic Review*. 1995. 39. P. 17.

*Acemoglu D., Johnson S., Robinson J.* The Colonial Origins of Comparative Development. An Empirical Investigation // *The American Economic Review*. 2001. Vol. 91. № 5. P. 1369–1401.

*Acemoglu D., Robinson J.* Persistence of Power, Elites, and Institutions // *The American Economic Review*. 2008. Vol. 98. № 1. P. 267–293.

*Baumol W.* Entrepreneurship: Productive, Unproductive, and Destructive // *Journal of Political Economy*. 1990. XCVIII. P. 893–921.

*Easterly W., Levine R.* Tropics, Germs, and Crops: the Role of Endowments in Economic Development // *Journal of Monetary Economics*. 2003. Vol. 50. № 1. P. 3–39.

*Kaufmann D., Kraay A., Mastruzzi M.* The Worldwide Governance Indicators: A Summary of Methodology, Data and Analytical Issues. World Bank Policy Research, 2010.

*Knack S., Keefer P.* Institutions and Economic Performance: Cross-Country Tests Using Alternative Institutional Measures // *Economics and Politics*. 1995. Vol. 7. P. 207–228.

*Landes D.* *The Unbound Prometheus*. N.Y.: Cambridge University Press, 1969.

*La Porta R., Lopez-de-Silanes F., Shleifer A., Vishny R.W.* The Quality of Government // *Journal of Law, Economics, and Organization*. 1999. 15(1). P. 222–279.

*La Porta, R., Lopez-de-Silanes F., Shleifer A.* The Economic Consequences of Legal Origins // *Journal of Economic Literature*. 2008. Vol. 46. № 2. P. 285–332.

*Murphy K., Shleifer A., Vishny R.* The Allocation of Talent: Implications for Growth // *The Quarterly Journal of Economics*. 1991. Vol. 106. № 2. P. 503–530.

*Rodrik D., Subramanian A., Trebbi F.* Institutions Rule: the Primacy of Institutions over Geography and Integration in Economic Development // *Journal of Economic Growth*. 2004. Vol. 9. P. 131–165.

*Tabellini G.* Institutions and Culture // *Journal of the European Economic Association Papers and Proceedings*. 2008. Vol. 6. № 2–3.



**ГРАЖДАНСКОЕ  
ОБЩЕСТВО  
И ДЕМОКРАТИЯ**

---



И.В. Мерсиянова  
Национальный исследовательский  
университет «Высшая школа экономики»

# ПОВСЕДНЕВНЫЕ ПРАКТИКИ ГРАЖДАНСКОГО ОБЩЕСТВА В ОБРАЗЕ ЖИЗНИ РОССИЯН

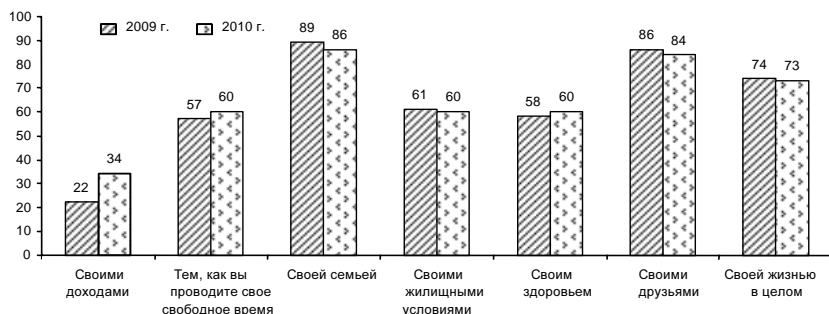
---

Формирование гражданского общества в нашей стране является частью российского трансформационного процесса. Оно сопровождается не только изменением институциональной структуры общества, но и изменением в образе жизни россиян, выступающим как совокупность форм деятельности, взятых в неразрывном единстве с условиями этой деятельности. Конкретизация образа жизни происходит через понятия стиля, уровня и качества жизни.

В повседневной жизни россиян присутствуют социальные практики гражданского общества (участие в деятельности добровольных объединений граждан, денежные пожертвования, добровольчество, участие в решении вопросов по месту жительства и др.). В статье будет показана связь между качеством жизни населения, индикатором которого выступает удовлетворенность жизнью, и вовлеченностью россиян в отдельные практики гражданского общества. Статья основана на данных мониторинга состояния гражданского общества, проводимого Центром исследований гражданского общества и некоммерческого сектора Национального исследовательского университета «Высшая школа экономики» в рамках программы фундаментальных исследований НИУ ВШЭ. Используемые в статье данные, если не указано иное, получены в результате серии всероссийских репрезентативных опросов населения, проведенных в 2009–2011 гг. в сотрудничестве с Фондом «Общественное мнение» (2009, 2011 гг.) и ОМА «Маркетдейта» (2010 г.). В ходе этих опросов объемы выборочных совокупностей составляли по 2000 респондентов, отобранных на основе многоступенчатой стратифицированной территориальной случайной выборки. Автор выражает благодарность сотрудникам Фонда «Общественное мнение» и ОМА «Маркетдейта» за участие в анализе и описании первичных данных результатов исследований.

## Оценка россиян удовлетворенности жизнью

Удовлетворенность жизнью является индикатором социального самочувствия и качества жизни населения. Согласно результатам всероссийского опроса населения, россияне сегодня в позитивном ключе воспринимают большинство аспектов своей жизни, однако уровень удовлетворенности ими неодинаков. Так, чаще респонденты удовлетворены своей семьей и друзьями (86 и 84% соответственно). Своим здоровьем, своими жилищными условиями и тем, как проводят свое свободное время, довольны почти две трети респондентов (по 60%). А процент людей, которых устраивает их уровень доходов, сегодня довольно низок (34%). Этот аспект их жизни не устраивает большинство респондентов (67%). Однако по сравнению с кризисным 2009 г. доля неудовлетворенных своими доходами снизилась на 10 п.п. (рис. 1).



**Рис. 1.** Распределение ответов на вопрос: «Скажите, пожалуйста, если говорить о сегодняшнем дне, насколько вы удовлетворены...» (доля ответивших «безусловно удовлетворен» и «скорее удовлетворен», % от опрошенных, по годам)

Определенная связь прослеживается между возрастом респондентов и удовлетворенностью различными сторонами жизни. Так, для самой молодой группы (18–30 лет) характерна довольно высокая степень удовлетворенности друзьями, здоровьем и проведением свободного времени – 82, 82 и 66% соответственно. Неудовлетворенность доходами одинаково характерна для всех возрастных когорт, хотя несколько меньше это проявляется в группе 18–30-летних (доля недовольных составляет 62%) и относительно больше это характерно для людей в возрасте 46–60 лет (72%). В когорте 31–45 лет чаще проявляется неудовлетворенность своими жилищными условиями и проведением свободного времени.



Распределение ответов на вопрос «Скажите, пожалуйста, если говорить о сегодняшнем дне, насколько вы удовлетворены своей жизнью в целом?» показывает, что удовлетворенность своей жизнью в целом находится у респондентов в зоне высоких значений: 73% демонстрируют позитивное эмоционально-психологическое восприятие своей жизни, и четверть опрошенных (23%) – негативное.

На удовлетворенность жизнью значительным образом влияет удовлетворенность уровнем доходов: те респонденты, которых устраивают доходы, чаще говорят о том, что довольны жизнью в целом. Люди в возрасте 18–30 лет также чаще положительно отвечают на поставленный вопрос.

Но гораздо больший интерес здесь представляет тот факт, что материальный фактор не оказывает основополагающего влияния на отрицательное социальное самочувствие людей. Две трети (68%) не удовлетворенных своими доходами все-таки довольны жизнью. Исследование показало, что на неудовлетворенность в целом в большей мере влияет недовольство семьей и друзьями. Иными словами, проблемы человека, связанные с отношениями в ближайшем окружении, чаще заставляют людей считать себя неудачниками, испытывать неудовлетворенность жизнью в целом.

В целом, вероятность ощутить чувство удовлетворенности жизнью выше у молодежи, людей с высшим образованием, с относительно высокими доходами, а также у жителей Москвы.

## **Влияние удовлетворенности жизнью на вовлеченность россиян в благотворительную деятельность**

Благотворительная деятельность россиян реализуется в двух формах – через добровольческую активность и посредством денежных пожертвований. Добровольческая деятельность представляет собой важнейшую практику гражданского общества. Видение роли добровольчества в разных странах детерминировано многими факторами и логикой их развития. Общая черта заключается в том, что добровольческая активность всегда связывается с позитивными изменениями в развитии общества в целом и отдельного человека. В нашей стране добровольческая активность рассматривается как один из важнейших факторов социального развития общества в таких сферах, как образование, наука, культура, искусство, здравоохранение, охрана окружающей среды и другие.

Определения добровольчества акцентируют внимание на таких категориях, как «время», «труд» и «деятельность»:

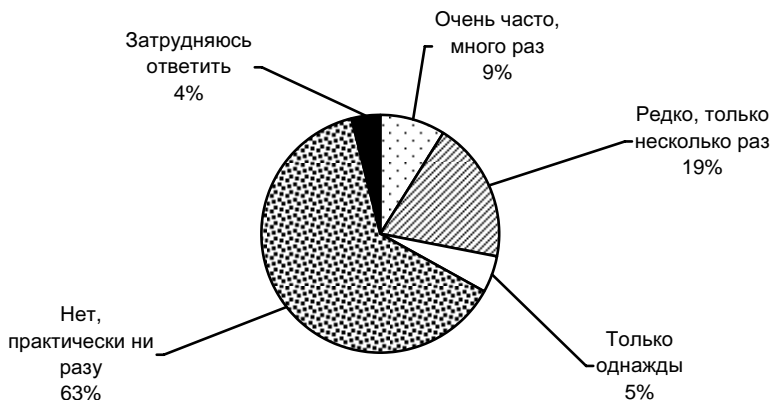
- любая деятельность, в которой свободное время дано для того, чтобы принести пользу другому человеку, группе или организации [Wilson, 2000, p. 215];
- время, отданное добровольно и бесплатно какой-либо организации, преследующей цель нести благо людям или борющейся за конкретное дело [Gaskin, Smith, 1997];
- жертвование времени на то, чтобы помочь другим людям, без получения оплаты в денежной форме [Hodgkinson, Virginia et al., 1992, p. 619];
- общественная совместная работа, которая приносит пользу участникам добровольчества, людям, на которых это добровольчество направлено, и обществу в целом [Nesbit, 2008, p. 1];
- деятельность, осуществляемая людьми добровольно на безвозмездной основе и направленная на достижение социально значимых целей, решение проблем сообщества [Кудринская, 2006, с. 15];
- труд, не предусматривающий оплаты в денежной форме или юридического обязательства, в интересах лиц, проживающих за пределами домашнего хозяйства самого добровольца [Badelt, 1999].

Расширительное толкование добровольческой деятельности дает Организация Объединенных Наций как «вклада, который частные лица вносят в виде деятельности, осуществляемой не на коммерческой основе, не за плату или ради перспективы карьерного роста, а в интересах благополучия своих соседей или общества в целом» [Руководство..., 2006, с. 292].

Нами добровольчество определяется как общественно полезная деятельность, осуществляемая людьми добровольно на безвозмездной основе и в интересах организаций, групп и лиц, не являющихся членами их семей или их близкими родственниками.

Добровольчество принято подразделять на формальное и неформальное. Основное отличие заключается в том, что первое связано с деятельностью в какой-либо организации, а второе – нет. Как показывают наши исследования, в России более развито неформальное добровольчество, чем формальное. Так, в ходе мегаопроса населения по технологии Георейтинга (ГУ ВШЭ и ФОМ, 2009; N = 41500 человек) респондентам был задан вопрос: «За последние 2–3 года вы занимались, помимо своей основной деятельности, добровольной и безвозмездной работой на благо других людей (не членов семьи и не близких родст-

венников)? Если занимались, то как часто?» (см. рис. 2). Около двух третей россиян отметили, что им не приходилось заниматься безвозмездной деятельностью (63%). Случалось работать на благо других людей трети опрошенных (33%). Из тех, кому приходилось работать безвозмездно, большая часть заявила, что делала это «редко, только несколько раз», примерно треть – часто, а седьмая часть – однократно. Также группу волонтеров можно идентифицировать посредством изучения вовлеченности людей в конкретные добровольческие практики. В целом, 61% россиян принимали участие хотя бы в одном виде добровольческой активности за последний год, при этом 37% участвовали в одном или в двух видах деятельности, каждый десятый – в трех, каждый четырнадцатый – в четырех видах.



**Рис. 2.** Распределение ответов респондентов на вопрос: «За последние 2–3 года вы занимались, помимо своей основной деятельности, добровольной и безвозмездной работой на благо других людей (не членов семьи и не близких родственников)? Если занимались, то как часто?» (% числа опрошенных)

Что касается участия россиян в деятельности НКО в качестве добровольцев, то, согласно данным всероссийского обследования НКО<sup>1</sup>, труд доброволь-

<sup>1</sup> Всероссийское обследование НКО, проведенное Центром исследований гражданского общества и некоммерческого сектора Государственного университета – Высшей школы экономики в 2009 г. Объем выборочной совокупности – 1000 НКО. Сбор эмпирической информации проведен компанией «МаркетАп».

цев в той или иной мере используют более 75% российских некоммерческих организаций. Общий уровень вовлеченности в добровольческую деятельность в некоммерческом секторе в 2008 г. составлял 3,02% численности экономически активного населения (3,2% числа занятых в экономике). Вовлеченность россиян в формальное добровольчество зависит от возраста, уровня образования, доходов и места жительства.

Данные мегаопроса населения по технологии Георейтинга (ГУ ВШЭ и ФОМ, 2009; N = 41500 человек) согласуются с названными результатами обследования НКО. Свое участие в НКО в качестве добровольцев декларировали 3% россиян. Характерно, что результаты этого исследования показывают отсутствие возможностей роста вовлеченности россиян в формальное добровольчество: также только 3% россиян выразили желание участвовать в деятельности каких-либо общественных объединений, гражданских инициатив, некоммерческих организаций в качестве добровольцев, т.е. работать в них безвозмездно, не получая денег за свой труд.

В среднем добровольцы работают в российских НКО 26 часов в месяц. В пересчете на полную занятость получается, что трудовые ресурсы добровольцев равны 0,42% численности экономически активного населения или 0,44% числа занятых в экономике. Таким образом, объем ресурсов добровольческого труда, задействованного в российских некоммерческих организациях, сопоставим с объемом трудовых ресурсов оплачиваемых сотрудников НКО. Можно дать и стоимостную оценку ресурсов труда добровольцев, участвующих в деятельности российских НКО: если бы труд добровольцев оплачивался так же, как труд наемных сотрудников НКО, то стоимость ресурсов добровольного труда в некоммерческом секторе составила бы 16,4 млрд руб. ежегодно.

Наши исследования показывают, что установка на благотворительную деятельность в большей степени присуща людям, которые удовлетворены своей жизнью в целом. Среди них несколько чаще, чем среди неудовлетворенных, встречаются те, кому приходилось что-либо делать безвозмездно для людей, не являющихся членами их семьи или близкими родственниками (57% против 46%). В частности, среди них выше доля тех, кто помогал «чужим» людям деньгами (25% против 17%).

Личную активность в благотворительной деятельности, как показало исследование, в меньшей степени демонстрируют те, кто не удовлетворен своей семьей и друзьями. Так, за последний год им реже прочих приходилось оказывать по собственной инициативе помощь кому-либо или заниматься благотворительностью (47 и 40% соответственно, 53% среди населения).

## **Влияние удовлетворенности жизнью на вовлеченность в практики самоорганизации по месту жительства**

Практически две трети россиян (60%) ответили, что за последний год им не приходилось участвовать в каких-либо мероприятиях, организованных самими гражданами по месту жительства. При этом треть (31%) вспомнила о своем посещении субботников, мероприятий по уборке двора (31%), каждый шестой (16%) – о посещении собраний жильцов дома или подъезда.

Наименее активны в общественной жизни самые молодые и самые «взрослые» респонденты (18–30 лет и старше 60). Им реже других приходилось участвовать в каких-либо подобных мероприятиях. Жители Москвы и городов-миллионников также не столь активны в данном вопросе по сравнению с остальными. Не участвовали в каких-либо мероприятиях, организованных самими гражданами по месту жительства, 67% москвичей и 69% других городов-миллионников против 60% среди населения.

Людам, не удовлетворенным своей семьей, значительно чаще остальных участвовать в таких собраниях не приходилось (70% против 60% среди населения).

Те, кто все же заявил об опыте участия в мероприятиях по месту жительства за последний год, склонны в большинстве своем считать их результативными (35%).

Исследование показало, что общественная активность зависит от того, как респонденты идентифицируют тех, с кем им пришлось бы объединяться. Так, если бы вокруг «было больше таких людей, как они», каждый второй (54%) стал бы более активно участвовать в решении общих проблем по месту жительства. При этом четверть опрошенных (24%) даже в этом случае не готовы к более активной общественной работе. Чаще это – лица с низким уровнем образования, люди старше 60 лет, а также жители Москвы и городов-миллионников.

Неудовлетворенность жизнью также влияет на распределение ответов на этот вопрос: среди недовольных семьей и друзьями больше тех, кто не стал бы более активно участвовать в общественной жизни, даже если вокруг было бы больше таких людей, как они (39 и 31%). Среди неудовлетворенных здоровьем пассивных людей тоже больше (30%). Соответствующие данные представлены в табл. 1.

**Таблица 1.**

Распределение ответов респондентов на вопрос: «Стали бы вы более активно участвовать в решении общих проблем, в общественной работе по месту жительства, если бы вокруг вас было больше таких людей, как вы?» (в зависимости от удовлетворенности жизнью, % от числа опрошенных)

	Население в целом	Удовлетворенность											
		доходами		проведением свободного времени		семьей		жилищными условиями		здоровьем		друзьями	
		удовлетворены	не удовлетворены	удовлетворены	не удовлетворены	удовлетворены	не удовлетворены	удовлетворены	не удовлетворены	удовлетворены	не удовлетворены	удовлетворены	не удовлетворены
<i>Доли групп</i>	100	22	75	57	39	89	8	61	38	58	41	86	6
Да	54	56	54	55	55	55	49	55	54	59	<del>48</del>	57	<del>45</del>
Нет	24	25	24	24	23	22	<b>39</b>	24	24	20	<b>30</b>	22	<b>31</b>
Затрудняюсь ответить	22	18	22	21	22	22	<u>12</u>	21	23	22	21	21	24

При ответах на вопрос «Как вы думаете, что из перечисленного может побудить ваших соседей участвовать в общественной жизни, мероприятиях, организованных по месту жительства?» респонденты чаще говорят о возможности благоустроить территорию, улучшить качество жизни местного населения (36%). Отмечают значимость гарантий того, что эта деятельность даст результаты, 25%. Еще 25% считают, что мотивацией может служить скорее возможность заработать.

В «меркантильном интересе» своих соседей (возможности для них заработать) чаще уверены молодые респонденты, а также сельские жители (35 и 32%).

Люди, не удовлетворенные своими друзьями, чаще остальных полагают, что побудить их соседей к общественной деятельности, в принципе, ничего не может (15% против 9% среди населения).

Лично участвовать в решении вопросов местной жизни за последний год приходилось трети россиян (31%). 17% совместно решали проблемы, возникающие по месту жительства. По 6% участвовали в собраниях жителей или опросах населения, по 2% участвовали в митингах и демонстрациях, публичных

слушаниях, либо обращались в органы местного самоуправления. Среди тех, кто нигде не участвовал, больше жителей Москвы (80% против 69% среди населения), а также людей молодого возраста (74%).

Судя по ответам респондентов, удовлетворенность жизнью в целом не оказывает влияния на их общественную активность.

Наиболее полезным в современных условиях, по мнению трети опрошенных (35%), является совместное решение проблем, возникающих по месту жительства. Так чаще всего полагают люди в возрасте 46–60 лет (41%).

Гораздо менее значимым респонденты считают участие в общих собраниях (13%), в обсуждении вопросов социального развития муниципального образования, внесение конкретных предложений и обращение в органы местного самоуправления (по 12%). Москвичи чаще прочих придают значение таким формам участия в общественной жизни, как обсуждение вопросов социального развития муниципального образования (18% против 12% среди населения), обращение граждан в органы местного самоуправления (18% против 12% среди населения), опросы населения (16% против 10% среди населения), выступления в прессе (14% против 8%).

Люди, не удовлетворенные друзьями, чаще остальных не видят форм участия жителей в общественной жизни, полезных для современных условий (23% против 16% среди населения).

Говоря о препятствиях, мешающих активному участию людей в решении общих проблем по месту жительства, большая доля опрошенных сетует на «индивидуализм» людей, жизни по принципу «каждый за себя» (37%) или их безразличие к общим делам (28%). Также респонденты часто упоминают в данном контексте недостаток времени (35%). Неверие в возможность влиять на принятие решений в качестве причины менее активного участия в общественных делах называют 32% россиян.

О неверии в возможность влиять на принятие решений как препятствию в данном случае чаще говорят жители Москвы, а также люди с высшим образованием (50 и 42%). О недостатке времени – люди в возрасте 31–45 лет (43%) и жители Москвы (45%), а также других городов-миллионников (43%). Низкое доверие властям среди людей, не стремящихся к активной общественной жизни, чаще отмечают жители городов-миллионников и Москвы (26 и 25% против 19% среди населения).

Люди, не удовлетворенные семьей, несколько чаще остальных называют безразличие к общим делам в качестве причины низкой активности в подобных вопросах (35% против 28% среди населения).

Таким образом, общая удовлетворенность жизнью россиян не оказывает заметного влияния на их вовлеченность в общественную активность по месту жительства. Однако такая связь прослеживается между отдельными аспектами удовлетворенности и участием в практиках самоорганизации по месту жительства.

## Литература

*Азарова Е.С., Яницкий М.С.* Психологические детерминанты добровольческой деятельности // Вестник Томского государственного университета. 2008. № 306.

*Кудринская Л.А.* Добровольческий труд: сущность, функции, специфика // Социологические исследования. 2006. № 5.

*Мерсиянова И.В., Якобсон Л.И.* Негосударственные некоммерческие организации: институциональная среда и эффективность деятельности. М., 2007.

*Мерсиянова И.В., Якобсон Л.И.* Практики филантропии в России: вовлеченность и отношение к ним населения. М., 2009.

Руководство по некоммерческим организациям в Системе национальных счетов. Методологические исследования. Серия F. № 91 / Организация Объединенных Наций. Департамент по экономическим и социальным вопросам. Статистический отдел. Нью-Йорк, 2006. С. 292.

*Синецкий С.Б.* Российские волонтеры: черты социального портрета // Благотворительность в России. Социальные и исторические исследования. СПб., 2001. С. 646–654.

Труд в некоммерческом секторе: формы, структуры и методологии // Руководство по некоммерческим организациям в Системе национальных счетов. Методологические исследования. Серия F. № 91 / Организация Объединенных Наций. Департамент по экономическим и социальным вопросам. Статистический отдел. Нью-Йорк, 2006. С. 304.

*Badelt C.* Ehrenamtliche Arbeit im Nonprofit Sektor // Badelt C. (Hrsg.). Handbuch der Nonprofit Organisationen. Strukturen und Management. Stuttgart, 1999. S. 433–462.

*Gaskin K., Smith J.D.* A New Civil Europe? A Study of the Extent and Role of Volunteering. L.: The National Center for Volunteering, 1997.

*Hodgkinson V. et al.* The Nonprofit Almanac. San Francisco, 1992.

*Nesbit R.* The Institutional Context of Volunteering: the Impact of Families, Paid Labor, State Policies, and Military Service. School of Public and Environmental Affairs Indiana University, 2008.

*Wilson J.* Volunteering // Annual Review of Sociology. 2000. Vol. 26.



## ГРАЖДАНСКОЕ ОБЩЕСТВО И ЕГО АДАПТИВНЫЕ ВОЗМОЖНОСТИ В КРИЗИСНЫХ УСЛОВИЯХ

---

Вступление Российской империи в Первую мировую войну обернулось для экономики страны необходимостью милитаризации, а для населения – потребностью в тотальной мобилизации. Потребность в мобилизации своих материальных и людских ресурсов, а также в переориентации их на решение задач воюющей державы остро ощутили и общественные организации. Милитаризация гражданского общества осуществлялась, прежде всего, под влиянием войны и ориентированной на нее государственной политики. В то же время импульс к милитаризации исходил и от самого общества. Одним словом, не только война и политика милитаризации организовывали общество, но и само общество формировало себя через войну и во имя войны [Холквист, 1999, с. 84].

Учитывая степень развития в дореволюционной России институтов гражданского общества и их вовлеченности в решение стоящих перед страной задач, позволим себе утверждать, что способность гражданского общества к самомобилизации на военные нужды определяла успех государства в тыловой его политике в годы войны не в меньшей степени, чем способность государства к перестройке аппарата управления. Эта закономерность была характерна для всех стран – участниц Первой мировой войны. Однако применительно к России – стране с авторитарной государственной традицией и разбухшим бюрократическим аппаратом, неспособным на быстрое и адекватное реагирование на «вызовы» времени, она «работала» как железное правило.

Участие России в Первой мировой войне породило серию социальных вопросов внутри страны. Одним из наиболее острых было беженство, т.е. исход населения из мест проживания, которые занял или собирался занять неприятель. Наряду с добровольным оставлением мест своего жительства существовали также факты выселения жителей из районов военных действий по распоряжению военных или гражданских властей. Действующим законодатель-

ством собственно беженцы и выселенцы объединялись в единую категорию, именуемую «беженцы» [Кустов, 1917, с. 7].

Помощь беженцам являлась одной из ключевых задач для российского гражданского общества. Под гражданским обществом автор подразумевает сеть добровольных, самоуправляющихся, организационно оформленных и нацеленных на решение общепольных задач ассоциаций, не имевших целью извлечение из своей деятельности прибыли, таких как благотворительные, научные, просветительские, литературно-художественные и иные общества. Настоящая статья призвана показать, как происходила мобилизация усилий российского гражданского общества на осуществление помощи беженцам, на основании чего, как представляется, мы сможем судить об адаптивном потенциале, имевшемся у общественности в условиях общенационального кризиса, каковым была для населения Российской империи Первая мировая война.

Основную массу беженцев в Российской империи составляли выходцы с западного театра военных действий. С начала войны и до весны 1915 г., когда основные сражения происходили в Привислинском крае, в стране преобладало стихийное беженство, носившее добровольный характер, а общая численность перемещенных людей не превышала нескольких сотен тысяч человек, большинство которых расселилось в прифронтовой полосе. Весной 1915 г., когда противник перешел в наступление на Западе России и в Галиции, наряду со стихийным беженством началось принудительное выселение военным командованием и гражданскими властями сельского населения призывного возраста, еврейских граждан и др. Сначала переселяли в рамках губерний в восточные их уезды, затем – в соседние губернии, наконец – во внутренние губернии России для разгрузки прифронтовой местности от избыточного населения. В июле-августе 1915 г. массовое прибытие беженцев с западного театра военных действий в тыловые губернии Российской империи достигло своего максимума и завершилось в ноябре-декабре 1915 г. К середине сентября 1915 г. в различных губерниях находилось около 750 тыс. беженцев, в следующие 3,5 месяца маршрутные поезда вывезли на восток еще свыше 2 млн человек [Курцев, 1999, с. 134–135]. Таким образом, летом – осенью 1915 г. беженство приобрело в России характер серьезного социального бедствия.

Разрешением проблем, связанных с беженством, таившим угрозу здоровью, семейным устоям, общественной нравственности как переселявшихся, так и окружающих их людей, занимались государство (в лице Особого совещания по устройству беженцев при МВД и его губернских и городских филиалов), органы местного самоуправления (в лице комитетов помощи беженцам при зем-

ских и городских управах) и добровольные организации. Можно говорить о своеобразной государственно-общественной организации беженского дела [Курцев, 1999, с. 139], в которой общественная составляющая играла заметную роль.

В военное время была создана сеть добровольных обществ, призванных сгладить негативные последствия беженства как системной проблемы российского общества. Значительная их часть была образована еще в 1914 г., однако расцвет их деятельности пришелся на вторую половину 1915 г. – 1916 год, когда «беженский вопрос» приобрел наибольшую остроту. Характерной чертой беженских обществ была сплоченность, стремление к объединению усилий и распределению сфер деятельности между собой, к индивидуализации оказываемой помощи. Это было вызвано желанием общественности оказать помощь максимальному числу нуждающихся.

Центральным органом по оказанию помощи беженцам в России являлся Комитет его императорского величества великой княжны Татьяны Николаевны для оказания временной помощи пострадавшим от военных бедствий (Татьянинский комитет). Учрежден он был в начале войны, 14 сентября 1914 г., и оказывал беженцам различные виды помощи: выдавал единовременные пособия, содействовал отправлению беженцев на родину или на место их жительства, занимался трудоустройством способных к труду, размещал неспособных трудиться в богадельни, приюты и иные заведения и т.п. [Комитет... 1916]. Татьянинский комитет состоял под руководством члена Государственного совета А.Б. Нейдгардта (царская дочь Татьяна была почетной председательницей), пользовался правительственной поддержкой (миллионными государственными субсидиями, пособия беженцам распределял через чиновников – губернаторов, полицмейстеров, уездных исправников) [ЦИАМ, д. 23, л. 1–30]. Лишь небольшую часть поступлений давали всероссийские сборы пожертвований и взносы частных лиц.

Учредив сеть губернских отделений во главе с местными губернаторами (сначала на прифронтовой территории, а затем по всей стране), Комитет превратился в крупнейшую общественную благотворительную организацию по оказанию помощи беженскому населению. Он координировал деятельность беженских организаций в центре и на местах, финансировал их, контактировал с Особым совещанием по устройству беженцев. Современники высоко оценивали деятельность отделений Татьянинского комитета, где «...нашлись хорошие руководители, свое дело сделали и спасли не одну сотню беженцев» [Джунковский, 1997, с. 429–430].

Политизация российской общественности, наблюдавшаяся в начале XX в., не обошла беженское дело стороной. Так, в Петрограде в период пика бежен-

ского движения, в октябре 1915 г., было образовано Всероссийское общество попечения о русских беженцах. Его учредителями были поборники «русского дела» член фракции правых Государственной думы Г.Г. Замысловский, сенаторы А.А. Римский-Корсаков и М.М. Бородин. Предполагалось, что усилия этой организации дополняют правительственные действия в данной области. В сферу компетенции общества входили организация столовых для беженцев, расселение их в съемных квартирах и временных бараках, обеспечение обувью, одеждой и бельем, трудоустройство, удовлетворение духовно-нравственных потребностей, организация приютов, яслей и школ для детей, осуществление санитарного надзора и оказание юридической помощи [Писаренко, 2001, с. 18–19]. В Москве русские беженцы получали помощь от Московского отдела организации, действовавшего под началом правомонархически настроенных митрополита Московского и Коломенского Макария и протоиерея о. Иоанна Восторгова. В течение первого года деятельности, с 15 ноября 1915 г. по 1 сентября 1916 г., за помощью к московскому отделению обратились почти 5,5 тыс. беженцев. Единовременными пособиями на питание и лечение воспользовались в общей сложности около 2 тыс. человек, в питательном пункте организации столовались ежедневно до 120 человек. Религиозные и культурные нужды беженцев обслуживались двумя православными священниками, осуществлялось призрение детей, учащихся и одиноких женщин и девушек в общежитиях-интернатах и приюте [Кустов, 1917, с. 71–74].

Открывшееся в Москве в январе 1915 г. общество «Помощь жертвам войны», напротив, исповедовало либеральные ценности всеобщего равенства в правах, поэтому оказывало помощь всему населению империи без различия вероисповедания и национальности. Его учредителями выступили бывший председатель Государственной думы второго созыва Ф.А. Головин, избранный председателем организации, а также Н.В. Давыдов, Е.Д. Кускова, С.Н. Прокопович и др. При обществе существовала разветвленная инфраструктура исполнительных комиссий: финансовой, продовольственной, помощи детям – жертвам войны, жилищной, юридической, медицинской, призрения инвалидов, что свидетельствовало о многоплановости оказываемой помощи [Русское слово, 1915, 16 января]. В обнародованной в либеральной газете «Русское слово» программе деятельности организации отмечалось, что она была намерена сосредоточиться именно на «бедствующем населении», разоренном войной либо временно потерявшем заработок. Возможный успех организации связывался с наличием человеческого ресурса – «достаточного числа идейных работников, понимающих все значение планомерной помощи населению в такой момент», его компетентностью – способностью «близко и умело подойти ко всяким формам

нужды», а также готовностью к мобилизации «общественной энергии в деле помощи ближним» [Русское слово, 1915, 25 января].

Яркой и новой для беженского дела страницей явилось создание в годы войны беженских организаций, нацеленных на оказание помощи определенным национальным сообществам. Их появление было беспрецедентным и не имевшим аналогов в довоенной истории, свидетельствовало об остроте проблемы беженства, а также о дискриминационной политике, которая проводилась правительством России по отношению к ряду сообществ (евреи, поляки). По мере того, как представители нерусских национальностей прибывали в коренные русские губернии, этническая ситуация там усложнялась.

Большое число национальных беженских организаций существовало в Москве. Для московских беженских обществ было характерно желание консолидировать усилия, что достигалось посредством создания коллективных беженских объединений. Такой организацией в 1915 г. был комитет объединенных национальных и общественных организаций г. Москвы, осуществлявший сбор и распределение между беженскими обществами Москвы денежных средств. Для привлечения финансов комитет инициировал обращение к торговым фирмам второй столицы с просьбой отчислять проценты из торгового оборота в пользу детей-беженцев и воинов [Русские ведомости, 1915, 18 ноября].

С марта 1916 г. в Москве функционировал Общегородской комитет по согласованию деятельности организаций, оказывавших помощь беженцам. Беженские общества были призваны руководствоваться нормами, разработанными Комитетом. Согласно им, беженец должен был находиться всецело на попечении той организации, на учете которой он состоял. Продовольственный и квартирный паек он мог получить только с момента своего обращения к беженской организации. При этом право на получение пайка имели только нетрудоспособные беженцы: дети и подростки до пятнадцатилетнего возраста, мужчины старше 55 лет и беременные женщины, больные при условии удостоверения нетрудоспособности врачом организации. Трудоспособные беженцы получали паек в течение двух недель, уклонявшиеся от получения работы лишались продовольственного и квартирного довольствия [Кустов, 1917, с. 8].

Одной из наиболее крупных национальных беженских организаций второй столицы являлся Польский комитет по оказанию помощи жертвам войны в Москве. Образованный в июле 1914 г. в качестве комиссии при Благотворительном обществе вспомоществования бедным римско-католического вероисповедания в Москве, Комитет приобрел статус самостоятельной организации спустя год. К 1 декабря 1916 г. в работе этой организации участвовало более

1000 человек, из них более трети трудились безвозмездно. Возглавлял комитет известный общественный деятель и поляк по национальности А.Р. Ледницкий [Кустов, 1917, с. 9–10]. Существовал Польский комитет на дотации Татьянинского комитета, средства, отпущенные ему Особым совещанием по устройству беженцев при МВД, а также на пожертвования (единовременные, членские взносы, самообложения польского населения, доходы от концертов и спектаклей и др.). Как и у других беженских организаций, львиную долю дохода организации составляли государственные средства.

С начала существования в июле 1914 г. и до 1 сентября 1916 г. регистрационным отделом Польского комитета было зарегистрировано в Москве около 91 тыс. беженцев. Почти все они воспользовались помощью организации, причем более 30 тыс. беженцев получали постоянное призвание. Все зарегистрированные беженцы были расселены по частным квартирам, убежищам и приютам для беженцев в самой Москве и в пригородах [Там же, с. 11]: Марьиной роще, Бутырках, селе Черкизово, по Ярославскому шоссе [ЦИАМ, д. 72, л. 2].

В Петрограде с начала войны действовало Общество вспомоществования бедным семействам поляков, участвующих в войне, и бедствующему польскому населению, пострадавшему от военных действий. Учредителями являлись представители польского общества столицы – редактор журнала «Голос Польский» Р.С. Квятковский, присяжный поверенный Б.Г. Олышамовский, а также депутат Государственной думы Г.И. Свенцицкий. Общество оказывало материальную поддержку пострадавшему от военных действий населению, подыскивало работу нуждающимся и т.п. [ГАРФ, д. 121, л. 72–72 об.].

Если в центральной России действовали польские общества, то в самой Польше существовала организация, оказывавшая помощь исключительно беженцам русского происхождения. Это было Русское общество в Варшаве, основанное для объединения русского населения Привислинского края и защиты его национальных, религиозных и экономических интересов еще в 1907 г. С началом войны, нарушившей течение мирной жизни Привислинского края, Русское общество оказывало первую помощь пострадавшему русскоязычному населению края. С эвакуацией государственных учреждений из Варшавы Русское общество также эвакуировалось в Москву, где и возобновило с декабря 1915 г. деятельность. Общество выдавало целевые единовременные пособия русским беженцам из Польши, содержало для них швейную мастерскую, удовлетворяло их религиозно-нравственные потребности в храме Преподобной Ирины при Министерстве иностранных дел на Воздвиженке, предоставленном епархиальной властью [Кустов, 1917, с. 75].

Возвращаясь к национальным беженским организациям Москвы, следует упомянуть Литовский комитет по оказанию помощи жертвам войны, образованный при Литовском Вспомогательном обществе в Москве осенью 1914 г. и начавший оказывать помощь беженцам в июне 1915 г. Литовский Комитет имел традиционный для беженских обществ набор отделов: жилищный, выдачи денежных пособий, хозяйственный, медицинский, училищный, организации трудовой помощи, юридический [Кустов, 1917, с. 47].

По общему для беженских обществ правилу выделение беженцам пособий производилось только после обследования их семейного и имущественного положения. Пособиями пользовались исключительно нуждающиеся и нетрудоспособные. Безработные беженцы, способные к труду, получали только месячное пособие. Силами общества для беженцев-литовцев в Москве к октябрю 1915 г. было открыто шесть начальных училищ (в них обучалось 400 детей), детский приют, белошвейная мастерская со школой кройки и шитья и общежитие для студентов-литовцев [Русские ведомости, 1915, 7 октября]. За период с 1 июля 1914 г. по 1 сентября 1916 г. в Литовский комитет обратились за помощью 13 тыс. беженцев; 4,3 тыс. из них проживали в общежитиях Комитета, 200 призревались в приютах, интернатах и богадельне для нетрудоспособных одиноких старцев и около 8 тыс. жили на наемных квартирах по 20–30 человек в каждой. С помощью открытого обществом Бюро труда почти 1,5 тыс. беженцев получили работу [Кустов, 1917, с. 48–52].

Наряду с польскими и литовскими обществами существовали в Москве организации помощи беженцам-латышам, эстонцам, евреям и др.

Рядом с многопрофильными беженскими обществами всероссийского масштаба и национальными организациями помощи беженцам, порожденными войной, помощь беженцам осуществлял целый ряд общественных организаций, действовавших еще в довоенный период. Так, профессиональные общества были сориентированы на поддержку определенных категорий беженцев: учителей, учащихся, писателей и др.

Помощь учителям-беженцам оказывали учительские организации, развитие деятельности которых было важной составной частью активизации учительского движения в годы Первой мировой войны [Scott, 2000, р. 293–294]. В Москве заботу об учителях, прибывших из местностей, пострадавших от нашествия неприятеля, взяли на себя Комиссия о положении учащихся при Московском обществе грамотности и Московское общество попечения об улучшении быта учащихся. Помощь беженцам-учителям была поставлена здесь на твердые основания. У большинства учителей имелись бесплатные квартиры,

почти все были обеспечены одеждой и продовольствием, некоторым удалось найти работу, дети были пристроены в учебные заведения [Русское слово, 1915, 10 января; 10 ноября]. В Петрограде нужды эвакуированных учителей народных школ удовлетворяло Петроградское педагогическое общество взаимопомощи.

Итак, беженские организации времени войны служили неотъемлемой частью «оборонного потенциала» России. Они играли важную роль в мобилизации ресурсов представителей национальных сообществ империи и в развитии национального самосознания в годы войны. Российское гражданское общество тех лет было, с одной стороны, весьма эффективным, продемонстрировавшим способность к скорой адаптации и переходу на «военные рельсы», а с другой стороны, раздираемым национальными и политическими противоречиями, в которые было вовлечено население страны. Процессы милитаризации гражданского общества Российской империи, его мобилизации на нужды войны происходили под эгидой государства, органов самоуправления и при заинтересованном участии самой общественности.

## Литература

Государственный архив Российской Федерации (ГАРФ). Ф. 102. 4 д-во. 1915. Д. 121. Л. 72-72 об.

*Джунковский В.Ф.* Воспоминания. М., 1997. Т.2.

*Кустов Н.И.* Краткие очерки о деятельности национальных и благотворительных организаций, оказывающих помощь беженцам в гор. Москве. М., 1917.

*Курцев А.Н.* Беженство // Россия и Первая мировая война. М., 1999.

Комитет Татьяны Николаевны, 14 сентября 1914 г. – январь 1916 г. Т. 1. Пг., 1916.

*Писаренко И.С., Воценкова Н.С., Домнина Т.Г., Жукова Л.Ф.* Благотворительные организации Калужской губернии в годы Первой мировой войны. Калуга, 2001. С. 18–19.

Русское слово. 1915. 10, 16 и 25 января, 7, 9, 10 октября, 8, 10, 18, 30 ноября.

*Холквист П.* Тотальная мобилизация и политика населения: российская катастрофа (1914–1921) в европейском контексте // Россия и Первая мировая война (материалы международного научного коллоквиума) / Н.Н. Смирнов (отв. ред.), З. Галли, Р. Зелник и др. СПб., 1999.

Центральный исторический архив г. Москвы. Ф. 17. Оп. 93. Д. 23; Ф. 18. Оп. 93. Д. 72. Л. 2.

*Scott T.S.* Zemstvos, Peasants, and Citizens: The Russian Adult Educational Movement and World War I // *Slavic Review*. 2000. Vol. 59. № 2. P. 293–294.



Л.И. Никовская  
Институт социологии РАН,  
В.Н. Якимец  
Институт системного  
анализа РАН

# **АНАЛИЗ ОЦЕНОК ПРЕДСТАВИТЕЛЯМИ ГРАЖДАНСКОГО ОБЩЕСТВА И ВЛАСТИ СОСТОЯНИЯ ПУБЛИЧНОЙ ПОЛИТИКИ В РЕГИОНАХ РОССИИ**

---

Заявленный руководством страны курс на модернизацию общества требует привлечения значительных ресурсов, в том числе и активизации потенциала граждан, структур гражданского общества. Как показывает мировая практика реализации модернизационных проектов, одним из условий их успешности является наличие социальных сил, способных стать инициаторами и проводниками перемен. В условиях системной модернизации возрастает роль самоуправления и самоорганизации, идущих от низовых социальных структур. Посткризисный период развития экономики и социальной сферы России показали, что основной ресурс модернизации сосредоточен в более активном вовлечении субъектов и институтов гражданского общества в процессы разработки и реализации социально значимых решений. Это предполагает расширение возможностей самореализации инициатив отдельных граждан и их объединений (в общественной и деловой сферах) через использование и продвижение институтов публичной политики (далее ПП). В статье излагаются результаты крупномасштабного исследовательского проекта по оценке представителями гражданского общества и власти состояния институтов ПП (21 регион, около 4000 респондентов). Проект реализован на средства государственной поддержки, выделенные в виде гранта Институтом общественного проектирования в соответствии с распоряжением Президента РФ от 16 марта 2009 г. № 160-рп «Об обеспечении в 2009 году государственной поддержки некоммерческих неправительственных организаций, участвующих в развитии институтов гражданского общества».

Была подтверждена основная гипотеза: чем меньше развиты институты и субъекты публичной политики, тем больше степень социальной напряженности и конфликтности в регионе, недовольства эффективностью государственного и муниципального управления, тем хуже показатели взаимодействия вла-

сти и гражданского общества и использования его потенциала для решения социально значимых проблем регионального сообщества.

На развитие социально-политических процессов и характер государственного управления существенно влияет реальная заинтересованность населения в развитии полноценного взаимодействия субъектов гражданского общества и власти.

На основе разработанного инструмента – ЯН-индекса – в 21 регионе представителями гражданского общества и власти были даны оценки степени развитости субъектов и институтов публичной политики в регионе. Это позволило провести качественный анализ сопоставления позиций власти, бизнеса и НКО, сравнить оценки каждой из групп в разных регионах и построить классификацию исследуемых регионов по степени развитости субъектов и институтов публичной политики.

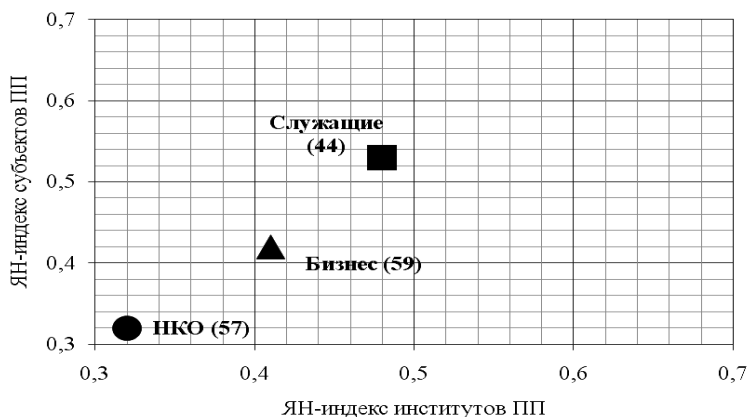
Было выявлено пять типов региональной ПП [Якимец, 2010, с. 22].

1. Регионы с консолидированными низкими оценками ПП – респонденты из всех трех секторов одинаково низко оценивают состояние ПП.
2. Центрированные регионы – дана консолидированная средняя оценка.
3. Регионы с партнерскими отношениями между секторами – имеют консолидированные высокие оценки состояния ПП.
4. Регионы с неконсолидированными оценками ПП – оценки респондентов одного из секторов отличаются от оценок двух других.
5. Регионы с разрывами неконсолидированных оценок ПП – оценки ПП респондентами из двух секторов не консолидированны и характеризуется значимым разрывом.

Покажем выявленные различия в оценках власти и представителей гражданского общества для некоторых регионов.

Так, состояние ПП в Краснодарском крае характеризуется существенными «разрывными» моментами (см. рис. 1). В крае достаточно неплохо развиты институты гражданского общества, край – лидер по количеству созданных территориальных общественных самоуправлений (ТОС) в стране, занимает третье место по рейтингу продвижения механизмов межсекторного партнерства. Однако активные акторы гражданского общества (малый и средний бизнес и НКО) демонстрируют высокую степень недовольства возможностями для развития своей гражданской и деловой инициативы, что существенно влияет на уровень социального напряжения и недоверия по отношению к власти. Выявлен существенный отрыв оценок представителей государственной и муниципальной власти

от оценок НКО и бизнеса. Оценки госслужбы в целом оказались более субъективизированы в том смысле, что их видение характера и уровня развития ПП, ее институтов и механизмов, отличающееся определенным оптимизмом, не учитывает фактически «проваливающиеся» оценки этого явления представителями бизнеса и НКО. Сравнивая оценки респондентов всех трех групп – бизнеса, НКО и власти Краснодарского края, – мы наблюдаем определенную дихотомию. Представители НКО и бизнеса в большей степени связывают проблемы своего участия в принятии социально значимых решений, формировании региональной политики с отсутствием необходимых условий для их развития на региональном и местном уровнях. Представители органов региональной власти и местного самоуправления (МСУ), напротив, склонны полагать, что все необходимые условия для этого создаются. По их мнению, население не воспринимает себя в качестве активного субъекта ПП, демонстрируя полную индифферентность происходящим на региональном и локальном уровнях процессам.



**Рис. 1.** Сводный ЯН-индекс публичной политики, Краснодарский край, 2009 г.

На экспертной сессии в Краснодаре отмечалось:

**НКО** – «В крае жесткая вертикаль власти, НКО вытеснены из процесса принятия решений: многие институты номинальны, имеют декоративный характер: Общественный Совет по содействию развитию гражданского общества при Главе не очень активен, три года назад принят закон о создании Общественной палаты края, но она так и не появилась».

**Бизнес** – «У нас не эффективны антикоррупционные законы, нет независимых судов, работают неформальные связи. Власть – закрытая корпорация, она оторвана от понимания интересов других групп».

**Власть** – «Третий сектор маргинален, формально всякие “Советы при ...” не позволяют ему реально влиять на принятие решений. Признаем, что степень взаимодействия власти и НКО слабая, НКО играют формальную роль в ПП».

Неожиданным результатом стало существенное понижение оценок, по сравнению с началом «нулевых» годов, состояния межсекторного взаимодействия в поле ПП в Иркутске, который выступал «пионером» по продвижению гражданских и деловых инициатив в стране. Оценки состояния публичной политики оказались консолидированно низкими у всех трех субъектов регионального сообщества (см. рис. 2), а несколько лет назад они были более благоприятными. При обсуждении этих результатов представители гражданского общества региона констатировали, что сформировавшееся в последние годы отставание Иркутской области по темпам экономического и социального роста связано не с отсутствием потенциала роста гражданского общества, а с его нереализованностью.

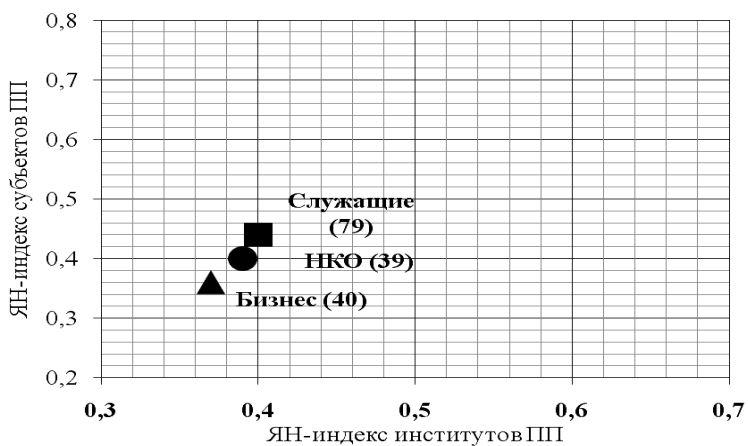
На экспертной сессии в Иркутске ее участники отмечали следующее.

**НКО** – «Сворачиваются партнерские отношения – прекращена деятельность Губернского собрания общественности, власть выдавливает НКО-сектор на обочину публичной политики».

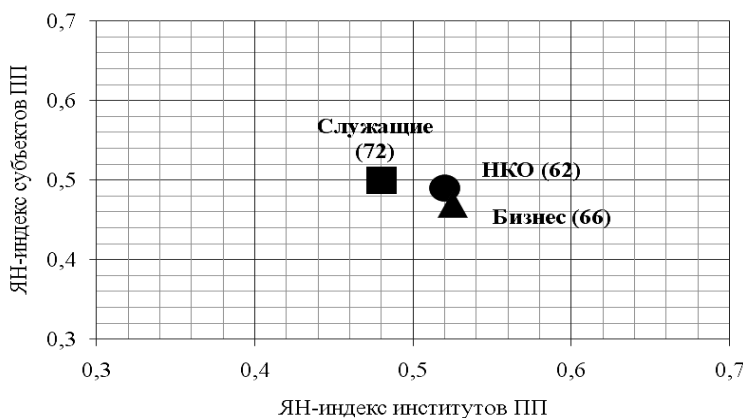
**Бизнес** – «Власть давит и устрашает, бизнес в ответ не подчиняется законам, уходит от непомерных налогов, вынужденно участвует в коррупции».

**Власть** – «Мы не совсем удовлетворены: нормативно-правовая база не развита, институты и механизмы межсекторного социального партнерства слабы».

«Центрированным» по типу реализации публичной политики оказался регион-реципиент – Курская область (рис. 3), где власть, учитывая свои незначительные материальные и финансовые ресурсы, не отрывается в своих ожиданиях от основных носителей деловой и гражданской инициативы, а представители последней, в свою очередь, чувствуют климат заинтересованности и поддержки: ссориться никто не хочет, все силы стремятся к определенному балансу и взаимовыгодному позиционному обмену.



**Рис. 2.** Сводный ЯН-индекс публичной политики, Иркутская область, 2009 г.



**Рис. 3.** Сводный ЯН-индекс публичной политики, Курская область, 2009 г.

Мнения на экспертной сессии в Курске были следующие.

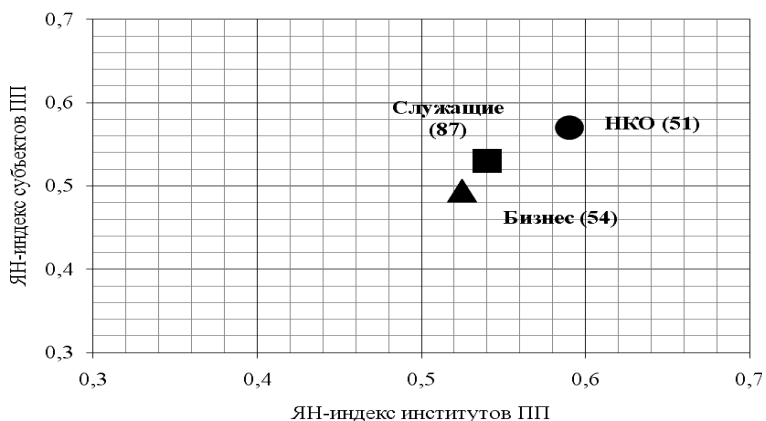
**Власть** – «В совокупности все три сектора гражданского общества работают неплохо и удовлетворены существующим балансом интересов».

**Бизнес** – «Нет особых барьеров для входа на уровень принятия решений. Власть поддерживает полезные начинания».

**НКО** – «Полярные позиции отсутствуют, так как в публичной политике работает принцип золотой середины. Нет авторитаризма, но нет и бурных волн».

Таким же типом публичной политики характеризуются и Нижегородская, и Ярославская области, где успели сформироваться устойчивые традиции диалога власти и гражданского общества, и именно этот «запас прочности» политической культуры демонстрирует определенную сопротивляемость негативным тенденциям по свертыванию публичной сферы и политики.

«Партнерский» тип ПП показала Республика Карелия, где основными условиями ее формирования выступили факторы трансграничного сотрудничества со Скандинавскими странами и компетентно проработанное «уроки Кондопоги» (см. рис. 4).



**Рис. 4.** Сводный ЯН-индекс публичной политики, Республика Карелия, 2009 г.

На экспертной сессии в Петрозаводске отмечались моменты.

**НКО** – «Власти привлекают НКО к решению вопросов социальной политики. В Конституции РК с 1993 г. за НКО закреплено право *законодательной инициативы*. Власть поддерживает трансграничное сотрудничество НКО со Скандинавскими странами».

**Бизнес** – «Из-за кризиса малый бизнес разорется. Надеемся на усиление потенциала частно-государственного партнерства и на развитие взаимодействия между бизнес-ассоциациями и властью».

**Власть** – «РК настроена на развитие потенциала межсекторного партнерства. Мнение НКО важно при подготовке решений, это надо для верной

расстановки приоритетов, выявления острых проблем и поиска правильных вариантов решения (справедливых, отвечающих ожиданиям общества).

## Обобщения

В целом, на общий уровень и характер развития институтов, механизмов и субъектов публичной политики в регионах, безусловно, влияют все системные пороки модели «*управляемой демократии*», креативный потенциал которой в условиях кризиса фактически оказался исчерпан. Переход к реализации целей и задач системной модернизации требует существенного пересмотра принципов организации публичной политики как на федеральном, так и региональном уровнях.

Подтвердилось наше предположение о том, что чем ниже качество и характер осуществления принципов публичной политики в регионе, тем выше недовольство такими дисфункциональными явлениями, как *коррупция, неэффективность деятельности институтов и технологий диалога между властью и обществом, большой потенциал недовольства и социальной напряженности, негативное отношение к действиям власти, низкий уровень доверия и взаимопонимания всех основных акторов публичной сферы*, что сказывается на качестве состояния социального и человеческого капитала региона [Никовская, Якимец, 2011, с. 92].

Сложившийся моноцентричный режим привел к снижению роли публичной сферы и политики в современном политическом процессе как на федеральном, так и на региональном уровнях. Так, например, наши исследования показали, что, во-первых, там, где регионы получают существенную «подпитку» со стороны федерального Центра (как в случае с Краснодарским краем, который активно реализует ФЦП «Сочи-2014»), или крупного бизнеса со штаб-квартирой в Москве, они в большей степени начинают ориентироваться на интересы верхних этажей политико-государственной системы, часто превращая управление регионом в аналог иерархично и жестко выстроенной модели крупной корпорации. И наоборот – чем более дотационен и, соответственно, социально уязвим регион, тем более взвешенно и партнерски он стремится выстраивать отношения с основными акторами публичного пространства, апеллируя к его деловой и гражданской активности. Во-вторых, степень развитости субъектов и институтов, механизмов публичной политики на региональном уровне во многом зависит от комбинации факторов своего регионального свойства – качества государственного и муниципального управления, стабильности и культуры кадрового корпуса управленцев (так, например, частая смена

губернаторов Иркутской области, нестабильность управленческих команд привела к существенным откатам в развитии институциональной базы публичной политики, наработанной в 1990-е годы), особенностей развития культуры взаимодействия гражданского общества и власти, наконец, личной политической воли лидеров, занимающих основные статусные позиции в регионе – губернаторов, руководителей законодательных собраний, Общественных палат, институтов гражданского общества и бизнеса.

Таким образом, на федеральном уровне публичная политика пока не является системным свойством нынешней политической системы. Продолжает сохраняться система принятия политических и социально значимых решений в «режиме консультаций» и «приводных ремней», при активном контроле государственно-административных структур. Но подобная практика конструирования публичной политики порождает опасность усиления бюрократического корпоративизма. Традиционное чиновничество не готово к постоянному диалогу с партнерами, которые пытаются войти в круг общественных консультаций. Формирование государственной политики оно по-прежнему рассматривает как составную часть своих прерогатив. Участие внешних сил воспринимается как покушение на суверенную территорию исполнительной власти. Существующая система принятия решений демонстрирует устойчивую склонность превращать «режим консультаций» в декорацию традиционно бюрократической политики. Поэтому «режим консультаций» работает в той мере, в какой высшая политико-государственная власть заинтересована оказывать политическое давление на участников, принуждая их к лояльности и сотрудничеству. Многие перспективные общественные организации и структуры, не обладая надежными каналами представительства интересов и политическими связями, оказываются вне сферы «парадигмы согласования», которая пока все больше функционирует в духе бюрократически-элитистского корпоративизма.

А между тем новые вызовы общественного развития, определенные задачами перехода к системной модернизации, нацеливающей на формирование национальной инновационной системы, создают повышенный спрос на функции и услуги, связанные с экспертизой и консалтингом по публичной политике, поскольку только последняя позволяет «свежей крови» социальных инноваций «взломать» стагнирующий механизм «управляемой демократии». Отсюда появляется потребность в поддержке со стороны гражданского общества, центров публичной политики, связанных с различными гражданскими и деловыми инициативами. В этом, видимо, кроется глубинный настрой государства поддерживать тот формат взаимодействия с гражданскими структурами, который в последнее время оформился в виде общественных обсуждений программных



статей и обращений Президента РФ (пример публичной дискуссии вокруг его статьи «Россия, вперед!», подготовки последнего Послания Федеральному Собранию РФ). Иными словами, тот вариант стабильности и порядка, который вначале нынешнего десятилетия отвел Россию от края пропасти и минимизировал угрозы безопасности государства и общества, сегодня показал невысокий запас прочности и особенно – развития.

Но в настоящий момент проблема стоит глубже – без расширения качества и системности публичной политики невозможно вести речь о переходе к модернизации, а тем более – к инновационному типу развития российского общества. Модернизационный проект был выдвинут как средство посткризисного развития. Как известно, серьезный кризис не просто дает шанс новому или ранее маргинальному. Устойчивый выход из него возможен только усилиями тех субъектов, которые формируют существо нового этапа. Но заранее сказать, какие это будут субъекты, невозможно. Именно поэтому необходимо дать равные возможности для более широкого круга сторон, чтобы быстрее произошел поиск и переход от спада к оживлению. Авторитарные методы могут быть эффективным инструментом преодоления хаоса, выхода из кризиса. Однако в том случае, если ясны цели, задачи и методы такого процесса. Жесткие методы неприемлемы в сложных ситуациях, когда отсутствуют не только проверенные технологии решения проблем, но не совсем ясны сами стратегические цели. Именно поэтому все развитые государства мира, успешно осуществившие модернизацию, существуют в демократических системах ценностей, имеют демократическую политическую систему. Управленческие системы, где люди отчуждены от власти, где их духовно-нравственные потребности и интересы в значительной степени игнорируются и подавляются, неуклонно разрушаются, хотя и такие системы способны существовать достаточно долгое время. Попытка жестко защитить механизмы вчерашнего роста способна лишь усугубить проблемы, поскольку предпосылки для такого роста уже исчерпаны. Именно поэтому так важна «декомпрессия» режима, уход от его чрезмерной «вертикализации», моноцентричности, расширение институтов обратной связи, форм и практик публичной политики.

## Литература

*Никовская Л.И., Якимец В.Н.* Публичная политика в регионах России: типы, субъекты, институты и современные вызовы // ПОЛИС. 2011. №1(121). С. 80–96.

*Якимец В.Н.* Типы и особенности региональной публичной политики в России // XI Международная научная конференция по проблемам развития экономики и общества. Т. 3. / отв. ред. Е.Г. Ясин. М.: Изд. дом ГУ ВШЭ, 2011. С. 21–28.

М.И. Левин,  
Н.В. Шилова,  
М.Л. Фреер

Национальный исследовательский  
университет «Высшая школа  
экономики»

## О МОДЕЛЯХ КСЕНОФОБИИ И МЕЖНАЦИОНАЛЬНОЙ РОЗНИ<sup>1</sup>

---

Ксенофобия как реальность экономической и политической жизни современной России приобрела в последние годы не только актуальность, но и остроту, требующую глубокого исследования.

События на Манежной площади в Москве (декабрь 2010 г.) показали, что в России в значительной степени исчерпан запас «дружбы народов», активно пропагандировавшийся в Советском Союзе. Политика мультикультурализма в Европе, по-видимому, также исчерпала себя. Мультикультурализм, коммунизм, христианство, конфуцианство, ислам как идеологии могли бы объединять людей разных национальностей и этнических групп, но их столкновения порождают войны и конфликты. Это противоречие исследовалось многими экономистами, и в данной статье представлен обзор ряда работ по ксенофобии и межнациональной розни.

Поскольку определений того, что есть ксенофобия, существует множество, будем считать, что ксенофобия есть чувство нелюбви к «другому», как только такой другой обнаружен. При этом признак, по которому такой «другой» выделяется, неважен. Исходя из такого определения, мы будем относить к работам по ксенофобии те, что затрагивают, например, вопросы расовой дискриминации и проблемы миграции.

Связь миграции и ксенофобских настроений в обществе в последнее время усиленно изучается. В работе Хаттона и Вильямсона [Natton, Williamson, 2006] сравнивается рост темпа миграции и рост уровня ксенофобии. В другой работе этих исследователей [Natton, Williamson, 2004] показано, как падало качество рабочей силы мигрантов начиная с 1950-х годов, как прибывающие работники негативно влияли на рынок рабочей силы в западных странах и как это все влияло на политические требования участников этого рынка. Конечно,

---

<sup>1</sup> Представленная работа выполнена при поддержке Научного фонда НИУ ВШЭ в рамках конкурса «Учитель – ученики», «Политэкономическое моделирование ксенофобии и ее последствий» 2010–2011 гг.

степень остроты проблемы зависит от культурных особенностей государства и различий в способах перераспределения – об этом работа [Guiso, Sapienza, Zingales, 2006]. При этом, несомненно, развитый мир нуждается в трудовых миграциях, а развитие человечества и постоянный экономический рост напрямую связаны между собой [Oded, Moav, 2002], в том числе и благодаря трудовым миграциям. Поэтому несмотря на то, что все страны разные в культурном плане, они как-то пытаются решать проблемы, связанные с иммиграциями. Обзор таких политик можно найти у авторов работы [Shaw, Kibitkewski, 2001].

Интересна в этом плане работа Д. Бартрама [Bartram, 2004], в которой сравнивается миграционная политика Японии и Израиля. Автор считает, что японская бюрократия, препятствуя импорту рабочей силы, успешно предотвращает и возникновение долгосрочных расходов, связанных с пребыванием этой рабочей силы в стране, которые не оплачиваются непосредственно работодателями и тормозят рост производительности труда. В отличие от этого Израиль становится жертвой такого процесса из-за слабого институционального потенциала для создания условий, которые могли бы побудить работодателей искать альтернативные решения проблемы нехватки рабочей силы.

Использование ксенофобии в условиях активной трудовой миграции возможно для максимизации общественной прибыли [Timmer, Williamson, 2000]. Мигранты условно делятся на два основных класса: неквалифицированные и квалифицированные. Квалифицированные мигранты считаются антиблагом, так как они отнимают высокооплачиваемую работу у местного населения. Таким образом, повышается безработица среди коренного населения. А неквалифицированные работники, которые идут на низкооплачиваемые работы, куда крайне редко устраивается коренное население, приносят общественную прибыль. Построение функции полезности при разделении всего населения на два данных класса дает такой результат, что с помощью мигрантов возможно повышать общественную полезность за счет привлечения неквалифицированных работников в оптимальном количестве (таковое получается в результате максимизации функции полезности). Следовательно, мы выявили, что работодателю выгодней нанимать работников с большей производительностью труда за те же деньги исходя из условий максимизации его прибыли [Loureiro, Sachside, 2008].

Следующие работы не обращаются непосредственно к проблемам миграции, а рассматривают наличие нескольких этносов внутри страны как данность. Возможность рассмотрения взаимодействия различных этнических групп исходя из условий Парето-эффективности реализована в работе [Neilson, 1999]. Расширенная модель, принимающая во внимание изменения, происходящие

внутри таких этносов (этносы эволюционируют, деградируют, вымирают), представлена в исследовании [Wimmer, 2008].

Понятие ксенофобии тесно связано с понятием ненависти, потому далее мы приведем работы, посвященные экономике ненависти. Ненависть как экономическое благо, спрос на это благо и предложение его со стороны политиков описаны в работе [Glaeser, 2002]. В работе рассматривается борьба двух (этнических) групп. Дискриминируемая группа (меньшинство) получает меньшую долю прибыли при взаимодействии с недискриминируемой (большинством). В результате ей выгодней выделиться, объединиться в некую общину и развивать ненависть к большинству. Усиливая внутри себя ненависть к большинству, меньшинство повышают свой уровень полезности, при этом полезность членов другой группы снижается. Поскольку ненависть становится всеобщей и ее уровень растет, цена ненависти также постоянно растет, что не дает прийти к бесконечному повышению ее уровня. Производство же ненависти со стороны политиков рассматривается как производство блага со своей ценой и со своими издержками.

Такая ситуация возможна даже в случае недискриминируемых меньшинств [Ortona, 2000]. Лидеры этнических группировок, не имея другой возможности выйти на политическую арену, используют ненависть «своих» для максимизации собственной прибыли. Предполагается, что при производстве благ члены этнических групп могут использовать этнический и неэтнический капитал, и при определенных условиях использование этнического капитала становится менее выгодным, чем интеграция в принимающее общество.

Борьба самих этнических группировок между собой рассмотрена в работе [Tangeras, Lagerlof, 2009]. Авторы используют игровую модель, где вероятность победы зависит от количества вложенных ресурсов. При этом чем больше количество групп, участвующих в борьбе за власть, тем меньше вероятность победы каждой из них. Исследователи приходят к выводу, что вероятность гражданской войны максимальна в случае, если этническое разнообразие в стране находится на неком «среднем» уровне; во всех остальных случаях эта вероятность гораздо ниже.

Борьба двух этнических групп как трехфазовая игра рассмотрена в работе [Caselli, Coleman, 2006]; эта же модель применительно к Великобритании, Франции и Германии использована в работе [Thranhardt, 1999]. В данном случае рассматривается борьба двух примерно равных по численности групп за власть. На первой стадии группы решают, сколько им необходимо затратить на борьбу за власть и ресурс. Исходя из функций полезности каждой группы выбираются

равновесные значения и происходит переворот (захват власти). На второй стадии группы решают вопрос интеграции. Если группа, находящаяся у власти, не дискриминирует другую, то происходит их интеграция и игра закончена, в противном случае происходит переход к третьей фазе игры. В этой стадии группы начинают бороться за перераспределение ресурса и против дискриминации.

«Продажи» ненависти зависят от работы СМИ по распространению радикализма. В модели [Glaeser, Sunstein, 2007] общество постепенно поляризуется и назревает конфликт, если «доверчивые» граждане подвергаются массовой пропаганде.

Математическое обоснование критериев рациональности выбора дается в работе [Graciela, Chichilnisky, 2007]. Исследуются замкнутые подпространства бесконечномерных пространств, что позволяет рассматривать выборы в том числе и на конечномерных пространствах политики, будучи уверенным в рациональности выбора при выполнении определенных условий. Продажа ненависти может быть полезна политикам при формировании предвыборных программ и на двумерном пространстве политик [Roemer, Lee, Straeten, 2005]. В последней работе поиск равновесных политик происходит исходя из условий равновесия Нэша. Эта же модель использовалась для рассмотрения ситуаций, складывавшихся в Дании [Roemer, Straeten, 2006] и Франции [Roemer, Straeten, 2004]. Общий вывод в этих работах – возврат к консерватизму во многих случаях становился результатом расистских (ксенофобских) взглядов политиков, которые проводят недальновидную политику перераспределения.

Рассмотрению игры двух кандидатов на выборах, но в условиях одномерной политики (перераспределение общественного блага), посвящена игровая модель с равновесием Нэша [Valfortand, Wantchekon, 2008]. Особенностью модели является то, что страна условно делится на районы, каждому из которых приписывается своя общественная функция полезности.

Важным фактором в политическом выборе является страх [Carlin, 2002]. Страх и выбор связаны между собой через ожидания людей относительно будущего, поскольку в случае ожидания плохого последующего периода меняется уровень сбережений населения. Получаемый в модели оптимальный уровень сбережения трактуется как политический выбор на политической шкале партий или кандидатов. Соответственно увеличивая или снижая уровень страха в обществе, политики могут влиять на результаты выборов. При этом страх другой этнической группы – один из наиболее просто вызываемых и нагнетаемых страхов.

Ксенофобия как антиблаго изучается в работе [Cheikbossian, 2008]. Исследователь утверждает, что в равновесных условиях ценность денег выше

ценности этнического капитала. Автор работы [Akerlof, 2007] также рассматривает агента, который исходя из соображений собственной выгоды либо может начать взаимодействовать с «непохожими» на него агентами, либо перестает взаимодействовать с агентами из «его» группы. И если он ксенофоб, то в определенных условиях будет терять полезные контакты с людьми, принадлежащими другой группе, а следовательно, и собственную прибыль.

Одна из интересных моделей с дискриминацией рассматривается в работе [Challier, 2009]. В ней предполагается, что вероятность возникновения конфликтов в обществе зависит от степени «удовлетворенности» каждой группы. Политическая стабильность определяется четырьмя факторами: уровнем агрессии (внутренние конфликты, партизанские войны или революции), протестами (массовыми беспорядками и антиправительственными демонстрациями), нестабильностью режима (устойчивостью режима и конституционными изменениями), нестабильностью правительства (политическим единством). На таком четырехмерном пространстве вводится евклидова норма, которая определяет то, насколько велика возможность переворота и насколько довольны население (оно разделено на классы, каждый из которых имеет собственную функцию полезности). Вводится дискретная функция полезности для каждого класса (доволен/недоволен). Таким образом получаем вероятность восстания и свержения существующей власти.

После же совершения переворота новому лидеру необходимо перераспределить полученную прибыль. Игровая модель [Olsson, 2003] в этом смысле идет дальше модели, рассмотренной в работе [Challier, 2009]. В первой фазе игры также прогнозируется возможность восстания, но в данной модели лидер (лидер по Штакельбергу – исходя из условий распределения ресурсов) и повстанцы относятся либо к разным классам, либо к разным этническим группам. Также повстанцы не могут заниматься никакой деятельностью кроме «своей» (в основном земледелие) из-за национальной дискриминации или из-за того, что другие секторы рынка переполнены и не могут вместить в себя дополнительных агентов. В результате в мирной фазе игры правитель (лидер по Штакельбергу) должен обеспечить повстанцам наибольшую полезность, но если масштабы производства и экономики не позволяют ему этого сделать, то он наверняка будет свергнут, так как альтернатива непроизводственного дохода и использования ресурсов государства более выгодна.

Ксенофобия тесно связана с борьбой за ренту, так как карта ксенофобии может разыгрываться для максимизации прибыли от ренты. Однако ксенофобия требует инвестиций, а готов ли агент инвестировать, чтобы получить ренту?! Да, если проанализировать игровые модели борьбы за ренту [Riechmann,

2007]. В свою очередь, размер инвестиций связан с уровнем развития антикоррупционных институтов государства [Colombatto, 2001], что продолжает модели, имеющие различные равновесные уровни ренты.

## Литература

- Akerlof G., Kranton R.* Economics and Identity // *Quarterly Journal of Economics*. 2000. 115(3). P. 715–753.
- Bartram D.* Labor Migration Policy and the Governance of the Construction Industry in Israel and Japan // *Politics and Society*. 2004. 32(2). P. 131–170.
- Caplín A.* Fear As a Policy Instrument. New York University, 2002.
- Caselli F., Coleman W.J. II.* On the Theory of Ethnic Conflict: CEP Discussion Papers dp0732, LSE, 2006.
- Challier T.* Socio-political Conflict, Social Distance, and Rent Extraction in Historical Perspective // *European Journal of Political Economy*. 2010. Vol. 26. Iss. 1. P. 51–67.
- Cheikbossian G.* Heterogeneous Groups and Rent-seeking for Public Goods // *European Journal of Political Economy*. 2008. 24(1). P. 133–150.
- Chichilnisky G.* The Topology of Fear // *Journal of Mathematical Economics*. 2009. Vol. 45. Iss. 12. P. 807–816.
- Colombatto E.* Discretionary Power, Rent-seeking and Corruption: Univ. di Torino Working Paper. 2001.
- Glaeser E.L., Sunstein C.R.* Extremism and Social Learning: NBER Working Papers 13687. 2007.
- Glaeser E.L.* The Political Economy of Hatred: NBER Working Papers 9171. 2002.
- Hatton T.J., Williamson J.G.* International Migration in the Long-Run: Positive Selection, Negative Selection and Policy: IZA Discussion Papers 1304. 2004.
- Hatton T.J., Williamson J.G.* What Determines Immigrations' Impact? Comparing Two Global Centuries: CEPR Discussion Papers 5885. 2006.
- Loureiro P.R.A., Carneiro F.G., Sachsida A.* Race and Gender Discrimination in the Labor Market: An Urban and Rural Sector Analysis for Brazil // *Journal of Economic Studies*. Emerald Group Publishing. 2004. Vol. 31(2). P. 129–143.
- Neilson B.* On the New Cosmopolitanism. Communal/Plural // *Journal of Transnational and Cross-Cultural Studies*. 1999. 7(1). P. 111–124.
- Oded G., Moav O.* Natural Selection and the Origin of Economic Growth // *Quarterly Journal of Economics*. 2002. 117. P. 1133–1191.
- Olsson O.* Conflict Diamonds // *Journal of Development Economics*. 2007. Vol. 82(2). P. 267–286.
- Ortona G.* On the Xenophobia of Non-discriminated Ethnic Minorities. University of Piemonte Orientale, Department of Public Policy and Public Choice: Working Paper № 16. 2000.
- Riechmann T.* An Analysis of Rent-seeking Games with Relative-payoff Maximizers // *Public Choice*. 2007. Vol. 133(1). P. 147–155.
- Roemer J.E., Straeten K.* Xenophobia and Distribution in France: A Political-economic Analysis. New Haven, 2004.
- Roemer J.E., Van der Straeten K.* The Political Economy of Xenophobia and Distribution: The Case of Denmark // *Scandinavian Journal of Economics*. 2006. 108. P. 25–277.

*Roemer J.E., Lee W., Van der Straeten K.* Racism, Xenophobia and Distribution: Multi-Issue Politics in Advanced Democracies. Cambridge: Harvard University Press, 2007.

*Sapienza P., Zingales L., Guiso L.* Does Culture Affect Economic Outcomes?: NBER Working Papers 11999. 2006.

*Shaw K.B., Kibitkewski J.* Hate, Hate Groups and Hate Crimes: Fighting Xenophobia in the European Union. 2001. Unpublished.

*Tangerås T., Lagerlöf N-P.* Ethnic Diversity, Civil War and Redistribution // Scandinavian Journal of Economics. 2009. Vol. 111. Iss. 1. P. 1–27.

*Thranhardt D.* Germany's Immigration Policies and Politics // Mechanisms of Immigration Controls / G. Brochmann, T. Hammar (ed.) Oxford: Berg, 1999. P. 29–58.

*Timmer A.S., Williamson J.G.* Racism, Xenophobia or Markets? The Political Economy of Immigration Policy Prior to the Thirties: NBER Working Papers 5867. 1996.

*Valfortand M., Wantchekon L.* Inter-ethnic Interaction and Cooperation: Experimental Evidence from Benin. 2008. Unpublished.

*Wimmer A.* The Making and Unmaking Of Ethnic Boundaries: A Multi-level Process Theory // American Journal of Sociology. 2008. 113. P. 970–1022.



И.В. Мерсиянова,  
Е.И. Пахомова  
Национальный  
исследовательский  
университет «Высшая школа  
экономики»,  
В.Н. Якимец  
Институт системного анализа  
РАН

# **РОЛЬ ДОВЕРИЯ К ГОССЛУЖАЩИМ ВО ВЗАИМОДЕЙСТВИИ ГРАЖДАНСКОГО ОБЩЕСТВА И ГОСУДАРСТВА**

---

Доверие является одной из важнейших установок, определяющих как характер взаимодействия гражданского общества и государства, так и вовлеченность населения в повседневные практики гражданского общества и деятельность негосударственных некоммерческих организаций. Доверие населения к государственным служащим выступает основой совместной деятельности, служит поддержанию социальных норм, обеспечивает определенный уровень коммуникации. Существующий уровень доверия в определенной ситуации формирует перцептивную установку на ее восприятие.

В связи с этим является актуальной, во-первых, необходимость изучения феномена доверия в сфере государственной службы, определения его слагаемых и форм проявления, во-вторых, разработка комплекса мер, направленных на формирование доверия населения к государственным служащим. Первым шагом является разработка показателей, характеризующих уровень доверия граждан к профессиональной деятельности государственных служащих, и последующая разработка системы мониторинга данных показателей.

Нами выполнена работа по оценке доверия населения к государственным служащим для разработки и реализации политики государства в области реформирования и развития государственной службы. Авторы выражают глубокую признательность А.В. Клименко, Н.Н. Клищу, а также сотрудникам Минэкономразвития и Администрации Президента Российской Федерации, принимавшим участие в обсуждении методики и инструментария исследования, О.Н. Кононыхиной за статистическую обработку данных опроса и формирование массивов выходной информации.

Следует отметить, что проблема доверия давно стала предметом исследований известных социологов, социальных психологов, экономистов и политологов [Luhman, 1979, 2000; Giddens, 1990; Fukuyama, 1995; Stompka, 1996, 1997,

1999; Glaeser, 2000; Селигмен, 2002; Корнаи, 2003]. Ими были созданы развернутые концепции, которые представляют серьезный вклад в теоретическое осмысление проблемы, но оставляют дискуссионным вопрос о методологии определения доверия населения к специфическим социальным группам государственных служащих.

Определим доверие граждан профессиональной деятельности государственных служащих как совокупность социально обоснованных и социально подтвержденных ожиданий в отношении профессиональной деятельности государственных служащих.

Создавая многопараметрический индекс доверия, мы методологически исходили из того, что доверие граждан формируется под влиянием их личного опыта взаимодействия с государственными служащими (на микроуровне) и оценки ими адекватности принятых норм и правил деятельности служащих в рамках институциональных структур, обладающих определенными характеристиками (на макроуровне). Основание доверия к государственным служащим – вера в надлежащее функционирование системы, ее социальные нормы и законы. Специфическими функциями доверия к государственным служащим являются: обеспечение деперсонифицированного взаимодействия в соответствии с социальными ролями, воспроизводство социальной структуры.

Отметим, что преобладают «одномерные» индексы доверия, фиксирующие число россиян, доверяющих и не доверяющих деятельности того или иного института власти.

Нами применен комплексный подход, основанный на использовании индекса обобщенного доверия и многопараметрического индекса доверия. В соответствии со ст. 2 Федерального закона «О системе государственной службы Российской Федерации» от 27 мая 2003 г. № 58-ФЗ мы выделяем три вида государственной службы – гражданскую, военную и правоохранительную.

## **Индекс обобщенного доверия**

Индекс обобщенного доверия государственным служащим (в разрезе трех видов) рассчитывается на основе значений двух показателей:

- 1) показатель обобщенного доверия госслужащим данного вида;
- 2) показатель меры личного доверия госслужащим данного вида.

*Показатель обобщенного доверия государственным служащим.* Градациями соответствующей переменной являются ответы на вопрос: «По ваше-

му мнению, [государственным служащим] доверяют или нет?» (аналогично по всем видам государственной службы). Данная переменная принимает четыре значения: «доверяют» (объединение ответов «безусловно доверяют» и «скорее доверяют») и «не доверяют» (объединение ответов «безусловно не доверяют» и «скорее не доверяют»). Доля затруднившихся ответить не учитывается. Для расчета значений показателя обобщенного доверия большинству госслужащих данного вида используется следующая формула:

$$I_i^G = \frac{trust_i - notrust_i}{N_{answer}} + 1,$$

где  $i$  – номер вида госслужбы, сотрудники которого подверглись оценке,  $i = 1, 2, 3$ ;  $trust_i$  – число граждан, полагающих, что можно доверять госслужащим  $i$ -го вида госслужбы;  $notrust_i$  – число граждан, полагающих, что нельзя доверять госслужащим  $i$ -го вида госслужбы;  $I_i^G$  – компонент обобщенного доверия;  $N_{answer}$  – объем выборки (учитываются только респонденты, ответившие на вопрос анкеты).

Значения данного показателя изменяются в интервале от нуля до двух.

**Показатель меры личного доверия госслужащим** данного вида определяется на основе ответов на вопрос: «Пожалуйста, оцените, насколько вы доверяете [государственным служащим]. Для этого используйте шкалу от 1 до 10, где «1» означает, что вы совершенно им не доверяете, а «10», что вы полностью им доверяете». Для расчета значений второго компонента используется формула:

$$I_i^{pt} = \frac{\sum_{j=1}^N q_{ij}}{10 \cdot N_{answer}},$$

где  $i$  – номер вида госслужбы, сотрудники которого подверглись оценке,  $i = 1, 2, 3$ ;  $q_{ij}$  – оценка доверия сотрудникам  $i$ -го вида госслужбы, данная  $j$ -м респондентом,  $q_{ij} \in \{1, 2, 3, \dots, 10\}$ ;  $I_i^{pt}$  – показатель меры личного доверия;  $N_{answer}$  – объем выборки (без учета затруднившихся ответить).

Для построения индекса обобщенного доверия значения показателя обобщенного доверия и показателя меры личного доверия унифицируются в процентном формате: шкала значений данного показателя изменяется от 0 до 100%, где значение в интервале от 0 до 20% интерпретируется как низкое значение показателя; значение показателя от 21 до 40% оценивается как ниже среднего; от 41 до 60% – как среднее; от 61 до 80% – как выше среднего; выше 81% – как

высокое. То есть при определении границ используется равномерное распределение шкалы от 0 до 100% по пяти интервалам, с прирастанием на 20 п.п.

Используя индексы обобщенного доверия (по трем видам государственной службы) можно определить значение *усредненного индекса обобщенного доверия государственным служащим*, рассчитываемое как среднее арифметическое:

$$I_{trust} = mean(I_{trust}^i),$$

где  $I_{trust}^i$  – индекс обобщенного доверия, рассчитанный для каждого вида госслужбы.

Значение данного индекса изменяется по шкале значений от 0 до 100%, при определении границ используется равномерное распределение шкалы от 0 до 100% по пяти интервалам.

## Многопараметрический индекс доверия

Разработанный нами многопараметрический индекс доверия населения профессиональной деятельности госслужащих нацелен не только на получение данных о текущем состоянии доверия населения к государственным служащим, но и на выявление отношения к совокупности социально обоснованных норм профессиональной деятельности государственных служащих и оценке оправданности и подтвержденности их ожиданий в процессе личного взаимодействия.

Многопараметрический индекс доверия состоит из двух субиндексов:

- *субиндекс структурных условий* (являющихся детерминантами уровня доверия/недоверия к деятельности госслужащих со стороны граждан на институциональном уровне);
- *субиндекс оправданных ожиданий* (на основании оценок гражданами своего опыта взаимодействия с госслужащими).

Первый субиндекс опирается на работу П. Штомпки [Sztompka, 1997] и В. Мининой [Минина, 2002, с. 87–97], развивающей его идеи. Совокупность показателей, используемых при создании субиндекса структурных условий, основана на работе П. Штомпки [Sztompka, 1999, р. 97–103], где им предложены 7 структурных (контекстуальных в его терминологии) условий, степень проявления которых в деятельности органа государственного управления обуславливает уровень доверия/недоверия граждан. В нашем случае указанная совокуп-

ность детерминант была подвержена корректировке, чтобы в максимально возможной форме отразить стратегические цели и задачи программы «Реформирование и развитие системы государственной службы Российской Федерации (2009–2013 гг.)». В результате были определены следующие показатели: доступность большинству граждан информации о порядке работы госслужащих, обеспечение нормального взаимодействия госслужащих с гражданами посредством правил их работы, открытость деятельности госслужащих для контроля со стороны граждан, обеспечение соблюдения прав граждан госслужащими при выполнении своих обязанностей, добросовестное исполнение госслужащими своих обязанностей по отношению ко всем гражданам, осуществление деятельности госслужащими в интересах страны и общества в целом, а не в личных интересах.

Субиндекс оправданных ожиданий строится на основании оценок гражданами опыта личного взаимодействия с госслужащими. Очевидно, что удовлетворенность/неудовлетворенность граждан тем, как реагировали на их обращения, какого качества, полноты, достоверности и своевременности были госуслуги, которые они получили, а также тем, насколько оправдались их ожидания, определяет уровень доверия/недоверия населения к государственным служащим. Опираясь на направления и задачи действующей Программы реформирования госслужбы, утвержденной Указом Президента Российской Федерации № 261 от 10 марта 2009 г., нами были определены основные показатели оценки гражданами опыта взаимодействия с различными сторонами деятельности государственных служащих: доступность информации о порядке работы госслужащих, понятность порядка взаимодействия с госслужащими, правильность оформления запросов и иных документов, предоставляемых госслужащими, приемлемость сроков реагирования со стороны госслужащих, обладание госслужащими хорошим опытом работы и уровнем знаний, персональная ответственность госслужащих при работе с гражданами.

Конструирование субиндексов вели с учетом собственного опыта разработки иных инструментов оценки [Якимец, 2007, 2008]. Субиндексы рассчитывались в разрезе трех видов государственной службы – гражданской, военной и правоохранительной.

Введем следующие обозначения:

$x_{ij}$  – булева переменная, принимающая значение единица при выполнении условия (респондент согласен с предложенным высказыванием) или ноль – в противном случае;  $j = 1, 2, \dots, m$  – номер респондента;  $m_{answer}$  – число респондентов, ответивших на суждение  $i$  (без учета затруднившихся ответить),  $i = 1, 2, \dots, n$ .

Для расчета значений каждого показателя используется формула:

$$T^i = \frac{\sum_{j=1}^m x_{ij}}{m_{answer}}.$$

Значения показателей здесь изменяются в интервале от нуля до единицы. Для построения субиндексов значения унифицируются в процентном формате (от 0 до 100%), при определении границ используется равномерное распределение шкалы от 0 до 100% по пяти интервалам.

*Субиндекс структурных условий*  $T^S$  рассчитывается по формуле:

$$T^S = \frac{\sum_{i=1}^n \sum_{j=1}^m x_{ij}}{m \cdot n}.$$

*Субиндекс оправданных ожиданий*  $T^E$  рассчитывается по формуле:

$$T^E = \frac{\sum_{i=1}^k \sum_{j=1}^m y_{ij}}{m \cdot k}.$$

где  $y_{ij}$  – булева переменная, принимающая значение единица при выполнении условия (согласие с предложенным утверждением), или ноль – в противном случае,  $j = 1, 2, \dots, m$  – номер респондента;  $i = 1, 2, \dots, k$  – номер показателя.

Для унификации значение каждого субиндекса преобразуется в процентный формат и изменяется от 0 до 100%, при определении границ используется равномерное распределение шкалы по пяти интервалам.

## Результаты апробации

Источником эмпирических данных для расчетов значений индекса обобщенного доверия граждан деятельности государственных служащих и многопараметрического индекса доверия являются результаты всероссийского опроса населения. Сбор информации проведен в октябре 2010 г. методом формализованного интервью по разработанному авторами инструментарию. Выборочная совокупность опроса составила 1600 респондентов, отобранных с учетом социально-демографических характеристик, репрезентирующих взрослое население Российской Федерации по полу, возрасту, типу населенного пункта и

пропорциональной представленности по образованию и социально-профессиональной принадлежности в соответствии с принципами и критериями, разработанными в рамках программы исследования. Организация и проведение опроса осуществлялись Всероссийским центром изучения общественного мнения (ВЦИОМ).

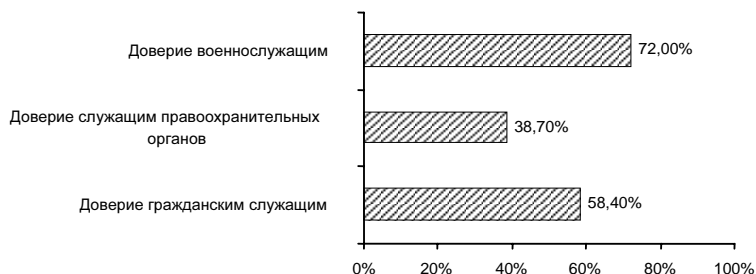
По результатам опроса были получены линейные распределения ответов респондентов, на основе которых рассчитаны все разработанные нами индексы.

Значения *индекса обобщенного доверия государственным служащим*, рассчитанного как среднее арифметическое из двух показателей – *индекса обобщенного доверия* и *индекса меры личного доверия*, соответствуют зоне средних значений.

Максимальное значение *показателя обобщенного доверия* зафиксировано в отношении российских военнослужащих. Оно составляет 77,8%. Значение индекса обобщенного доверия гражданским служащим составляет 54,5%, служащим правоохранительных органов – 32,5%.

Наивысшее значение *показателя меры личного доверия* зафиксировано в оценках населением также в отношении российских военнослужащих – 66,1%. Значение индекса меры личного доверия гражданским служащим ниже и составляет 61,8%. Значение индекса меры личного доверия служащим правоохранительных органов – 44,8%.

Итак, максимальное значение *интегрального индекса доверия* (72%) наблюдается в оценках гражданами деятельности российских военнослужащих (рис. 1). Заметно ниже оценка деятельности гражданских служащих – 58,4%. Значение интегрального индекса доверия деятельности служащим правоохранительных органов составляет 38,7%.



**Рис. 1.** Значение интегрального индекса доверия государственным служащим

Предложенный нами подход позволяет не столько зафиксировать текущий уровень доверия граждан деятельности государственных служащих, но, прежде всего, выявить соответствие или несоответствие деятельности государственных служащих направлениям реформирования и развития госслужбы, а также сформулировать дополнительные предложения по совершенствованию реформы государственной службы в целом и деятельности той или иной службы. С этой целью был создан многопараметрический индекс, рассчитываемый также в разрезе трех видов государственной службы. Рассмотрим его составляющие – субиндекс структурных условий и субиндекс оправданных ожиданий – в разрезе трех видов государственной службы.

Анализ значений показателей субиндекса структурных условий деятельности гражданских служащих (рис. 2) свидетельствует, что наиболее низко респондентами оценивается такой аспект деятельности гражданских служащих, как открытость для контроля со стороны граждан. Однако для сбалансированного функционирования аппарата государственной власти гражданское общество должно располагать инструментами контроля за профессиональной служебной деятельностью государственных служащих.



**Рис. 2.** Субиндекс структурных условий

Все параметры (кроме одного) структурных условий деятельности российских военнослужащих оценены выше, чем у гражданских госслужащих и служащих правоохранительных органов (см. рис. 2). Деятельность служащих



правоохранительных органов оценена гражданами низко по пяти из шести показателей субиндекса структурных условий – доминирование личных интересов в работе над интересами страны и общества в целом (28%), закрытость их деятельности для контроля со стороны граждан (19%) и «избирательность» их действий в зависимости от положения и дохода граждан (22%), права граждан соблюдаются не очень хорошо (31%) и пр. Лишь в отношении доступности информации о деятельности этих служащих для граждан высказалось более половины респондентов (52%).

Значения целого ряда показателей субиндекса оправданных ожиданий, основанных на оценках личного опыта взаимодействия опрошенных с гражданскими служащими, находятся в интервале «выше среднего» (рис. 3).



Рис. 3. Субиндекс оправданных ожиданий

Это касается таких параметров деятельности гражданских служащих, как уровень доступности информации о порядке работы (69% опрошенных согласны с этим), правильность оформления служащими запросов и иных документов (58%), уровень знаний и опыт работы (61%), доступность порядка взаимодействия граждан с гражданскими служащими (65%). В то же время лишь около половины респондентов согласились с тем, что уровень персональной ответственности гражданских служащих при работе с гражданами приемлем (49%), так же как и оценка сроков их реагирования на запросы населения (52%). Они находятся в более низком интервале, по сравнению со значениями субиндекса

сов других параметров деятельности гражданских служащих, расположенных в интервале средних значений.

Большинство значений показателей субиндекса оправданных ожиданий в отношении военнослужащих также оцениваются высоко и находятся в диапазоне значений выше среднего: хороший опыт и уровень знаний военнослужащих (79% респондентов согласны), понимание порядка взаимодействия с военнослужащими (76%), приемлемость сроков реагирования на запросы (70%) и доступность для большинства граждан информации о порядке работы военнослужащих (70%). Несколько ниже оценивали правильность оформления ответов на запросы и иные документы (67%) и уровень персональной ответственности (67%).

Большинство значений параметров субиндекса оправданных ожиданий в оценках гражданами служащих правоохранительных органов оценены респондентами выше, чем параметры субиндекса структурных условий. Однако в сравнении с аналогичными оценками в отношении деятельности гражданских служащих и военнослужащих, результаты опроса также фиксируют минимально низкие индексные оценки оправданных ожиданий в отношении деятельности служащих правоохранительных органов. Лишь треть респондентов (33%) согласилась с тем, что для деятельности служащих правоохранительных органов была характерна персональная ответственность при работе с гражданами. Также достаточно низко оцениваются такие аспекты деятельности служащих правоохранительных органов, как приемлемость сроков реагирования на запросы граждан (44% согласных с этим респондентов) и хороший опыт работы и уровень знаний служащих правоохранительных органов (45%).

Представленные значения многопараметрического индекса и его составляющих – субиндексов структурных условий и оправданных ожиданий – позволяют дать оценку отдельным аспектам деятельности государственных служащих в разрезе конкретных видов службы и на основе данных оценок сформулировать предложения как по дополнению и корректировке основных мероприятий реформирования и развития государственной службы, так и по реализации системы действий структур гражданского общества по общественному контролю за деятельностью государственных служащих.

## Литература

*Корнаи Я.* Честность и доверие в переходной экономике // Вопросы экономики. 2003. № 9.

*Минина В.Н.* Проблема недоверия в системе государственного управления современным российским обществом // Социология политики и управления: Сб. статей / под ред. Л.Т. Волчковой. СПб.: Книжный дом, 2002. С. 87–97.

*Селигмен А.* Проблема доверия / пер. с англ. И. Мюрберг, Л. Соболевой. М.: Идея-Пресс, 2002.

*Факторы развития* гражданского общества и механизмы его взаимодействия с государством/ под. ред. Л.И. Якобсона. М.: Изд. дом ГУ ВШЭ, 2008.

*Якимец В.Н.* Индекс для оценки и мониторинга публичной политики // Публичное пространство, гражданское общество и власть: опыт взаимодействия. М.: РАПН, РОССПЭН, 2008. С. 107–121.

*Якимец В.Н.* Инструменты для оценки деятельности органов власти // Сборник трудов Международной конференции «Государственное управление в XXI веке: традиции и инновации». М.: МГУ им. М.В. Ломоносова, 2007.

*Barber B.* The Logic and Limits of Trust. New Brunswick, NJ: Rutgers University Press, 1983.

*Castaldo S.* Trust Variety: Conceptual Nature, Dimensions and Typologies: Paper presented at the 19th IMP-conference in Lugano, Switzerland. 2003. ([http://www.impgroup.org/paper\\_view.php?viewPaper=4317](http://www.impgroup.org/paper_view.php?viewPaper=4317))

*Fukuyama F.* Trust: the Social Virtues and the Creation of Prosperity. N.Y.: The Free Press, 1995.

*Giddens A.* The Consequences of Modernity. Cambridge: Polity Press, 1990.

*Glaeser E.* Measuring Trust // The Quarterly Journal of Economics. 2000. August. P. 811–846.

*Luhman N.* Familiarity, Confidence, Trust: Problems and Alternatives // Trust: Making and Breaking Cooperative Relations (electronic edition) / ed. by D. Gambetta. Oxford: University of Oxford, 2000. Ch. 6. P. 94–107.

*Luhman N.* Trust and Power. Chichester: Wiley, 1979.

*Sztompka P.* Trust: a Sociological Theory. Cambridge: Cambridge University Press, 1999.

*Sztompka P.* Trust, Distrust and the Paradox of Democracy. P. 97–103, Wissenschaftszentrum Berlin für Sozialforschung gGmbH (WZB), Reichpietschufer 50, D-10785 Berlin. (<http://bibliothek.wzb.eu/pdf/1997/p97-003.pdf>)

*Uslaner E.* Trust in the Knowledge Society. 2002. (<http://www.esri.go.jp/en/workshop/030325/030325paper3-e.pdf>)

# СОВРЕМЕННАЯ ПОЛИТОЛОГИЯ О ВЗАИМОДЕЙСТВИИ ВЛАСТИ И ОБЩЕСТВА: ТЕОРЕТИЧЕСКОЕ ОСМЫСЛЕНИЕ И ЗНАЧЕНИЕ ДЛЯ РОССИЙСКОЙ ПОЛИТИКИ

---

Модернизация экономики невозможна без социальной модернизации, без изменения отношений между обществом и политической системой. Авторитетные эксперты утверждают: «...чтобы отойти от инерционного сценария для российской экономики, нужно немедленно начать модернизационные институциональные реформы» [Акиндинова, Алексахенко, Ясин, 2011, с. 70]. Таким образом, политическая модернизация является важнейшим пунктом повестки дня.

А для политической модернизации, «умной политики» (говоря словами Д.А. Медведева) политология является не «заумным бормотанием», а интеллектуальным базисом, источником новых идей и смыслов.

Но чтобы справиться с этой ролью, политология (*political science*) должна быть в состоянии дать ответы на вопросы, возникшие перед современным государством и обществом. К сожалению, современная политическая наука, в том числе российская, находится в серьезном кризисе. Причины его возникновения и путь выхода из него мы и попытаемся рассмотреть ниже.

## Истоки проблемы

Сегодня в России для политологии словно бы не осталось места. Выборы почти утратили свое значение, причем даже не столько из-за «зачистки» оппозиционных партий, сколько из-за сокращения влияния избираемых органов власти. Электоральный процесс не воспринимается гражданами как что-то существенное, способное повлиять на их повседневную жизнь. Имевшая место в

2007 г. кампания по презентации думских выборов как «референдума» о доверии политике В. Путина ясно показала, что выборы сегодня рассматриваются не как способ формирования будущей власти, но как форма легитимации власти существующей. Отказаться в доверии действующей власти, конечно, можно (и никакие фальсификации и отмена порога явки ситуацию не спасут), но чем ее заменить? Люди не находят ответа на этот вопрос, поскольку не видят альтернативной политической программы, и готовы соглашаться на сохранение status quo. В такой системе замещение значимых должностей в системе государственного управления и даже смена власти происходят непублично, а, стало быть, изучение этого процесса с помощью инструментов, бывших до сего дня в арсенале политологии, представляется крайне затруднительным.

Однако похожие трудности возникают и там, где представительная демократия, казалось бы, не испытывает проблем с конкурентностью и публичностью. В развитых странах Запада выборы остаются вполне конкурентными, оппозиция действительно имеет доступ к СМИ и исход голосования до последнего дня часто остается непредсказуемым. Но и там электоральный процесс в большой мере приобретает характер интерактивного шоу, а относительная «непредсказуемость» придает ему остроты, но не значимости. Независимо от того, победят республиканцы или демократы в США, консерваторы или лейбористы в Великобритании и т.п., политический курс правительств в этих странах не претерпит существенных изменений. Экономическая и политическая элита останется той же самой, интересы ее будут неизменными, а наличие в органах власти тех или иных лиц погоды не сделает. Публичный политический процесс, в ходе которого происходит смена власти, сегодня все больше походит на футбольный матч. Самый яркий пример тому – Б. Обама, который шел на выборы под лозунгом «Change We Need», победил «по-демократически» совершенно блистательно, а в результате продолжает в основном политику (policy) своих предшественников (примеры: Афганистан, Ливия, убийство У. бен Ладена). Для политической науки это опять-таки означает существенные затруднения – публичный процесс, конечно, можно изучать, но если он ни на что принципиально не влияет, то много ли в таком изучении толку? Не удивительно, что в такой ситуации стали раздаваться голоса о «смерти политологии» или ее «ненаучности».

Однако мы решительно утверждаем, что такой взгляд ошибочен. Не политология умерла, а показала свою абсолютную несостоятельность старая методология, которая в центр внимания политической науки ставила государственную власть, вследствие чего единственным объектом исследования стал процесс борьбы за распределение властного ресурса. Подлинно научное исследо-

вание этого процесса возможно лишь там, где он протекает открыто и публично, т.е. имеет форму демократических выборов. А поскольку выборы, как любой массовый процесс может быть описан статистически и, стало быть, математически смоделирован, политическая методология попала в жесткие тиски «модельного подхода», эконометрики, математической статистики и комбинаторики [Джексон, 1999, с. 699]. Там же, где сбор количественных данных затруднен, статистика оказывается в тупике, и феномены неэлекторальной природы просто выпадают из ее поля зрения.

В итоге все, что могла бы предложить политология специфически «своего», попало в абсолютную зависимость от одного-единственного политического института. Такая политология действительно испытывает трудности, если избирательная система перестает оказывать существенное влияние на расстановку политических сил. И такой науке нечего сказать тем общественным силам, которые и не собираются встраиваться в государственную власть или с ней конкурировать, но стремятся только к улучшению окружающей действительности (гражданским движениям, например).

Таким образом, задача видится не в том, чтобы «похоронить» политологию или ожидать того прекрасного дня, когда выборы снова станут определять лицо политической системы. Нам надлежит подумать над тем, чтобы уйти от старой методологии и, более того, от прежнего объекта изучения – процесса борьбы за власть.

## **Смена координат**

Наше предложение заключается в том, чтобы по-иному посмотреть на объект исследования политической науки. Однако возможно ли политологически изучать невластные феномены? Наш ответ – возможно.

Какая бы судьба ни постигла институт выборов и каким бы авторитарным и закрытым ни был политический режим – социальные проблемы никуда не исчезают, процесс артикуляции и агрегирования интересов не прекращается. А процесс этот гораздо шире, чем собственно борьба за доступ к властному ресурсу, в него вовлечены гораздо более значительные социальные силы. Вместе с тем он не может рассматриваться в отрыве от политики в традиционном ее понимании. В современном мире государство пронизывает все, причем в наиболее «демократических» и «передовых» обществах оно часто проникает даже в те сферы, которые в обществах «авторитарных» им мало затрагивались (например, институт семьи [Козырева, Гурко, 2010, с. 73]). Потому никакое существ-

венное изменение социальной реальности невозможно без его участия; всякая общественная активность, независимо от того, исходит ли первоначальный импульс «сверху» или «снизу», неизбежно оказывается перед необходимостью общения с администрацией и политической властью. Как отметил авторитетный российский политолог А. Галкин, «...политические сигналы, поступающие от индивидов, не могут быть сведены к электоральным действиям. По сути дела, любая акция, адресованная гражданином политическим институтам (будь то письменное послание, отказ платить налоги, девиантное поведение), является политическим действием» [Галкин, 2004, с. 128]. Таким образом, не борьба за обладание государственной властью как инструментом легального насилия, но процесс выявления и разрешения социальных проблем при участии государственной власти – вот что представляется нам достойным объектом исследования современной политологии.

Сегодня политологами (и российскими в том числе) ведутся исследования и по этому направлению, но этим исследованиям не хватает теоретического базиса. Не только в массовом сознании, но и в исследовательском сообществе продолжает господствовать убеждение, что политика – это борьба за власть. Достаточно почитать вузовские учебники по политологии, чтобы в этом убедиться. Так, в одном из наиболее популярных учебников политика определяется как «совокупность отношений, складывающихся в результате целенаправленного взаимодействия групп по поводу завоевания, удержания и использования государственной власти» [Соловьев, 2001, с. 53].

Кроме того, в широком политологическом дискурсе результаты исследований, не направленных на изучение «власти», почти не присутствуют. А политология тем и отличается от многих других научных дисциплин, что она в принципе не может быть уделом узкой коллегии профессионалов. Политология имеет ценность (на этой позиции мы готовы стоять твердо!), только если функционирует цепочка «академическая наука – прикладная наука – публичный дискурс». Потому сегодня требуется даже не столько смена объекта, сколько «смена координат» в политологии. Мы нуждаемся в подходе, при котором государственная власть рассматривается уже не как самоцель, но как инструмент для решения конкретных вопросов.

## **Теоретический базис**

Ключевой проблемой политологии при обозначенном нами подходе становится проблема взаимодействия государства и общества, а борьба за власть как таковая отступает на задний план.

Теоретической основой дальнейших исследований здесь может выступать условная двухчастная модель социального мира, восходящая еще к Гегелю и Токвиллю (см.: [Коэн, Арато, 2003, с. 142]).

В этой модели существует две сферы – «политическое сообщество» (или политическая система), в которую помимо «государства» в узком смысле входят и политические партии, группы давления и другие структуры, так или иначе связанные с завоеванием и осуществлением политической власти, с одной стороны, и, с другой, «неполитическое сообщество», сфера частной жизни людей, преследующих свои личные (семейные) интересы. Две эти сферы существуют одновременно и параллельно в рамках одного целого – социума, но при этом их функционирование основано на абсолютно различных принципах.

Политическая сфера, как это заметил еще Аристотель, ориентирована на общее благо [Аристотель, 1998, с. 38], которое удивительным образом не только не является простой суммой частных благ, но представляет собой нечто, в корне от них отличное. Неполитическая сфера ориентирована на разнородные частные блага, трудно совместимые друг с другом и объединяющиеся в некое групповое благо только случайным образом и на краткое время.

Нормативным и аксиологическим центром политической сферы является власть, причем власть публичная. Для неполитической сферы ключевым понятием является интерес.

Соответственно, сама логика бытия этих сфер глубоко различна. Политическая сфера устроена вертикальным образом, она функционирует в логике иерархии, дисциплины, подчинения. Разнообразные демократические новации, наподобие разделения властей, несколько смягчают тотальность и централизм, но отнюдь не устраняют логику господства-подчинения из отношений политики. Неполитическая же сфера действует в логике взаимодействия, компромисса, договора. В ней нет места понятиям «главный» и «подчиненный», ибо любые роли в ней являются условными и временными. Как отмечал Э. Геллнер, в гражданском обществе «совершенно неясно, кто начальник» [Геллнер, 2004, с. 216].

Таким образом, логики бытия двух этих сфер принципиально различны, едва ли не противоположны. А подобное различие логик приводит к тому, что коммуникация между этими сферами становится крайне затруднительной.

А ведь речь здесь идет об идеальной модели, в которой не учитываются ни индивидуальные пороки составляющих политическую систему личностей (которые в реальности часто пользуются властью для достижения личных благ, а не системной цели общего блага), ни возможность подмены переговоров насилием.



Вывод: трудности в коммуникации и взаимодействии политической и неполитической подсистем социальной системы являются не временными и исторически обусловленными, но сущностными и непреодолимыми в рамках известного нам мира.

Вместе с тем очевидно, что политическое и «неполитическое»<sup>1</sup> суть две части одного целого, которые не в состоянии существовать одна без другой, и они вынуждены не только сосуществовать рядом, но и как-то коммуницировать. Ликвидировать государство не представляется возможным (все подобные попытки потерпели полный провал), более того, его значение в современном мире все возрастает. Политическая сфера призвана регулировать деятельность неполитической, она дает ей законы, суд, защиту от внешнего врага и от внутренних преступников. Неполитическая сфера «кормит» политическую. Старинная метафора о голове и ногах вполне адекватно отражает суть их общения. Можно предложить и другую, новую метафору – с конем и жокеем. Но суть здесь одна – две части социума, основанные на принципиально различных логиках, неразрывно связаны и не могут существовать одна без другой – и это неизбежно порождает напряженность и парадоксальность в отношениях между ними. На протяжении большей части истории цивилизации вопрос коммуникации двух сфер решался разными способами, но все они сводились, в общем, к одному: вытеснению неполитического на периферию социальной системы. Неполитическое отнюдь не было уничтожено, так как это невозможно, но презентировалось как не имеющее самостоятельной ценности. И то, что история политической власти, по меткому замечанию К. Поппера, стала подноситься как синоним истории человечества [Поппер, 1992, с. 311], вовсе не является плодом чьего-то злого умысла, – это естественное следствие сложившейся ситуации. Христианство автономизировало духовную сферу и тем самым нанесло сильный удар по абсолютному доминированию политического, но сращение Церкви с государственными институтами после эдикта Феодосия 380 г. привело к восстановлению традиционного отношения двух сфер.

В специфических условиях протестантской Европы неполитическая сфера смогла выйти из-под господства политики и занять самостоятельное место. Эта революция, не имевшая прецедентов в истории [Геллнер, 2004, с. 87], и породила современный экономический и политический строй, который мы знаем и подразумеваем сегодня, говоря о «модернизации» [Андреев, 2010, с. 298]. Тогда появилась возможность институализировать коммуникацию политического и неполитического с обеих сторон. Так появились органичные институты

---

<sup>1</sup> Можно называть это «жизненный мир», по Ю. Хабермасу.

влияния неполитического (гражданского) сообщества на политическую сферу: свободные выборы, гражданский контроль, независимый суд, автономное (т.е. не зависящее от воли политической власти) гуманитарное право и т.п. Это не разрешило фундаментального противоречия, заложенного в самой природе двух сфер социума, но заметно облегчило существование неполитической сферы и, высвободив заложенный в ней потенциал, дало возможность быстрого социально-экономического развития, основанного на технических и социальных инновациях.

Можно с достаточной уверенностью утверждать, что эта модель вполне адекватна исследовательским проблемам, стоящим перед современной политологией. Кроме того, она предлагает достаточно ясный критерий «современности» политической системы: уровень влияния гражданского на политическое через публичные, легальные институты, и это не обязательно должны быть выборы и политические партии. Чем выше уровень институализации и публичности такого влияния – тем более «современной» может считаться политическая система. Этот критерий представляется гораздо более удобным для оценки качества политических систем, чем туманные индексы «демократичности».

## **Значение для России. Исследовательские перспективы**

Если применить описанную выше модель к ситуации современной России, можно видеть, что основное направление политических исследований следует скорректировать. С нашей точки зрения, никак нельзя согласиться с мнением, что демократия в России «не удалась» или же что она «невозможна» в силу культурной специфики или мистических причин. Но, тем не менее, мы видим, что отчуждение общества и власти весьма велико – связь между «головой» и «ногами» нарушена. И многочисленные социологические опросы, фиксирующие низкий уровень доверия политическим институтам, это подтверждают (см.: [Рейтинг одобрения и доверия, 2011]).

Это порождает опасную ситуацию – сущностное отчуждение двух сфер в России не преодолевается, но даже усугубляется. И решать эту проблему необходимо, причем как можно скорее.

Для политологии это означает, что нужно переместить внимание от избирательной и партийной систем к изучению коммуникационных институтов. Для нас представляет интерес не то, какими формальными признаками характеризуются институты воздействия власти на общество и общества на власть,

но то, как они реально действуют. Действительно ли у нас как в традиционной системе нет иных каналов общественного влияния, кроме коррупционных? Какие из легальных и публичных институтов работают (или теоретически могли бы работать) как эффективные коммуникационные каналы? В этом смысле и роль партийной системы может быть переосмыслена. Так, «Единая Россия» не является политической партией с точки зрения классической теории. Но является ли она коммуникационным институтом? Может ли гражданин добиться каких-то позитивных изменений, «достучаться» до власти через аппарат «ЕР»? Может быть, это эффективнее, чем обращаться напрямую в органы государственной власти. Тот же самый вопрос можно задать и в отношении других, так называемых системных политических партий, общественных палат, различных некоммерческих организаций (как существующих «при власти», так и независимых), СМИ и других институтов.

В рамках предложенной методологии, центральной исследовательской проблемой становится именно качество коммуникации «власть – общество – власть».

Значит, на уровне высокого теоретизирования требуются: дальнейшая разработка «двухчастной» модели и создание определений «политики» и «политического процесса», не исходящих из борьбы за власть как основания.

На уровне фундаментальных исследований основное исследовательское внимание следует сосредоточить на изучении таких институтов, как обращения граждан, общественные палаты и советы, общественные приемные, некоммерческие организации и т.п.

В области прикладных разработок главное внимание нужно направить на использование существующих и конструирование новых коммуникационных институтов для продвижения интересов граждан. Кроме того, следует обратить самое пристальное внимание на трансляцию достижений академической политологии в публичное пространство, искать общий язык с активом гражданских движений, для которого обновленная политология может быть полезной и интересной.

Все это в близком будущем должно стать одним из основных направлений политологических исследований. Вероятно, именно на этом пути и можно найти вожделенный выход из идейного кризиса, в котором находится сейчас наша наука. Тогда политология может быть востребована и экономикой, и государственным управлением, и у политики появится возможность стать по-настоящему «умной».

## Литература

*Акиндинова Н.В., Алексащенко С.В., Ясин Е.Г.* Сценарии и альтернативы макроэкономической политики. М.: Изд. дом ВШЭ, 2011.

*Андреев А.Л.* Приемлем ли для России западный путь модернизации? // Готово ли российское общество к модернизации / под ред. М.К. Горшкова, Р. Крумма, Н.Е. Тихоновой. М.: Весь мир, 2010.

*Аристотель.* Политика. Афинская полития. М.: Мысль, 1998.

*Галкин А.А.* Индивид, общество и структуры власти // Размышления о политике и политической науке. М.: ИСП РАН, 2004.

*Геллнер Э.* Условия свободы. Гражданское общество и его исторические соперники / пер. с англ. М.: МШПИ, 2004.

*Джесксон Д.И.* Политическая методология: общие проблемы // Политическая наука: новые направления / под ред. Р. Гудина, Х.Д. Клингеманна; пер. с англ. М., 1999.

*Козн Д.Л., Арато Э.* Гражданское общество и политическая теория / пер. с англ. М.: Весь мир, 2003.

*Поппер К.Р.* Открытое общество и его враги / пер. с англ. Т. II. М., 1992.

Рейтинг одобрения и доверия. Март 2011. (<http://www.levada.ru/press/2011032401.html>)

Роль семьи в консолидации российского общества / Козырева П.М., Гурко Т.А., Воронин Г.Л. и др. // Социальные факторы консолидации российского общества: социологическое измерение / под ред. М.К. Горшкова. М.: Новый хронограф, 2010.

*Соловьев А.И.* Политология: политическая теория, политические технологии. М.: Аспект-пресс, 2001.

И.И. Солодова  
Национальный  
исследовательский  
университет  
«Высшая школа  
экономики»

# **ПОТЕНЦИАЛ КОРПОРАТИВНОЙ БЛАГОТВОРИТЕЛЬНОСТИ В РАЗВИТИИ МЕСТНЫХ СООБЩЕСТВ: СУЩЕСТВУЮЩИЕ ОГРАНИЧЕНИЯ**

---

В России активно развивается корпоративная благотворительность, явление приобретает большие масштабы и становится социально значимым. Практически каждая крупная бизнес-организация имеет программы корпоративной благотворительности, средний и малый бизнес также занимаются благотворительностью, но в меньших масштабах. Для эффективной деятельности корпоративной благотворительности в решении социальных проблем местного сообщества необходимо межсекторное партнерство. Логично, если партнерами в этом будут выступать некоммерческие организации (НКО). Однако пока в России они не выполняют данной роли, НКО развиваются как простые благополучатели и посредники денежной благотворительности бизнеса. Практически не растет потенциал НКО как институционального партнера корпоративной благотворительности. Это связано с системными ограничениями на макро-, мезо- и микроуровнях, которым и будет посвящена статья. Будут обозначены сетевые взаимодействия корпоративных доноров, наличие и характеристики донорского сообщества.

С одной стороны, деятельности НКО не доверяет значительная доля россиян (каждый четвертый), социальная база этого сектора относительно слаба – в деятельности НКО участвуют лишь 18% россиян, а вклад НКО в решение социальных задач территории низко оценивают больше половины опрошенных. С другой – существуют серьезные институциональные барьеры партнерской деятельности корпоративных благотворителей и НКО, среди них: небольшая доля работающих НКО (38% от зарегистрированных); слабость материальной базы НКО (это значимо для 60% российских НКО); слабая роль НКО как посредника денежной частной благотворительности (через НКО жертвует деньги только каждый десятый), а также незначительная интенсивность и качество

сетевых взаимодействий с корпоративными донорами. Барьерами со стороны НКО являются дефицит квалифицированных специалистов, недостаточно высокий уровень финансовой и управленческой грамотности для сотрудничества с бизнесом. Российские НКО пока еще не нарастили необходимого институционального и квалификационного потенциала для того, чтобы выступать партнерами в планировании и реализации корпоративных благотворительных программ и, таким образом, повышать их эффективность. Эти аспекты будут подробно освещены в статье.

Эмпирической базой работы являются результаты исследований Центра исследований гражданского общества и некоммерческого сектора<sup>1</sup>.

## **Ошибки микроуровня: отдельный индивид**

*Дефицит доверия.* Данные Центра исследований гражданского общества и некоммерческого сектора показали, что большая часть россиян (37%) оказывают материальную поддержку нуждающимся в одиночку, не полагаясь на общественные или государственные организации. Всего 1% респондентов указали на наличие каких-либо благотворительных организаций, которым они доверили роль посредников между собой и нуждающимися в помощи людям. Когда речь идет об оказании помощи в более широком смысле – деньгами, вещами, личным участием, – доля готовых действовать лично еще больше и составляет 46%. Фактически, никакие организации – ни государственные, ни российский, ни зарубежные – не воспринимаются населением в качестве посредников благотворительной деятельности<sup>2</sup>.

Исследования фиксируют недостаточно высокий уровень доверия граждан нашей страны к благотворительным организациям. Лишь половина респондентов (53%) полагают, что большинству российских благотворительных организаций можно доверять. Примерно четверть (24%) придерживаются противоположного мнения. Очень высока доля (23%) затруднившихся ответить на вопрос о доверии к благотворительным организациям, что практически равнозначно наличию существенных сомнений у респондента в том, заслуживают ли благотворительные организации его личного доверия.

---

<sup>1</sup> Исследование «Донорское сообщество в России», выполненное в 2009 г. в рамках качественной методологии. Мегаопрос населения по технологии Георейтина, проведенный совместно с ФОМ в 2009 г., выборка составляла 41500 респондентов. Подробнее см.: Потенциал и пути развития филантропии в России / под ред. И.В. Мерсияновой, Л.И. Яковсона. М.: Изд. дом ГУ ВШЭ, 2010. Гл. 6, 7, 9.

<sup>2</sup> Там же. С. 37.

*Отсутствие личного опыта участия в деятельности благотворительных организаций.* Не более 3% респондентов опросов помогали благотворительным организациям деньгами или вещами, лишь 1% декларировал личное участие в мероприятиях благотворительных организаций или фондов. Свое участие в НКО в качестве добровольцев декларировали 3% россиян. Личный опыт участия в работе благотворительных организаций – наиболее эффективный инструмент информирования и повышения доверия. Его отсутствие затрудняет формирование положительных установок по отношению к благотворительности.

*Недостаточная информированность населения о деятельности благотворительных организаций.* Согласно данным всероссийских опросов населения лишь каждый третий россиянин (32%) знает или хотя бы слышал об организациях, оказывающих помощь нуждающимся (детские приюты, помощь бездомным, жертвам насилия и др.). Еще меньше людей (19%) знают о благотворительных фондах, выделяющих средства на решение различных проблем. Прослеживается прямая зависимость между уровнем информированности и уровнем доверия к благотворительным организациям. Например, уровень доверия к благотворительным организациям выше среди москвичей и жителей мегаполисов, уровень информированности которых составляет соответственно 77 и 56%.

*Сомнения в истинных целях российских благотворительных организаций.* В суждениях респондентов об истинных целях благотворительных организаций преобладают негативные оценки. Лишь 17% граждан полагают, что в большинстве своем благотворительные организации бескорыстно ведут свою деятельность; 40% считают, что большинство организаций занимаются благотворительностью, чтобы добиться популярности; почти столько же (38%) думают, что основная задача благотворительных организаций – прикрыть коррупционные связи с чиновниками (38%), либо недобросовестный бизнес (37%).

## **Ошибки мезоуровня: субъекты благотворительности**

*Ошибки в поле корпоративной благотворительности.* Говоря об ошибках корпоративной благотворительности, мы прежде всего имеем в виду те ее особенности, которые ограничивают результативность, отдачу от благотворительных средств. Если обобщать, то системные ошибки приводят к тому, что вместо комплексного решения социальных проблем корпоративная благотворительность направляется на точечное решение проблем, носит несистематический и стихийный характер.

Корпоративная филантропия понимается как использование ресурсов компании для оказания помощи нуждающимся или для решения конкретных социальных проблем на территории присутствия, что не относится к основному бизнесу компаний<sup>3</sup>. Корпоративная благотворительность определяется двумя основными типам реализации: альтруистическим и стратегическим<sup>4</sup>. Стратегический признан как наиболее полно обеспечивающий эффективность корпоративной благотворительной деятельности<sup>5</sup>.

Распространенность стратегического подхода (характерно для крупного бизнеса) в отечественном управлении корпоративной благотворительностью существенно ниже, чем альтруистического (характерно для малого и среднего бизнеса)<sup>6</sup>. Рядом компаний были найдены новые формы решения социальных проблем местного сообщества, благодаря которым «бизнесу удалось перейти от функции “большого кошелька” к функциям инициатора новых форм взаимодействия с властью и местным сообществом, системно организовывать и управлять благотворительными программами для помощи территории присутствия». Схематично особенности каждого из подходов в отечественных компаниях можно обозначить следующим образом.

<p>Малый и средний бизнес</p>	<ul style="list-style-type: none"> <li>• нерегулярное оказание помощи, финансирование проектов по запросам, адресная текущая помощь;</li> <li>• слабо развиты упреждающие программы и принципы ранней профилактики социальных проблем;</li> <li>• преимущественно материальная помощь нуждающимся – ограниченное использование новых форм, в том числе корпоративного волонтерства;</li> <li>• неразвито внутри- и межсекторное партнерство; слабо привлекаются НКО как институциональные посредники благотворительности;</li> <li>• недостаточная развитость управленческого и финансового менеджмента</li> </ul>
-------------------------------	--

<sup>3</sup> *Frame B.* Corporate Social Responsibility: A Challenge for the Donor Community // *Development in Practice*. 2005. Vol. 15. № 3–4.

<sup>4</sup> *Dennis B.S., Buchholtz A., Butts M.M.* The Nature of Giving: A Theory of Planned Behavior Examination of Corporate Philanthropy // *Business Society*. 2009. Vol. 48. P. 362.

<sup>5</sup> См., например: *Saia D.H., Carroll A.B., Buchholtz A.K.* Philanthropy As Strategy: When Corporate Charity Begins at Home // *Business and Society*. 2003. Vol. 42. P. 185. Цит по: *Campbell D., Slack R.* Some Insights from Voluntary Disclosures in Annual Reports Corporate «Philanthropy Strategy» and «Strategic Philanthropy» // *Business and Society*. 2008. Vol. 47. P. 198.

<sup>6</sup> См., например: Потенциал и пути развития филантропии в России. С. 283–350; Бизнес как субъект социальной политики: должник, благодетель, партнер? / А.Е. Чирикова, Н.Ю. Лапина, Л.С. Шилова и др.; Независимый институт социальной политики. М.: ГУ ВШЭ, 2005; Развитие социально ответственной практики: аналитический обзор корпоративных нефинансовых отчетов, 2006–2007 годы выпуска. Аналитический обзор / А. Аленичева, Е. Феоктистова, Ф. Прокопов и др. М.: РСПП, 2008. С. 65.



<p>Крупный бизнес</p>	<ul style="list-style-type: none"> <li>• согласованность со стратегическими целями компании;</li> <li>• структурирование благотворительной деятельности организации по программному или проектному принципам, направление на социальную инфраструктуру и предупреждение развития социальных проблем;</li> <li>• долгосрочный характер реализации программ;</li> <li>• выбор адекватных механизмов и форм реализации программ, в том числе корпоративных фондов; программно-конкурсного подхода, волонтерства;</li> <li>• практика внутри- и межсекторного партнерства, привлечение НКО;</li> <li>• профессионализация управления благотворительностью, создание отдельных позиций и отделов</li> </ul>
-----------------------	--

В первом случае это просто качественное управление, цели, задачи и т.д., во втором – встраивание благотворительной деятельности в цели компании, в стратегию развития как элемента, способствующего достижению бизнес-задач. Стратегия благотворительности может существовать без стратегической благотворительности, но не наоборот. В этом плане в российских компаниях, даже крупных, есть основания говорить о стратегии благотворительности, но не о стратегической благотворительности. Вместе с тем это уже является позитивной тенденцией, повышением качества управления процессом и повышением итоговой эффективности.

Однако даже в целом пока преждевременно говорить о существовании и распространенности стратегического подхода к реализации корпоративной благотворительности<sup>7</sup>. Наибольшее распространение имеют корпоративные инициативы и программы, характеризующиеся точечным решением отдельных задач, исправлением «огрехов» государственной социальной политики, отсутствием системного подхода в распределении усилий<sup>8</sup>.

*Сетевые взаимодействия корпоративных благотворителей.* Западные исследователи гражданского общества обеспокоены ограниченной эффективностью организационной схемы, по которой работает большинство корпоративных филантропов и некоммерческих организаций: «Сектор должен разработать и внедрить новую парадигму жизнедеятельности». Исследователи видят решение и потенциал повышения эффективности работы во внедрении принципов социальных сетей и межсекторного партнерства как организационных основ. Для изу-

<sup>7</sup> См., например: Потенциал и пути развития филантропии в России. С. 283–350; Бизнес как субъект социальной политики: должник, благодетель, партнер?; Развитие социально ответственной практики: аналитический обзор корпоративных нефинансовых отчетов, 2006–2007 годы выпуска. С. 65.

<sup>8</sup> Горшков М.К., Лебедев А.Е. Крупный российский бизнес: социальная роль и социальная ответственность (позиция населения и оценки экспертов). М.: Национальный инвестиционный совет; Институт комплексных социальных исследований, 2005.

чения гражданского общества, по мнению ряда исследователей, подходящим является понимание социальных сетей как создаваемых для достижения целей, разделяемых всеми участниками. Социальные сети являются основаниями для формирования социальных сообществ, члены которых имеют объединяющую характеристику. Обращает на себя внимание объем публикаций об эффективности социальных сетей как организационного принципа, на основе которого выстраивается деятельность организаций в некоммерческой сфере. Например, по словам Дж. Пратта, «сетевые стратегии деятельности предлагают набор эффективных инструментов управления и решения задач, с которыми сталкиваются организации некоммерческого сектора. Сетевое мышление является стратегическим инструментом для повышения стабильности и социального авторитета, а также независимости организаций сектора».

Были исследованы ключевые признаки социального сообщества – донорского сообщества как технологии повышения эффективности корпоративной благотворительности<sup>9</sup>. Сделан вывод об отсутствии сформированного донорского сообщества среди региональных коммерческих компаний среднего и малого бизнеса. Крупные региональные компании также не всегда включены в сетевые взаимодействия. Это свидетельствует о неразвитости процессов формирования собственной идентичности (см., например, классические социальные теории Дж. Мида, З. Баумана и др.) у корпоративных благотворителей и воспроизводства данного статуса в сообществе. Основные характеристики донорского сообщества, доказывающие его неразвитость, следующие:

- понимание благотворительности – непубличное, частное действие, индивидуальная альтруистическая инициатива;
- взаимное знание доноров в одном муниципальном образовании довольно низкое. Корпоративные доноры взаимодействуют по различным вопросам, но не связанным с их благотворительной деятельностью;
- горизонтальные коммуникации как корпоративных доноров слабо развиты;
- координирующий центр практически отсутствует. Чаще всего это роль органов власти на местном уровне;
- совместные благотворительные проекты распространены незначительно. В ряде случаев НКО объединяют ресурсы доноров для решения конкретной проблемы.

---

<sup>9</sup> В рамках качественного исследования донорского сообщества, проведенного автором в 2009 г. Подробнее результаты см.: Мерсиянова И.В., Солодова И.И. Корпоративная благотворительность в России и проблемы формирования донорского сообщества // Потенциал и пути развития филантропии в России. Гл. 9. С. 293–350.

*Недостаток узкоспециализированных специалистов в НКО.* Деятельность некоммерческих и благотворительных организаций достаточно часто имеет простую организацию и не требует специального обучения или профессиональных навыков. Это является следствием нескольких взаимосвязанных причин (обозначим только несколько для примера):

- простота проектов в силу недостатка финансирования и недостаточного опыта сектора в целом;
- недостаток квалифицированных кадров для управления организацией (маркетологи, пиар-специалисты, фандрайзеры) и для выполнения конкретных проектов (специалисты с медицинским, педагогическим, юридическим образованием и т.д.);
- недостаточный спрос на услуги НКО, отсутствие запросов на «сложные» проекты.

*Недостаточный уровень финансовой и управленческой грамотности НКО.* Некоммерческие и благотворительные организации часто не придают особой значимости управлению проектной деятельностью, правилам отчетности и фандрайзинга. Например, в большинстве действующих фондов местного сообщества оценка деятельности организации проводится своими силами, при этом опрошенные затруднились назвать конкретные действия по результатам этой оценки. Организационная стратегия также не имеет определяющей силы, часто ее разработка является формальной процедурой<sup>10</sup>. Фандрайзингу во многих НКО присущи следующие недостатки.

- Несоблюдение конкурсных процедур. Еще не все некоммерческие организации привыкли к механизму конкурсного отбора, не соблюдают формальные требования и процедуры. В ряде случаев соискатели благотворительной помощи предпочитают добиваться получения финансовых ресурсов с помощью сбора писем от различных административных органов или влиятельных лиц, вместо того чтобы грамотно подготовить заявку в соответствии с опубликованными условиями конкурса. В большей степени это характерно для муниципальных учреждений и органов власти.
- Несоблюдение правил/требований проектной работы. Ряд некоммерческих организаций не обладают опытом и квалификацией, достаточной для грамотного написания отчетов по конкурсным проектам – многие НКО не освоили в достаточной мере проектно-конкурсные формы работы.

---

<sup>10</sup> Мерсиянова И.В., Солодова И.С. Фонды местных сообществ в России. М.: Изд. дом ГУ ВШЭ, 2009.

- Небольшое разнообразие предлагаемых на конкурс проектов. В ряде случаев доноры не получают достаточного количества разнообразных заявок, вынуждены поддерживать менее интересные проекты, чем рассчитывали.

- Незрелость процедур оценки проектов в организации, а также недостаток организаций, оказывающих профессиональные услуги в сфере аудита некоммерческих проектов и организаций-соискателей благотворительной поддержки. Пренебрежение анализом потребностей и мониторингом результатов финансирования нередко ведет к отсутствию ожидаемых улучшений в положении получателей помощи.

Не менее значимым ограничивающим фактором для корпоративных доноров является недостаточное внимание к стратегическим целям компании, специфике бизнеса и целевым аудиториям со стороны НКО. Для корпоративных благотворителей, особенно крупных компаний с развитым менеджментом благотворительности, любая программа должна сочетаться и учитывать специфику и характер бизнес-задач компании.

## **Ошибки макроуровня: слабость НКО как ключевого института благотворительности**

Благотворительная деятельность в России сегодня недостаточно институционализована. Это выражается в следующих показателях.

*Взаимодействие корпоративных доноров с НКО.* В логике межсекторного партнерства при реализации благотворительной деятельности для решения социальных задач на территории действуют организации и инициативы третьего сектора. Они имеют потенциал взаимодействия с корпоративными благотворителями для совместной реализации социальных программ. Вместе с тем на практике преждевременно говорить о тесном сотрудничестве, межсекторное партнерство корпоративных доноров с некоммерческими организациями развито достаточно слабо.

На практике большинство НКО вовлечено в достаточно ограниченный набор взаимодействий с корпоративными донорами. С коммерческими структурами и предпринимателями взаимодействуют 49% НКО<sup>11</sup>.

Как видно на рис. 1, сравнительно небольшие доли НКО сотрудничают с коммерческими донорами для реализации совместной программы или благо-

---

<sup>11</sup> Результаты всероссийского обследования НКО в рамках мониторинга состояния гражданского общества ГУ ВШЭ (2009).

творительной акции – 15% некоммерческих организаций оказывают услуги коммерческим структурам. Из всех взаимодействующих с бизнесом НКО каждая третья организация проводит совместные акции с коммерческими структурами. При этом для большинства организаций сотрудничество с корпоративными донорами носит односторонний характер – 37 и 51% НКО получают благотворительные пожертвования от коммерческих структур в натуральной и денежной формах соответственно.



**Рис. 1.** Формы взаимодействия НКО с коммерческими компаниями (% от числа опрошенных)

Чаще всего взаимодействие, по словам опрошенных доноров, является нерегулярным, происходит 1–2 раза в год и касается предоставления информационно-справочных услуг со стороны НКО, помощи в выборе получателя благотворительной помощи.

*Количество НКО.* По данным Центра исследований гражданского общества и некоммерческого сектора, в 2009 г. было зарегистрировано 358689 некоммерческих организаций. Из них реально действующими оказалось 38% – 136302 организации. Для сравнения отметим, что в США действует свыше 1 млн только благотворительных НКО, численность благотворительных фондов составляет 72 тыс.<sup>12</sup>

<sup>12</sup> Источник данных по США: National Philanthropic Trust: Philanthropy Statistics. National Philanthropic Trust. ([http://www.nptrust.org/philanthropy/philanthropy\\_stats.asp](http://www.nptrust.org/philanthropy/philanthropy_stats.asp))

*Институциональная устойчивость некоммерческих и благотворительных организаций.* Негосударственные некоммерческие организации образуют институциональную инфраструктуру гражданского общества, представляют собой его организационный стержень. Большинство НКО не в полной мере ощущают себя устойчиво функционирующими организациями. Обращает на себя внимание слабость материальной базы благотворительных и иных некоммерческих организаций. Почти 60% руководителей НКО отметили в числе основных проблем функционирования своих организаций недостаток денег, материальных средств<sup>13</sup>. В пятерку наиболее значимых проблем попали также отсутствие поддержки, интереса со стороны местных властей (33% ответов), отсутствие поддержки, интереса со стороны возможных спонсоров, бизнес-структур (26%), отсутствие поддержки, интереса со стороны региональных властей (19%) и проблемы с помещением (17%). Нетрудно заметить, что все пять ключевых проблем функционирования организаций, наиболее беспокоящих руководителей российских НКО, касаются слабого материального обеспечения организаций.

*Ограниченное разнообразие типов НКО.* Характерной особенностью современных систем благотворительности в странах с устойчивыми традициями филантропической деятельности является наличие многих типов организаций, выполняющих вспомогательные функции. Такие организации способствуют повышению эффективности работы ключевых благотворительных институтов, таких как благотворительные фонды и благотворительные организации, непосредственно оказывающие помощь нуждающимся людям.

В России сегодня инфраструктурные элементы системы благотворительности либо полностью отсутствуют, либо находятся на самых начальных этапах развития. В частности, это касается нехватки в России благотворительных фондов, которые располагали бы собственными целевыми капиталами, сопоставимыми по размерам с целевыми капиталами аналогичных зарубежных фондов, нехватки организаций, систематически ведущих сбор благотворительных пожертвований среди физических и юридических лиц. Особенно это справедливо для организаций, специализирующихся в сфере информационной поддержки благотворительности, в том числе ведущих сбор и распространение информации о доступных благотворительных ресурсах, о потребностях в благотворительной поддержке, о лучших практиках в сфере благотворительной деятельности; для организаций, специализирующихся на развитии сетевых от-

---

<sup>13</sup> Данные социологического опроса руководителей НКО, проведенного ГУ ВШЭ в рамках мониторинга состояния гражданского общества в 2007 г. Было обследовано 1057 организаций по всероссийской репрезентативной выборке. Респондентам предлагалось выбрать не более пяти наиболее подходящих вариантов ответов.

ношений, «внутрисекторного» взаимодействия, а также на «межсекторном» взаимодействии благотворительных организаций с иными общественными организациями и структурами, органами власти, бизнесом. Слабое развитие характерно и для такого сегмента инфраструктуры благотворительности, как организации образования и просвещения по вопросам благотворительности, и организации, предоставляющие прочие сервисные услуги, такие как проектный аудит, аудит организаций – соискателей благотворительной поддержки, юридическую помощь и др. Перечисленные здесь слабости развития инфраструктуры благотворительной деятельности являются одной из существенных причин недоиспользования российского потенциала благотворительности, медленного становления «массовой» благотворительности, а также межсекторного партнерства НКО с коммерческими компаниями.

## Введение

Проблемы дорожного движения в России, знакомые с исторических времен и вошедшие в классическую литературу и фольклор, значительно обострились в последние годы. Основными признаками неблагополучия на дорогах страны являются пробки и аварии. Для решения этих проблем предлагаются преимущественно технические и административные меры, такие как расширение дорожной сети, ужесточение контроля над соблюдением правил дорожного движения, строительство автостоянок, ограничение проезда и пр. Предметом исследования в настоящей работе является роль «человеческого фактора» в возникновении и возможном решении дорожных проблем. Основной задачей является анализ связи положения дел на дорогах российских городов с нормами и ценностями населения, составляющими *социальный капитал*.

Целью исследования является эмпирическая проверка гипотезы о влиянии социального капитала на положение дел на дорогах. Проверка этой гипотезы представляет интерес, поскольку позволяет пролить свет на проблемы, связанные с дорожным движением, а также вносит вклад в литературу о социальном капитале. Важным представляется не просто установление факта влияния социального капитала на положение дел на дорогах, но и определение механизмов и каналов, через которые оно распространяется. Рассматриваются два потенциальных канала: горизонтальный и вертикальный. В первом случае (горизонтальный канал) каждодневное поведение водителей и пешеходов непосредственно влияет на положение дел на дорогах. Предположительно сознательность, взаимное уважение участников дорожного движения, соблюдение правил непосредственно влияют на дорожную ситуацию. Чем «культурнее» люди ведут себя на дорогах, тем меньше пробки и аварийность. Во втором случае (вертикальный канал) основой «передаточного механизма» является гражданская активность населения, от которой зависит подотчетность и эффективность власти, а тем самым содержание дорог, качество городского и дорожного планирования, работа надзорных и милицейских служб и пр.



Эмпирической основой исследования являются материалы опроса автомобилистов в двадцати крупных городах России, проведенного нами в 2010 г. совместно с компанией «Маркетдейта». В данной работе основные результаты и гипотезы исследования представлены в сокращенной, схематичной форме.

## 1. Социальный капитал

Существует множество определений социального капитала. В данной работе используется следующее определение.

*Социальный капитал – это нормы, ценности и сети, способствующие самоорганизации и кооперации людей для повышения общественного благосостояния.*

Во многих исследованиях устанавливается связь социального капитала с уровнем экономического развития [Knack, Keefer, 1997], качеством бюрократии [Knack; 2002], состоянием здоровья [Bolin et al., 2003] и т.д.

Однако вопрос о том, каковы каналы этого влияния, остается открытым.

Социальный капитал обычно оценивается по следующим сведениям:

- членство в формальных и неформальных группах [Putnam, Leonardi Nanetti, 1993];
- доверие<sup>1</sup> [Knack, Keefer 1997];
- толерантность, уважение к окружающим [Tabellini, 2008].

Литературы, связывающей социальный капитал и положение дел на дорогах, на данный момент нам практически не известно.

## 2. Дорожная сеть: предложение и использование

Дорожную сеть можно рассматривать как со стороны спроса (использования ее водителями), так и со стороны предложения (предоставления инфраструктуры государством). Опишем, каким образом социальный капитал может оказать воздействие и на то, и на другое.

### 2.1. Государство, общество и дорожная сеть

Дороги являются элементом инфраструктуры и как таковые представляют собой общественное благо<sup>2</sup>. Предоставлением общественных благ ведает госу-

---

<sup>1</sup> Доверие незнакомым членам общества, а не только близким друзьям и семье.

<sup>2</sup> Точнее следовало бы говорить об общественном благе «с переполнением» (*congestable public good*), когда чрезмерно большое число пользователей начинают создавать помехи друг другу в виде пробок.

дарство, которое отвечает за строительство и эксплуатацию дорог и прочих элементов дорожной сети, ремонт и очистку дорожного покрытия, планирование строительства развязок и новых домов, контроль ГИБДД за соблюдением правил и т.п.

Государство заинтересовано в предоставлении общественного блага населению, если оно подотчетно. Государство подотчетно, если в зависимости от качества общественного блага избиратели решают, переизбирать ли им текущее правительство, организовывать ли акции протеста и обращаться ли в суд в случае нарушения своих прав.

Если правительство не подотчетно, то у него не только может не быть стимулов улучшать положение дел на дорогах, но и могут возникать стимулы максимизировать свое благосостояние за счет общественного. Если в экономике есть некоторая группа, занимающая доминирующее положение, то она может использовать свое влияние для того, чтобы сделать из общественного блага клубное. К клубному благу будут иметь доступ не все индивиды, а лишь члены данной группы. В результате повышается благосостояние группы, однако снижается благосостояние общества в целом [Olson, 1982]. Дороги можно рассматривать как клубное благо в случаях:

- наделения чиновников особыми правами при проезде (проблесковые маячки у чиновников, возможность остаться безнаказанным в случае нарушения правил). У неподотчетных властей нет стимулов принимать меры для снижения пробок, когда пробку всегда можно объехать с проблесковым маячком;
- строительства и поддержания дорог высокого качества не там, где нужно большей части населения, а там, где удобно чиновникам (пример: Рублево-Успенского шоссе).

Нормы, ценности и сети могут заложить основу гражданской культуры, обеспечивающей достаточно массовую политическую активность населения, способную заставить власти отказаться от соображений частной выгоды и действовать в общественных интересах.

## **2.2. Социальный капитал и поведение на дорогах**

Дороги можно рассматривать как ресурс открытого доступа (*commons*). Основная проблема, возникающая с ресурсами открытого доступа, – это их переиспользование [Ostrom et al., 1999]. Чем больше людей пользуются дорогами, тем выше пробки или интенсивность движения. Под использованием дорог

можно понимать не только то, сколько машин используют люди, но и то, как водители ведут себя на дороге. Переиспользование возникает из-за того, что каждый индивид, принимая решение об использовании ресурса, не учитывает негативные эффекты, которые оказывает этим на окружающих. Например, паркуясь в неполюженном месте, автомобилист увеличивает свое благосостояние (тем, что припарковался близко к нужному месту), однако в итоге снижает общественное благосостояние, поскольку перегораживает проезд, провоцирует пробки. Люди (водители) в процессе использования дорожной сети напрямую могут влиять на положение дел на дорогах. Государство также может способствовать кооперации индивидов. Как отмечают Остром и др. [Ostrom et al., 1999], государство, с одной стороны, может обеспечить индивидам возможность для кооперации и самоорганизации, а также ввести правила и обеспечить их выполнение. С другой стороны, чрезмерное вмешательство государства может снизить желание людей кооперироваться, поскольку у них будет создаваться иллюзия того, что государство все контролирует и от них ничего не зависит; при несовершенном принуждении к исполнению (*enforcement*) государство может разрушить кооперацию, возникшую в результате самоорганизации.

### 3. Эмпирический анализ

Гипотезы исследования о влиянии социального капитала на положение дел на дорогах тестируются на российских данных, полученных в результате опроса автомобилистов в городах России. Опрос был проведен летом 2010 г. в 20 городах России лабораторией ПриИСК НИУ ВШЭ и объединенным маркетинговым агентством «Маркетдейта». В каждом городе было опрошено по 80 автомобилистов. Если не сказано иного, то анализ данных проводится по усредненным данным на уровне города<sup>3</sup>. Это вызвано тем, что все интересные для данного исследования эффекты (культура поведения на дороге и подотчетность власти) предположительно проявляются именно на уровне города, а не на уровне отдельного индивида.

#### 3.1. Положение на дорогах

Базовая гипотеза исследования состоит в том, что социальный капитал влияет на положение дел на дорогах (аварийность и пробки). Интерес представляет не только факт этого влияния, но и канал, через который это влияние

---

<sup>3</sup> Индивидуальные ответы респондентов суммируются и делятся на число респондентов в городе, в итоге формируется агрегированный показатель для города.

осуществляется. Нами будут рассмотрены два потенциальных канала: горизонтальный (непосредственное влияние водителей на положение дел) и вертикальный (влияние водителей на власти, а уже через них на положение дел).

В качестве индикаторов *аварийности* используются три показателя. Первые два показателя из официальной статистики ГИБДД: количество ДТП на 10 тыс. транспортных средств и количество пострадавших в ДТП на 100 тыс. (на уровне регионов). Однако у ГИБДД есть стимулы исказить статистику. Поэтому мы используем еще один показатель аварийности – цену автомобильной страховки КАСКО<sup>4</sup>. КАСКО – страховка, компенсирующая ущерб, причиненный автомобилю страхователя. Рынок страхования автомобилей в России высоко конкурентный, поэтому можно утверждать, что цена страховки отражает реальные риски, с которыми сталкиваются автомобилисты на дорогах. КАСКО – рыночная оценка аварийности.

Показатель *пробок*, используемый в данной работе, рассчитывается на основе данных опроса. В опросе водителей просили оценить время, которое у них занимает проезд от дома до работы, в двух случаях: если пробки есть и если пробок нет<sup>5</sup>. Отношение этих оценок друг к другу и используется как показатель пробок.

### **3.2. Поведение на дороге (горизонтальный канал)**

Одна из гипотез данного исследования состоит в том, что люди непосредственно оказывают влияние на положение дел на дорогах. Взаимное уважение участников дорожного движения, учет интересов друг друга, соблюдение правил движения, оказание взаимной помощи предположительно способствуют улучшению положения дел на дорогах.

Поведение водителей на дороге (культура вождения) складывается из различных аспектов. В данном исследовании поведение на дороге оценивается исходя из того, что говорят автомобилисты о происходящем в своем городе. Респондентам описывались различные ситуации и варианты поведения и предлагалось «оценить из своего опыта, какая доля водителей поступит следующим образом». Водителям предлагались различные ситуации: от пропуска пешехода

---

<sup>4</sup> В данной работе используется цена страховки для машины «Renault Logan» 2010 г. выпуска, для водителя женщины возраста 25 лет со стажем вождения 5 лет по состоянию на август 2010 г.

<sup>5</sup> Вопрос «Оцените, пожалуйста, сколько времени в минутах у вас займет путь на машине от дома до работы в час пик/по пустой дороге».

на пешеходном переходе до объезда пробки по обочине. Вопрос задавался не о поведении самого респондента, а о поведении людей в городе. Следовательно, у респондентов нет стимулов искажать свои ответы, пытаться казаться более «культурными» на дорогах, чем они есть на самом деле. Для удобства дальнейшего анализа был проведен факторный анализ (см. табл. 1), позволивший объединить разные аспекты поведения на дороге в одну переменную. Чем этот показатель выше, тем «хуже» ведут себя люди на дороге. Показатель поведения на дороге можно рассматривать как индикатор социального капитала, поскольку ситуации типа объезда пробки по обочине или выезд на перекресток, на котором образовался затор, можно воспринимать как дилемму заключенного. Они отражают то, насколько люди предпочитают свои сиюминутные интересы общественным интересам безопасного и быстрого дорожного движения.

**Таблица 1.** Факторный анализ: поведение на дороге

Ситуации	Поведение на дороге
Пропустит того, кто хочет перестроиться	-0,42
Пропустит машину экстренных служб	-0,79
Пропустит пешехода на переходе	-0,46
Поблагодарит пропустившего сигналом аварийки или рукой	-0,03
Мигнет предупреждая о посте ГИБДД	0,1
Поможет вытащить застрявшую машину	-0,12
Поможет с ремонтом машины	-0,2
Проскочит на желтый или только что загоревшийся свет	0,9
Даст взятку сотруднику ГИБДД	0,85
Купит техосмотр	0,78
Припаркуется в неподобающем месте, мешая остальным участникам дорожного движения	0,89
Объедет пробку по обочине	0,85
Покинет место происшествия, если можно остаться незамеченным	0,87
Заедет на перекресток, на котором образовался затор	0,92

Поведение водителей довольно сильно варьируется от города к городу (см. рис. 1). Есть значительно более «культурные» по поведению города (например, Новосибирск) и значительно менее «культурные» (Ростов-на-Дону).

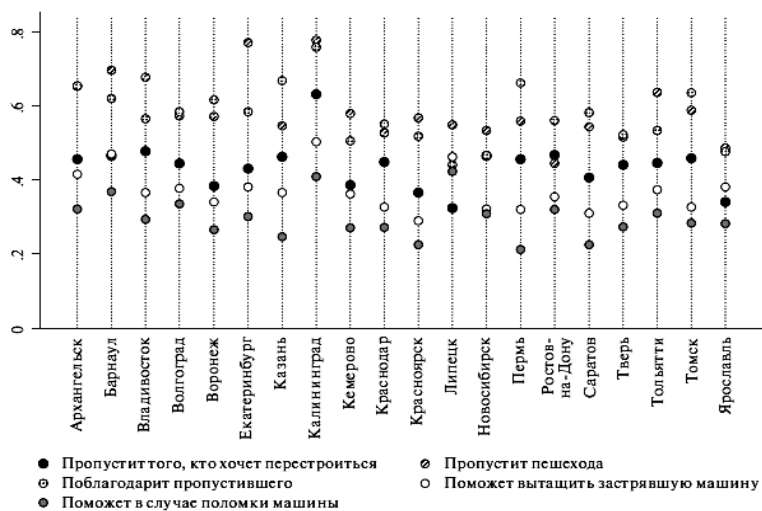


Рис. 1. Поведение водителей на дороге (по городам России)

### 3.3. Гражданская культура (вертикальный канал)

Люди могут влиять на положение дел на дорогах через взаимодействие с властями. Население может заставить власть учитывать свои интересы за счет: участия в выборах, участия в акциях протеста, готовности обращаться в суды (в случае нарушения их прав), участия в ассоциациях и т.п. Такое поведение делает власть более подотчетной, подталкивает ее к учету интересов населения в предоставлении общественных благ (своевременного ремонта дорог, качественной работы дорожных служб и ГИБДД, качественного городского планирования), что в свою очередь оказывает влияние на положение дел на дорогах.

В качестве индикаторов гражданской культуры в данном исследовании будут использоваться вопросы об:

- участия в выборах;
- членстве в автомобильных ассоциациях;
- участия в акциях протеста и его мотивации;
- готовности обращаться в суд в случае нарушения прав сотрудниками ГИБДД или дорожных служб.

### 3.4. Регрессионный анализ

Строятся регрессии зависимости положения дел на дорогах от социально-го капитала. Регрессии имеют следующий вид:

$$Road = \alpha + \beta_1 Horizontal + \beta_2 Vertical + \gamma_i control_i + \varepsilon_i.$$

Ситуация на дорогах: аварийность (КАСКО, статистика аварийности ГИБДД) и пробки объясняются через горизонтальный и вертикальный каналы социального капитала при контроле на различные переменные (количество машин в городе, экономическое развитие в регионе (депозиты в банках на душу населения), объем бюджетных средств на душу населения, долготы и широты и т.п.). Возможность для включения контрольных переменных крайне ограничена, поскольку анализ делается всего на 20 точках, поэтому контроли включаются в регрессии попеременно.

## 4. Результаты

### 4.1. Аварийность и горизонтальный канал

Анализ данных показал, что фактор поведения на дороге (показатель культуры вождения) оказывается высоко значимым для объяснения всех доступных показателей аварийности (КАСКО, число ДТП, число жертв ДТП). Значимость сохраняется при включении любых контрольных переменных (см. табл. 2, для КАСКО в качестве объясняемой переменной).

**Таблица 2.** КАСКО и горизонтальный и вертикальный каналы

Переменные	КАСКО							
	(1)	(2)	(3)	(4)	(5)	(6)	(7)	(8)
Поведение на дороге	3,139*** (848,6)	2,207*** (701,5)	2,354** (864,5)	3,166*** (884,8)	3,252*** (959,8)	3,019*** (829,8)	2,841** (980,0)	2,788*** (759,0)
Численность машин на 1000 жителей	-1,480 (9,128)	-0,736 (7,478)	7,265 (10,30)	-1,415 (9,241)	-1,401 (9,306)	-2,044 (9,265)	-0,697 (9,493)	4,238 (8,814)
Бюджетное финансирование на 1000 жителей	-0,178 (0,172)							
Объем депозитов на душу населения		0,408 (0,261)						
Долгота			-58,24 (37,27)					

Переменные	КАСКО							
	(1)	(2)	(3)	(4)	(5)	(6)	(7)	(8)
Год основания города				2,723 (3,204)				
Участие в выборах					-5,798 (7,810)			
Готовность обращаться в суд						-3,969 (4,170)		
Членство в автомобильных ассоциациях							-1,121 (11,068)	
Готовность участвовать в акциях протеста								6,145 <sup>*</sup> (3,234)
Constant	32,138 <sup>***</sup> (2,781)	26,895 <sup>***</sup> (3,089)	32,386 <sup>***</sup> (2,678)	26,930 <sup>***</sup> (5,527)	34,049 <sup>***</sup> (4,797)	39,369 <sup>***</sup> (9,097)	35,408 (42,915)	4,155 (14,366)
Observations	19	18	18	19	19	19	19	19
R-squared	0,478	0,494	0,522	0,466	0,460	0,472	0,441	0,549

## 4.2. Пробки и горизонтальный канал

Регрессионный анализ не выявил связи между пробками и поведением на дороге (см. табл. 3). Этот результат не представляется удивительным, поскольку, как отмечают теоретики транспортной науки и урбанисты, большинство мер по снижению пробок могут претворяться в жизнь только государством [Downs, 2004]. То, как люди используют дороги, не представляется важным (не может существенно снизить пробки), если физические возможности дорог, их содержание, планирование и развитие системы парковки находятся на очень низком уровне. В то же время оценка людьми качества работы дорожных служб и оценка качества и количества парковочных мест оказываются значимыми в объяснении пробок, что еще раз подтверждает тот факт, что местные власти могут влиять на положение дел на дорогах, однако, вероятно, делают это в недостаточных объемах. То есть для пробок потенциально более важен вертикальный канал социального капитала, чем горизонтальный.



Таблица 3.

Пробки и горизонтальный и вертикальный каналы

Переменные	Пробки					
	(1)	(2)	(3)	(4)	(5)	(6)
Поведение на дороге	0,0782 (0,0997)	0,0617 (0,0969)	0,139 (0,1000)	0,124 (0,0988)	0,109 (0,0880)	0,143 (0,0887)
Численность машин на 1000 жителей	0,00178 (0,00107)	0,00191* (0,00103)	0,000920 (0,00119)	0,00164 (0,00103)		
Бюджетное финансирование на 1000 жителей	3,49e-06 (2,02e-05)					-1,04e-05 (1,79e-05)
Объем депозитов на душу населения		-3,44e-05 (3,61e-05)			-2,81e-05 (3,22e-05)	
Долгота			0,00618 (0,00431)			
Год основания города				0,000404 (0,000358)		
Оценка качества городского планирования: наличие парковочных мест					-0,622** (0,229)	-0,675** (0,236)
Constant	2,208*** (0,327)	2,484*** (0,427)	2,088*** (0,310)	1,616** (0,617)	4,272*** (0,581)	4,191*** (0,537)
Observations	19	18	18	19	19	20
R-squared	0,185	0,234	0,291	0,247	0,365	0,368

Примечание. Стандартные ошибки в скобках. \*\*\*  $p < 0,01$ ; \*\*  $p < 0,05$ ; \*  $p < 0,1$ .

### 4.3. Вертикальный канал

Регрессионный анализ не выявляет связи между гражданской активностью населения и пробками или аварийностью. То есть не обнаруживается влияние социального капитала на положение на дорогах через вертикальный канал в городах России. Из этого можно сделать вывод о том, что горизонтальный канал не работает или что он не работает в России. Мы проверяем аналогичную гипотезу на данных по городам США. Выясняется, что электоральное поведение вносит значимый вклад в объяснение пробок в городах США. То есть можно предположить, что вертикальный канал работает в странах с более развитой

гражданской культурой. Наблюдавшийся же в последнее время рост политической активности вокруг проблем дорожного движения в российских городах недостаточен для того, чтобы оказать реальное воздействие на ситуацию на дорогах.

В целом можно заключить, что нормы и ценности населения оказываются значимым «нематериальным активом», от которого во многом зависит ситуация на дорогах страны.

Означает ли связь между аварийностью и поведением на дороге причинность? Проблема пропущенных переменных в данной работе несколько смягчается, поскольку объектом изучения являются города одной страны со схожими дорожными институтами, системой штрафов, структурой ГИБДД и т.п. Однако мы подробнее исследуем проблему эндогенности в более объемных текстах.

## Литература

*Bolin K., Nystedt P., Lindgren B.* Investments in Social Capital Implications of Social Interactions for the Production of Health // *Social Science & Medicine*. 2003. Vol. 56. Iss. 12. P. 2379–2390.

*Downs A.* Still Stuck in Traffic: Coping with Peak-hour Traffic Congestion. Washington D.C.: Brookings Institution Press, 2004.

*Knack S.* Social Capital and the Quality of Government: Evidence from the United States // *American Journal of Political Science*. 2002. Vol. 46. 40. P. 772–785.

*Knack S., Keefer Ph.* Does Social Capital Have an Economic Payoff? A Cross-Country Investigation // *Quarterly Journal of Economics*. 1997. P. 1251–1288.

*Olson M.* The Rise and Decline of Nations. Yale University Press, 1982.

*Ostrom E., Burger J., Field C. et al.* Revisiting the Commons: Local Lessons, Global Challenges // *Science*. 1999. 284, 278.

*Putnam R., Leonardi R., Nanetti R.* Making Democracy Work: Civic Traditions in Modern Italy. Princeton: Princeton University Press, 1993.

*Tabellini G.* Institutions and Culture // *Journal of the European Economic Association*. 2008. 6(2-3). P. 255–294.

## МОДЕЛИРОВАНИЕ СОЦИАЛЬНОГО КАПИТАЛА В ЖИЛИЩНОЙ САМООРГАНИЗАЦИИ

---

С целью определения степени текущей зрелости собственников многоквартирных домов, их готовности к ответственному управлению общим имуществом, а также выявления факторов и условий, способствующих формированию «эффективного собственника», в 2009 г. нами было проведено исследование поведения городских жителей в Ростове-на-Дону и Азове [Ермишина, Клименко, 2010]. Результаты исследования, включающего экономико-социологические методы, показали, что в настоящее время для основного большинства собственников жилья характерна скорее пассивная позиция и явно выраженная ориентация на перекладывание ответственности за состояние жилищной сферы на органы власти. Одним из факторов формирования модели «неэффективного» поведения у коллективных собственников в многоквартирных домах может быть низкий уровень социального капитала городских жителей. Проверке этой гипотезы и посвящено настоящее исследование.

В качестве рабочего определения нами была принята расширительная трактовка Джеймса Коулмена, согласно которой социальный капитал – это потенциал взаимного доверия и взаимопомощи, целерационально формируемый в межличностных отношениях: обязательства и ожидания, информационные каналы и социальные нормы [Coleman, 1990].

Собственники жилья в многоквартирном доме (МКД) представляют собой группу субъектов, объединенных общим интересом – обеспечением качественного и надежного получения услуг по содержанию общедомового имущества. Для реализации этих интересов требуется принятие коллективных решений. Чем выше уровень социального капитала в группе собственников, тем более эффективные коллективные решения принимаются и тем более существенные выгоды получает группа.

Цель настоящего исследования – определить модельный профиль социального капитала по месту жительства и выявить специфику его проявления на уровне соседского взаимодействия жителей многоквартирных домов.

В качестве параметров для оценки социального капитала нами приняты следующие:

- осознание социального капитала как ценности, накопление которой способствует более эффективным коллективным действиям;
- доверие между участниками группы;
- способность к координации личных и коллективных действий в реализации коллективных интересов.

В проведенном эмпирическом исследовании уровень социального капитала в группах жителей многоквартирных домов проявлялся при ответах на ряд вопросов анкеты массового социологического опроса, проведенного в городах Ростовской области в 2009 г.

**Восприятие наиболее болезненных проблем жилищной сферы.** Опрошенные жители двух городов наиболее болезненно воспринимают проблему ценовой доступности жилищно-коммунальных услуг. Острыми проблемами оказываются также отсутствие эффективных механизмов контроля за состоянием ЖКХ и работой управляющих компаний, низкое качество жилищных услуг и недостаточный уровень профессионализма работников ЖКХ. Кроме того, опрошенное население Ростова отмечает в качестве серьезной проблемы пассивность жильцов в решении проблем ЖКХ, их неумение принимать коллективные решения, договариваться по важным вопросам. В ответах респондентов из Азова острота этой проблемы намного ниже (15,9% в г. Ростове-на-Дону и 2,0% – в г. Азове).

Таким образом, сами жители многоквартирных домов осознают потребность в более тесном взаимодействии, налаживании отношений между соседями, отсутствие которых создает болезненные проблемы в условиях коллективного проживания.

**Основные источники информации об изменениях в сфере ЖКХ.** В числе основных источников информации о реформах в сфере ЖКХ в обеих группах опрошенных определенное место занимают соседи – около 14% ответов. Интересен тот факт, что среди опрошенных в Ростове в качестве собеседников по проблемам ЖКХ почти в три раза чаще указаны «знакомые, друзья, родные», чем в группе опрошенных азовчан (14,1% против 5%). Следовательно, темы, связанные с проблемами предоставления жилищных и коммунальных услуг, жители Азова обсуждают преимущественно с соседями, в то время как ростовчане в равной мере затрагивают вопросы ЖКХ в общении как с соседями, так и с другими лицами из ближайшего окружения.

**Наличие среди соседей респондентов людей, которым они доверяют и которые готовы лично участвовать в управлении домом, т.е. войти в правление ТСЖ или домовый комитет.** Отмечают достаточное число своих соседей, которым доверяют и которые готовы лично участвовать в управлении домом, только пятая часть респондентов-ростовчан и практически половина жителей Азова. А также полагают, что таких людей совсем мало или не знают о таких людях около 40% опрошенных первой группы и только десятая доля – во второй.

Следовательно, уровень социального капитала соседей многоквартирных домов, измеряемый доверием принятия общих решений по управлению МКД, находится на низком уровне в Ростове и принимает обнадеживающие значения в Азове.

**Проективные способы реагирования в случае ухудшения качества ЖКУ.** Уровень развития социального капитала среди жителей многоквартирных домов проявляется и в ориентациях собственников на проективные способы реагирования в случае ухудшения качества ЖКУ. Ростовчане в сравнении с опрошенными в Азове демонстрируют большую степень активности в области отстаивания своих прав в суде (38,8% против 10,5%) или реализации протестных действий (18,2% против 0,0%). Но также для большего количества жителей областного центра характерна пассивно-смирительная позиция, когда собственники готовы платить больше, лишь бы избежать лишних хлопот (14,5% против 1,5%).

Для принявших участие в исследовании населения Азова доминирующей моделью реагирования на ухудшение жилищно-коммунального обслуживания является ориентация на собственные силы и кооперацию с соседями (56,0%).

**Факторы, препятствующие развитию самоуправления в МКД.** Более 55% ростовчан отметили, что отсутствие навыков принятия коллективных решений (55,2% ответов) и недоверие населения к активистам-управленцам ТСЖ (47,0%) являются существенными препятствиями самоорганизации жителей. Азовчан этот фактор беспокоит гораздо меньше, практически не мешая, по их мнению, развитию жилищного самоуправления. Население Азова во многом чаще склонно договариваться между собой, формировать и поддерживать горизонтальные социальные связи внутри МКД.

Территориальная специфика изучаемых установок опрошенных собственников жилья в многоквартирных домах проявляется и в том, что ростовчане реже участвовали в собраниях по выбору способа управления домом, для них в большей степени характерны проблемы в коммуникациях с другими жильцами.

Таким образом, на сегодняшний момент в небольших российских городах, таких как Азов Ростовской области, выше уровень социального капитала, а значит, несколько больше возможностей в области солидаризации собственников, что является необходимым условием для развития жилищного самоуправления. В то время как в урбанизированной среде крупных городов, таких как областной центр и столица Южного федерального округа Ростов-на-Дону, более распространен индивидуализм и атомизация социальных отношений, что может затруднять налаживание практик совместных инициатив жильцов в сфере управления МКД.

Кроме исследования территориальной специфики социального капитала (фактора урбанизации), выявлена корреляция уровня социального капитала с такими параметрами респондентов, как пол, возраст, уровень дохода, способ управления многоквартирным домом. Полученные результаты позволили сформировать модель социального капитала на уровне соседского взаимодействия жителей российских городов.

**Моделирование самоорганизации в МКД.** С целью моделирования поведения городских жителей в многоквартирных домах нами использовалась игровая модель типа «дилеммы заключенных» с двумя игроками. Такого рода модели применяются в некоторых исследованиях, изучающих склонность индивидов к сотрудничеству (например: [Schmidt et al., 2001]). Предлагаемая модель позволяет выявить и описать стратегии поведения жильцов многоквартирного дома, а также уровень социального капитала в группе. Основные параметры модели: выгода от сотрудничества, затраты (инвестиции) и оценка риска неполучения положительного результата совместных действий.

Выгода от кооперации – это преимущества, получаемые группой от объединения и принятия совместных решений. Затраты – уровень инвестиций и расходов, которые придется понести каждому игроку, принимающему решение о вступлении в кооперацию с соседями (дополнительные денежные инвестиции, посещение собраний жильцов – временные издержки и т.п.). Риск – вероятность неполучения положительных результатов от деятельности, предполагающей взаимодействия с другими собственниками. Выгода от сотрудничества скорее относится к долгосрочному инструменту стимулирования кооперации в среде жильцов, нежели риски и затраты, которые имеют место здесь и сейчас.

В экспериментальной установке, где количество субъектов и множество допустимых действий постоянны, выявляются четыре основных элемента, которые влияют на поведение жильцов. К ним относятся:

- выигрыши;
- типы игроков;

- информация о типах игроков;
- связи между игроками, которые возникают при повторных игровых ситуациях.

В ходе исследования были определены две основные стратегии игроков: активная стратегия «кооперации» и пассивная стратегия «безбилетника». При этом были выявлены жильцы, которые систематически выбирают стратегию кооперации, а также собственники, пассивно относящиеся к управлению МКД.

Распределение выигрышей при различных оценках параметров модели в ситуации низкого и высокого уровней социального капитала представлено на рис. 1.

Низкий уровень социального капитала

		Игрок 2			
		Стратегия безбилетника		Стратегия кооперации	
Игрок 1	Стратегия безбилетника	60	60	110	10
	Стратегия кооперации	10	110	80	80

Затраты = 30, Риск = 50, Выгода от сотрудничества = 20.

Высокий уровень социального капитала

		Игрок 2			
		Стратегия безбилетника		Стратегия кооперации	
Игрок 1	Стратегия безбилетника	50	50	110	10
	Стратегия кооперации	10	110	90	90

Затраты = 20, Риск = 40, Выгода от сотрудничества = 40.

**Рис. 1.** Параметры игровой модели при различных уровнях социального капитала

Если исходить из предпосылки, что собственники жилья в МКД – абсолютно рациональные игроки, стремящиеся максимизировать свою личную выгоду, то моделирование ситуации отрицает наличие значимых уровней социального капитала в группе. Абсолютно рациональный человек будет стремиться минимизировать свои личные издержки, выбирая стратегию отстранения от участия в управлении жильем.

Однако на практике мы видим, что существуют примеры эффективной жилищной самоорганизации в многоквартирных домах (хотя множество примеров можно найти и вне сферы коммунальной экономики, когда люди выбирают стратегии кооперации).

В неповторяющихся играх игроки чаще выбирают стратегию эгоистичности и обособления. Но в повторяющихся играх игроки чаще выбирают сотрудничество. Среди возможных объяснений этого результата существует и тот, что денежные выгоды не всегда принимаются в расчет в первую очередь при принятии решений. Психологи давно утверждали, что социальные ценности, управляющие человеком, влияют на преобразование денежной матрицы выигрышей в эффективную матрицу [Kelley, Thibaut, 1978; Kramer et al., 1986; Kuhlman et al., 1986]. Вместо того чтобы предполагать существование только одного типа игрока, максимизирующего денежные выплаты, целесообразно предположить, что игроки придерживаются разных ориентаций в игре, основанных на их собственных внутренних системах ценностей и их связях с другими игроками.

В нашем исследовании более 55% опрошенных отметили, что не доверяют активистам и не знают людей, которые могли бы эффективно заниматься организацией своих соседей (данные по Ростову). Эти игроки будут более склонны к стратегии обособления от соседей («безбилетники», предполагающие, что эффективное управление может осуществляться и без их участия). Другие игроки более склонны к сотрудничеству, так как больше доверяют другим собственникам («кооператоры»). Проведенные фокус-группы, позволили выявить типы особо склонных к сотрудничеству игроков, а также особо пассивных игроков.

При этом следует отметить еще одну важную особенность моделирования социального капитала в среде собственников жилья. Если игроки четко разделены на «безбилетников» и «кооператоров», то «кооператоры» всегда имеют большую склонность к сотрудничеству, чем «безбилетники». Однако вклады в общее дело от всех игроков, когда они сортированы случайно («безбилетники» и «кооператоры» перемешаны), оказываются меньше, чем если бы «кооператоры» участвовали в повторяющихся играх только среди себе подобных.

Групповое поведение во многом определяется общими групповыми установками, контингент соседей влияет на каждого индивида в отдельности. Так, есть основания предполагать, что в ТСЖ, где большинство собственников проявляют заинтересованность в управлении МКД, эффективность их действий выше, чем если бы в доме было, например, только несколько особо активных соседей. Попав в среду «безбилетников», «кооператоры» снижают свой энтузиазм.



В результате социологического исследования мы выяснили, что некоторые жильцы, стремящиеся привлечь своих соседей к участию в управлении и не получающие ожидаемого отклика и поддержки, откладывают активные действия. Например, собственники, которым не удается убедить своих соседей в необходимости создания ТСЖ, в конце концов оставляют это начинание, ограничивая свои выигрыши повышения эффективности управления домом и соглашаясь на издержки упущенных возможностей, т.е. фактически принимая также стратегию «безбилетника». В целом затраты от такой пассивности собственников жилья часто во много раз превышает необходимые краткосрочные инвестиции, связанные с процессом самоорганизации.

Таким образом, уровень социального капитала оказывает значимое влияние на соотношение параметров модели. Чем выше степень доверия и склонность к взаимопомощи в группе, тем меньше издержки несет каждый из игроков в процессе самоорганизации, тем меньше риски неполучения положительных результатов организованных действий и тем выше оказываются выгоды от сотрудничества. В результате выигрыши обоих игроков при высоком уровне социального капитала превышают аналогичные выигрыши при низком уровне социального капитала. Следовательно, стимулирование жилищной самоорганизации связано с влиянием как на внешние параметры модели – распределение издержек, рисков и выгод от самоуправления в МКД, так и на внутренние факторы – типы игроков, информацию о типах игроков и связях между игроками, которые возникают при повторных игровых ситуациях. Совокупность этих внутренних факторов и описывает модель социального капитала.

**Перспективы жилищной самоорганизации.** Учитывая, что целенаправленное влияние на уровень социального капитала в городской среде достаточно проблематично, а процесс урбанизации и связанные с ним тенденции повышения мобильности населения по-прежнему носят активный характер, следует признать, что активизация жилищного самоуправления в современной России может происходить в основном за счет внешних факторов – снижения издержек и рисков самоорганизации при одновременном повышении выгод от соседского сотрудничества.

## Литература

*Ермишина А.В., Клименко Л.В.* В поисках эффективных собственников в многоквартирном доме // Экономическая социология. 2010. Т. 11. № 4. С. 105–136. ([http://ecsoc.hse.ru/issues/2010-11-4/annot.html#doc\\_23041](http://ecsoc.hse.ru/issues/2010-11-4/annot.html#doc_23041))

*Coleman J.* Foundations of Social Theory. Cambridge, Mass.: Belknap Press of Harvard University Press, 1990.

*Kelley H.H., Thibaut J.W.* Interpersonal Relations. N.Y.: Wiley, 1978.

*Kramer R.M., McClintock C.G., Messick D.M.* Social Values and Cooperative Response to a Simulated Resource Conservation Crisis // *Journal of Personality*. 1986. 54. P. 576–592.

*Kuhlman D.M., Camac C.R., Cunha D.A.* Individual Differences in Social Orientation // *Wilke H., Messick D.M., Rutte C.G. (eds.) Experimental Social Dilemmas*. Frankfurt: Peter Land, 1986.

*Schmidt D., Shupp R., Walker J. et al.* Dilemma Games: Game Parameters and Matching Protocols // *Journal of Economic Behavior & Organization*. 2001. Vol. 46. P. 357–377.

Ш.Ш. Какабадзе,  
Н.А. Звягина  
Национальный исследовательский  
университет «Высшая школа  
экономики»

# ДОБРОВОЛЬНЫЙ ОТКАЗ ГРАЖДАНСКИХ ОБЩЕСТВЕННЫХ ОБЪЕДИНЕНИЙ ОТ СТАТУСА ЮРИДИЧЕСКОГО ЛИЦА: НОВЫЕ РИСКИ И НОВЫЕ ВОЗМОЖНОСТИ<sup>1</sup>

---

В условиях сужения возможностей развития демократических институтов и представительной демократии (пример – последняя избирательная кампания) гражданское участие в России приобретает новые организационные формы: многие появляющиеся гражданские объединения отказываются от статуса юридического лица, некоторые «старые» и ранее зарегистрированные общественные объединения переходят в статус «неформальных» и продолжают действовать.

При этом стране необходим инновационный импульс и гражданская активность, которая свойственна именно инициативным гражданским объединениям, способным выявлять и решать социальные проблемы самостоятельно, без оглядки на государственное финансирование. На это способны гражданские общественные объединения, которые обладают следующими характеристиками: самоорганизация, самоуправление, субъектная самодостаточность, разделение принципов «гражданской этики», выражение общественно-значимого интереса, использование публичных и открытых методов общественной работы, вовлеченность в политический процесс – политическое участие.

В неблагоприятных условиях «внешней среды» (сокращение объемов финансирования, ужесточение законодательного и политического режима в отношении общественных объединений, создание и поддержка лояльных власти об-

---

<sup>1</sup> Статья подготовлена в рамках междисциплинарного исследовательского проекта ГУ ВШЭ «Организационные формы гражданского участия в России: основные характеристики до и во время экономического кризиса» (проект поддержан Научным фондом ГУ ВШЭ, Программа «Учитель-ученики» 2010–2011 гг. № 10-04-0031).

пественных объединений, выстраивание сужающихся каналов гражданского участия и т.п.) гражданские объединения переходят в форму инициативных групп граждан, отказываются от правового статуса, зарегистрированных НКО; возникают новые субъекты гражданской активности – коалиции, движения и т.п., организационно-правовой статус которых порой бывает трудно определить.

На наш взгляд, главным фактором, подталкивающим гражданские объединения к неформальному инициативному организационному статусу, является прерванный характер институционализации гражданского участия в России и изменение правовых условий существования общественных структур.

Под добровольным отказом от статуса юридического лица подразумевается решение общественной организации о невступлении или о непродолжении после неудачных попыток процедуры регистрации в установленном законом органе государственной власти<sup>2</sup>.

## **Развитие законодательства об общественных организациях: от формализации к созданию барьеров**

В начале 1990-х годов в России начался новый этап формализации структур гражданского общества. В соответствии с ранее действовавшим с 1930 г. положением «О добровольных обществах и союзах» объединения признавались одним из инструментов «социалистического строительства» и «последовательной реализации общегосударственного плана народного хозяйства и социально-культурного строительства». Фактически организации в течении 60-ти лет оставались частью единого государственного аппарата. В 1990-е годы на законодательном уровне общественные объединения становятся формально независимыми от власти и ее курса. В соответствии с законами «Об общественных объединениях» и «О некоммерческих организациях» государственные органы власти не могут быть учредителями общественных структур. Конституция РФ закрепила право граждан на объединение, включая право создавать профессиональные союзы для защиты своих интересов, также основной документ гарантировал равенство общественных объединений перед законом<sup>3</sup>. Оба эти положения в равной сте-

---

<sup>2</sup> До 2005 г. регистрирующим органом было Министерство юстиции (для международных и общероссийских организаций) и Налоговая служба (для всех остальных), с 2006 г. единым регистрирующим органом стала созданная Федеральная регистрационная служба, с 13 мая 2008 г. регистрирующим и контролирующим НПО органом снова стало Министерство юстиции РФ. См.: Гнездилова О. Новое законодательство: НКО и Росрегистрация – 5 проблем взаимодействия. Воронеж, 2008. С. 6.

<sup>3</sup> Ст. 13 и ст. 30 Конституции РФ. 1993.

пени распространяются на все организации с момента их образования независимо от их юридического статуса. Зарегистрированные же организации в 1990-е годы получили целый ряд законодательно закрепленных преимуществ: от возможности выдвигать кандидатов на выборах различных уровней, действуя в качестве избирательных объединений<sup>4</sup>, до закрепленной в законодательстве обязанности органов власти взаимодействовать с общественными объединениями.

Правовое положение организаций, закрепившее декларативно равные права и свободы в сочетании с существенным различием в конкретных инструментальных возможностях, предопределило предпочтительность зарегистрированных организаций как представителями органов власти, так и самими гражданами. Важно, что формально зарегистрировать объединение при этом было достаточно просто. Последнее существенным образом нивелировало проблему формального правового неравенства. Например, регистрация профсоюзов носила уведомительный характер, профсоюзы были освобождены от уплаты государственной пошлины за регистрацию. Регистрация местных, региональных и межрегиональных организаций осуществлялась в Налоговой службе де юре и де факто в течение одного месяца. Сложнее было зарегистрировать лишь общероссийские и международные организации, которые находились в ведомстве Министерства юстиции. К концу 1990-х в ответственных за регистрацию органах власти был сформирован корпус соответствующих внутренних положений и инструкций<sup>5</sup>. Не случайно подавляющее большинство опрошенных в рамках исследования ЦИРКОН организаций были фактически зарегистрированы в период с 1996 г. по 2001 г. В том числе 37 созданных в 1994 г. организаций были зарегистрированы лишь в 1996 г.

Регистрация общественных структур носила массовый характер. Официальная статистика зафиксировала на 1 января 2000 г. наличие 275 тыс. неправительственных организаций в России, из них 70 тыс. вели активную работу, в которой участвовали около 2,5 млн человек, включая штатных сотрудников и добровольцев. В 2001 г. зарегистрированных организаций насчитывалось уже 350 тыс., а к 2004 г. это число выросло на 34% по сравнению с 2001 г. Ряд исследователей при этом утверждают, что часть НПО продолжают существовать без регистрации, полагая, что с учетом незарегистрированных объединений данные цифры могут быть вдвое больше<sup>6</sup>.

---

<sup>4</sup> Ст. 30 Федерального закона № 67-ФЗ «Об основных гарантиях избирательных прав и права на участие в референдуме граждан РФ» от 12 июня 2002 г.

<sup>5</sup> Интервью с О. Гнездиловой – адвокатом, правовым советником фонда «За экологическую и социальную справедливость», апрель, 2011 г.

<sup>6</sup> *Халий И.А.* Современные общественные движения: инновационный потенциал российских преобразований в традиционалистской среде. М.: Институт социологии РАН, 2007. С. 69.

К началу 2000-х годов общественные организации стали массовым и заметным явлением. В связи с изменениями в политическом курсе внимание к ним властей возрастает. С середины 2000-х годов принимаются поправки в отраслевые законы, в том числе в сфере охраны безопасности, которые предоставляют правоохранительным органам большие полномочия контроля над деятельностью объединений граждан. Это происходит потому, что уже «в нормативных определениях этих законов за основу терминологических определений «экстремистской организации» и «экстремистской деятельности» берутся понятия «общественных объединений»<sup>7</sup>.

Существенным образом ситуация изменилась в 2006 г., когда с принятием поправок в законодательство об общественных объединениях и некоммерческих организациях объективно необходимое государственное регулирование работы сектора и помощь ему в решении общих социальных задач было «заменено мелочной опекой и детальной регламентацией каждого шага»<sup>8</sup>.

Созданная Федеральная регистрационная служба (ФРС) и ее региональные отделения стали новым контрольным органом, осуществляющим специализированный административный надзор за всей уставной деятельностью негосударственных объединений. Существенно расширена сфера административной ответственности общественных организаций. Полномочия ФРС в области контроля сделали законодательство в сфере НКО инструментом давления государственных органов на структуры гражданского общества. Введена система ежегодной отчетности. Поводом для приостановления деятельности организации и исключения ее из единого государственного реестра юридических лиц теперь может стать любое «непредоставление документов» или «нарушение сроков отчетности». Процедура регистрации усложнилась, стала отнимать значительно больше времени и финансовых ресурсов. По данным газеты «Ведомости», зарегистрировать новую НКО теперь на 40% дороже, чем коммерческую фирму, а по времени регистрация занимает не менее двух месяцев<sup>9</sup>.

Таким образом, все то, что в 1990-е годы не препятствовало ассоциациям граждан проходить процедуру регистрации, в 2000-х стало реальным барьером.

---

<sup>7</sup> Беляева Н.Ю. Регулирование конституционного права на объединение в середине 2000-х годов: гражданское участие в тисках «Поправок-2006» // Сборник научных статей «Конституционное развитие России: задачи институционального проектирования». М., 2007.

<sup>8</sup> Квашионкин А.В. Организационно-правовые формы, создание и регистрация НКО в РФ. Проблемы и особенности законодательства // Государственное управление. Электронный вестник. Вып. № 6. 10 августа 2005 г.

<sup>9</sup> Стоимость услуг посреднических фирм в Москве – от 45000 руб. до 70000 руб. См.: НКО и Федеральная регистрационная служба – 5 проблем взаимодействия. ([http://www.ngo.hrworld.ru/download/ngo\\_5problems\\_f\\_2008.doc](http://www.ngo.hrworld.ru/download/ngo_5problems_f_2008.doc))

Весомые же преимущества, которые давало наличие у организации статуса юридического лица, сводятся в основном к праву вести легальную финансово-хозяйственную деятельность. Возможность участвовать в избирательном процессе практически полностью заблокирована. Общественные организации на федеральном уровне в большинстве субъектов РФ и на местном уровне более не могут выдвигать кандидатов или проводить общественное наблюдение за выборами. Общественники, желающие выдвинуть своих кандидатов на местных выборах, должны заключать с той или иной партией союз и подписывать предварительный договор о совместном участии в выборах<sup>10</sup>. Возможность участия в совещательных структурах при органах власти на практике напрямую не зависит от наличия членства в организациях. А рекомендация «провластной структуры» или приравненных по статусу к госорганам региональных общественных палат значит при выдвижении значительно больше, чем любой зарегистрированной НПО.

Прирост числа неправительственных объединений существенно сократился. По данным Росстата, общая численность некоммерческих организаций в Российской Федерации за период с 1 января 2008 г. по 1 января 2009 г. увеличилась с 655,4 тыс. до 669,9 тыс., или на 2%. Во многом этот незначительный прирост обеспечен за счет дачных и садоводческих товариществ, потребительских кооперативов и товариществ собственников жилья. Данные об общественных организациях свидетельствуют о сокращении их почти на 8,5 тыс., или на 5,5%<sup>11</sup>.

Сокращение числа зарегистрированных организаций не является следствием исчезновения феномена гражданской активности или способности граждан к объединению. Речь идет лишь об уходе общественной активности в «серые зоны».

## **Институт гражданского участия в России: «прерванное формирование»**

В процессе взаимодействия властных и гражданских акторов не наблюдалось какой-либо непрерывной последовательности институционального строительства. При этом характер процесса в 1990-е и в 2000-е годы существенно отличается. Если в первом случае речь идет о попытках выстраивать реальные отношения, с политическим уклоном самих общественных деятелей, то во вто-

---

<sup>10</sup> *Кынев А.В.* Мы не партия, мы здесь живем. ([http://www.4cs.ru/materials/publications/wp-id\\_548/](http://www.4cs.ru/materials/publications/wp-id_548/)), ([http://www.gazeta.ru/comments/2009/02/18\\_x\\_2944886.shtml](http://www.gazeta.ru/comments/2009/02/18_x_2944886.shtml))

<sup>11</sup> См. доклад Общественной палаты РФ: О состоянии гражданского общества в Российской Федерации // Стратегии России. 2010. № 2.

ром начала преобладать ориентация на канализацию взаимодействия и его имитационность.

Институт гражданского участия для России явление новое<sup>12</sup>, институционализация отношений между общественными объединениями и властью началась во время Перестройки, в конце 1980-х годов. Государство разрешило в первую очередь самоорганизацию населения в сфере охраны окружающей среды. В 1989 г. была создана крупнейшая экологическая неправительственная организация Советского Союза Социально-экологический союз. Протестная деятельность экологического движения сыграла большую роль в институционализации гражданского участия, она была публичной и широко обсуждаемой в советских СМИ, на съезде Советов народных депутатов. В результате протестов многие из активистов движения становились депутатами, многие консультировали депутатов. В начале 1990-х годов появляется большое число разнообразных движений социальной направленности и так называемые новые движения (феминистское, антиядерное и др.)<sup>13</sup>. Массовыми стали возглавляемое шахтерами рабочее движение, движение правозащитников. В этот период идет интенсивный процесс создания разнообразных практик взаимодействия гражданских и государственных организаций: проведение консультаций, организация круглых столов, организация и осуществление общественных экспертиз, участие в общественных слушаниях и т.п.

Формальные институты гражданского участия федерального уровня возникают в результате нескольких знаковых, публичных событий – проведения Гражданского форума 2001 г., создания Общественной палаты РФ в 2004 г., преобразования Комиссии по правам человека в Совет при Президенте Российской Федерации по содействию развитию институтов гражданского общества и правам человека в 2005 г. В регионах создаются различные практики взаимодействия, включая советы при администрациях и первые общественные палаты<sup>14</sup>.

---

<sup>12</sup> В условиях тоталитаризма организаций гражданского общества, по мнению социологов, не может быть, исключая квазиобщественные организации типа Комитета советских женщин. Однако некоторые общественные объединения все-таки возникали (например, дружины охраны природы), но они не были институционализированы как общественные организации, а взаимодействия между ними и государством и вовсе не предусматривалось. См., например: Халий И.А. Современные общественные движения: инновационный потенциал российских преобразований в традиционалистской среде. М.: Институт социологии РАН, 2007. С. 300.

<sup>13</sup> Халий И.А. Современные общественные движения: инновационный потенциал российских преобразований в традиционалистской среде.

<sup>14</sup> Брянецев И.И. Некоторые аспекты политической эволюции Общественной палаты Саратовской области как субъекта публичной политики в период с 1996 г. по 2005 г. Российская ассоциация политической науки. Алтайское отделение. (<http://ashpi.asu.ru/rapn/reports06/brnzv.html>). См. также: Фолтин О.Н. Трудный путь к согласию: региональный опыт. Саратов: ПАГС, 2002. С. 180.



Так, Президент В.В. Путин в своем Послании к Федеральному Собранию в 2000 г. говорил о незрелости российского гражданского общества, хотя и признавал неумение власти сотрудничать с ним. По мнению ученых и лидеров общественных организаций, форум был реакцией власти на действия гражданского общества, на постоянные попытки его объединений заставить государство хотя бы слушать<sup>15</sup>. Итогом Гражданского форума 2001 г. стали решения, которые фактически представляют собой программу институционального строительства в сфере гражданского участия<sup>16</sup>. Было запланировано создание новых (и развитие существующих) структур (советов, рабочих групп, комитетов), целью которых должно было стать обеспечение процесса согласования по целому ряду направлений государственной политики, включая национальную политику, обеспечение безопасности, политику в сфере миграции, экологическую политику и др., а также в сфере гражданского контроля и развития некоммерческого сектора. Ожидалось, что проведение гражданских форумов станет устойчивой и эффективной практикой гражданского участия, поскольку это позволило бы вовлечь в процесс НПО очень широкого спектра деятельности и, соответственно, практически все ветви и структуры власти. Но сам Гражданский форум так и не стал устойчивой «площадкой» гражданского участия<sup>17</sup>. Следующий форум был проведен в январе 2008 г., его подготовка и проведение практически не освещались в СМИ.

Анализ институционального развития возможностей участия общества в жизни страны за последнее десятилетие показывает взаимосвязь двух тенденций: сокращение возможностей для реального политического участия граждан России, совпадающее с созданием сужающихся каналов гражданского участия.

О сокращении возможностей политического участия через масштабное перекраивание законодательства о выборах, политических партиях и НКО было сказано и написано довольно много<sup>18</sup>. Резюмируя трансформацию правового поля в этой сфере, завершившуюся к 2007–2008 гг., важно отметить сокраще-

---

<sup>15</sup> Аузан А.А. Правозащитник. 2002. № 1. (<http://www.hro.org/editions/hrdef/200201/0207.htm>)

<sup>16</sup> См.: Гражданский форум. Итоговые документы // Правозащитник. 2001. № 4. (<http://hro.org/editions/hrdef/401/0406.htm>); Гражданский форум. Московские соглашения // Правозащитник. 2001. № 4. (<http://hro.org/editions/hrdef/401/0407.htm>)

<sup>17</sup> См.: Беляева Н. Что осталось после Гражданского форума. (<http://magazines.russ.ru/nz/2003/2/beliae.html>)

<sup>18</sup> См., например, Бузин А.Ю., Любарев А.Е. Преступление без наказания. Административные технологии федеральных выборов 2007–2008 годов. Серия: Право и выборы. Группа компаний «Никколо М», Панорама, 2008; Кынев А.В. Выборы парламентов российских регионов 2003–2009. Первый цикл внедрения пропорциональной избирательной системы. М.: Центр «Панорама», 2009; Кынев А.В., Любарев А.Е. Партии и выборы в современной России: Эволюция и деволюция. М.: Фонд «Либеральная миссия»; Новое литературное обозрение, 2011.

ние числа субъектов политического участия фактически до политических партий; при этом произошла централизация и сокращение числа политических партий; имевшиеся ранее возможности участия общественных объединений в избирательном процессе и жизни партий были заблокированы.

Параллельно власти начинают канализировать гражданское участие, создавая такие структуры, как общественные советы и общественные палаты, которые признаются единственными легитимными каналами взаимодействия и коммуникации с государством. В состав таких структур входят большей частью представители лояльных общественных учреждений, в результате чего большая часть гражданских объединений и интересов оказывается не представленной. В результате создаются управляемые структуры, подменяющие собой институт гражданского участия. Оценивая результативность, к примеру, общественных советов при органах власти, их члены нередко сетуют на то, что полномочия этих органов носят совещательный характер<sup>19</sup>.

Зачастую отбор в совещательные органы происходит на уровне персональных, а не организаций. В частности, процесс формирования общественной палаты РФ<sup>20</sup>, по образу и подобию которой создается ряд региональных общественных палат, выстроен так, что только для выдвижения одной трети палаты нужна общественная организация, и отбор кандидатов от НПО происходит в последнюю очередь. Одна треть формируется по предложению президента, вторая треть по предложению первой трети. При этом не обязательно быть членом выдвигающей организации. В частности, известный московский скульптор Зураб Церетели был выдвинут в члены Общественной палаты РФ первого созыва «Тульским обществом архитекторов, о чем сами архитекторы узнали задним числом, чем были сильно удивлены. Неудача, однако, не смутила мастера, и он вновь выдвинулся от той же Тульской области, но уже от организации памяти жертв политических репрессий «Мемориал»<sup>21</sup>. Во многих случаях важно, чтобы рекомендуемая организация имела статус юридического лица не менее нескольких лет, что не всегда реально для организации, созданной для реакции на конкретную ситуацию или проблему.

Немаловажен и тот факт, что в России неформальные схемы влияния на принятие решений играют существенную роль<sup>22</sup>. К примеру, руководитель об-

---

<sup>19</sup> По материалам интервью с В.И. Битюцким, Председателем ВИПО «Мемориал».

<sup>20</sup> Федеральный закон № 32-ФЗ «Об Общественной палате Российской Федерации» от 4 апреля 2005 г.

<sup>21</sup> Зураб Церетели был выдвинут в общественную палату РФ Тульским обществом архитекторов. (<http://www.7info.ru/index.php?kn=1131879310>)

<sup>22</sup> *Авервиев И.* О Духонине, Шулькине и взятках. (<http://www.prpc.ru/averkiev/050919.shtml>)

пественного объединения «ЛАНА» города Буденновска (Южный федеральный округ) так описала способы взаимодействия ее организации с органами местной власти: «Мы выходили с инициативой провести совместно акции или мероприятия. На взаимодействие и сотрудничество они не идут, если только не задействованы личные связи. У нас налажены личные связи с главой Буденновского района. Давняя дружба с советских времен. Но пользуемся этим рычагом очень редко. Не более двух раз в год»<sup>23</sup>.

К тому же, для некоторых часто используемых активными гражданами, объединенными в группы, публичных действий, призванных повлиять на власть, статус юридического лица не требуется. Так, для проведения протестных публичных акций, написания петиций и ведения информационных кампаний, которые большинство опрошенных организаций ведут также активно как и ранее, обладать специальным статусом не требуется.

И в довершение всего, в современных «развитых» странах институт гражданского участия существует и используется гражданами как инструмент изменения социальной реальности. Более того, данный институт западными государствами развивается и поддерживается. В России всякое несанкционированное проявление гражданского участия воспринимается как угроза власти.

## **Гражданские объединения в форме инициативных групп граждан как субъекты гражданского участия: риски и возможности**

Инволюция института гражданского участия, отрыв власти от общества, неблагоприятная нормативно-правовая среда, превосходство неформальных институтов над формальными, слабая межличностная солидарность привели к тому, что более приемлемой формой самоорганизации гражданских объединений и гражданской активности становятся инициативные группы граждан.

Инициативная группа граждан – это социальная группа, организованная индивидами для решения общей проблемы и не обязывающая их к созданию юридического лица, но предполагающая определенную степень консолидации ее участников для достижения целей продвижения и защиты общих для них интересов.

11 организаций из 360 опрошенных в рамках исследования ЦИРКОН определили свой статус как «инициативная группа». С одной стороны, это число

---

<sup>23</sup> Опрос участников общественных организаций и инициативных групп.

невелико, но сам факт такого самоопределения показателен: подобная формулировка, во-первых, прижилась в лексиконе активистов; а во-вторых, эта форма воспринимается как вполне самостоятельная, постоянно воспроизводится и, таким образом, фактически является реальной формой существования общественных организаций, не будучи лишь оформленной законодательно.

Инициативные группы действуют наряду с традиционными неправительственными организациями как альтернативные им общественные практики, иногда даже вместо них. Инициативные группы создаются гражданами для решения крайне разнообразных и часто бытовых проблем, среди которых наиболее распространенными являются проблемы в области собственности жилья, управления жильем, земельных отношений, прав потребителей, повышения эффективности гражданского контроля за деятельностью властей и правоохранительных органов. Также в рамках инициативных групп граждане борются за развитие и сохранение культурно-досуговых центров, клубов по интересам и иных мест общения жителей, занимаются мониторингом безопасности городских и сельских территорий, в том числе благоустройством подъездов, домов, дворов, придомовых территорий и улиц, сохранением архитектурных памятников и культурных заповедников.

В ходе исследования нами был проведен заочный опрос представителей 360 гражданских общественных объединений, а также ряда общественных лидеров с целью выявить достоинства и недостатки такой формы гражданской самоорганизации, как инициативные группы граждан. Обобщив полученные ответы, мы получили следующие результаты.

Достоинства инициативных групп граждан по тем возможностям, которые данная форма предоставляет гражданам объединениям:

- отсутствие необходимости в регистрации и отчетности, формы которой постоянно меняются и которой больше, чем у коммерческих организаций (налоговая, Минюст, грантодатели и т.д.);
- экономия средств и ресурсов на содержание организационной структуры. По результатам опроса, проведенного исследовательской группой ЦИРКОН, средний объем финансирования, которое имеют стабильно существующие НПО, колеблется в пределах от 700 тыс. до 1,5 млн руб. в год. Довольно большая часть этих средств уходит на содержание инфраструктуры организации (офис, связь, технические сотрудники), а не на содержательную деятельность;
- организационно меньшая связанность рамками устава;
- возможности более оперативного реагирования на публичные проблемы ввиду ориентированности на конкретную задачу и (часто) малочисленности;

- способность оперативно изменяться, адаптироваться к конкретным обстоятельствам, зачастую – весьма неблагоприятным, гибкость и креативность в выборе форм работы;

- «коллективное лидерство» или «совместная ответственность» (*«shared responsibility»*) вместо жестко структурированной иерархии, «общественных должностей» – все вместе делают ту работу, которая в данный момент необходима;

- большая «открытость» по отношению к окружающей среде, к местным сообществам, поскольку нет жесткой границы «членства» или «нечленства» в какой-то «организации».

Недостатки инициативных групп граждан, приводящие к рискам для гражданских объединений, выбирающих данную форму самоорганизации:

- аморфность и трудноразличимость для «контрагентов»;
- отсутствие постоянных лидеров, иерархии и структуры (не ясно, кто за что отвечает и кто несет ответственность);

- краткосрочность большинства гражданских инициатив, неподкреплённость ресурсами, за исключением личной энергетике, которая имеет свойство быстро иссякать и переключаться на другие более ресурсные и требующие меньших издержек проекты, в результате подобные инициативы оказываются нужными нескольким «пассионариям».

Специфика и сила инициативных групп в том, что они идут в обход формализованных правил и процедур. Эти группы создаются под решение конкретной задачи, не желая упрямо «сохранять форму ради формы», если цель достигнута или ясно, что это невозможно. Люди объединяются для решения проблемы, после объединяются с другими людьми для достижения следующей цели. Отказ от юридического статуса не предполагает потери устойчивости организации. Объединения не перестают действовать организованно, они просто избавляются от излишней государственной опеки и зачастую бессмысленных формально-юридических обязательств. Они годами продолжают действовать системно и слажено. Возможно, данная форма «здесь и сейчас», в настоящих условиях, действительно оказывается более приемлемой для гражданских объединений для решения публичных проблем.

Все это делает инициативные группы граждан действительными «ядрами» гражданских сообществ, «ячейками гражданского общества», в отличие от «третьего сектора», сегмента некоммерческих организаций, который безудержно бюрократизируется и коммерциализируется, встраивается в «вертикаль власти», превращаясь в полную противоположность идее и должной практике субъектов гражданского общества, института гражданского участия.

Н.Ю. Беляева,  
В.Е. Карастелев  
Национальный исследовательский  
университет «Высшая школа экономики»

# ФОРМЫ ГРАЖДАНСКОГО УЧАСТИЯ ГРАЖДАНСКИХ ОБЪЕДИНЕНИЙ В ПУБЛИЧНОЙ ПОЛИТИКЕ<sup>1</sup>

---

## Введение

Статья основана на результатах социологического исследования в форме опроса представителей общественных объединений России, который проводился в ноябре–декабре 2010 г.

Цель исследования – выявить и описать сегменты гражданского общества, имеющие потенциал инноваций и гражданского участия.

Рабочая гипотеза: под воздействием факторов ужесточения политико-правового режима происходит рост протестных форм гражданской активности в сегменте гражданских объединений. В опросе приняло участие 360 представителей общественных объединений, в том числе представители неинституционализированных инициативных групп граждан.

Однако в ходе исследования авторы столкнулись с необходимостью решения проблемы выделения среди общественных объединений (ОО) гражданских перед тем как изучать формы участия гражданских ОО в политике.

## Идентификация реальных субъектов гражданского участия: постановка проблемы и пути ее решения

Участниками проекта была проведена серия интервью с известными практиками – лидерами сетей гражданских объединений, перед которыми в ходе

---

<sup>1</sup> Работа подготовлена в рамках междисциплинарного исследовательского проекта НИУ ВШЭ «Организационные формы гражданского участия в России: основные характеристики до и во время экономического кризиса» (проект поддержан Научным фондом НИУ ВШЭ, Программа «Учитель – ученики» 2010–2011 гг. № 10-04-0031).

своей деятельности в качестве «ресурсных центров» также возникала задача идентификации реальных общественных объединений и имитационных. В ходе интервью был поставлен ряд конкретных вопросов: как выделить среди некоммерческих организаций и структур гражданские общественные объединения, какими отличительными признаками характеризуются последние. Таким образом, был актуализирован вопрос о выделении среди некоммерческих организаций и структур «реальных» общественных объединений, созданных по инициативе «снизу», и отделении их от «искусственных», созданных «сверху», объединений. В развитии данного вопроса была поставлена проблема выявления оснований, критериев и признаков, на основе которых можно было бы отделить «искусственные» общественные объединения от «реальных» общественных объединений, а среди последних выделить гражданские общественные объединения. Данные, собранные в результате интервью, были положены в основу авторской концепции идентификации гражданских объединений.

Однако с этой проблемой сталкивались не только активисты гражданских объединений, но и ученые – специалисты, исследователи проблем гражданского общества в России. Обзор последних исследований в данной области позволяет сделать вывод о том, что это глубочайшая концептуальная проблема научных и прикладных исследований гражданского общества в России.

Хотя большинство исследователей гражданского общества России согласны с проблемой подмены «реальных» структур гражданского общества «формальными» и откровенно «фальшивыми» (Л.И. Якобсон, И.В. Мерсиянова, А.Ю. Сунгуров, Т.Е. Ворожейкина, М.А. Липман, Н.В. Петров и др.), мало кто брался за ее решение.

Само явление подмены социальной функции ее имитацией было выявлено и описано Ж. Бодрийяром в 1980–1990х гг.<sup>2</sup> Для обозначения данного и иных подобных явлений подмены реальности «воображаемым образом», «системой знаков» Ж. Бодрийяр использовал термин «симулякр».

С того времени возможности имитировать реальную деятельность, используя современные технологии (цифровое телевидение, Интернет), только увеличивались, и этот феномен возрастает неограниченно по всем параметрам и направлениям (культурным, социальным, экономическим и политическим).

Термин «симулякр» и описываемые им явления активно стали использоваться и вошли в российский общественно-политический дискурс в начале 2000-х годов. Политологи, социологи, философы всех направлений и политиче-

---

<sup>2</sup> Бодрийяр Ж. Симулякры и симуляция / Simulacra and Simulation (англ.) / Simulacres et simulation (фр.) (1981, рус. пер. 1996).

ских ориентаций (либералы и консерваторы, «западники» и «патриоты») постоянно говорят об имитации выборов, деятельности парламента, политических партий, имитации социальной и гражданской активности. Примеры таких «симуляций» чрезвычайно разрослись, а следом увеличивается количество научно-исследовательских и прикладных работ и изысканий, описывающих и анализирующих данные явление и феномен<sup>3</sup>.

Решение обозначенной выше проблемы, в свете рассматриваемого явления подмены реальных институтов и субъектов их имитациями, потребовало от участников проекта разработки концепции идентификации гражданских общественных объединений. Вот ее основные теоретические положения.

Основной гражданской общества являются активные и сознательные граждане<sup>4</sup>, а не только общественные организации, поскольку последние, особенно при условиях давления внешней среды, очень легко «имитировать». А вот реальных граждан (грамотных, думающих, равнодушных, действующих) «имитировать» невозможно, причем, даже при очень слабо развитом гражданском обществе, поскольку какое-то количество таких граждан остается всегда.

Важнейшая характеристика гражданина – осмысление им самим своих отношений с государством, а именно: освоение им в практической деятельности взаимных прав и обязанностей между государством и гражданами, которые закреплены нормативно в публичном договоре. Граждане сознательно отдают часть своих свобод публичной власти в обмен на то, что она должна их защищать, а в социальных государствах – и дополнительно обеспечивать минимальный набор социальных благ. В современных обществах такой «публичный договор» закреплен в конституциях, что предполагает возможность, а в некоторых странах и обязанность, граждан участвовать в управлении государством и обществом, а также предъявлять определенные требования к государству. Именно осознание индивидом права требовать защиты и реализации своих прав у государства делают индивида гражданином.

Выявление и повторение минимальных признаков гражданина нам здесь необходимо, поскольку те же признаки ложатся в основу определения гражданского объединения.

Итак, чтобы быть способным требовать что-то у государства, гражданин должен обладать тремя качествами самостояния (можно использовать термины

---

<sup>3</sup> Публичная политика в современной России: субъекты и институты: сб. статей / под ред. Н.Ю. Беляевой. М., 2006.

<sup>4</sup> Исследовательский коллектив проекта, таким образом, разделяет активистский подход к пониманию и анализу гражданского общества.



«самостоятельности», «субъектности», «автономности»), которые обеспечиваются тремя свободами:

1) самостоятельностью сознания и способностью целеполагания (осознания своих собственных интересов и способностью построения стратегий их реализации);

2) самостоятельностью воли (чаще используется термин «свобода воли»), позволяющей самостоятельно – без помощи «извне», а зачастую и преодолевая сопротивление – организовать и реализовать свои действия, в том числе и в неблагоприятной среде, устраняя всевозможные препятствия на пути реализации своих интересов и жизненных стратегий;

3) самостоятельностью ресурсной, т.е. возможностью обеспечить свои действия и достижение своих целей необходимыми ресурсами, наличие разного вида «капиталов», в том числе собственности.

Таковыми же минимально необходимыми признаками, характеристиками должны обладать и общественные и гражданские объединения, поскольку «самостоятельность» – это только «первичный признак». Самостоятельностью, в достаточной степени, должно обладать любое общественное объединение, не являющееся «агентом чужой воли» и не «созданное сверху, под заказчика». Несамостоятельные общественные объединения являются той самой формой имитации реальной гражданской активности и коллективного действия, назовем их «агентскими».

Итак, реальные, самостоятельные общественные объединения являются таковыми при соответствии трем признакам, характеризующим их собственные качества.

Во-первых, самоорганизация. Данный признак означает, что инициатива создания общественного объединения исходит «снизу» (от граждан, ассоциаций граждан, шире – от негосударственных структур).

Одним из индикаторов соответствия общественного объединения признаку самоорганизации в исследовании служит показатель «оказания поддержки» при создании объединения. Понятно, что в условиях России актуальным является отсутствие «поддержки» со стороны власти. По данным опроса представителей общественных объединений (НКО и инициативных групп граждан), проведенного Исследовательской группой ЦИРКОН<sup>5</sup>, на вопрос о том, кто поддержал создание вашего общественного объединения, около 48% опрошенных

---

<sup>5</sup> <http://www.zircon.ru/>

структур ответили «никто» или «затрудняюсь ответить». Соответственно более половины общественных объединений были созданы «при поддержке» властей.

Во-вторых, самоуправление. Данный признак означает невозможность изменения видов деятельности, поведения сотрудников объединения извне, готовность объединения отстаивать свои принципиальные позиции перед «третьими лицами». Например, спорить с грантодателем о предмете деятельности в рамках реализации гранта, отказаться от каких-либо выгод (в том числе материальных), если получение таких выгод нарушает основные задачи и принципы деятельности объединения.

Весьма болезненным для российских ОО является вопрос «контроля» над деятельностью ОО со стороны «третьих лиц» (прежде всего власти и других возможных «патронов»: политических организаций, спонсоров, бизнеса, международных организаций и фондов и т.п.). Так, по данным опроса ОО, о том, что «третьи лица» осуществляют контроль над текущей работой объединения, заявило около 30% опрошенных респондентов.

Третий критерий «реальных» ОО – самостоятельность. Данный признак означает ресурсную самостоятельность общественного объединения, которая может поддерживаться, во-первых, независимостью от одного источника доходов (например, государственного), во-вторых, соответствием, адекватностью поставленных общественным объединением задач внутренним ресурсным возможностям объединения. Это предполагает грамотный анализ и управление имеющимися внутренними и внешними ресурсами (фандрайзинг), а также осознание возможностей и ограничений внешней среды (доминирование одних субъектов политики и слабость других). Например, по такому параметру, как достаточность средств у ОО на выполнение основного вида деятельности, наблюдается похожая дифференциация ОО – вновь чуть более половины объединений (58%) признались в нехватке средств на выполнение основного вида деятельности, необходимости привлечения для этого дополнительных источников доходов. При этом у почти 40% опрошенных ОО средств на выполнение основного вида деятельности хватает. Следствием нехватки средств как раз и является подпадание под контроль со стороны «спонсора» и установление патрон-клиентских отношений зависимости.

Выше перечислены необходимые базовые принципы, которые отличают самостоятельное общественное объединение от «агентских», находящихся под влиянием «внешних сил».

Среди самостоятельных ОО – по многолетнему анализу статистики зарегистрированных объединений – абсолютное большинство составляют объеди-

нения «рекреационного типа», т.е. созданные для совместного проведения свободного времени и удовлетворяющие многообразные любительские интересы. Их основная деятельность направлена «внутрь» самого объединения, на удовлетворение интересов участников. Такие объединения никак не могут быть отнесены к гражданским, поскольку служат удовлетворению частных и групповых интересов и никак не обращены к публичным институтам и к государству.

Отличительная особенность гражданских объединений – направленность их целей и самой деятельности во внешнюю по отношению к объединению публичную среду. Гражданские объединения ставят своей задачей решение общественных проблем (от которых страдает «неопределенный круг лиц»), и решение этих проблем требует участия государства, поскольку входит в его обязательства по общественному договору с гражданами.

Таким образом, основное отличие гражданских объединений в том, что они служат публичной цели, работают на достижение общественного блага. Они потому и называются «гражданские», что действуют в интересах всех граждан, поскольку результатом их деятельности является изменение социальных практик, отвечающих общественным интересам.

Итак, среди ОО необходимо выделять «реальные», «неимитационные», самостоятельные ОО, а среди последних – гражданские, преследующие публичные цели, отстаивающие публичные интересы «во имя» достижения общего блага.

Как показывает анализ существующей информации об ОО России (как настоящих, так и ранее проведенных исследований, в том числе данные, собранные в ходе проекта), выделенных признаков реальных общественных объединений недостаточно для идентификации гражданских ОО. Последние характеризуются следующими дополнительными признаками, описывающими «внешнюю» направленность их деятельности.

Во-первых, направленность на решения актуальных общественных проблем. Цели и деятельность гражданского общественного объединения направлены на выявление и решения актуальных, важных общественных проблем. Поэтому гражданское общественное объединение должно быть способно выявить общественную проблему, сформулировать ее, мобилизовать общественные силы, людей и привлечь ресурсы на решение этой проблемы. Гражданские общественные объединения представляют интересы граждан. Поэтому основная сфера их деятельности – защита прав и интересов (политических, экономических, социальных) уязвимых и/или уязвленных категорий граждан (*advocacy work*). В этом одно из основных отличий гражданских общественных объединений от некоммерческих объединений, предоставляющих услуги населению.

Во-вторых, провозглашение и реализация «гражданской этики». Гражданские общественные объединения в своей деятельности соблюдают «гражданскую этику». Это, прежде всего, имеет отношение к целевым группам гражданских общественных объединений, которыми являются «слабые», нуждающиеся, дискриминируемые меньшинства. Кроме того, гражданское общественное объединение действует, прежде всего, с этических позиций, целей извлечения прибыли перед собой не ставит. Лидеры гражданских общественных объединений придерживаются единых ценностных установок (разделение принципов демократии, гражданского общества, уважение прав человека). Это может проявляться также в неравнодушном отношении к окружающим, внимании к общественным проблемам, чувстве солидарности с гражданами (особенно нуждающимися в какой-либо помощи). Лидеры гражданских общественных объединений проявляют готовность жертвовать чем-либо, идти на риск ради реализации своей общественно значимой задачи (работать без зарплаты, в неблагоприятной политической, экономической, социальной среде и т.п.).

Третьим отличительным критерием гражданских объединений является использование ими публичных и открытых методов общественной работы в конкуренции с другими объединениями, полный отказ от насилия. Цели и деятельность гражданского объединения не должны быть направлены на причинение ущерба имуществу и нанесение вреда здоровью и жизни других граждан. Поэтому гражданское общественное объединение не применяет «насильственные» методы в своей деятельности. Деятельность гражданского общественно-го объединения отвечает принципам публичности и открытости. Поэтому наличие постоянно обновляемого сайта, публичного отчета о деятельности объединения могут быть атрибутами гражданского общественного объединения.

Гражданские ОО в условиях неблагоприятной «внешней среды» вынуждены чаще применять протестные формы активности, при этом, чтобы оставаться «гражданскими», необходимо придерживаться ненасильственных методов работы. Таким образом, сочетание протестных и ненасильственных методов общественной работы является характерным признаком гражданских объединений. По данным опроса, таких ОО 22%.

Еще одним, четвертым, отличительным критерием гражданского ОО является его стремление и включенность в политическое участие, процесс выработки, принятия, реализации и оценки политико-управленческих решений. Так, по данным опроса представителей ОО, стремление к политическому участию объединения в процессе выработки, принятия, реализации и оценки политико-управленческих решений свойственно в той или иной степени 34% опрошен-

ных, не свойственно 46%, еще 20% выбрали неопределенную «промежуточную» позицию (то ли свойственно, то ли нет). То есть по данному параметру наблюдается поляризация мнений ОО. Это может говорить о том, что данный критерий является одним из главных, отделяющих гражданские объединения от остальных. Реальное политическое участие в процессе выработки, принятия, реализации и оценки политико-управленческих решений, судя по декларациям, свойственно еще меньшему количеству ОО – 24%.

## Формы участия гражданских объединений

Для оценки форм участия гражданских объединений в публичной политике в ходе опроса представителей общественных объединений был задан вопрос о распространенности среди ОО 16-ти форм гражданского участия (см. рис. 1). Особо оценивалось изменение частоты использования форм гражданского участия за последние 2–3 года, когда тенденция ужесточения политико-правового режима в отношении общественных объединений стала очевидной для многих специалистов и экспертов – общественников.

В целом гражданские ОО являются более активными, чем ОО в целом. Особенности отличия между гражданскими ОО и ОО в целом зафиксированы в отношении следующих форм участия: *гражданская (общественная) экспертиза, гражданский (общественный) контроль, переговоры и альтернативное разрешение проблем*. Именно эти формы участия являются «визитной карточкой» гражданских общественных объединений.

В последние 2–3 года гражданские общественные объединения стали чаще использовать следующие формы участия: *информационные кампании, общественные обсуждения, консультирование деятельности общественных организаций, гражданское образование, гражданская (общественная) экспертиза, социальное проектирование, гражданский (общественный) контроль, гражданская инициатива*. Гражданские ОО, в отличие от общественных объединений в целом, стали использовать чаще такие формы, как *информационные кампании, консультирование деятельности общественных организаций, гражданский (общественный) контроль, гражданская (общественная) экспертиза*. Далее следуют *общественные обсуждения, гражданская инициатива, гражданское образование, лоббирование интересов социальных групп, социальное проектирование*.

Такие формы, как *защита интересов, социальная переписка, общественная дипломатия, общественные мероприятия, протестные действия, переговоры и альтернативное разрешение проблем, публичные акции* не дают суще-

ственных различий между ОО и гражданскими ОО и, более того, их использование за последние 2–3 года увеличивалась у малого числа объединений.

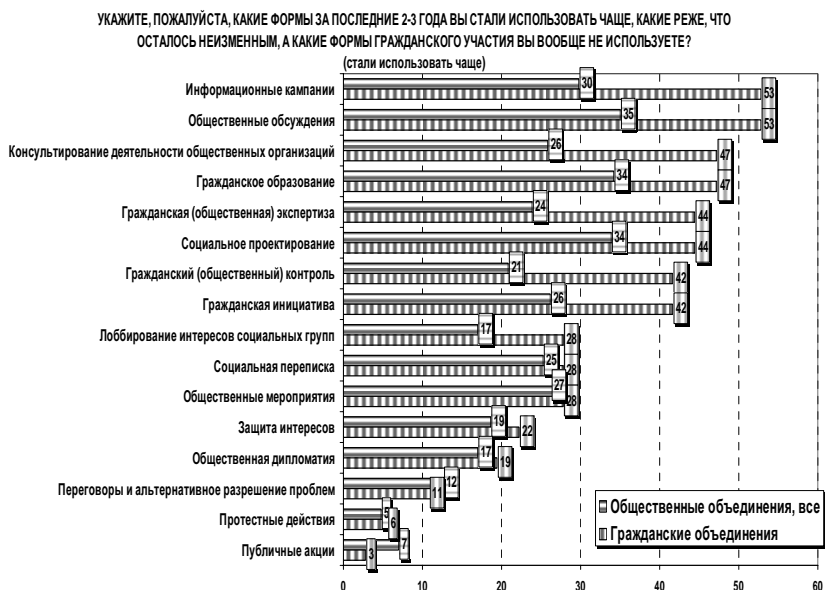


Рис. 1.

## Заключение

Таким образом, гипотеза исследования о росте протестных форм активности у гражданских общественных объединений в условиях ужесточения политико-правового режима не подтвердилась. Вместе с тем обнаружилось повышение активности гражданских ОО в публичных формах (*общественные обсуждения, гражданское образование, социальное проектирование, гражданская инициатива*) и более сложных, требующих специальных аналитических навыков и компетенций, символических «экспертных» капиталов (*информационные кампании, консультирование деятельности общественных организаций, гражданская (общественная) экспертиза, гражданский (общественный) контроль*).

## Литература

Бодрийяр Ж. Симулякры и симуляция / Simulacra and Simulation (англ.) / Simulacres et simulation (фр.) (1981, рус. пер. 1996).

Публичная политика в современной России: субъекты и институты: сб. статей / под ред. Н.Ю. Беляевой. М., 2006.

И.В. Задорин  
Исследовательская группа  
ЦИРКОН,  
Д.Г. Зайцев  
Национальный  
исследовательский  
университет  
«Высшая школа экономики»

## **ВОПРОСЫ ИДЕНТИФИКАЦИИ И САМОИДЕНТИФИКАЦИИ «ГРАЖДАНСКИХ ОБЪЕДИНЕНИЙ»<sup>1</sup>**

---

Сегодня общим местом в работах российских политологов и социологов стал тезис о слабости гражданского общества в современной России. Данный тезис подтверждается множеством проведенных исследований «третьего сектора» и гражданского общества России в целом (в том числе проектами Исследовательской группы ЦИРКОН).

Чтобы выйти из «замкнутого круга», когда модернизация «сверху» оказывается неэффективной, так как не поддерживается «инициативой снизу», потому что гражданское общество слабо (так как не «модернизированно»), необходимо рассматривать гражданское общество не в целом, а исследовать его части (сегменты), искать альтернативных (и «конгруэнтных») государству агентов модернизации внутри гражданского общества.

Таковыми «альтернативными» агентами модернизации могут быть «гражданские объединения» и социально ориентированные НКО.

Гражданская активность свойственна не всем НКО, а именно инициативным гражданским объединениям, способным выявлять и решать социальные проблемы самостоятельно, без оглядки на государственное финансирование. Это признается и учеными, и политиками, а в выступлениях Президента РФ все чаще содержатся призывы к активизации инновационного потенциала гражданского общества. Российские обществоведы по сей день утверждают, что гражданского общества в России нет, а возможно, и не может быть, в связи с отсутствием условий. В связи с этим необходимо анализировать те его ростки, которые существуют уже более 20 лет, выявить различные организационные формы гражданского участия, а также их адаптивность к меняющимся соци-

---

<sup>1</sup> Статья подготовлена в рамках междисциплинарного исследовательского проекта ГУ ВШЭ «Организационные формы гражданского участия в России: основные характеристики до и во время экономического кризиса» (проект поддержан Научным фондом ГУ ВШЭ, Программа «Учитель – ученики» 2010–2011 гг. № 10-04-0031).

альным условиям, в том числе в период экономического спада, а также спрогнозировать перспективы их развития.

Недавно принятый закон о социально ориентированных НКО, способных взять на себя часть функций по предоставлению социальных услуг гражданам страны, также требует четкой идентификации подобного рода организаций. Это необходимо не только для выявления данных потенциальных агентов модернизации, но и для принятия управленческих решений органами государственной власти, регулирующих их деятельность, оценки эффективности функционирования данного сегмента НКО. В настоящее время многие региональные органы власти испытывают трудности при фиксации статуса «социально ориентированный».

Статья основана на результатах социологического исследования в форме опроса представителей общественных объединений России. Опрос проводился в режиме он-лайн в декабре 2010 г. по регулярной панели НКО Исследовательской группы ЦИРКОН и базе общественных объединений кафедры публичной политики НИУ ВШЭ. В основе панели ЦИРКОН – базы заявителей на конкурсы грантовой поддержки НКО Общественной палаты РФ, базы НКО «ресурсных центров» России. База кафедры публичной политики НИУ ВШЭ представляет собой в основном общественные объединения, являвшиеся участниками проекта «Неполитические кампании по продвижению общественных интересов»<sup>2</sup>. Совокупная база охватывает ОО всех федеральных округов Российской Федерации и представлена самыми разнообразными формами объединения граждан. В опросе приняло участие более 300 представителей общественных объединений, в том числе представители неинституционализированных инициативных групп граждан.

Цель исследования – выявить и описать сегменты гражданского общества, имеющие потенциал инноваций и гражданского участия.

Задачи исследования:

- 1) разработать методику идентификации «гражданских объединений»;
- 2) разработать методику идентификации «социально ориентированных НКО»;
- 3) выявить организационные формы существования и активности гражданских объединений;
- 4) выявить организационные формы существования и активности социально ориентированных НКО;

---

<sup>2</sup> Подробнее см.: <http://www.interlegal.ru/projects> и <http://www.citizens.ru/>



5) определить факторы, влияющие на деятельность гражданских объединений и социально ориентированных НКО (в том числе фактор экономического кризиса).

В настоящей статье представлены результаты решения первой задачи исследования – описание разработанной методики и ее тестирования на данных конкретного опроса общественных объединений.

Перед авторами стояла задача проверки теоретических схем и разработок специалистов в области изучения гражданского общества, а именно тех критериев, которые закладываются в основу различения различных сегментов гражданского общества (гражданских объединений и социально ориентированных НКО), на конкретном эмпирическом материале. Прикладная задача – выдать понятные отличительные признаки сегментов гражданского общества, прежде всего, речь идет о социально ориентированных НКО, управленцам, которым в своей профессиональной практике необходимо различать данные сегменты. Кроме того, это будет способствовать сужению пространства для манипуляций управленцами в этой сфере (раз не ясно, кто это такие, то будем «наказывать» либо «поощрять» по собственному усмотрению).

Исходя из исследований и разработок кафедры публичной политики НИУ ВШЭ, была выстроена определенная схема идентификации гражданских общественных объединений. Минимально необходимыми признаками, характеристиками, которыми должны обладать и общественные, и гражданские объединения, являются самоорганизация, самоуправление, самообеспечение, а также наличие организационной идентичности. Согласно схеме, выделенных признаков реальных общественных объединений недостаточно для идентификации гражданских объединений. Последние характеризуются следующими дополнительными признаками: выражение общественно значимого интереса (в том числе решение актуальных общественных проблем), провозглашение и реализация «гражданской этики», использование публичных и открытых методов общественной работы, вовлеченность в политический процесс.

Отмеченные критерии позволяют выделять среди общественных объединений (ОО) «реальные», «неимитационные», самостоятельные ОО, а среди последних – гражданские, преследующие публичные цели, отстаивающие публичные интересы «во имя» достижения общего блага.

Однако выделенные «теоретические» критерии гражданских объединений при их переносе в социально-политическую реальность российского гражданского общества очевидно теряют свою строгость и не могут четко разделять один сегмент гражданского общества от другого. Ясно, что абсолютная самостоятель-

ность и гражданственность – недостижимый идеал. Поэтому *при анализе существующих общественных объединений мы можем говорить о большей или меньшей степени самостоятельности и/или гражданственности данного конкретного объединения и/или их групп.*

При разработке методики идентификации гражданских объединений каждый обозначенный выше критерий определения общественных и гражданских объединений был подвергнут процедуре операционализации – каждому критерию были найдены соответствующие показатели и индикаторы, которые впоследствии были преобразованы в вопросы анкеты обследования представителей общественных объединений.

Далее, при обработке и анализе полученных данных опроса представителей общественных объединений было построено восемь частных индексов по числу критериев, характеризующих степень *самостоятельности* общественного объединения (4 критерия самостоятельного ОО) и определяющих степень *гражданственности* общественного объединения (4 дополнительных критерия гражданского ОО).

### **1. Индекс самоорганизации ОО.** Складывался из трех показателей.

- Инициатива создания общественного объединения (ОО) исходит от граждан и ассоциаций.
- ОО учреждена гражданами или ассоциациями.
- Отсутствие поддержки создания общественного объединения властью, политическими организациями, их представителями.

### **2. Индекс самоуправления ОО.**

- Самостоятельная постановка задач перед ОО и определенных направлений деятельности.
- Самостоятельное определение способов решения поставленных перед ОО задач.
- Выборность руководства ОО (в объединениях больших размеров).
- Самостоятельный выбор руководства ОО.
- Самостоятельный контроль за исполнением решений ОО.
- Самостоятельное принятие бюджета объединения.

### **3. Индекс самостоятельности ОО.**

- Наличие собственных внутренних ресурсов у ОО (взносы учредителей, членов).

- Наличие возможностей увеличения внутренних собственных ресурсов ОО (собственная хозяйственная деятельность).

- Диверсифицированность источников доходов ОО (отсутствие доминирования одного источника доходов).

- Соответствие собственных ресурсов поставленным ОО задачам.

- Наличие у объединения собственного постоянного помещения (офиса).

#### **4. Индекс организационной идентичности ОО.**

- Наличие механизма (алгоритмов и процедур) фиксации принадлежности к ОО.

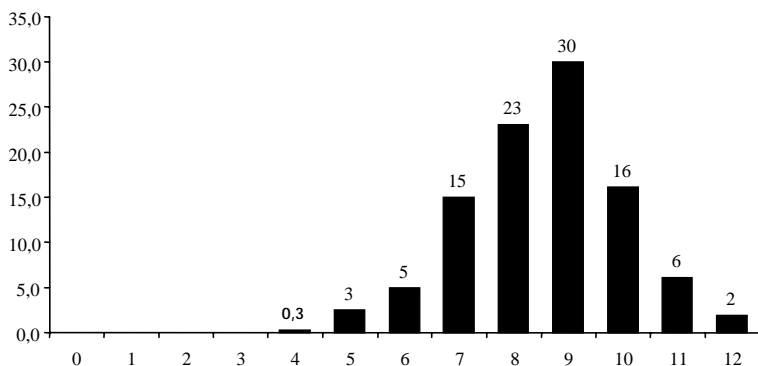
- Наличие определенных качеств у участников ОО, которые требуются, чтобы быть участником ОО (быть единомышленниками, разделять цели организации и т.п.).

- Наличие постоянной коммуникации между членами объединения.

Каждый показатель степени самостоятельности для каждого объединения преобразовывается в бинарную шкалу, где ноль – объединение не соответствует данному показателю, единица – соответствует. Общий индекс самостоятельности общественного объединения подсчитывался как сумма *нормированных* частных индексов так, что диапазон возможных изменений значений общего индекса составил от 0 до 12, где 0 – самая низкая степень самостоятельности ОО, 12 – самая высокая степень самостоятельности ОО (см. рис. 1).

На рис. 1 представлено распределение опрошенных общественных объединений в зависимости от самооценки степени их самостоятельности.

Интересно, что распределение смещено во вторую половину шкалы (от 0 до 12) индекса самостоятельности ОО. То есть подавляющее большинство опрошенных ОО скорее самостоятельные, чем несамостоятельные. Вместе с тем ОО с высокой степенью самостоятельности немного – 7 опрошенных ОО (2%). (Хотя абсолютно несамостоятельных ОО в нашей выборке вовсе нет.) Незначительное количество ОО по краям шкалы и тот факт, что большинство опрошенных ОО приобретают центральные значения индекса самостоятельности, могут говорить о том, что выделенные теоретические критерии и эмпирические показатели адекватно идентифицируют самостоятельные ОО, а методика в целом работает. Также методика позволяет выделить группу самостоятельных общественных объединений (со значением индекса от 10 до 12), таких оказалось 24% опрошенных ОО. Эту цифру можно считать оценкой «сверху» объема данного сегмента гражданского общества (самостоятельных общественных объединений).



**Рис. 1.** Доля организаций с определенным значением индекса самостоятельности

Для построения общего индекса гражданственности ОО также рассчитывались частные индексы по критериям идентификации гражданских объединений и расшифровывающим их показателям.

**1. Выражение общественно значимого интереса (в том числе решение актуальных общественных проблем).**

- Наличие определенного интереса у граждан, заявленного и зафиксированного в публичном пространстве.
- Наличие одобрения (доверия к, позитивного отношения к) деятельности ОО гражданами.
- Наличие у ОО вида деятельности, связанного с выявлением, изучением, анализом общественных проблем.
- Предоставление услуг населению безвозмездно.
- Стремление расширить общественную поддержку деятельности.
- Соотнесенность интересов объединения с актуальной общественной проблематикой.

**2. Провозглашение и реализация «гражданской этики».**

- Не ориентированность на коммерческий успех, извлечение прибыли.
- Разделение принципов демократии, уважения прав человека.
- Внимание к общественным проблемам.
- Чувство солидарности с гражданами.
- Готовность жертвовать чем-либо, идти на риск ради реализации своей цели (работать без зарплаты, в неблагоприятной политической, экономической, социальной среде).

- Ориентированность на помощь нуждающимся, слабым категориям граждан.

- Готовность и склонность к коллективным действиям.
- Готовность и склонность к поиску партнерских объединений.
- Неприменение насильственных методов в своей деятельности.
- Допущение участие только в мирных акциях протеста.
- Соблюдение закона в деятельности ОО.

### **3. Использование публичных и открытых методов общественной работы.**

- Информационная и финансовая прозрачность и открытость объединения.
- Публикация информации о деятельности объединения.
- Наличие элементов открытости в объединении.
- Открытость отдельных мероприятий ОО для участия граждан – не членов ОО.
- Респонсивность ОО – готовность ОО к ответу на запросы граждан – не членов ОО.

- Публичность освещения действий ОО.

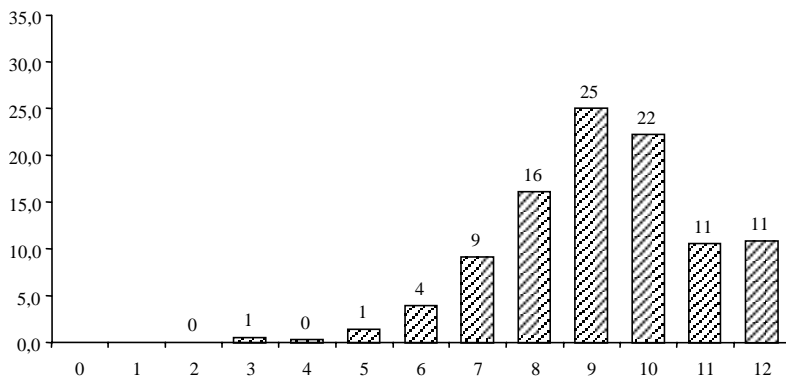
### **4. Вовлеченность в политический процесс.**

- Стремление к политическому участию.
- Стремление к политическому влиянию.
- Реальное политическое участие.

Каждый показатель степени гражданственности для каждого объединения преобразовывается в бинарную шкалу, где ноль – объединение по собственной самооценке не соответствует данному показателю, единица – соответствует. Общий индекс гражданственности общественного объединения подсчитывался как сумма *нормированных* частных индексов так, что диапазон возможных изменений значений общего индекса составил от 0 до 12, где 0 – самая низкая степень гражданственности ОО, 12 – самая высокая степень гражданственности ОО (см. рис. 2).

На рис. 2 представлено распределение опрошенных общественных объединений в зависимости от самооценки степени их гражданственности. Интересно, что распределение также смещено во вторую половину шкалы (от 0 до 12) индекса гражданственности ОО, как было и в случае с индексом самостоя-

тельности. Здесь мы не можем оценить соответствие общественных объединений критериям гражданского ОО, так как последнее предполагает сочетание признаков самостоятельности и гражданственности. Однако можно говорить о масштабах «имитации» гражданской деятельности, ее декларативности у многих опрошенных общественных объединений и отсутствии в реальной практике деятельности ОО. И тот факт, что более 90% опрошенных ОО получили значения индекса гражданственности 7 баллов и более, говорит в пользу больших масштабов такой «имитации».



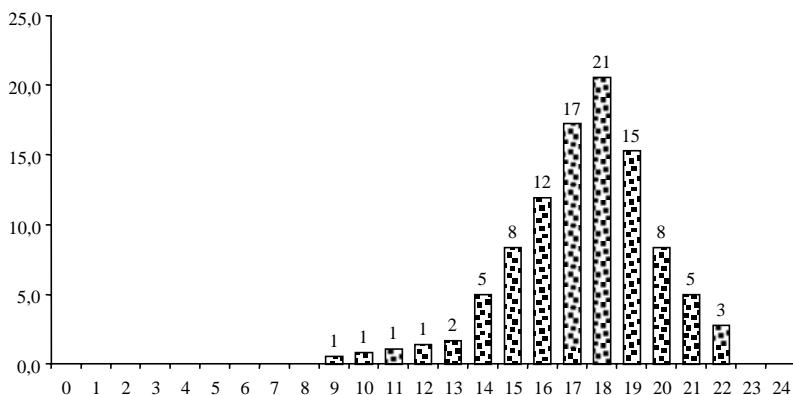
**Рис. 2.** Доля организаций с определенным значением гражданственности

Также был рассчитан итоговый индекс по всем показателям самостоятельности и гражданственности ОО. Итоговый индекс самостоятельности и гражданственности – сумма *нормированных* частных индексов, диапазон возможных изменений значений итогового индекса составил от 0 до 24, где 0 – самая низкая степень самостоятельности и гражданственности ОО, 24 – самая высокая степень самостоятельности и гражданственности (см. рис. 3).

С точки зрения идентификации гражданских общественных объединений результаты исследования, показанные на рис. 3, кажутся более релевантными. Снова распределение смещено во вторую половину шкалы (от 0 до 24) индекса самостоятельности и гражданственности ОО. То есть подавляющее большинство опрошенных ОО скорее гражданские, чем не гражданские (что может быть связано с отмеченными выше распространенными и «одобряемыми» явлениями «имитации» и декларации гражданской деятельности ОО).

Вместе с тем ОО с высокой степенью самостоятельности и гражданственности немного – 10 опрошенных ОО (3%). (Хотя абсолютно несамостоя-

тельных и негражданских ОО в нашей выборке вовсе нет, так же как и абсолютно гражданских.) Незначительное количество ОО по краям шкалы и тот факт, что большинство опрошенных ОО приобретают центральные значения индекса самостоятельности и гражданственности, может говорить о том, что выделенные теоретические критерии и эмпирические показатели адекватно идентифицируют самостоятельные и гражданские ОО, а методика в целом работает. Также методика позволяет выделить группу самостоятельных гражданских общественных объединений (со значением индекса от 20 до 24), таких оказалось 16% опрошенных ОО. Эту цифру можно считать оценкой объема данного сегмента гражданского общества (самостоятельных гражданских общественных объединений) «сверху».



**Рис. 3.** Доля организаций с определенным значением интегрального индекса самостоятельности – гражданственности

Анализ корреляции между частными индексами самостоятельности и гражданственности показывает, что в целом каждый из них оказывается значимым и по-своему дифференцирующим изучаемые общественные объединения. Коэффициенты корреляции между восемью частными индексами крайне невелики, что свидетельствует об их определенной независимости. Единственное исключение – обнаруженная взаимосвязь между индексами провозглашения, реализации гражданской этики и использования публичных и открытых методов общественной работы. Однако то, что общественное объединение, разделяющее принципы гражданской этики, провозглашает и практикует принципы открытости и прозрачности в своей деятельности, кажется естественным и понятным явлением, отражающим реальное положение вещей.

Авторы индекса самостоятельности и гражданственности общественных объединений допускают совершенствование методики за счет внесения в модель данных иной природы (не субъективных, не декларативных), основанных, например, на анализе документов, официальной статистики «третьего сектора» (объективных). Считаем, что включение данных разной природы будет способствовать более точному измерению степени самостоятельности и гражданственности общественных объединений.



# ДЕМОГРАФИЯ

---



Ю.Ю. Шитова,  
Ю.А. Шитов  
Международный университет  
природы, общества и человека  
«Дубна»

# КОЛИЧЕСТВЕННЫЕ ОЦЕНКИ ВЗАИМОСВЯЗИ ПОТОКОВ МАЯТНИКОВОЙ ТРУДОВОЙ И БЕЗВОЗВРАТНОЙ МИГРАЦИЙ В ПОДМОСКОВЬЕ

---

В настоящей работе исследовались корреляции между потоками маятниковой трудовой миграции (МТМ) и обычной безвозвратной миграции в Московской области (МО) на микро- и макроуровнях 2001 г. Обнаружены значимые взаимосвязи: примерно 3% жителей МО, работающих в Москве, переезжают жить в Москву, и около 10% жителей МО, работающих в других районах, меняют место жительства внутри МО.

## Введение

Влияние маятниковой трудовой миграции на динамику трудовых ресурсов, экономику регионов, в особенности крупных агломераций, нельзя не учитывать в региональной экономике современной России, что было показано в ряде наших предыдущих исследований Московской агломерации [Шитова, 2008, 2009]. Под МТМ понимается ежедневное челночное перемещение маятниковых трудовых мигрантов (МТМ)<sup>1</sup> между местами работы и проживания, находящимися в разных экономических субъектах и, как правило, удаленных друг от друга.

Следующим этапом исследования стало изучение взаимосвязи МТМ и обычной миграции. Структура и динамика обоих этих процессов отражает и на-

---

<sup>1</sup> Для обозначения маятниковой трудовой миграции и маятниковых трудовых мигрантов мы будем использовать одинаковую аббревиатуру МТМ, поскольку из контекста понятно, что имеется в виду в каждом конкретном случае.

прямою влияет на состояние трудовых ресурсов региона, а значит, и на состояние экономики в целом. Тем самым количественные оценки обоих потоков и их взаимовлияния представляются актуальными для задач прогнозирования и управления региональной экономики. Далее будут представлены методика и результаты, предваряемые анализом современного состояния научных исследований по данной проблематике.

## **Статус исследований связи между МТМ и обычной миграцией**

И МТМ, и невозвратная миграция являются факторами мобильности (подвижности) населения, напрямую определяющими ситуацию с трудовыми ресурсами региона, а именно оттоками и перетоками трудового капитала. К примеру, по данным опроса, проведенного Министерством экономики Московской области (МО), недостаток квалифицированного персонала назван существенным и основным факторами, препятствующими технологическим инновациям, тридцатью и десятью процентами организаций МО соответственно (Минэк МО, 2008 г.). При этом, исследования показывают, что МТМ за последние 10–20 лет существенно выросла, а ее масштаб в ряде стран близок или превышает объем ежегодных безвозвратных переселений [Рыбаковский, 2001]. Поскольку группы реальных и потенциальных участников обоих процессов сильно перекрываются, возникает закономерный вопрос взаимовлияния МТМ и обычной миграции, которому посвящено достаточно много научных исследований. Спектр мнений авторов по данному поводу максимально широк – от отсутствия связи до идентичности обоих явлений, что подробно обсуждается далее.

**МТМ не связана с миграцией.** Радикальное отрицание базируется на том факте, что в отличие от безвозвратных переездов МТМ не вызывает изменений в размещении производительных сил, поэтому в отношении МТМ неправомерно использовать сам термин «миграция» [Раковский, 1971]. На наш взгляд, это слишком академичный, абстрактно-теоретический подход, не позволяющий проводить практические исследования.

**МТМ связана с миграцией.** Большинство авторов все же признают связь между МТМ и миграцией, предлагая различные теоретические обоснования.

Часть авторов трактуют **МТМ как форму обычной миграции.** Такого мнения придерживается М. Курман [Курман, 1973, с. 115]: «МТМ – это адаптированная форма стационарной миграции в условиях образования и развития городской агломерации... В перспективе МТМ превратится из средства приспособления к сложившимся в центре агломерации стесненным условиям для про-

живания в средство, обеспечивающее более удобное налаживание быта и досуга трудящихся». Данный подход в чистом виде является стационарным (структурным), поскольку фиксирует существующее положение дел с МТМ и миграцией как элементами целого, не позволяя исследовать их взаимовлияние.

Поэтому наиболее популярным является динамичный подход в духе того, что *МТМ и миграция – суть различные, но взаимосвязанные процессы*. При этом предметом исследования является характер этой взаимосвязи. Среди многообразия мнений можно выделить два основных:

- *МТМ и миграция – конкурирующие, взаимозамещающие, взаимодополняющие процессы*. «Существует конкуренция безвозвратной и маятниковой миграции по направлениям село-город, город-город, что имеет особое значение с точки зрения их взаимозамещаемости» [Хорев, Моисеенко, 1974].

- *МТМ является претечей обычной миграции*. «МТМ – это скрытые горожане» [Лаппо, 1961, с. 93; Раковский, 1971].

Следует отметить, что в научных работах можно встретить разные комбинации указанных выше основных вариантов, включая смешанные структурно-динамические варианты трактовок. «МТМ есть промежуточная или незавершенная форма полной миграции. Маятниковые мигранты постепенно перебираются в города» [Орлова, Ситник, 1981, с. 14–15]. Существует интересная смешанная модель [Марксоо, 1977], в которой по связи с безвозвратной миграцией маятниковые поездки можно разделить на две части. Первая из них – стационарное, в основном, самостоятельное явление, на возникновение которого безвозвратная миграция существенно не влияет. Вторая часть маятниковых поездок при этом разделяется на три подгруппы по временному фактору:

- маятниковые поездки в качестве предыдущей стадии безвозвратной миграции;
- маятниковые поездки как промежуточная стадия между двумя актами безвозвратной миграции;
- маятниковые поездки в качестве последней стадии безвозвратной миграции.

**Прикладные исследования.** Выявлению степени взаимосвязи между МТМ и обычной миграцией посвящен ряд прикладных исследований. В частности, взаимодополняемость МТМ и миграции была подтверждена в исследовании рынка труда Северной Каролины (США) [Renkow, 2003]. В изучении мобильности шведских работников после участия в разных программах занятости была выявлена прямая связь – более высокий уровень МТМ предопределяет более низкий

уровень обычной миграции. Та же отрицательная корреляция между миграцией и МТМ получена в обследовании 290000 шведов в 1994–1995 гг. [Eliasson, Lindgren, Westerlund, 2003]. В рассмотренном исследовании установлено эмпирически, что появление возможности работы в соседнем районе значительно повышает вероятность выбора МТМ как альтернативы обычной миграции. Маятниковые поездки, как первая ступень к постоянному переезду в город, являются важной чертой МТМ в Литовской ССР [Лукошевичоте, 1981, с. 75].

Авторы некоторых работ не столь категоричны в отношении связи МТМ и обычной миграции. Например, в ходе опросов датских работников в 1990 и 1998 гг. по поводу смены места работы исследовалась связь между подвижностью в выборе работы и места жительства (в стандартных моделях первая приоритетна по отношению ко второй) с точки зрения длительности МТМ. Эмпирический анализ показал [Rouwendal, van der Vlist, 2005], что мобильности разных типов следуют одна за другой. Однако зависимость оказалась незначимой, поэтому исследование не смогло однозначно подтвердить упоминающуюся выше гипотезу, что подвижность на рынке труда вызывает подвижность на рынке жилья. Косвенное подтверждение следования обычной миграции вслед за МТМ получили авторы работы [Козлов, Польский, Хасдан, 1981]. Согласно полученным ими данным, численность трудящихся, работающих в Минске, но имевших иногороднюю прописку, была в 1971 г. в девятнадцать раз больше, чем тех, кто имел прописку, но работал в пригороде. В 1978 г. эти группы различались лишь в семь раз.

В отношении России нам известна только одна «современная» оценка, согласно которой в «последней четверти XX века» в СССР соотношение между постоянной и маятниковой миграцией составляло 2:3 [Хорев, Чапек, 1978]. На наш взгляд, эта оценка завышена. Прежде всего, данная оценка – явно прогнозная<sup>2</sup>, Возможно, это связано с резким всплеском безвозвратной миграции в конце советского периода, т.е. в начале реформ по различным направлениям: республики СССР – Россия, Север-Восток – Центр-Юг, Россия – граница.

В последнее время большое внимание МТМ уделяется в ЕС в плане интеграции новых стран. В ЕС возлагают большие надежды на МТМ как способ решения проблемы безработицы, а также фактор сдерживания наплыва безвозвратных мигрантов из новых менее развитых стран в более развитые страны еврозоны [Пачи, 2007].

---

<sup>2</sup> Что очевидно из сравнения даты публикации с периодом, за который дается оценка.

## Методика

В настоящей работе мы исходили из смешанной модели взаимоотношений между обычной миграцией и МТМ. В первую очередь, МТМ является устойчивым динамическим процессом, неотъемлемой частью экономического пространства крупных агломераций. Вместе с тем МТМ стимулирует (порождает) обычную миграцию, поскольку определенная доля маятниковых мигрантов принимает решение переселиться по месту работы. В этой связи следует ожидать положительной корреляции между потоками МТМ и обычной миграции, потому что чем выше количество МТМ, тем большее их число переходит в разряд безвозвратных мигрантов. В качестве исходных данных в разрезе районов Подмоскovie мы использовали микропоказатели [Шитова, 2008]: количество жителей района, работающих в Москве ( $N_{МОС}$ ) и в других районах МО ( $N_{МО}$ ), количество приезжающих на работу в район жителей других подмосковных районов ( $N_{ИЗМО}$ ). А также макроданные Мособлкомстата (2001): количество мигрантов, прибывших в район из МО ( $M_{ИЗМО}$ ), а также уезжавших из района в МО ( $M_{МО}$ ) и за пределы области ( $M_{ЗАМО}$ ). В отношении последнего показателя мы полагаем, что поток мигрантов из МО в Москву ( $M_{МОС}$ ) составляет подавляющую часть мигрантов за пределы области ( $M_{ЗАМО}$ ). Согласно предложенной модели между указанными потоками МТМ и обычной миграции должны существовать следующие корреляционные зависимости:

$$M_{МОС} \approx M_{ЗАМО} = A \cdot N_{МОС} + B, \quad (1a)$$

$$M_{ИЗМО} = C \cdot N_{ИЗМО} + D, \quad (1б)$$

$$M_{МО} = E \cdot N_{МО} + F. \quad (1в)$$

Формула (1a) показывает взаимосвязь между потоками МТМ и обычной миграции из МО в Москву. Формулы (1б) и (1в) связывают соответственно входящие и исходящие потоки маятниковой межрайонной трудовой миграции в МО (МТМ) и обычной миграции в пределах МО. Поскольку обе формулы описывают один и тот же процесс, только с разных его сторон, то следует ожидать равенства корреляционной связи в обеих формулах:

$$C \approx E. \quad (2)$$

Проверка условия (2) представляется особо интересной, поскольку корреляционные зависимости (1б) и (1в) получаются на независимых друг от друга исходных данных. И выполнение (2) является хорошей перекрестной проверкой выдвигаемых гипотез, повышает надежность получаемых результатов.

Для оценки систематической погрешности (1) мы учитываем два наиболее значительных фактора (согласно предыдущим исследованиям): расстояние от

района до Москвы  $R$  и размер региона в виде количества трудоспособного населения  $N_{TH}$ . Расчет многопараметрической регрессии осуществляем по формуле:

$$M_{3AMO} = A_1 \cdot N_{MOC} + A_2 \cdot R + A_3 \cdot N_{TH} + B, \quad (3)$$

а именно, значимость коэффициентов  $A_2$  и  $A_3$  является проверкой существенности влияния выбранных факторов на взаимосвязь миграционных потоков.

Из всех параметров регрессий (1) наибольший практический интерес представляют коэффициенты эластичности  $A$ ,  $C$ , и  $E$ , которые можно интерпретировать как доли маятниковых трудовых мигрантов, ставших обычными мигрантами. Данная трактовка верна при условии справедливости выдвигаемой нами гипотезы, что основную долю обычных мигрантов составляют МТМ, переезжающие ближе к месту работы.

Отдельно следует отметить возможное влияние временного фактора на исследуемые процессы. Прежде чем мигрировать работник некоторое время  $T_{MTM}$  является МТМ. Поэтому максимальная достоверность результатов корреляции должна получаться для данных:

$$N_{OM}(T) = K_1 \cdot N_{MTM}(T - \langle T_{MTM} \rangle) + K_2, \quad (4)$$

где временным лагом является  $\langle T_{MTM} \rangle$  – среднее время пребывания мигранта в статусе МТМ,  $N_{MTM}$  и  $N_{OM}$  – потоки МТМ и обычной миграции соответственно. К сожалению, определить величину  $\langle T_{MTM} \rangle$  из имеющихся данных не представляется возможным. Вместе с тем в условиях стационарности (динамического равновесия) сложившихся миграционных потоков, отсутствия резких колебаний их динамики регрессионные модели (1) и (4) должны давать близкие результаты.

## Результаты

Исходные данные для расчетов сведены в табл. 1, а результаты расчетов регрессионных моделей (1) представлены в табл. 2. При расчетах исключались районы с аномально большими показателями плеча (*centered leverage value*) и расстоянием Кука (*Cook's distance*), оказывающие чрезмерное воздействие на коэффициенты регрессии. Графики регрессионных зависимостей (матрицы рассеяния) представлены на рис. 1, 2. Анализ полученных данных позволяет сделать ряд интересных выводов.



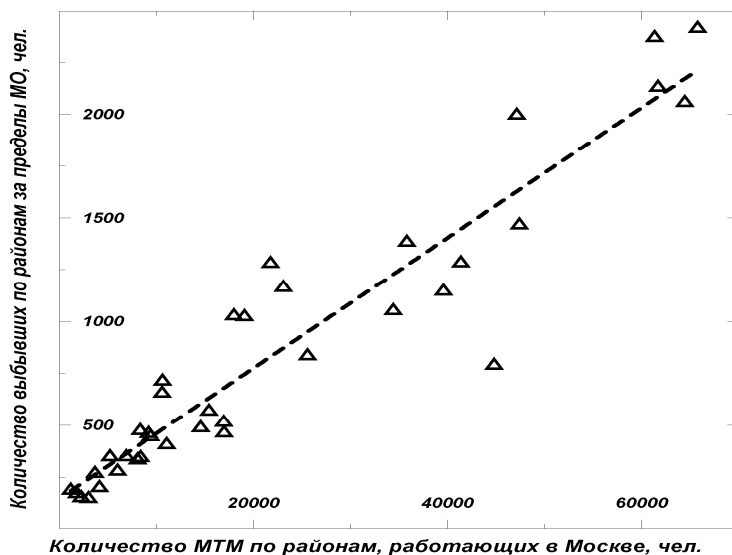
Таблица 1.

Потоки МТМ и обычных мигрантов  
в разрезе районов Подмосковья в 2001 г.

№	Район	Расстояние до Москвы R, км <sup>1)</sup>	Работоспособное население <sup>2)</sup> , N <sub>мтм</sub> , чел.	Микроданные: МТМ			Макроданные: обычная миграция		
				место работы жителей района, чел.		МТМ из МО, N <sub>мтм,мо</sub> , чел.	из МО в район, M <sub>мо</sub>	из района в МО, M <sub>мо</sub>	из района за пределы МО, M <sub>мтм</sub>
				Москва, N <sub>мос</sub>	другой район МО, N <sub>мо</sub>				
1	Балашихинский	21,9	215574	65770	5489	9146	1860	1492	2412
2	Волоколамский	99,0	30071	4152	1718	640	254	239	200
3	Воскресенский	90,0	92650	14552	4661	2547	693	804	487
4	Дмитровский	80,0	88910	16946	5079	2095	580	612	513
5	Домодедовский	30,0	73126	15428	2580	3283	916	709	568
6	Егорьевский	99,0	62983	8089	2160	1048	869	539	333
7	Зарайский	140,0	26906	3026	1552	165	134	140	147
8	Истринский	50,0	69317	16968	4571	3045	422	485	462
9	Каширский	124,0	43549	6014	2701	1492	147	175	279
10	Клинский	94,0	80246	8351	2911	4075	533	580	474
11	Коломенский	92,0	114915	10641	3370	4824	781	748	712
12	Красногорский	21,0	88778	25581	2488	6817	981	636	834
13	Ленинский	29,0	79224	44797	5431	3166	921	503	789
14	Лотошинский	133,0	10478	1179	398	221	30	73	187
15	Луховицкий	115,0	37969	3686	2173	1588	228	398	267
16	Люберецкий	20,4	201192	61677	6864	9140	1863	1538	2130
17	Можайский	117,0	39727	5242	1342	3602	380	471	347
18	Мытищинский	25,1	198087	64433	8670	35075	1384	1207	2056
19	Наро-Фоминский	75,0	103838	21757	2753	2530	293	602	1280
20	Ногинский	57,1	228332	34397	7493	10100	897	1032	1052
21	Одинцовский	26,3	163496	47394	4091	13512	1071	1275	1465
22	Озерский	141,0	22635	2276	1546	224	88	96	151
23	Орехово-Зуевский	97,0	148431	23088	4701	3566	643	834	1164
24	Павлово-Посадский	74,4	62492	11073	3068	902	239	262	405
25	Подольский	38,4	230686	47107	5206	6332	1587	1563	1996
26	Пушкинский	40,5	164093	61333	29760	12936	2954	2537	2368
27	Раменский	42,3	194238	39588	7443	19060	1162	1115	1146
28	Рузский	91,0	40258	6906	3738	1067	269	404	347
29	Сергиево-Посадский	80,0	137856	19067	6694	2018	810	1063	1023
30	Серебряно-Прудский	178,0	14238	1611	1379	82	42	69	114
31	Серпуховский	101,4	133217	17995	3641	1804	250	607	1027
32	Солнечногорский	69,0	73776	57458	6548	4775	367	479	992
33	Ступинский	111,0	64700	8395	2194	2804	83	334	343
34	Талдомский	128,0	70597	9394	2298	1624	241	369	445
35	Химкинский	24,0	103915	41364	3873	9955	727	560	1283
36	Чеховский	74,0	57134	10589	4441	1537	592	527	655
37	Шатурский	148,9	56674	9215	2134	1253	363	397	460
38	Шаховской	130,0	14418	1826	663	167	94	100	170
39	Щелковский	36,0	169457	35814	28431	5350	554	1027	1382

<sup>1)</sup> Расстояние от Москвы до районного центра. <sup>2)</sup> Мужчины 16–59 лет и женщины 16–54 лет.

Примечание. Данные по МТМ: [Шитова, 2008], обычным мигрантам: [Мособлкомстат, 2001].



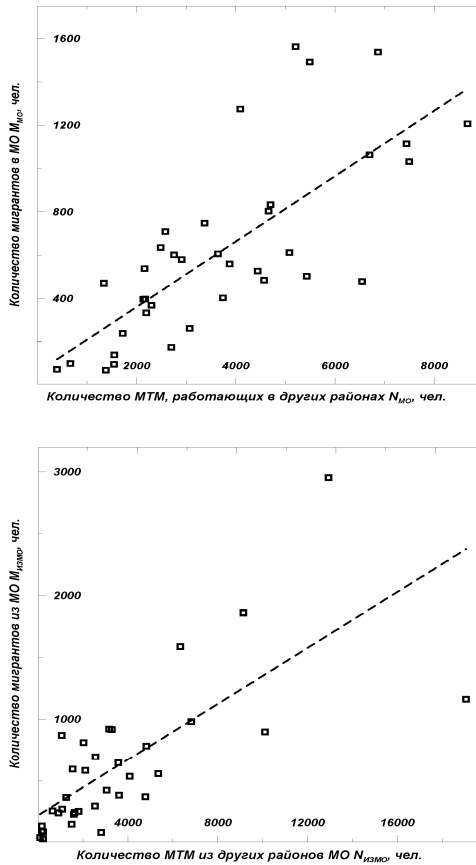
**Рис. 1.** Взаимосвязь между МТМ, работающими в Москве, и жителями района, выбывшими за его пределы

**Миграция МО – Москва.** В этом направлении между МТМ и обычной миграцией обнаружена корреляционная зависимость (формула (5а) в табл. 2 и рис. 1) с очень высокой степенью детерминированности ( $r = 0,8$ ). Из нее следует, что примерно 3% маятниковых трудовых мигрантов из Подмоскovie, работающих в Москве, принимают решение переселиться в столицу.

**Миграция внутри МО.** В этом случае также обнаружена статистически значимая связь между МТМ и обычной миграцией внутри МО (формулы (5б, в) в табл. 2 и рис. 2), хотя и менее ярко выраженная ( $r \approx 0,55$ ), чем в предыдущем случае.

**Таблица 2.** Результаты расчетов регрессионных моделей (1) по данным табл. 1 (приведены статистические ошибки на уровне достоверности 67%)

Корреляционные коэффициенты	Коэффициент детерминации $r$	Районы, исключенные из расчетов регрессии	Нумерация
$A = 0,027 \pm 0,003$	0,80	Солнечногорский, Серебряно-Прудский	5а)
$B = 213 \pm 101$			
$C = 0,08 \pm 0,02$	0,54	Мытищинский, Химкинский, Одинцовский	5б)
$D = 316 \pm 101$			
$E = 0,11 \pm 0,03$	0,58	Пушкинский, Щелковский	5в)
$F = 217 \pm 116$			



**Рис. 2.** Взаимосвязь между исходящими из районов (вверху) и входящими (внизу) в районы потоками ММТМ и обычной миграции

Основная причина слабости связи – ММТМ процесс существенно меньше (в 5–6 раз) доминирующего потока МО – Москва, поэтому влияние второстепенных неучтенных факторов на результаты регрессии существенно выше. Вместе с тем коэффициенты эластичности  $C$  (5б) и  $E$  (5в) оказались сравнимыми между собой в пределах статистических погрешностей, что подтверждает гипотезу (2). С учетом независимости данных, использовавшихся в регрессионных расчетах моделей (1б) и (1в), это позволяет нам говорить о надежности полученного результата: примерно 10% подмосковных жителей, работающих маятниковым способом в другом районе МО, решают сменить место жительства

внутри области. Мы предполагаем, что они переезжают ближе к месту работы<sup>3</sup>. Более высокий процент активности ММТМ в плане перехода в разряд невозвратных мигрантов (в 3,3 раза выше, чем для МТМ Москвы), на наш взгляд, связан с тем, что издержки переселения внутри МО существенно ниже, чем переезд в Москву. Вместе с тем полученная величина меньше оценки отношения безвозвратной к маятниковой миграции, в последней четверти XX в. на уровне ~67% [Хорев, Чапек, 1978]. Как уже отмечалось, возможные причины расхождений связаны с тем, что структура и характер МТМ в начале XXI в. кардинально изменились в связи с бурными процессами, происходившими в России в 90-х годах прошлого века.

В завершении работы была опробована многопараметрическая регрессионная модель (3) методом пошагового включения предикторов в порядке убывающей значимости. В результате, единственной значимой независимой переменной регрессии оказался поток МТМ ( $N_{МОС}$ ), в то время как расстояние от района до Москвы ( $R$ ) и размер региона в виде количества трудоспособного населения ( $N_{ТН}$ ) были автоматически исключены из регрессии как незначимые. Это означает, что эти параметры, являвшиеся значимыми в других наших исследованиях МТМ, не вносят существенной систематической погрешности в расчеты настоящей работы.

Перспективы предложенной методики связаны с исследованием временной динамики выявленной взаимосвязи. Сдерживающим фактором при этом является отсутствие информации. При наличии необходимых микроданных по МТМ и, особенно, по обычной миграции (к примеру, распределение мигрантов внутри МО по парам район выбытия-прибытия), расширение методики расчетов не представляет сложности.

## Заключение

Результаты, полученные в настоящей работе, говорят в пользу гипотезы о том, что МТМ порождает обычную миграцию. Около 3% МТМ из МО в итоге переселяются в Москву, и примерно 10% жителей МО, работающих не в своем районе (ММТМ), решают сменить место жительства внутри МО, по нашему мнению, переселяясь ближе к месту работы. Было установлено, что такие потенциально важные факторы влияния, как расстояние от района до Москвы и размер региона, не вносят существенную систематическую погрешность в рас-

---

<sup>3</sup> Из имеющихся данных установить направление миграции невозможно, поэтому мы выдвигаем это положение в качестве гипотезы.

четы. Оценка взаимосвязи ММТМ и обычной миграции была проверена на основе методики перекрестной проверки путем расчетов исходящих/входящих потоков, результаты которой совпали в пределах статистических погрешностей. Это позволяет говорить о надежности полученного результата.

Предложенная методика расчетов имеет хорошие перспективы дальнейшего развития при условии наличия необходимых данных.

## Литература

Инновационная деятельность в Московской области: информационно-аналитический сборник. Министерство экономики Московской области, 2009.

*Козлов Г., Польский С., Хасдан И.* Маятниковая миграция сельского населения. М.: Финансы и статистика, 1981. С. 53–61.

*Курман М.В.* Роль маятниковой миграции населения и методы ее изучения // Миграция населения РСФСР. М., 1973.

*Лаппо Г.М.* Расселение в пригородных зонах. М.: Мысль, 1971. С. 89–102.

*Лукошевичюте Я.* Маятниковая миграция сельского населения / под ред. Д. Валентей. М.: Финансы и статистика, 1981. С. 70–76.

*Марксоо А.* Учен. записки Тарт. гос. ун-та. Вып. 432. Тарту, 1977. С. 126–170.

*Орлова Г., Ситник Л.* Маятниковая миграция сельского населения / под ред Д. Валентей. М.: Финансы и статистика, 1981.

*Пачи П. и др.* Внутренняя мобильность трудовых ресурсов и дисбаланс рынков труда // Beyond Transition, Всемирный банк и ЦЭФИР. Январь–март 2007. С. 8–9. (<http://www.cefir.ru/download.php?id=1009>)

*Раковский С.Н.* Расселение в пригородных зонах // Вопросы географии. 1971. № 97. С. 125–139.

*Рыбаковский Л.Л.* Миграция населения. Три стадии миграционного процесса. РГИУ, 2001. (<http://www.i-u.ru/biblio/archive/migracia>)

Социально-экономическое положение муниципальных образований Московской области: стат. сб. М.: Мособлкомстат, 2001.

*Хорев Б.С., Моисеенко В.М.* Миграционная подвижность населения в СССР. М.: Статистика, 1974.

*Хорев Б.С., Чанек В.Н.* Проблемы изучения миграции населения. М., 1978.

*Шутова Ю.Ю., Шутов Ю.А.* Регион: экономика и социология. 2008. № 4. С. 119–137.

*Шутова Ю.Ю.* Экономическая наука современной России. 2009. № 4. С. 99–106.

*Eliasson K., Lindgren U., Westerlund O.* Geographical Labour Mobility: Migration or Commuting? // Regional Studies. 2003. Vol. 37. Iss. 8. P. 827–837. (<http://search.epnet.com/login.aspx?direct=true&db=bth&an=11094199>)

*Renkow M.* Employment Growth, Worker Mobility, and Rural Economic Development // American Journal of Agricultural Economics. 2003. № 85 (2). P. 503–513.

*Rouwendaal J., van der Vlist A.* A Dynamic Model of Commutes // Environment and Planning A. 2005. Vol. 37. P. 2209–2232.

Е.С. Вакуленко,  
Н.В. Мкртчян,  
К.К. Фурманов  
Национальный  
исследовательский  
университет  
«Высшая школа  
экономики»

# **МЕЖРЕГИОНАЛЬНАЯ МИГРАЦИЯ В РОССИИ: МОДЕЛИРОВАНИЕ СВЯЗИ С СОЦИАЛЬНО- ЭКОНОМИЧЕСКИМИ ИНДИКАТОРАМИ И ВЛИЯНИЕ ФАКТОРА РАССТОЯНИЯ<sup>1</sup>**

---

Миграция населения – процесс, в котором отражаются происходящие в стране события, и поэтому очень важно его изучать и следить за его динамикой. С одной стороны, миграция является индикатором социально-экономической ситуации в стране и ее регионах, с другой стороны – процессом, оказывающим существенное влияние на демографическую и социальную структуру населения мест выхода и вселения мигрантов, определяющим состояние региональных и локальных рынков труда. Для успешного проведения социально-экономической политики необходимо уметь прогнозировать величину и направление миграционных потоков, а для этого нужно понимать особенности внутрисероссийской миграции и факторы, ее определяющие. Однако в современной России связи между миграцией и экономикой остаются во многом неизученными, это касается как международной, так и внутривострановой миграции. Не в последнюю очередь такая ситуация возникла благодаря недостатку информации о разных формах миграции населения [Чудиновских 2005; Мкртчян, 2009].

На данный момент существует ряд исследований, посвященных эконометрическому анализу миграции в России, в которых осуществлены попытки моделирования миграционных потоков между регионами [Gerber, 2005, 2006; Андриенко, Гуриев, 2004, 2006]. Данное исследование развивает подход, использованный в работе [Андриенко, Гуриев, 2004]. Сделана попытка усовершенствования модели миграции путем введения более гибкой спецификации и разбиения всей анализируемой выборки на относительно однородные группы.

---

<sup>1</sup> Исследование проведено при поддержке гранта факультета экономики НИУ ВШЭ 2010 г.

В качестве информационной базы мы используем панельные данные 2001–2008 гг. о миграционных потоках между регионами, собираемые, но не публикуемые Федеральной службой государственной статистики РФ, а также общедоступные данные официальной статистики о показателях социально-экономического развития регионов.

Для анализа использовалась следующая спецификация уравнения регрессии:

$$\ln M_{i,j,t} = \alpha_{i,j,t} + \beta'_t Y_{i,t-1} + \gamma'_t Y_{j,t-1} + \varepsilon_{i,j,t}, \quad (1)$$

где  $M_{i,j,t}$  – величина миграционного потока из региона  $i$  в регион  $j$  в году  $t$ ;  $Y_{i,t-1}$  – вектор характеристик региона  $i$  (региона выбытия) в момент времени  $t-1$ ;  $Y_{j,t-1}$  – вектор характеристик региона прибытия в момент времени  $t-1$ ;  $\alpha_{i,j,t}$  – свободный член уравнения регрессии в момент времени  $t$ , отличающийся для разных пар регионов  $i, j$  (т.е. включающий в себя индивидуальный эффект пар регионов);  $\beta_t, \gamma_t$  – векторы коэффициентов при объясняющих переменных – характеристиках регионов прибытия и выбытия.

Заметим, что векторы коэффициентов в уравнении (1) имеют индекс  $t$ , т.е. предполагается их непостоянство во времени. Дело в том, что предварительный анализ данных на основании коротких (двухлетних) панелей показал, что коэффициенты регрессионной модели изменялись в течение анализируемого периода времени. Чтобы учесть эти изменения, не перегружая модели, была сделана предпосылка, что изменения коэффициентов описываются линейным трендом. Так, векторы  $\beta_t$  и  $\gamma_t$  могут быть записаны в виде  $\beta_t = \beta_0 + \eta t$ ,  $\gamma_t = \gamma_0 + \lambda t$ , где  $\eta$  и  $\lambda$  – векторы, содержащие приращения коэффициентов в течение года (наклоны трендов). Аналогично индивидуальный эффект пары регионов может быть выражен как  $\alpha_{i,j,t} = \alpha_{i,j,0} + \delta t$ . В случае постоянства коэффициентов  $\delta$  векторы  $\eta$  и  $\lambda$  равны нулю, и это равенство является одной из проверяемых в нашем исследовании гипотез.

Оценивание при наличии линейного тренда в коэффициентах не вызывает затруднений, так как описанная модель допускает представление в линейном виде

$$\ln M_{i,j,t} = \alpha_{i,j,t} + \delta t + \beta'_0 Y_{i,t-1} + \eta' t Y_{i,t-1} + \gamma'_0 Y_{j,t-1} + \lambda' t Y_{j,t-1} + \varepsilon_{i,j,t}. \quad (2)$$

Уравнение (2) оценивалось методом наименьших квадратов с учетом детерминированного индивидуального эффекта. При проверке гипотез о значимости мы опирались на так называемые кластеризованные стандартные ошибки, учитывающие возможную гетероскедастичность и коррелированность слу-

чайных ошибок в наблюдениях, относящихся к одному и тому же региону выбытия [Stock, Watson, 2006].

В качестве объясняющих переменных брались характеристики 1) населения (численность, доля городского населения и т.д.), 2) рынка труда (уровень безработицы, уровень заработных плат и т.д.), 3) рынка жилья (доступность жилья, ввод новых квартир и т.д.), 4) качества жизни (уровень здравоохранения, образования и т.д.), 5) географические характеристики регионов прибытия и выбытия (расстояние между регионами, зимняя и летняя температуры).

Значения всех объясняющих переменных были взяты за предыдущий по отношению к объясняемой переменной год, чтобы избежать эндогенности. Многие из объясняющих переменных сами испытывают влияние миграции, однако мы считаем, что миграция в момент времени  $t$  не воздействует на объясняющие переменные в момент  $t - 1$ .

Особая роль в исследовании отводилась расстоянию между регионами. Были выявлены различия в регрессионной зависимости между близкими и далекими друг от друга парами регионов (расстояние рассчитывалось по длине железнодорожных путей между центрами регионов – методика, предложенная Татевосовым Р.В.) Чтобы учесть эту неоднородность, все пары регионов были разбиты на девять групп. В первую входили пары, расстояние между которыми не более 500 км, в последнюю – находящиеся друг от друга более чем в 10000 км.

Оценивание показало, что эконометрическая модель относительно хорошо описывает данные для близких (менее 500 км) регионов, что проявляется в относительно высоком значении внутригруппового коэффициента детерминации  $R^2$ -within (см. табл. 1). Миграция на более далеких расстояниях оказывается менее тесно связанной с объясняющими переменными. Видимо, это связано с большей «специфичностью» миграции на далекие расстояния – индивиды, переезжающие на дальние расстояния, имеют особые, зачастую более сложные и комплексные причины для переезда и требования к месту жительства, раз им не подходят ближние регионы. Интересно, что для сильно удаленных друг от друга (более 10000 км) пар регионов коэффициент детерминации опять повышается, что, видимо, связано с особенностями конкретных направлений миграции (в эту группу входят, в основном, потоки между областями европейской России и Дальним Востоком). Однако число миграций на столь дальние расстояния мало – около 2% от общего числа фиксируемых статистикой переселений.

Во всех группах регионов модель с линейным трендом в коэффициентах оказывается лучше модели с постоянными коэффициентами на уровне значимости 1%. Укажем на некоторые изменения в воздействии объясняющих фак-



торов на миграцию. Роль числа студентов в регионе прибытия сильно возросла за исследуемый период, что, возможно, связано с введением ЕГЭ. Также интересно отметить динамику эластичности по охвату сотовой связью в регионе. Чувствительность миграции по этому показателю снижалась со временем. Этот факт, скорее всего, связан с тем, что наличие мобильной сотовой связи стало повсеместным. Эластичность миграции по разнице в средних заработных платах выросла за исследуемый период. Причем для пар регионов, находящихся на дальних ( $\geq 10025$  км) расстояниях, эта эластичность в три раза больше, чем для близких пар регионов ( $\leq 500$  км).

**Таблица 1.** Качество подгонки регрессионной модели для групп регионов

	Расстояние между центрами регионов, км								
	$\leq 500$	500 – 1000	1087 – 2022	2026 – 3186	3204 – 4585	4593 – 6094	6111 – 7891	7941 – 9985	$\geq 10025$
$R^2$ -within	0,32	0,14	0,11	0,10	0,07	0,10	0,12	0,16	0,24

Подробное описание значимости отдельных факторов не приводится в работе по двум причинам. Во-первых, предпосылка о линейной динамике коэффициентов довольно жестка и может приводить к некорректным выводам. Так, если влияние фактора, значимого в 2002 г., постепенно сходило на нет, и соответствующий коэффициент стабилизировался на уровне около нуля, модель с линейным трендом может показать, что коэффициент стал со временем отрицательным (и, возможно, значимым). С другой стороны, ввод более гибкой спецификации означает усложнение и без того загруженной параметрами модели, что вряд ли целесообразно.

Во-вторых, значимость отдельных коэффициентов может оказаться следствием ошибок первого рода, с высокой вероятностью возникающих при проверке большого числа гипотез. Возможный способ решения этой проблемы – переход от множества социально-экономических индикаторов к интегральным показателям рынка труда, жилья и т.д. – мы оставляем для дальнейших исследований.

Однако можно сформулировать два вывода, не зависящих от значимости отдельных переменных и представляющихся надежными. Во-первых, роль различных социально-экономических факторов в определении миграционных потоков менялась в течение исследуемого периода. Во-вторых, социально-экономическое положение регионов определяет величину миграционных потоков,

прежде всего, на близких, до 500 км расстояниях. Уравнения, оцененные для пар регионов, расположенных на расстояниях 500–8000 км друг от друга, имеют весьма низкое качество подгонки, а потоки на большие расстояния малочисленны, и их вклад в межрегиональную миграцию невелик.

## Литература

*Андриенко Ю., Гурьев С.* Разработка прикладной модели внутренних и внешних миграционных потоков населения для регионов Российской Федерации. М.: ЦЭФИР, 2006.

*Мкртчян Н.В.* Миграционная мобильность в России: оценки и проблемы анализа // SPERO. 2009. № 11.

*Татевосов Р.В.* Исследование пространственных закономерностей миграции населения. Статистика миграции населения. М.: Статистика, 1973.

*Чудиновских О.С.* Учет миграции в России: причины и последствия кризиса // Демоскоп Weekly. 2005.

*Andrienko Y., Guriev S.* Determinants of Interregional Mobility in Russia. Evidence from Panel Data // Economics of Transition. 2004. Vol. 12. (1). P. 1–27.

*Arellano M., Bond S.* Some Tests of Specification for Panel Data: Monte Carlo Evidence and an Application to Employment Equations // The Review of Economic Studies. 1991. Vol. 58. № 2. P. 277–297.

*Gerber T.* Individual and Contextual Determinants of Internal Migration in Russia, 1985–2001. University of Wisconsin, 2005. Mimeo.

*Gerber T.* Regional Economic Performance and Net Migration Rates in Russia, 1993–2002 // International Migration Review. 2006. Vol. 40. № 3. P. 661–697.

*Stock J.H., Watson M.W.* Heteroskedasticity-robust Standard Errors for Fixed Effects Panel Data Regression: NBER Technical Working Paper. 323. 2006.

## **ИНДИВИДУАЛЬНЫЕ ИСТОРИИ ОБРАЗОВАНИЯ И РОЖДЕНИЯ ПЕРВОГО РЕБЕНКА В РАЗНЫХ ПОКОЛЕНИЯХ МУЖЧИН И ЖЕНЩИН В РОССИИ**

---

В данной статье будут раскрыты результаты одного из направлений исследования связи образовательных стратегий и репродуктивного поведения. Получение образования, с одной стороны, отражает индивидуальные ценности и предпочтения в отношении личностной реализации, а с другой стороны, способствует формированию этих ценностей за счет воздействия соответствующей социальной среды. Этот фактор может быть более значимым для женщин (именно с образованием в первую очередь связывают женскую эмансипацию), но нельзя исключать его влияние и на семейные ценности мужчин. Помимо этого образование выступает краеугольным камнем при формировании дальнейшего социально-экономического положения индивида, оно влияет и на его возможности на рынке труда и на величину потенциальных доходов.

Фактор образования играет ключевую роль в исследовании репродуктивного поведения, он традиционно включается в теоретические концепции рождаемости. Классический подход, базирующийся на экономической теории рождаемости Г. Беккера [Becker, 1981], объясняет его влияние через различия в прямых и косвенных издержках рождения ребенка для людей с разным уровнем образования. Обобщая теоретические предпосылки, можно сказать, что среди женщин получение высокого образования негативно сказывается на числе детей, среди мужчин – положительно или нейтрально. При динамическом подходе внимание сосредоточено на объяснении календаря рождений, и здесь экономическая теория не дает однозначного ответа о том, как уровень образования сказывается на длительности периода между его окончанием и рождением ребенка. С одной стороны, время рождения ребенка обусловлено максимизацией ожидаемого дисконтированного потока полезности для женщины, и рождение первенца в период между окончанием учебы и началом трудовой жизни наиболее выгодно. Более поздний выход с рынка труда связан с большей величи-

ной упущенных заработков. С другой стороны, наиболее образованные женщины имеют крутой профиль возраст-заработки, и старт карьеры чрезвычайно важен для них. Альтернативные издержки деторождения сразу после вхождения на рынок труда больше, чем когда-либо потом.

Привлечение концепции жизненного цикла дает основания утверждать, что возраст при рождении первого ребенка определенно зависит от длительности обучения. Наиболее высокообразованные женщины учатся дольше и в силу трудностей совмещения обучения и родительства, при прочих равных условиях, дольше остаются бездетными. Планирование карьеры заставляет откладывать рождение и после окончания образования: среди высокообразованных сильнее предпочтения в отношении формирования успешной карьеры и ниже склонность к ее прерыванию ради рождения ребенка. Данная гипотеза опирается на предпосылки о существовании штрафа за прерывание карьеры, хорошей вертикальной мобильности на рынке труда, традиционном распределении ролей внутри семьи и трудностях совмещения материнства и карьеры. Однако в действительности существует множество факторов, ослабляющих эти предпосылки.

Эмпирические исследования дают противоречивые результаты. Многие из них демонстрируют, что высокообразованные женщины имеют меньшее число детей (см. исследования по Восточной Европе: [Aassve, Billari, Spéder, 2006 (Венгрия); Klasen, Launov, 2003 (Чехия); Perelli-Harris 2008 (Украина); Muresan, Hoem, 2010 (Румыния)] и др.), но есть также свидетельства и противоположной связи (см.: [Kravdal, 1992 (Соединенные Штаты и Норвегия); Kreyenfeld, 2002; Oláh, 2003; Kreyenfeld, Zabel, 2005; Köppen, 2006 (цит. по [Muresan, Hoem, 2010]) – по ряду западных стран). Отрицательное влияние уровня образования на возраст при рождении первенца в целом можно считать эмпирически доказанным. В частности, Г.-П. Блоссфельд и Й. Хуининк [Blossfeld, Huinink, 1991] выявили эффект откладывания для Германии (ФРГ), А.С. Лифброер и М. Корин [Liefbroer, Corijn, 1999] – для Дании, Т. Лаппегард и М. Ронсен [Lapppegård, Rønsen, 2005] – для Норвегии. Однако наряду с эффектом откладывания свою роль играет и эффект наверстывания. Так, в работе Т. Лаппегард и М. Ронсен показано также, что по окончании обучения наиболее высокообразованные демонстрируют более высокие показатели рождаемости по первым детям, чем остальные.

Необходимо отметить, что связь между получением образования и рождением ребенка фактически имеет три направления. Во-первых, репродуктивные намерения или фактические рождения детей оказывают влияние на дальнейшие планы в отношении образования. Рождение ребенка в период обучения нередко

приводит к его досрочному завершению. Во-вторых, внешние детерминанты (события жизненного цикла, ценностные установки, институциональные факторы) могут оказывать влияние и на образовательные, и на репродуктивные биографии. И, наконец, образование само оказывает комплексное воздействие на нормативное и фактическое репродуктивное поведение. В связи с этим наиболее привлекательными исследовательскими методами являются те, которые позволяют установить направление причинно-следственной связи.

Изучение микроуровневой зависимости между образовательной биографией и репродуктивным поведением мужчин и женщин в современной России представляет собой актуальную аналитическую задачу. В настоящее время Россия относится к странам с высоким уровнем образования мужчин и женщин. Во второй половине XX в. изменения коснулись как образовательной структуры населения (в послевоенных поколениях), так и самого содержания образования (в постсоветском периоде). Каким образом эти трансформации отразились на эффекте образования в репродуктивном поведении, можно понять, обратившись к ретроспективному анализу биографий мужчин и женщин разных поколений. В условиях низкой детности, когда большинство женщин имеет 1–2 детей, наибольшее исследовательское значение приобретают темпо-характеристики рождаемости. Изучение календаря рождений в непосредственной связке с периодами обучения позволяет устранить обратную причинно-следственную связь между этими элементами индивидуального поведения. Дополнительным аргументом в сторону анализа темпо-характеристик выступает то, что влияние образования на репродуктивное поведение меняется с течением времени, постепенно уступая свое значение другим факторам.

Информационно-статистической базой исследования выступают микроданные двух масштабных выборочных обследований российского населения. Первое из них – «Родители и дети, мужчины и женщины в семье и обществе (далее РидМиЖ)». Оно имеет две волны, первая из которых была проведена в 2004 г. (выборка 11,261 человека 18–79 лет), вторая – в 2007 г. (выборка 11,117 человека 18–82 лет; панельная составляющая – 7,786 человека 21–82 лет). РидМиЖ предоставляет подробную ретроспективную информацию о брачно-партнерском и репродуктивном поведении мужчин и женщин, в том числе даты начала и окончания партнерских союзов, даты рождения детей. Второе – «Образование и занятость (далее ОиЗ)» – было проведено в 2005 г. на базе выборки РидМиЖ и охватило 6,654 респондента в возрасте 18–55 лет. Оно содержит сведения об основных событиях в жизни респондентов, начиная с 17-летнего возраста и покрывая временной период с 1967 по 2005 гг. Данные ОиЗ позво-

ляют выстроить полные образовательные биографии респондентов – они включают уровень образования, форму обучения, сведения о том, было ли оно прервано и/или закончено, являлось ли основной или дополнительной деятельностью. Таким образом, в целях исследования была сформирована уникальная база данных, позволяющая получить максимально возможную информацию о репродуктивных и образовательных биографиях мужчин и женщин. Объем окончательной выборки составляет 4735 респондентов 1950–1986 годов рождения, среди которых 1705 мужчин и 3030 женщин. Рождение первого ребенка состоялось у 3936 респондентов.

Различия в образовательном уровне между поколениями необходимо учитывать во избежание неверного толкования структурных эффектов (см. табл. 1, представлен наивысший достигнутый уровень образования). Чем шире та или иная образовательная группа, тем она разнородней. В частности, это касается высшего образования, доступ к которому становится все выше, особенно среди женщин. В поколении 1970–1979 годов рождения более трети женщин получили высшее образование. Самая молодая когорта еще не завершила период обучения, но можно сказать, что в ней будет еще больше доля получивших высшее образование, и в целом уровень образования в ней будет выше. В старших поколениях те мужчины и женщины, кто получили высшее образование, могут сильнее отличаться от остальных по своим демографическим и социально-экономическим характеристикам.

В качестве основного метода исследования выступает анализ наступления событий. Зависимым параметром является рождение первого ребенка. Анализ последующих рождений вынесен за рамки данной статьи, но будет включен в дальнейшие исследования. Для предварительного анализа и иллюстраций используется метод Каплана – Майера, в дальнейшем – регрессия Кокса. Контролирующими переменными выступают пол и год рождения респондента, они позволяют изучить гендерный и поколенческий аспекты исследуемого явления. Для установления причинно-следственной связи между двумя процессами – получением образования и рождением детей – в качестве объясняющей переменной используется достигнутый на момент зачатия уровень образования. Таким образом, объясняющий параметр измеряется не на момент опроса, а на тот момент, когда он мог оказать влияние на факт наступления события. Обследование ОиЗ позволяет использовать информацию как обо всех периодах обучения, так и только о тех, которые респондент обозначил как «основную деятельность» на то время. На данном этапе работы мы принимаем во внимание только такое образование. Старт времени начинается с достижения респонден-

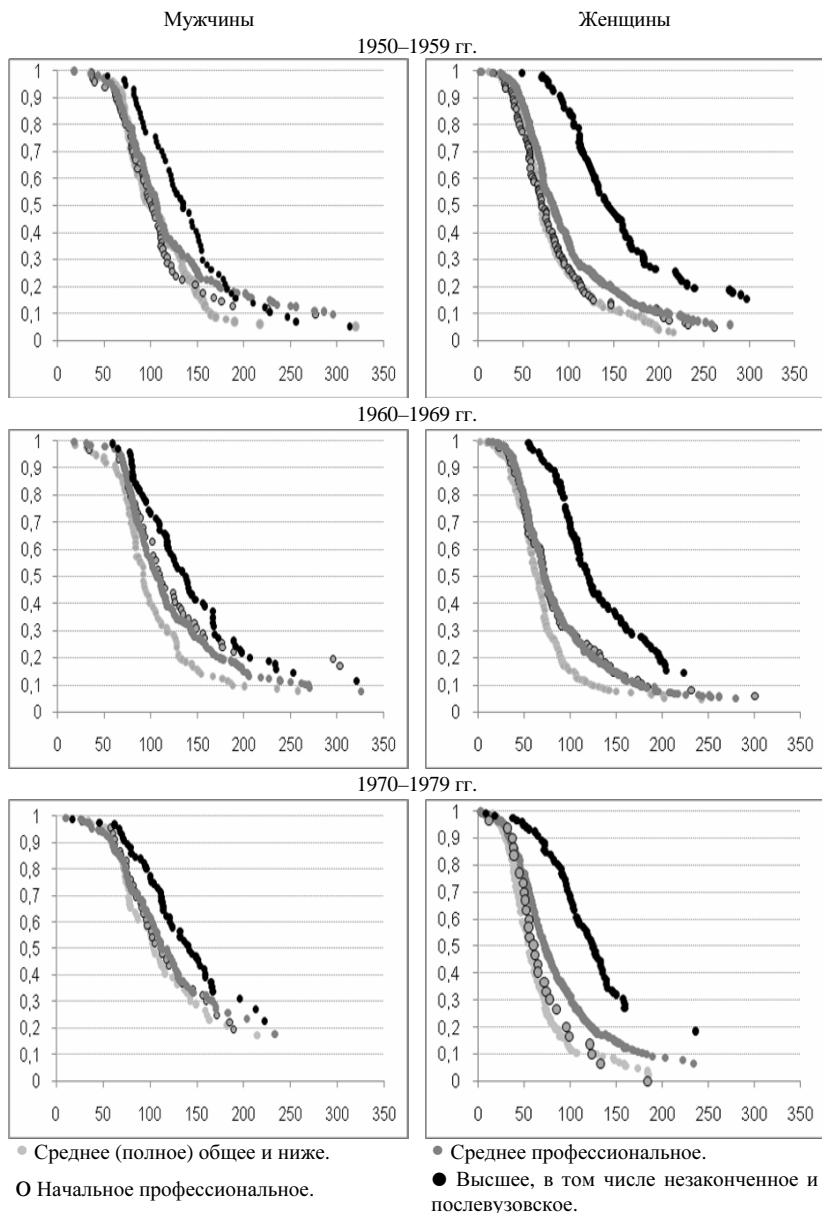
том возраста 16 лет и отсчитывается ежемесячно до времени рождения первого ребенка или до момента опроса, если рождения не наступало.

**Таблица 1.** Образовательная структура мужчин и женщин разных поколений, %

Годы	Образование				
	основное общее и ниже	среднее (полное) общее	начальное профессио- нальное	среднее профессио- нальное	высшее, в том числе незакончен- ное и после- вузовское
<b>Мужчины</b>					
1950–1959	2,1	16,6	34,9	24,0	22,3
1960–1969	2,1	16,8	37,7	20,0	23,4
1970–1979	5,8	13,4	32,9	19,4	28,5
<i>1980–1986</i>	<i>3,0</i>	<i>22,8</i>	<i>32,5</i>	<i>18,7</i>	<i>23,1</i>
Среднее значение	3,2	16,8	34,9	20,8	24,3
<b>Женщины</b>					
1950–1959	1,9	13,8	19,2	41,6	23,5
1960–1969	1,0	12,2	24,7	36,4	25,8
1970–1979	1,0	8,9	22,8	33,1	34,3
<i>1980–1986</i>	<i>2,3</i>	<i>21,4</i>	<i>18,8</i>	<i>27,3</i>	<i>30,2</i>
Среднее значение	1,5	13,0	21,7	36,4	27,5

Метод Каплана – Майера наглядно демонстрирует, что эффект образования для женщин более значим, чем для мужчин. В частности, получение высшего образования существенным образом сдвигает календарь рождений в поколении мужчин 1950–1959 годов рождения и во всех поколениях женщин (рис. 1).

Наблюдаемый эффект наверстывания относительно невелик среди женщин, и потому окончательного нивелирования разрыва в доле бездетных между теми, кто получил высшее образование, и остальными не происходит. Однако среди мужчин итоговое число первых рождений не снижается с ростом образования.



**Рис. 1.** Кумулятивная функция «дожития» в состоянии бездетности в зависимости от образовательного статуса

(графики «дожития» показывают безусловную вероятность пребывания респондента в данном состоянии; оси абсцисс – число месяцев с 16 лет (наблюдение до 44 лет, т.е. до 336 месяцев))



К сожалению, выборка ОиЗ ограничена респондентами до 55 лет, поэтому провести аналогичный анализ для старших поколений мы не можем. Поэтому эффект изменения образовательной структуры проступает не очень отчетливо. Тем не менее на его счет можно отнести наблюдаемое среди женщин усиление отличий в репродуктивном поведении сначала среди тех, кто имеет основное общее образование или ниже, а потом и среди тех, кто получил начальное профессиональное образование.

Наиболее сильное откладывание рождения первенца характерно для самого старшего из исследуемых поколений. К 25 годам в когорте 1950–1959 годов рождения только каждая пятая женщина с высшим образованием имела ребенка, тогда как в более молодых когортах – каждая третья. Это, в частности, может быть эффектом влияния семейной политики 1980-х годов.

Регрессия Кокса подтверждает полученные ранее результаты. Среди мужчин получение высшего образование значимо снижает отношение шансов на рождение первенца по сравнению со средним общим образованием. Среди женщин это снижение еще сильнее. Влияние когорты варьируется по полу – если для мужчин чем моложе когорта, тем ниже отношение шансов на рождение первенца, то для женщин прямой зависимости нет. Наиболее высокие шансы имеет когорта 1970–1979 годов рождения.

Включение контролируемых переменных в регрессию Кокса – количества братьев и сестер респондента и типа населенного пункта, в котором он(а) родился(лась) – позволило хотя бы косвенно включить в анализ контроль на установки детности респондента. Как и следовало ожидать, и среди мужчин и среди женщин наименьшие риски рождения первенца имеют выходцы из наиболее крупных городов – областных, краевых, республиканских центров. Прямой зависимости между количеством братьев и сестер респондента и шансами рождения первенца не наблюдается.

В связи с тем, что подвыборка женщин более многочисленная, на ней можно провести анализ не только по 10-летним, но и по 5-летним возрастным группам. В таком разбиении лучше видно, как уменьшается эффект образования в группе 1960–1964 годов рождения, для которой характерно наибольшее воздействие семейной политики начала 1980-х годов.

В настоящее время данное исследование находится в стадии разработки, но уже проведенные расчеты позволяют сделать ряд выводов. Как и предсказывает экономическая теория рождаемости, отрицательное влияние высокого уровня образования для репродуктивного поведения женщин более значимо, чем для мужчин. Наибольший разрыв между крайними образовательными группами наблюдается среди женщин 1975–1979 годов рождения, т.е. тех, кто заканчивал свое образование уже в рыночных условиях экономики.

Таблица 2.

Оценка факторов, влияющих на вероятность рождения первого ребенка, регрессией Кокса

	B	Sig	Exp(B)
Мужчины			
Образование			
среднее (полное) общее и ниже			
начальное профессиональное	-0,225	<b>0,019</b>	0,799
среднее профессиональное	-0,159	<b>0,015</b>	0,853
высшее, в том числе незаконченное и послевузовское	-0,534	<b>0,000</b>	0,586
1950–1959 гг.			
1960–1969 гг.	-0,019	0,774	0,981
1970–1979 гг.	-0,187	<b>0,013</b>	0,830
1980–1986 гг.	-0,597	<b>0,000</b>	0,551
Место рождения: сельская местность			
областной, краевой, республиканский центр	-0,222	<b>0,005</b>	0,801
другие города	-0,123	<b>0,099</b>	0,884
ПГТ	0,028	0,771	1,029
Не было ни братьев, ни сестер			
1 брат/сестра	0,244	<b>0,005</b>	1,276
2 братьев/сестер	0,108	0,265	1,114
3 и более братьев/сестер	0,048	0,636	1,049
Женщины			
Образование			
среднее (полное) общее и ниже			
начальное профессиональное	-0,154	<b>0,043</b>	0,857
среднее профессиональное	-0,319	<b>0,000</b>	0,727
высшее, в том числе незаконченное и послевузовское	-1,099	<b>0,000</b>	0,333
1950–1959 гг.			
1960–1969 гг.	0,192	<b>0,000</b>	1,212
1970–1979 гг.	0,285	<b>0,000</b>	1,329
1980–1986 гг.	-0,112	0,198	0,894
Место рождения: сельская местность			
областной, краевой, республиканский центр	-0,194	<b>0,000</b>	0,824
другие города	-0,106	<b>0,044</b>	0,900
ПГТ	-0,132	<b>0,056</b>	0,877
Не было ни братьев, ни сестер			
1 брат/сестра	0,106	0,100	1,112
2 братьев/сестер	0,167	<b>0,018</b>	1,182
3 и более братьев/сестер	0,051	0,477	1,052

ref. – среднее (полное) общее и ниже.

Примечание: при контроле на тип населенного пункта и число братьев/сестер.

Таблица 3.

Оценка влияния образования на вероятность рождения первого ребенка у женщин 1950–1979 годов рождения регрессией Кокса

Годы	Образование	B	Sig	Exp(B)
1950–1954	начальное профессиональное	0,342	<b>0,032</b>	1,407
	среднее профессиональное	–0,055	0,604	0,947
	высшее, в том числе незаконченное и послевузовское	–0,664	<b>0,000</b>	0,515
1955–1959	начальное профессиональное	–0,253	0,113	0,777
	среднее профессиональное	–0,352	<b>0,000</b>	0,703
	высшее, в том числе незаконченное и послевузовское	–1,158	<b>0,000</b>	0,314
1960–1964	начальное профессиональное	–0,350	<b>0,038</b>	0,704
	среднее профессиональное	–0,233	<b>0,023</b>	0,792
	высшее, в том числе незаконченное и послевузовское	–0,865	<b>0,000</b>	0,421
1965–1969	начальное профессиональное	–0,343	0,128	0,709
	среднее профессиональное	–0,469	<b>0,000</b>	0,626
	высшее, в том числе незаконченное и послевузовское	–1,170	<b>0,000</b>	0,310
1970–1974	начальное профессиональное	–0,133	0,631	0,876
	среднее профессиональное	–0,528	<b>0,000</b>	0,590
	высшее, в том числе незаконченное и послевузовское	–1,045	<b>0,000</b>	0,352
1975–1979	начальное профессиональное	–0,156	0,595	0,855
	среднее профессиональное	–0,463	<b>0,001</b>	0,629
	высшее, в том числе незаконченное и послевузовское	–1,426	<b>0,000</b>	0,240

## Литература

Aassve A., Billari F.C., Spéder Z. Societal Transition, Policy Changes and Family Formation: Evidence from Hungary // European Journal of Population. 2006. Vol. 22. № 2. P. 127–152.

Becker G.S. A Treatise on the Family // NBER Books. National Bureau of Economic Research, Inc, 1981. № 81–1.

*Blossfeld H.P., Huinink J.* Human Capital Investments or Norms of Role Transition? How Women's Schooling and Career Affect the Process of Family Formation // American Journal of Sociology. 1991. Vol. 97. № 1.

*Klasen S., Launov A.* Analysis of the Determinants of Fertility Decline in the Czech Republic // Sonderforschungsbereich 386. Paper 352. 2003.

*Kravdal O.* The Emergence of a Positive Relation between Education and Third Birth Rates in Norway with Supportive Evidence from the United States // Population Studies. 1992.

*Lappegård T., Rønsen M.* The Multifaceted Impact of Education on Entry into Motherhood // European Journal of Population. 2005. Vol. 21. № 1.

*Liefbroer A.C., Corijn M.* Who, What, Where, and When? Specifying the Impact of Educational Attainment and Labour Force Participation on Family Formation // European Journal of Population. 1999. Vol. 15. № 1.

*Muresan C., Hoem J.M.* The Negative Educational Gradients in Romanian Fertility // Demographic Research. 2010. Vol. 22. Article 4.

*Perelli-Harris B.* Ukraine: On the Border between Old and New in Uncertain Times // Demographic Research. 2008.

## ОТЦОВСТВО: ЛИБЕРАЛЬНЫЙ ТРЕНД ОТ ОТЦА К ПАПЕ?

---

Эмпирическое знание о социальной практике отцовства довольно скудно. В гендерных и фамилистских дискуссиях стало общим местом упоминание об отсутствующем отце, что, тем не менее, увязывается и с отсутствующим объектом исследовательского желания. Отчасти это свидетельствует о феминизации как семьи, так и фамилистики в целом. Достаточно распространен сюжет о «хорошей матери», разработанный Элизабет Бадинтер, Ивонн Шютце [Badinter, 1981; Schütze, 1986], но отсутствует семантика хорошего отцовства. Более того, тема отцовства маргинальна и для направления «men's studies», по мнению Деборы Лаптон и Лесли Барклай [Lupton, Barclay, 1997].

В фокусе статьи – вопрос о современном отцовстве, отличается ли современный отец от того, кто воспитывал его лет тридцать назад, изменилось ли их представление об отцовской роли, остается ли прежним содержание отцовских практик и, вместе с этим, дискурс отцовства в обществе в целом. Последний аспект – развернутая публичная дискуссия в обществе – важен тем, что дискурсивно оформляется социальный заказ на ту или иную конфигурацию родительства, озвучиваются моральные паники по поводу дефицитарных родительских ролей и легитимируется профиль социальной политики, призванной компенсировать разрыв между реальным и желаемым как на уровне государственных потребностей, так и жизненных целей граждан. Мы обратимся к европейскому, более того, немецкому социально-культурному контексту, чтобы разведать тот ландшафт родительской культуры – отцовство, – который достаточно редко формулируется в качестве исследовательской и дискурсивной задачи в отечественной социологии, будучи сокрытой под понятием родительства в целом и подразумевающей де факто материнство. Собственно, почему выбрана Германия? Краткое, но не исчерпывающее объяснение заключается в том, что Германия, как и Россия, – страны с тоталитарным прошлым, а также обстоятельством, характеризующим типичный биографический конструкт поствоенного как немецкого, так и советского времени – феномен «отсутствующего отца». В этом отношении сюжет об авторитарной личности и эрозии автори-

тета мужчины в обществе и семье (работы франкфуртцев Адорно, Фромма, Хабермаса), а также по преимуществу знаменитая работа Александра Митчерлиха [Mitscherlich, 1963] о пути к беспаянному обществу оформляют дискурсивное поле дебатов о невидимом отце в 50–60-х годах прошлого века. В статье о новых ролях отцов немецкая исследовательница Илона Остнер упоминает, анализируя периодику, о дискурсивной связи между отцовством и нацизмом, проявляющейся в конфликтах отцов и сыновей и бунте 1968 г. [Ostner, 2002]. Она ссылается на работу Кристиана Гамперта [Gampert, 2000], который описывает пересмотр авторитета отца сыном и обесценивание всего, что связывает отца с периодом нацизма. Другой контекстуальный аспект – тематизация отцовства в связи с важными событиями середины 1960-х – например, Франкфуртским процессом 1963 г. Он документально зафиксировал признания авторов Холокоста и имел огромное значение для диалога о «немецкой вине» отцов и детей. Также в связи с молодежными протестами 1968 г., вменявшими поколению отцов вину слепого повиновения институтам. Эти события общественной жизни и дискуссий требовали ответа и самоопределения, радикально меняли поколенческую картину мира. Наконец, еще один момент, сближающий российский и немецкий контекст анализа отцовства, – переход от социалистической системы, патерналистской по отношению к семье и тем самым отчасти узурпирующей символическое значение отцовства и поддерживающей модель отца-бредвиннера. Как отмечает И. Остнер, режим восточной социальной политики фокусировался на возможности для матерей совмещать материнство и занятость, но при этом маргинализировал женатых, разведенных или сожительствующих отцов [Ostner, 2002].

Итак, на фоне общественной дискуссии, высветившей символическое значение отца в социальной истории XX в., на фоне европейской картины второго демографического перехода с его низкими матримониально-фертильными процессами и конкурентной моделью гражданского брака и доминирующей моделью двойной занятости в семье возник феномен либерализованного отцовства, отчасти как немногочисленная практика, но более как социальная гендерная потребность. Ее амбивалентный характер отражают цифры опросов общественного мнения. Так, по данным Немецкого института молодежи («От потенциального к реальному отцу», опрос К. Церле и И. Крок [Zerle, Krok, 2008] по заказу фонда Бертельсман), почти половина мужчин до 45 лет считают, что «можно счастливо жить и без детей». В то же время 90% еще бездетных молодых мужчин хотели бы детей. Похоже, с возрастом уверенность в совмещении работы и семьи с детьми тает, наталкиваясь на рифы институционального происхождения. Кстати, на российском материале исследования, построенного

на европейском сравнении отцов и матерей, была выявлена аналогичная амбивалентность мужского/отцовского сознания [Sass, Jaeckel, 1998], готовность участвовать в отпуске по уходу за ребенком как институциональной отцовской практике, но нереализуемые условия (например, сохранение прежней зарплаты или возможность подработки) согласия фактически дезавуировали саму идею.

В конце 1970-х – начале 1980-х годов в Германии стали появляться работы социологов, психологов и журналистов на тему «нового отцовства». Поднимаемые вопросы касались конфликтов, возникающих на пересечении отсутствующей ролевой модели отца и образов альтернативно воспринимаемой отцовской роли. Дебатировали и сюжет отцовской компетенции: «Обладает ли “новый отец” специфически мужскими качествами или он представляет лишь несовершенную имитацию матери?» [Schneider, 1989, s. 152]. Как это часто бывает, десятилетием раньше психологи занялись эмпирическим тестированием готовности нового поколения отцов соперничать с беременностью матери; подтверждением родительской готовности отцов в зависимости от участия в подготовке рождения; характеристиками специфической интеракции между отцами и младенцами. Профиль этих задач и вопросов уже явно носил не стигматизирующий характер общественного осуждения, а отражал интерес к поведению и эмоциям мужчин, обретающих отцовскую идентичность. Хотелось бы подчеркнуть важную подстегивающую общественную дискуссию роль профессиональной журналистики в этом повороте<sup>1</sup>. Так, в 1979 г. журналистка Рут Мартин опубликовала книгу «Отцы вне игры. Мать и ребенок в безопасном обществе», вновь обратившись к бестселлеру А. Митчерлиха, с призывом к немецким отцам не оставаться в офсайде [Martin, 1979]. Десятилетие спустя работа Вернера Шнайдера о шансах и рисках новых отцов однозначно утверждала, что «отцы, в сотрудничестве с матерями, вносят *специфический* вклад в социализацию своих детей» [Schneider, 1989, s. 152]. Но развитие дискурса о новом отцовстве затормозилось иной темой – проблемой совмещения семьи и занятости для женщин, хотя безусловно существовало и «отцовское» измерение той же проблемы. Лишь 20 лет спустя социологи Клаудиа Борн и Хельга Крюгер в их многолетнем анализе гендеризованного глобализованного рынка труда придут к важному выводу о том, что «существующая структура лишь постольку учитывает измененное отцовство, насколько оно не затрагивает доступности мужчины к рынку труда [Born, Krüger, 2002, s. 138]. То есть вопрос об «объеме и содержании отцовства» зависит не только от взглядов на отцовскую роль в обществе, но и от реальных возможностей ее исполнения, включая конкрет-

---

<sup>1</sup> В отечественной дискуссии в свое время подобную роль сыграла популярная статья демографа Б. Урланиса «Берегите мужчин!», опубликованная в 1968 г. [Урланис, 1968].

ную конфигурацию на рынке труда. И в этом смысле парадоксально выглядят данные актуальных опросов общественного мнения, о которых сообщает Хайнц Вальтер [Walter, 2008]: большинство молодых людей, собственно и молодых женщин, планируют свое будущее в виде удавшегося баланса профессионального и семейного ангажемента, но конкретные представления о реализации касаются только профессии, относительно семьи и партнерства все тонет в неопределенности.

**Как сегодня представляют себе отцовство молодые мужчины.** Согласно результатам исследования DJI-Bertelsmann «Пути к отцовству», молодые мужчины от 15 до 42 лет прежде всего видят себя ответственными за финансы в семье (N = 1,803) [Zerle, Krok, 2008]. Гарантированное рабочее место и доход – основа формирования семьи. Относительно высокий процент опрошенных на фоне распространенной в немецком обществе идеологии равных прав и возможностей считают, что ребенок должен появиться лишь тогда, когда они могут прокормить семью (52%). Более того, 38,7% считают, что если жена и работает, мужчина все равно должен быть основным кормильцем. Заметно, что самоопределение отцовства зависит от взглядов на гендерное распределение ролей в семье, что это «отношенческий» конструкт (*relationship concept*). В этом исследовании молодые мужчины демонстрируют скорее критическое отношение к эгалитарным ролевым моделям, против ожиданий – 47,8% за классическое «Муж работает, жена занимается детьми», причем чем выше уровень образования, тем больше эгалитаризм, чем моложе опрашиваемые, тем традиционнее их установки. Как же выглядит конкретно уточненная модель кормильца у молодого поколения: свои отцовско-мужские обязанности они формулируют как обеспечение жилья для семьи, зарабатывание для пропитания семьи, заботу о надежной работе и доходе, позднее (с появлением ребенка) находить время для него и общаться с ним. Желаемое сокращение работы после рождения ребенка, вплоть до отказа от карьеры, у 40% молодых мужчин следует оценивать пессимистичнее, так как, по данным официальной федеральной статистики, мужчины работают после рождения первого ребенка как правило, даже больше. В этом противоречии – желании большей вовлеченности в общение с ребенком, но без ограничения профессиональной занятости, Михаэль Матцнер усматривает характеристику «современного/модерного кормильца», фактически подвигающего жену к уступкам в профессии и выбирающего вторые роли в домашнем труде [Matzner, 2004].

Другой важный вопрос, подлежащий эмпирической проверке, – наличие желания молодых мужчин обзавестись детьми, в каком возрасте и при каких условиях. В рамках уже упомянутого исследования DJI-Bertelsmann сделан важ-



ный вывод: молодые люди хотят детей, и при этом желают стать отцами раньше, чем предыдущее поколение. Оптимальный возраст для отцовства видится между 25 и 28 годами, по мнению почти половины (47,6%). Еще треть (31,7%) планирует это на возраст от 29 до 32 лет. При каких же условиях реализуемо это желание относительно раннего для Германии отцовство, если учесть, что треть немцев в возрасте от 35 до 40 лет бездетны и 25% остаются таковыми длительно [Schmitt, Winkelmann, 2005], а первым ребенком немцы-мужчины обзаводятся в возрасте от 29 до 33 лет [Zerle, Krok, 2008]? С точки зрения сконденсированного смысла отцовство понимается как перенимание ответственности и забота о семье. Исходя из этого молодые мужчины готовы к нему, если выполнимы условия надежного партнерства (66,1%), гарантированного дохода (58,9%) и стабильной профессиональной позиции (56,6%). Очевидно, что вновь характеристики рынка труда с высоким риском безработицы, растянутым временем учебы, сложным негарантированным стартом в профессиональную жизнь, вследствие этого долгой экономической зависимостью от родителей ставят институциональные барьеры для реализации изменившихся по биографическому таймингу желаний отцовства.

Не менее важен вопрос о том, в какой степени участие отцов зависит от ряда стратификационных условий: социально-классовой принадлежности, регионального контекста, возраста и количества детей. Конфигурация этих факторов, будучи проверенной эмпирически, имела следующие зависимости: чем выше социальное положение, тем более ангажированные отцы. Отцовский вклад в воспитание выше у жителей больших городов, самое низкое участие у отцов из сельской среды. Молодые отцы принимают значительно более активное участие в уходе за младенцами и маленькими детьми, чем старшие, наконец, чем меньше количество детей в семье, тем больше отцовского участия. Данные результаты по исследованиям У. Шмидт-Дентер [Schmidt-Denter, 1984] находят свое подтверждение и в работах М. Петцольда [Petzold, 1991].

Эти эмпирические данные, с одной стороны, подтверждают некоторую неизменность феномена отцовства и у молодых поколений, с другой, свидетельствуют об определенных подвижках, как минимум, либерализации, и более ранней фазе биографического пространства, которое молодые люди готовы открыть для переживания отцовства. Но что остается недоступным данному типу анализа, так это образы отцовства в их динамике. Актуальная научная дискуссия по поводу отцовства, его типологии, вырастающей из галереи образов, содержит суммарно общую посылку о мультипликации отцовства, отсылки к его социальной дифференциации. Дифференциация отцовских моделей из патерналистского дискурса Патриарха как главы домохозяйства выкристаллизовала три типа

отцовской модели, сохраняющие отчасти и сегодня свое влияние [Gross, 1996; Rosenbaum, 1992].

- *Традиционный отец* – мало заботится о детях, их возвращение и воспитание в ведении матери, вторгается в процесс воспитания строго, по необходимости.

- *Социал-демократический отец* – очень интересуется развитием и повседневной активностью детей, ведет беседы, заботится о школьных успехах, детоцентричен. Его собственная внешняя социальная активность, участие в союзах и партиях ведет к наличию социальной сети контактов.

- *Мелко-буржуазный, индивидуалистичный отец* – поддерживает интенсивные контакты в контексте расширенной семьи, но мало ангажирован внутри семьи. Вследствие сохраняющейся социально-стратификационной базы эти типы обнаруживаются и в современных манифестациях отцовства. В своей работе А. Ланге и К. Церле утверждают, что здесь, с одной стороны, присутствует опора на традиционно приписываемые ответственности и обязательства, а с другой, фиксируется движение в направлении общественно желаемых форм усиленного отцовского ангажемента [Lange, Zerle, 2008].

Актуальная дифференциация пост-пост патриархатного отцовства в немецком культурном контексте, по эмпирическим реконструкциям М. Мацнера [Matzner, 2004], Х.-В. Гумбингера и А. Бамби [Gumbinger, Bambey, 2007], уже значительно более разнообразна, что отражает многообразие полей практик, реальное отражение деинституционализации жизненного пути и перенимание индивидами рисков и преимуществ индивидуального биографического проекта.

В этой галерее типов отцовства – традиционный кормилец (*breadwinner*), современный кормилец, «рефлексивный» отец, в терминах С. Уильямса [Williams, 2008]; целостный, комплексный, тотальный, почти «пама» до взаимозаменяемости с матерью, эгалитарный отец, делит обязанности по обеспечению семьи и воспитанию детей с партнершей 50 на 50, в интерпретации М. Бюргиссер [Bürgisser, 2006], так называемый генеративный отец, по работам Д. Доллахайта, А. Хавкинса, С. Бразерсона [Dollahite, Hawkins, Brotherson, 1997] и В. Фтенакиса [Fthenakis, 2002], как забота о следующем поколении и этически обоснованная и организованная работа родителя, также классическая модель отсутствующего отца в результате отклонения заботы о последующем поколении. Эта тема особенно представлена в англо-американских исследованиях, например, в работе Д. Попеное «Жизнь без отца» [Popenoe, 1996], усматривающих в отсутствии отца дефицит социализации и различные криминальные последствия от употребления наркотиков до уличного насилия. Примерно та же дефи-

цитарная парадигма простиралась вплоть до 1980-х годов и в поле анализа практик разведенных и незаботящихся отцов. Анализировались эффекты депривации детей от «Bad Dads» у Ф. Фюрстенберга [Furstenberg, 1988], когда отцы после развода больше не заботились о своих детях. Та же тень негации ложилась и на отцов, сохранявших контакт с детьми, но только в уикенд, прежде всего развлекательно-досуговой направленности – «Disneyland Dads». Смена парадигмы, содержащей оценочные характеристики, привела и к иному исследовательскому профилю, более прагматичному и интегрирующему разные поля отцовских практик в круг нормативного отцовства. Так, в исследованиях Мариам Тази-Преве было обнаружено, что дети только выигрывают когнитивно и эмоционально, если удастся реализовать в модели проживания на два дома приличный объем отцовской работы в повседневности, не сводя отцовскую роль после развода только к функции кормильца [Tazi-Preve et al., 2007]. Наконец, как реакция на разбуженный общественный интерес к фигуре отца, его эгалитарным, современным, «новым» вариациям, но и скептицизм относительно широкого воплощения из-за перегрузок профессиональной роли, было предложено Хайнцем Вальтером более трезвое прагматичное обозначение нового, эмпирически узнаваемого типажа «достаточно хорошего отца» [Walter, 2008].

Вернемся к исследованию К. Борн и Х. Крюгер, вернее, к их выводу о том, что документируемая во многих исследованиях потребность молодых отцов шире участвовать в семейной жизни разбивается «о границы института рынка труда» [Born, Krüger, 2002, s. 117]. «Новые формы отцовства должны быть не только нормативно желаемы, но и соответственно фактически оформлены – вразрез с существующей структурой рынка труда» [Ibid, s. 138]. Но не только в этом дело. Как полагает Михаэль Мойзер, расширение социального ангажемента отцовства зависит и от готовности женщин выпустить ряд домашних обязанностей из своих рук [Meuser, 2007, s. 146], т.е. одновременно и расстаться с долей влияния, авторитета внутри семьи. Поэтому не в последнюю очередь значение имеют желания и страхи самих женщин относительно своей роли хорошей матери [Lupton, Barclay, 1997, p. 147], объем авторитета которой зиждится на отправляемых функциях внутри домохозяйства, связанных с этим компетенциях, равно как и их отсутствием у других членов семьи. Ядро унаследованного от буржуазного общества проекта маскулинной идентичности – профессиональная ориентация в ущерб семейной. Но, как известно, в доминирующем образце семейной пары с двойной карьерой и двойным доходом профессиональная деятельность больше не является прерогативой мужчин, более того, для женщин выход на рынок труда и конкуренция с мужчинами имеет позитивную коннотацию завоевания, эмансипации. Напротив, мужская приватизация на-

ступает на сами основы маскулинной идентичности, конфронтируя с концептом гегемонной маскулинности и гомосоциальности. Может быть, именно через меняющееся либерализированное отцовство, выходящее за рамки гомосоциальности и отказывающееся от иерархий в семейном кругу, этот разрыв возможно будет сократить? Исходя из описанных выше тенденций, как нам кажется, нормативное отцовство может приобрести большее влияние и практику, если в публичном дискурсе будет граничить с возросшими к нему ожиданиями, требованиями, а также институциональными возможностями. Пока же повседневный мир семьи поддерживает традиционный расклад ожиданий. Кроме того, как мы знаем, решающим условием для принятия решения о семейной жизни для мужчины является полная трудовая занятость, если же эффекты деинституционализации жизненного пути приводят к разрушению нормализованных биографий с полной занятостью, хотя и с адаптацией к рискам, это, скорее всего, негативно скажется на готовности к новым практикам отцовства.

## Литература

- Урланис Б. Берегите мужчин! // Литературная газета. 1968. 26 июля.
- Badinter E.* Die Mutterliebe: Geschichte eines Gefühls vom 17. Jahrhundert bis heute. 1981.
- Born C., Krüger H.* Vaterschaft und Väter im Kontext sozialen Wandels. Über die Notwendigkeit der Differenzierung zwischen strukturellen Gegebenheiten und kulturellen Wünschen // Walter, Heinz (Hrsg.) Männer als Väter. Sozialwissenschaftliche Theorie und Empirie. Gießen, 2002. S. 117–143.
- Bürgisser M.* Egalitäre Rollenteilung. Erfahrungen und Entwicklungen im Zeitverlauf. Zürich, 2006.
- Dollahite D.C., Hawkins A.J., Brotherson S.E.* Fatherwork: A Conceptual Ethic of Fathering as Generative Work. Generative Fathering: Beyond Deficit Perspectives. Thousand Oaks, 1997. P. 17–35.
- Fthenakis W.E.* Mehr als Geld? Zur (Neu-) Konzeptualisierung väterlichen Engagements // Fthenakis W.E., Textor M.R. (Hrsg.) Mutterschaft, Vaterschaft. Weinheim, 2002. S. 90–119.
- Furstenberg F.* Good Dads – bad Dads // Cherlin, Andrew (Hrsg.) The Changing American Family and Public Policy. Washington, 1988. P. 193–218.
- Gampert C.* Der entmachtete «Vater». Auszug aus Kursbuch 140 «Väter», Rowohlt, Juni, 2000. S. 161–169.
- Gross M.* Familien im Wandel – Ein historischer Abriß der Familie ab dem 18. Jahrhundert bis heute // Familie – woher, wohin? Lebensformen im Wandel der Zeit. Weimar, 1996. S. 5–16.
- Gumbinger H.-W., Bambej A.* Vaterschaft zwischen Norm und Selbstbestimmung? WestEnd Neue Zeitschrift für Sozialforschung, 4. Jg., H. 1. 2007. S. 92–101.
- Lange A., Zerle C.* Väter im Familienalltag. Die Kluft zwischen Einstellung und Verhalten // BZgA Forum Sexualaufklärung und Familienplanung. H. 2. 2008. S. 17–20.

*Lupton D., Barclay L.* (eds.) *Constructing Fatherhood: Discourses and Experiences*. L., Thousand Oaks, Calif.: Sage, 1997.

*Martin R.* *Väter im Abseits. Mutter und Kind in der vaterlosen Gesellschaft*. Stuttgart, 1979.

*Matzner M.* *Vaterschaft aus der Sicht von Vätern*. Wiesbaden, 2004.

*Meuser M.* Vereinbarkeit von Beruf und Familie – ein Problem für Männer? Familie und Lebensverlaufsplanung bei Männern // E. Barlösius, D. Schiek (Hrsg.) *Demographisierung des Gesellschaftlichen. Analysen und Debatten zur demographischen Zukunft Deutschlands*. VS Verlag für Sozialwissenschaften. 2007. S. 135–150.

*Mitscherlich A.* *Auf dem Weg zur vaterlosen Gesellschaft. Ideen zur Sozialpsychologie*. München, 1963.

*Ostner I.* *A New Role for Fathers? The German Case* // Hobson B. (ed.) *Making Men into Fathers : Men, Masculinities and the Social Politics of Fatherhood*. West Nyack, NY, USA: Cambridge University Press, 2002.

*Petzold M.* *Vorbereitete und unvorbereitete Väter fünf Jahre nach der Geburt des ersten Kindes* // *Psychologie in Erziehung und Unterricht*. 1991. 38. S. 263–271.

*Popenoe D.* *Life without Father: Compelling New Evidence that Fatherhood and Marriage Are Indispensable for the Good of Children and Society*. N.Y., 1996.

*Rosenbaum H.* *Proletarische Familien. Arbeiterfamilien und Arbeiterväter im frühen 20. Jahrhundert zwischen traditioneller, sozialdemokratischer und kleinbürgerlicher Orientierung*. Frankfurt am Main, 1992.

*Sass J., Jaeckel M.* (Hrsg.) *Leben mit Kindern in einer veränderten Welt. Einstellungen und Lebensplanung von Eltern im Ost-West Vergleich*. München, 1998.

*Schmitt C., Winkelmann U.* *Wer bleibt kinderlos? Sozialstrukturelle Daten zur Kinderlosigkeit von Frauen und Männern*. Discussion Paper 473. Berlin: Deutsches Institut für Wirtschaftsforschung (DIW), 2005.

*Schmidt-Denter U.* *Die soziale Umwelt des Kindes*. Berlin: Springer, 1984.

*Schneider W.* *Die neuen Väter. Chancen und Risiken. Zum Wandel der Vaterrolle in Familie und Gesellschaft*. Augsburg, 1989.

*Schütze Y.* *Die gute Mutter. Zur Geschichte des normativen Musters «Mutterliebe»*. Bielefeld: Kleine, 1986.

*Tazi-Preve M.I., Kapella O., Kaindl M. et al.* *Väter im Abseits. Zum Kontaktabbruch der Vater-Kind-Beziehung nach Scheidung und Trennung*. Wiesbaden, 2007.

*Walter H.* *Das Echo der Vatersuche* // Walter H. (Hrsg.) *Vater wer bist du? Auf der Suche nach dem «hinreichend» guten Vater*. Stuttgart, 2008. S. 9–44.

*Williams S.* *What Is Fatherhood? Searching for the Reflexive Father* // *Sociology*. 2008. 42 (3). P. 487–502.

*Zerle C., Krok I.* *Null Bock auf Familie? Der schwierige Weg junger Männer in die Vaterschaft*. Gütersloh: Verlag Bertelsmann Stiftung, 2008.

А.Ю. Орлов  
Нижегородский  
филиал  
Национального  
исследовательского  
университета  
«Высшая школа  
экономики»

# **ДЕМОГРАФИЧЕСКИЕ ИССЛЕДОВАНИЯ ЭТНОАССИМИЛЯЦИОННЫХ ПРОЦЕССОВ (НА ПРИМЕРЕ НАСЕЛЕНИЯ ПРИВОЛЖСКОГО ФЕДЕРАЛЬНОГО ОКРУГА)**

---

Историко-географические факторы обусловили формирование сложного полиэтнического пространства России. Совместное существование этносов в нашей стране явилось условием сохранения и развития каждого из них наряду с условием целостности государства. До тех пор пока в России сохраняется феномен полиэтничности, неотъемлемой чертой демографических исследований будет являться их дифференциация по этническому признаку.

Причины неоднородной динамики численности этносов объясняются, с одной стороны, этническими особенностями естественного движения и миграционной активности, а с другой, собственно этническими процессами, под которыми, прежде всего, понимаются процессы смены идентичности или, что то же самое, этноассимиляционные процессы. Поскольку эти процессы не меняют общей демографической структуры и численности населения, они редко становятся объектом собственно демографических исследований, оставаясь в исследовательском поле гуманитарных дисциплин – этнологии, культурологи, психологии и др. Тем не менее, так как в полиэтничных государствах от изменения этнодемографического баланса во многом зависит стратегия регионального развития, целесообразно изучение процессов смены этнической идентичности с позиций демографии.

В качестве ключевого региона для исследований выбран Приволжский федеральный округ (ПФО). Этнодемографическая особенность округа заключается в том, что в Российской Федерации он один из самых многонаселенных (занимает второе место после Центрального округа) и самых полиэтничных, его территория на протяжении многих веков являлась бесконфликтным пространством.

Корни этнического смешения на территории Поволжья уходят в далекую древность, когда славянские племена, выходцы из Киевской Руси, переселив-

шись сюда, совместно проживали с обитавшими здесь финно-уграми и тюрками, взаимно воспринимая многое из материальной и духовной культуры друг друга. Этот исторический пример показывает, что на территории округа изначально проживает генетически смешанное население без контрастных культурных различий, что облегчает возможность смены идентичности.

В настоящей работе ставилась цель не столько рассчитать в абсолютном измерении потоки населения из одних этнических групп в другие (выполнить это достоверно практически невозможно), сколько зафиксировать при помощи численных показателей сам факт существования таких процессов и интенсивность ассимиляции этносов относительно друг друга.

При фиксации уровня ассимиляции возникает проблема выбора численных показателей. Целесообразно, прежде всего, сравнить значения уровня итоговой рождаемости, определяющего среднее количество детей, рожденных каждой женщиной реального поколения в среде конкретного этноса к концу фертильного периода, с изменением численности данного этноса за определенный период времени. В качестве главного канала этноассимиляционных процессов выступают межэтнические браки, дети от которых обычно выбирают этническую принадлежность одного из родителей, прерывая тем самым этническую линию другого. Численно зафиксированный уровень межэтнической брачности, отражающий ее долю в общем количестве браков представителей данного этноса, будет важным показателем.

Таким образом, динамика численности за межпереписной период 1989–2002 гг., среднее число рожденных детей каждой женщиной поколения 1953–1957 гг. рождения к концу фертильного периода и уровень межэтнической брачности основных этносов ПФО (тех, чья доля в общей структуре населения превышает 0,1%) представлены в табл. 1.

Можно видеть некоторую парадоксальность и демографическую нелогичность показателей. Этноты, имеющие сравнительно высокую рождаемость – удмурты, чуваша, марийцы и, особенно, коми-пермяки – сократили свою численность (известно, что миграционного оттока данных народов не наблюдалось). С другой стороны, татары, имеющие низкий уровень итоговой рождаемости, возросли. Уровень рождаемости еще более увеличивших свою численность башкир относительно высок, но все же ниже, чем у марийцев и коми-пермяков. Этнос с невысоким уровнем рождаемости – мордва – значительно снизил свою численность, тогда как этнос с еще более низкой рождаемостью – русские – незначительно. Близкородственные им белорусы и украинцы с более высокой, чем у русских, рождаемостью сократились значительно сильнее.

Таблица 1.

Динамика численности, уровень итоговой рождаемости и уровень межэтнической брачности основных народов ПФО

Этносы	Динамика численности населения 1989–2002 гг., %	Среднее число рожденных детей каждой женщиной поколения 1953–1957 гг. рождения к концу фертильного периода	Уровень межэтнической брачности, 2002 г., %
Немцы	-36,39	2,320	50,3
Украинцы	-27,52	2,044	48,5
Белорусы	-23,37	1,875	51,4
Мордва	-17,52	1,974	34,5
Коми-пермяки	-15,73	2,537	–
Удмурты	-8,23	2,184	25,0
Чуваши	-4,25	2,206	20,8
Марийцы	-4,10	2,408	19,3
Русские	-2,90	1,808	11,8
Татары	+3,31	1,979	21,1
Казахи	+9,30	2,622	15,7
Башкиры	+33,86	2,366	21,9
Азербайджанцы	+114,25	2,596	22,8
Армяне	+318,73	2,139	19,5

*Источник:* расчеты на основе данных Госкомстата по Всесоюзной переписи населения 1989 г., Всероссийской переписи населения 2002 г.; данные Центра демографии и экологии человека [Население России 2003–2004, 2006].

Если брать в расчет то, что восточнославянские этносы в ПФО за весь межпереписной период получали иммиграционную подпитку, то результаты выглядят еще более парадоксальными. Если увеличение численности казахов и, особенно, закавказских народов, а также убыль немцев можно объяснить миграционными процессами, то снижение численности украинцев, имеющих приток извне в абсолютном исчислении еще больше, с точки зрения демографии необъяснимо.

Таким образом, видно, что помимо собственно демографических процессов на изменение численности народов в ПФО влияют еще процессы иного рода, а именно – смена этнической идентичности или, проще, переход населения из одних этнических групп в другие.



Уровень межэтнической брачности достигает максимального значения как раз у тех этносов, у которых выявлены демографические нелогичности – украинцев, белорусов, мордвы (по коми-пермякам данных нет, но на основе этносоциологических исследований в бывшем автономном округе [Шабаев, 2006] можно сделать вывод, что и у них велика доля межэтнических браков). Так же высок уровень межэтнической брачности у немцев, сокращение которых, вероятно, можно объяснить помимо эмиграции еще и ассимиляцией.

Исследования, проведенные ранее, выявили зависимость числа межнациональных браков от этнической гомогенности самих брачующихся [Кожевникова, Рыбаковский, Сигарева, 1998]. Та часть населения, которая имеет в своем происхождении со стороны предков или родителей брачные связи с другими этническими группами, вступает в иноэтнические браки в три раза чаще, чем те, кто два последних поколения строили брачные отношения на моноэтнической основе. Таким образом, межэтническая брачность у этносов, склонных к ней, еще более нарастает.

Следует верифицировать гипотезу об ассимиляции части финно-угорского и славянского населения на другом примере. Исходным предположением будет следующее: при ассимиляции посредством межэтнической брачности более молодых представителей этноса должно быть непропорционально меньше, чем более взрослых. Для этого следует рассмотреть возрастную структуру основных народов округа. Градация населения проведена по трем основным возрастным группам: моложе трудоспособного возраста, трудоспособное население и старше трудоспособного возраста (табл. 2).

Из таблицы видно, что самая низкая доля молодежи и самая высокая доля пожилых среди титульных этносов округа опять у мордвы и коми-пермяков, а среди нетитульных – у украинцев, белорусов и немцев. Причем доля молодежи у украинцев и белорусов «вызывающе» неестественна.

Смешанные семьи украинцев, белорусов и немцев встречаются в половине случаев, немного меньше – у финно-угорского населения (исключение – марийцы с относительно невысокой долей межэтнической брачности). Но даже в мононациональных семьях славянских и финно-угорских народов русская идентичность если и не преобладает, то сосуществует наряду с родной. Чем моложе возраст, тем большая существует вероятность ассоциирования себя с языковой и культурной средой повседневного окружения, в данном случае русской.

По мнению большинства этнологов, этнической ассимиляции предшествует ассимиляция языковая. Если два показателя этнического самосознания человека – этническая идентичность и родной язык – совпадают, это означает

естественный ход этнокультурного развития, нормальную передачу этнической информации из поколения в поколение. Выбор в качестве родного языка другой национальности означает преодоление серьезного психологического барьера.

**Таблица 2.** Возрастная структура основных этносов ПФО, 2002 г.

Этносы	Моложе трудоспособного возраста, %	Трудоспособного возраста, %	Старше трудоспособного возраста, %
Белорусы	5,25	55,92	38,83
Украинцы	6,94	59,42	33,64
Мордва	12,08	60,96	26,96
Немцы	15,06	65,24	19,70
Коми-пермяки	16,47	63,10	20,43
Удмурты	17,29	63,33	19,38
Русские	18,30	60,89	20,81
Чуваши	18,89	61,24	19,87
Татары	19,90	60,81	19,29
Марийцы	20,85	63,17	15,98
Башкиры	23,97	58,28	17,75
Казахи	26,80	63,26	9,92
Армяне	26,87	63,78	9,35
Азербайджанцы	32,71	65,21	2,08

*Источник:* расчеты на основе данных Госкомстата по Всероссийской переписи населения 2002 г.

Третьей гипотезой будет тезис о том, что те народы, которые в наименьшей степени владеют языком своей национальности и в наибольшей – языком большинства (в данном случае таковым считается русский), более предрасположены к смене этнической идентичности. В качестве индикаторов языковой ситуации выделены степень владения русским языком как родным и степень невладения языком своей национальности.

К сожалению, языковой блок вопросов в переписи 2002 г. существенно отличался от вопросов, применявшихся в прошлых переписях. Из него был исключен вопрос о родном языке, а из вопроса о владении русским языком выпало слово «свободно». В связи с этим достоверно отследить динамику си-

туации за межпереписной период не представляется возможным. Единственным динамическим показателем, который можно использовать, является степень невладения языком своей национальности. Языковую ситуацию целиком наиболее адекватно будут отражать данные переписи 1989 г. (табл. 3).

**Таблица 3.**

Языковая ситуация в среде основных народов ПФО

Этносы	Считают родным русский язык 1989 г., %	Не владеют языком своей национальности, %	
		1989 г.	2002 г.
Белорусы	63,5	48,8	69,3
Немцы	58,0	58,2	68,4
Украинцы	57,0	41,6	56,9
Армяне	31,8	24,5	28,7
Мордва	30,8	23,1	32,6
Удмурты	28,9	23,8	32,6
Коми-пермяки	28,7	21,6	16,9
Чуваши	22,3	18,0	23,46
Марийцы	17,8	14,8	23,2
Азербайджанцы	14,6	13,2	18,6
Татары	14,2	10,8	19,2
Казахи	11,5	9,6	28,0
Башкиры	10,0	25,4	28,70

*Источник:* расчеты на основе данных Всесоюзной переписи населения 1989 г. и Всероссийской переписи населения 2002 г.

Прежде всего, следует отметить возрастание в 2002 г. доли лиц, не владеющих языком своей национальности у подавляющего числа народов округа. Объяснение этому явлению может заключаться в укоренении пришлых народов и этнической конвергенции всех живущих на территории ПФО этносов.

Максимальна доля невладеющих языком своей национальности у немцев, белорусов и украинцев (более 40% в 1989 г. и более половины в 2002 г.). Средние значения (от 20 до 40%) отмечены у башкир, мордвы, удмуртов, коми-пермяков, чувашей и армян. Минимальны показатели у азербайджанцев, казахов, татар и марийцев.

Показатели доли лиц, считающих родным языком русский, вполне коррелируют с показателями доли лиц, невладеющих языком своей национальности. Исключение составляют башкиры, у которых невысок процент считающих родным языком русский, но относительно высок – невладеющих башкирским. Объясняется это тем, что около 17% башкир родным языком считают татарский.

Если выделенные показатели языковой ситуации считать маркерами ассимиляционных процессов, то все этносы можно разделить на три группы: с показателями, максимально соответствующими ассимиляции, – украинцы, белорусы, немцы; со средними показателями – чувашаи, мордва, удмурты, коми-пермяки и армяне; с показателями, препятствующими ассимиляции, – татары, башкиры, марийцы, казахи, азербайджанцы.

Таким образом, на основе всех индикаторов, отмечающих ассимиляционные процессы – межэтнической брачности, возрастной структуры и языковой ситуации – можно провести типологию основных этносов округа по интенсивности процессов смены этнической идентичности.

*1 тип* – максимально ассимилируемые народы с очень высоким уровнем межэтнической брачности (около 1/2), неестественно низкой долей молодых возрастов и максимальной долей в населении невладеющих языком своей национальности и считающих родным русский язык – белорусы и украинцы. К этой группе следует также отнести немцев, у которых доля молодых возрастов в структуре населения выше, чем у двух предыдущих этносов, но показатели межэтнической брачности и языковой ассимиляции соответствуют данному типу.

*2 тип* – значительно ассимилируемые народы с высоким уровнем межэтнической брачности (более 1/4), низкой долей молодых возрастов и высокой долей лиц, перешедших на русский язык в качестве родного, – мордва, коми-пермяки, удмурты.

*3 тип* – незначительно ассимилируемые народы, мало сократившие свою численность, со средним уровнем межэтнической брачности (около 1/5), имеющие возрастную структуру, близкую к среднеокружной, и относительно невысокую долю лиц, не владеющих языком своей национальности, – марийцы, чувашаи.

*4а тип* – неассимилируемые титульные народы, увеличившие свою численность, со средним уровнем межэтнической брачности и долей молодых возрастов, незначительно превышающих общеокружной уровень, а также с минимальной долей лиц, перешедших на русский язык в качестве родного, – татары и башкиры.

*4b тип* – неассимилируемые нетитульные народы со значительным или очень значительным увеличением численности, со средним или низким уровнем межэтнической брачности (1/5 и ниже), повышенной долей молодых и трудоспособных возрастов и минимальной долей перешедших на русский язык в качестве родного – казахи и азербайджанцы. К этому типу следует отнести также армян, у которых, в отличие от двух предыдущих этносов, велика доля перешедших на русский язык. Но все остальные показатели и национальная специфика армянского народа свидетельствуют об их неассимилируемости.

И, наконец, в отдельный тип можно выделить русских с очень низким уровнем рождаемости, неблагоприятной возрастной структурой с долей молодежи ниже среднеокружного уровня, которые по демографической логике должны были бы сократиться значительно, чем есть на самом деле. Незначительное сокращение русских дает основание назвать их ассимилирующим этносом.

Ассимиляционный прирост играет существенную положительную роль в сохранении численности русского населения на территории ПФО; несмотря на более низкие показатели рождаемости русских в округе, чем по России в целом, их сокращение здесь ощутимо меньше.

Следует добавить, что в данной типологии такие понятия, как «значительно ассимилируемые», «неассимилируемые» народы и др., достаточно условны, поскольку абсолютно неассимилируемых народов в современном мире быть не может. Какая-то доля межэтнических браков существует всегда, и дети от них чаще все же выбирают национальность одного из родителей, чем усваивают этническую культуру обоих в равной степени. В таких случаях возможна ассимиляция и русских, и татар, и закавказских народов. Вопрос лишь в пропорциях, что определяет большую или меньшую склонность этноса к смене идентичности.

Таким образом, можно сделать вывод о том, что ассимиляционные процессы существенно влияют на динамику численности некоторых народов Поволжья, тех, для которых характерно особенно сильное смешение с соседними этносами, главным образом, с русскими.

Вторым не менее важным выводом является то, что ассимиляционный прирост русского этноса в ПФО является главной преградой на пути к его стремительной депопуляции. И если миграционная подпитка русских постепенно сошла на нет, то говорить о прекращении ассимиляционного прироста нет основания.

Поскольку трансформация этнической идентичности представляет собой процесс, то в демографических исследованиях правомерно обозначить его как

ассимиляционное движение населения, которое может прямо или косвенно фиксироваться статистикой. Таким образом, при анализе демографической ситуации полиэтничного региона целесообразно рассматривать не только «традиционные» для демографии естественное и миграционное движение населения, но и включать в исследования ассимиляционное движение.

## **Литература**

*Кожневникова Н.И., Рыбаковский Л.Л., Сигарева Е.П.* Русские: этническая гомогенность? (Опыт социологического исследования). М.: ИСПИ РАН, 1998.

Население России 2003–2004. Одиннадцатый-двенадцатый ежегодный демографический доклад / под ред. А.Г. Вишневого. М.: Наука, 2006.

*Шабав Ю.П.* Этносоциальные последствия объединения регионов (Из опыта формирования Пермского края) // Социологические исследования. 2006. № 3. С. 64–71.

I. Niculescu-Aron,  
C. Mihaescu,  
R. Caplescu  
Bucharest Academy  
of Economic Studies

# **DO ROMANIAN PEOPLE STILL WANT BABIES? RECENT ASPECTS REGARDING THE NATALITY BEHAVIOUR AS A COMPONENT OF A NEW MODE OF LIFE<sup>1</sup>**

---

## **1. Introduction**

In the Western and Central European countries, as well as in other regions with western culture, the demography of the mid-1960s «signalled» the beginning of important changes regarding family life, especially marriage and reproductive behaviour. The occidental society begins to pay increasingly more attention to the *fulfilment of a person's needs*, their freedom to build their own life, focus on their professional career and other ways of personal fulfilment. The importance of family and children in a person's life is diminishing compared to the past, competing with other elements that may bring them satisfaction, joy or fulfilment.

In the plan of demographic paradigms appears a breach. The classical demographic transition theory cannot comprise evolutions that break the demographic equilibrium between natality and mortality. Therefore, the model of the Second Demographic Transition emerges [Dirk van de Kaa, 1987]. The classical family model, dominated by «altruistic» relations becomes the individualist model, and the child decays from the role of «king-child» to a smaller one [Aries, 1980, apud. Rotariu, 2005].

The process of women emancipation becomes increasingly more obvious. Her old statute as defined by the triad «children, saucepan, church» becomes a new one,

---

<sup>1</sup> The aims of the paper fit into the interest area of the research project entitled «Modelling the financial behaviour of the population under the impact of demographic ageing. System of specific indicators and measures for controlling the financial disequilibria», contract number 91016/2007 CNMP (National Centre for Program Management), in the competition Partnerships PNDII2007, Romania. Project Acronym: ID\_CFP, site: [www.idcfp.ase.ro](http://www.idcfp.ase.ro) (for I. Niculescu-Aron, C. Mihaescu). This work was cofinanced from the European Social Fund through Sectoral Operational Programme Human Resources Development 2007–2013, project number POSDRU/107/1.5/S/77213 «Ph.D. for a career in interdisciplinary economic research at the European standards» (for R. Caplescu).

in which education and career prospects, the presence on the labour market and financial autonomy gain importance. Moreover, with respect to the reproductive behaviour, in mid-1960s the use of the contraception pill becomes widespread, which radically changes the birth control process and triggers a true revolution of women sexuality, freeing them from the spectrum of unwanted pregnancies.

In this context, the ex-communist countries differ with regard to their reproductive behaviour, which was restricted to a high extent by the rigours of a pro-natalist, coercive demographic policy imposed by the totalitarian regimes. After their fall and the abrogation of the legislation concerning abortion, divorce and contraception and family planning methods, all the countries in the former communist bloc recorded a steep and drastic decline of fertility [Sobotka, 2003]. Among them Romania was the most severe case. For these reasons, it is possible to admit that such evolutions could have been the consequences of a change in the attitude-value system of the respective population.

Until 2005, when Romania took part in the first wave of the Generations and Gender Survey (GGS) [Vikat et al., 2006], no surveys regarding the reproductive behaviour of the population were made. Unfortunately, Romania did not continue the recordings for the second wave (2008) of this Survey initiated by the UN (UNECE). In order to solve some of these informational problems, in April 2010 a group of researchers from the Polls and Surveys Centre of the Bucharest Academy of Economic Studies conducted a survey on the topic of couple formation and procreative behaviour, gathering some recent data relevant to the topic.

## 2. Recent trends in Romanian fertility

The decrease of the Romanian natality after the abrogation of the pro-natalist – coercive legislation at the end of 1989 was a natural and expected reaction. However, the steepness and the speed of the decrease took even the specialists by surprise. This evolution made fertility through natality the decisive factor (but not the exclusive one) in the onset and acceleration of two of the demographic processes that affect the country's population for almost two decades: **demographic decline** and **demographic ageing**.

Although the decrease in population size is worrisome, what raises more concerns is the shift in its age structure. The most recent demographic data indicate almost equal weights for youth and elderly, in other words, so many young, as many elderly [Mihăescu et al., 2009]. Under these circumstances, the demographic «pressure» on the adults (15–64 years) is almost equally distributed between the two population segments.



In the Romanian society the prevalent factors that led to this natality decrease are those of economic nature, such as the emancipation of women, the increase in education period and level, the diminished importance given to moral, cultural and religious norms, the high cost for raising a child, the diminishing economic role of the child, especially for the economic security of the elderly, and the emergence of the contraceptive means [Mureşan, Hărăguş et al., 2008].

From a level of 1,83 children/woman in 1990, the total fertility rate decreased firmly and vertiginously to levels that placed Romania among the countries with the lowest fertility in the world. Despite this being the dominant and most concerning trend of the fertility evolution in the 1990s, there is a second important change of the phenomenon as well and that is **the restructuring of the fertility model** [Gheţău, 2007], which manifests itself through the postponement of marriage and childbearing, these taking place not in the early, but in the late twenties.

Considering all these factors and analysing their influence on the evolution direction of natality, we may state that *Romania converges towards the «European» reproductive model, characterized by an increase in fertility of women aged 30 years and more and to a greater extent by single mothers, but in consensual unions.*

The structural changes in natality that began in the mid-1990s are still developing and the experience of the developed countries shows that this process may extend over several decades. By postponing births the generational replacement process is hindered and this distortion may lead to major unwanted implications.

The demoscopic survey that took place in April 2010 constituted the data base for the analysis of the most recent mentalities and options regarding the Romanian procreative behaviour.

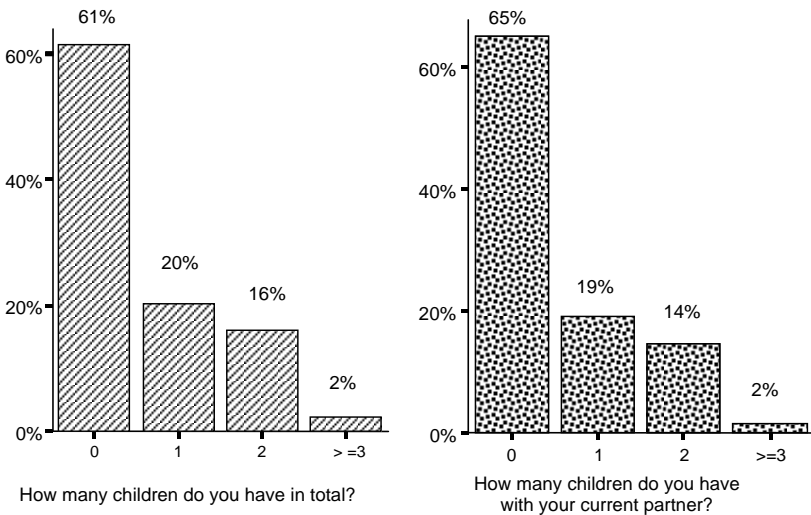
### **3. The survey regarding the procreative behaviour**

The survey was conducted on a non-probabilistic sample of 4525 respondents in the period between 1–15 April 2010 using face-to-face interview. The target population consists of adults aged between 18 and 49 years, who declared that they have a partner for at least two months. The sample was made using directional sampling, according to the **age** and **gender** characteristics of the respondent, and the method was that of quota sampling. The questionnaire used is based on 37 questions clustered in distinct sections: general information, behaviour regarding couple formation and attitudes regarding procreative behaviour.

### 3.1. Data base analysis

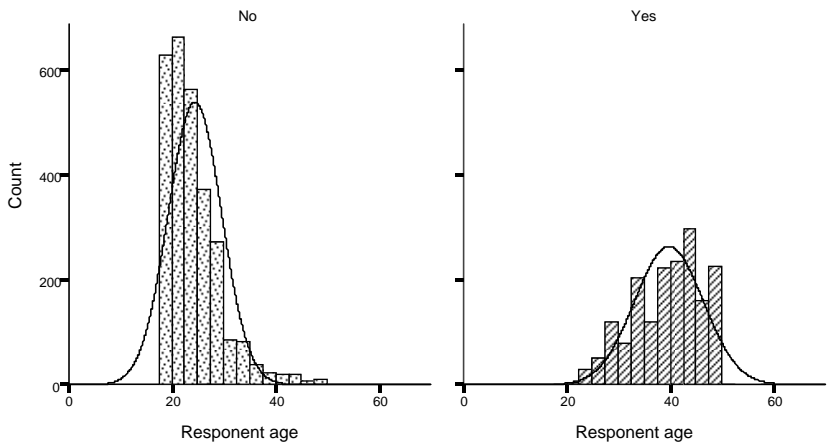
The analysis will focus on the respondents' options and decisions regarding couple behaviour. Out of the total 4525 respondents, 61,4% do not have children, 20,3% have one child, 16% have two children, and the rest of 2,3% have three children or more. For the variable **Number of children with the current partner** the results are relatively similar (as may be observed in Fig. 1). Only 9,45% of the respondents have one or more children from another relationship.

The analysis focused on the group of respondents that do not have children yet, trying to identify the specificities of this group and the factors that might influence them when deciding whether to have children or not. Thus, we split the data base by the dichotomous variable «Do you have any children?», with possible answers «Yes» and «No» (Fig. 2).



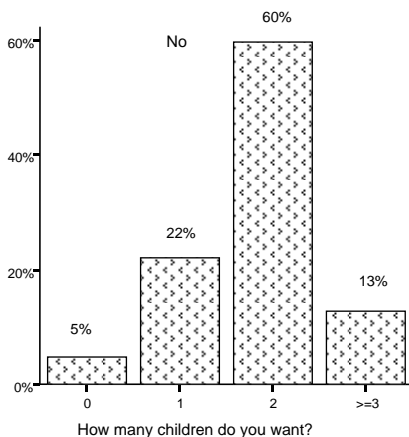
**Fig. 1.** Distribution of the respondents by the number of children they have

Those who do not have any children yet are generally young, their average age being 24,51 years, while the level of the indicator for those who have children is 39,79 years (the difference between the two averages is statistically significant for a probability of 99,9%).



**Fig. 2.** Age distribution of the respondents by the variable «Do you have any children?»

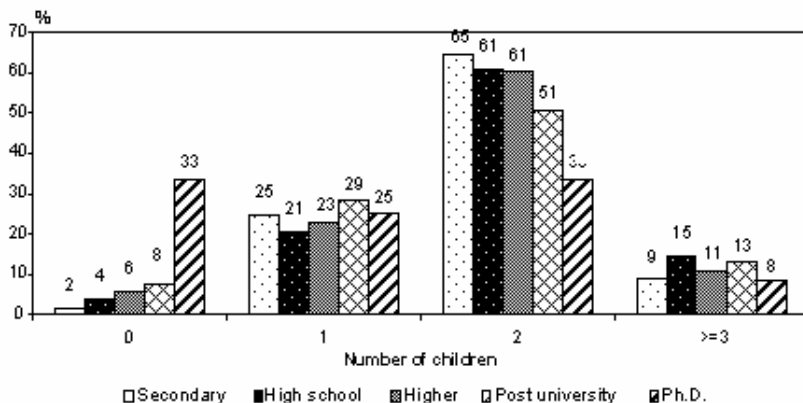
We studied the influence of factors such as age, gender and residence area on the procreative options of the respondents that had no child at the moment of filling in the questionnaire. More than half of the respondents (60%) said that they would want two children, 22% would want one child, 13% would want at least three, while 5% of the 2779 respondents want no children (Fig. 3).



**Fig. 3.** Number of children wanted by the respondents with no children

The average number of children wanted is 1,85, result complying with the realistic current level (1,3 children/woman) and the desirable target (2,1 children/woman) for generational replacement and for slowing down the decline and the demographic ageing in Romania.

Compared to practicing a religion, the respondents that do not want children are 44,2% non-practitioners, and 55,8% are practitioners. In the case of those who want **one child**, the percentages are similar (44,2% non-practitioners and 55,8% practitioners), while the situation is different for the respondents who want **two children**. 618 of them (37,1%) do not have a special relationship with religion, meaning that they do not go to church regularly or they do not have a particular feeling of belonging to any religion, while 62,9% are religious persons. Approximately the same structure is observed for those who would like to have three children or more: 36,4% non-practitioners and 63,6% practitioners.



**Fig. 4.** Number of children wanted by education level

The computed values of the Chi-Square test = 12,164 is significant for a significance level  $\alpha = 0,001$ , which indicates the existence of a relation between the variables **Number of children wanted** and **Religious practitioner**. Despite the weak intensity (Cramer's coefficient is 0,266), the relationship highlights the influence of the religious behaviour on the desire to have children. Those stating that they are practicing religion want children to a greater extent than those who are not.

Gender, residence area and people's option to emigrate do not represent decisive factors in establishing the number of children that the Romanians want to have.

It is interesting, however, to note the connection between the education level of the respondent and the number of children wanted. The persons who have a higher education level want to a lesser extent to have a second child, while 33% of the persons with Ph.D. studies want no children at all. The influence of the education level is statistically significant for a probability of 99,99% (Fig. 4).

The average age when the respondents want their first child is 28,83 years. For males the average age is 29,75 years, while women declare that they would want children at 28,17 years on average. The age at which males want the first child is significantly higher than in the case of women (the value of the Student test is  $t = 11,959$  and the significance level is  $\alpha = 1\%$ ). The results confirm what we mentioned in the first part of the paper regarding the restructuring of the Romanian fertility model, by transiting towards the late, western model (Fig. 5).

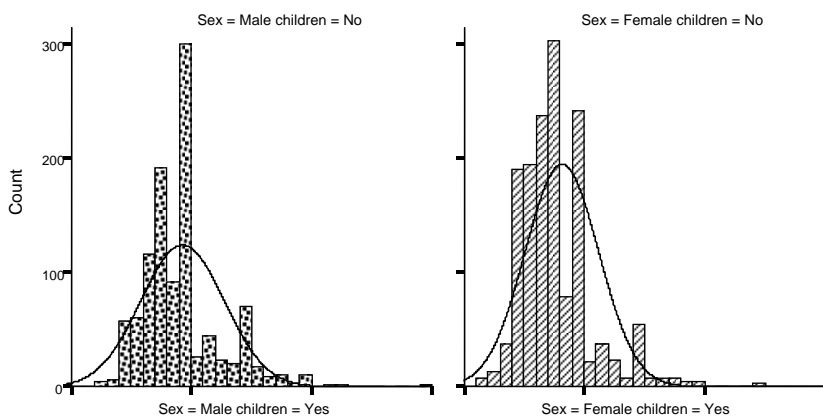


Fig. 5. Age at which they want the first child

### 3.2. Models of procreative behaviour according to residence area

In Romania there are major differences between the capital, Bucharest, and the rest of the country regarding the development level, the access to resources, consumer and accumulation behaviour and implicitly of the demographic behaviour. For this reason, we aim at modelling the procreative behaviour of the respondents by estimating the age at which the first child is wanted, according to residence area.

*The model of fertility behaviour for Bucharest.*

The equation of the model is:

$$\text{Age\_FC}_i = 18,057 - 0,5381 \cdot \text{Md}_i + 0,5938 \cdot \text{Age\_R}_i - G \cdot 0,7539 + \\ + 0,3724 \cdot S_i - 0,0832 \cdot \text{Age\_c}_i - 0,4605 \cdot P_i + \varepsilon_i,$$

$\text{Age\_FC}$  = the age when the first child is wanted;  $\text{Md}$  = dummy variable defined as follows: 1 the respondent is married; 0 the respondent is not married;  $\text{Age\_R}$  = age of the respondent;  $G$  = dummy variable defined as follows: 1 the respondent is a female; 0 the respondent is a male ;  $S$  = education level measured on a scale from 1 to 7;  $\text{Age\_c}$  = the duration of the couple;  $P$  = dummy variable defined as follows: 1 the respondent is a religious practitioner; 0 the respondent is not a religious practitioner;  $\varepsilon_i$  = random component.

After computing the ANOVA test, the regression model is validated ( $F = 460,403$ ) for a probability of 99,9%. The model explains 61,9% of the variation in the age at which children are wanted ( $R^2 = 0,619$ ).

The coefficients of the regression model are statistically significant for a probability of at least 98,9%. If the respondent is married, the age at which they want the first child decreases by 0,5381 years. The coefficient of the variable **Respondent's age** = 0,5938 shows that for one year increase in the age of the respondent, the age at which the first child is wanted increases by 0,5938 years. If the **education level** of the respondent gets one step higher, the age at which the first child is wanted increases by 0,3724 years, and if religion plays an important role for the individual, the age at which the first child is wanted decreases by 0,4605 years. The same is valid for the last estimation: if the couple stays together a year more, the age at which the first child is wanted decreases by 0,0832 years.

*The model of fertility behaviour for the rest of the country.*

The equation of the model is:

$$\text{Age\_FC}_i = 16,521 - 0,7446 \cdot \text{Md}_i + 0,6534 \cdot \text{Age\_R}_i - \\ - G \cdot 0,6991 + 0,5059 \cdot S_i + \varepsilon_i,$$

The meaning of the parameters is the same as mentioned above.

After computing the ANOVA test the regression model is validated ( $F = 394,48$ ) for a probability of 99,9%. The model explains 69,7% of the variation in the age at which the first child is wanted ( $R^2 = 0,697$ ). The coefficients of the regression model are statistically significant for a probability of at least 99,6%.

If the respondent is **married**, the age at which they want the first child is decreased by 0,7446 years. The coefficient of the variable **Respondent's age** = 0,6534 shows that for one year increase in the age of the respondent, the age at which the first child is wanted increases by 0,6534 years. If the **education level** of the respondent gets one step higher, the age at which the first child is wanted increases by 0,5059 years. Also, for female respondents the age decreases by 0,6991.

It is worth noticing that, if the status of the respondent is «married», the age at which the first child is wanted reduces more for a respondent from the province than in the case of a respondent living in Bucharest. Therefore the assertion according to which in the rest of the country the reproductive behaviour follows the traditional model where the first child is born relatively soon after marriage is verified. Because in the rest of the country most respondents (81%) are religious practitioners (compared to 63% in Bucharest), this variable does not influence the procreative behaviour.

But what are the factors that might influence the decision of having (another) child? In order to clear this out we included a question for which the respondents gave marks from 1 to 10 to the various conditions that would influence their decisions.

With the help of the Student test for paired samples, after doing successive tests for all pairs of variable constituted from the answers given for the eight decision factors, a hierarchy was possible. Thus, three groups of factors were identified.

#### **Group 1. Very important factors.**

1. Job stability.
2. Own dwelling.
3. Family income higher than 1000 Euros per month.

#### **Group 2. Important factors.**

1. Help from the parents for raising and fostering the children.
2. Excellent conditions for fostering and education in nurseries and kindergartens.

#### **Group 3. Factors with reduced importance.**

1. Stimulating fees (small, according to parents' incomes) in the nurseries and kindergartens, including the private ones.
2. A state child allowance of at least 50 Euros per month.
3. The state paying a 100 euro salary to a grandparent who would take care of the grandchild.

Therefore, **job stability** is a very important factor for the decision to have a child, as well as the safety of an own dwelling and monthly family incomes higher than 1000 Euros.

The help given in the raising and fostering of the child by their grandparents and excellent conditions for fostering and education in nurseries and kindergartens are the next important factors considered, while the state paying a 100 Euro salary to a grandparent who would take care of the grandchild, stimulating fees in the nurseries and kindergartens, and a state child allowance of at least 50 Euros per month have a reduced importance that could barely influence the decision of having (another) child.

## 4. Conclusion

For the last two decades, the Romanian society went through numerous demographic, socio-economic and cultural changes during the complex process of its modernisation. From a demographic point of view, two evolutions are most visible and raise most concerns: **demographic decline** and acceleration of **demographic ageing**. The main cause is **the severe decrease of fertility and natality after 1989**, generated by the radical change of the *procreative behaviour* of the population.

The Total Fertility Rate decreased steeply and rapidly to levels that placed Romania among the countries with the lowest fertility in the world. *Romania converges towards the «European» reproductive model, characterized by an increase in fertility of women aged 30 years and more and to a greater extent by single mothers, but in consensual unions.*

With the help of the data base resulted from the survey conducted in April 2010, we analysed the options and mentalities of couples regarding their fertile behaviour. The analysis of the data base focused on the procreative behaviour of the respondents and the decisive factors that determine this attitude.

In Romania, there are major differences between Bucharest, the capital, and the rest of the country regarding the development level, the access to resources, consumer and accumulation behaviour and, implicitly, of the demographic behaviour. For this reason, we built two models in order to identify the differences in the procreative behaviour of the respondents in Bucharest and in the rest of the country. Estimation of the age at which the first child is wanted with the help of these models is done through some socio-cultural variables. We verified the assertion according to which in the rest of the country the reproductive behaviour follows the traditional model where the first child is born relatively soon after marriage.

With respect to the conditions that would encourage Romanians to have (more) children, they chose as main decision factor **job stability**, then monthly **income** higher than 1000 Euros, **safety of own dwelling**, **better conditions in kindergartens**, **help in raising and fostering the child/children** by grandparents, **receiving**



**a monthly child allowance** of at least 50 Euros, and stimulating fees in the nurseries and kindergartens and the state paying a 100 euro salary to a grandparent who would take care of the grandchild are the last in the top of conditions that might influence the decision to have a/another child.

The proactive behaviour of Romanians acquires new meanings in the process of mentality and attitude change during the process of modernisation of the Romanian society. Many of them confirm the model of the Second Demographic Transition, while maintaining some specific features. The survey whose data we analyzed revealed the fact that the Romanians want children, but their birth is conditioned by the improvement of the economic and social context.

## References

- Generații și gen, Raport Valul I (Generations and Gender, First Wave Report). 2007. ([ftp://ftp.unfpa.ro/unfpa/Raport\\_GGS.pdf](ftp://ftp.unfpa.ro/unfpa/Raport_GGS.pdf), last accessed on 25.09.2010)
- Ghețu V.* Declinul demografic și viitorul populației României – O perspectivă din anul 2007 asupra populației României în secolul 21. București, Editura Alpha Mdn, 2007.
- Mihăescu C., Niculescu-Aron I., Petre D. Natality Impact on Recent Demographic Ageing Dynamics in Romania // JAQM. 2009. Vol. 4. ([http://www.jaqm.ro/issues/volume-4,issue-3/3\\_mihaescu\\_niculescu\\_petre.php](http://www.jaqm.ro/issues/volume-4,issue-3/3_mihaescu_niculescu_petre.php))
- Mureșan, C., Hărăguș P.T., Hărăguș M. et al.* Romania: Childbearing Metamorphosis within a Changing Context // Demographic Research. 2008. 19(23). (<http://www.demographic-research.org/Volumes/Vol19/23/>)
- Rotariu T.* Anchetă asupra unor fenomene populaționale și emergența unor stiluri de viață în Români. Metro Media Transilvania, CERES. 2005.
- Sobotka T.* Re-emerging Diversity: Rapid Fertility Changes in Central and Eastern Europe after the Collapse of the Communist Regimes // Population-E. 2003. 58 (4–5).
- Van de Kaa, Dirk J.* Europe's Second Demographic Transition // Population Bulletin. 1987. Vol. 42. № 1.
- Vikat A. & col.* Generations and Gender Survey (GGS): Towards a Better Understanding of Relationships and Processes in the Life Course. UNECE/PAU, Geneva, 2006. ([ftp://ftp.unfpa.ro/unfpa/Raport\\_GGS.pdf](ftp://ftp.unfpa.ro/unfpa/Raport_GGS.pdf), last accessed on 25.09.2010)

C. Mihaescu,  
I. Niculescu-Aron,  
R. Caplescu  
Bucharest Academy  
of Economic Studies

# RECENT EVIDENCE IN COUPLE FORMATION IN ROMANIA: SHIFTING TOWARDS THE WESTERN MODEL?<sup>1</sup>

---

## Introduction

The times we live in are marked by profound changes in the social values system regarding family life, especially concerning non-marital cohabitation, the roles and responsibilities of the partners and the demographic behaviour. These changes emerged initially in Western Europe in the second half of the 20<sup>th</sup> century, but they have spread to Central-Eastern Europe as well, where they were fuelled by the fast-changing economic and social conditions caused by their transition to market economies that began in the 1990s.

The most important features of the recent evolutions are greater ease in starting, carrying and terminating relationships, which may be observed when looking at the increasing number of the non-marital cohabitation habits of couples and the increasing divorce rate [Beaujot, 2002, apud Hărăguș, 2005]. The tendency to postpone marriage, the desire to acquire better education level, deferring birth, defining new roles for partners in a relationship, mainly due to a reorganisation of women's priorities (with the career moving towards the top of the list) are some of the most important factors leading to the current social value system and to new life-style habits and personal arrangements.

Choosing a partner, no matter the cohabitation choice, is just as important as finding the right job, deciding whether to have children or not, buying a house or choosing

---

<sup>1</sup> The aims of the paper fit into the interest area of the research project entitled «Modelling the financial behaviour of the population under the impact of demographic ageing. System of specific indicators and measures for controlling the financial disequilibria», contract number 91016/2007 CNMP (National Centre for Program Management), in the competition Partnerships PNDII2007, Romania. Project Acronym: ID\_CFP, site: [www.idcfp.ase.ro](http://www.idcfp.ase.ro) (for I. Niculescu-Aron, C. Mihaescu). This work was cofinanced from the European Social Fund through Sectoral Operational Programme Human Resources Development 2007–2013, project number POSDRU/107/1.5/S/77213 «Ph.D. for a career in interdisciplinary economic research at the European standards» (for R. Caplescu).

friends. All these choices are important decisions in the life of a person, with major consequences for the individual and complex effects on the society [Bozon, 1988].

The base of any relationship is a value system comprising economic, social, cultural and psychological factors that influence its development by interfering with choices and the way they are made.

This being the context, it is of great interest to study the various kinds of motivations that constitute the core elements for choosing a partner. Since the process is not random, there are many criteria that greatly influence it, among which the residence area, the education level, the social class, the health, the role played by family and friends in the life of the individual etc. At the same time, this process is highly dependent on the values of the individual concerning intimate relationships. Recent evolutions confirm the major mutations in these values, which generated a transition from the classical family (couple), initiated by the romantic love, to the post-modern family (couple), with two careers, sustained by a «pure relationship» and «confluent love» [Giddens, 2000, apud Rughiniş, 2002].

Romania is following the same trend. However, unlike other European countries, the manifestation of changes in the demographic behaviour of partnerships has a certain time, rhythm and intensity lag. The characteristics of the Romanian model, common to all Eastern-European countries, are on the one side, the wide spread of cohabitation, combined with high levels of extramarital fertility [Lesthaeghe; Moors, 2000, apud Hărăguş, 2005], and on the other, by child birth soon after marriage.

Romania has one of the most elevated marriage rates in Europe (6,1 per 1000 inhabitants in 2009) and young ages when marriage occurs and children are born. The divorce rate is at a medium level (1,51 per 1000 inhabitants in 2009), compared to other European countries, and a great stability in time. Neither the pro-natalist policy, nor the socio-economic transformations that took place after 1990 could shake this stable cultural model.

According to the first wave of the GGS (2005), the most wide-spread family model is the one of married couples, with one child. The decrease in the living standards determined parents to channel their resources on raising a single child. Compared to the other European countries, Romania has quite a significant proportion of extended, multi-generational families, both because of some economic pressures, and because of the persistence of the traditional model.

Despite the fact that increasingly more couples choose this way of cohabitation, it does not mean that the idea of marriage is rejected. The young persons don't reject the idea of making their relationship official, but they need certainties at all levels

and especially emotional stability. Almost half of those who choose cohabitation are not married and aged between 20 and 34 years.

The first important survey that touched the subject of couple formation in Romania was the Generations and Gender Survey (GGS), whose first wave was conducted in 2005. Unfortunately, Romania did not continue the recordings for the second wave (2008) of this Survey initiated by the UN (UNECE), thus generating an informational gap. With the view to filling some of this gap, a team of researchers from the Polls and Surveys Centre of the Bucharest Academy of Economic Studies conducted a survey on the topic of couple formation and procreative behaviour, gathering some recent data relevant to the topic.

## The survey regarding couple formation in Romania

The data from the last Population and Households Census from 2002 indicate a low proportion of consensual unions in Romania (the first time they were officially recorded): 3,9% of the total population. The data from the GGS estimate higher proportions, between 5 and 7% of the population. In the first wave of the GGS, the population that admitted to live in consensual unions represented 5,7%. Their spread is relatively narrow, compared to Western Europe – in Denmark one in five families is of such type. However, their weight is bigger than in some eastern countries (Poland, The Czech Republic, Slovakia, Lithuania) or Mediterranean countries (Italy, Spain, Greece, Portugal).

The research made shows that persons living in consensual union are generally young, with a more disadvantaged social profile than the married population. They are less educated and poorer. However, the Romanian cohabitants are not a homogeneous population, tending to divide into two distinct categories: for one the cohabitation is more a contextual option, the result of adaptation to a problematic situation (lack of income or dwelling, family problems) and for the other consensual union represents a life option, the expression of a post-modern value orientation.

Our survey was conducted on a non-probability sample of 4525 respondents during 1–15 April 2010 using face-to-face interview. The target population consisted of adults aged between 18 and 49 years, who declared that they have a partner for at least two months. The sample was built using directional sampling, according to the **age** and **gender** characteristics of the respondent, and the method was that of quota sampling. The questionnaire used is based on 37 questions clustered in distinct sections: general information, behaviour regarding couple formation and attitudes regarding procreative behaviour.

## Data base analysis

Since the society is continually changing, we intend, through this survey, to identify the valuing of the marriage institution. Is marriage threatened in a context in which **cohabitation** seems to gain increasingly more ground? In order to answer this question we focused on aspects regarding marriage and cohabitation as living options.

In order to highlight the mentality difference between generations, we created three qualitative groups by respondent's age:

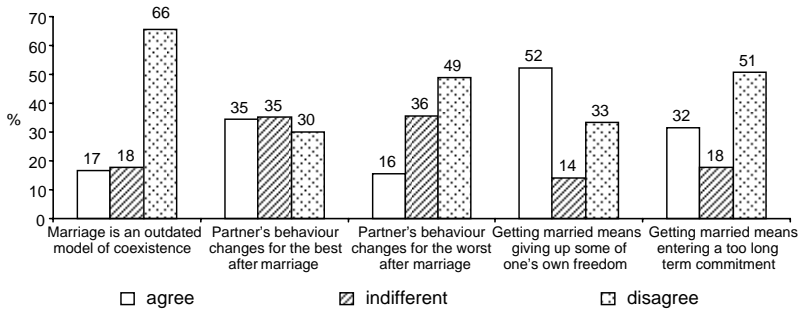
a. The group of the very young respondents, aged up to 24 full years. They are born after the revolution or a little before, which means that they spent their childhood and adolescence under the new regime, taking advantage of the new economic, social, cultural and border opening opportunities, as well as the extraordinary access to information, in an era of information technology and communications.

b. The group of the young respondents, aged between 25 and 34 full years. They are those who spent their childhood under the old regime and the adolescence in a transition period. When adolescents, they had the opportunity to start a career in a period of economic boom. The specifics of the life period they are living, they benefit from the opening of the borders and the extraordinary access to information, in an era of information technology and communications.

c. The group of mature respondents, aged between 35 and 49 full years. They lived their childhood and adolescence under the old, communist regime. Actually, these generations are parents of the respondents in the first group, and who are relatively flexible to the profound changes of the value-attitudes system that took place after 1990 in Romania. We expect their mentality to be much more conservative.

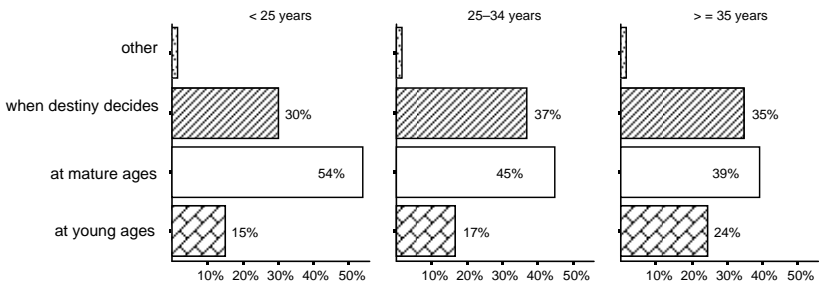
### **1. Mentalities regarding marriage and the reasons why the respondents would get/have gotten married.**

The attitude towards the institution of marriage (see Fig. 1) is not influenced by the generation or the gender of the respondent. 66% of the respondents do not consider it an outdated model of coexistence and the behaviour of the partner is considered to be the same before and after marriage. However, 52% believe that getting married means giving up some of their freedom, but only 32% of them consider that marriage is a too long-term commitment. In the support of this favourable attitude towards marriage also comes the observation that only 16,6% of the married respondents state that they have the feeling that they got married too early.



**Fig. 1.** Attitudes towards marriage

If the attitudes of the generations regarding marriage and its implications are similar, this is not the case of their thoughts about the moment of marriage (Fig. 2). The young and the very young believe to a higher extent that it is better to postpone the moment of marriage until after they have built a career and they reached a certain financial stability. The persons older aged over 35 years attribute a bigger importance to starting a family when the two partners are young and have bigger possibilities to influence each other's behaviour.



**Fig. 2.** Thoughts regarding the moment of marriage by generations

The analysis presented so far helped in getting an idea of the place where the couples met, their attitude towards marriage and thoughts about the moment when it happened. It is important, however, to identify the reasons on which starting a family is based.

In the questionnaire, the respondents were supposed to mark from 1 to 10 the different reasons that would influence/influenced their decision to get married. The options refer to attitudes, subjective norms and perceptions of the behavioural control of the respondents, in order to see whether a certain behaviour related to marriage materializes.

**Table 1.**

Hierarchy of reasons for which the marriage materialised

Married	Mean	Unmarried	Mean
To get married is the proof of true love	8,4	To get married is the proof of true love	7,7
When one wants children, which is our case as well, one must get married	6,4	The birth of a child	7,0
The birth of a child	6,2	When one wants children, which is our case as well, one must get married	5,8
Since we decided to live together, we thought it was natural to get married	6,0	Since we decided to live together, we thought it was natural to get married	4,6
One of us (or both) didn't (don't) want to live with the parents anymore	3,8	One of us (or both) didn't (don't) want to live with the parents anymore	4,0
Marriage is (was) a formality for which our parents insist (insisted)	3,1	Marriage is (was) a formality for which our parents insist (insisted)	2,9
For administrative or financial reasons	2,5	For administrative or financial reasons	2,8

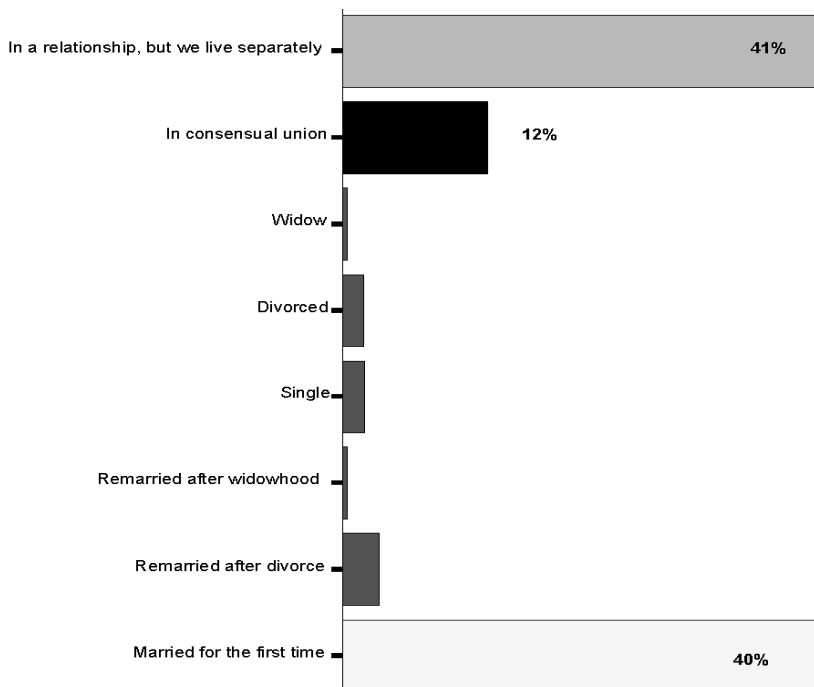
After doing successive Student tests for paired samples for all pairs of variables constituted from the answers given for the seven motivational factors, we made a hierarchy. The average levels of the given marks are presented in Table 1 separately for the married group and the unmarried one, taking into account the resulted hierarchy for each group. The differences between the means are statistically significant for a probability of 99,9%

Comparing the two groups, we notice that, despite the differences between the marks given, the hierarchy is almost identical. The only exception is the rank reversal of the criteria «When one wants children, which is our case as well, one must get married» and «The birth of a child».

## **2. Cohabitation versus marriage. Is consensual union a way of life or a transition period towards marriage?**

The percentage of those who admit to being in consensual union is 12%. At a first sight, it is a much bigger value than those previously presented, but we must remember that the survey sample only consists of persons aged 18 to 49 years, who declared that they have a partner for at least two months.

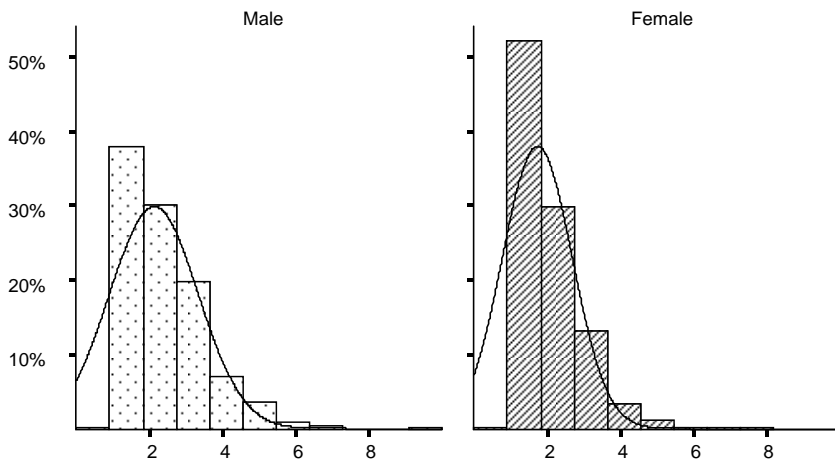
The distribution by marital status (Fig. 3) is well differentiated by the three age groups. In the group of the very young 84% of the respondents have a relationship with their partner, but live separately, and 13% cohabit with the partner. In the group of young people, only 36% live separately and 40% are already married. Characteristic for this age group is the high number of those living in consensual unions (20%). In the group of mature respondents, 80% are married and only 8% declared that they live in consensual union.



**Fig. 3.** Distribution of the respondents by marital status

The average number of stable relationships, including the current one, is 1,88. After computing this indicator by gender, resulted an average value of 2,13 relationships for males and 1,73 for females. The difference between the two means (also suggested by the graphic representation in fig. 4) was verified statistically. The computed value of  $t$  ( $t = 11,6$ ) indicates that the average number of relationships for males is significantly higher than for female respondents (for a probability of 99,9%).





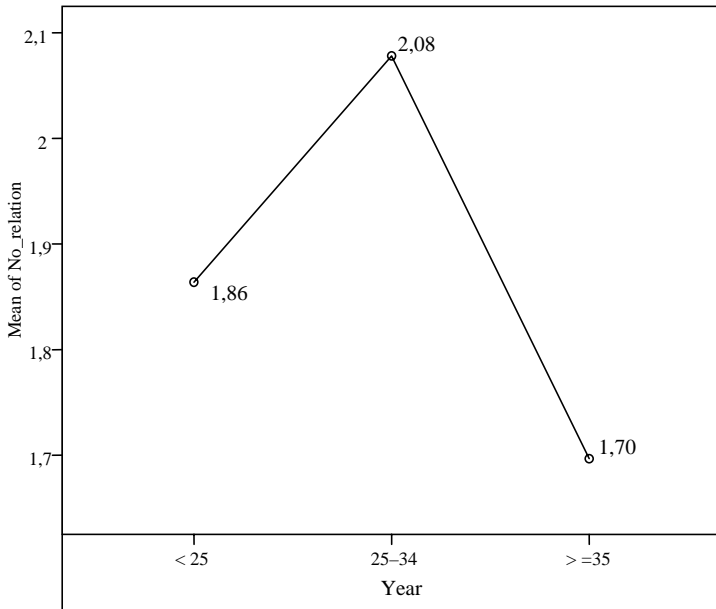
**Fig. 4.** Distribution of the respondents by number of stable relationships and gender

In order to determine whether there are differences between generations regarding couple stability, we started with the variable «Number of stable relationships», applying the ANOVA test with the Welch correction<sup>2</sup>. The computed value of the Welch statistic is 43,828, which indicates significant differences between generations in the number of stable relationships.

The Games-Howell Post-Hoc Multiple Comparison Test suggests that there are no homogenous subgroups, the differences between the three generations being significant, as may be seen in Fig. 5.

The smallest number of relationships is attributed to the generation of 35 years and more (1,7), despite the fact that the period during which they could have changed their partners is bigger. This is a foreseeable result if we take into account that the people in this age group have more traditional mentalities and attitudes compared to the others, considering the social (subjective) norms of the times they grew up in and during which their demographic behaviours were formed. In the same time, the first group, of people aged less than 24 years, although very young, has a bigger average number of stable relationships than the third group.

<sup>2</sup> When the variances of the dependent variable are not equal across groups, the results of the ANOVA test are questionable. The Welch and Brown-Forsythe statistics are alternatives to the usual F test in such a case. As the sample size increases, the distributions of these statistics converge towards an F distribution.



**Fig. 5.** Average number of stable relationships by age groups

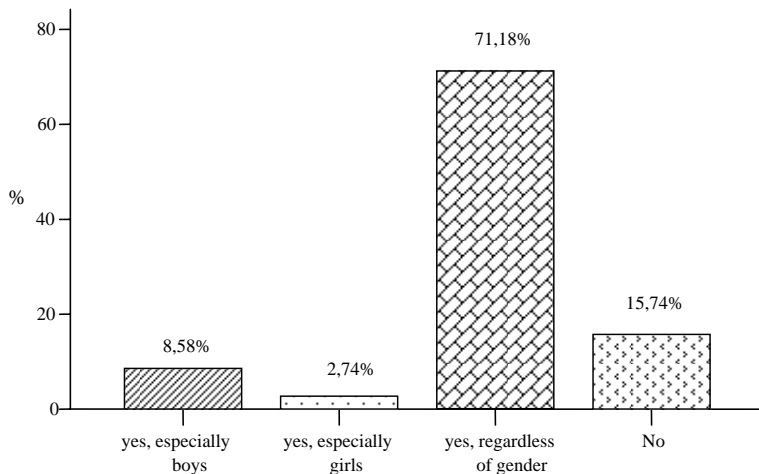
Adaptation to the changes in the norms and values system is confirmed through the answers regarding the cohabitation with the partner before the marriage of the respondent's children.

Most of the respondents (71,18%) believe that it is useful that their son/daughter cohabitates with their partner before marriage. This open-minded attitude is common to all generations and does not differ by gender.

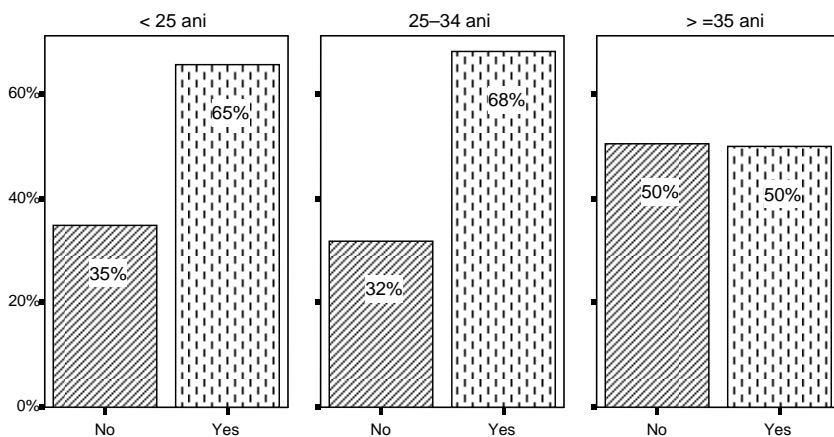
Regarding the moment of initiating sexual relationships in the life of a couple we notice that the group of mature persons differentiates itself from the younger generations (see Fig. 7). The later, about 65% of the very young and 68% of the young, started their sexual relationships in less than six months after meeting the partner.

Next, we aim at determining the characteristics of a person from the group of those who start their sexual relationships in less than six months after meeting the partner with the help of a binomial logistic regression model.

The dichotomous dependent variable is «Person who started their sexual relationships in less than six months after meeting the partner», with answer options **0 No** and **1 Yes**.



**Fig. 6.** Thoughts regarding the cohabitation of the son/daughter with the partner before marriage



**Fig. 7.** Proportion of those who started their sexual relations after less than six months after meeting the partner, by age groups

For the categorical independent variables we consider by default the last option as reference category: the generation of 35 years and more, religious, female, from Bucharest.

All the regression coefficients are statistically significant (the significance level of Wald's  $\chi^2$  is smaller than 0,05 for all coefficients).

The negative, statistically significant, value of the regression coefficient for the independent variable **Residence** indicates that the odds for a person living in the province to start having sexual relationships shortly after having met their partner are 18,9% smaller than for someone living in Bucharest.

In the case of **Religion**, the odds of a non-practitioner are 1,404 times bigger than in the case of a practitioner to start their sexual relationships in less than six months after meeting the partner.

The independent variable **Age\_Begin\_Couple** (the age at the beginning of the relationship) has a direct influence on the dependent variable. Thus, a one year increase in the age at which the partners met, causes the odds of them starting to have sexual relationships shortly after they met to increase 1,087 times.

The odds of a **male** starting their sexual relationships in less than six months after they met their partner are 1,431 times higher than for **females**.

The independent variable **No. relation** (the number of stable relationships) also has a direct influence on the dependent variable. Thus, a one unit increase in the number of relations results in a 1,496 times (almost 50%) increase in the odd of starting sexual relationships shortly after having met.

For the independent categorical variable **Generation** the reference category is the group of 35 years and more. The odds of a very young person to initiate sexual relationships shortly after meeting the partner is almost three times higher, and the odds of those in young group is 2,18 times higher.

## Conclusion

In European context, Romania's population is one of the most traditionalist regarding marriage. However, young couples tend to follow the western model, focusing on their career. This situation is also due to the increasing desire of youth to complete higher education. The young persons don't reject the idea of making their relationship official, but they need certainties at all levels and especially emotional stability.

The survey conducted in April 2010 by a group of researchers from the Polls and Surveys Centre of the Bucharest Academy of Economic Studies, highlighted some features of the respondents divided into three age groups (18–24 years, 25–34 years and 35–49 years). The most important targeted the attitude towards marriage and the right age for getting married, the hierarchy of the pro-marriage reasons, opinions regarding consensual union and the number of stable relationships that the respondent had until the interview.

The results of the data base analysis confirmed the existence of the traditional model of valuing marriage for all three age groups. However, certain «modernity» accents may be noticed, especially for the young age respondents (18–24 years and 25–34 years), manifested through the opening towards consensual union, which is understood rather like a way of cohabitation preceding marriage.

The modelling of the behaviour regarding the starting of sexual relationships in less than six months after having met their partner led to some interesting conclusions. Thus, the odds of starting their sexual life soon (less than six months) after having met their partner are higher for the respondents who: are from the capital (Bucharest); are males; are young persons from the first age group (18–24 years); are not practicing religion; have had more stable relationships before or are of mature age when they meet their current partner.

These results confirm the preservation of a traditional system of attitude, norms and values, regardless of the generations and the regional context.

## References

- Bozon M.* Le mariage en moins // Société française. 1988. № 26. Janv–Mars.
- Hărăguș M.* Modele de constituire a familiei // Muresan C. (coord.) Ancheta pi-lot Generații și gen la Cluj. Diferențe de gen și intergeneraționale în comportamentul reproductiv și de parteneriat familial. Cluj: Presa Universitară Clujeană, 2005.
- Hoem J.M., Giuseppe G., Jasilioniene A. et al.* Levels of Recent Union Formation: Six European Countries Compared // Demographic Research. 2010. Vol. 22. Article 9.
- Hoem J.M., Kostova D., Jasilioniene A. et al.* Traces of the Second Demographic Transition in Four Selected Countries in Central and Eastern Europe: Union formation as a Demographic Manifestation: MPIDR WORKING PAPER, Max Planck Institut, Demographic Research, 2008. (<http://www.demogr.mpg.de/papers/working/wp-2007-026.pdf>)
- Hoem J.M., Kostova D., Mureșan C. et al.* The Structure of Recent First-union Formation in Romania // Romanian Journal of Population Studies. 2009. № 1.
- Mureșan C.* Family Dynamics in Pre- and Post-transition Romania: A Life-table Description: MPIDR WP-2007-018. Rostock, 2007. (<http://www.demogr.mpg.de/papers/working/wp-2007-018.pdf>)
- Mureșan C.* How advanced Romania is in the Second Demographic Transition? // Romanian Journal of Population Studies. Cluj. 2007.
- Popescu R.* Introducere în Sociologia familiei. Familia românească în societatea contemporană. Bucharest: Editura Polirom, 2009.
- Rughiniș C.* Valori europene în relațiile intime. Studiu comparativ // Sociologie românească. 2002. № 1–2.

V. Agadjanian  
Arizona State University, USA,  
P. Dommaraju  
Nanyang Technological  
University, Singapore,  
L. Nedoluzhko  
Stockholm University, Sweden

# **DIVERGING ECONOMIC FORTUNES AND FERTILITY DYNAMICS IN CENTRAL ASIA: KAZAKHSTAN AND KYRGYZSTAN COMPARED**

---

The dissolution of the Soviet Union twenty years ago led to a dramatic decline in the economic output and living standards throughout the post-Soviet world, including Central Asia. The deep economic crisis of the early post-Soviet years was accompanied by a no less dramatic drop in fertility. After the early post-Soviet period, the economic and political situation in most former Soviet republics gradually stabilized and growth resumed. However, the economic recovery has differed in scale in different parts of Central Asia. Specifically, while Kazakhstan, richly endowed with oil, natural gas, and other mineral resources, has experienced vigorous economic growth and a commensurate rise in incomes, Kyrgyzstan, its neighbor to the south, has seen a much more modest rate of development, which has been further impaired by bouts of political instability.

The main objective of this study is to examine how these divergent economic fortunes may have impacted fertility dynamics in both countries in the end of the 1990s and the first half of the 2000s. For this comparative analysis we employ data from the Kazakhstan and Kyrgyzstan Multiple Indicators Cluster Surveys (KazMICS and KyrMICS), both conducted in 2006. We examine both cross-country and within-country differences in levels of post-crisis fertility. Specifically, we look into ethnic differences with the two countries. Both Kazakhstan and Kyrgyzstan are multiethnic nations, whose populations, in addition to the respective titular ethnic groups (Kazakhs and Kyrgyz), include sizeable minorities both of Asian stock (Uzbeks in Kyrgyzstan) and of European roots (Russians and other European-origin groups in both countries). This analysis builds upon our previous work on ethnic-specific fertility dynamics in the earlier post-Soviet period which detected considerable ethnic variations in fertility timing and in parity that can be traced to the ethnic groups' experiences of the demographic transitions as well as sociopolitical positioning in post-Soviet societies. In addition to ethnicity, we look at educational variations in fertility as individuals of different level of education may set and implement their fertility goals differently in

response to changing socioeconomic environment. However, because in Central Asian settings most childbearing occurs within marriage, we also include in our analysis an overview of trends in entry into first marital union.

This study builds upon the large demographic literature on decline in marriage and fertility following the dismantlement of the socialist socioeconomic and political system in Eastern Europe and Central Eurasia (e.g., [Agadjanian, Makarova, 2003; Agadjanian et al., 2008; Clifford et al., 2010; Dommaraju, Agadjanian, 2008; Frejka, 2008; Kohler, Kohler, 2002; Perelli-Harris, 2005; Sobotka, 2004]). In contrast to the relatively rich literature on the early post-socialist period characterized by a deep economic and sociopolitical crisis, little is known about fertility response to post-crisis economic recovery and sociopolitical stabilization, especially in the countries of the former Soviet Union. This study is an attempt to help fill this gap.

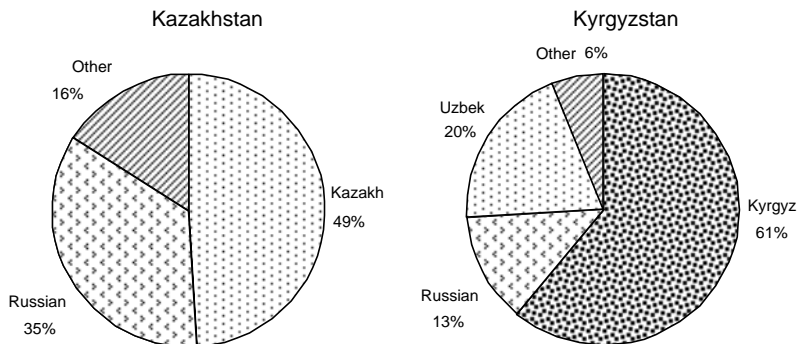
## Data and method

We use primarily data from the latest available Kazakhstan and Kyrgyzstan Multiple Indicators Cluster Surveys (KazMICS and KyrMICS), both conducted in 2006. We use mainly the women's files (women aged 18–49,  $N = 14,710$  in KazMICS and  $N = 6,973$  in KyrMICS). While the data collected by the two surveys are unique for the two countries, they have limitations that constrain our analysis. Three main limitations of the data must be acknowledged. First, neither MICS questionnaires differentiated between entry into formal marriage and non-formal union (The corresponding question reads: «What month and year did you marry or started living in union for the first time?»). Although non-formalized cohabitation has not been very common in Kazakhstan and Kyrgyzstan as in western settings, the differences in the risk of entry in each of the two forms of union may be non-trivial, especially across ethnic groups [Agadjanian, Dommaraju, 2011]. In the text below, we use the terms «marriage» and «marital union» for both formal marriages and informal unions.

Second, neither survey collected complete birth histories: only the years of the first and the last births are available. We therefore are unable to carry out a dynamic analysis of probabilities of birth over the entire reproductive span. Also, the calculation of the total fertility rates in the 12 months preceding the survey assumes that no woman had more than one live birth during that period.

The third limitation is that ethnicity («nationality» in local parlance) and native language is only available in the household questionnaire and only for the household head. We choose to use household head's language rather than ethnicity because language better reflects real (rather than nominal) ethnic identity. For example, the

Russian language is a more relevant and consequential ethnic identifier for individuals of European background than their ethnic self-identification (e.g., Russian, Ukrainian, Belorussian, German, etc.). We therefore use the household head's language as a proxy for ethnicity of the woman interviewed in that household. Figure 1 presents the breakdown of the two samples by household head's native language.



**Fig. 1.** Household head language in MICS samples

In addition to KazMICS and KyrMICS data we use estimates of total fertility rates (TFR)<sup>1</sup> generated by the statistical agencies of the two countries as well as ethnic and education-specific TFRs computed from the Demographic and Health Surveys (DHS) conducted in the 1990s: in 1995 and 1997 in Kazakhstan and in 1997 in Kyrgyzstan. We also use published estimates of economic growth of Kazakhstan and Kyrgyzstan in the post-Soviet period to illustrate the trends in economic performance of both of nations.

## Method

We start by comparing trends in annual economic growth rates in the two countries in the post-Soviet period from available statistical data. We then examine the trends in probabilities of transition to first marriage during the post-Soviet era and compare the two sets of trends. We then plot trends in estimated annual TFRs for the same period and relate them to trends in economic performance and in entry into marital union. We then compare ethnic and education-specific TFRs from DHS and MICS. Finally, we fit a Poisson regression model predicting the number of child-

<sup>1</sup> Total fertility rate is the average number of children a woman would have in her lifetime if she were to experience current age-specific fertility.

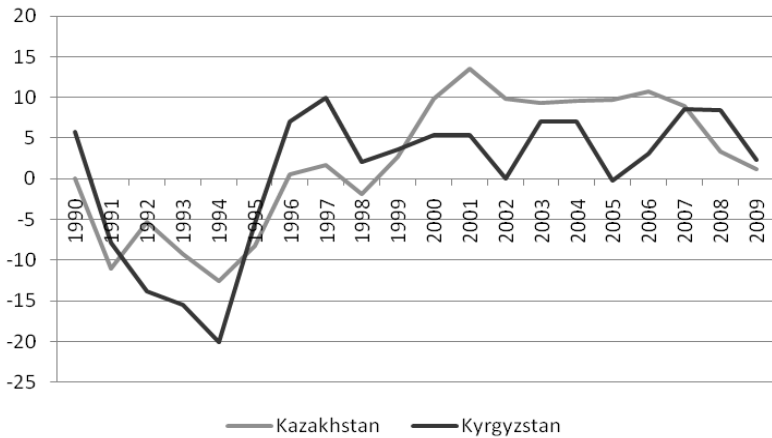


ren ever born from ethnicity (native language) and education using the KazMICS and KyrMICS data.

## Results

### *Economic trends in the post-soviet period.*

Figure 2 presents annual GDP growth rates in both countries. As can be seen, both countries experienced a dramatic shrinking of their economies in the early post-soviet years. The collapse of Kyrgyzstan's economy was particularly spectacular, but even in Kazakhstan the economy contracted by about 12% in 1994.

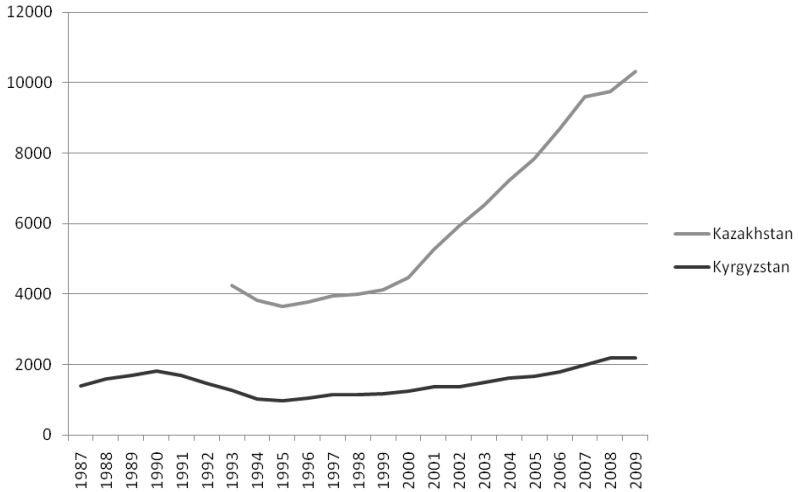


**Fig. 2.** Annual GDP growth rates (%), Kazakhstan and Kyrgyzstan since 1990

In the second half of the 1990s, both countries, and especially Kyrgyzstan, saw a no less impressive recovery of economic growth rates. After its economy stumbled during the 1998 financial crisis, Kazakhstan, boosted by oil and gas exports, posted vigorous growth rates of about 10% throughout most of the first decade of this century (the economic growth came to a virtual halt during the latest global financial and economic crisis, but the effects of this crisis cannot be captured by our data). In Kyrgyzstan, the rate of GDP growth in the past decade was generally more modest and inconsistent.

Figure 3 depicts trends in absolute GNP per capita in both countries. Kazakhstan, richly endowed with mineral resources, has always been wealthier than its smaller southern neighbor. Moreover, while both nations registered a steady growth in in-

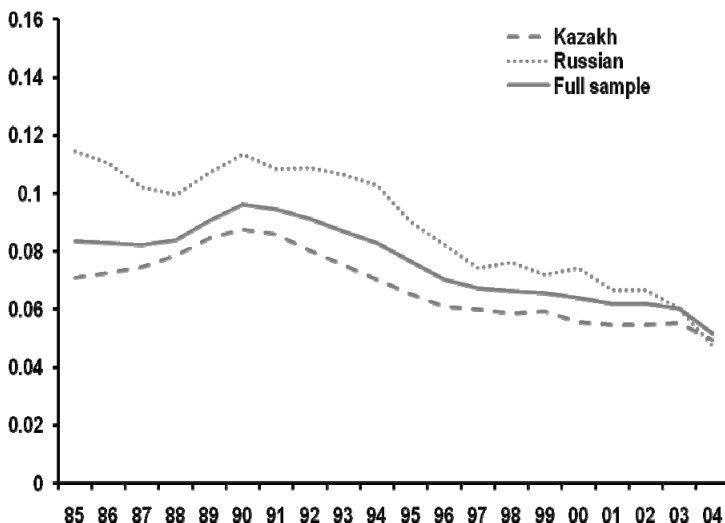
comes after the decline in most of the 1990s, the graph also clearly illustrates major differences between the two countries. Since the beginning of the past decade, income Kazakhstan's income per capita, boosted by oil and gas revenues, shot up to exceed 10000 in PPP dollars by the end of the decade, whereas Kyrgyzstan's GNI PPP barely reached one-fifth of that level.



**Fig. 3.** GNI PPP per capita (USD), Kazakhstan and Kyrgyzstan

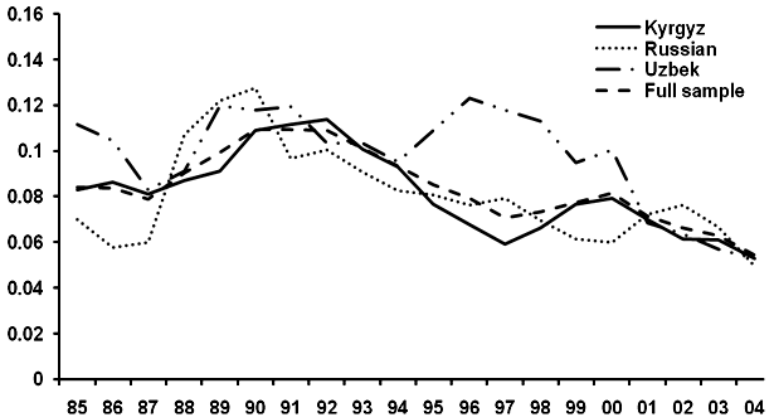
*Entry into marital union.*

Figure 4 presents overall and ethnic-specific trends in annual predicted probabilities of entry into first marital union in Kazakhstan. These probabilities are computed from KazMICS data on the basis of a discrete-time logistic model with the ethnicity  $\times$  year interaction term, with duration in years since 15<sup>th</sup> birthday (linear and quadratic) as a control. The graph shows an increase in the probability of marriage around the late 1980s-early 1990s and a steady decline throughout the post-Soviet period. Probabilities of entry into marriage are higher among Russian-speakers for all but the end of the observation period, echoing the patterns observed in earlier studies [Agadjanian, 1998; Dommaraju, Agadjanian, 2008], but the post-Soviet trends are very similar between two groups. Starting in the end of the 1990s, the decline in the probability of marriage tends to level off in both groups, and especially so among Kazakhs, resulting in a near conversion by the early years of the 2000s.



**Fig. 4.** Predicted probability of entry into first marriage in Kazakhstan

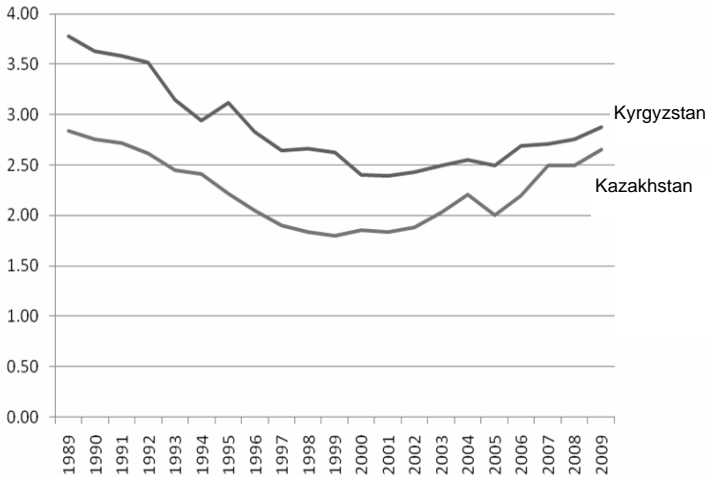
Figure 5 depicts the same trends in predicted probabilities of transition to marriage for Kyrgyzstan as a whole and for its main ethnic groups – Kyrgyz, Uzbek, and Russians. Because the size of the Uzbek and Russian subsamples is small, the estimates for these groups are quite unstable. The overall trends, however, seem quite similar to those in Kazakhstan at least through the end of the 20<sup>th</sup> century: an increase in probabilities in late 1980s-early 1990s and a steep decline during most of the 1990s. The turn of the century witnessed a minor reversal of the trend (more pronounced than Kazakhstan), but the slide resumed in the early 2000s. Not surprisingly, ethnic Kyrgyz followed the overall trend most closely, but even among Russian the trend was similar. Uzbeks displayed an anomalous increase in probability of entry into marriage in the mid-1990s but after that showed a precipitous and inexorable drop.



**Fig. 5.** Predicted probability of entry into first marriage in Kyrgyzstan

*Total fertility rates.*

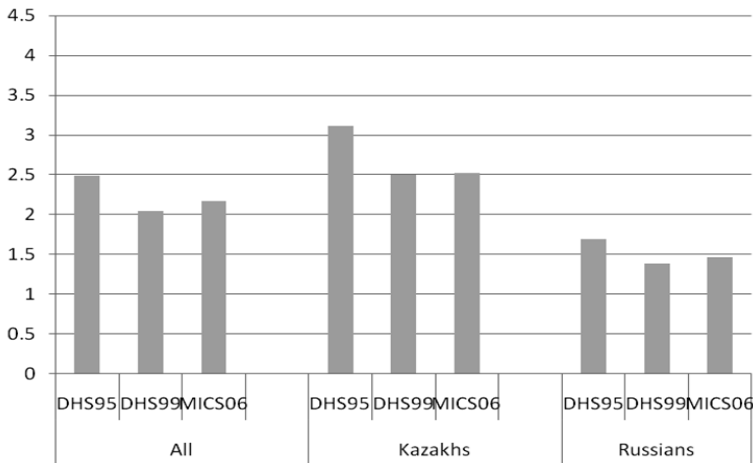
Figure 6 shows trends in total fertility rates (TFRs), in both countries compiled from available published estimates. The trends echo the changes in the two countries economic fortunes described above: TFRs declined rather steeply throughout the 1990s but then start to rise as the economic growth picks up.



**Fig. 6.** Trends in total fertility rates in Kazakhstan and Kyrgyzstan

It is to note that TFR is consistently lower in Kazakhstan than in Kyrgyzstan although the gap becomes narrower toward the end of the 2000s as Kazakhstan's fertility recovers somewhat more strongly than Kyrgyzstan's. In fact, while Kyrgyzstan's TFR remained almost one child lower in the end of the 2000s than in the late 1980s, Kazakhstan's estimated TFR for 2009 is just .2 lower than the 1989 estimate.

Figures 7a and 7b compares TFRs computed from three surveys in Kazakhstan – the 1995 Demographic and Health Survey, the 1999 Demographic and Health Survey, and the 2006 KazMICS – and two surveys in Kyrgyzstan – the 1997 Demographic and Health Survey and the 2006 KyrMICS. These survey estimates for the entire population of Kazakhstan are generally higher than the estimates from statistical agencies on which Figure 5 is based; for Kyrgyzstan, the survey estimate is higher for 1997 but is lower for the MICS year than, compared to the corresponding statistical agency estimates. The overall trends, however, are similar in the survey and in the published data.

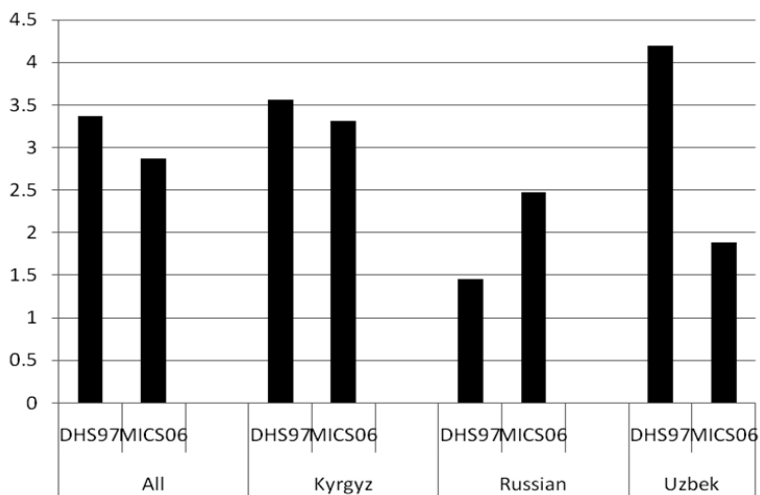


**Fig. 7a.** Kazakhstan's ethnic TFRs estimated from DHS and MICS

Figure 7a, which shows ethnic-specific TFRs computed from DHS and MICS, illustrates stark ethnic differences in fertility. The differences in fertility between Kazakhs and Russians predate the post-Soviet crisis and are fairly well-researched (see e.g., [Agadjanian et al., 2008]). A more interesting observation that can be made from Fig. 6, is that fertility in each of the two ethnic groups declined sharply between the two DHS but stabilized and even slightly rebounded by the middle of the 2000s. In

fact, a rebound was somewhat more palpable among Russians (from 1,38 to 1,46 children per woman) than among Kazakhs (2,50 vs. 2,52).

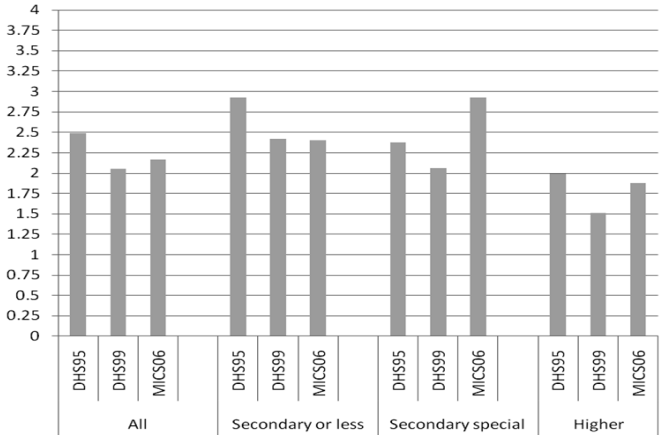
In Kyrgyzstan (Fig. 7b), both the overall and ethnic specific trends appear somewhat different from those in Kazakhstan. It should be noted that in the second half the 1990s both Kyrgyz and especially Kyrgyzstan’s Uzbeks had much higher fertility than Kazakhs, whereas fertility levels of Kazakhstan’s and Kyrgyzstan’s Russians were comparable. The overall TFR declined noticeably in Kyrgyzstan between 1997 and 2006, but this decline was concentrated among the titular ethnic group and especially among Uzbeks, whose fertility plunged from 4,19, by far the highest in the country in 1997, to 1,89, the lowest of all major ethnic groups in the mid-2000s. In contrast to the two Asian groups, the TFR of Russians shot up from 1,46 in 1997 to 2,47 in 2006. While the trend parallels in principle that among Kazakhstan’s Russians observed in Figure 6a, the magnitude of this jump is suspect and may have been influenced by the small sample size (the dramatic drop in Uzbek fertility invites a similar suspicion for the same reason).



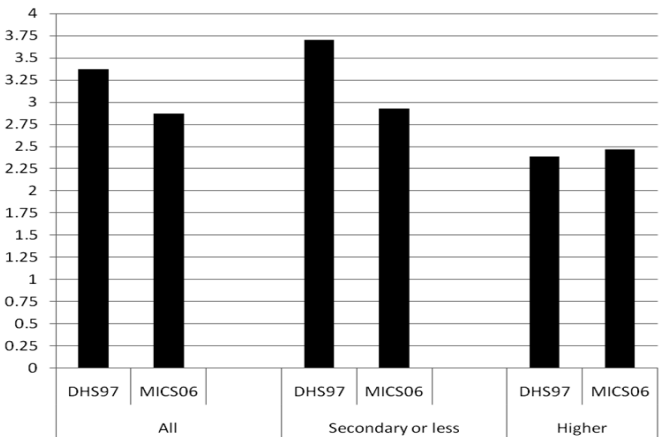
**Fig. 7b.** Kyrgyzstan’s ethnic TFRs estimated from DHS and MICS

Figures 8a and 8b display TFRs for educational categories in Kazakhstan and Kyrgyzstan, respectively, computed from the DHS and MICS. Note that KyrMISC distinguishes only two groups – secondary or less and higher, and the comparable estimates are presented only for these two educational categories. In Kazakhstan, a rebound in fertility is clearly present among women with secondary special and higher

education; among the former group, the KazMICS TFR noticeably exceed that among the least educated women in that survey. In fact, no rebound of fertility can be observed among women with secondary or less education, even though a stabilization of fertility in that group in the first half of the 2000s is obvious. In contrast, no such stabilization among the less education women is apparent in Kyrgyzstan. Fertility seemed to increase between 1997 and 2006 among university-educated women but the magnitude of that increase is nowhere near the increased observed among Kazakhstan's women with higher education.



**Fig. 8a.** Kazakhstan's TFRs by education, DHS and MICS estimates



**Fig. 8b.** Kyrgyzstan's TFR by education, from DHS and MICS estimates

*Children ever born.*

The MICS data allows for a multivariate analysis of children ever born. Whereas this analysis does not allow for assessing temporal trends, it offers a more robust test of ethnic and educational differences in lifetime fertility as it adjust for other factors that may influence fertility such area of residence and household wealth. The results of the Poisson regression predicting the number of children ever born for KazMICS and KyrMICS are presented in Tables 1a and 1b, respectively. These results point to considerable ethnic differences between the titular and non-titular groups in each country. Whereas lower fertility of ethnic Russians compared to fertility of the titular groups is of no surprise, it is noteworthy that the Russian-titular ethnicity gap is wider in Kyrgyzstan than in Kazakhstan. It is perhaps most interesting that in Kyrgyzstan Uzbeks' fertility also appears to be lower than that of Kyrgyz even after controlling for education, area of residence, and economic conditions (the difference between Uzbeks and Kyrgyz is only marginally significant). The Kyrgyz-Uzbek differences echo the earlier observed trends in TFRs, but because but it requires further investigations that may not be possible with the KyrMICS data.

**Table 1a.** Children Ever Born, Poisson Regression with an Offset for Duration since Marriage, KazMICS

Parameter	Estimate	SE	Wald 95% CI		Wald Chi-Sq	Pr > Chi-Sq
Intercept	-2,0098	0,028	-2,0646	-1,955	5167,76	<0,0001
Russian (Kazakh as reference)	-0,3445	0,017	-0,3778	-0,3113	412,9	<0,0001
Primary or Secondary (Higher as ref)	0,0564	0,0203	0,0167	0,0961	7,77	0,0053
Secondary specialized	-0,0445	0,0207	-0,085	-0,0039	4,62	0,0316
Wealth index – 1 – poorest – (Richest as ref)	0,3946	0,0297	0,3363	0,4529	176,1	<0,0001
Wealth index – 2	0,2607	0,028	0,2058	0,3155	86,85	<0,0001
Wealth index – 3	0,1729	0,0258	0,1224	0,2234	44,97	<0,0001
Wealth index – 4	0,0525	0,0245	0,0045	0,1004	4,6	0,032
Urban	-0,0412	0,0193	-0,0789	-0,0035	4,58	0,0323



**Table 1b.**

Children ever born, Poisson regression with an offset for duration since marriage, KyrMICS

Parameter	Estimate	SE	Wald 95% CI		Wald Chi-Sq	Pr > Chi-Sq
Intercept	-1,6838	0,0362	-1,7547	-1,6128	2163,42	<0,0001
Russian (Kyrgyz as ref)	-0,5393	0,033	-0,6041	-0,4746	266,4	<0,0001
Uzbek	-0,04	0,0232	-0,0854	0,0054	2,98	0,0846
Secondary or below (Higher as ref)	0,0629	0,0256	0,0127	0,1131	6,03	0,014
Wealth index – 1 – poorest – (Richest as ref)	0,1208	0,0385	0,0453	0,1963	9,84	0,0017
Wealth index – 2	0,1082	0,037	0,0357	0,1807	8,56	0,0034
Wealth index – 3	0,0934	0,0363	0,0222	0,1645	6,62	0,0101
Wealth index – 4	0,0266	0,033	-0,038	0,0911	0,65	0,4204
Urban	-0,1172	0,0248	-0,1658	-0,0687	22,39	<0,0001

As one would expect, in both countries women with university education have significantly fewer children than women who only have secondary education or less. Interestingly, in Kazakhstan, women with secondary special education have lower lifetime fertility than women with a university degree (secondary special is not available as a separate educational category from the KyrMICS). When we test for interactions between ethnicity and education, no interaction effects are statistically significant (not shown).

## Conclusion

The two Central Asian countries compared in this study have shown both similarities and differences in their post-Soviet economic and demographic development. In both countries, the breakdown of the USSR led to a sharp economic decline, but the decline seemed to have been more dramatic in Kyrgyzstan than in Kazakhstan. The post-crisis economic recovery started in the middle of the 1990s and appears to have proceeded more vigorously and consistently in Kazakhstan. Without major mineral resources, Kyrgyzstan was poorer than its richly endowed northern neighbor even in the Soviet times, but the income gap between the two countries began to widen rapidly

since the end of the 1990s. Although we do not have reliable data on income distribution, there is no reason to believe that the two countries differed much on this measure. Importantly, the growing income gap between the two countries parallel their political development: while Kazakhstan enjoyed socio-political stability, Kyrgyzstan went through periods of major political disruptions such as the 2005 Tulip Revolution.

Using available aggregate and survey data we set out to examine whether these different trajectories have impacted trends in family formation in each of these countries as a whole and in ethnic and educational subgroups. We found no indication that the post-crisis economic recovery or inter-country differences in the rate of this recovery have affected entry into marriage: in both countries and in all ethnic groups (with a suspicious exception of Uzbeks) yearly probabilities of entry into marital union declined almost monotonously after a rise around the time of the Soviet collapse.

In contrast, total fertility rates in both countries registered an increase starting at about the same time as the economies began to grow. The rise of fertility appeared stronger in Kazakhstan, where the economy recovery was more vigorous. However, it is important to note that even before the collapse of the Soviet Union fertility in Kazakhstan was much lower than in Kyrgyzstan (largely, but not entirely, due to a bigger share of Russians and other Europeans in Kazakhstan's population), and the differences persisted into the post-Soviet period as Kazakhstan's fertility plunged below the replacement level for much of the 1990s, while Kyrgyzstan's TFR, despite a sharp drop in the first half of the 1990s, stayed well above it. In any case, in the end of the 2000s, the two countries' TFRs were as close to each other as they had ever been in the past two decades.

The comparison of ethnic- and education-specific TFRs computed from survey data revealed instructive differences across and within the two countries. In Kazakhstan, the titular ethnicity's fertility remained largely stable in the first half of the 2000s while Russians' fertility rose somewhat, even if still remaining below 1,5 children per woman. In Kyrgyzstan (for which we had only two points of estimates, compared to Kazakhstan's three) we did not observe any sign of fertility stabilization among the titular group. Even so, ethnic Kyrgyz' TFR remained much higher than that of ethnic Kazakhs'. The dramatic drop in TFRs among Uzbeks and a significant rise among Russians are intriguing but may be artifacts of the relatively small size of each of the two ethnic groups in the KyrMICS sample. Finally, the breakdown by education suggests that the post-crisis fertility rise was concentrated among better educated women; however, it is also among those women that fertility was lowest before the rise.

In summary, we found some evidence that fertility has responded to the economic recovery in a predictable way in both countries. While the response seems to have been stronger in more prosperous Kazakhstan, it has been concentrated among the subgroups with already below-replacement fertility.

## References

*Agadjanian V.* Post-Soviet Demographic Paradoxes: Ethnic Differences in Marriage and Fertility in Kazakhstan // *Sociological Forum*. 1999. 14 (3). P. 425–446.

*Agadjanian V., Dommaraju P., Glick J.E.* Reproduction in Upheaval: Crisis, Ethnicity, and Fertility in Kazakhstan // *Population Studies*. 2008. 62 (2). P. 211–233.

*Agadjanian V., Makarova E.* From Soviet Modernization to Post-Soviet Transformation: Understanding Marriage and Fertility Dynamics in Uzbekistan // *Development and Change*. 2003. 34(3). P. 447–473.

*Clifford D., Falkingham J., Hinde A.* Through Civil War, Food Crisis and Drought: Trends in Fertility and Nuptiality in Post-Soviet Tajikistan // *European Journal of Population*, 2010. 26. P. 325–350.

*Dommaraju P., Agadjanian V.* Nuptiality in Soviet and Post-Soviet Central Asia // *Asian Population Studies*. 2008. 4 (2). P. 195–213.

*Frejka T.* Determinants of Family Formation and Childbearing During the Societal Transition in Central and Eastern Europe // *Demographic Research*. 2008. 19. P. 139–170.

*Kohler H.P., Kohler I.* Fertility Decline in Russia in the Early and Mid 1990s: the Role of Economic Uncertainty and Labour Market Crises // *European Journal of Population*. 2002. 18. P. 233–262.

*Perelli-Harris B.* The Path to Lowest-low Fertility in Ukraine // *Population Studies*. 2005. 59(1). P. 55–70.

*Sobotka T.* Postponement of Childbearing and Low Fertility in Europe. Amsterdam: Dutch University Press, 2004.

В. Агаджанян  
Университет штата Аризона, США,  
Н. Зотова  
Институт этнологии и антропологии  
РАН

# СОЦИАЛЬНАЯ УЯЗВИМОСТЬ И СЕКСУАЛЬНЫЕ РИСКИ ЖЕНЩИН- МИГРАНТОВ ИЗ СРЕДНЕЙ АЗИИ В МОСКВЕ<sup>1</sup>

---

## Введение

В статье мы представляем результаты исследования сексуального поведения и рисков ИППП/ВИЧ женщин-мигрантов из стран Средней Азии, которое проводилось в Москве осенью 2010 г. Подавляющее большинство мигрантов из Средней Азии направляются в Россию; здесь крупнейшим центром притяжения мигрантов выступает Центральный федеральный округ и, в первую очередь, Москва и московский регион. Согласно данным Федеральной миграционной службы России о распределении рабочей силы из Центральной Азии по федеральным округам России в первом полугодии 2007 г., 38,2% выходцев из Киргизстана работали в Центральном федеральном округе (в том числе в Москве и Московской области – 35,3%), для выходцев из Узбекистана эти цифры составляют 34,8 и 23,4% соответственно [Трудовая миграция в Республике Узбекистан, с. 34]. Нужно отметить, что официальные цифры отражают численность мигрантов, получивших разрешение на работу; с учетом недокументированных мигрантов (т.е. работавших нелегально) мы можем говорить о более высоких показателях. Так, по оценкам С. Олимовой<sup>2</sup>, наиболее привлекательной территорией для таджикских мигрантов в России является московская агломерация (49% всех мигрантов из Таджикистана, работающих в России) [Региональное измерение трансграничной миграции в Россию, с. 83].

---

<sup>1</sup> Проект выполнен при поддержке гранта Школы социальной и семейной динамики Университета Штата Аризона, США (School of Social and Family Dynamics, Arizona State University, USA).

<sup>2</sup> Оценка основана на данных опросов фонда «Шарк» в Таджикистане.

Распад Советского Союза повлек за собой большие социальные, экономические и другие потрясения. Это дало старт процессам, ранее не фиксировавшимся в регионе, в частности, широкомасштабной внешней миграции. Лавинообразный рост числа мигрантов привел к значимым структурным сдвигам в организации общества. Так, огромная волна мужской трудовой миграции повлекла за собой выезд женщин на заработки в чужую страну; женщины стали заметной частью миграционного потока. Женская миграция представляет собой новое явление для среднеазиатского общества, но в целом она укладывается в основные закономерности развития миграционных процессов в мире на рубеже XX–XXI вв. Специалисты отмечают, что феминизация миграционных потоков с 1990-х годов становится характерной чертой новейшего этапа развития международной трудовой миграции [Castles, Miller, 1998]. Согласно различным оценкам, женщины составляют до 40–50% общего числа мигрантов в мире [ИОМ, 2008, р. 10–11].

Большинство мигрантов, как мужчины, так и женщины, являются в той или иной степени недокументированными (например, у них может отсутствовать регистрация по месту жительства и/или разрешение на работу); вследствие этого подвергаются эксплуатации, испытывают давление и угрозы со стороны работодателей и сотрудников правоохранительных органов. При этом в сравнении с мужчинами-мигрантами женщины более уязвимы в силу гендерного неравенства, которое усиливает проблемы, связанные с их правовым статусом. Такие гендерные диспропорции могут вести к более рискованному сексуальному поведению и риску ИППП (инфекций, передающихся половым путем). Учитывая быстрый рост числа ВИЧ-инфицированных в Российской Федерации, женщины-мигранты могут быть в большей степени подвержены риску ВИЧ-инфекции. Значительный объем литературы, посвященной сексуальному поведению и рискам ИППП и ВИЧ среди мигрантов в разных странах мира, демонстрирует, что мигранты, как правило, чаще вступают в рискованные сексуальные связи и характеризуются более высоким уровнем ИППП/ВИЧ, чем немигранты [Decosas et al., 1995; He et al., 2005; Sevoyan, Agadjanian, 2010; Yang, 2004]. Более того, некоторые исследования показывают, что уровень ИППП у женщин-мигрантов выше, чем у мужчин-мигрантов [Liu et al., 2005; Wang et al., 2010]. Исследований по ИППП среди женщин-мигрантов в России и на территории бывшего Советского Союза в целом, по нашим данным, не существует. Хотя эта проблематика в регионе еще практически не исследована, она представляется исключительно актуальной, учитывая массовый характер миграций на постсоветском пространстве, большую распространенность ИППП и быстро

растущий уровень заражения ВИЧ. Наше исследование является первой попыткой заполнить этот пробел.

## Данные

В качестве первого шага в изучении этой проблематики мы провели исследование 224 женщин в возрасте от 18 до 40 лет, которые были равномерно распределены между тремя этническими группами, – это киргизки, узбечки и таджички. Мы выбрали три сектора городской экономики, в которых концентрация женщин-мигрантов достаточно велика – рынки (продавщицы), предприятия общественного питания (в основном, официантки и уборщицы) и небольшие продуктовые магазины (продавщицы, кассиры, мерчендайзеры и уборщицы). Киргизки, узбечки и таджички были выбраны в силу того, что они составляют значительную долю мигрантов в Москве. В то время как три этнические группы имеют много общих черт, особенно в сравнении с местным населением, у них есть этнокультурные различия, которые мы также постарались уловить, используя инструментарий исследования. Так, киргизки и узбечки тюркоязычны; таджикский относится к группе иранских языков. Узбечки и таджички представляют оседлое население Средней Азии, где роль и место женщины в семье жестко регламентированы традицией. Киргизы исторически являются кочевниками, процессы массового оседания на землю начались сравнительно недавно по историческим меркам – с конца XIX в. Изучаемые этнические группы принадлежат к мусульманскому населению, при этом степень влияния ислама на повседневную жизнь таджичек и узбечек сильнее, нежели киргизок. Другая культурная традиция определяет и иное положение женщин в семье и обществе – киргизки пользуются большей свободой в обществе. Наконец, таджикский миграционный поток в Россию в целом и в Москву в частности является самым «старым», узбечки и киргизки стали приезжать на заработки сравнительно недавно.

Поиск респонденток осуществлялся при помощи вероятностной выборки на рабочих местах. Была осуществлена случайная выборка рынков, а затем рынки были закреплены за той или иной этнической группой. На рынках использовался пошаговый алгоритм поиска. Для работы в точках общественного питания (кафе и рестораны) и магазинах были случайно отобраны станции метрополитена, вокруг которых в круге радиусом 500 метров (300 метров для центральных станций) был проведен натурный обход, нанесены на карту и переписаны все кафе, рестораны и магазины. Таким образом, было получено два отдельных списка – точек общественного питания и магазинов. Точки в списках были отсортированы в случайном порядке; интервьюеры посещали точки в том порядке, в

каком они были перечислены в списке, чтобы провести анкетирование необходимого числа женщин. Помимо анкетирования 224 женщин мы провели глубинные интервью с 21 из них (по 7 из каждой этнической группы), чтобы уточнить и дополнить результаты анкеты.

## Результаты

В табл. 1 представлены основные результаты. Следует отметить, что отказов отвечать на чувствительные вопросы зафиксировано не было. Хотя мы и допускаем, что женщины могли где-то недоговаривать, но у нас нет оснований полагать, что склонность утаивать информацию специфична для той или иной этнической группы.

Первый показатель в таблице относится к количеству сексуальных партнеров за всю жизнь. Здесь выделяются таджички: их средний возраст самый высокий, но среднее число сексуальных партнеров равно 0,9 в сравнении с 1,5 и 1,4 для киргизок и узбечек соответственно. Это различие еще более заметно среди таджичек, занятых на рынках в сравнении с узбечками и таджичками в той же сфере. В целом, все женщины-мигранты, работающие на рынках, имеют большее число сексуальных партнеров сравнительно с двумя другими сферами занятости. Среднее количество сексуальных партнеров опрошенных женщин за последний год составило 0,8 человек; этот показатель выше среди узбечек (0,9), особенно работающих на рынках (1,3 человека), что коррелирует со значительной долей разведенных женщин, которая отмечена среди узбечек, работающих на рынках (см. табл. 1). Отметим, что по этому показателю таджички не выделяются.

Около одной пятой всех респонденток, 19%, имеют постоянного партнера или живут в гражданском браке. Эта доля самая низкая среди киргизок (8%); и самая высокая среди таджичек (25,6%). Среди узбечек, работающих на рынках, эта доля самая высокая во всей выборке (39%), что также отражает большой процент разведенных женщин в данном сегменте. Таджички были наиболее склонны подозревать своих партнеров в неверности: 32% женщин знает или подозревает, что партнер был им неверен за последние 12 месяцев. Для узбечек и киргизок это число составляет 15 и 5% соответственно.

Для того чтобы убедиться, что указанные этнические различия не отражают склонности вступать в постоянные отношения с женатыми мужчинами (феномен «вторых жен» или «московских жен»), здесь мы исключили женщин, которые знают о том, что у их партнеров есть другая женщина или жена ( $n = 20$ ). При

этом разница между таджичками и киргизками становится еще более заметной. Доля узбечек, имеющих постоянного партнера, оказалось значительно ниже, чем в общей выборке, однако в целом заметно выше, чем среди киргизок.

**Таблица 1.** Сексуальное поведение и риски

Характеристики	Киргизки	Таджички	Узбечки	Всего
Количество сексуальных партнеров за всю жизнь, человек	1,5	0,9	1,4	1,3
рынки	2,0	1,1	2,3	1,8
кафе	0,8	0,8	1,0	0,9
магазины	1,6	0,8	1,0	1,1
Количество сексуальных партнеров за последние 12 месяцев, человек	0,7	0,7	0,9	0,8
рынки	0,7	0,9	1,3	1,0
кафе	0,4	0,5	0,8	0,6
магазины	1,0	0,6	0,7	0,8
Не замужем, имеют постоянного партнера, %	8,0	25,6	22,5	18,8
рынки	4,4	29,6	39,1	24,7
кафе	4,0	16,0	20,0	13,3
магазины	14,8	30,8	8,7	18,4
Незамужние, имеют постоянного неженатого партнера ( $n = 206$ ), %	5,5	22,1	14,3	13,7
Знают или подозревают, что постоянный партнер имел сексуальные контакты с другой женщиной в последний год, <i>среди ведущих половую жизнь и имеющих постоянного партнера</i> ( $n = 143$ ), %	5,1	31,7	15,1	18,1
Употребляли алкоголь по меньшей мере один раз за последний месяц, %	34,7	25,6	38,0	32,6
рынки	43,5	26,0	52,2	39,7
кафе	20,0	20,0	32,0	24,0
магазины	40,7	30,8	30,4	34,2
Использовали презервативы во время вагинального секса с постоянным партнером за последний месяц, <i>среди имевших сексуальный контакт в последний месяц</i> ( $n = 131$ ), %				



Характеристики	Киргизки	Таджички	Узбечки	Всего
всегда	16,2	2,1	17,0	11,5
иногда	13,5	29,8	10,6	18,3
никогда	70,4	68,1	72,3	70,2
Использовали презерватив исключительно или частично для предотвращения ИППП, среди использовавших презерватив с постоянным партнером, %	18,2	93,3	53,8	59,0
Имели в последний год как минимум один симптом, который может свидетельствовать о наличии ИППП среди ведущих половую жизнь (n = 184), %	31,2	44,1	20,3	31,5
Обеспокоены возможностью заражения ИППП, %	37,3	57,7	46,5	47,3
рынки	39,1	52,9	47,8	46,6
кафе	20,0	68,0	44,0	44,0
магазины	51,9	53,9	47,8	51,3
Обеспокоены возможностью заражения ВИЧ, %	36,0	57,7	45,1	46,4
рынки	39,1	55,6	43,5	46,6
кафе	20,0	68,0	48,0	45,3
магазины	48,2	50,0	43,5	47,4
Сдавали анализ на ВИЧ, %	73,3	69,2	70,4	70,8
рынки	73,9	51,9	56,5	60,3
кафе	68,0	76,0	72,0	72,0
магазины	77,8	80,8	82,6	80,3

Употребление алкоголя традиционно связывают со склонностью к более рискованному сексуальному поведению. Можно было бы предположить, что употребление алкогольных напитков среди женщин-мусульманок мало. Однако треть респонденток пила алкогольные напитки в последние 4 недели, предшествующие исследованию (при этом только 6% отметили, что пили крепкие напитки, такие как водка, коньяк или самогон). Узбечки, особенно группа занятых на рынках, были более склонны употреблять алкоголь; доля употреблявших алкоголь среди таджичек оказалась значительно ниже, чем среди двух других этнических групп. Интересно отметить, что доля употреблявших алкоголь среди

всех респонденток, занятых в сфере общественного питания, оказалась самой низкой, хотя в этой сфере доступ к алкогольным напиткам кажется наиболее легким.

В табл. 1 также показано распределение по использованию презервативов в вагинальных сексуальных контактах с постоянными партнерами за 4 недели, предшествовавшие исследованию. Поскольку здесь мы учитывали только женщин, у которых есть постоянный сексуальный партнер в настоящее время ( $n = 131$ ), распределение по секторам занятости не представлено. Уровень постоянного использования презервативов очень низок (12%), при этом 70% респонденток никогда не используют презерватив со своими постоянными партнерами. Доля тех, кто не пользуется презервативом, не дает значимых вариаций по этническим группам. Однако среди тех, кто регулярно пользуется презервативом, доля таджичек наиболее низкая. Полученный результат особенно значим, если принять во внимание долю таджичек, которые имеют постоянного партнера, не состоя в браке. Также можно отметить, что в сравнении с узбечками и особенно киргизками таджички более склонны использовать презерватив только или частично с целью предохранения от инфекций, передающихся половым путем (ИППП). Полученные цифры интересны, однако их следует трактовать с особой осторожностью, учитывая небольшое число женщин с постоянными партнерами.

В анкете присутствовал вопрос о том, было ли у респондентки когда-либо диагностировано ИППП (были перечислены 8 наиболее распространенных заболеваний). Очень маленькая доля женщин (2%) ответили, что такой диагноз был когда-либо поставлен. Такой низкий процент может быть отнесен частично к тому факту, что респондентки могли здесь скрывать информацию, а также к затрудненному доступу женщин-мигранток из Средней Азии к медицинским услугам. Однако около трети респонденток (32%), ведущих половую жизнь ( $n = 184$ ), отметили у себя наличие хотя бы одного симптома, который может свидетельствовать о наличии ИППП, в последние 12 месяцев, предшествовавших исследованию. Перечень симптомов, использованный в анкете, был разработан на основе методологии Всемирной организации здравоохранения для оценки распространения ИППП. Если оценивать данный показатель по трем изучавшимся этническим группам, он оказался самым высоким среди таджичек (44%). Среди киргизок и узбечек цифры составили 31,2 и 20,3% соответственно, т.е. доля узбечек оказалась в два раза ниже в сравнении с таджичками.

Несмотря на ограниченность знаний мигранток об ИППП, респондентки проявляют значительную обеспокоенность возможностью заражения венериче-

скими заболеваниями. В целом, почти половина респондентов, 47%, обеспокоены риском ИППП. Таджикские женщины высказывают более высокую степень озабоченности (58%), независимо от сектора занятости. Киргизки в целом проявляют меньшую степень обеспокоенности, но и в этой группе доля обеспокоенных составила 37%. Показатели обеспокоенности риском заражения ВИЧ распределены по этническим группам и секторам занятости сходным образом; это указывает на то, что риски ВИЧ/СПИДа волнуют женщин-мигрантов наряду с ИППП.

В табл. 1 также показана доля женщин, когда-либо сдававших тест на ВИЧ. Эта доля высока в целом по всей выборке; она самая высокая среди женщин, работающих в магазинах (80%), и самая низкая среди занятых на рынках. Тем не менее в этом секторе занятости она находится на высоком уровне (60%).

## **Заключение**

Число и доля женщин-мигрантов из Средней Азии в миграционном потоке растет как в целом в России, так и в Москве в частности. Женщинам-мигрантам свойственны многие общие характеристики, но в то же время внутри этой группы существуют значимые различия. Этнокультурные характеристики, обстоятельства жизни в иной культурной среде и опыт работы на российском рынке труда оказывают влияние как на социальную уязвимость, так и на сексуальные риски женщин.

Как мы уже отмечали, в силу небольшого размера выборки полученные результаты следует трактовать с осторожностью. Отсутствие контрольной группы (например, женщин-немигрантов, женщин-мигрантов из других стран) на этой стадии исследования также ограничивает наши выводы. Несмотря на эти ограничения, наши результаты вносят важный вклад в понимание уязвимости женщин-мигрантов в российской городской среде.

Так, мы выявили различия среди трех изучавшихся этнических групп в количестве сексуальных партнеров за весь период половой жизни женщин. Таджички, которых можно считать наиболее приверженной традиционным нормам поведения группой, имели в среднем самое малое число сексуальных партнеров. При этом по параметру количества сексуальных партнеров за последние 12 месяцев, предшествовавших исследованию, эта разница нивелируется.

Таджички и узбечки более склонны завязывать постоянные отношения без вступления в брак, нежели киргизки. На первый взгляд, это противоречит представлению о том, что киргизки в меньшей степени следуют традиционным

нормам и должны были бы с большей легкостью преодолевать традиционную установку на необходимость официального оформления постоянных отношений. Мы полагаем, что ббльшая распространенность неформальных постоянных отношений без заключения брака среди более «традиционных» таджичек и узбечек отражает скорее их склонность к выстраиванию стабильных отношений.

Уровень обеспокоенности рисками заражения ИППП/ВИЧ высок во всей выборке, особенно среди таджикских женщин. В то же время уровень регулярно-го использования презервативов низок, и особенно низок именно среди таджичек. При этом среди тех, кто регулярно использует презерватив, по сравнению с двумя другими этническими группами, таджички наиболее склонны использовать презерватив с постоянными партнерами для предохранения от ИППП. Наконец, среди таджичек отмечен самый высокий процент распространения симптомов, которые могут говорить о наличии ИППП за последние 12 месяцев. Все это в совокупности указывает на высокую потенциальную уязвимость таджикских женщин. Однако относительно высокие доходы таджичек могут в некоторой степени способствовать снижению рисков, так как хорошие заработки дают ббльшую возможность выбора половых партнеров и повышают доступность медицинских услуг для диагностики и лечения ИППП.

По результатам глубинных интервью, можно выделить два основных фактора, которые влияют на уязвимость женщин-мигрантов и риски заражения ИППП/ВИЧ. Первый фактор связан с сексуальным поведением постоянных партнеров женщин. В условиях городской среды со значительной свободой поведения, относительно высокими заработками и разнообразными возможностями для сексуальных отношений стабильность брачных союзов мигрантов испытывает постоянную проверку на прочность. Брак выходцев из Средней Азии, который зачастую заключается по договоренности между родителями, и где в силу этого любовь и степень эмоциональной привязанности супругов друг к другу может быть невелика, может дать трещину под действием искушений большого города.

Вторым фактором рисков является стремление женщин формировать эмоциональные привязанности, социальные связи и постоянные отношения с мужчинами. Эти отношения расцениваются женщинами как поддержка и опора в условиях непростой жизни и недружественного отношения к мигрантам в принимающем обществе. Женщины-мигранты, особенно те, кто ранее состоял в браке или имел сексуальные отношения, понимают, что в случае возвращения на родину их шансы на реинтеграцию в традиционное общество, включая систему брачных отношений, низки. Это связано с их возрастом и сексуальным опытом,

как действительным, так и приписываемым им. Московский рынок брачных или постоянных отношений – а именно его мигрантский сегмент, в котором могут реализоваться женщины из Средней Азии, – предоставляет большой набор возможностей для краткосрочных отношений, зачастую транзакционных сексуальных связей. Напротив, вероятность вступить в брак или даже иметь долгосрочные постоянные отношения довольно мала.

Описанный здесь проект представляет собой первый шаг к более масштабному исследованию социальной уязвимости и сексуальных рисков женщин-мигранток в России. Мы надеемся провести исследование в разных регионах страны и среди других этнических групп женщин-мигрантов. Также для сравнения мы планируем добавить группу внутренних мигрантов и местных жителей.

## Литература

Региональное измерение трансграничной миграции в Россию. М.: Аспект-пресс, 2008.

Трудовая миграция в Республике Узбекистан: социальные, правовые и гендерные аспекты. Программа развития ООН в Узбекистане и Гендерная программа Посольства Швейцарии в Узбекистане. Ташкент, 2008.

*Castles S., Miller J.* The Age of Migration. International Population Movements in the Modern World. L.: Macmillan, 1998.

*Decosas J., Kane F., Anarfi J.K. et al.* Migration and AIDS // *The Lancet*. 1995. 346. P. 826–828.

*He N., Detels R., Zhu J., Jiang Q. et al.* Characteristics and Sexually Transmitted Diseases of Male Rural Migrants in a Metropolitan Area of Eastern China // *Sexually Transmitted Diseases*. 2005. 32 (5). P. 266–292.

International Organization for Migration (IOM). World Migration Report 2008: Managing Labour Mobility in the Evolving Global Economy. Geneva: IOM, 2008.

*Liu H., Li X., Stanton B. et al.* Risk Factors for Sexually Transmitted Disease among Rural-to-urban Migrants in China: Implications for HIV/sexually Transmitted Disease Prevention // *AIDS Patient Care and STDs*. 2005. 19. P. 49–57.

*Sevoyan A., Agadjanian V.* Male migration, Women Left Behind, and Sexually Transmitted Diseases in Armenia // *International Migration Review*. 2010. 44 (2). P. 354–375.

*Wang W., Wei C., Buchholz M.E. et al.* Prevalence and Risks for Sexually Transmitted Infections among a National Sample of Migrants Versus Non-migrants in China // *International Journal of STD & AIDS*. 2010. 21. P. 410–415.

*Yang X.* Temporary Migration and the Spread of STDs/HIV in China: Is there a link? // *International Migration Review*. 2004. 38 (1). P. 212–235.

З.О. Пальян  
Киевский  
национальный  
университет  
им. Тараса Шевченко

# РОЖДАЕМОСТЬ В КОНТЕКСТЕ ЕСТЕСТВЕННОГО ВОСПРОИЗВОДСТВА НАСЕЛЕНИЯ УКРАИНЫ: СТАТИСТИЧЕСКИЙ АСПЕКТ

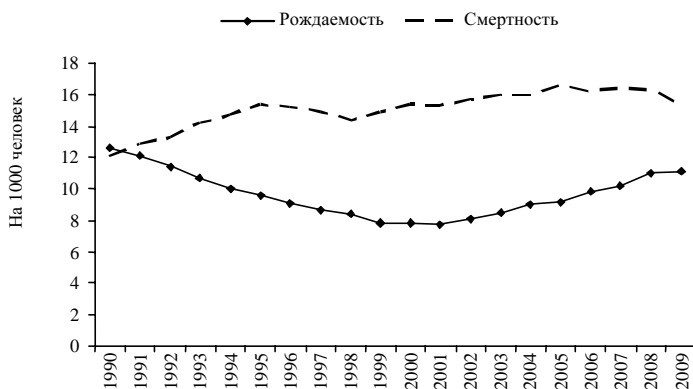
---

Степень демографической зрелости страны обуславливается преимущественно характером естественного воспроизводства населения. Установившийся режим дожития диктует порядок замены поколений, «стиль» репродуктивного поведения. В современных условиях эти процессы регулируются комплексом социально-экономических, в том числе экологических, политических факторов, а также демографической политикой. Причем демографическая политика государства в идеале должна быть направлена на оптимальную сбалансированность между интенсивностью дожития и деторождения, при которой можно не только уберечь страну от депопуляции, но и способствовать развитию населения.

Насколько реальное соотношение двух компонентов естественного воспроизводства в Украине соответствует оптимальному? Позволяет ли имеющийся демопотенциал страны улучшить характер воспроизводства и каковы вероятные его перспективы? Определенные ответы на эти вопросы дают результаты статистического оценивания влияния демографических факторов на воспроизводство населения Украины и его моделирование. В процессе исследования использовались данные Государственного комитета статистики Украины за 1991–2009 гг.

Украина, как и большинство европейских стран, живет в режиме суженого воспроизводства, когда интенсивность деторождения не возмещает потерь, вызванных смертностью. Причем рождаемость в Украине выступала в роли дестимулятора в течении одиннадцати лет (1991–2001 гг.) и одновременно с нарастающей смертностью углубила процесс депопуляции украинского населения. За последние восемь лет тенденции обеих составляющих естественного воспроизводства существенно изменились (рис. 1). Рождаемость возросла в це-

лом на 8,8%, или ежегодно в среднем на 1,1%, и в 2009 г. составила 11,1%, т.е. достигла уровня 1993 г., когда численность населения Украины была наибольшей за всю ее историю (52,2 млн). Смертность заметно снизилась до нижней границы высокого уровня (15,3%). В результате в 2009 г. размер естественной убыли населения сократился до 194 тыс. человек, или до -4,2 промильных пункта.



**Рис. 1.** Динамика общих коэффициентов рождаемости и смертности в Украине за 1991–2009 гг.

*Источник:* данные Госкомстата Украины.

Определенный оптимизм вселяет улучшение порядка воспроизводства материнского поколения, сущность которого состоит в том, что в стране рождается достаточное количество девочек, доживающих до среднего возраста своих матерей и способных их заменить в процессе воспроизводства. За период с 2002 г. по 2009 г. суммарный коэффициент плодовитости ежегодно возрастал в среднем на 3,6% и составил 1,45 детей в расчете на одну женщину детородного контингента против чрезвычайно низкого уровня 1,09 детей в 2001 г. Однако этот показатель не учитывает реального режима дожития женщин репродуктивного возраста. В «чистом» виде воспроизводство материнского поколения оценивает нетто-коэффициент воспроизводства, который в 2009 г. достиг уровня 0,689, т.е. каждая женщина условного репродуктивного поколения за свою детородную жизнь могла родить в среднем менее одной дочери, что в общем-то типично для большинства развитых стран. Значение этого показателя формируется преимущественно за счет двух факторов – повозрастной плодовитости женщин и интенсивности их дожития в пределах детородного возраста. В незначительной мере влияет доля девочек среди новорожденных. В Украине в среднем на каждую тысячу новорожденных приходится 483–485 девочек.

Статистическая оценка роли факторов воспроизводства материнского поколения позволяет своевременно скоординировать государственные меры, направленные на сохранение и продление жизни женщин плодovитого возраста или на активизацию их детородной активности, либо на то и другое одновременно.

Для анализа влияния каждого из указанных факторов были построены трехфакторные индексные модели за 1993–2009 гг. и отдельно за период, когда установилась позитивная тенденция рождаемости 2001–2009 гг. Следует отметить, что 1993 год выбран базой сравнения не случайно. Ранее указывалось, что именно в этом году численность населения Украины достигла своего максимума, а показатели воспроизводства материнского поколения не переступили границы «очень низкого уровня» (1,5–1,8 ребенка).

За последние шестнадцать лет (1993–2009 гг.) нетто-коэффициент воспроизводства снизился на 9,38% (против 0,76 в 1993 г.). Основной причиной падения коэффициента было резкое снижение плодovитости женщин (–9,69%). Слабо выраженную негативную роль сыграло уменьшение доли девочек среди новорожденных (–0,33%). Единственным положительным фактором было некоторое продление продолжительности жизни женщин плодovитого возраста (+0,68%). Интересно рассмотреть подробно шестнадцатилетний динамический ряд, поскольку, как отмечалось выше, в разные промежутки времени характер изменений был не однонаправленный.

**Таблица 1.** Динамика нетто-коэффициента воспроизводства за счет отдельных факторов в Украине, 1993–2001 гг. и 2001–2009 гг.

Показатель	1993–2001 гг.		2001–2009 гг.	
	абсолютное изменение, число девочек	относительное изменение, %	абсолютное изменение, число девочек	относительное изменение, %
Нетто-коэффициент воспроизводства	–0,251	67,05	+0,182	135,60
Изменение нетто-коэффициента за счет:				
плодovитости женщин	–0,250	67,19	+0,178	134,85
дожития женщин репродуктивного возраста	+0,002	100,29	+0,002	100,35
доли девочек среди новорожденных	–0,003	99,51	+0,002	100,21

Источник: авторские расчеты по данным Госкомстата Украины.



Очевидно, что за два рассматриваемых отрезка времени направления изменений почти по всем показателям диаметрально противоположные. Период обвального снижения воспроизводства материнского поколения на 32,95% (1993–2001 гг.) сменился этапом почти равнозначного компенсационного роста. Нельзя не заметить, что основную роль на первом этапе сыграло катастрофическое снижение плодовитости женщин (–32,8%), а именно в 2001 г. суммарный коэффициент плодовитости был чуть более единицы (1,09 ребенка). На фоне такого уровня последующие изменения плодовитости кажутся весьма внушительными.

За последние восемь лет (2002–2009 гг.) нетто-коэффициент воспроизводства возрос на 35,6% против небывало низкого уровня 2001 г., когда каждая женщина условного поколения за весь детородный период могла обеспечить себе замену лишь «наполовину» (нетто-коэффициент составлял 0,51 девочки). Повышение детородной активности украинских женщин сыграло главную роль в увеличении нетто-коэффициента на 34,85%, или на 178 девочек в расчете на 1000 матерей условного поколения. Улучшение характера дожития материнского поколения привело к незначительному росту нетто-воспроизводства на 0,35%. Едва заметное влияние оказало удачное изменение соотношения полов. Благодаря увеличению доли девочек в структуре новорожденных, нетто-коэффициент воспроизводства возрос на 0,2%.

Слабое влияние фактора дожития может объясняться либо исчерпанностью естественных резервов удлинения продолжительности жизни, либо недостаточной управляемостью процессом смертности. Ярким показателем «исчерпанности» ресурсов дожития является вероятность дожития новорожденных дочерей до возраста, когда они родились у своих матерей. Таким образом, при определении этой вероятности учитывается средняя длина материнского поколения, т.е. число лет, необходимое для замены двух поколений – матерей и дочерей.

**Таблица 2.** Средняя длина материнского поколения и вероятность дожития дочерей до среднего возраста матерей в Украине в 2001 и 2009 гг.

Вид местности	Средняя длина материнского поколения, лет		Вероятность дожития дочерей до среднего возраста матерей		Темп роста вероятности дожития дочерей до среднего возраста матерей за 2002–2009 гг., %
	2001 г.	2009 г.	2001 г.	2009 г.	
Городская	24,9	26,6	0,979	0,982	100,306
Сельская	24,1	25,2	0,976	0,978	100,205
В целом	24,6	26,1	0,978	0,981	100,307

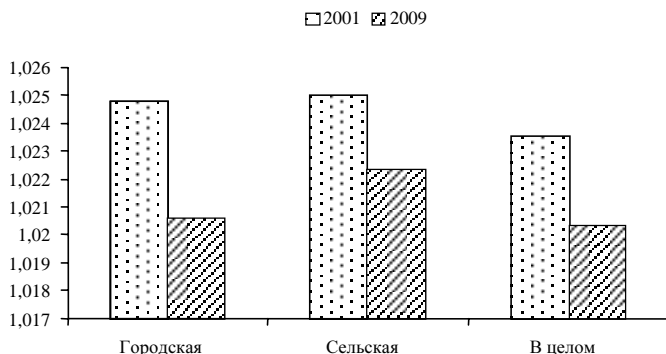
Источник: авторские расчеты по данным Госкомстата Украины.

В Украине вероятность дожития девочек до среднего возраста матерей, который в 2009 г. составлял 26,1 года, была довольно высокой – 981 шанс из 1000, что практически отвечает уровням западноевропейских стран. Хотя нельзя не признать того, что материнский контингент Украины не исчерпал резерв снижения смертности в плодовитом возрасте. Несколько ниже интенсивность дожития в сельских местностях – 0,978. Однако вероятности дожития девочек в сельской и городской местности за последние восемь лет заметно возросли при одновременном увеличении средней длины материнского поколения с 24,6 лет в 2001 г. до 26,1 лет в 2009 г. Последнее явление объясняется, с одной стороны, постарением детородного контингента благодаря улучшению режима дожития, а с другой – активизацией деторождения среди женщин старшего и позднего репродуктивного возраста. А именно, с 2001 по 2009 гг. плодовитость женщин в возрасте 30–34 и 35–39 лет ежегодно увеличивалась в среднем более чем на 11%. Трансформация повозрастной структуры детородной активности украинских женщин в значительной мере является следствием реализации ранее отложенных рождений (как правило второй очередности), особенно в период обострения социально-экономического кризиса. Параллельно отмечается постепенное изменение модели плодовитости женщин Украины и переход на общеевропейскую модель отложенных первых рождений.

Рациональность характера восстановления материнского поколения определяется соотношением брутто- и нетто-коэффициента воспроизводства. При оптимальном характере замены поколений он должен равняться единице. Чем выше единицы этот коэффициент, тем ниже эффективность воспроизводства материнского контингента. В Украине в 2009 г. этот показатель составлял 1,0203. Это означает, что при существующем режиме дожития и плодовитости каждая 1000 украинских женщин должна за год родить 1020 дочерей для поддержания теperешней интенсивности замены поколений.

Как видно из рис. 2, за последние восемь лет эффективность воспроизводства заметно улучшилась, особенно среди городских женщин, у которых явно лучшие условия жизни и работы, выше уровень медицинского и социального обеспечения, больше возможностей заняться собой, собственным здоровьем. Между тем сельские женщины обладают большим резервом для увеличения продолжительности жизни в репродуктивном возрасте. Снижение фактора риска преждевременной смерти потенциальных и реальных матерей заключается не только в кардинальном реформировании сельской медико-социальной инфраструктуры. Проблема состоит в трудоустройстве населения по месту жительства. Массовая трудовая миграция сельских женщин в поисках хоть какого-нибудь заработка не только подрывает их здоровье, но и отвлекает от выполнения дето-

родных функций и родительских обязанностей. Поэтому в сельской местности главными инструментом повышения эффективности воспроизводства является радикальное изменение социально-экономических условий жизни.



**Рис. 2.** Эффективность воспроизводства материнского поколения в Украине в разрезе типов поселений в 2001 г. и 2009 г.

*Источник:* авторские расчеты по данным Госкомстата Украины.

В целом же оценка влияния факторов воспроизводства позволяет сориентировать демографическую и социальную политику Украины на дальнейшее стимулирование рождаемости, особенно появление детей второй очередности, отложенное в кризисное время. Не менее важным резервом сдерживания депопуляции является продление жизни как материнского поколения, так и, особенно, когорты мужчин активного брачного (25–29 лет) и зрелого репродуктивного возраста (40–49 лет), среди которых индекс сверхсмертности колеблется в пределах 3,1–3,2 раза.

Обобщающей характеристикой воспроизводства всего населения является истинный коэффициент естественного прироста. Он оценивает относительную скорость обновления населения. Поскольку коэффициент рассчитывается на основе модели стабильного населения, то он не подвержен влиянию режима воспроизводства предыдущих поколений.

Очевидно, что за весь анализируемый период истинный коэффициент естественного прироста населения Украины был отрицательным, что свидетельствует о дальнейшем уменьшении численности населения вследствие естественной убыли. Его значение в 2009 г. позволяет сказать, что население Украины будет уменьшаться ежегодно в среднем на 1,42%, если в последующие 26 лет (средняя длина материнского поколения) сохранится существующий режим дожития и плодовитости, при котором замещение материнского поколения осуществляется лишь на 68,9%.

**Таблица 3.** Истинный коэффициент естественного прироста населения Украины и его компоненты в 1993, 2001, 2009 гг.

Показатель	1993 г.	2001 г.	2009 г.
Истинный коэффициент естественного прироста населения, %	-1,11	-2,70	-1,42
Средняя длина материнского поколения, лет	24,0	24,6	26,1
Нетто-коэффициент воспроизводства, девочек на одну женщину	0,760	0,510	0,689

*Источник:* авторские расчеты по данным Госкомстата Украины.

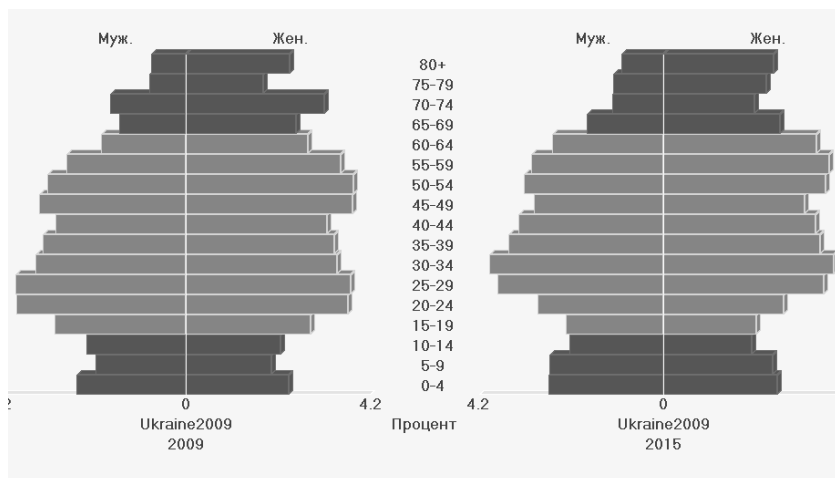
Если исходить из того, что в последующие 6 лет сохранятся современные тенденции роста по возрастной плодovitости, то с вероятностью 0,95 можно предположить, что к 2015 г. суммарный коэффициент плодovitости может увеличиться до 1,48–1,55 ребенка, а нетто-коэффициент воспроизводства вернется к уровню 1993 г. (0,76 дочек в расчете на одну женщину репродуктивного возраста). Учитывая, что в последующие 10 лет активный детородный контингент (27–32 года) будут представлять наиболее многочисленные за последние 30 лет когорты родившихся (1983–1988 г. рождения), а также их переход на модель «поздних рождений», сценарий воспроизводства может быть еще более оптимистическим. Тогда при сохранении средней продолжительности жизни мужчин и женщин на уровне 2009 г. и современного положительного сальдо миграции можно ожидать, что суммарный коэффициент плодovitости к 2015 г. возрастет до 1,63 ребенка в расчете на одну женщину репродуктивного возраста (табл. 4).

**Таблица 4.** Фактические и прогнозные показатели естественного воспроизводства населения Украины, 2009 и 2015 гг.

Показатели	Фактически в 2009 г.	Прогноз на 2015 г.
Абсолютный естественный прирост населения, тыс. человек	-194,2	-186,7
Коэффициент естественного прироста, промилльные пункты	-4,2	-4,1
Суммарный коэффициент плодovitости, детей	1,45	1,63
Брутто-коэффициент воспроизводства, девочек	0,703	0,788
Нетто-коэффициент воспроизводства, девочек	0,689	0,770
Общий коэффициент рождаемости, %	11,1	11,6
Численность родившихся, тыс. человек	512,5	517,9
Численность населения, млн человек	45,8	44,7

*Источник:* авторские расчеты по данным Госкомстата Украины.

Такие изменения могут несколько замедлить процесс депопуляции украинского населения. А именно, если уровень рождаемости возрастет до 11,6%, можно ожидать, что размер естественной убыли сократится до 186,7 тыс. человек (или до 4,1 промиллевого пункта). При таком порядке воспроизводства и неизменном сальдо миграции ожидаемая в 2015 г. численность украинского населения может составить 44,7 млн человек. На фоне снижающейся численности населения небольшой прирост числа родившихся (+ 5,4 тыс. человек) может наложить отпечаток на возрастную-половую структуру украинского населения. В частности, несколько увеличить долю детей самой младшей возрастной группы (0–4 года) с 5,15% в 2009 г. до 5,54% в 2015 г. Автоматически возрастет процент мужского населения за счет детей раннего возраста, поскольку среди новорожденных преобладает мужской пол<sup>1</sup>. Прогнозируемая трансформация возрастно-половой структуры населения Украины хорошо прослеживается на изменении конфигурации возрастно-половой пирамиды (рис. 3).



**Рис. 3.** Фактическая в 2009 г. и прогнозная на 2015 г. возрастно-половая пирамида населения Украины

*Источник:* авторские расчеты по данным Госкомстата Украины.

Постепенное расширение основания пирамиды несколько уменьшит старение населения «снизу». Однако даже это не остановит углубление общего процесса постарения из-за того, что первый порог старости 60–64 года пере-

<sup>1</sup> В Украине на протяжении последних двадцати лет на каждые 100 новорожденных девочек приходится в среднем 106–107 мальчиков.

шагнет многочисленное поколение послевоенных беби-бумеров, а также в группе старшего поколения по-прежнему будет пребывать не малая когорта родившихся перед Второй мировой войной.

Произойдет заметная «перегруппировка сил» в составе детородного контингента. Наиболее многочисленная когорта родившихся в 1983–1988 гг., а это дети беби-бумеров 1959–1962 годов рождения, вступит в достаточно активный детородный возраст 30–34 года. Как отмечалось выше, именно в этой и в следующей (35–39 лет) возрастных группах в течение последних 10 лет наблюдается интенсивный рост плодовитости. Это проявление постепенного перехода на европейскую модель поздних рождений первенцев, обусловленную изменением жизненных приоритетов современных молодых женщин, у которых период социализации приходится на молодой репродуктивный возраст (20–30 лет). Эти годы тратятся женщинами на получение соответствующего образовательного и профессионального статуса, позволяющего занять устойчивую позицию на рынке труда. Немалую роль играет распространение среди молодежи, особенно экономически независимой ее части, неформальных, ни к чему не обязывающих брачных отношений. Как правило, в таких «многokrатно пробных семьях» вероятность рождения ребенка мизерна. Следует сказать, что подобный стиль детородного поведения у украинских женщин только формируется. Можно ожидать, что он наложит свой отпечаток на плодовитость молодой генерации женщин, которые в 2015 г. только вступят в активный детородный возраст (20–24 года). А их поколение значительно меньше двух предыдущих.

Поэтому в прогнозном периоде определенные надежды возлагаются на когорты матерей среднего возраста. Именно в их детородном поведении в последние годы отмечается компенсаторная тенденция – реализация отложенных во времени рождений второго и третьего ребенка, которые приходятся на возраст 30–39, а также 40–44 года. Данные последних 9 лет показывают устойчивое снижение доли первенцев с 63% в 2001 г. до 53% в 2009 г. в пользу вторых (+7 п.п.) и третьих (1,5 п.п.) очередностей рождений. Реализация отсроченных репродуктивных планов оказалась возможной при определенной стабилизации экономической ситуации, восстановлении сети дошкольных учреждений, некотором улучшении материального положения украинских семей, а главное – их адаптации к существующим условиям переходного периода. Немалую стимулирующую роль сыграла государственная программа одноразовой денежной помощи родителям при рождении ребенка, внедренная с 2005 г. В последующие годы размер помощи увеличивался и дифференцировался в зависимости от очередности рождений.

Таким образом, приоритетом теперешней государственной демографической политики Украины является поддержка ориентации людей детородного возраста на двухдетные семьи. Однако, как показывает исторический опыт большинства европейских стран, система пронаталистических мер не имеет долговременной отдачи либо имеет циклический эффект, как-то «реакция по мере вливания». Кроме того, указанные меры приносят и нежелательные плоды – повышают детность в маргинальных семьях. Не трудно предположить, что при условии стабилизации социально-экономической ситуации, гарантированности устойчивых доходов, уверенности в том, что наличные доходы смогут покрыть сегодняшние и завтрашние расходы, украинское население начнет адекватно реагировать, реализуя естественную потребность в детях, а не только в одном ребенке.

Проведенный статистический анализ имеющихся и потенциальных ресурсов сужения депопуляции в Украине, позволяет выделить два направления. Первое – это поддержка детородных планов наиболее представительной когорты людей среднего плодovitого возраста. Причем стимулирование рождаемости может быть краткосрочным, на ближайшие 5–10 лет, пока указанное поколение не вышло за пределы активного возраста. Одновременно необходимо бороться за продление жизни репродуктивного контингента, в том числе в сельской местности; за сохранения баланса полов, особенно в возрасте 30–45 лет. Именно в этом интервале смертность мужчин втрое превышает женскую смертность. Приоритетом государственной политики должно быть формирование стиля здоровой упорядоченной жизни, которая может дать здоровое потомство, способное к воспроизводству.

Очевидно, в условиях демографического кризиса, государственная политика должна оптимально использовать все возможные рычаги воздействия на сохранение национального генофонда.

## Литература

- Бьюкенен П.Дж.* Смерть Запада / пер. с англ. А. Башкирова. М.: АСТ, 2003.
- Вишневикий А.Г.* О мотивационной основе рождаемости / Демографическое развитие семьи. М.: Статистика, 1979. С. 135–136.
- Молодь та молодіжна політика в Україні: соціально-демографічні аспекти / за ред. Е.М. Лібанової. К.: Ін-т. демогр. та соціальн. досліджень НАН України ім. М.В. Птухи, 2010. С. 8–30.
- Пальян З.О.* Статистичний аналіз трансформації репродуктивної активності населення України // Вчені записки. К.: КНЕУ 2009. Вип. 11. С. 197–203.
- Пальян З.О.* Статистичний аналіз чинників та передумов народжуваності в Україні // Статистика України. 2009. № 2. С. 48–54.

*Романюк А.І.* Демографічні студії: Вибрані праці. К.: Ін-т економіки НАН України, 1997.

Шлюб, сім'я та дітородні орієнтації в Україні. К.: АДФЕ-Україна, 2008. С. 10–39.

The New Demographic Regime. Population Challenges and Policy Responses / ed. by M. Macura, A.L. MacDonald, W. Haug. UN, N.Y. and Geneva, 2005. P. 65–66.



# РЫНКИ ТРУДА

---



# RUSSIAN LABOR: THE PUZZLE OF QUIESCENCE

---

## Introduction

After decades of political control and suppression under Soviet Communism, Russian labor burst onto the political scene with the massive miners' strikes of 1989 and 1991. More than 400,000 workers participated in these strikes, which engulfed major coal basins, produced independent miners' unions, and contributed to the Soviet collapse and the emergence of Boris Yeltsin. Some analysts anticipated the growth of a powerful workers' movement in Russia, but in retrospect the miners' strikes represented the height, rather than the beginning, of labor's mobilization and influence. The post-Communist transition brought expanded organizational and political rights, but Russia's workers remained largely quiescent throughout the deep economic downturn of the 1990s, as well as the years of recovery and growth from 2000–2008. Unions made forays into electoral politics but never had much impact, and the main surviving labor federation eventually subordinated itself to Putin's «party of power», United Russia. Still, modest new strike and protest movements have emerged since 2006, and contemporary scholars anticipate various futures for Russian labor.

The present study focuses on the «puzzle of quiescence», the contending explanations for labor's failure to mobilize that have preoccupied much of the scholarly and analytical literature. (See, for example, [Ashwin, 1999; Connor, 1996; Cook, 1997; Crowley, 1997; Crowley, Ost, 2001; Javeline, 2003; Kubicek, 1999; Mandel, 2000]). Looking to the future, some analysts argue that labor in Russia has been permanently disempowered by the forces of economic globalization; that it has been marginalized by the constraints of Russia's competitive-authoritarian political regime; or, by contrast, that it retains potential to mobilize and to affect distributive and political outcomes.

## Labor's significant but short-lived role in the postcommunist transition

The summer, 1989 coal miners' strike constituted the first major grass-roots challenge to the Soviet regime, the emergence of «perestroika from below». The strikes seemed to reveal an enormous, unexpected capacity for labor's self-organization and mobilization. The workers' demands focused on working and living conditions, poor management, and broader systemic issues. Strikers were generally pro-reform, seeking greater economic independence from central authorities. Though these initial strikes were met with deep concessions, rapidly worsening conditions and growing discontent led to another strike wave in the coal basins in 1991. This time the miners added political demands that helped bring the end of Gorbachev's presidency and collapse of the Soviet Union. Strikes also emerged among oil and gas workers, transport, and some public sector workers during this period [Christensen, 1999; Connor, 1996; Crowley, 1997; Filtzer, 1994; Friedgut, Sieglebaum, 1990; Mandel, 1990].

The 1989 strikes spawned new grass-roots leadership and labor organizations that presented a direct challenge to the monopoly of the Federation of Independent Trade Unions (FNPR), the holdover Communist-era union federation. While the Independent Miners' Union (NPG) remained the most prominent of the new labor unions, independents also emerged among pilots, air traffic controllers, longshoremen, and white-collar workers (i.e., Sotsprof). Workers' activism in Russia, Poland and elsewhere during this period led to predictions that labor would be a key player in the success or failure of the postcommunist transition, that «trade unions... would have to be beaten or tamed as politicians juggled the demands of simultaneous political and economic reform» [Kubicek, 1999, p. 83; Przeworski, 1991].

But events would prove otherwise. Despite sharply worsening economic and labor market conditions in Russia, strikes spread only in the public sector, where they were mainly defensive (i.e., demanding payment of wage arrears), and soon dropped off. While most workers continued as nominal members of the successor FNPR or quit unions altogether, independents remained few and fragmented (Clarke et. al., 1995; Gordon, 1995). Collective labor did not mobilize to defend its interests, and unions found only ephemeral political allies. By 1995 Russia's governing elite was no longer worried about a «social explosion», while analysts focused on explaining the weakness and passivity of postcommunist labor.

## The puzzle of quiescence

From the beginning of 1992, the Russian government pursued a strategy of «shock therapy» reform that included price liberalization, sharp cuts in public spending, and privatization of most productive resources to managers and a new class of wealthy oligarchs. Russia's workers experienced severe real wage declines, growing open and «hidden» unemployment, mass dismissals and forced furloughs, growth of the «working poor», and an overall catastrophic decline in living standards. Wage arrears became widespread. Trade and capital liberalization opened Russia to the international economy, leading to large-scale capital flight and cheap imports that further depressed domestic production. Corruption, intra-elite conflict, state incapability, and the demonetization and primitivization of the economy marked the decade.

Throughout this period workers remained largely quiescent. From 1992 to 1999 only 1–2% of Russia's labor force was involved in strikes, while the number of labor days lost to strikes in Russia was lower than in Western Europe. Labor was also marginalized in political decision-making, as Yeltsin's government pursued policies that proved inimical to the interests and well-being of the vast majority of workers [Crowley, Ost, 2001]. Scholars have proposed *four contending explanations* for Russian labor's quiescence in the face of these policies: changes in the global structure of production; organizational and ideological legacies of communism; political opportunity structures and elites' interests; and cognitive obstacles to collective action. These explanations are not mutually exclusive, but each stresses different causal factors and processes.

The first explanation points to changes in the global structure of production that coincided with the postcommunist transition. As elaborated by Kubicek, this explanation emphasizes that unions everywhere have been weakened by several major shifts: 1) erosion of manufacturing industries and jobs that are most conducive to unionization; 2) attendant decline in the size of enterprises; 3) growth of the private service sector, which is less amenable to unionization, and 4) economic globalization, which privileges mobile capital over labor and increases pressures for competition and flexibility in labor markets. All four shifts were prominent in Russia's economy during the 1990s. Many of Russia's massive industrial plants were closed or re-structured, labor moved from manufacturing to service sectors and from larger to smaller enterprises, and the outflow of capital greatly exceeded the inflow of investment in the liberalized capital regime. Russian labor was also in surplus, further weakening its position. Even in West European industrial democracies with strong national labor federations, these structural changes weakened labor's bargaining

power. In the postcommunist states they militated against unions even establishing influence; in Kubicek's (1999) terms the «Western sun was setting» on organized labor's power globally by the time Communism collapsed.

The second explanation points to legacies of communism, including enterprise-level production relations and ideology, to account for labor quiescence. Its proponents point to the fact that Soviet workers depended on their employing enterprises not only for jobs and wages, but often for housing, medical care, access to consumer goods, social services, recreation, etc. Many of these benefits were controlled and manipulated by managers, though social provision also had a paternalistic aspect. This system of enterprise distribution created «multiple strands of dependence», that tied workers to their enterprises, made the costs of protest prohibitive, and subordinated individual workers to management in ways that undermined solidarity. Key conditions were different in the few strike-prone sectors, mainly mining and public services. Here enterprises distributed meager in-kind benefits compared to most sectors of industry. Thus, according to Crowley's (1997) study, Russian and Ukrainian coal miners struck in 1998–1991 while steelworkers in the same cities did not, because steel mills distributed many more in-kind goods and services to their workers in a discretionary manner that bound them to their enterprises, than did coal mines.

Other studies rely on variants of the «legacies» argument. Ashwin (1998) explains Russian workers' «endless patience» by studying demobilization in a formerly militant Kuzbass coal town. Here the struggles of everyday life during the mid-1990s produced alienation and reliance on individual survival strategies, resulting in a lack of collective action among the miners. Another variant of the «legacies» argument holds that the Soviet state's appropriation of working class identity left postcommunist workers unable to forge an authentic collective identity, or to formulate legitimate collective interests [Crowley, Ost, 2001]. In a somewhat different vein, Filtzer (1994), argues that Russian workers had to go through a Marxian process of post-Communist reformation as a class.

A third explanation focuses on political opportunity structures, resources and interests, particularly the interests of governmental and trade union elites. As the 1990s progressed, Russia's government depended increasingly on opaque, often-corrupt relations with economic and other elite strata, rather than political and electoral support from broad social groups. Political parties proved too ephemeral to form stable alliances with unions [Cook, 1997]. Governing elites grew increasingly insulated and autonomous from societal pressures. Meanwhile, leaders of the main trade union federation, the successor FNPR, depended on the government to maintain

inherited status and property, as well as control over distribution of social insurance and other benefits [Davis, 2001]. In any case the successor FNPR had too little authority with rank-and-file workers to challenge the government, and fell back on old habits of cooperation with management to protect union prerogatives. The independent unions remained too small, weak and divided to represent or bargain on behalf of labor. Christensen (1999) communicates affectingly the «neoliberal neglect» of labor's interests in the Yeltsin period, and the resulting disillusionment of workers. He and Kubicek (2004), argue that organized labor forms a key part of the civil society that is necessary to hold governments accountable, and that labor's weakness and political marginalization augered poorly for democracy's future in Russia.

A fourth explanation for labor's quiescence focuses on cognitive limitations, in particular workers' difficulty in assigning blame for their grievances or figuring out who could or should redress them. In Russia's chaotic 1990s economy with its shifting mix of state, private, shareholder, and municipal ownership, implicit subsidies, barter transactions, and the opaque system of fiscal federalism that funded the public sector, it proved genuinely difficult for workers to know who was responsible for unpaid wages and other problems. In a survey conducted at the depths of the wage arrears crisis in 1997–1998, for example, Javeline (2003) found that the vast majority of Russia's workers could not assign blame for their unpaid wages to any individual or institution, while the minority who could assign blame proved much more likely to protest. Javeline argues that the widespread inability to attribute blame undermined labor activism. While political entrepreneurs might have compensated for this information gap, they rarely tried in Russia during this period.

While quiescence predominated, Russian workers and unions were far from entirely passive during the 1990s. Public sector workers, in health care and especially education, mounted strikes throughout the decade. Unions made electoral alliances with a range of political parties. Some FNPR unions allied with the Communist and Agrarian Parties, the FNPR's leadership formed a bloc with the main organization of industrial managers, Volsky's Russian Union of Industrialist and Entrepreneurs, which failed electorally. Boris Misnik's pro-reform Metallurgical Union briefly appeared significant. Public sector unions supported the liberal Yabloko Party, independent unions tried but failed to form stable federations, and there were periodic grass-roots organizing initiatives. Some local unions resisted or negotiated changes at individual enterprises [Cook, 1997, 2007].

Increasingly, though, labor activism consisted of sporadic, localized wildcat strikes and desperate tactics such as hunger strikes, hostage-taking, and the «Rail Wars» in which miners blocked the Transiberian and other major rail lines in response

to the 1998 financial crisis [Gordon, 1995]. At their most extreme, protesters adopted tactics of the incarcerated and disempowered. Many of the strikes that did take place were «directors strikes», initiated by management or local administrations with the goal of extracting resources from higher, regional or federal levels of government [Gimpelson, Triesman, 2002; Robertson, 2007]. Renewed economic growth did seriously affect this situation. After 2000 economic and social conditions for labor improved while the FNPR subordinated itself to United Russia and the Putin – Medvedev government, acting largely to manage workers rather than represent them [Robertson, 2007].

## **Conclusion: divergent views of labor's future in Russia**

Contemporary scholars propose divergent views on labor's future in Russia. Kubicek and others maintain that organized labor has been permanently disempowered by the forces of economic globalization. Robertson (2007) argues that labor organization and strikes are likely to remain severely constricted by Russia's electoral-authoritarian politics. Ost (2000, 2009), by contrast, has moved from pessimism to anticipating a qualified revival of labor's strength.

Kubicek views globalization and its accompanying changes in the structures of production and labor markets as permanently disempowering for labor, in Russia and progressively world-wide. By contrast, Ost argues that after a long period of decline and quiescence postcommunist labor unions have begun to revive. However, they will not become the inclusive, mass democratic organizations of Europe's past. Rather, postcommunist unions will include and empower only the top strata of skilled, mainly male labor elite in key production sectors. The large majority of workers will not recover bargaining power, but will remain organizationally weak and politically marginal [Ost, 2009].

In another view, Robertson (2007) assigns a central role to political regime-type, arguing that labor activism and protest in electoral-authoritarian regimes such as the Russian is likely to take different forms than it has historically in democratic systems. In this view, Russia's political regime deprives labor of the capacity for independent political mobilization, so workers are likely to protest only in desperation, or in actions organized and directed by elites (i.e., directors' strikes.) The patterns of activism observed in Russia both in the late 1990s and in the 2008–2009 recession provide some support for this analysis, which assumes the long-term marginalization of labor as an autonomous social force.



In sum, most analyses stress the quiescence and political marginalization of postcommunist labor in Russia. At the same time, recent research calls into question the likelihood of labor's continuing passivity and political marginalization, and suggests new frameworks for thinking about its future significance in Russia.

Acknowledgment: A longer version of this paper is to be found in Graeme Gill, ed. *Handbook of Russian Politics and Society* [Routledge, forthcoming 2011] Thanks to for comments on earlier drafts Graeme Gill and Elena Vinogradova.

## References

*Ashwin S.* Russian Workers: the Anatomy of Patience. Manchester, U.K.: University of Manchester Press, 1999.

*Chetvernina P., Smirnov P., Dunaeva N.* Mesto profsoyuza na predpriyatii // Voprosi Ekonomiki. 1995. № 6.

*Christensen P.T.* Russia's Workers in Transition: Labor, Management, and the State under Gorbachev and Yeltsin. DeKalb: Northern Illinois University Press, 1999.

*Clarke S., Fairbrother P., Borisov V.* The Workers' Movement in Russia. Brookfield, VT: Edward Elgar Pub., 1995.

*Connor W.* Tattered Banners: Labor, Conflict, and Corporatism in Post-communist Russia. Boulder, CO: Westview Press, 1996.

*Cook L.J.* Labor and Liberalization: Trade Unions in the New Russia. N.Y.: Twentieth Century Fund, 1997.

*Cook L.J.* Postcommunist Welfare States: Reform Politics in Russia Eastern Europe. Ithaca: Cornell University Press, 2007.

*Crowley S.* Hot Coal, Cold Steel: Russian and Ukrainian Workers from the End of the Soviet Union to the Postcommunist Transformation. Ann Arbor: Univ. of Michigan Press, 1997.

*Crowley S., Ost D.* (eds.) Workers after Workers' States: Labor and Politics in Postcommunist Eastern Europe. N.Y.: Rowman and Littlefield, 2001.

*Davis S.* Trade Unions in Russia and Ukraine: 1985–1995. L.: Palgrave, 2001.

*Filtzer D.* Soviet Workers and the Collapse of Perestroika: The Soviet Labour Process and Gorbachev's Reforms, 1985–1991. Cambridge: Cambridge Univ. Press, 1994.

*Friedgut T., Siegelbaum L.* Perestroika from Below: The Soviet Miners' Strike and its Aftermath // New Left Review. 1990. 18. 1. P. 5–23.

*Gimpelson V., Treisman D.* Fiscal Games and Public Employment: A Theory with Evidence from Russia // World Politics. 2002. 54. 2.

*Gordon L.A.* Hope or Threat? The Workers' Movement and Trade Unions in Transitional Russia (in Russian). M.: IMEMO, RAN, 1995.

*Javeline D.* The Role of Blame in Collective Action: Evidence from Russia // American Political Science Review. 2003. 97. 1. P. 107–121.

*Kozmina I.* Industrial Conflict in Contemporary Russia (in Russian) // Ekonomicheskaja Sotsiologija. 2009. 11. 3.

*Kubicek P.* Organized Labor in Postcommunist States: Will the Western Sun Set on it, Too? // Comparative Politics. 1999. 32. 1. P. 83–102.

*Mandel D.* Why Is there No Revolt? The Russian Working Class and the Labor Movement // *The Socialist Register*. L.: Merlin Press, 2001.

*Ost D.* Illusory Corporatism in Eastern Europe: Neoliberal Tripartism and Post-communist Class Identities // *Politics and Society*. 2000. 28(4). P. 503–530.

*Ost D.* The End of Postcommunism: Trade Unions in Eastern Europe's Future // *East European Politics and Society*. 2009. 23(1). P. 13–33.

*Przeworski A.* *Democracy and the Market*. N.Y.: Cambridge Univ. Press, 1991.

*Robertson G.B.* Leading Labor: Unions, Politics, and Protest in New Democracies // *Comparative Politics*. 2004. 36. 3. P. 253–272.

*Robertson G.B.* Strikes and Labor Organization in Hybrid Regimes // *American Political Science Review*. 2007. 101(4). P. 781–798.

*Rutland P.* Labor Unrest and Movements in 1989 and 1990 // *Soviet Economy*. 1990. 6(4). P. 345–384.

# НЕСТАНДАРТНЫЕ ТРУДОВЫЕ ДОГОВОРА: ОПЫТ РОССИЙСКИХ ПРЕДПРИЯТИЙ<sup>1</sup>

---

Трудовые отношения между работником и работодателем, продолжительность которых заранее определена в трудовом договоре и конечна во времени, составляют суть нестандартных договоров. В большинстве развитых стран трудовые отношения на основе нестандартных трудовых договоров являются распространенной формой отклонения от стандарта<sup>2</sup>. Нестандартные договора включают в себя достаточно широкий круг различных видов временной занятости (срочные договора, договора с агентствами занятости, договора на выполнение определенного объема работ, ученические договора и др.).

В российских условиях рассмотрение нестандартных договоров актуально по нескольким причинам. Во-первых, в российской экономике законодательное регулирование нестандартных трудовых договоров сложилось еще не в полной мере. И в бизнес-среде, и среди политической элиты и законодателей по данному вопросу ведутся активные дискуссии. Во-вторых, интерес к нестандартным трудовым договорам связан с экономическими и социальными последствиями их применения (уровнем жизни работников, занятостью, производительностью труда и т.п.). Поскольку в условиях кризиса 2008–2009 гг. обострились проблемы безработицы и ее застойности, то использование предприятиями нестандартных трудовых договоров все больше рассматривается как один из способов повышения уровня занятости.

## **База данных и методика исследования**

В данном исследовании рассмотрены нестандартные трудовые договора двух видов. Это срочные трудовые договора, которые охватывают все виды

---

<sup>1</sup> Работа выполнена в рамках проекта Лаборатории исследований рынка труда ГУ ВШЭ «Взаимодействие внутренних и внешних рынков труда в российской экономике», поддержанного Центром фундаментальных исследований ГУ ВШЭ (2009–2011 гг.).

<sup>2</sup> Стандартные трудовые договора – это договора, время действия которых заранее не ограничено.

срочных договоров, заключаемых предприятием с работниками на определенный срок, а также договора лизинга (аутстаффинга), согласно которым трудовой договор на определенный срок заключает с работниками агентство занятости.

Для анализа использованы данные опроса предприятий «Взаимодействие внутренних и внешних рынков труда» (ВВВРТ), проведенного в 2009 г. Лабораторией исследований рынка труда (ЛИРТ)». В выборку вошли 1100 предприятий семи отраслей экономики (добыча полезных ископаемых, промышленность, строительство, транспорт и связь, торговля, финансы и бизнес-услуги) с числом работников более 10 человек. Сформированная база данных содержит как текущую (2009 г.), так и ретроспективную информацию о предприятиях. Она включает сведения по основным показателям и направлениям деятельности предприятий и учитывает их разнородность относительно финансово-хозяйственной деятельности, положению на рынке, кадровой политике, организации труда и управления, а также по размеру, форме собственности, возрасту и т.п.

Оценка детерминант использования предприятиями нестандартных трудовых договоров осуществлялась с применением эконометрических моделей («Probit», «Tobit»), на основе которых вначале оценивалось уравнение выбора (бинарное), а затем – уравнение доли работающих по нестандартным видам трудовых договоров.

## **Нестандартные трудовые договора на российских предприятиях: результаты исследования**

Результаты проведенного анализа свидетельствуют, что масштабы агентской занятости в России являются незначительными, но вполне сопоставимыми с масштабами агентской занятости в других странах (Германия, Греция, Эстония, Литва, Польша) [СИЕТТ, 2010].

Так, в России 2,5% предприятий используют работников по договорам лизинга (аутстаффинга), а количество работников, на которых распространяются эти договора, составляет менее 1% (табл. 1). При этом, например, в Германии количество предприятий, применяющих агентскую занятость, является близким к российскому уровню и составляет 2,8% [Bellmann, Kühl, 2007], а в Греции, Эстонии, Литве и Польше доля агентских работников так же, как и в России, не превышает 1% от общего числа занятых.

Основной характеристикой агентской занятости в России, как и во многих других странах, является ее неравномерное распределение по предприя-

ям и отраслям экономики. Общая картина распространения агентской занятости на российском рынке труда во многом совпадает с отраслевым распределением этого вида занятости в других странах. Так, наибольшее количество предприятий, использующих агентскую занятость в России, как и во многих европейских странах (например, Германии, Франции, Голландии и др.), наблюдается в промышленности и сфере бизнес-услуг (табл. 1). Однако есть и российские особенности. Наряду с названными отраслями лидерами по применению лизинга (аутстаффинга) в России являются еще и предприятия строительства и финансов.

**Таблица 1.** Доля предприятий с нестандартными трудовыми договорами, %

Отрасли	Договора лизинга (аутстаффинга)		Срочные договора	
	2008 г.	2009 г.	2008 г.	2009 г.
Добывающая промышленность	1,1	1,1	13,7	13,7
Промышленность	3,4	2,6	22,7	23,9
Строительство	3,1	3,8	29,6	31,8
Торговля	1,3	1,9	12,5	13,1
Транспорт и связь	0,9	0,9	10,6	9,8
Финансы	4,6	3,7	24,0	19,2
Услуги	2,0	2,0	14,9	16,1
Всего	2,5	2,4	19,1	19,4

Неравномерно распределена агентская занятость и по численности работников (табл. 2). На небольшом количестве российских предприятий (2,5%), применяющих агентскую занятость, средняя доля агентских работников в среднесписочной численности персонала составляет 26%. Иными словами, на таких предприятиях практически каждый четвертый работник занят на условиях аутстаффинга. При этом наибольшая концентрация агентских работников наблюдается в сфере бизнес-услуг (68%), а также в промышленности (35%) и финансах (23%). Меньше агентских работников на предприятиях строительства (12%), торговли (11%), в сфере добычи полезных ископаемых (7%) и на транспорте (1%).

Гораздо чаще используются предприятиями срочные договора, чем договора аутстаффинга. В среднем срочные договора применяются 19% предпри-

ятий и охватывают 2,4% от общего числа всех работников. Российский уровень использования срочных договоров оказался выше, чем в некоторых развитых странах<sup>3</sup>. При этом в отличие от договоров лизинга (аутстаффинга), срочные договора более равномерно распределены по отраслям и предприятиям российской экономики.

**Таблица 2.** Доля работников с нестандартными трудовыми договорами на предприятиях, которые используют нестандартные трудовые договора

Отрасли	Договора лизинга (аутстаффинга)		Срочные договора	
	2008 г.	2009 г.	2008 г.	2009 г.
Добывающая промышленность	0,05	0,10	0,15	0,26
Промышленность	0,38	0,23	0,15	0,13
Строительство	0,10	0,17	0,38	0,33
Торговля	0,10	0,09	0,28	0,25
Транспорт и связь	0,01	0,01	0,31	0,32
Финансы	0,21	0,24	0,21	0,25
Услуги	0,60	0,48	0,41	0,35
Всего	0,27	0,22	0,27	0,26

Доля работников со срочными договорами на предприятиях, которые используют такие договора, в среднем составляет 27%. Как и в случае с договорами аутстаффинга, практически каждый четвертый работник занят по срочному договору на тех предприятиях, где они применяются. При этом все-таки наибольшее количество работников, которые имеют срочные договора, сосредоточено в сфере бизнес-услуг (38%), в строительстве (36%), а также в отрасли транспорта и связи (32%) и в торговле (27%).

Несмотря на отличия, между двумя видами трудовых договоров есть и сходство. Оно заключается в том, что срочные договора и договора лизинга (аутстаффинга) чаще встречаются на предприятиях одних и тех же отраслей экономики. Наибольшее количество предприятий, заключающих с работниками оба вида нестандартных трудовых договоров, сосредоточено в промышленности (23,3%), финансах (21,6%), строительстве (30,7%) и сфере бизнес-услуг

<sup>3</sup> Например, в Германии срочные договора применялись в 2009 г. на 15% предприятий.

(15,5%). Если сложить обе эти группы, то окажется, что на тех предприятиях, которые применяют нестандартную занятость, каждый второй работник имеет нестандартный трудовой договор.

Причины использования предприятиями нестандартных трудовых договоров разнообразны – это и экономия издержек, и замена временно отсутствующих работников, и подстройка к колебаниям спроса, и т.п. В результате оценки детерминант путем проведения регрессионного анализа было установлено, что предприятия обращаются к заключению срочных договоров с работниками при ухудшении своего финансового положения. Поскольку издержки увольнения при срочных договорах равны практически нулю, то предприятия формируют за счет этих договоров «буфер», повышающий гибкость в условиях неопределенности и позволяющий защитить работников первичного сегмента от увольнений в периоды спада экономики. Так, в условиях кризиса 2008–2009 гг. срочные договора использовались предприятиями как способ подстройки к падению спроса на продукцию (услуги).

Вместе с тем вероятность использования предприятиями срочных договоров увеличивается одновременно с ростом количества увольнений работников. Наша выборка не позволяет оценить, от каких работников предприятия «освобождались» в первую очередь, но можно предположить, что это были работники, в которых предприятие менее всего нуждалось, так как на этих предприятиях сохранялись вакансии.

Таким образом, при ухудшении финансового положения предприятия осуществляли подстройку к падению спроса по двум направлениям, используя одновременно две стратегии, одних работников они увольняли, а с другими заключали срочные договора. Но чем больше было количество увольнений, тем выше становилась и вероятность применения предприятиями срочных договоров.

Не только необходимость адаптироваться к колебаниям спроса, но и другие причины подталкивают предприятия к применению срочных трудовых договоров. В частности, срочные договора часто применяются предприятиями, которые финансируют различного рода инновации (совершенствование и внедрение новых продукции (услуг), производственных технологий и процессов и т.п.) и осуществляют обучение работников. Причем увеличение размеров финансирования инноваций и рост масштабов обучения работников повышает на этих предприятиях долю работников со срочными договорами. Внедрение инноваций часто происходит параллельно с реструктуризацией и реорганизацией предприятий и направлено на оптимизацию численности персонала. В результате меняется организационная структура предприятий, и часть работников перево-

дится на новые условия занятости, в частности на срочные трудовые договора. Внедрение инноваций требует более высокой квалификации работников, поэтому на таких предприятиях чаще обучают работников. При этом срочные договора заключаются с теми работниками, которые в ближайшее время должны быть уволены (например, предпенсионного и пенсионного возраста), освободив рабочее место для обученных работников. Данное предположение подтверждается также тем, что на предприятиях со срочными договорами высок удельный вес работников со стажем более 10 лет. На этих предприятиях более востребованы специфические инвестиции, и срочные договора с большей вероятностью заключаются с работниками, имеющими более продолжительный стаж работы.

Причины, по которым предприятия используют договора лизинга (аутстаффинга), отличаются от причин использования ими срочных трудовых договоров. С одной стороны, вероятность использования предприятиями договоров аутстаффинга повышается, если на них уже применяются срочные договора. Причем доля работников с договорами аутстаффинга на предприятиях тоже возрастает. С другой стороны, если предприятие использует такие договора, то это не влияет на вероятность заключения срочных договоров. Мы наблюдаем, таким образом, одностороннюю «комплементарность» между двумя видами договоров<sup>4</sup>.

Известно, что срочные трудовые договора не позволяют предприятиям осуществлять массовый перевод работников из категории «внутренних» в категорию «внешних», т.е. выводить за штат. Это реализуется за счет аутстаффинга, что дает предприятию возможность экономить издержки и делает использование аутстаффинга более выгодным по сравнению со срочными договорами.

Для предприятий, на которых применяют оба вида нестандартных трудовых договоров, характерно наличие незаполненных вакансий. С увеличением незаполненных вакансий повышается не только вероятность использования предприятиями нестандартных договоров, но и увеличивается степень охвата ими работников. Почему предприятия не заполняют имеющиеся вакансии штатными (постоянными) работниками? Одной из причин являются высокие издержки увольнения при найме работников на постоянной основе. Поскольку при срочных договорах и договорах лизинга (аутстаффинга) издержки увольнения равны нулю, то предприятия имеют возможность обеспечить подстройку к колебаниям спроса с меньшими издержками.

---

<sup>4</sup> Предположения о том, что применение договоров лизинга (аутстаффинга) будет повышать вероятность применения срочных договоров, не подтвердились.



Вероятность применения предприятиями договоров аутстаффинга зависит от востребованности специфических инвестиций. Известно, что по этим договорам предприятия нанимают работников тех профессий и на такие рабочие места, которые не требуют специфических инвестиций [Смирных, 2009, с. 125]. В результате на предприятиях с договорами лизинга (аутстаффинга) ниже доля работников со стажем более десяти лет, чем на предприятиях со срочными договорами.

Особенностью договоров лизинга (аутстаффинга) является то, что они применяются на предприятиях, на которых есть профсоюзы. Чаще всего профсоюзы негативно относятся к данным договорам. Однако, защищая занятость «внутренних» работников, они идут на соглашение с работодателем и поддерживают привлечение «внешних» работников. Таким образом, профсоюзы соглашаются на использование предприятием договоров аутстаффинга взамен на сохранение занятости работников-инсайдеров, способствуя тем самым сегментации рынка труда.

Интерес предприятий к использованию агентской занятости тесно связан с особенностями российской модели рынка труда. Известно, что основными факторами адаптации к негативным экономическим колебаниям на российском рынке являются гибкое рабочее время и гибкая заработная плата [Капелюшников, 2009]. Нестандартные трудовые договора находятся в этом списке скорее на одном из последних мест. Однако отношение к ним со стороны предприятий зависит от возможностей использования альтернативных способов адаптации (рабочего времени и заработной платы). Эти возможности могут быть косвенным образом оценены через отношение предприятий к нормам трудового законодательства.

Если предприятия оценивают жесткость законодательства в области регулирования режимов рабочего времени как высокую, то это снижает вероятность применения ими договоров лизинга (аутстаффинга). Вероятно, на этих предприятиях действуют ограничения по использованию гибких режимов рабочего времени, и одновременно на них высок спрос на либеральные нормы трудового законодательства в области регулирования режимов рабочего времени. Однако этот спрос не может быть удовлетворен договорами аутстаффинга, которые не могут заместить потребности в гибком режиме рабочего времени и неполной занятости работников.

Вместе с тем, если предприятия считают действующее трудовое законодательство в области регулирования режимов рабочего времени минимально жестким, т.е. достаточно либеральным и вполне «доступным» для использова-

ния, то они с большей вероятностью применяют договора лизинга (аутстаффинга). Эти предприятия вероятно уже исчерпали возможности гибких режимов рабочего времени в рамках действующего трудового законодательства и при адаптации к колебаниям спроса стремятся задействовать для этого другие способы, в частности экономию издержек за счет применения договоров аутстаффинга.

## **Заключение**

Рост количества предприятий и численности работников, занятых на условиях нестандартных трудовых договоров, характерен для большинства стран мира и свидетельствует об общем стремлении к повышению гибкости рынка труда. Несмотря на ограничения российского трудового законодательства относительно применения срочных трудовых договоров и «непризнание» договоров лизинга (аутстаффинга), масштабы использования российскими предприятиями нестандартных видов трудовых договоров являются сопоставимыми с другими странами.

Основной причиной, подталкивающей предприятия к применению нестандартных видов трудовых договоров, являются высокие издержки увольнения при использовании стандартных договоров. В силу разной доходности отраслей и рентабельности предприятий нестандартные трудовые договора неравномерно распределены по отраслям и предприятиям. Наиболее часто они применяются на предприятиях в промышленности, строительстве, финансах и бизнес-услугах.

Чем чаще предприятия используют срочные договора, тем с большей вероятностью переходят они на договора лизинга (аутстаффинга). Вместе с тем одновременный интерес предприятий к двум видам договоров существует не всегда. Он чаще наблюдается в строительстве, где занято больше «внешних» работников, но, например, практически отсутствует на транспорте и связи.

Несмотря на сохранение основных черт российской модели рынка труда с относительно гибким рабочим временем и гибкой заработной платой, предприятия все чаще используют нестандартные трудовые договора для обеспечения гибкости с целью подстройки к внешним колебаниям спроса.

В результате происходят изменения в структуре кадрового состава предприятий. С одной стороны, для ряда рабочих мест и профессий занятость на постоянной основе заменяется нестандартными видами трудовых договоров, и наблюдается сокращение количества постоянных рабочих мест и найма на по-

стоянной основе. С другой стороны, стабильная занятость работников с бессрочными контрактами «сохраняется» за счет увеличения числа работников с нестандартными видами трудовых договоров. На ряде предприятий, на которых применяются оба вида нестандартных договоров, численность работников, занятых на них, может составлять более 50%.

Эти обозначившиеся на российском рынке тенденции вызывают негативное отношение к нестандартным видам трудовых договоров в обществе. Предложения о запрете договоров лизинга (аутстаффинга) являются тому ярким примером. Однако не стоит игнорировать и тот факт, что данные договора применяются предприятиями уже в достаточно широких масштабах. В этой связи представляется наиболее правильным направить усилия не на запрет нестандартных договоров, а на обсуждение условий их применения, учитывая, в том числе, интересы работников, как это принято во многих развитых странах. Для этого, наряду с обобщением опыта применения нестандартных договоров за рубежом, следует заняться более детальным анализом ситуации, которая сложилась в России.

Необходимо осуществлять сбор данных, отражающих использование российскими предприятиями нестандартных трудовых договоров. Такого рода обследования следовало бы проводить не эпизодически или разово, а сделать их регулярными. Также для принятия решений об условиях применения нестандартных договоров необходима информация о положении работников, занятых на нестандартных условиях, какие виды работ они выполняют, как это отражается на их производительности и мотивации труда. Представляется, что игнорирование названных обстоятельств не позволит разработать меры по регулированию нестандартной занятости, адекватные ситуации, сложившейся на российском рынке труда.

## Литература

*Капелюшников Р.И.* Конец российской модели рынка труда. М.: Фонд «Либеральная миссия», 2009.

*Смирных Л.И.* Агентства занятости на российском рынке труда // Справочник кадровика. 2009. № 8. С. 122–127.

*Bellmann L., Kühl A.* Weitere Expansion der Leiharbeit? Eine Bestandsaufnahme auf Basis des IAB-Betriebspanels, Studie an die Hans-Böckler-Stiftung. Berlin, 2007.

CIEET (International Confederation of Private Employment Agencies). The Agency Work Industry Around the World. Brussels, 2010.

## Введение

За 40 лет активного изучения «неформальной» экономики исследователи не пришли к консенсусу ни в определениях, ни в характеристиках ее природы. В настоящий момент в разных странах наблюдается увеличение интереса к изучению неформального сектора (НФС).

В России масштаб неформальности на рынке труда значителен и продолжает расти. Неформально или полуформально (в зависимости от определения) на российском рынке труда в настоящий момент работают от 13 до 35%. При этом мы очень мало знаем о социально-демографической, профессиональной и отраслевой структуре неформальной занятости<sup>1</sup>, и тем более отсутствуют ответы на более сложные вопросы, связанные с природой неформального сектора и его социальными последствиями.

## Эмпирическая методология

Основная задача данной статьи состоит в описании структуры и динамики занятости в неформальном секторе на российском рынке труда. Для этого мы должны:

- оценить масштаб и динамику НФС на рынке труда;
- описать составляющие занятости в НФС;
- выявить ее социально-демографические черты и ареалы распространения (характеристики рабочих мест);
- выявить факторы, влияющие на вероятность «неформальности».

---

<sup>1</sup> Понятия занятости в неформальном секторе и неформальной занятости в общем случае не являются синонимами. Более точное различие между ними приводится ниже.

Эмпирическую базу исследования составляют данные Обследования населения по проблемам занятости (ОНПЗ), проводимого Росстатом, за 1999–2009 гг. ОНПЗ представляет собой ежеквартальное<sup>2</sup> выборочное обследование домохозяйств, проводимое во всех субъектах Российской Федерации в соответствии с методологией МОТ. Выборка обследования составляла около 270 тыс. человек при ежеквартальном сборе данных, а переход к ежемесячному обследованию в середине 2009 г. увеличил объем годовой выборки до 800 тыс. человек. Выбор периода (1999–2009 гг.) связан с тем, что в эти годы изменения в методологии ОНПЗ, включая построение выборки и периодичность обследования, были минимальными. Он также охватывает как этап роста экономики, так и кризис 2008–2009 гг., позволяя наблюдать реакцию на шоки разной направленности.

Опора на ОНПЗ предполагает использование принятого Росстатом производственного определения, связывающего неформальность с характеристиками рабочих мест. Основным критерием выделения единиц неформального сектора здесь является отсутствие государственной регистрации в качестве юридического лица<sup>3</sup>. В рамках ОНПЗ к *занятым в неформальном секторе* относятся следующие группы работников:

- занятые по найму у физических лиц;
- предприниматели без образования юридического лица;
- занятые на индивидуальной основе (самозанятые);
- занятые в домашнем хозяйстве по производству продукции для реализации;
- занятые в фермерском хозяйстве в случаях либо если регистрация или оформление документов отсутствуют, либо с регистрацией в качестве индивидуального предпринимателя.

## Краткая история вопроса

Изначально теории неформального сектора возникли как частный случай теории сегментированных рынков, одним из ключевых постулатов которых является тезис о наличии постоянно воспроизводящихся барьеров между отдель-

---

<sup>2</sup> С сентября 2009 г. – ежемесячное.

<sup>3</sup> В приведенной методологии под занятостью в неформальном секторе понимается занятость на предприятиях неформального сектора. Таким образом, из рассмотрения исключается неформальная занятость на предприятиях формального сектора, т.е. без оформления договора или контракта.

ными секторами рынка труда, мобильность между которыми затруднена. Британский социолог и антрополог К. Харт [Hart, 1970; 1973], впервые употребивший термин «неформальный сектор» применительно к городским трущобам африканских городов, понимал под ним примитивную и разнообразную самозанятость. Представители исследованных им рынков труда являлись городскими бедными, необразованными мигрантами из сел, находящими в низкопроизводительной, малооплачиваемой самозанятости единственный источник своих средств к существованию, так как формальный рынок труда оказывался не в состоянии генерировать новые рабочие места, а системы помощи безработным в этих странах не существовало. Данная концепция получила свое теоретическое осмысление в модели дуального рынка труда Харриса и Тодаро 1970 г., анализировавшей массовую трудовую миграцию из сел в города [Harris, Todaro, 1970].

Дальнейшее развитие теоретических подходов к анализу неформального сектора шло по пути признания неоднородности самого неформального сектора и необходимости отдельного анализа двух категорий внутри него – наемных работников и самозанятых. Впервые на это обратил внимание еще Г. Филдс [Fields, 1990], а дальнейшей ревизии теоретическое осмысление неформального сектора подверг У. Мэлони. Опираясь на целый ряд эмпирических исследований, проведенных в Латинской Америке, он утверждал, что неформальные рабочие места не обязательно являются худшими по качеству и работники занимают их вполне добровольно в соответствии со своими предпочтениями. Так, Мэлони показывает, что межсекторная разница в заработной плате является несущественной, а жесткие перегородки между секторами отсутствуют [Maloney, 2004].

## **Подходы к определению неформального сектора**

В соответствии с традиционным и ревизионистскими подходами были предложены два определения неформального статуса на рынке труда.

*Производственное* определение было разработано международными экономическими организациями на основе подхода К. Харта. Ключевое значение для причисления к неформальному сектору с данных позиций имеют характеристики предприятий: небольшой размер, низкие уровни организации и капиталоемкости, отсутствие статуса юридического лица [Hussmans, 2004]. Этот подход используется Росстатом при проведении ОНПЗ.

*Легалистский (legalistic)* подход определяет неформальный сектор с точки зрения того, в какой мере фирмы или индивиды следуют формальным пра-

вилам и законодательным нормам [Saavedra, Chong, 1999; Kanbur, 2009], а особое внимание уделяется возможностям доступа к системе социального обеспечения [Khamis, 2009].

Описанные различия между определениями, на наш взгляд, соответствуют различиям между понятиями «занятости в неформальном секторе» и «неформальной занятости». Последнее шире и включает также незарегистрированную занятость в формальном секторе – такой подход к определению занятости в неформальной экономике был рекомендован XVII Международной конференцией статистиков труда (2003), тем самым знаменуя шаг в сторону легилистского подхода. Однако в рамках ОНПЗ она практически не выявляется<sup>4</sup>.

## Общая динамика неформальной занятости в России: 1999–2009 гг.

Рисунок 1 показывает изменения в величине и структуре занятости в неформальном секторе<sup>5</sup>. В 1999 г. численность занятых в неформальном секторе на основной работе, усредненная по итогам четырех кварталов, составляла около 8 млн человек.

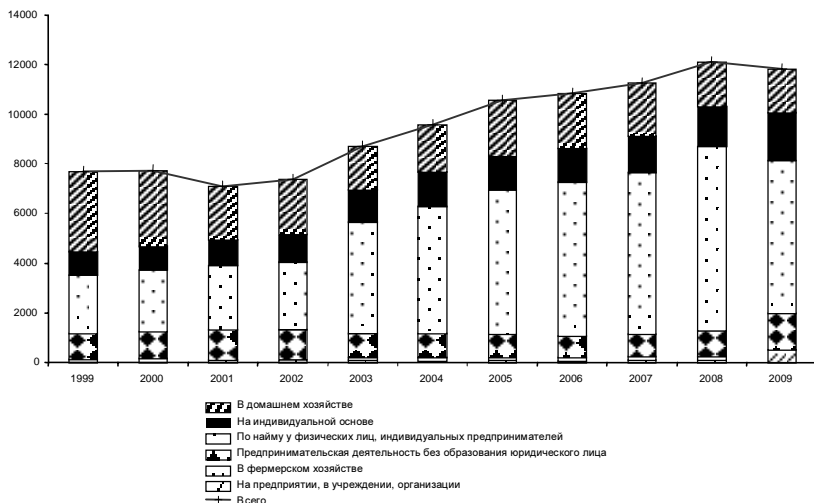
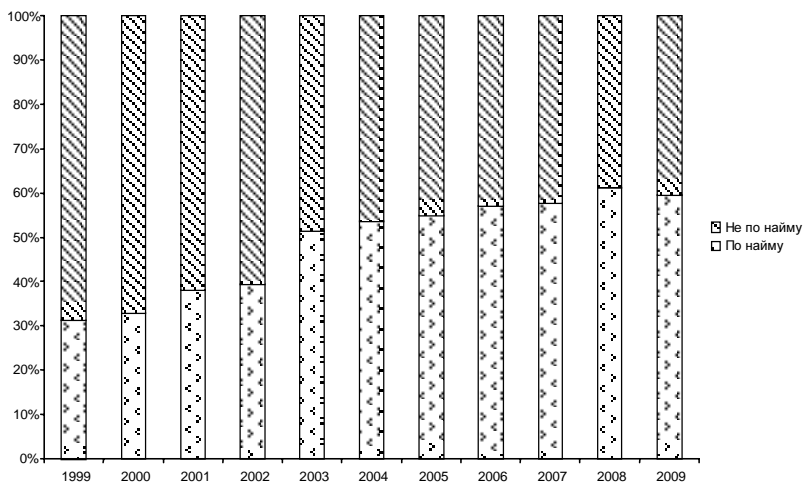


Рис. 1. Динамика занятости в НФС по составляющим, 1999–2009 гг., тыс. человек

<sup>4</sup> По имеющимся данным, доля составляет около 2% от всех неформально занятых, оценки могут быть сильно занижены из-за трудностей измерения.

<sup>5</sup> Здесь и далее рассматривается показатель занятости в НФС на *основной работе*.

На протяжении последующего десятилетия она демонстрировала тенденцию к росту и в 2009 г. составляла уже около 12 млн человек. Данный рост был обеспечен преимущественно увеличением численности занятых по найму у физических лиц и у индивидуальных предпринимателей. Если в 1999 г. занятость в НФС насчитывала менее 2,5 млн человек, то в 2008 г. – около 7,5 млн человек.



**Рис. 2.** Структура занятости в НФС, 1999–2009 гг., %

В структуре занятых в неформальном секторе соответствующая доля за рассматриваемый период увеличилась с 30 до 60% (см. рис. 2). В этом может проявляться одно из отличий переходных экономик от экономик развивающихся стран, где неформальный сектор является протопредпринимательским и где ключевыми фигурами являются самозанятые.

На рис. 3 представлена динамика квартальных показателей безработицы и занятости в неформальном секторе<sup>6</sup>. Оба показателя отличаются сильной сезонностью и контрциклическостью по отношению друг к другу. Снижение безработицы летом в среднем на 1–1,5 п.п. сопровождается ростом неформальной занятости на 3–4 п.п., и наоборот. Занятость в сельскохозяйственном секторе весной притягивает к себе не только безработных, но и экономически неактивных граждан, а также, возможно, и занятых в формальном секторе.

<sup>6</sup> Рассчитаны по отношению к экономически активному населению.



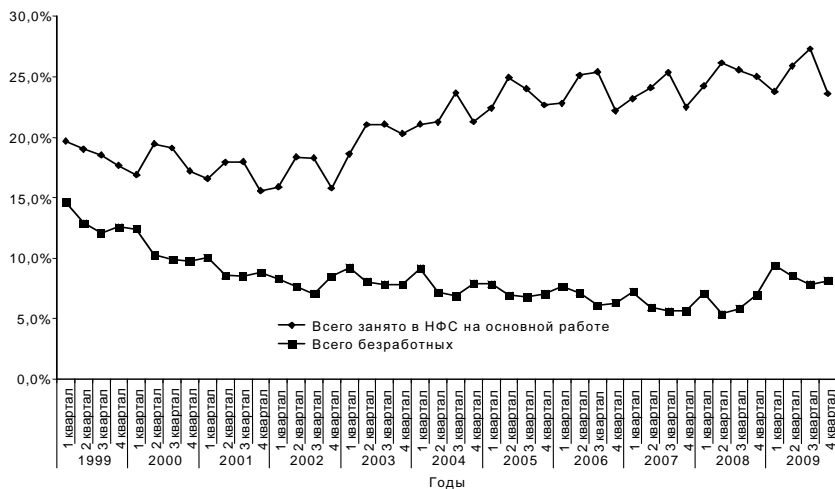


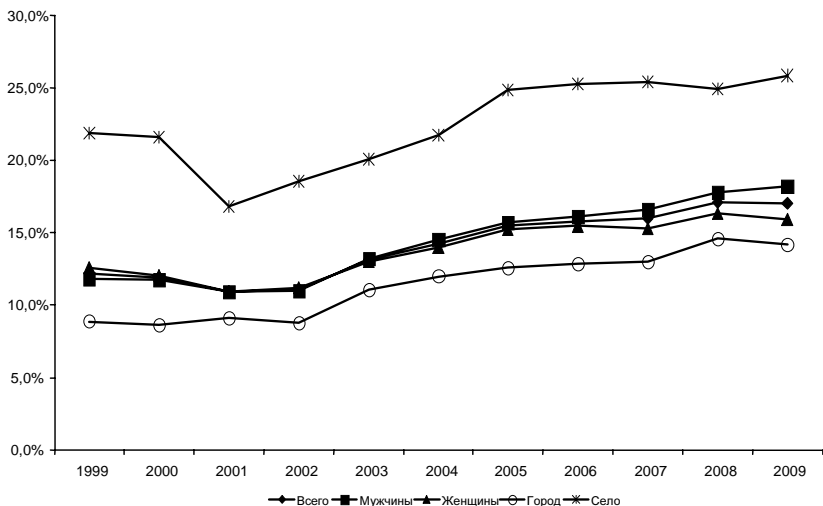
Рис. 3. Занятость в НФС и безработица, 1999–2009 гг., в % к экономически активному населению

## Социально-демографические и профессиональные особенности неформального сектора в России

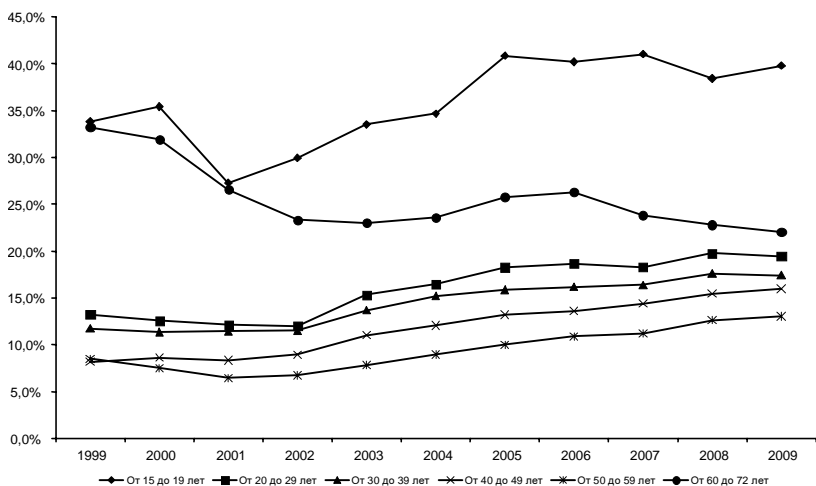
Вероятность неформальности для разных социально-демографических групп различается, но везде она росла примерно с одинаковым темпом (см. рис. 4). Среди мужчин и женщин она примерно одинакова, но в последние годы мужчины несколько вышли «вперед» по этому показателю.

Доля неформалов среди сельского населения была гораздо выше, чем среди городского, что во многом определяется характером сельской экономики<sup>7</sup>. Максимальная вовлеченность в неформальный сектор характерна для самых младших и самых старших возрастных групп (рис. 5). Однако если старшие сокращали такую занятость (уровень занятости среди лиц в возрасте старше 60 лет снизился с 33 до 22%), то младшие, наоборот, увеличивали.

<sup>7</sup> Падение уровня занятости в НФС среди сельского населения является статистическим артефактом, связанным с изменением методологии расчета показателя занятости в домашнем хозяйстве.



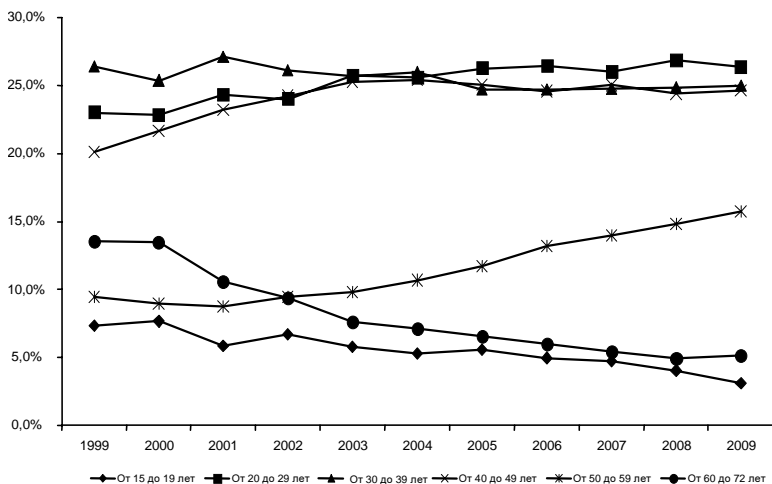
**Рис. 4.** Динамика уровня занятости в НФС, 1999–2009 гг., % по полу и типу поселения



**Рис. 5.** Динамика уровня занятости в НФС, 1999–2009 гг., % от всех занятых по возрастным группам

Изменение повозрастных рисков еще не означает изменения возрастной структуры неформальной занятости в целом, поскольку общие уровни занятости для разных возрастов различны и к тому же менялись во времени (см.

рис. 6). Так, в самой младшей возрастной группе (15–19 лет) уровень занятости в целом был невелик, а потому абсолютный масштаб занятости в неформальном секторе также может казаться небольшим. В целом же больше половины всех неформальных работников находятся в возрасте до 40 лет.



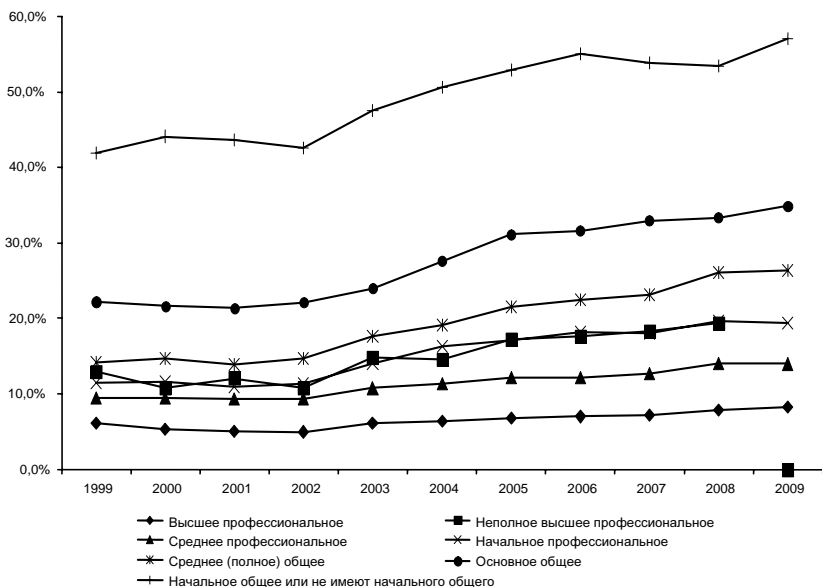
**Рис. 6.** Динамика структуры занятости в НФС, 1999–2009 гг., %, по возрастным группам

Рост уровня образования гасит риск неформальности (рис. 7). Отсутствие профессионального образования существенно повышает как вероятность попадания в НФС, так и темп ее роста.

Наличие высшего или среднего профессионального образования снижает этот риск и скорость его увеличения. В 2009 г. 8% всех занятых, имеющих высшее образование, и 14% со средним специальным были заняты в неформальном секторе. Что же касается начального профессионального образования, то каждый пятый его обладатель трудился неформально. Этот показатель почти удвоился менее чем за 10 лет.

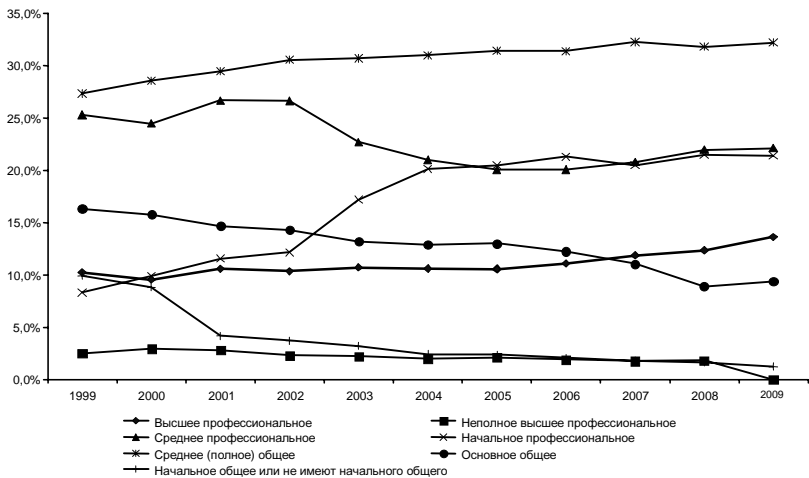
Анализ образовательной структуры занятых в неформальном секторе свидетельствует о том, что в нем наиболее широко представлены работники со средним общим образованием, доля которых составляет примерно треть (рис. 8). Второе место с очень близкими долями (около 21–22% в 2009 г.) занимают обладатели начального и среднего профессионального образования. Однако если доля выпускников СПО несколько снизилась, то удельный вес обладателей НПО вырос с 8,3% в 1999 г. до 21,4% в 2009 г. По-видимому, это стало

результатом двух автономных процессов: во-первых, массового возврата на рынок труда в нулевые годы лиц старших возрастов с невысоким уровнем образования и, во-вторых, отсутствия достаточного числа вакансий и низких темпов создания рабочих мест в формальном секторе экономики [Гимпельсон, 2010].

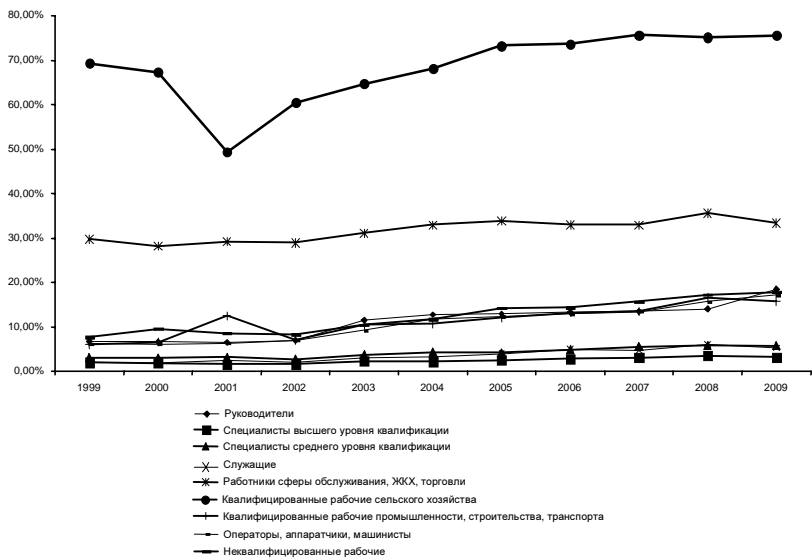


**Рис. 7.** Динамика уровней занятости в НФС, 1999–2009 гг., % от всех занятых по уровню образования

Максимальная вероятность неформальности у работников сельского хозяйства, среди которых каждые трое из четырех представителей могут быть классифицированы как неформалы (см. рис. 9). На втором месте идут профессии группы 5 по ОКЗ (работники сферы обслуживания, торговли и т.п.), среди которых примерно каждый третий – неформал. В группах 1 (руководители) и 7–9 (квалифицированные рабочие; операторы; неквалифицированные рабочие) доля неформально занятых в 2009 г. составляла примерно 16–18% и удвоилась за последнее десятилетие.



**Рис. 8.** Динамика структуры занятости в НФС, 1999–2009 гг., %, по уровням образования



**Рис. 9.** Динамика уровней занятости в НФС, 1999–2009 гг., % от всех занятых по профессиям

## Факторы выбора типа занятости в неформальном секторе

Описав возможные бинарные связи между неформальностью и индивидуальными характеристиками работника, мы переходим к анализу влияния различных факторов на риск неформальности (самозанятости и найма). Для этого мы оцениваем мультиномиальные логит-регрессии, а вместо коэффициентов рассчитываем предельные эффекты. Зависимой переменной является статус работников с точки зрения того, является ли он «неформалом» и если да, то каким, а базовой категорией является занятость в формальном секторе. Набор объяснительных характеристик включает: пол, возраст, образование, состояние в браке, тип поселения (город/село), вид деятельности, профессию и регион. Мы оцениваем регрессию для трех лет – 2000, 2004 и 2008 гг. (табл. 1), которые соответствуют началу, середине и концу межкризисного (1999–2008 гг.) периода.

Остановимся на некоторых результатах. Возраст является важной детерминантой неформальности, но его эффект заметен лишь в отношении наемных работников, а на самозанятость он практически не влияет<sup>8</sup>. Риск занятости по найму в неформальном секторе сильно скошен в пользу молодых возрастов – несмотря на то, что экспансия неформальности затрагивает все возрастные группы, младшие реагируют первыми.

Эффект образования сильнее проявляется по отношению к неформалам, занятым по найму. В 2000 г. наличие лишь основного общего образования повышало риск такой занятости (по сравнению с наличием высшего образования) на 1,3%, а в 2008 г. уже на 6,2%. Зависимость между возрастом и неформальной самозанятостью носит менее выраженный характер. Если в 2000 г. любое невысшее образование значимо понижало вероятность предпринимательской самозанятости, то в 2004 и в 2008 гг. разрыв между высшим и невысшим образованием практически исчез.

Неформально занятые по найму изначально концентрировались в группе работников сферы обслуживания, ЖКХ и торговли, где эффект профессии составил 11%, хотя и в других профессиях физического труда вероятность такой неформальности была на 3–4% выше базового уровня<sup>9</sup>. Относительные риски для всех групп со временем возрастают, прежде всего для профессий физического труда, но также и для групп ОКЗ 2–4.

---

<sup>8</sup> Это может объясняться неоднородностью данной деятельности, в результате чего ее разные компоненты распределяются по всем возрастным группам.

<sup>9</sup> Базовый уровень определялся риском для группы руководителей.

**Таблица 1.**

**Оценки мультиномиальных логит-регрессионных моделей, предельные эффекты (пп)**

	2000 г.				2004 г.				2008 г.			
	занятые по найму у физических лиц		самозанятые		занятые по найму у физических лиц		самозанятые		занятые по найму у физических лиц		самозанятые	
	$\beta$	SE	$\beta$	SE	$\beta$	SE	$\beta$	SE	$\beta$	SE	$\beta$	SE
<i>Пол (1 – женщины)</i>	-0,64***	0,16	-2,60***	0,15	-0,70***	0,21	-2,03***	0,18	-0,49**	0,24	-2,14***	0,18
<i>Возраст</i>												
от 15 до 19 лет	5,63***	1,16	0,34	0,44	7,42***	1,25	-0,29	0,66	6,52***	1,23	-0,88	0,63
от 20 до 29 лет	3,78***	0,77	0,61	0,50	3,54***	0,82	-0,75*	0,43	5,24***	0,83	-1,17***	0,37
от 30 до 39 лет	2,40**	0,55	2,20***	0,58	3,05***	0,80	0,85	0,55	4,10***	0,80	0,52	0,47
от 40 до 49 лет	1,78***	0,43	1,17**	0,45	1,33*	0,71	0,60	0,52	1,73**	0,73	0,89*	0,48
от 50 до 59 лет	0,51*	0,29	0,20	0,31	-0,69	0,63	-0,35	0,46	-0,31	0,67	0,06	0,44
от 60 до 72 лет												
<i>Семейное положение (1 – состоит в браке)</i>												
	0,22***	0,04	-0,10***	0,04	-1,72***	0,18	0,35**	0,16	-2,07***	0,21	0,49***	0,17
<i>Образование</i>												
высшее профессиональное												
неполное высшее профессиональное	0,48*	0,25	-0,63*	0,35	1,30	0,79	1,17*	0,62	2,26**	0,98	0,10	0,63
среднее профессиональное	0,47**	0,22	-1,34***	0,21	0,29	0,39	-0,36	0,22	0,95**	0,44	0,13	0,24
начальное профессиональное	0,45*	0,23	-1,88***	0,25	1,85***	0,45	-0,93***	0,23	2,42***	0,48	-0,74***	0,24
среднее (полное) общее	0,81***	0,26	-1,32***	0,24	1,61***	0,43	-0,14	0,24	3,39***	0,49	0,51*	0,27
основное общее	1,33***	0,28	-1,37***	0,27	3,30***	0,58	-0,55*	0,30	6,23***	0,72	-0,86**	0,34
начальное общее или ниже	1,15***	0,38	-1,11**	0,51	5,57***	1,48	0,61	0,90	12,18***	1,84	0,87	1,05
<i>Тип поселения (1-село)</i>	-0,85***	0,17	-0,45***	0,17	0,08	0,21	0,18	0,17	0,83***	0,23	-0,20	0,16
<i>Вид деятельности</i>												
A. Сельское хозяйство												
B. Рыболовство и рыбоводство	0,67	0,75	-2,28**	1,07	1,32	1,60	-1,61**	0,71	8,92***	2,16	-3,77***	0,38
C. Горнодобывающая промышленность	-1,45***	0,16	-7,17***	1,44	-4,88***	0,66	-3,87***	0,09	-8,46*	5,08	-4,39	66,24
D. Обрабатывающая промышленность	0,54**	0,25	-2,31***	0,25	3,45***	0,56	-1,61***	0,24	4,29***	0,61	-2,00***	0,23
E. Электроэнергия, газ и водоснабжение	-1,61***	0,09	-9,91***	1,89	-4,97***	0,53	-3,88***	0,08	-8,72***	0,43	-4,13***	0,11
F. Строительство	5,04***	0,72	-2,59**	0,48	13,54***	0,90	-0,70**	0,34	14,37***	0,84	-0,99***	0,30

Продолжение табл. 1.

	2000 г.				2004 г.				2008 г.			
	занятые по найму у физических лиц		самозанятые		занятые по найму у физических лиц		самозанятые		занятые по найму у физических лиц		самозанятые	
	$\beta$	SE	$\beta$	SE	$\beta$	SE	$\beta$	SE	$\beta$	SE	$\beta$	SE
Г. Оптовая и розничная торговля	15,83***	1,27	10,35***	0,75	19,82***	1,03	5,98***	0,61	19,65***	0,92	4,38***	0,52
Н. Гостиницы и рестораны	3,94***	0,87	-2,52***	0,76	9,45***	1,04	-1,73***	0,40	9,07***	1,02	-2,64***	0,32
И. Транспорт и связь	0,33	0,27	0,15	0,35	2,40***	0,60	1,30***	0,41	3,94***	0,66	1,18***	0,41
Ж. Финансовое посредничество	-0,62	0,54	-5,90***	1,73	-3,57***	1,30	-2,82***	0,53	-4,20***	1,20	-3,96***	0,25
К. Деятельность по операциям с недвижимым имуществом	3,70***	0,85	0,40	0,52	0,85	0,68	-1,53***	0,33	1,72**	0,74	-1,56***	0,32
Л. Государственное управление и оборона	-1,57***	0,07	-8,48***	0,92	-8,03	87,10	-4,18	96,83	-11,35	118,81	-4,64	112,66
М. Образование	-1,12***	0,09	-6,53***	0,83	-6,19***	0,30	-3,40***	0,15	-9,36***	0,26	-3,88***	0,13
Н. Здравоохранение и социальные услуги	-1,02***	0,13	-5,67***	0,77	-5,20***	0,40	-3,08***	0,21	-8,10***	0,37	-3,50***	0,18
О. Деятельность по предоставлению коммунальных, социальных и персональных услуг	3,05***	0,50	0,66 <sup>e</sup>	0,37	4,89***	0,89	1,31**	0,57	6,14***	0,89	2,03***	0,56
<i>Профессия</i>												
руководители												
специалисты высшего уровня	0,90***	0,23	-2,82***	0,23	1,28 <sup>e</sup>	0,75	-3,60***	0,09	3,56***	0,88	-3,97***	0,10
специалисты среднего уровня	1,30***	0,32	-2,71***	0,25	4,21***	0,82	-3,52***	0,10	7,46***	0,95	-4,29***	0,08
служащие, занятые подготовкой информации	1,30***	0,43	-7,17***	1,04	3,75***	1,13	-3,69***	0,10	5,41***	1,26	-4,13***	0,09
работники сферы обслуживания, ЖКХ, торговли	11,47***	2,32	-2,69***	1,05	13,55***	1,13	-1,52***	0,21	17,57***	1,14	-2,67***	0,17
квалифицированные рабочие сельского хозяйства	3,51***	0,98	-0,47	0,72	10,73***	1,44	-0,78**	0,35	17,19***	1,58	-0,79**	0,35
квалифицированные рабочие операторы, аппаратчики, машинисты	3,83***	0,89	-3,72***	0,27	7,65***	0,86	-3,30***	0,12	10,97***	0,95	-4,07***	0,11
неквалифицированные рабочие	2,76***	0,65	-5,08***	0,35	7,99***	0,89	-3,26***	0,10	11,67***	0,99	-3,95***	0,11
	4,27***	0,92	-6,16***	0,31	9,92***	0,95	-3,90***	0,12	13,14***	1,02	-4,42***	0,09



	2000 г.				2004 г.				2008 г.			
	занятые по найму у физических лиц		самозанятые		занятые по найму у физических лиц		самозанятые		занятые по найму у физических лиц		самозанятые	
	$\beta$	SE	$\beta$	SE	$\beta$	SE	$\beta$	SE	$\beta$	SE	$\beta$	SE
<i>Регионы</i>	контролируются											
Number of obs	78438		78438		78381		78381		81815		81815	
Prob > chi2	0		0		0		0		0		0	
Pseudo R <sup>2</sup>	0,2971		0,2971		0,2976		0,2976		0,2737		0,2737	
Log likelihood	-23689,67		-23689,67		-23607,70		-23607,70		-30069,79		-30069,79	

Неформальная самозанятость включает в себя индивидуальное предпринимательство, а потому в значительной степени ассоциируется с группой руководителей (ОКЗ-1), а также с околodomашним производством сельскохозяйственной продукции (ОКЗ-6).

## Заключение

Неформальный сектор в России имеет вполне определенные ареалы концентрации на рынке труда, которые отличаются малой производительностью и низкой квалифицированностью. Увеличение численности занятых по найму и быстрый рост неформальности в молодых возрастах также представляются негативными и тревожными тенденциями современной экономики. Экспансия неформальности, несмотря на экономический рост и регулярные заклинания властей по поводу «наведения порядка», является следствием многочисленных и глубоких институциональных дефектов в российской экономике. В результате формальный сектор не создает новые рабочие места и работники вытесняются в неформальный.

## Литература

*Гимпельсон В.Е.* Нужны ли отечественной промышленности квалифицированные работники? История последнего десятилетия // Экономическая социология. 2010. Т. 11. № 4.

*Fields G.S.* Labour Market Modeling and the Urban Informal Sector: Theory and Evidence // D. Turnham, B. Salomé, A. Schwarz (eds.) The Informal Sector Revisited. 1990.

*Harris J.R., Todaro M.P.* Migration, Unemployment and Development: A Two Sector Analysis // American Economic Review. 1970. March. P. 126–142.

*Hart K.* Small-scale Entrepreneurs in Ghana and Development Planning // Journal of Development Planning. 1970. № 6. P. 104–120.

*Hart K.* Informal Income Opportunities and Urban Employment in Ghana // The Journal of Modern African Studies. 1973. Vol. 11. № 1. P. 61–89.

*Husmanns R.* Defining and Measuring Informal Employment: International Labour Office Working Paper. Geneva, 2004.

*Kanbur R.* Conceptualising Informality: Regulation and Enforcement: IZA Discussion Paper № 4186. May 2009.

*Khamis M.* A Note on Informality in the Labor Market: IZA Discussion Paper № 4676. December 2009.

*Maloney W.F.* Informality Revisited // World Development. 2004. Vol. 32. № 7. P. 1159–1178.

*Saavedra J., Chong A.* Structural Reform, Institutions and Earnings: Evidence from the Formal and Informal Sectors in Urban Peru // Journal of Development Studies. 1999. 35(4). P. 95–116.

**КАЧЕСТВО  
ГОСУДАРСТВЕННОГО  
УПРАВЛЕНИЯ**

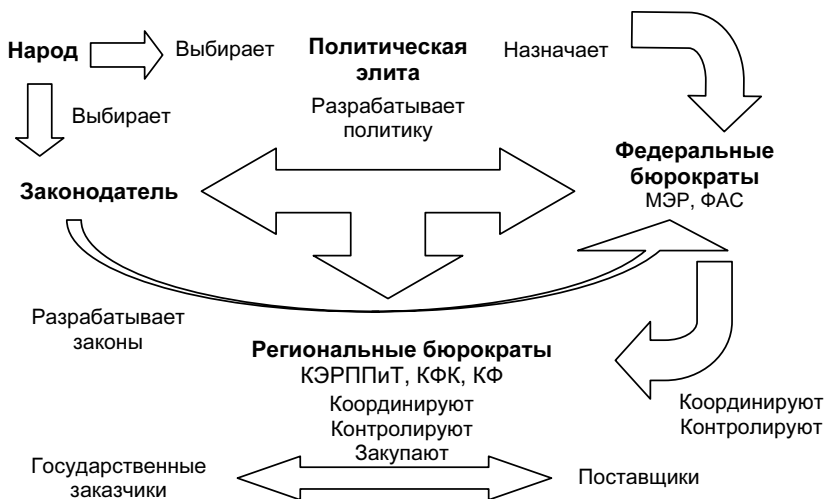
---



# ГОСУДАРСТВЕННЫЙ ЗАКАЗЧИК НА КОНКУРЕНТНОМ РЫНКЕ

## Принципал и агент в системе регулирования государственного заказа Российской Федерации

Рассмотрим упрощенную схему системы регулирования размещения государственного и муниципального заказа<sup>1</sup> в Российской Федерации (рис. 1).



**Рис. 1.** Принципал и агент в упрощенной модели системы регулирования государственных закупок Российской Федерации

На уровне политического руководства страны формулируется политика в области размещения государственного заказа, соответствующие исполнитель-

<sup>1</sup> Ниже для упрощения изложения используется термин «государственный заказ».

ные органы наделяются функциями по выработке государственной политики и нормативно-правовому регулированию в сфере государственных закупок (Минэкономразвития России) и контролю за процессом их проведения (Федеральная антимонопольная служба). Во исполнение сформулированной политики законодатель разрабатывает систему законодательных актов, краеугольным камнем которой в настоящее время является Федеральный закон «О размещении заказов на поставки товаров, выполнение работ, оказание услуг для государственных и муниципальных нужд» (ниже – Федеральный закон) № 94-ФЗ от 21 июля 2005 г.

Объединим под названием принципа политическую, законодательную и административную элиты страны, отвечающие за формирование институциональных условий проведения государственных закупок (включая Минэкономразвития и ФАС), а под названием агента – государственных заказчиков и изобразим упрощенную схему системы регулирования размещения государственного заказа в Российской Федерации.

Условимся (следуя [Jain, 2001]) понимать под коррупцией использование должностным лицом своих полномочий в целях извлечения личной выгоды путем нарушения установленных правил. С этой точки зрения очевидно, что для возникновения и существования коррупции необходимы три условия: наличие распорядительной власти, возможность извлечения из нее ренты и слабость институтов (политических, административных и юридических), стимулирующих участников к добросовестному поведению [Aidt, 2003, p. 633].

Анализ изменений в системе регулирования государственных закупок Российской Федерации, связанных с принятием Федерального закона и его реализацией, позволяет идентифицировать два направления применяемой принципом стратегии регулирования государственных закупок.

Первое направление связано с сокращением распорядительных полномочий государственного заказчика путем:

- введения исключительно низкого ценового порога, превышение которого обязывает агента к проведению торгов;
- ограничения (в оригинале – запрещения) применения квалификационных критериев;
- стремления к размещению заказа путем аукциона (в оригинале, в основном, очного) в любой экономической ситуации за счет минимизации сферы применения конкурса и полного запрещения использования иных процедур (закрытых торгов, переговорных процедур, запроса котировок, двухэтапного конкурса, биржевого размещения заказов);

- исключения антидемпинговых процедур.

Второе направление формируют мероприятия, связанные с укреплением институтов в сфере регулирования государственных закупок:

- объединение в Федеральном законе регламентации закупок для всех уровней власти;
- наделение ФАС контрольными полномочиями и правом оперативного вмешательства в процесс размещения государственного заказа;
- введение временного «эмбарго» на заключение контракта по результатам тендерной процедуры торгов.

Таким образом, стратегия регулирования государственных закупок Российской Федерации, реализуемая с момента принятия Федерального закона, может быть охарактеризована как антикоррупционная и направленная, в первую очередь, на сокращение распорядительной власти агента<sup>2</sup>.

## Об одном недостатке конкурсной процедуры

Прибегая к широкомасштабному внедрению аукционного способа размещения заказа в систему регулирования государственных закупок Российской Федерации, органы, отвечающие за формирование институциональных условий проведения государственных закупок (принципал), исходят из предположения об атрибутивном несовершенстве конкурсной процедуры, в условиях которой недобросовестный заказчик располагает возможностью манипулирования ее результатами.

Рассмотрим общепринятый механизм организации конкурсной процедуры размещения заказа. В процессе разработки конкурсной документации государственный заказчик должен формализовать предмет и условия поставки в виде совокупности конечного числа характеристик, значения которых могут изменяться в пределах соответствующих множеств<sup>3</sup>:

$$x = (x_1, x_2, \dots, x_n), \quad x_i \in D_i, \quad i = 1, 2, \dots, n \quad (x \in D \subseteq D_1 \cdot D_2 \cdot \dots \cdot D_n),$$

---

<sup>2</sup> Оставляя обсуждение эффективности мер, направленных на сокращение распорядительной власти агента, за рамками настоящей статьи, укажем, что все они находятся в противоречии с положениями типового закона о закупках товаров, строительных работ и услуг, разработанного Комиссией ООН по праву международной торговли [Uncitral Model Law].

<sup>3</sup> Введенные характеристики, вообще говоря, не предполагаются количественно измеримыми. В их число, в частности, могут входить цвет, дизайн и т.д.

причем для каждой характеристики заказчиком должна быть указана допустимая область изменения ее значений:

$$x_i \in \tilde{D}_i \subseteq D_i, \quad i = 1, 2, \dots, n, \quad x \in \tilde{D} \subseteq \tilde{D}_1 \cdot \tilde{D}_2 \cdot \dots \cdot \tilde{D}_n.$$

Введенные характеристики могут быть разделены на три группы:

- характеристики, используемые только на стадии допуска участников к конкурсной процедуре;
- характеристики, используемые и на стадии допуска участников к конкурсной процедуре, и на стадии сопоставления и оценки их предложений;
- характеристики, используемые только на стадии сопоставления и оценки предложений поставщиков<sup>4</sup>.

Первые две группы характеристик могут быть определены как критерии допуска (*selection criteria*), последние две – как критерии сравнения (*awarding criteria*).

В частности, в соответствии со ст. 28 п. 4 Федерального закона в процессе оценки предложений поставщиков могут использоваться, разве лишь, следующие критерии сравнения.

1. Цена контракта.
2. Функциональные характеристики (потребительские свойства) или качественные характеристики товара.
3. Качество работ, услуг и (или) квалификация участника конкурса при размещении заказа на выполнение работ, оказание услуг.
4. Расходы на эксплуатацию товара.
5. Расходы на техническое обслуживание товара.
6. Сроки (периоды) поставки товара, выполнения работ, оказания услуг.
7. Срок предоставления гарантии качества товара, работ, услуг.
8. Объем предоставления гарантий качества товара, работ, услуг.

Для упрощения изложения предположим, что государственный заказчик использует в качестве критерия сравнения единственную функциональную (качественную) характеристику товара или единственную качественную (квалификационную) характеристику при размещении заказа на выполнение работ, оказание услуг.

---

<sup>4</sup> Для характеристик этой группы все возможные значения являются допустимыми для заказчика.



Введем в рассмотрение вектор критериев сравнения:

$$y = (x_{i_1}, x_{i_2}, \dots, x_{i_k}) = (y_1, y_2, \dots, y_k), \quad i_1 < i_2 < \dots < i_k, \quad k \leq n,$$

$$y \in \tilde{Y} \subseteq \tilde{D}_{i_1} \cdot \tilde{D}_{i_2} \cdot \dots \cdot \tilde{D}_{i_k}.$$

Как правило, для определения победителя конкурса используется метод линейной свертки критериев, который требует внесения в конкурсную документацию:

- правил преобразования значений критериев в единую балльную шкалу:  $Y = F(y) = (Y_1, Y_2, \dots, Y_k)$ ;

- вектора весов критериев  $w = (w_1, w_2, \dots, w_k)$ ,  $\sum_{i=1}^k w_i = 1$ .

В этом случае победителем конкурса признается предложение поставщика, которому будет соответствовать наибольшее скалярное произведение вектора весов критериев на вектор балльных оценок:

$$U(y) = wY = \sum_{i=1}^k w_i Y_i.$$

Рассмотрим технику преобразования значений критериев в единую балльную шкалу. Предположим, что к стадии оценки и сопоставления предложений допущены заявки  $N$  поставщиков<sup>5</sup>:

$$y^1 = (y_1^1, y_2^1, \dots, y_k^1) \in \tilde{Y}, \quad y^2 = (y_1^2, y_2^2, \dots, y_k^2) \in \tilde{Y}, \quad \dots,$$

$$y^N = (y_1^N, y_2^N, \dots, y_k^N) \in \tilde{Y}.$$

Введем обозначения:

$L$  – порядок применяемой балльной шкалы;

$Y_i^s$  – балльная оценка  $s$ -й альтернативы по  $i$ -му критерию ( $s = 1, 2, \dots, N$ ;  $i = 1, 2, \dots, k$ );

$I_{\uparrow}(I_{\downarrow}, I_q)$  – множество индексов количественно измеримых возрастающих критериев (количественно измеримых убывающих критериев, качественных (репутационных) критериев);

$y_{i\max} = \max(y_i^1, y_i^2, \dots, y_i^N) \cdot (y_{i\min} = \min(y_i^1, y_i^2, \dots, y_i^N))$  – наибольшее (наименьшее) значение  $i$ -го критерия среди предложений всех поставщиков ( $i \in I_{\uparrow} \cup I_{\downarrow}$ ).

<sup>5</sup> Критерии допуска, не являющиеся критериями сравнения, опущены.

В этом случае балльные оценки наблюдаемых количественно измеримых критериев, как правило, вычисляются по следующим формулам, отображающим значения количественных критериев в отрезок  $[1, L]$  (либо по незначительно модифицированным формулам, отображающим значения критериев в отрезок  $[0, 1]$  или  $[0, L]$ ) [5, 6]:

$$Y_i^s = 1 + \frac{y_i^s - y_{i\min}}{y_{i\max} - y_{i\min}}(L-1), \quad i \in I_{\uparrow}, s = 1, 2, \dots, N;$$

$$Y_i^s = 1 + \frac{y_{i\max} - y_i^s}{y_{i\max} - y_{i\min}}(L-1), \quad i \in I_{\downarrow}, s = 1, 2, \dots, N.$$
(1)

Перевод в балльную шкалу значений качественных (репутационных) критериев требует от государственного заказчика либо включения в конкурсную документацию объективного правила такого перевода *ex ante*, либо соответствующей экспертной оценки *ex post*.

Рассмотрим проблему полноты отношения предпочтения государственного заказчика, определенного на множестве  $\tilde{D}$  и представленного в конкурсной документации. Введем в рассмотрение два гипотетических допустимых предложения поставщиков:  $y^1 \in \tilde{Y}$ ,  $y^2 \in \tilde{Y}$ .

Применяемые способы преобразования количественных значений критериев в балльные имеют, как минимум, два основных недостатка.

Во-первых, даже располагая полной информацией о параметрах предложений поставщиков, невозможно сравнить рассматриваемые предложения *ex ante*, опираясь на описание отношения предпочтения государственного заказчика, приведенное в конкурсной документации.

Во-вторых, в условиях применяемых способов преобразований возникают стимулы для недобросовестного поведения и поставщика, и заказчика.

Применение формулы (1) создает стимулы для недобросовестного поведения поставщика, заключающегося в возможности влияния на балльные оценки предложений других поставщиков путем включения в конкурсную процедуру фиктивного конкурента с манипулируемыми параметрами предложения [Алескеров, 2010].

В свою очередь, процедура субъективной оценки качественных (репутационных) критериев открывает возможность для недобросовестного поведения государственного заказчика *ex post*.

Таким образом, отношение предпочтения государственного заказчика, сформулированное в конкурсной документации, вообще говоря, не является полным.

## Как принципал совершенствует конкурсную процедуру: балльная оценка количественных критериев

Для исследования комплекса мер, предлагаемых принципалом для противодействия последствиям сформулированного выше атрибутивного недостатка конкурсной процедуры, рассмотрим «Правила оценки заявок на участие в конкурсе на право заключить государственный или муниципальный контракт на поставки товаров, выполнение работ, оказание услуг для государственных или муниципальных нужд», утвержденные постановлением Правительства РФ от 10 сентября 2009 г. № 722 (ниже – Правила оценки).

При переводе в балльную шкалу значений количественно измеримых критериев (см. критерии 1, 4–8 выше) принципал радикально препятствует манипулированию результатами конкурсной процедуры со стороны поставщиков, отказываясь от использования в расчетах формулы (1)<sup>6</sup>.

Рассмотрим предлагаемую технологию перевода в балльную шкалу ценового критерия. С этой целью государственному заказчику предписывается использовать формулу<sup>7</sup>

$$P_i = \frac{P_{\max} - p_i}{P_{\max}} \cdot 100, \quad (2)$$

где  $p_i$  – ценовое предложение  $i$ -го поставщика;  $P_i$  – балльная оценка ценового предложения  $i$ -го поставщика;  $P_{\max}$  – начальная (максимальная) цена контракта.

Экономический смысл формулы (2) заключается в том, что в процессе преобразования количественного значения ценового критерия в балльное ценовому предложению поставщика сопоставляется размер скидки, который он предлагает государственному заказчику. Отсюда следуют достоинства формулы (2). С одной стороны, балльная оценка заявки нечувствительна к ценовым предложениям конкурентов, а с другой, участники конкурсной процедуры (поставщики) имеют информацию о числе баллов, получаемых их заявками по ценовому критерию, *ex ante*.

---

<sup>6</sup> Речь идет о невозможности повлиять на результат конкурсной процедуры путем выставления фиктивного поставщика.

<sup>7</sup> Использование формулы (2) предполагает перевод значения ценового критерия в 100-балльную шкалу.

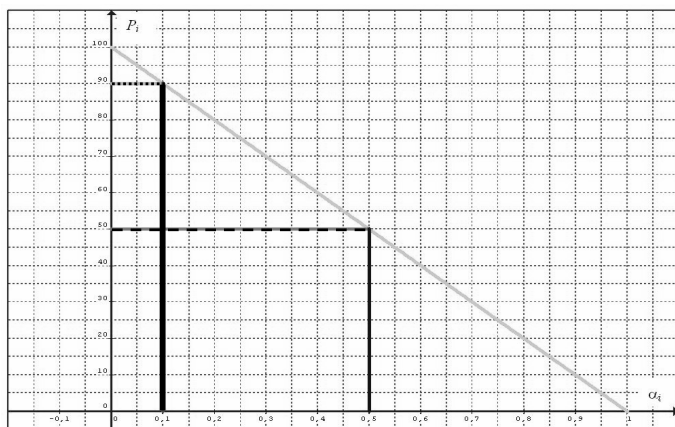
Перейдем к обсуждению недостатков формулы (2). Обозначим через  $\alpha_i$  отношение предлагаемой поставщиком цены контракта к его начальной (максимальной) цене:

$$\alpha_i = \frac{P_i}{P_{\max}}$$

В этом случае балльная оценка ценового предложения поставщика выглядит следующим образом:

$$P_i = (1 - \alpha_i) \cdot 100. \quad (3)$$

Изобразим графически зависимость между долей  $\alpha_i$ , которую составляет ценовое предложение от начальной цены контракта, и балльной оценкой ценового предложения поставщика.



**Рис. 2.** Зависимость балльной оценки ценового предложения от размера снижения цены

Легко видеть, что для получения 50 баллов по ценовому критерию поставщик должен снизить начальную стоимость контракта в 2 раза, что практически невозможно при ответственном подходе заказчика к ее установлению. А чтобы получить 90 баллов, поставщик должен снизить цену в 10 (!) раз. Таким образом, формула (2) порождает значительные стимулы к демпинговому поведению поставщиков.

Следует отметить, что использование формулы (2), вообще говоря, возможно только в условиях отечественного регулирования государственных закупок, принципиально избегающего антидемпинговых процедур. В междуна-

родной практике аналогичная формула используется в несколько модифицированном виде [Dini et al., 2006, p. 305]:

$$P_i = \frac{P_{\max} - P_i}{P_{\max} - P_0} \cdot 100, \quad (4)$$

где  $P_0$  – нижняя граница ценовых предложений, устанавливаемая конкурсной документацией.

Формула (4) наследует отмеченные выше достоинства формулы (2) и позволяет получать высокие балльные оценки в рамках добросовестного с точки зрения государственного заказчика экономического поведения.

Обращает на себя внимание тот факт, что при переводе в балльную шкалу количественных значений критериев 4–8 принципал предписывает использование формул типа (4), а не типа (2), оставляя возможность только ценового демпинга<sup>8</sup>.

## **Как принципал совершенствует конкурсную процедуру: балльная оценка качественных (репутационных) критериев**

Рассмотрим п. 22 (29) Правил оценки: «Рейтинг, присуждаемый заявке по критерию “функциональные характеристики (потребительские свойства) или качественные характеристики товара” (качество работ, услуг и (или) квалификация участника конкурса при размещении заказа на выполнение работ, оказание услуг), определяется как среднее арифметическое оценок в баллах всех членов конкурсной комиссии, присуждаемых этой заявке по указанному критерию».

Обратим внимание на следующие проблемы, порожденные вводимым механизмом оценки качественных (репутационных) критериев.

1. Правила оценки не указывают на исключительный характер субъективной оценки рассматриваемых критериев и не прописывают особого механизма контроля за его результатами. Это позволяет недобросовестному заказчику произвольным образом устанавливать разницу в балльных оценках поставщиков: «...у нас в 90% случаев один получал 50 баллов, остальные – 0!» [Артемьев, 2010].

---

<sup>8</sup> Этот факт не известен руководителю ФАС, которой искренне считает, что, неограниченно уменьшая срок выполнения заказа, поставщик может получить преимущество перед конкурентами [Артемьев, 2010].

2. Правила оценки расширительно трактуют положения Федерального закона, касающиеся функций членов конкурсной комиссии, который не требует экспертных знаний в области закупаемой продукции от всех членов комиссии. Сопоставление марок автомашин для органа власти, томографов, закупаемых для учреждения здравоохранения, университетов, в которые образовательное учреждение намерено направить своих сотрудников для повышения квалификации, требует специальных знаний, которыми, как правило, не обладает ряд членов комиссии (например, юристы и специалисты по снабжению).

3. Демократический способ принятия управленческих решений, предписываемый в данном случае Правилами оценки, обладает рядом общеизвестных негативных свойств и редко применяется при принятии решений экономических. Здесь, чаще всего, работает правило диктатора.

Следует отметить, что в связи с вышесказанным предложение ввести в тендерные комитеты представителей гражданского общества [Артемьев, 2010] представляется, скажем так, не вполне обоснованным.

## **Как принципал усовершенствовал конкурсную процедуру: коррупционный практикум**

Рассмотрим, препятствуют ли Правила оценки недобросовестным действиям государственного заказчика в процессе конкурсной процедуры. Для упрощения изложения предположим, что речь идет о закупке товаров и услуг, в которой возможно для критерия «Качество работ, услуг и (или) квалификация участника конкурса» установить вес, равный 0,45.

Предположим, что недобросовестный заказчик действует следующим образом.

- Устанавливает завышенную начальную (максимальную) цену государственного контракта<sup>9</sup>.
- «Назначает» будущего победителя конкурсной процедуры (фаворита).
- В числе критериев сравнения указывает: цену контракта, качество работ, услуг и (или) квалификацию участника конкурса, сроки (периоды) поставки товара, выполнения работ, оказания услуг.

---

<sup>9</sup> Руководитель контролирующего органа констатирует невозможность воспрепятствовать установлению завышенной цены [Артемьев, 2010].

• Не нарушая предписаний Правил оценки, устанавливает веса критериев следующим образом:

цена контракта – 0,35;

качество работ, услуг и (или) квалификация участника конкурса – 0,45;

сроки (периоды) поставки товара, выполнения работ, оказания услуг – 0,2.

• Предписывает фавориту указать срок поставки товара, соответствующий максимальной оценке.

• Вскрывает конверты с предложениями поставщиков.

• Переводит ценовые предложения в балльную шкалу<sup>10</sup>.

• Вычисляет (когда конверты уже вскрыты), какое преимущество в балльной оценке за качество/квалификацию необходимо фавориту, чтобы стать победителем конкурса.

• Проводит формальное голосование членов комиссии.

• Через 10 дней подписывает контракт с победителем конкурсной процедуры.

• Получает от победителя денежный трансферт.

Таким образом, современная конкурсная процедура, механизм которой прописан Федеральным законом и Правилами оценки, порождает сочетание отмеченных выше необходимых условий коррупции: наличие распорядительной власти у недобросовестного государственного заказчика, возможность извлечения из нее ренты и слабость контролирующих институтов.

## Литература

*Алескеров Ф.Т.* О моделях манипулирования при проведении конкурсов для государственных закупок // X Международная научная конференция по проблемам развития экономики и общества / отв. ред. Е.Г. Ясин. Кн. 1. М.: Изд. дом ГУ ВШЭ, 2010.

*Артемов И.Ю.* Наши союзники – и президент, и председатель правительства // Новая газета. 2010. № 144. 22 декабря. (<http://www.novayagazeta.ru/data/2010/144/16.html>)

Методические рекомендации по балльной оценке конкурсных заявок и квалификации поставщиков, участвующих в конкурсах на размещение заказов на поставки товаров. Министерство экономики РФ, письмо от 2 июня 2000 г. № АС-751/4-605.

Правила оценки заявок на участие в конкурсе на право заключить государственный или муниципальный контракт на поставки товаров, выполнение работ,

---

<sup>10</sup> Не умаляя общности, можно считать оценки по сроку выполнения контракта максимальными у всех участников процедуры.

оказание услуг для государственных или муниципальных нужд. Утверждены постановлением Правительства РФ от 10 сентября 2009 г. № 722.

*Aidt T.* Economic Analysis of Corruption: A Survey // *The Economic Journal*. 2003. 113. Royal Economic Society.

*Dini F., Pacini R., Valetti T.* Scoring Rules. Handbook of Procurement / ed. by N. Dimitri, G. Piga, G. Spagnolo. Cambridge, UK: Cambridge University Press, 2006. P. 293–321.

*Jain A.K.* Corruption: A Review // *Journal of Economic Surveys*. 2001. Vol. 15(1). P. 71–121.

Uncitral Model Law on Procurement of Goods, Construction and Services with Guide to Enactment. (<http://www.uncitral.org/pdf/english/texts/procurem/ml-procurement/ml-procure.pdf>)



А.В. Ерёмина,  
И.В. Зороастрова  
Нижегородский филиал  
Национального исследовательского  
университета «Высшая школа  
экономики»

# ЭМПИРИЧЕСКИЙ АНАЛИЗ ФАКТОРОВ СГОВОРА НА РЫНКЕ ГОСУДАРСТВЕННЫХ ЗАКУПОК

---

Размещение государственного заказа посредством конкурентных процедур зачастую сопряжено с определенной вероятностью сговора между потенциальными поставщиками. Выгоды кооперативного поведения для фирм-участниц закупочного процесса возникают одновременно с ущемлением интересов государства: закупка происходит по завышенной цене, но с заниженным качеством поставляемых товаров, работ, услуг. Государственный заказ при наличии сговора не отвечает законодательно установленным требованиям экономичности и эффективности, что свидетельствует о необходимости предупреждения кооперативного поведения участников государственных закупок.

Выявление и пресечение сговора является комплексной проблемой в силу существования неявных механизмов поддержания стратегии кооперативного поведения и координации действий между потенциальными поставщиками в ходе размещения заказа. Судить о наличии сговора в государственных закупках после размещения заказа можно лишь по некоторым индикаторам, в частности по небольшой величине снижения начальной цены в ходе закупки, сопряженной с низкой степенью конкуренции на процедурах.

Проблема сговора между участниками размещения государственного заказа рассматривается, как правило, в рамках моделей поведения конкурирующих фирм на олигополистическом рынке, которые с целью увеличения ожидаемой прибыли согласуют свои действия, имитируя поведение единственной доминирующей фирмы. С позиции данного подхода исследования сговора осуществляются в нескольких направлениях.

К первому можно отнести теоретические работы, определяющие экономическое понятие «сговор», его основные категории [Stigler, 1964], содержащие модели скоординированного взаимодействия фирм на олигополистическом рынке, а также особенности таких объединений [Graham, Marshall, 1987]. Наиболее приближенными к области государственного заказа исследованиями являются

работы [McAfee, McMillan, 1992; Aoyagi, 2000], в которых выделяются наиболее распространенные модели сговора между участниками государственных закупок, а также описывается порядок формирования цепочек сговора в ходе процедур торгов.

К другому направлению следует отнести теоретические работы, в которых предприняты попытки выявления основных характеристик рынка или особенностей процедур, способствующих возникновению и успешному поддержанию сговора. Так, в работе [Stenbacka, 1990] в терминах динамической модели сформулирована зависимость вероятности сговора от количества и высоты барьеров входа на рынок для новых фирм. Вопросы влияния степени асимметричности в долях рынка и производственных возможностях участников картеля отражены в работах [Bain, 1948, Lambson, 1987, 1994, 1996]. Воздействие процедурных факторов на вероятность сговора между участниками закупок обсуждается в работах [Cramton, Schwartz, 2000; Robinson, 1985].

К числу эмпирических работ, посвященных проблеме выявления сговора в государственных закупках, можно отнести труды [Porter, 1983; Lanzilloti, 1996], в которых предпринимаются попытки не только установить наличие сговора на основании истории имевших место аукционов в США, но и определить его природу, а также механизм формирования.

Несмотря на всестороннюю изученность проблемы координации действий между участниками закупочного процесса, обнаружение сговора по-прежнему относится к категории нерешенных проблем. Все модели, как теоретические, так и практические, либо дают представление о механизмах реализации сговора в системе государственного заказа, либо позволяют подтвердить гипотезу о его наличии на основании анализа эмпирических данных – истории цен в состоявшихся закупках. Отчасти судить о наличии сговора в рамках определенного рыночного сегмента можно по ряду индикаторов, описываемых Стиглером в качестве особенностей среды, создающих предпосылки для кооперативного поведения участников.

- Вероятность сговора между участниками размещения заказа повышается при небольшом количестве участников в отдельно взятой конкурентной процедуре торгов. Чем чаще происходит взаимодействие потенциальных поставщиков в условиях повторяющихся процедур закупок товаров и услуг одного класса, тем легче им сохранять и поддерживать сговор.

- Растущий спрос на предлагаемый товар делает стратегию кооперативного поведения более привлекательной для фирм-участников конкурсных процедур, поскольку увеличивает их ожидаемые прибыли в случае сговора.

- Снижению вероятности сговора способствует увеличение асимметрии распределения рыночных долей потенциальных поставщиков.

В целях исследования индикаторов конкурентной среды, косвенным образом свидетельствующих о наличии стратегии кооперативного поведения между участниками размещения заказа, авторы провели сравнительный анализ особенностей рынков горюче-смазочных материалов в различных субъектах Российской Федерации. Объектом проведенного исследования являлись закупки нефтепродуктов для муниципальных нужд за период 2008–2009 гг. в 83 субъектах РФ. В течение этого времени закупки горюче-смазочных материалов посредством проведения конкурентных процедур проводились в 47 субъектах РФ, и их общее число составило 938 закупок.

Каждый муниципальный заказ был подвергнут анализу по основным показателям, в том числе: форме закупки, начальной (максимальной) цене, цене контракта, победителю и т.д.

Анализ эмпирических данных выявил общий *низкий уровень конкуренции* между поставщиками в муниципальных закупках нефтепродуктов.

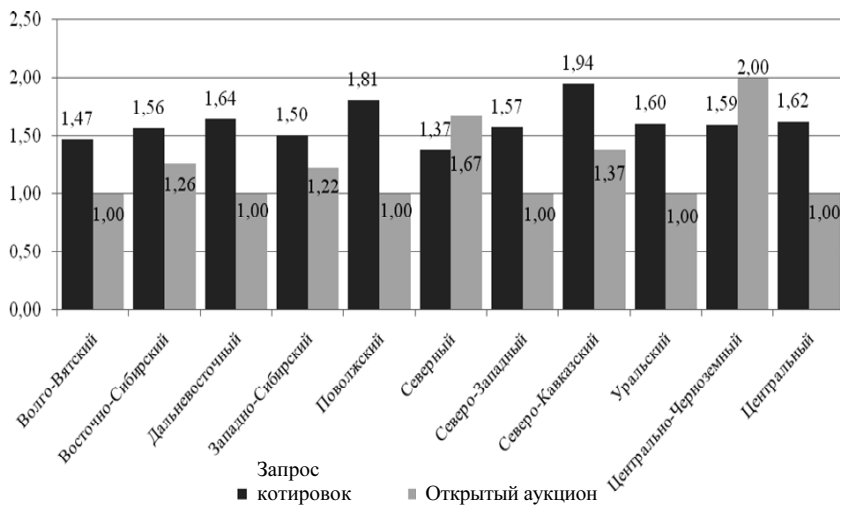
Наименее конкурентным способом закупок являлся открытый аукцион. Здесь среднее количество участников размещения заказа на одну процедуру, по результатам которой был заключен муниципальный контракт, составляет 1,22 потенциальных поставщика. Это означает, что более чем в половине случаев открытый аукцион был признан несостоявшимся, поскольку на участие в нем была подана лишь одна заявка, соответствующая требованиям аукционной документации.

В шести из одиннадцати экономических районов Российской Федерации среднее количество поставщиков, изъявивших желание принять участие в открытых аукционах и допущенных аукционной комиссией до участия, равно единице (см. рис. 1). Это означает в соответствии с законодательно установленными нормами, что в большинстве исследованных случаев открытые аукционы были признаны несостоявшимися и контракт заключен по максимальной цене, установленной заказчиком до начала процедур.

Наивысшие показатели конкуренции на закупках нефтепродуктов посредством проведения открытых аукционов прослеживаются в Центрально-Черноземном районе, здесь среднее количество поставщиков, подающих заявку на участие в аукционе, составляет 2 участника размещения заказа.

Запрос котировок как процедура, наименее сложная для участия, а соответственно и наиболее привлекательная для поставщиков, характеризуется бо-

лее высоким уровнем конкуренции. Применительно к неторговым способам размещения государственного заказа данный показатель составляет 1,61 поставщика на процедуру. По сравнению с уровнем конкуренции на открытых аукционах в запросах котировок данный показатель колеблется от 1,37 в Северном экономическом районе до 1,94 в Северо-Кавказском. В среднем на две процедуры запроса котировок приходится около трех участников.



**Рис. 1.** Среднее количество участников размещения заказа на один открытый аукцион и одну процедуру запроса котировок в экономических районах России

В целом, судя по уровню конкуренции в торговых и неторговых процедурах, можно сделать вывод, что либо значительная часть заказов, размещаемых для удовлетворения имеющейся потребности в нефтепродуктах, не привлекает достаточного количества поставщиков, либо же низкий уровень конкуренции обусловлен наличием стратегии скоординированных действий участников данного рынка.

В числе двух основных условий, по которым можно судить о существовании сговора на рынке, кроме небольшого количества поставщиков на отдельно взятую процедуру можно выделить также *уровень снижения начальной цены* по результатам закупки.

Исследования средних величин снижения цены в закупках нефтепродуктов для нужд муниципалитетов показали, что *цена контракта незначительно отличается от начальной цены*, установленной заказчиком.

Открытый аукцион является, по определению, более конкурентным способом размещения заказа по сравнению с запросом котировок, поскольку участник процедур имеет возможность повлиять на исход закупки, предложив более низкую цену контракта. Однако на деле средняя величина снижения цены по результатам открытого аукциона в Российской Федерации составляет лишь 2,38%. Кроме того, более чем в половине экономических районов, в которых имели место процедуры торгов на закупку нефтепродуктов, снижения цены по результатам не произошло. Причиной тому может стать недостаточный уровень конкуренции, что ведет к заключению контракта с единственным поставщиком, подавшим заявку, соответствующую требованиям аукционной документации.

**Таблица 1.** Средняя величина снижения цены по результатам открытых аукционов и запросов котировок в разрезе экономических районов РФ, %

Экономический район	Запрос котировок	Открытый аукцион
Волго-Вятский	4,82	0,00
Восточно-Сибирский	2,66	4,25
Дальневосточный	0,70	0,00
Западно-Сибирский	0,18	5,74
Поволжский	2,75	0,00
Северный	3,33	8,67
Северо-Западный	5,02	0,00
Северо-Кавказский	7,09	1,40
Уральский	2,73	0,00
Центрально-Черноземный	5,96	0,50
Центральный	4,21	0,00
<b>Общий итог</b>	<b>3,56</b>	<b>2,38</b>

Наиболее высокие значения среднего снижения начальной цены контракта в ходе открытого аукциона наблюдаются в Восточно-Сибирском (4,25%), Западно-Сибирском (5,74%) и Северном (8,67%) экономических районах. Сопоставив эти значения с показателями уровня конкурентности открытых аукционов, получаем очевидную закономерность: при увеличении количества участников размещения заказа в открытом аукционе начальная цена контракта может быть снижена на большую величину.

В Волго-Вятском, Дальневосточном, Поволжском, Северо-Западном, Уральском, Центральном экономических районах проблема отсутствия конкуренции на торгах обусловила нулевую величину снижения начальной цены, предложенной заказчиком.

Запрос котировок как процедура менее транспарентная, простая, а значит, и более привлекательная для участников размещения заказа, вступивших в сговор, позволяла в среднем сбросить цену на 3,56% (см. табл. 1). При этом снижение цены происходило во всех экономических районах, и максимальная величина была зафиксирована в Северо-Западном (5,02%), Центрально-Черноземном (5,96%), Северо-Кавказском (7,09%) экономических районах.

Распределение величин снижения начальной цены по субъектам РФ без учета способа закупки показательно варьируется от минимальных значений в 0,00% в Якутии, Ямало-Ненецком, Ненецком АО до 10,00% в Кемеровской области. Причины нулевого снижения начальной цены в удаленных регионах могут быть связаны с низким уровнем деловой активности местного предпринимательства, которое не стремится участвовать в муниципальных закупках, вкупе с отсутствием инициативы со стороны поставщиков из сторонних регионов, поскольку транспортная удаленность неизменно будет являться причиной высоких цен на нефтепродукты.

Рассматривая величины экономии бюджетных средств, нельзя обойти вниманием в целом недостаточно высокую готовность субъектов предпринимательства к снижению цены контракта. По Российской Федерации снижение начальной цены в среднем не превышает 3,31%, что в терминах бюджетных расходов не является ощутимой экономией.

В целях проверки наличия стратегии скоординированных действий между поставщиками нефтепродуктов в различных регионах Российской Федерации авторами также была проанализирована модель, призванная выявить зависимость между устойчивостью взаимоотношений участников торгов и способом размещения заказа.

В качестве гипотезы исследования было принято наличие взаимосвязи «устойчивости» заключения контрактов с определенными поставщиками и формы проведения торгов. Проверка гипотезы была осуществлена с помощью регрессионной модели, построенной методом наименьших квадратов на основе преобразованного массива данных.

В роли количественной характеристики устойчивости связей между поставщиками и заказчиками в работе была предложена *частота заключения контрактов с определенными поставщиками* для каждого заказчика (в модели обозначена *Frequency*). Значение этой величины соответствует отношению суммарного числа контрактов, заключенных за анализируемый период данным заказчиком с определенным поставщиком, к общему количеству контрактов, заключенных данным заказчиком. Предполагалось, что устойчивость связи между

участниками рынка может свидетельствовать о наличии согласованного поведения.

Выяснилось, что более чем 80% заказчиков взаимодействовали только с одним поставщиком (т.е. частота была равна единице, см. табл. 2), в этих случаях абсолютное большинство контрактов было заключено по итогам котировок (80,3%).

**Таблица 2.** Структура наблюдений в зависимости от значения частоты

Значение частоты	Доля наблюдений, %
$Frequency = 1$ , максимальная частота	80,1
$0,5 < Frequency < 1$ , высокая частота	4,4
$0,2 \leq Frequency \leq 0,5$ , средняя частота	13,2
$0 < Frequency < 0,2$ , низкая частота	2,3

Для всех сочетаний «заказчик – поставщик» были также рассчитаны частоты использования каждого из способов размещения в общем количестве заказов, размещенных соответствующим способом данным заказчиком:

*auction* – доля контрактов, заключенных с определенным поставщиком по итогам открытого аукциона, в общем количестве заказов, размещенных этим способом данным заказчиком;

*zaproskotirovok* – доля контрактов, заключенных с определенным поставщиком по итогам запроса котировок, в общем количестве заказов, размещенных этим способом данным заказчиком.

Массив данных, содержащий значения перечисленных выше количественных характеристик, был составлен на основе выбранных из исходного массива данных 342 наблюдений сочетаний «заказчик – поставщик».

Результаты построения регрессионной модели представлены в табл. 3.

Анализ полученных результатов (см. табл. 3) показывает, что гипотеза о взаимосвязи «устойчивости» заключения контрактов с определенными поставщиками и формы проведения торгов подтвердилась. Как и ожидалось, более сильная зависимость между «устойчивостью» пары «заказчик – поставщик» и процедуры закупок наблюдалась при запросе котировок (коэффициент регрессии + 0,778222).

Таблица 3.

Регрессионная модель

Dependent Variable: FREQUENCY

Method: Least Squares

Included observations: 342

FREQUENCY = C(1) + C(2) · AUCTION + C(3) · ZAPROSKOTIROVOK

	Coefficient	Std. error	t-Statistic	Prob.
C(1)	0,186546	0,028339	6,582571	0,0000
C(2)	0,699675	0,032248	21,69649	0,0000
C(3)	0,778222	0,030422	25,58093	0,0000
R-squared	0,660946	Mean dependent var		0,885965
Adjusted R-squared	0,658946	S.D. dependent var		0,247512
S.E. of regression	0,144546	Akaike info criterion		-1,021699
Sum squared resid	7,082949	Schwarz criterion		-0,988061
Log likelihood	177,7106	Durbin – Watson stat		1,580941

$$\text{FREQUENCY} = 0,186546 + 0,699675 \cdot \text{AUCTION} + 0,778222 \cdot \text{ZAPROSKOTIROVOK}$$

Таким образом, в числе выявленных особенностей конкурентной среды рынка нефтепродуктов в разрезе муниципального заказа в субъектах Российской Федерации можно заключить о наличии ряда факторов, указывающих на определенную вероятность существования сговора в рамках данных сегментов:

- закупки горюче-смазочных материалов за двухлетний период характеризуются низким показателем конкуренции;
- ощутимого снижения начальной цены, предложенной заказчиком, в ходе закупки не происходит;
- участие в государственных закупках нефтепродуктов не выгодно для потенциальных поставщиков;
- наличие стратегии кооперативного поведения вероятно как для участников открытых аукционов, так и запросов котировок.

## Литература

- Aoyagi M.* Bid Rotation and Collusion in Repeated Auctions: University of Pittsburgh, CMPO Working Paper series № 00/29. 2000.
- Bain J.* Output Quotas in Imperfect Cartels // Quarterly Journal of Economics. 1948. 62. P. 617–622.
- Cranton P., Schwartz J.A.* Collusive Bidding: Lessons from the FCC Spectrum Auctions // Journal of Regulatory Economics. 2000. 17. P. 229–252.



- Graham D., Marshall R.* Collusive Bidder Behavior at Single-Object Second-Price and English Auctions // *Journal of Political Economy*. 1987. 95. P. 1217–1239.
- Lambson V.E.* Optimal Penal Codes in Price-Setting Supergames with Capacity Constraints // *Review of Economic Studies*. 1987. 54. P. 385–397.
- Lanzillotti R.F.* The Great School Milk Conspiracies of the 1980's // *Review of Industrial Organization*. 1996. 11. P. 413–458.
- McAfee R., McMillan J.* Bidding Rings // *American Economic Review*. 1992.
- Porter R.H.* A Study of Cartel Stability: The Joint Executive Committee, 1880–1886 // *The Bell Journal of Economics*. 1983. 14. 2. P. 301–314.
- Robinson M.* Collusion and the Choice of Auction // *Rand Journal of Economics*. 1985. 16. P. 141–145.
- Stenbacka L.R.* Collusion in Dynamic Oligopolies in the Presence of Entry Threats // *Journal of Industrial Economics*. 1990. 39. 2. P. 147–154.
- Stigler G.J.* A Theory of Oligopoly // *Journal of Political Economy*. 1964. 72. P. 44–61.

Н.С. Маслова,  
И.В. Кузнецова  
Национальный исследовательский  
университет «Высшая школа  
экономики»

# ОЦЕНКА РИСКОВ КАК ИНСТИТУТ УПРАВЛЕНИЯ ОБЕСПЕЧЕНИЕМ ГОСУДАРСТВЕННЫХ НУЖД

---

Государственные закупки являются одним из важнейших направлений деятельности государства. Закупки продукции для государственных нужд составляют от 10 до 20% валового внутреннего продукта (ВВП) и являются мощным импульсом, стимулирующим потребление, что в свою очередь приводит к росту валового национального продукта (ВНП).

Существенным фактором доминирования негативных тенденций в практике размещения госзаказа в российской экономике является недостаточная степень разработанности методологических основ и концептуальных положений системы управления госзаказом с учетом рисков, возникающих в ходе осуществления закупочной деятельности.

Процесс управления рисками представляет собой системный подход к минимизации рисков явлений, которые могут каким-либо образом воздействовать на достижение ключевых целей проекта закупок.

Общий концептуальный подход к методам управления рисками в системе государственных закупок заключается в следующем:

- выявление возможных последствий хозяйственной деятельности в рискованной ситуации;
- разработка мер, не допускающих, предотвращающих или уменьшающих (минимизирующих) ущерб от воздействия непредвиденных рискованных факторов;
- реализация такой системы адаптирования бюджетных учреждений к рискам, при помощи которой могут быть не только нейтрализованы или компенсированы вероятные негативные последствия, но и максимально использованы шансы на получение максимального эффекта.

Методология управления рисками строится на базе двух подходов: технологического и процессного. При управлении рисками в экономической и социальной сфере продуктивнее и чаще используется процессный подход.

Используя процессный подход к описанию закупочного цикла можно выделить следующие основные процессы закупочного цикла: «Формирование заказа (планирование закупок)», «Размещение заказа», «Управление исполнением заказа».

Каждый из центральных закупочных процессов можно декомпозировать на несколько последовательно осуществляемых подпроцессов.

Количество и полнота исполнения каждого подпроцесса зависит от сложности, значения закупки и специфики рынка объектов закупки. Указанные характеристики определяют способ размещения заказа, а тот, в свою очередь, диктует необходимость осуществления тех или иных процедур и (или) подпроцессов формирования заказа в полном или фрагментированном объеме.

Центральные закупочные процессы в случае их регулярного повторения, требуют создания и встраивания в постоянно действующую систему закупок, в которой значительное место занимают не только центральные процессы, но и процессы управления и обеспечения ресурсами.

Закупочная деятельность представляет собой систему, включающую в себя большое количество центральных, управляющих и обеспечивающих процессов, имеющих в качестве основного внешнего входа возникшую у государства или общества потребность в товарах, работах, услугах и основного внешнего выхода – удовлетворенность государства и общества произведенной закупкой, т.е. удовлетворенную потребность.

Риски закупочной деятельности в соответствии с процессным подходом имеют место как в центральных, так и в процессах управления и обеспечения закупочной деятельности. Поэтому определение риска в закупочной сфере должно осуществляться по каждому из вышеперечисленных процессов.

Наиболее существенной проблемой эффективного управления риском является проблема многокритериальности (согласования оценок рисков, полученных по различным основаниям, из различных источников, с использованием различных индикаторов и оценок).

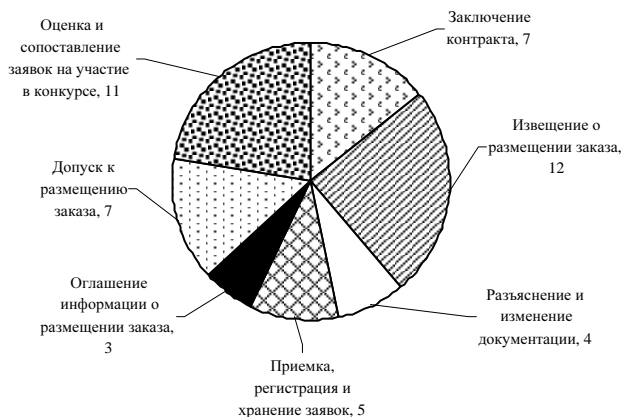
Управлять можно только тем объектом, модель которого существует в системе управления этим объектом. Поэтому, основной целью моделирования процессов и операционных рисков системы является построение ее модели с целью снижения вероятности влияния негативных факторов, повышения управляемости и обеспечения эффективного развития.

В настоящее время для управления процессными (операционными) рисками в IT-системах используются методология ARIS (Architecture of Integrated Information Systems), разработанная германской фирмой IDS Scheer.

ARIS позволяет не только описывать существующие процессы, организационную структуру, продукты организации и т.д., но также реализует возможность ведения классификаторов операционных рисков с последующим расчетом возможных потерь по каждой из категорий рисков.

Для осуществления качественного прогноза результатов размещения заказа, разработки и реализации мероприятий, направленных на совершенствование системы государственных закупок, необходима оценка текущей ситуации проявления рисков, возникающих при размещении заказа для государственных нужд.

В рамках проекта «Экономические основы обеспечения государственных нужд» НИУ ВШЭ был проведен анализ рисков закупочной деятельности в Российской Федерации и на основании методологии ARIS были разработаны классификация, описание, прогноз объема последствий и частоты встречаемости рисков размещения заказа, а также воздействия по управлению рисками. В результате было выделено 49 процессных рисков размещения заказа. Распределение выделенных рисков по процедурам размещения заказа приведено на рис. 1.



**Рис 1.** Распределение процессных рисков по процедурам размещения заказа

С применением процессного подхода в рамках исследования была разработана матрица процессных и технологических рисков закупочной деятельно-

сти в Российской Федерации, включающая десять обязательных элементов описания выделенных рисков размещения заказов:

- 1) «Процесс, подпроцесс, процедура»;
- 2) «Наименование риска»;
- 3) «Характер риска»;
- 4) «Причины риска»;
- 5) «Возможные индикаторы»;
- 6) «Вероятность возникновения риска»;
- 7) «Величина воздействия риска»;
- 8) «Ответственный за управление риском»;
- 9) «Методы управления риском»;
- 10) «Управляющие воздействия».

Далее на примере описания одного из рисков приведен порядок формирования матрицы процессных и технологических рисков закупочной деятельности в Российской Федерации, использованный в рамках исследования.

**Наименование риска:** *«Правила оценки и сопоставления заявок не адекватны предмету, объекту закупки, основным условиям контракта, условиям рынка».*

*Процесс, на цели которого влияет риск:* оценка и сопоставление заявок (определение победителя).

*Цель процесса, на которую влияет риск:* определение победителя.

*Субъект – источник угрозы:* заказчики.

*Владелец риска:*

*а) субъект угрозы (на кого направлен основной удар):* поставщики;

*б) субъект управления (основной):* заказчик.

*Фактор риска:* операционный, коррупционный.

*Описание причин:* некомпетентность персонала подразделения, размещающего заказ; сознательное ограничение конкуренции (с целью получения конкретного поставщика), отсутствие регламента выбора условий оценки и сопоставления заявок в соответствии с предметом, объектом закупки, основными условиями контракта.

*Описание возможных последствий:* ограничение и снижение конкуренции, административное и судебное обжалование, административная и уголовная от-

ветственность, закупка ненужной продукции, закупка некачественной продукции, финансовые потери в размере контракта и транзакционных издержек, последствия ничтожности сделки, нарушение сроков удовлетворения потребности, увеличение коррупции, потеря доверия власти.

*Объект рискового события:* поставщики.

*Место возникновения риска:* оценка и сопоставление заявок (определение победителя).

*Оценка присущего риска:*

- а) вероятность риска – 5;*
- б) существенность последствий риска – 3;*
- в) интегральная оценка риска – 15.*

*Временной горизонт, относительно которого произведена оценка риска:* квартал.

*Существующие (выполняемые) процедуры по управлению риском.* Базовый метод управления – снижение риска: Обеспечение заказывающего подразделения квалифицированными кадрами, мониторинг протоколов оценки и сопоставления заявок, административная ответственность, внесение изменений в законодательство, выбор адекватных условий оценки и сопоставления заявок.

*Оценка остаточного риска:*

- а) вероятность риска – 3;*
- б) существенность последствий риска – 3;*
- в) интегральная оценка риска – 9;*

*Описание ключевых индикаторов риска (КИР).*

*а) Наименование КИР – размещение заказа подавших заявки на 1 процедуру (1 лот) – снижение конкуренции, незаинтересованность в заказе поставщика (проблемные закупки), 2) количество случаев обоснованных жалоб, 3) количество случаев наличия запросов на разъяснение, изменение документации, устраняющих противоречия с законодательством, 4) количество случаев наличия снижения качества поставок, 5) количество случаев наличия срыва сроков удовлетворения потребности и размещения заказа, 6) количество случаев наличия расторжения контракта по соглашению сторон или решению суда;*

*б) единица измерения:* 1) – человек (участников); 2), 3), 5), 6) – шт.;

*в) нижнее предельное значение:* 1) – 3 человека (участника); 2), 3), 5), 6) – 1% из общего объема;

г) *верхнее предельное значение*: 1) – 1 человек (участник); 2), 3), 5), 6) – 10% из общего объема;

д) *текущее значение*;

е) *дата замера*.

*Выбор способа реагирования на риск*: базовый метод управления – снижение риска.

В представленном порядке были описаны 49 процессных рисков размещения заказа.

По результатам экспериментальной апробации матрицы процессных и технологических рисков закупочной деятельности в Российской Федерации была дана экспертная оценка объема последствий и частоты встречаемости рисков на выборке заказчиков. Опрос проводился в среде экспертов закупщиков: опрошено 255 экспертов – закупщиков, работников Федеральной налоговой службы, 44 эксперта закупщика – работников Федерального казначейства, 107 экспертов – закупщиков различных федеральных органов власти и государственных и муниципальных учреждений (406 специалистов федеральных, региональных и муниципальных органов власти и организаций). При оценке рисков использовался опросник, разработанный авторами доклада, включающий в себя экспертную оценку риска размещения заказа по объему последствий и частоте встречаемости.

По результатам оценки были определены средние значения оценки рисков и их стандартные отклонения, а также проведен корреляционный анализ выделенных ранее рисков.

Все респонденты отметили наличие выделенных рисков в практике размещения государственных и муниципальных заказов.

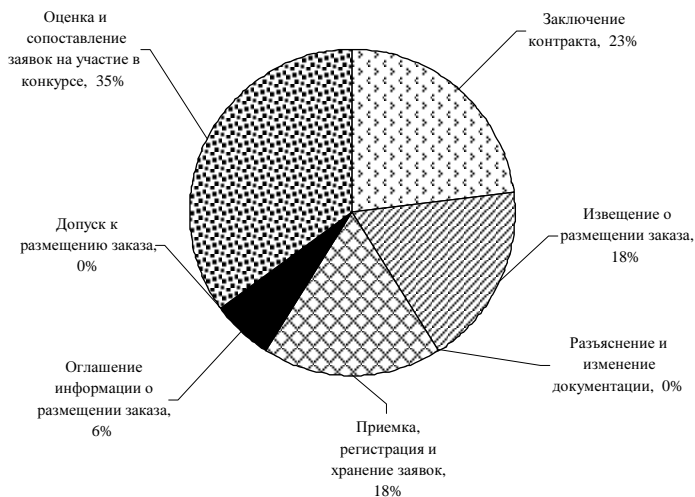
Респонденты оценивали объем последствий и частоту встречаемости рисков по их названию и описанию последствий по 5-балльной шкале: 5 баллов присуждалось катастрофическому объему последствий и высокой частоте встречаемости, 1 балл – малому объему последствий и низкой частоте встречаемости.

Результаты опроса показывают высокий уровень риска по объему последствий и средний в целом по всем рискам по частоте встречаемости.

Эксперты особо выделяют риски предоставления, состава и содержания закупочной документации, объем последствий и частота встречаемости кото-

рых значительно превышает риски иных процессов и документальных входов и выходов процесса.

Средние значения объема последствий риска находятся по 2/3 показателей на среднем уровне и по 17 показателям превышают средний уровень. Распределение рисков, по которым средние значения объема последствий риска превышают средний уровень, по процедурам размещения заказа приведено на рис. 2. При этом, из семнадцати показателей семь показателей относятся к рискам невыполнения требований законодательства и десять – к рискам моделирования результатов размещения заказа, в том числе (по большей части показателей) к коррупционным рискам. Стандартные отклонения показателей значительно ниже значения показателя, что свидетельствует о схожей оценке рисков большинством экспертов.



**Рис. 2.** Распределение рисков со значением последствий риска, превышающим средний уровень, по процедурам размещения заказ

Первая пятерка рисков, имеющих наибольший уровень выраженности, по мнению экспертов, выглядит следующим образом.



Риски	Последствия
<p>Размытость, неясность, неконкретность, неполнота информации и (или) противоречивость предмета, объекта закупки, основных условий контракта, изложенных в Извещении о закупке; мистификация (сознательное искажение или подмена предмета контракта, объекта закупки), использование «зачоченных» под единственным исполнителем условий сделки</p>	<p>Ограничение и снижение конкуренции, административное и судебное обжалование, административная и уголовная ответственность, закупка ненужной продукции, закупка некачественной продукции, финансовые потери в размере контракта и транзакционных издержек, последствия притворной сделки, нарушение сроков исполнения контракта, увеличение коррупции, потеря доверия власти</p>
<p>Несоответствие содержания Извещения требованиям законодательства о закупках</p>	<p>Ограничение и снижение конкуренции, административное и судебное обжалование, административная и уголовная ответственность, закупка ненужной продукции, закупка некачественной продукции, финансовые потери в размере контракта и транзакционных издержек, последствия притворной сделки, последствия ничтожности сделки, нарушение сроков удовлетворения потребности, увеличение коррупции, потеря доверия власти</p>
<p>Изменения в извещении внесены с нарушением законодательства о размещении заказа</p>	<p>Ограничение и снижение конкуренции, административное и судебное обжалование, административная и уголовная ответственность, закупка ненужной продукции, закупка некачественной продукции, финансовые потери в размере контракта и транзакционных издержек, последствия притворной сделки, последствия ничтожности сделки, нарушение сроков удовлетворения потребности, увеличение коррупции, потеря доверия власти</p>
<p>Включение необоснованных, дополнительных необъявленных и(или) не соответствующих законодательству условий в контракт при его заключении</p>	<p>Судебное обжалование, недействительность сделки (ничтожность), последствия недействительной сделки; административная и уголовная ответственность, закупка ненужной продукции, закупка некачественной продукции, финансовые потери, нарушение сроков исполнения контракта, увеличение коррупции, потеря доверия власти</p>
<p>Игнорирование информации о продукции поставщика и возможности выполнить контракт в заявке и полученной из других источников</p>	<p>Заключение контракта с недееспособным поставщиком или поставщиком, неспособным выполнить контракт, непоставка или поставка некачественной продукции, срыв сроков исполнения контракта, финансовые издержки на повторное заключение контракта, судебное обжалование, издержки государства на коррупцию</p>

Корреляционный анализ процессных рисков размещения заказа показал взаимосвязь рисков не только по совокупности процедур одного процесса, но и влияние рисков одних процессов на проявление рисков иных процессов. То есть риски носят системный характер, и проявление одного из них в большинстве случаев вызывает синергетический эффект и проявление ряда других рисков по модели «снежного кома». Однако данное явление не носит всеобщий характер и специфично для разных групп рисков.

Таким образом, экспертная оценка текущей ситуации проявления рисков размещения заказа, основанной на предшествующем опыте размещения заказа экспертами, ниже прогнозной экспертной оценки, большая часть рисков находится на среднем уровне выраженности. Объем последствий проявления рисков по 17 рискам выше среднего уровня, причем большая часть процессных рисков относится к рискам моделирования торгов и носит коррупционный характер. Частота встречаемости всех выявленных рисков не превышает среднего уровня.

Д.О. Дерман,  
Д.Б. Цыганков  
Национальный исследовательский  
университет «Высшая школа  
экономики»

# СРАВНИТЕЛЬНЫЙ АНАЛИЗ ВНЕДРЕНИЯ ИНСТРУМЕНТОВ ОЦЕНКИ РЕГУЛИРУЮЩЕГО ВОЗДЕЙСТВИЯ В РОССИИ И СНГ<sup>1</sup>

---

Инструмент оценки регулирующего воздействия (ОРВ) нормативно-правовых актов, разработанный во второй половине XX в., обладает достаточно серьезными требованиями к дизайну системы принятия политических решений страны. Сложность используемого аналитического инструментария, применяемого в процессе оценки, подразумевает наличие компетентного государственного аппарата, ответственного за реализацию оценки. Основной целью использования ОРВ является максимизация эффективности затрат, зачастую неразрывно связанная с необходимостью их уменьшения. Таким образом, внедрение ОРВ в силу своей специфики сталкивается с целым спектром проблем, от решения которых непосредственно зависит успешность внедрения и дальнейшего его использования.

Настоящее компаративистское исследование было сфокусировано по следующим направлениям:

- выявление общих закономерностей в процессе внедрения механизма ОРВ на постсоветском пространстве;
- попытка разработки оптимального и реалистичного дизайна внедрения механизма ОРВ в странах СНГ и России;
- анализ действий Департамента ОРВ МЭР РФ с точки зрения выработанной оптимальной стратегии.

В ходе исследования были проанализированы действия трех стран СНГ, которые так или иначе пытались внедрить механизм ОРВ в деятельность госу-

---

<sup>1</sup> Данная исследовательская работа была выполненная в рамках ряда грантов Программы «Научный фонд ГУ ВШЭ» в 2009–2010 гг.

дарственных органов страны (Украина, Узбекистан, Кыргызстан). Использовался следующий инструментарий:

- анализ зарубежного опыта внедрения ОРВ;
- анализ нормативно-правовых актов стран СНГ;
- взаимодействие с зарубежными экспертами;
- разработка и использование контрольного листа, оценивающего эффективность процесса внедрения механизма ОРВ.

До настоящего времени исследования подобной направленности и масштаба по данной тематике в СНГ не проводились. Наиболее близкими работами, которые были взяты нами за основу при планировании исследования, являются доклад группы Манделькерн [Mandekern Group, 2001] и исследования «Mapping of ex-ante Policy Impact Assessment Experience and Tools in Europe» [Staronova, 2007]. В последней работе оценивается опыт внедрения механизма ОРВ в Боснии и Герцеговине, Хорватии, Сербии и Молдове – странах, схожих по уровню развития государственного управления со странами СНГ.

На основе изучения внедрения ОРВ в странах Западной Европы группой Манделькерн было выделено семь основных условий для успешного внедрения ОРВ [Mandekern Group, 2001, p. 19–20]:

- 1) процесс ОРВ должен быть неотъемлемой частью комплексной стратегии по совершенствованию нормативно-правовой среды;
- 2) концепция ОРВ и ее применение на практике нуждается в поддержке на самом высоком политическом уровне;
- 3) аналитические усилия, затраченные на проведение ОРВ, должны всегда пропорционально соответствовать предполагаемым результатам оцениваемой программы или политики;
- 4) там, где это возможно, подготовку ОРВ следует осуществлять силами заинтересованных официальных лиц и начинать ее нужно как можно раньше в процессе разработки политических решений;
- 5) результаты оценки должны опираться на информацию, поступающую от заинтересованных сторон, и являться предметом обсуждения в ходе официальных и неофициальных консультаций;
- 6) общее руководство процессом проведения ОРВ должно осуществляться отдельной независимой структурой, в обязанности которой входит как совершенствование нормативно-правовой базы, так и разработка рекомендаций и системы обучения государственных служащих;

7) для обеспечения работы системы, структурам, осуществляющим ОРВ, должны выделяться достаточные ресурсы для качественного и всестороннего анализа.

Из предложенных условий можно выделить пять (1, 2, 4 и 7, а также 6 в части обучения), которые являются универсальными, и отсутствие выполнения которых как раз и ведет обычно к неудаче при внедрении ОРВ.

В работе группы Манделькерн интерес также представляет стратегическая последовательность действий при внедрении ОРВ, хорошо структурированная в статье К. Староновой [Staronova, 2007, p. 13–14]. Она включает в себя следующие шаги:

1) проведение комплексной реформы законодательства и государственного управления, направленной на укрепление открытости, прозрачности и стратегического учета приоритетов, где ОРВ может быть использована как инструмент;

2) принятие нормативно-правового акта (постановления правительства, закона и др.), по которому ОРВ становится обязательным требованием для инициаторов наиболее значимых законодательных мер (министерств и других структур центрального правительства);

3) профессиональное развитие сотрудников, которым поручается провести ОРВ при формировании новой законодательной инициативы в отдельных отраслевых министерствах или в централизованной структуре; выделение ресурсов, достаточных для осуществления этой задачи;

4) создание централизованной структуры, ответственной и способной осуществлять общий надзор, координацию и «контроль качества» оценок влияния, прилагаемых к проектам законодательных актов (с полномочиями вернуть ОРВ низкого качества инициаторам законодательной инициативы на доработку);

5) поэтапное внедрение ОРВ во избежание неприятия или противодействия (например, проведение пилотных исследований, выборочное применение требований ОРВ к НПА и т.п.). Очень важно, чтобы эта начальная фаза не осталась ограниченной лишь узким кругом рассматриваемых законопроектов или не стала постоянной;

6) оценка и дальнейшая корректура изначальных сопроводительных материалов по требованиям к ОРВ для закрепления результатов начального этапа; определение санкций и вознаграждений для учреждений и организаций за несоблюдение или низкое качество ОРВ;

7) применение и использование ОРВ при принятии любых решений, имеющих значительные последствия и базовый скрининг ОРВ по всем совокупным мероприятиям политического курса;

- 8) формирование порядка оценки качества проведенных оценок;
- 9) формирование профессиональной сети «специалистов по ОРВ».

Как отмечается в работе, пункты 1–5 принадлежат к начальному этапу, а пункты 6–8 могут иметь место на этапе стабилизации. Необходимо понимать, что группой Манделькерна дана идеальная стратегическая последовательность. На самом деле изменение некоторых фаз не сильно влияет на итоговый результат внедрения, однако необходимость большинства этапов не ставится нами под сомнение.

Так, первая фаза – проведение комплексной реформы – необходима почти для всех стран, особенно, входящих в СНГ. Весь механизм ОРВ строится вокруг такого важного компонента государственной политики, как целеполагание. Соответственно, у государственных служащих должно быть четкое понимание того, куда движется политика в той или иной области, какие цели ставятся перед государственным аппаратом в средне- и долгосрочной перспективе. Иначе ОРВ теряет всякий смысл, так как даже получившая отличный отзыв программа может привести к плачевным результатам из-за того, что изначально была поставлена неверная цель регулирования или было выбрано неправильное направление политики. С другой стороны, укрепление открытости и прозрачности также необходимо, так как ОРВ подразумевает проведение максимально подробных количественных расчетов и качественных оценок. Поэтому без информационной базы, без наличия открытой информации относительно предыдущих программ и политик даже самая грамотная с методологической точки зрения оценка не сможет сделать релевантных выводов по анализируемой политике.

Например, К. Старонова отмечает, что для успешного осуществления всех этапов проведения ОРВ странам Восточной Европы пришлось достаточно существенно изменить принципы работы правительства. Так, был обеспечен более открытый процесс формирования политики взамен «традиционно существовавшего закрытого и политизированного процесса» [Staronova, 2007, p. 18]. Также для разработки механизмов стратегического планирования, способного определить как кратко- и средне-, так и долгосрочные приоритеты и потребности общества, внедрены или улучшены следующие инструменты:

- стратегическое планирование;
- горизонтальная и вертикальная координация;
- сбор данных;
- проверка качества и учета ненормативных правовых инструментов при рассмотрении возможных вариантов решения.

Через внедрение этих инструментов правительства стран решали задачу уязки механизма ОРВ с существующими схемами планирования и законодательными процессами.

Вторая фаза – принятие отдельного законодательного акта по ОРВ, а также нормативно закрепленное обязательное требование проведения ОРВ – необходимое условие для перехода оценки из статуса «механизма, внедряемого зарубежными фондами», в статус действительно работающего инструмента совершенствования процесса разработки государственной политики. Однако данная фаза может идти совместно и с первой фазой, либо стартовать несколько позже.

Формирование потенциала избранных сотрудников, и в первую очередь – разработка специализированных образовательных программ и дальнейшее повышение квалификации госслужащих, – на наш взгляд, одна из важнейших фаз в стратегии внедрения ОРВ, и начинаться она должна в России и странах СНГ как можно раньше. Более того, данная фаза должна идти раньше фазы принятия рамочного закона об ОРВ. Иначе требование обязательного проведения оценки может с самого начала стать очередной формальностью, так как попросту некому будет ее компетентно осуществлять. А такой удар по репутации новый инструмент может и не преодолеть, и тогда проведение ОРВ рискует остаться лишь на бумаге, либо ограничиваться формальными отписками.

А вот создание централизованной структуры, ответственной за проведение ОРВ, – не такая критичная для удачного внедрения фаза. Как было отмечено выше, можно ограничиться и отдельным Департаментом внутри основного министерства, ответственного за внедрение механизма, а также специалистами в каждом из государственных органов, где используется оценка. Более того, создание такого органа не всегда можно наблюдать и на более позднем этапе (этапе стабилизации). Создание нового государственного органа – задача дорогостоящая, а затраты на его создание и функционирование не всегда оправдываются теми (пусть и в долгосрочном периоде) выгодами и бюджетной экономией, которые дает ОРВ.

Анализируя опыт внедрения ОРВ в Восточной Европе, К. Староньова также отмечала важность двухуровневой структуры, отвечающей за реализацию ОРВ. Первый, горизонтальный, уровень составляют государственные служащие конкретных министерств, использующих в своей деятельности ОРВ. Именно они и занимаются проведением ОРВ. На них же, соответственно, лежит и ответственность за ее результаты. Как отмечает исследователь, это «порождает чувство причастности и интегрированности в процесс принятия решений» [Staronova,

2007, р. 32]. Тем не менее обязательно должен быть и второй уровень, выполняющий координирующую и надзорную функцию. Координирующее ведомство обычно несет ответственность за обеспечение руководства, поддержку, оценку и ревизию работы. Оно может подготовить инструкции по проведению оценки влияния в целом для отраслевых министерств, предоставить рекомендации по проведению отдельных заключений по оценке регулирующего воздействия, а также официально или неофициально оценить качество и глубину уже проведенных ОРВ. Староньова также делает вывод, что намного чаще этот уровень реализуется через создание структурного подразделения в уже существующем государственном органе, например, в Литве это отдел стратегического планирования в аппарате правительства.

Тем не менее все эти четыре этапа должны завершиться прежде, чем правительство может приступить непосредственно к реализации оценки. Первые шаги по проведению ОРВ описывает пятая фаза. К сожалению, во многих странах (особенно с активными зарубежными фондами-донорами) процесс внедрения ОРВ сразу начинают с этой фазы. Без подготовки государственного механизма, без какого-либо закрепления процедуры на законодательном уровне, с минимальным количеством проведенных (зачастую необязательных) тренингов для государственных служащих – сразу начинается пилотный проект по оценке регулирующего воздействия какого-либо выбранного совместно закона, обычно финансируемый как раз этим фондом. Пилотный проект реализуется, деньги заканчиваются, а процесс внедрения ОРВ, не имея никакой другой базы кроме зарубежного финансирования, сворачивается.

Шестая, восьмая и девятая фазы описывают обычное становление и развитие методологии любого внедряемого инструмента и так или иначе присутствуют в любой стране, в которой применение ОРВ закрепилось.

А вот седьмая фаза носит достаточно дискуссионный характер. Группа Манделькерна, рассматривая ее, утверждает, что ОРВ должно использоваться при «принятии любых решений, имеющих значительные последствия», а базовый скрининг вообще должен применяться всегда. На самом деле, если исходить из этого критерия, то даже ЕС до конца не внедрила ОРВ в свою практику. Более того, данная фаза противоречит одному из базовых принципов проведения ОРВ – пропорциональности. Действительно, даже в ЕС существует большое количество важных государственных программ и политик, оценка которых (ввиду их специфики) невозможна, либо экономически неоправдана.

Подводя итог анализу представленной группой Манделькерна стратегии внедрения ОРВ в стране, можно сделать вывод, что в целом большинство пере-



численных этапов универсальны и деятельность в этом направлении необходима для успешного внедрения механизма ОРВ в любой стране. С другой стороны, для адаптации стратегии к особенностям принятия государственных решений в России и странах СНГ, необходимо несколько по иному расставить ключевые акценты и переформатировать структуру стратегии.

Для анализа внедрения ОРВ в странах СНГ нами была разработана стратегия внедрения механизма ОРВ, включающая в себя три фазы и десять стратегических направлений, эффективная работа государства по каждому из которых определяет общий успех внедрения механизма. Они были сгруппированы в оценочном листе с описанием каждого направления и трехступенчатой градацией эффективности.

На следующей сравнительной таблице по трем странам СНГ серым выделены те направления, к которым в том или ином государстве приложили недостаточно усилий.

№	Стратегические направления	Украина	Узбекистан	Кыргызстан
0.0	Поддержка	На уровне Президента	На уровне Кабинета Министров	Отсутствует понимание базовых принципов ОРВ
1.1	Законодательные изменения	Комплексная реформа	Разработан поэтапный план изменений	«Изменения за месяц». De facto отсутствуют
1.2	Законодательная основа	Закон	Постановление Кабинета Министров	Указ Президента
1.3	Обучение	40 семинаров в 28 госорганах (2008 г.)	Специализированные программы	Отсутствует
1.4	Двухуровневая структура	Госкомитет + структурные подразделения (не везде)	Межведомственная комиссия, структурные подразделения не созданы	Межведомственная комиссия, структурные подразделения не созданы

Какие получились результаты внедрения ОРВ? В Украине ОРВ используется с 2004 г., по информации Госкомитета Украины, оценено более 1100 законопроектов, НПА, принятых на центральном уровне, а с учетом регионов и муниципалитетов – более 2000. Соответственно мы можем классифицировать данные на основе конечных результатов как «историю успеха».

В Узбекистане до лета 2010 г. процесс развивался примерно как и в России. В 2008 г. было проанализировано 8 пилотных законопроектов, причем на

основе ОРВ три из них были отклонены. Таким образом, есть все предпосылки для развития этой системы, для содержательной работы механизма ОРВ при условии организации нормального обучения, изменения структуры. В Узбекистане мы видим «многообещающий пилотный проект», который сейчас несколько притормозился (возможно, в силу уменьшения технической помощи международных доноров?).

В Кыргызстане было проанализировано к 2008 г. всего 20 законопроектов. Сейчас желание внедрения ОРВ в стране существует, однако нет достаточного опыта и времени. Кроме того, ОРВ осуществляют люди, непосредственно реализующие политику, которые, естественно, не всегда находят время для оценки. Соответственно в Кыргызстане мы видим «историю провала».

По итогам исследования можно сделать следующие выводы.

1. Внедрение ОРВ в России и странах СНГ возможно.
2. Для этого нужно провести некоторые активные действия, которые необходимы и достаточны для успешного внедрения.
3. Эти активные действия могут быть для стран примерно одинаковыми, а именно:

– на подготовительной фазе усилия драйверов внедрения должны быть сконцентрированы на проведении ключевых законодательных изменений для приведения процесса разработки государственных программ и законопроектов к стандартам, требуемым ОРВ, а также на анализе законодательства на предмет выявления остальных «слабых мест» и разработке поэтапного плана их устранения. В дополнение к этому сфера и порядок использования ОРВ должны быть четко прописаны и закреплены в нормативно-правовых актах. Описанные усилия способствуют более гармоничному внедрению ОРВ в существующий механизм принятия нормативно-правовых актов, а также минимизирует риск саботажа проведения ОРВ со стороны государственных служащих. Кроме того, на данном этапе критично важна разработка и проведение курсов обучения государственных служащих, так как без высокого качества подготавливаемых заключений можно легко дискредитировать внедряемый механизм. Наконец, на подготовительной фазе четко должны быть прописаны сферы ответственности по подготовке заключений ОРВ на ведомственном уровне. На основе проведенного исследования можно сделать вывод, что достаточным является выделение специального структурного подразделения внутри одного из министерств экономического блока, которое наделяется полномочиями по внедрению и методологической поддержке механизма ОРВ, координации процесса обучения госслужащих, а также контролирует качество ОРВ, проведенных внутри ми-

нистерств, инициирующих разработку нормативно-правовых актов, подпадающих под оценку;

– на этапе начального использования ОРВ основным риском, на минимизацию которого должна быть направлена деятельность, является риск недостаточного качества подготовленных заключений и потеря доверия к инструменту. Поэтому необходима разработка поэтапного плана проведения ОРВ с целью постепенного закрепления механизма в практике деятельности госслужащих, а также выделения достаточного количества финансовых и временных ресурсов для подготовки заключений. Так, здесь может быть использована практика пилотных проектов или сокращенного варианта оценки в дополнение к ограничению анализируемых проектов нормативно-правовых актов. Кроме того, работа над заключением должна начинаться за достаточное количество времени до срока вынесения проекта НПА на утверждение;

– на этапе стабилизации необходимо провести ревизию методологической базы оценки с целью учета национальной специфики, а также накопленного опыта проведения ОРВ на предыдущих этапах. Достаточным можно считать совершенствование методологических пособий и внутренних инструкции по проведению оценки, а также четкое установление ответственности сторон. Также на данном этапе требует дальнейшей конкретизации сфера применения ОРВ, необходима разработка и утверждение годового плана работ и списка проектов, для которых оценка является обязательной.

На основе описанной стратегии была проанализирована деятельность Департамента ОРВ Минэкономразвития в августе – декабре 2010 г. Исследование показало, что в целом была выбрана правильная траектория внедрения, адекватно и в полной мере оценены риски проекта. Тем не менее по некоторым направлениям деятельности декларируемые активности и прилагаемые усилия недостаточны, что не позволяет однозначно прогнозировать успех процесса внедрения механизма ОРВ в систему разработки НПА в России. Побочным результатом настоящего исследования является разработка унифицированной модели оценки эффективности стратегии внедрения ОРВ, которая может быть применена при анализе данного процесса в странах постсоветского пространства.

## Литература

- Mandelkern Group Report. Final Report, Brussels, 13 November. 2001.  
Staronova K. Mapping of Ex-ante Policy Impact Assessment Experience and Tools in Europe: A Resource Book for Practitioners, 2007.

# АЛГОРИТМ ПЕРЕДАЧИ НА АУТСОРСИНГ АДМИНИСТРАТИВНО- УПРАВЛЕНЧЕСКИХ ПРОЦЕССОВ ОРГАНАМИ ИСПОЛНИТЕЛЬНОЙ ВЛАСТИ

---

## Постановка задачи и актуальность

В рамках административной реформы аутсорсинг рассматривается как инструмент оптимизации *административно-управленческих процессов* (АУП), необходимых для оказания государственных услуг и исполнения государственных функций, закрепленных за органами исполнительной власти (ОИВ), а также снижения затрат на содержание и повышения качества работы ОИВ.

Однако, по оценке многих авторов, на сегодняшний день «разработка и внедрение системы, принципов и механизмов аутсорсинга АУП на территории Российской Федерации не реализованы» [Филатова, 2009]. Одной из причин, которая создает серьезные препятствия на пути применения аутсорсинга ОИВ, является предубеждение представителей ОИВ. Они считают, что основная деятельность органов власти не должна передаваться на исполнение частному сектору. Другой причиной недостаточного распространения практики передачи внешним организациям рутинной и трудоемкой деятельности в рамках АУП, на наш взгляд, является отсутствие методической базы.

В статье обоснованы методологические основы анализа АУП и предложен алгоритм действий по принятию решения о передаче деятельности, связанной с выполнением государственной функции, внешним организациям на основе контракта. В рамках этого алгоритма необходимо получить ответ на следующие вопросы.

1. Какую деятельность целесообразно передавать внешней организации?
2. Какие риски возникают при передаче деятельности на аутсорсинг и как их снизить в рамках контракта?

Как управлять АУП после передачи его или части АУП внешней организации?

## Терминология

Термин «аутсорсинг» представляет собой аббревиатуру фразы «outside resource using» (использование внешних ресурсов). Передача деятельности на аутсорсинг означает отказ от собственного процесса и покупку услуг по его реализации у внешних организаций.

Под «аутсорсингом АУП» в данной работе мы будем понимать делегирование независимым внешним организациям части полномочий ОИВ, необходимых для решения закрепленных за ним задач, а также передачу отдельных административных процедур, действий или операций (далее – деятельности) в рамках некоторого АУП.

АУП разрабатываются самостоятельно каждым ОИВ для реализации государственных функций и оказания государственных услуг, закрепленных за ним Положением о его деятельности, и фиксируются в административных регламентах. Детальное рассмотрение регламентов позволяет разложить АУП на процедуры, каждая из которых включает последовательность действий, состоящих из ряда отдельных операций. Декомпозиция АУП на операции позволит выделить деятельность, которую целесообразно вынести за границы ОИВ. Декомпозиция АУП исполнения государственной функции представлена на рис. 1 на примере функции Комитета финансов Санкт-Петербурга по управлению ликвидностью бюджета и рисками.



Рис. 1. Декомпозиция государственной функции

Основные этапы процесса передачи АУП на аутсорсинг:

1. Декомпозиция существующего АУП и оценка целесообразности передачи на аутсорсинг его отдельных процедур/операций.
2. Описание делегируемой деятельности и/или ее результатов и определение параметров контракта при подготовке конкурсной документации.
3. Организация и проведение конкурса по отбору аутсорсера и заключение государственного контракта с победителем (победителями) конкурса.
4. Планирование и внедрение в ОИВ решений, связанных с применением аутсорсинга. Взаимодействие с аутсорсером, координация действий и мониторинг исполнения контракта.

Рассмотрим факторы, которые важно учитывать при выборе деятельности, передаваемой на аутсорсинг, и разработке параметров контракта для снижения транзакционных издержек.

## **Критерии выбора деятельности, передаваемой на аутсорсинг**

С экономической точки зрения целесообразность применения аутсорсинга АУП определяется соотношением тех выгод, которые несет передача деятельности внешней организации, и тех дополнительных издержек, которые возникают в связи с этой транзакцией. С аутсорсингом связаны следующие потенциальные выгоды:

- сокращение трансформационных издержек и/или повышение качества конечных результатов процесса;
- повышение эффективности оставшихся за организацией видов деятельности за счет концентрации ресурсов, сокращения потерь времени на переключение с ключевого вида деятельности на вспомогательный и обратно, уменьшения численности персонала и т.п.;
- получение быстрого доступа к ресурсам, которыми организация не располагает, в том числе к инновационным, и т.п.

На выбор деятельности для передачи ее на аутсорсинг в условиях ОИВ дополнительно влияют:

- легитимность ее вывода за пределы ОИВ;
- сложность ее делегирования с точки зрения последующего реинжиниринга АУП;

- риски возникновения ущерба у ОИВ и прочих представителей, подвергающихся воздействию внешних эффектов от исполнения государственной функции, вследствие оппортунизма аутсорсера.

Государственные функции являются нормативно-установленным видом властной деятельности ОИВ, поэтому АУП по реализации таких функций включают в себя процедуры принятия решений, обязательность исполнения которых для определенного круга физических и юридических лиц обеспечивается властными полномочиями ОИВ. Очевидно, что процессы принятия такого рода решений не могут передаваться внешним организациям. Так, в рамках реализации полномочий ОИВ по контролю и надзору процедуры согласования и принятия решений о проведении плановых и внеплановых проверок организаций, очевидно, не могут быть переданы сторонней организации. Однако действующее законодательство позволяет для непосредственного проведения проверки привлекать физических лиц или организации, аккредитованные государственными органами в качестве экспертов по данному виду деятельности.

АУП, обеспечивающие реализацию функции, могут быть условно разделены на элементарные и композитные. К первым относятся те процессы, результат которых достигается в рамках одного структурного подразделения ОИВ. К композитным следует отнести АУП, в которых участвуют два и более подразделения, а конечный продукт процесса формируется в результате совместного исполнения собственных административных процедур, действий или операций каждым подразделением. В таких АУП возникают проблемы координации деятельности подразделений, согласования решения о применении аутсорсинга, определения четких границ разделения полномочий.

Вследствие того, что исполнение функции влияет не только на эффективность деятельности ОИВ, но и на представителей, являющихся прямыми или косвенными потребителями результатов исполнения этой функции, деятельность с недопустимо высокими рисками возникновения ущерба у ОИВ и прочих представителей, подвергающихся такому воздействию из-за оппортунизма аутсорсера, должна оставаться внутри границ ОИВ.

Потенциальные выгоды от передачи деятельности внешней организации зависят как от особенностей деятельности, так и от наличия на рынке конкуренции между компетентными поставщиками за право предоставления услуги по осуществлению делегируемой деятельности [Lacity, Willcocks, Feeny, 2005]. От деятельности зависит наличие рынка услуг по ее выполнению внешними организациями, а от конкуренции между поставщиками – возможность уменьшения стоимости услуг требующегося заказчиком качества. Также Кеттл Д. [Kettl, 1993]

указывал на возможность проявления отрицательных внешних эффектов в результате снижения эффективности рынка, например, вследствие монополизации рынка аутсорсером, получившим крупный контракт на оказание услуг, и, соответственно, ухудшения потенциала снижения трансформационных издержек.

Однако необходимо учитывать и то, что применение аутсорсинга целесообразно только в том случае, когда делегирование деятельности обоюдно выгодно как заказчику, так и его исполнителю. Возможность использования преимуществ экономии от масштаба является тем источником снижения затрат на выполнение деятельности, который может привлечь потенциального аутсорсера предложить собственные услуги заказчику и выполнить работу в соответствии с ожиданиями ОИВ.

Таким образом, для того чтобы передача деятельности ОИВ на аутсорсинг была экономически целесообразной, необходимо: существование рынка такой деятельности; наличие на рынке конкуренции между компетентными поставщиками за право предоставления услуги государству, отсутствие отрицательных внешних эффектов от ее передачи на аутсорсинг, а также потенциальная возможность использования аутсорсером преимуществ экономии от масштаба.

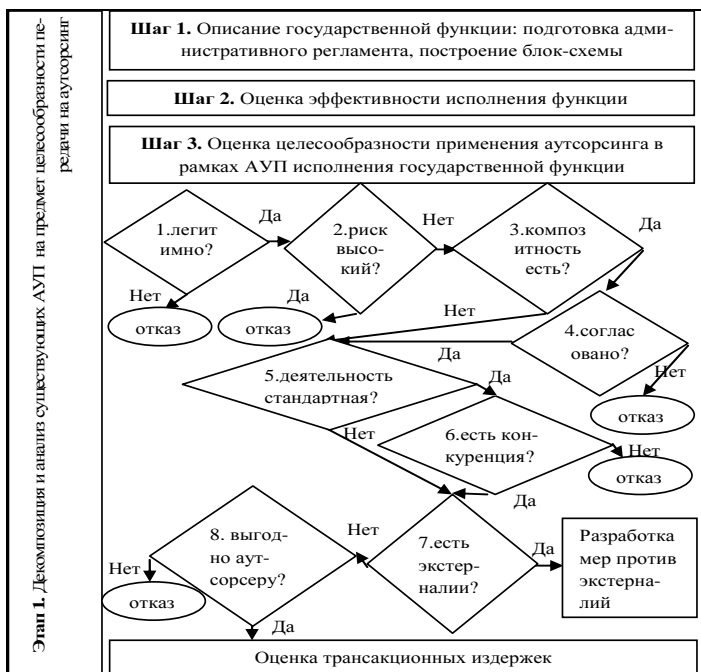


Рис. 2. Выбор деятельности для передачи на аутсорсинг



## Оценка транзакционных издержек и выбор параметров контракта

В рамках аутсорсинга в реализацию АУП вовлекается внешняя организация. В результате, во-первых, меняется исходный АУП исполнения государственной функции. Во-вторых, важным элементом управления процессом реализации функции становится контракт, регулирующий отношения между ОИВ и аутсорсером. Это порождает у ОИВ специфические управленческие проблемы и ведет к росту транзакционных издержек. Природа этих издержек, факторы, влияющие на их величину, а также механизмы контроля и снижения их уровня исследованы в рамках экономической теории транзакционных издержек [Уильямсон, 1996]. Уровень транзакционных издержек, как *ex ante*, так и *ex post* зависит от специфики делегируемой деятельности ОИВ.

При разработке проекта контракта определяются три группы параметров: *спецификация требований* к организации и результатам процесса, передаваемого на аутсорсинг, выбор *системы стимулирования* и *механизмов принуждения*, снижающих транзакционные издержки, связанные с оппортунизмом аутсорсера в условиях неполноты контракта. Проблемы возникают при спецификации услуг специального назначения, которые отличаются сложностью АУП, отсутствием у заказчика детальных знаний об особенностях и возможных способах реализации делегируемого процесса.

В условиях, когда на аутсорсинг передается деятельность специального назначения, лучшим способом спецификации требований к делегируемым полномочиям является описание результатов, которые заказчик ожидает получить по факту исполнения деятельности. Но при этом перед ОИВ встает задача разработки показателей результата деятельности аутсорсера и получения доступа к достоверным данным, на основе которых будет осуществляться расчет этих показателей. При делегировании деятельности стандартного назначения ОИВ может представить требования как к результату, так и к процессу его создания.

Стоит подчеркнуть еще один важный аспект аутсорсинга АУП: оценка качества предоставляемой аутсорсером услуги возможна исключительно только после заключения контракта. Используя классификацию потребительских благ Нельсона [Nelson, 1970], услуги аутсорсера по реализации государственных функций можно отнести к экспериментальным благам. Зачастую издержки на измерение качества такого блага достаточно высоки, поэтому заказчику необходимо получить информацию о способности поставщика предоставлять услуги надлежащего качества *ex ante*, до заключения контракта. Для этого он может

воспользоваться «сигналами» рынка или услугами специализированных институтов. В качестве источника такой информации может выступать система лицензий, сертификатов или дипломов, в рамках которой качество блага или способности поставщика подтверждаются профессиональным сообществом [Юдкевич, Пивоварова, 2009]. В случае делегирования деятельности специального назначения заказчик может провести предквалификацию поставщиков, чтобы оценить их производственные возможности и репутацию на рынке самостоятельно либо с привлечением третьих лиц, что ведет к увеличению транзакционных издержек на измерение.

Рост транзакционных издержек также может быть обусловлен сложностью встраивания деятельности внешней организации в существующий АУП, которая связана с низкой стратегической зрелостью процессов управления деятельностью ОИВ. Издержки возникают в связи с необходимостью передачи аутсорсеру знаний, которые в силу низкой стратегической зрелости АУП слабо формализованы, плохо документированы. ОИВ, во-первых, сталкивается с проблемой формализации знаний, а, во-вторых, оказывается «запертым» в сделку с аутсорсером. Передача знаний и навыков представляет собой инвестиции в специфические активы, которые должен создать ОИВ при применении аутсорсинга. В этом случае для органа власти повышается ценность непрерывных отношений с аутсорсером и увеличивается риск оппортунизма с его стороны, что порождает издержки мониторинга и принуждения исполнения контракта. Дополнительные проблемы возникают в случае высокой неопределенности в сфере делегируемой деятельности, которая не позволяет или даже делает неэффективным заключение полного контракта. Во всех этих случаях ОИВ должен либо отказаться от аутсорсинга, либо предусмотреть в контракте и в новом АУП соответствующие *гарантии непрерывности отношений и защиты от проявления оппортунизма*.

Чтобы снизить *ex post* оппортунизм, в контракт необходимо включить механизмы, позволяющие минимизировать риски сторон контракта. Наибольшую значимость приобретают те из них, которые позволяют еще на этапе *ex ante* смягчить конфликты, а также разработать формальные и неформальные правила, с помощью которых могут быть урегулированы споры на этапе *ex post*. Среди них выделяют:

- различные схемы выплаты вознаграждения;
- механизмы принуждения;
- механизмы контроля и координации деятельности участников АУП.

Выплаты вознаграждения по принципу «фиксированного платежа» позволяют не допустить роста транзакционных издержек на принуждение к ис-

полнению контракта, если деятельность является стандартной, ее сфера обладает низкой неопределенностью и существует возможность контроля результатов выполнения деятельности [Tadelis, 2002]. Схему выплаты вознаграждения по принципу «зависимости от показателя» (например, от количества выписанных штрафов за выявленное нарушение правил парковки) эффективно применять, если на этапе *ex ante* заказчик в силу высокой неопределенности сферы деятельности не способен точно определить объем работ и стоимость контракта. Однако использование этой схемы предполагает, что заказчик может сформулировать набор показателей, отражающих результат деятельности аутсорсера, и создать систему мониторинга, позволяющую собрать необходимые и достоверные данные для расчета показателей. Схема выплаты по принципу «издержки плюс маржа» применяется, если деятельность нестандартная, а высокая неопределенность ее среды препятствует точной оценке объема и стоимости контракта. Но она в большей степени ориентирована на процесс выполнения деятельности, чем на результат, в связи с чем у аутсорсера могут отсутствовать стимулы по сокращению затрат за счет инноваций по качеству продукта деятельности, поэтому такую схему предпочтительно использовать в комбинации со схемой выплаты дополнительного вознаграждения за достигнутые успехи.

Включение в контракт между ОИВ и аутсорсером обязательств обусловлено необходимостью создания соответствующих механизмов принуждения к исполнению контракта. Кронман [Kronman, 1985] выделил несколько методов создания формальных механизмов.

«Заложники» и залого предоставляются ОИВ в заверение того, что деятельность будет выполнена согласно условиям контракта. Например, предоставление аутсорсером гарантии исполнения контракта в форме залога денежных средств, поручительства третьих лиц, страховки. Применение «заложников» и залога является оптимальным вариантом при делегировании деятельности, по которой существует развитый рынок, поскольку эти механизмы принуждают исполнителя выполнить деятельность в соответствии с условиями контракта, но не привязывают аутсорсера к ОИВ, так как при передаче на аутсорсинг деятельности стандартного назначения ОИВ с малой долей вероятности столкнется с проблемой поиска нового исполнителя.

При передаче деятельности специального назначения ОИВ заинтересован в поддержании непрерывных отношений с исполнителем. В такой ситуации на первый план выходит задача создания крепких связей между ОИВ и аутсорсером. Механизм «связывания рук» решает эту задачу. «В каждом случае тот, кто принимает на себя обязательство, вначале совершает нечто, что делает последующее нарушение этого обязательства с его стороны более дорогостоящим»

[Kronman, 1985]. Например, аутсорсер при предоставлении услуг ОИВ использует информационную систему, принадлежащую заказчику. Нарушение обязательств исполнителем ведет к расторжению контракта, и аутсорсер лишается права пользования системой и, соответственно, теряет навыки, полученные за время осуществления деятельности на аутсорсинге.

Механизм «объединение» как «любое устройство, целью которого является уменьшение дивергенции сторон посредством развития духа единения или симпатии между ними» [Kronman, 1985], также может содействовать непрерывности отношений, и его предпочтительнее использовать, если отсутствует возможность «связать руки» либо в случае «запертости» заказчика в сделку. Например, создание специализированной организации с участием исполнителя и заказчика в качестве учредителей, в которой каждый будет заинтересован в результатах ее деятельности.

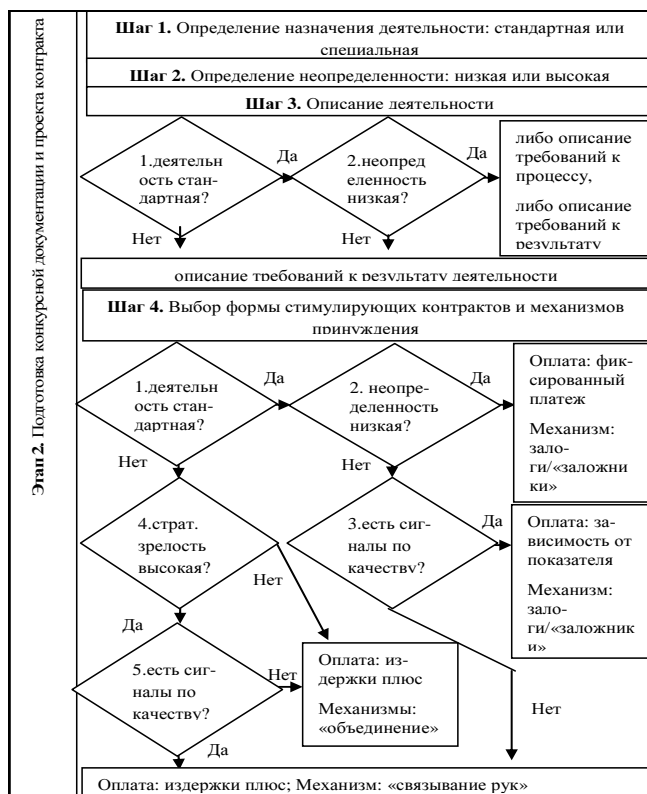


Рис. 3 Выбор параметров контракта

Действенность указанных механизмов защиты от оппортунизма зависит от наличия возможностей ОИВ осуществлять мониторинг за деятельностью аутсорсера, а также системы координации, позволяющей ОИВ получать информацию от прочих участников о недостатках в поведении аутсорсера, вовремя информировать его об этом и принимать совместные решения по сложившейся ситуации. Выбор механизмов защиты должен найти свое отражение как в конкурсной документации при описании требований к деятельности, так и в структуре государственного контракта.

## **Заключение**

Проведенный анализ позволяет сделать следующие выводы.

Целесообразность и экономическая эффективность передачи на аутсорсинг АУП, реализуемых в органах власти, определяется множеством факторов, как внутренних, так и внешних по отношению к ОИВ. Принятие решения о делегировании деятельности, традиционно выполнявшейся внутри ОИВ, требует анализа всей совокупности факторов, поэтому априорно невозможно выделить виды деятельности, которые следует передать на аутсорсинг.

Внедрение и развитие аутсорсинга в ОИВ требует от государственных служащих обновления знаний и развития новых компетенций в области управления. Это, прежде всего, касается навыков в сфере формализации и документирования АУП на основе процессного подхода для выделения и спецификации видов деятельности, потенциально пригодных для аутсорсинга, а также в области разработки контрактов и управления отношениями с контрагентами на их основе. Указанные компетенции позволят государственным служащим осуществлять в рамках предложенного алгоритма системный анализ внутренних и внешних факторов, определяющих специфику реализации АУП исполнения государственной функции, выбирать вид деятельности для передачи на аутсорсинг и создавать соответствующие инструменты управления отношениями в зависимости от этих факторов.

## **Литература**

*Уильямсон О.И.* Экономические институты капитализма. Фирмы, рынки, «отношенческая» контрактация. СПб.: Лениздат, 1996.

*Филатова А.В.* Аутсорсинг административно-управленческих процессов // Предпринимательское право. 2009. № 1. С. 14–17.

*Юдкевич М.М., Пивоварова С.Г.* Классификация благ и выбор оптимальной процедуры в системе государственных закупок // Госзаказ: управление, размещение, обеспечение. 2009. № 18. С. 54–61.

*Kronman A.T.* Contract Law and the State of Nature // Journal of Law, Economics, & Organization. 1985. P. 5–32.

*Kettl D.F.* Sharing Power: Public Governance and Private Markets. The Brookings Institution, 1993.

*Lacity M., Willcocks L., Feeny D.* Taking the Measure of Outsourcing Providers // Sloan Management Review. 2005. Spring. P.45–48.

*Nelson P.* Information and Consumer Behaviour // Journal of Political Economy. 1970. 78. № 2. P. 311–329.

*Tadelis S.* Complexity, Flexibility, and the Make-or-Buy Decision // The American Economic Review. 2002. Vol. 92. № 2. P. 433–437.

# **КОРРУПЦИЯ КАК ФАКТОР СНИЖЕНИЯ КОНКУРЕНТОСПОСОБНОСТИ ГОСУДАРСТВА: СОПОСТАВИТЕЛЬНО- ИНСТИТУЦИОНАЛЬНЫЙ АНАЛИЗ**

---

Основным двигателем современного демократического государства служит добросовестная, транспарентная и профессиональная конкуренция – политическая, экономическая, информационная и в целом социальная, которую Людвиг фон Мизес определил как «стремление индивидов занять наиболее благоприятное положение в системе общественного сотрудничества» [Мизес, 2000, с. 259].

В тех государствах, в которых власть способствует подавлению конкуренции, а именно государственная власть является той главной силой, которая может и способна ее подавить, на первый план в качестве основы функционирования государства неизбежно выходит «раковая опухоль общественных отношений» – коррупция.

Традиционно коррупция рассматривается, прежде всего, в качестве фактора в экономической сфере, тесной взаимосвязанного с негативной (теневой) экономикой [Гевелинг, 2001, с. 45]. И в качестве цели такого проявления коррупции, которое обозначается как экономическая коррупция, выступает материальная выгода, материальное обогащение в том или ином виде.

В контексте функционирования государства принято выделять виды экономической коррупции в соответствии с теми иерархическими уровнями государственной власти, которые она поражает.

Назовую экономическую коррупцию, распространяющуюся на нижнем и среднем уровнях государственной власти, называют административной (должностной, бюрократической) коррупцией. Административная коррупция определяется как «намеренное искажение практик применения действующих законов, правил и норм для предоставления преимуществ государственным и

негосударственным экономическим агентам посредством незаконных и непрозрачных частных выплат государственным должностным лицам» [Anticorruption in Transition, 2000, p. 17]. Административная коррупция подразделяется на бытовую и деловую коррупцию. Бытовая коррупция возникает при взаимодействиях граждан с органами, учреждениями и должностными лицами нижнего уровня государственной власти. Деловая коррупция возникает, прежде всего, при взаимодействии субъектов частного сектора экономики и иных хозяйствующих субъектов с органами, учреждениями и должностными лицами нижнего и среднего уровней государственной власти.

Для обозначения верхушечной экономической коррупции, которая поражает верхний уровень системы государственной власти и управления, используется понятие «*state capture*». Наиболее точной по смыслу интерпретацией этого понятия в переводе на русский язык представляется «скупка государства». Авторы этого понятия определили его как «способность фирм воздействовать на формирование базовых правил игры (т.е. законов, указов, положений и инструкций) посредством незаконных и непрозрачных частных выплат государственным должностным лицам» [Hellman, Jones, Kaufmann, 2000]. При этом под фирмами понимаются различные экономические агенты. Из приведенного определения следует, что смысловое содержание понятия «*state capture*» состоит именно в скупке государства путем подкупа его высших должностных лиц для того, чтобы «скупщики, формируя его политику, правовую и регуляторную среду в собственных интересах, могли получать сконцентрированную ренту за счет остальной экономики» [Ibid].

Распространение экономической коррупции в системе государственной власти означает, что некоторые должностные лица, обладающие государственно-властными полномочиями и правами распоряжаться ресурсами власти, используют это для личного или группового материального обогащения. Но для того чтобы таким образом использовать ресурсы власти, необходимо сначала завоевать и удержать власть, создав соответствующий политический режим. Инструментом решения этой задачи также служит коррупция, цель которой в данном случае состоит в достижении не материальной, а политической выгоды.

Это позволяет рассматривать коррупцию не только как экономическое, но и как политическое явление и выделять политическую коррупцию, которую можно определить как использование лицом, занимающим государственную должность, доверенных ему государственно-властных полномочий и прав, служебного положения и статуса в системе государственной власти, статуса органа государственной власти, который он представляет, в целях противоправного



извлечения личной и (или) групповой, в том числе и в пользу третьих лиц, политической выгоды (политического обогащения).

Политическую коррупцию можно систематизировать по стадиям процесса взаимодействия политических акторов с государственной властью и разделить на коррупцию на стадии завоевания (удержания) власти и на стадии ее использования.

При завоевании (удержании) власти посредством выборов на высшие государственные должности может иметь место выборная коррупция, которую можно определить как создание преимуществ представителям правящих политических сил и групп, подавление их политических конкурентов и искажение свободного волеизъявления граждан посредством противоправного использования в ходе избирательного процесса государственных структур, их должностных лиц и ресурсов.

Политическую коррупцию на стадии использования государственной власти пришедшими во власть политическими акторами предлагается называть приватизацией власти. Приватизацию власти можно определить как присвоение себе правящими политическими акторами всех государственно-властных полномочий и прав, полное устранение политической оппозиции посредством законодательного и иного нормативно-правового формирования политических порядков и правил, а также кадровых назначений в системе государственной власти.

Конечной формой коррупции является захват государства. Захват государства представляет собой такое проявление коррупции, при котором государственная власть приватизируется правящими политико-экономическими группировками и все властно-принудительные полномочия и виды административного ресурса государственной власти направляются на захват природных ресурсов и земли, основных потоков финансовых средств, государственной и частной собственности и имущества, самых прибыльных экономических агентов, как в государственном, так и в частном секторе, а также наиболее влиятельных средств массового распространения информации для их использования в целях материального обогащения членов правящих группировок.

Захват государства всегда начинается с политической коррупции. Политический и государственный деятель, достигший и удерживающий власть посредством политической коррупции, теряет иммунитет ко всем видам коррупции, к коррупции как таковой [Нисневич, 2010, с. 60].

В «захваченном» государстве политическая и экономическая коррупция приобретает системный характер и становится основой функционирования государства, вытесняя конкуренцию и способствуя образованию монополий, под-

чиненных правящим группировкам, в политической, экономической, информационной и иных сферах жизнедеятельности общества и государства.

В современном мире коррупция представляет собой существенную проблему для большинства государств, из них насчитывается не более двадцати пяти, в которых коррупция успешно подавляется. В Конвенции ООН против коррупции отмечается «серьезность порождаемых коррупцией проблем и угроз для стабильности и безопасности общества, что подрывает демократические институты и ценности, этические ценности и справедливость и наносит ущерб устойчивому развитию и правопорядку» [Конвенцией ООН против коррупции, 2003]. Но, несмотря на это, распространенными остаются представление коррупции как средства дерегулирования – «смазки» для сокращения бюрократических барьеров [Huntington, 1968] и концепция «благодетельной коррупции» [Геллинг, 2001, с. 41–44].

Но, если концепция «благодетельной коррупции» верна, то государства, основной функционирования которых служит коррупция, должны успешно конкурировать с государствами, в которых коррупция в существенной мере подавлена. Однако более достоверной представляется гипотеза о том, что коррупция является фактором снижения конкурентоспособности государства. Для верифицируемой проверки этой гипотезы можно применить метод сопоставительно-институционального анализа. Суть этого метода заключается в сопоставлении различных институциональных характеристик государства как единичного объекта исследования с целью выявления существующих между ними взаимосвязей и трендов влияния, исходными данными для чего служат количественные оценки исследуемых характеристик, полученные для большинства существующих сегодня в мире суверенных государств как результат государствоведческих исследований [Нисневич, 2011].

Для оценки состояния коррупции могут быть использованы результаты двух государствоведческих исследований.

Наиболее представительные и авторитетные исследования состояния коррупции в различных государствах ежегодно проводит организация Трансперенси Интернешнл (Transparency International). С 1995 г. эта организация определяет такой показатель состояния коррупции, как индекс восприятия коррупции (Corruption Perceptions Index). Индекс восприятия коррупции (ИВК<sub>Т</sub>) отражает восприятие уровня коррупции аналитиками и предпринимателями, как проживающими в стране, так и зарубежными, и оценивается по шкале от 10 (коррупция практически отсутствует) до 0 (очень высокий уровень коррупции). В период с сентября 2009 г. по сентябрь 2010 г. ИВК<sub>Т</sub> был определен для 174 суверенных государств [Corruption Perceptions Index 2010].

Оценку состояния коррупции в различных государствах предоставляет также Всемирный банк (The World Bank) по результатам проводимого с 1996 г. исследования качества государственного управления (*governance matters*). В этом исследовании определяется такой индикатор, как сдерживание коррупции (*control of corruption*), который характеризует воздействие на публичную власть незаконных частных выплат государственным должностным лицам, включая как низовые, так и верхушечные формы коррупции и в том числе скупку государства в частных интересах. Индекс сдерживания коррупции (ИСК<sub>WB</sub>) оценивается по шкале от -2,5 (очень высокое воздействие коррупции) до 2,5 (воздействие коррупции практически отсутствует). В опубликованных в 2010 г. результатах исследования приведены данные по ИСК<sub>WB</sub> для 191 суверенного государства по состоянию на 2009 г. [The Worldwide Governance Indicators, 2010].

Для оценки конкурентоспособности государства могут быть также использованы результаты двух государствоведческих исследований.

Наиболее представительные и авторитетные исследования экономической конкурентоспособности современных государств ежегодно проводит Всемирный экономический форум (World Economic Forum). С 1979 г. эта организация определяет индекс глобальной конкурентоспособности (Global Competitiveness Index), который оценивается по шкале от 1 (минимальная конкурентоспособность) до 7 (максимальная конкурентоспособность). В опубликованном в сентябре 2010 г. отчете приведены данные по индексу глобальной конкурентоспособности (ИГК<sub>WEF</sub>) для 137 суверенных государств [The Global Competitiveness Report 2010–2011].

Если исходить из того, что главная задача современного государства состоит в обеспечении высокого качества жизни его граждан, то в целом конкурентоспособность государств следует оценивать по этому показателю.

Исследования непосредственно качества жизни в различных государствах были начаты только в 2009 г. изданием «International Living» (Ирландия). По результатам исследований, итоги которых подводятся в январе наступившего года, на основании показателей государства в девяти категориях – стоимость жизни, культура и досуг, экономика, окружающая среда, свобода, здоровье, инфраструктура, безопасность и риск, климат – определяется индекс качества жизни (Quality of Life Index). Индекс качества жизни (ИКЖ<sub>IL</sub>) оценивается по шкале от 0 (наихудшее качество жизни) до 100 (наилучшее качество жизни). В опубликованном в январе 2011 г. отчете приведены данные по ИКЖ<sub>IL</sub> для 187 суверенных государств [International Living's 2011 Quality of Life Index].

Сопоставительный анализ представляется целесообразным начать с рассмотрения государств с низким уровнем коррупции, характеризуемым значе-

ниями ИВК<sub>ТИ</sub>, превышающими две третьих от максимального значения этого индекса. Ранжированный перечень государств, удовлетворяющих принятому критерию отбора, и соответствующие этим государствам данные по оценочным индексам приведены в табл. 1.

**Таблица 1.**

Рейтинг	Государство	ИВК <sub>ТИ</sub>	ИСК <sub>WB</sub>	ИГК <sub>WEF</sub>	ИЖЖ <sub>IL</sub>
1	Дания*	9,3	2,42	5,32	71
1	Новая Зеландия*	9,3	2,38	4,92	76
1	Сингапур	9,3	2,26	5,48	57
4	Финляндия*	9,2	2,22	5,37	69
4	Швеция*	9,2	2,23	5,56	69
6	Канада*	8,9	2,04	5,3	70
7	Нидерланды*	8,8	2,1	5,33	73
8	Австралия*	8,7	2,03	5,11	73
9	Швейцария*	8,7	2,01	5,63	70
10	Норвегия*	8,6	1,94	5,14	72
11	Исландия*	8,5	2,05	4,68	71
11	Люксембург*	8,5	1,97	5,05	63
13	Ирландия*	8	1,72	4,74	71
14	Австрия*	7,9	1,75	5,09	74
14	Германия*	7,9	1,7	5,39	74
16	Барбадос*	7,8	1,34	4,45	64
16	Япония*	7,8	1,35	5,37	74
18	Катар	7,7	1,64	5,1	57
19	Великобритания*	7,6	1,54	5,25	74
20	Чили*	7,2	1,37	4,69	63
21	Бельгия*	7,1	1,43	5,07	75
21	США*	7,1	1,18	5,43	86
23	Уругвай*	6,9	1,22	4,23	71
24	Франция*	6,8	1,41	5,13	75

\* Электоральная демократия по определению «Freedom House».

Прежде всего, следует отметить, что государств с низкой коррупцией по критерию  $ИВК_{TI} \geq 6,67$  насчитывается всего 24 (14%) из 174 независимых государств, для которых в 2010 г. этот индекс был определен. Данный факт показывает, что коррупция представляет существенную проблему для подавляющего большинства государств.

Из анализа данных, приведенных в таблице, следует, что все государства с низким уровнем коррупции имеют как уровень глобальной конкурентоспособности выше среднего ( $ИГК_{WEF} > 4$ ), так и уровень качества жизни выше среднего ( $ИКЖ_{L} > 50$ ).

Диаграмма, отражающая общую картину влияния на экономическую конкурентоспособность государства, характеризуемую индексом глобальной конкурентоспособности  $ИГК_{WEF}$ , состояния коррупции, характеризуемого индексом восприятия коррупции  $ИВК_{TI}$ , приведена на рис. 1, а уровни коррупции, характеризуемого индексом сдерживания коррупции  $ИСК_{WB}$ , – на рис. 2.

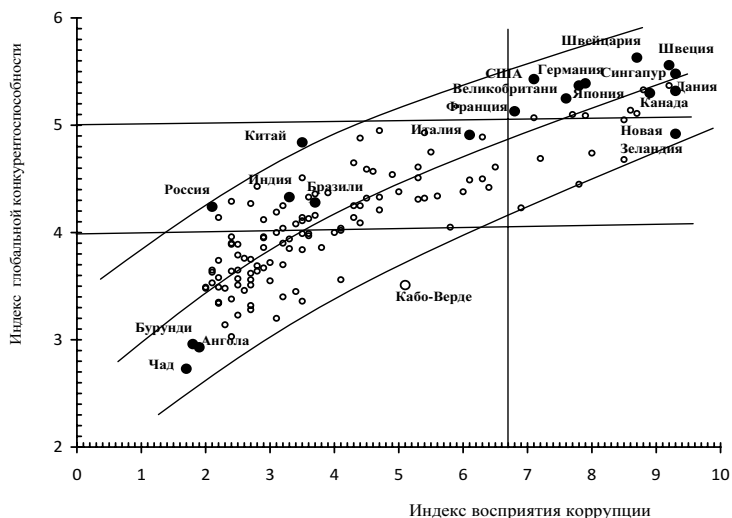


Рис. 1.

Из представленных на рис. 1 и 2 диаграмм можно сделать следующий вывод. Общий тренд влияния состояния коррупции в государстве на его экономическую конкурентоспособность состоит в повышении экономической конкурентоспособности при снижении уровня коррупции и, наоборот, в ее снижении при повышении уровня коррупции.

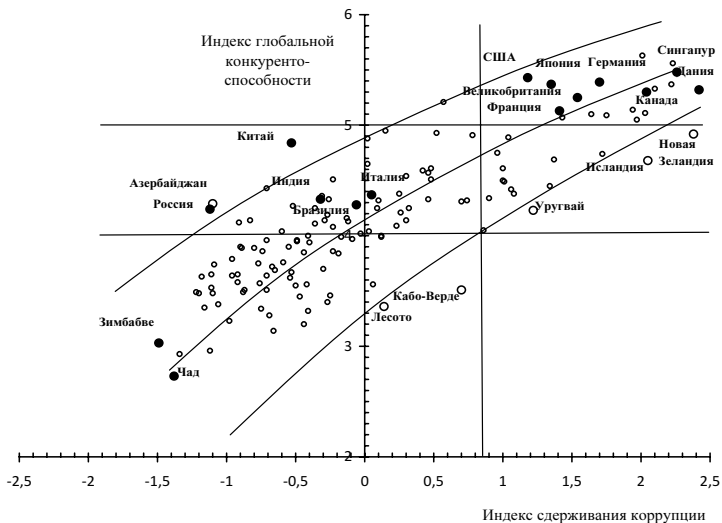


Рис. 2.

Диаграмма, отражающая общую картину влияния на качество жизни граждан государства, характеризуемое индексом качества жизни ИКЖ<sub>Ц</sub>, состояния коррупции, характеризуемого индексом восприятия коррупции ИВК<sub>Т</sub>, приведена на рис. 3, а уровня коррупции, характеризуемого индексом сдерживания коррупции ИСК<sub>WB</sub> – на рис. 4.

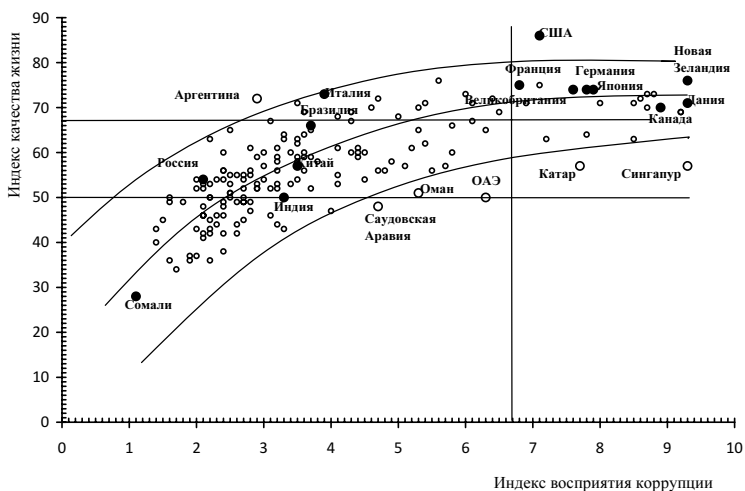


Рис. 3.

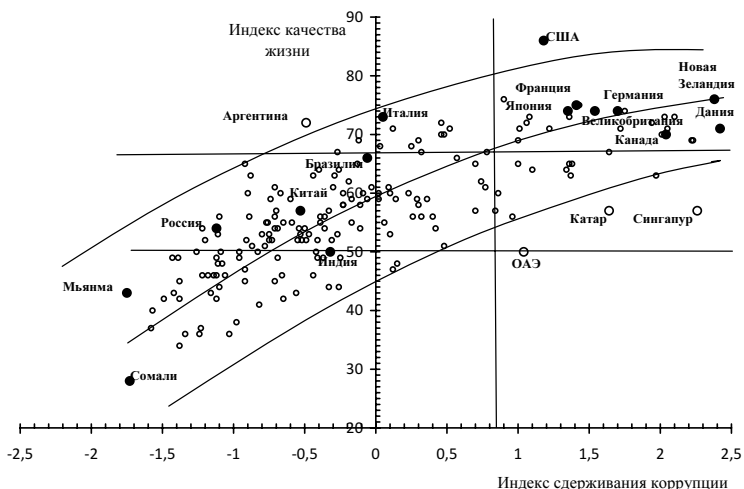


Рис. 4.

Из представленных на рис. 3 и 4 диаграмм можно сделать следующий вывод. Общий тренд влияния состояния коррупции в государстве на качество жизни его граждан состоит в повышении качества жизни при снижении уровня коррупции и, наоборот, в его снижении при повышении уровня коррупции.

Таким образом, представленные результаты подтверждают тот факт, что коррупция является фактором снижения конкурентоспособности государства и ухудшает как его экономическую конкурентоспособность, так и качество жизни его граждан.

## Литература

Гевелинг Л.В. Клептократия. Социально-политическое измерение коррупции и негативной экономики. Борьба африканского государства с деструктивными формами организации власти. М.: Изд-во «Гуманитарий» Академии гуманитарных исследований, 2001.

Конвенцией ООН против коррупции. Резолюция Генеральной Ассамблеи ООН № A/RES/58/4 от 31 октября 2003 г. ([www.un.org/russian/documents/instruments/docs\\_ru.asp](http://www.un.org/russian/documents/instruments/docs_ru.asp))

Мизес Людвиг фон. Человеческая деятельность: Трактат по экономической теории. М.: Экономика, 2000.

Нисневич Ю.А. Вертикаль никуда: Очерки политической истории России 1991–2008. М.: Аспект Пресс, 2010.

Нисневич Ю.А. Метод сопоставительно-институционального анализа // Мировая экономика и международные отношения. 2011. № 3.

Anticorruption in Transition: A Contribution to the Policy Debate. The World Bank, 2000.

Corruption Perceptions Index 2010 Results. Transparency International, 2010. ([http://www.transparency.org/policy\\_research/surveys\\_indices/cpi/2010/results](http://www.transparency.org/policy_research/surveys_indices/cpi/2010/results))

*Hellman J.S., Jones G., Kaufmann D.* Seize the State, Seize the Day: State Capture, Corruption and Influence in Transition. World Bank, Policy Research Working Paper № 2444, September 2000.

*Huntington S.P.* Modernization and Corruption. Political Order in Changing Societies. New Haven, Conn: Yale University Press, 1968.

International Living's 2011 Quality of Life Index Reveals Best Climate in the World. International Living, 2011. (<http://www1.internationalliving.com/qofl2011/>)

The Global Competitiveness Report 2010–2011. World Economic Forum, 2010. ([http://www3.weforum.org/docs/WEF\\_GlobalCompetitivenessReport\\_2010-11.pdf](http://www3.weforum.org/docs/WEF_GlobalCompetitivenessReport_2010-11.pdf))

The Worldwide Governance Indicators. World Bank, 2010. (<http://info.worldbank.org/governance/wgi/index.asp>)



# **ДЕКЛАРАЦИИ О ДОХОДАХ, ОБ ИМУЩЕСТВЕ И ОБЯЗАТЕЛЬСТВАХ ИМУЩЕСТВЕННОГО ХАРАКТЕРА ПУБЛИЧНЫХ ДОЛЖНОСТНЫХ ЛИЦ. ПРИМЕНЕНИЕ В РОССИИ И В МИРЕ**

---

## **Какие декларации есть в России**

Термин «декларации» применяется к различным формам подачи сведений о доходах или имуществе физического или юридического лица. В России существуют три различные сферы, в которых государство требует от граждан предоставления деклараций.

1. Налоговая декларация предоставляется физическим лицом в определенных случаях, регулируется Налоговым кодексом (в случае занятия предпринимательской деятельностью, получения налоговых вычетов при покупке квартиры и пр.).

2. Декларации кандидатов на выборные должности предоставляются кандидатами на выборах различных уровней. Регулируется предвыборным законодательством.

3. Декларации о доходах и имуществе публичных должностных лиц (ПДЛ) – ежегодные декларации, которые подаются государственными служащими и прочими публичными должностными лицами (например, депутатами, которые юридически не являются государственными служащими) в рамках законодательства о гражданской службе и закона о противодействии коррупции.

В данной работе речь пойдет именно о третьем типе деклараций. Впервые требование предоставлять сведения о доходах и имуществе в отношении государственных служащих в России было введено в 1995 г. В соответствии со ст. 12 Федерального закона от 31 июля 1995 г. № 119-ФЗ «Об основах государственной службы Российской Федерации» госслужащие должны были предос-

тавлять в органы налоговой службы «сведения о полученных ими доходах и имуществе, принадлежащем им на праве собственности, являющихся объектами налогообложения». Однако все эти сведения получали статус служебной тайны, и их проверка проводилось только налоговой службой. Эффективность их использования для предотвращения незаконного обогащения и урегулирования конфликта интересов оставалась крайне низкой.

Введение деклараций о доходах и имуществе публичных должностных лиц закреплено в Конвенции Организации Объединенных Наций против коррупции (ст. 8), в ряде документов Мирового банка, Организации экономического сотрудничества и развития, в других международных институтах. Россия ратифицировала Конвенцию ООН против коррупции 8 марта 2006 г., таким образом, страна взяла на себя обязательство ввести обязательную декларацию доходов и имущества публичных должностных лиц.

Обязанность декларировать доходы, имущество и обязательства имущественного характера для публичных должностных лиц и членов их семей, в лице супруга(и) и несовершеннолетних детей появилась в России с принятием Федерального закона Российской Федерации от 25 декабря 2008 г. № 273-ФЗ «О противодействии коррупции». С 2010 г. публичные должностные лица обязаны ежегодно предоставлять сведения о доходах, об имуществе и обязательствах имущественного характера в отношении себя и членов семей, супруга(и) и несовершеннолетних детей. Список лиц, которые должны публиковать декларации, указан в Указе Президента и в аналогичных приказах по каждому ведомству.

## **Зачем нужны декларации и нужны ли они вообще**

Введение деклараций в любой стране сопровождается общественной дискуссией о плюсах и минусах этой системы. Аргументы против введения деклараций можно разделить на две группы.

Во-первых, речь идет о прямых затратах, которые несет государство на внедрение и поддержание такой системы. Стоимость данного механизма может сильно различаться в зависимости от конкретных аспектов системы деклараций. В самом простом варианте государство будет нести затраты на заполнение анкет и на их архивацию. Более серьезные затраты нужны на внедрение качественной системы проверки данных, указанных в декларациях. Противники системы часто заявляют, что эти затраты не окупаются.

Во-вторых, указываются косвенные потери, которые несет государство вследствие потери кадров. Обязанность подавать декларацию о доходах и иму-

щество является дополнительным требованием, которое уменьшает привлекательность должности. Эта обязанность становится еще более обременительной, если в декларацию включается информация о близких родственниках и эти данные публикуются в открытом доступе. В ситуации, когда индивид рассматривает вакансию с равной заработной платой и прочими параметрами, он может отказаться от принятия на себя обязательств по декларированию доходов и имущества своей семьи и предпочесть работу в частном секторе. Увольнение публичных должностных лиц в связи с введением обязанности декларировать доходы и имущество наблюдалось в ряде стран, например в США в 1960-е годы и в Румынии в 2005 г. В Германии до сих пор продолжаются дебаты относительно системы деклараций имущества депутатов. В качестве ключевого аргумента против деклараций приводится тот факт, что это недопустимо для представителей малого бизнеса или индивидуальных предпринимателей, так как это приведет к разглашению их коммерческих секретов. В итоге эти люди не будут участвовать в выборах, и это приведет к ухудшению качества представительной демократии.

Отдельно можно выделить довод о нарушении ряда прав человека, однако в рамках данной работы этот вопрос рассматриваться не будет, так как основная суть аргументов совпадает с вышеизложенными.

Теперь рассмотрим доводы сторонников введения деклараций.

Во-первых, регулярные декларации чиновников позволяют отслеживать изменения имущества чиновников. Статья 20 Конвенции ООН против коррупции призывает все страны ввести в свое законодательство наказание за «незаконное обогащение», под которым понимается «значительное увеличение активов публичного должностного лица, превышающее его законные доходы, которое оно не может разумным образом обосновать». Стоит заметить, что при ратификации конвенции Россия сделала оговорку и не приняла данную статью. Поиск незаконного обогащения направлен на выявление самых простых случаев коррупции.

Вторым важным направлением противодействия коррупции, в котором применяются декларации, является предотвращение конфликта интересов. Из декларации работодатель может увидеть, что у конкретного ПДЛ есть личный интерес в той или иной области. Это может выражаться в прямом владении акциями компаний, либо в различном участии в этом бизнесе близких родственников.

Важным аргументом в пользу использования деклараций для противодействия коррупции является тот факт, что данная норма упрощает привлечение к ответственности недобросовестных ПДЛ. Доказать факт получения взятки или иной выгоды бывает достаточно сложно. В то же время, если в стране су-

ществует уголовная ответственность за умышленное предоставление неполных сведений в декларации, то привлечь по этой статье не так сложно. То же относится и к незаконно нажитому имуществу. При отсутствии деклараций для доказательства незаконного происхождения средств для приобретения того или иного имущества потребуются большие усилия. Если же декларации подаются, то обнаружение имущества, не указанного в декларациях, является нарушением законодательства само по себе.

Также стоит отметить, что наличие деклараций может сыграть ключевую роль при возвращении украденных активов. В современном мире регулярно возникают ситуации, когда ПДЛ приобретает недвижимость за рубежом и в случае возникновения проблем на родине чиновник покидает страну. При отсутствии системы деклараций правоохранительным органам потребуется доказать тот факт, что данное имущество было приобретено на деньги, полученные из незаконных источников. Если система деклараций эффективно работает, то доказывать это становится необязательным, достаточно указать на отсутствие собственности в декларациях.

В большинстве современных стран доводы в пользу введения деклараций перевесили доводы против. Из 149 стран-клиентов Всемирного банка, согласно данным за 2009 г., лишь 43 страны не требовали предоставления деклараций о доходах и имуществе<sup>1</sup>. Почти половина из этих 43 стран находятся в Африке, из европейских стран требование предоставлять декларацию ПДЛ отсутствует только в Эстонии.

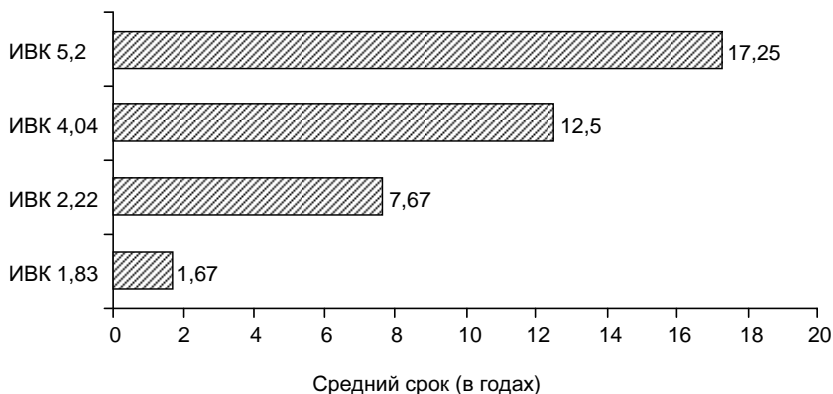
Декларации являются лишь одним из инструментов противодействия коррупции. Для эффективного противодействия коррупции необходима реализация комплексной антикоррупционной стратегии, сами по себе декларации вряд ли способны побороть коррупцию. В то же время следует отметить, что установлена четкая взаимосвязь между работой системы декларирования имущества и доходов и индексом восприятия коррупции (ИВК), ежегодно публикуемом Transparency International<sup>2</sup>.

Ниже приведены графики (рис. 1, 2) из исследования «Законы о декларациях ПДЛ, предотвращают ли они коррупцию».

---

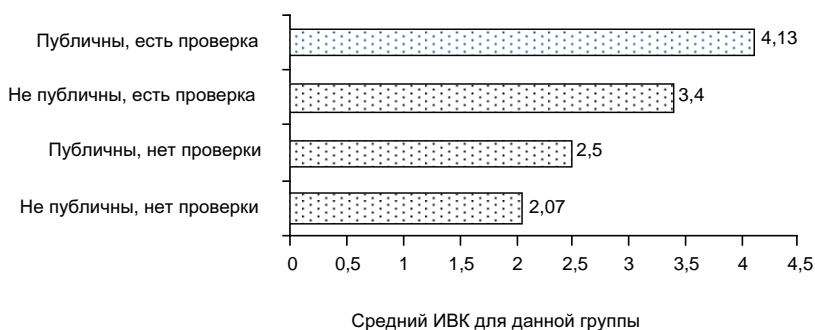
<sup>1</sup> Income and Assets Declarations: Issues to consider in developing a disclosure regime by Richard Messick, U4 Issue 2009. 6. P. 17 (<http://www.cmi.no/publications/file/3396-income-and-assets-declarations.pdf>)

<sup>2</sup> Индекс восприятия коррупции ранжирует страны по оценке восприятия уровня коррупции в стране, присваивая каждой из стран балл, где 10 – минимальный, а 0 – максимальный уровень восприятия коррупции.



**Рис. 1.** Декларации и ИВК. Время действия закона о декларациях  
*Источник:* Transparency International Global Corruption Report 2006, p. 326.

Для рис. 1 исследуемые страны были объединены в четыре группы в зависимости от уровня ИВК. В результате средний срок действия закона о декларациях имущества в странах с самым низким ИВК (т.е. высоким уровнем восприятия коррупции) составил 1,67 года, а в странах с самым высоким ИВК – более 17 лет. Из этого можно сделать вывод, что введение деклараций имеет долгосрочный эффект и со временем влияет на повышение ИВК (т.е. на снижение уровня воспринимаемой коррупции).



**Рис. 2.** Декларации и ИВК. Механизм верификации деклараций  
*Источник:* Transparency International Global Corruption Report 2006, p. 328.

На рис. 2 рассматривается механизм верификации данных, представленных в декларациях ПДЛ. Страны сгруппированы в соответствии с двумя критериями:

- являются ли декларации ПДЛ публичными, т.е. доступными всем гражданам через публикацию в СМИ, организацию доступа в специальных учреждениях и др. Этот механизм теоретически позволяет всем гражданам участвовать в верификации данных;
- существует ли механизм проверки каждой подаваемой декларации. Если механизм существует, то страны попадают в группы, обозначенные как «есть проверка». В ряде стран обязательной проверки нет, декларации подаются и хранятся в органах, а проверка инициируется лишь в случае предъявления обвинений в коррупции. На графике для обозначения стран такие страны обозначены как «нет проверки».

Таким образом, можно видеть, что в странах с более совершенным механизмом верификации деклараций уровень восприятия коррупции ниже (т.е. балл ИВК выше). Выявленная зависимость между ИВК и декларациями не обязательно объясняется только лишь влиянием деклараций на уровень воспринимаемой коррупции, однако с большой долей вероятности внедрение эффективных механизмов верификации деклараций является частью комплексных стратегий противодействия коррупции, реализуемых в этих странах.

## Как устроены декларации в России

Существующая система деклараций в России основывается на законе «О противодействии коррупции» и на ряде указов Президента<sup>3</sup>. Ежегодно государственные служащие, а также лица, замещающие государственные должности, должны предоставлять сведения о доходах, имуществе и обязательствах имущественного характера и аналогичные данные своей супруги (своего супруга) и несовершеннолетних детей. Круг декларируемых родственников основывается на принципе ведения совместного хозяйства. В то же время этот пункт активно критикуется, в частности, относительно декларирования данных лишь несовершеннолетних детей, так как часто можно наблюдать высокий уровень материального благополучия совершеннолетних детей государственных служащих при отсутствии у них высокооплачиваемой работы. Декларации подаются не позднее 30 апреля, в них указываются сведения за предшествующий год. Декларации должны содержать информацию о доходах, имуществе (транспорте и недвижимости), акциях и обязательствах имущественного характера (например, кредитах) должностного лица, супруги (супруга) и несовершеннолетних детей.

---

<sup>3</sup> Федеральный закон Российской Федерации от 25 декабря 2008 г. № 273-ФЗ «О противодействии коррупции», Указы Президента РФ от 18 мая 2009 г. № 558–561.

Из всех этих данных публичными являются лишь сведения о доходах и сведения об имуществе, без указания адреса нахождения имущества.

Закон прямо не обязывает государственные органы публиковать открытые данные из деклараций на своих сайтах, но предоставляет ведомствам такое право. В случае, если сведения не опубликованы, они должны быть представлены по запросу общероссийскому СМИ в течение 7 дней<sup>4</sup>. На практике большинство ведомств публикует данные на своих официальных сайтах, в различных форматах и на различных страницах. Иногда найти их бывает сложно, еще сложнее – обрабатывать. Далеко не все органы хранят эти данные в течение года, ряд страниц, где в мае–июне 2010 г. были размещены декларации ПДЛ, на данный момент недоступны.

Для проверки достоверности сведений, представленных в декларациях, в каждом ведомстве должны быть созданы комиссии по соблюдению требований к служебному поведению госслужащих и урегулированию конфликта интересов. Также проверками занимается Генеральная прокуратура и даже Федеральная налоговая служба. Кроме этого, полномочия проводить проверки в отношении ряда ПДЛ есть у Совета при Президенте по противодействию коррупции. Разнообразие органов и отсутствие четкого регламента проверок снижает эффективность этого инструмента.

## **Недостатки в российской системе деклараций**

По результатам первого года работы деклараций в России можно выделить ряд существенных недостатков в существующей в России системе деклараций доходов, имущества и обязательств имущественного характера публичных должностных лиц, их супруг (супругов) и несовершеннолетних детей.

### **1. Слабые санкции.**

Россия не ратифицировала ст. 20 Конвенции ООН о противодействии коррупции, и у нас в стране отсутствует наказание за «незаконное обогащение»<sup>5</sup>. Таким образом, чиновники могут указывать в декларациях имущество, которое невозможно приобрести при указанных доходах, и никаких санкций за это не предусмотрено. Введение наказания за незаконное обогащение является ключе-

---

<sup>4</sup> Указ Президента РФ от 18 мая 2009 г. № 561.

<sup>5</sup> Незаконное обогащение – значительное увеличение активов публичного должностного лица, превышающее его законные доходы, которое оно не может разумным образом обосновать.

вым элементом противодействия коррупции в системно коррумпированных странах, к которым, к сожалению, относится и Россия.

Также в российском законодательстве отсутствуют отдельные статьи, предусматривающие наказание за предоставление ложных сведений в декларации. Сейчас различными указами и положениями предусмотрена лишь дисциплинарная ответственность за предоставление ложных сведений или за отсутствие декларации. Таким образом, самым тяжелым наказанием может быть лишь увольнение. В то же время в различных странах существуют административные и уголовные наказания за предоставление заведомо ложных сведений в декларациях, предусматривающие наказание от штрафа до тюремного срока.

### 2. Отсутствие единого органа, осуществляющего проверки.

В большинстве стран, эффективно использующих декларации как инструмент противодействия коррупции, существует единый орган, занимающийся проверками достоверности сведений, представленных в декларациях. Более того, как было показано выше, наличие контроля за всеми декларациями при их подаче коррелирует с более низким восприятием коррупции (с более высоким уровнем ИВК). В России такого органа нет. Проверками деклараций занимаются комиссии по соблюдению требований к служебному поведению госслужащих и урегулированию конфликта интересов в каждом ведомстве, Генеральная прокуратура, Федеральная налоговая служба и Совет при Президенте по противодействию коррупции. Можно сказать, что Совет при Президенте по противодействию коррупции является прообразом подобного органа. Пока совет лишь один раз воспользовался своими полномочиями – в сентябре 2010 г. за предоставление недостоверных сведений был уволен генерал-майор Вооруженных Сил Гайдуков В.Н. В настоящий момент это единственный человек, который был публично уволен за нарушение данных, представленных в декларациях. Остальные проверки, о которых иногда упоминают руководители правоохранительных органов, проводились в закрытом режиме. Новый указ Президента<sup>6</sup> очень четко прописывает регламент принятия решений Совета при проверке деклараций, что может свидетельствовать о том, что в будущем этот инструмент будет применяться чаще.

### 3. Недостатки формата предоставления данных.

Формат фактического опубликования деклараций о доходах и имуществе делает крайне затруднительным изучение и анализ этих данных. Различные орга-

---

<sup>6</sup> Указ Президента РФ от 25 февраля 2011 г. № 233 «О некоторых вопросах организации деятельности президиума Совета при Президенте Российской Федерации...».



ны власти сами определяют, в каком формате опубликовать в сети Интернет данные своих служащих (законодательство определяет только перечень публикуемых данных). В итоге эти данные нужно искать на различных страницах (например, «антикоррупционная деятельность», «структура», «о нас» и т.д.), они опубликованы в различных форматах (HTML, Microsoft Word, PDF и пр.). Список ссылок на официальные страницы сайтов различных ведомств приведен в Приложении.

Также есть проблемы и в самих требованиях к предоставлению данных, например, чиновник не должен указывать год выпуска транспортного средства, только марку. Это оставляет очень большой разброс в оценке стоимости автомобиля.

В целом складывается ощущение, что у государственных органов, занимающихся внедрением системы деклараций в России, отсутствует понимание смысла данного инструмента и его места в системе противодействия коррупции. На данный момент происходит поверхностная калька с существующих зарубежных механизмов без внедрения реальных инструментов контроля за достоверностью сведений, представленных в декларации, и предотвращения незаконного обогащения.

## Приложение

### **Декларации публичных должностных лиц на официальных сайтах**

(из публикации Ивана Бегтина «Систематизация данных о доходах чиновников»  
<http://opengovdataru.pbworks.com/w/page/27540820/Систематизация-данных-о-доходах-чиновников>)

Прокуратура Рязанской области. (<http://www.prokrzn.ru/legislation/sveddoh/>)

Федеральное архивное агентство. (<http://archives.ru/anticorruption/info2009.shtml>)

Управление Министерства юстиции Российской Федерации по Смоленской области. (<http://just67.ru/content/?q=node/125>)

Законодательное собрание Санкт-Петербурга.  
(<http://www.assembly.spb.ru/manage/page/?tid=633200002&nd=458285018&nh=1>)

Министерство здравоохранения и социального развития Российской Федерации.  
(<http://www.minzdravsoc.ru/labour/public-service/11>)

Счетная палата Российской Федерации. (<http://www.ach.gov.ru/ru/info1/>)

Федеральное казначейство. ([http://www.roskazna.ru/news\\_1419.html](http://www.roskazna.ru/news_1419.html))

Президент России и администрация Президента. ([http://news.kremlin.ru/ref\\_notes/56](http://news.kremlin.ru/ref_notes/56))

Администрация Курганской области.

([http://www.kurganobl.ru/assets/files/gossluzhba/dohod/dohod\\_rukovodit\\_oiv\\_2009\\_2010-05-14.pdf](http://www.kurganobl.ru/assets/files/gossluzhba/dohod/dohod_rukovodit_oiv_2009_2010-05-14.pdf)) и ([http://www.kurganobl.ru/assets/files/gossluzhba/dohod/dohod\\_apparat\\_2009\\_2010-05-17.pdf](http://www.kurganobl.ru/assets/files/gossluzhba/dohod/dohod_apparat_2009_2010-05-17.pdf))

Федеральное казначейство. (<http://www.roskazna.ru/store/14052010wealth.doc>)

Администрация Магаданской области. (<http://www.magadan.ru/dms/doxod/y2009/sved2010.zip>)

## Литература

*Лукьянова Н.И.* Декларирование доходов государственными гражданскими служащими и членами их семей. Проблемы правоприменения // Лоббист. 2010. № 5.

Income and Asset Declarations: Tools and Trade-offs. Stolen Asset Recovery (StAR) Initiative. November 2009.

*Messick R.* Income and Assets Declarations: Issues to Consider in Developing a Disclosure Regime: U4 ISSUE 2009:6.

*Mukherjee R., Gokcekus O.* Officials' Asset Declaration Laws: Do They Prevent Corruption? Global Corruption Report 2006. Transparency International, 2006.

## КОРРУПЦИЯ В ШВЕЦИИ: ПРОБЛЕМЫ ИДЕНТИФИКАЦИИ И ИЗМЕРЕНИЯ<sup>1</sup>

---

Скандинавские страны входят в число стран с наименьшими индексами коррупции. Так, согласно ежегодным данным, публикуемым независимой интернациональной антикоррупционной организацией «Transparency International» (ТИ), Швеция в последние пять лет занимает третью или четвертую рейтинговую позицию среди 180 стран, охваченных исследованиями. Казалось бы, шведское общество не имеет оснований для беспокойства в этой области. Однако в действительности страницы шведских газет пестрят ежедневными разоблачениями коррупции, используя понятия «скандал», «афера», «халтура», «сливки» и пр.<sup>2</sup> Организация ТИ, критикуя Швецию в своем отчете в октябре 2010 г. за пробелы в законодательстве о способах финансирования шведских партий, указывает, что «настало время смыть темные пятна с демократии»<sup>3</sup>. Шведское общество должно осознать, что негативные процессы, происходящие в действительности, далеки от идиллической картины, которая ранее преподносилась политиками.

Критики расширяющейся коррупции в Швеции указывают на различные ее проявления, которые не попадают под ее официальное определение, а поэтому как будто бы таковой не являются. Коррупция и обман официальных органов – явления, от которых уже нельзя отвернуться. Миллиарды крон богатых людей Швеции освобождаются от налогов, в то время когда бедные не могут добиться заработанных денег<sup>4</sup>. Скандально известные директора (например, из шведского концерна ABB, а также из SAAB) богатых предприятий находятся

---

<sup>1</sup> Теоретическая работа выполнена в рамках стажировки в Стокгольмском университете. Базой для анализа послужили материалы социологического исследования, проведенного шведскими учеными – доктором Катариной Якобсон и докторантом Давидом Вестерфорсом из Университета г. Лунд, материалы политических дебатов в шведском риксдаге, материалы, опубликованные в периодической печати.

<sup>2</sup> Problemet är den svenska vänskapskorruptionen <http://rickfalkvinge.se>. Опубликовано 15.10.2010.

<sup>3</sup> Korruptionen ökar i Sverige <http://di.se>. Опубликовано 26.12.2010.

<sup>4</sup> Korruption och förljugenhet. ([www.bgf.nu/nomenklaturan/korruption](http://www.bgf.nu/nomenklaturan/korruption))

во взаимном управлении друг у друга и выписывают друг другу миллионные зарплаты.

Свое отношение к этому явлению было высказано Давидом Нуссбаумом (D. Nussbaum), руководителем независимой международной антикоррупционной организации «Transparency International»: «Самовознаграждение – лучший друг коррупции»<sup>5</sup>.

Негативные явления наблюдаются также и в политической жизни Швеции. Профессиональные политики, придя к власти, забывают демократические идеи и свои предвыборные обещания и усиленно заботятся о своем материальном обеспечении. Члены шведского парламента имеют в настоящее время такие зарплаты, гонорары и командировочные, которые были невероятны в период «политики благосостояния» 30–40 лет назад. Подобные материальные вознаграждения должны быть соизмеримы с компетенцией «народных избранников», что сейчас ставится критиками под сомнение. Критики деятельности парламента указывают, что государственные служащие, имеющие доступ к государственным или муниципальным бюджетам, «привыкают к большим числам»: сотни крон становятся тысячами, тысячи превращаются в миллионы. Подобные процессы происходят, когда речь заходит о вознаграждении госслужащих. Для коррумпированных чиновников выгодно, когда на экономику влияет небольшое число лиц. Когда ограниченное число политиков управляют страной десятилетия за десятилетиями, формируется лояльность между ними, поскольку они имеют общие интересы сохранять власть между собой и не впускать в нее других лиц. Этот союз власть придержащих может продолжаться до тех пор, пока они в состоянии обеспечить все увеличивающийся стандарт жизни своему народу. Проблемы возникают, когда качество жизни возрастает только у политиков.

Современное интернациональное определение коррупции звучит: «коррупция – это злоупотребление властью или понятием доверия ради персональных привилегий или в пользу привилегий другому лицу или группе лиц, к которым наблюдается отношение лояльности»<sup>6</sup>.

В европейских странах можно найти конкретные примеры осуждения ответственных лиц за подобные злоупотребления. Например, в 2004 г. бывший премьер-министр Франции А. Жупе был осужден за «политическую коррупцию», а именно за то, что выплачивал заработную плату товарищу по партии в то время, когда он сам отвечал за экономику страны. Сторонники А. Жупе пы-

---

<sup>5</sup> Utråv ansvar för korruption i staten. ([www.henrikvonsydow.se](http://www.henrikvonsydow.se))

<sup>6</sup> Se upp med «affärer» och «gräddfiler»! // Dagens Nyheter. 2004.12.22.

тались защитить его, утверждая, что он же не обогатился сам. Однако решение суда основывалось на том, что он подорвал доверие жителей к власти. Именно за злоупотребление доверием А. Жупе был осужден судом первой инстанции на десять лет лишения права занятия политических постов. Позднее суд высшей инстанции снизил этот срок до одного года.

Отметим, что понятие коррупции вообще не используется в шведских законодательных текстах, а только лишь фигурирует в обычных средствах информации. Законодательное определение понятия коррупционного явления очень конкретное и ограниченное. Под коррупцией понимается взятка – пачка купюр «под столом» за оказанную услугу<sup>7</sup>. В Швеции можно осудить за дачу взятки, но не за злоупотребление доверием. Таким образом, не существует осуждения за коррупцию. Этим фактом создается впечатление, что ее практически нет в Швеции.

Коррупция и другие формы злоупотребления властью относятся к понятиям, о которых мало говорят в «чистых» демократических обществах. В коррупцию вовлечены обе стороны, т.е. дающий и берущий, хотя обычно в фокусе внимания находится только берущий. Группа шведских экспертов в области коррупции выделяет несколько типических черт различных видов коррупционных действий<sup>8</sup>.

1. Во-первых, коррупция – это событие, при котором кто-то вопреки правилам и законам влияет на принятие решений и/или исход дела или изменение позиции ради своей (или другого конкретного лица) выгоды посредством использования денег, служебного положения или угрозы/принуждения к взятке (подкупу). Коррупцией можно также назвать действие, вызванное злоупотреблением своим положением ради собственной выгоды через требование взятки.

2. Коррупция существует на различных уровнях, от обыденных действий до грубых нарушений на национальном уровне. Коррупционные преступления на различных уровнях имеют общие черты, но внутренние их причины разные и должны предотвращаться разными способами. В странах, где существует коррупция на верхних этажах власти, легко процветают и развиваются традиции коррупционных действий в нижних слоях общества и среди простого народа.

3. Коррупция сопровождается утечкой капитала, «отмыванием денег», фаворитизацией. Для эффективной борьбы с экономическими злоупотреблениями

---

<sup>7</sup> Korruption på svenska. (www.bgf.nu)

<sup>8</sup> Afrikagrupperna och UBV/Latinamerika, 1 februari 2007. (www.afrikagrupperna.se)

важно различать различные виды преступлений и исходить из их причин и особенностей. Это же касается различных форм коррупции.

4. В борьбе с коррупцией недостаточно наказывать только тех, кто берет взятки. Необходимо обнаружить источник денег. Особенно это важно в случае грубой коррупции на верхних этажах власти. Необходимо выяснить, кто они, эти люди, дающие взятки и получающие громадные преимущества.

Коррупция в крупных размерах, когда министры или другие чиновники берут взятки, часто связана с интернациональными предприятиями. Обычно инициатива исходит от крупного богатого предприятия, которое стремится дать взятку для приобретения каких-либо преимуществ. Взятка направлена на лицо, исполняющее функцию (например, министр), которое принимает решения в пользу определенной персоны. Если взяточник наказан и смещен со своего поста, то предложение взятки последует преемнику его должности. В подобных случаях крупной коррупции грубые нарушения инициируются в богатых странах и направлены на дачу взяток в бедных регионах мира. Это явление можно назвать как «экспорт коррупции» из богатых регионов мира в бедные. Внимание и мероприятия против коррупции должны быть направлены на источники, откуда поступают деньги. В случае международной коррупции они, как правило, приходят из богатых стран.

Коррупция имеется во всех странах, но особенно она распространяется в государствах, где правовая система, средства массовой информации и государственное управление слабые и неразвитые. Можно указать на три вида коррупции<sup>9</sup>, они отличаются степенью поражения политической системы коррупционными нарушениями:

- бюрократическая коррупция;
- политическая коррупция;
- государственная коррупция.

В обществе наблюдаются различные степени поражения коррупцией. Незначительная коррупция (*petty corruption*) наблюдается в случаях, когда чиновники или государственные служащие (например, служащий таможи, врач или полицейский) нелегально облагают поборами население.

Более глубокая степень поражения коррупцией (*grand corruption*) характеризуется вовлечением в нее политиков и чиновников, которые используют свою власть для своего обогащения или для сохранения себя при этой власти.

---

<sup>9</sup> Vad är korruption? 05 december 2005. ([www.sida.se](http://www.sida.se))

Эта коррупция поражает часто интернациональную банковскую сеть. Она продвигается деловыми кругами развитых стран, которые рассматривают взятки чиновникам в развивающихся странах как незначительное нарушение.

Третья степень поражения коррупцией (*state capture*) возникает, когда слабые государства позволяют предпринимателям и другим влиятельным лицам в стране влиять на законодательство и/или исполнение законов таким образом, что нарушается конкуренция в частном секторе.

Коррупция предполагает всегда передачу денег «снизу вверх», т.е. тем слоям, которые уже имеют работу, власть и деньги. От коррупции страдают больше всего слабые слои населения, поскольку именно они часто не в состоянии заплатить за необходимое дорогостоящее лечение, достойное образование и жилье.

Изучение коррупционных проявлений в шведском обществе имеет длительную историю. Здесь был даже образован специальный научный Институт против взяток (*Institutet mot mutor*) в 1923 г. Современный руководитель этой организации К. Бейер (*Claes Beyer*), выступая в правительственных дебатах, посвященных борьбе с коррупцией, подверг острой критике современное шведское законодательство. Так, он указал, что в настоящее время имеются лишь два правонарушения, которые можно отнести к коррупционным явлениям согласно закону. Это – взятки и вымогательство<sup>10</sup>. Сам текст закона давно устарел не только по субъекту распространения, но и по содержанию: «работник, который для себя самого или для другого лица берет, обещает или требует взятку или иное неуместное вознаграждение за свои услуги, приговаривается к штрафу или к тюремному заключению сроком до двух лет»<sup>11</sup>. Эксперт указывает, что в тексте закона используется очень сильное обобщение субъекта правонарушения. В этой связи получается, что не играет никакой роли профессия этого работника. Неважно, что он может быть судьей или рабочим, просто они оба – работники. В законе имеется некоторый намек на род деятельности. Можно только предположить сферу деятельности, так как оба определения о взятках и подкупе находятся после параграфа, который касается общественной деятельности. Речь идет о преступлении в общественной деятельности относительно должностной ошибки. Но в действительности подобные преступления относятся и к частной, и к общественной деятельности. Таким образом, доктор К. Бейер, указывает на необходимость идентификации и скорейшего изменения законодательства.

---

<sup>10</sup> Betänkande 2003/04:JU021 Korruption. ([www.riksdagen.se](http://www.riksdagen.se))

<sup>11</sup> Там же.

Группа социологов из Университета Лунд под руководством профессора М. Акерстром (Malin Åkerström), изучая коррупционные явления, указывают на полное отсутствие каких-либо систематизированных официальных данных о происшествиях в этой области<sup>12</sup>. Более того, в полицейском ведомстве полагают, что само научное изучение подкупа и взяток является «сумасбродным», так как взятки в Швеции нет. Подобных взглядов придерживались и университетские коллеги, которые считали исследования о взятках малозначимыми для Швеции. Однако едва ли будет преувеличением утверждать, что в последнее время взятки и коррупция – это темы, которые получили распространение в официальных дебатах. Правовая сущность этих явлений требует расследований коррупционных преступлений. Народное неудовольствие демонстрируется такими знаками времени, как формирование общественного настроения в резолюциях, например, организации «Объединения против несправедливости и злоупотребления властью» («Föreningen mot orättvisor och maktmissbruk»). Таким образом, тема коррупции и взяток касается теперь также и Швеции, а не только других регионов мира.

Итак, группа ученых из Института социологии Университета города Лунд провела исследование под рубрикой «взятки и мораль» («mutor och moral»), целью которого был анализ традиционных представлений о взятках среди различных групп населения. Базой исследования послужили интервью, взятые социологами у людей, осужденных в Швеции за подкуп и взятки, а также у полицейских и обвинителей этой сферы правонарушений. Ученых интересовали именно традиционные представления о взятке, а не юридическая сторона дела. Народные представления о взятках очень важны тем, что они лежат в основе понимания того, почему известное действие рассматривается как подкуп или, напротив, как некоррупционное явление. Они говорят об обстоятельствах и ситуациях, которые могут быть оправданными или справедливыми в случаях юридически сомнительных явлений. Общепринятые представления о взятках также важны, так как они являются материалом для обвинений в делах о коррупции. Чтобы распознать взятку, нужно знать, что же она собой представляет.

Изучение этих традиционных представлений позволило выделить пять составляющих взятки: секретность, ценность, производство выгоды, четкая последовательность (сначала – дар, затем – услуга), принятие дара на дистанции от дарителя. Раскроем последовательно эти составляющие.

Что характеризует традиционные представления шведов о взятках? Что рассматривается в качестве взятки? Во-первых, взятка должна преподноситься секретно или хотя бы тактично, она боится гласности. Взятка передается скрыто

---

<sup>12</sup> Betänkande 2003/04:JUJ21 Korruption. ([www.riksdagen.se](http://www.riksdagen.se))



(в тени) или «под столом». Поэтому, по мнению обследуемых, открытые транзакции могут избегать рассмотрения в качестве коррупционных, так как они являются именно открытыми. К примеру, сделка носит сомнительный характер и имеется выплата комиссионных за предоставленную услугу. Но если в этом случае бухгалтерская отчетность оформляется в обычном порядке, то тогда невозможно говорить о взятке.

Во-вторых, по мнению интервьюируемых, ценность взятки должна быть высокой. К примеру, если подносится подарок в виде взятки, то ожидается, что он должен быть очень дорогим. Такое представление разделяют не только лица, осужденные за взятку, но и судьи. Взятки небольшого формата, как свидетельствуют судьи, имеют широкое распространение и не должны рассматриваться в качестве взятки. Многие шведские предприниматели указывают, например, что несколько денежных купюр облегчают полицейский и таможенный контроль в Восточной и Центральной Европе, и это явление носит повсеместный характер.

В-третьих, предполагается, что взятка производит пользу (милость). Действительно, в идеальном случае взятка обуславливает производство выгоды или благосклонности. Нужно уметь распознавать, в чем состоит выгода взятки. Например, при контроле превышения скорости взятка выводит из затруднительной ситуации. Взятка позволяет дающему ее добиться желаемого для него результата или каких-либо преимуществ при сделке. Отсутствие точного описания выгоды взятки уводит от обыденных человеческих представлений о взятках.

В-четвертых, предполагается, что дача взятки вовлечена в процесс определенной последовательности, а именно, сначала – подарок, затем – услуга. Обратная последовательность, другими словами, подарок, который дарится после предоставления услуги, едва ли может рассматриваться как взятка в обыденных представлениях. Подобные подарки оцениваются людьми как благодарность, а не как коррупционное явление. То, что юридически должно классифицироваться как взятка, может быть оправдано тем, что подарок был преподнесен после выполненной задачи и не мог влиять на ее исполнение.

В-пятых, согласно мнению обследуемых, дача взятки не производится в непосредственной близости «от нас» (т.е. за этим процессом невозможно наблюдать). Это происходит в каком-то секретном месте. Считается, что более вероятно, что подарки и услуги, которые происходят в другом месте («далеко от нас»), или в другой культуре, могут квалифицироваться как коррупционные, в отличие от подарков и услуг, которые дарятся в нашей непосредственной близости. Явления, происходящие вдали от нас, будут скорее описываться как коррупционные и объясняться культурной традицией других социальных слоев. В этом случае, как правило, коррупция приписывается иной культуре, а не

своей собственной. Таким образом, можно утверждать, что, по мнению шведов, взятки редко происходят вблизи их ближайшего окружения и представителями их (шведской) культуры.

Социолог Д. Вастерфорс (D. Wästerfors) из Университета г. Лунд в этой связи указывает, что само отсутствие законодательного определения и точного способа измерения коррупции может сделать характер антикоррупционной кампании контрпродуктивным. Более того, это создает в обществе атмосферу подозрительности, приводящей к «охоте на ведьм»<sup>13</sup>. Поэтому конструктивным решением является определение четких юридических границ понятия взятки, а также детальных критериев того, что есть взятка, а что ею не является. В настоящее же время в общественном сознании шведов укоренилось представление, что таких явлений, как подкуп и взятки, в Швеции не существует. Д. Вастерфорс напомнил о том, что антикоррупционная этика базируется на определенном западноевропейском идеале. Он заключается в вере в справедливое или беспристрастное решение, ценность которого настолько велика, что взятка оскорбляет его (решение). Тот, кто принимает решения – судья, чиновник, политик, не должны оказывать одолжение кому-либо, а должны лишь честно исполнять свои функции. Успешность этой идеи тесно связано с важнейшим правилом функционирования западной бюрократии. Она должна принимать решения исходя из существа дела, независимо от статуса вовлеченных в него лиц. Насколько достижим этот идеал на практике, свидетельствуют бесчисленные научные исследования.

Шведские социологи, анализируя представления о взятках в обществе в своих исследованиях, делают оптимистичный вывод о том, что поскольку сознание простых людей в действительности направлено на ожидание справедливости и беспристрастности, то необходимо юридически защитить и поддержать эту позицию.

Таким образом, можно подвергнуть сомнению индекс коррупционности, приводимый независимой интернациональной антикоррупционной организацией «Transparency International». Этот индекс строится на анализе исследований, которые проводят различные научные институты. Измерение индикаторов коррупции при этом строится на опросах аналитиков и предпринимателей в соответствующих странах. Но, как показывает наш анализ традиционных представлений о коррупции, понимание этого явления основано на индивидуальном специфическом восприятии людьми. В связи с этим международные сравнения интегральных показателей уровней коррупции в разных странах могут быть некорректны.

---

<sup>13</sup> Betänkande 2003/04:JUJ21 Korruption. ([www.riksdagen.se](http://www.riksdagen.se))

# **БАНКИ И ФИНАНСЫ**

---



N.V. Tlekhugov,  
K.F. Kush,  
A.I. Stolyarov  
Higher School of Economics

# **METHODS FOR DETECTION OF NON-TYPICAL TRANSACTIONS. APPLICATION FOR RUSSIAN STOCK MARKET**

---

## **Introduction**

Russian stock market has quite a long history from its establishment in 90<sup>th</sup> of XX century till nowadays. Current operational and legal infrastructure of the financial market in Russia has [so far] been established as a complete system. And the market itself has become an essential part of the Russian economy.

Despite all modern developments, high market liquidity and securities turnover level, especially during the pre-crisis period of the year 2008, regulatory and controlling infrastructure has not developed sufficiently to be considered mature and complete. Allegedly, the most widespread market abuses in Russian stock market are illegal insider trading and market manipulation. It worth noting that the legal framework for that kind of control and monitoring activities on the market was not established till the end of 2010 when the federal act on prohibition of insider trading and markets manipulation was adopted (Federal Law № 224 – FL 224).

The FL № 224 introduced the notion of «insider», «insider (material) information» and declared norms and regulations for prevention of illegal activities on the financial market. It is obvious that it will take a while to fully incorporate all the innovations into the market and make the majority of the Russian stock market participants adopt «prudent» behavior. And it will definitely be accompanied by the development of comprehensive control and monitoring infrastructure, a bulk of government information letters and intra-firm bylaws concerning insider trading, material information, compliance guidelines etc. The process will be a little chaotic and step-like along with the information and experience accumulation within the market and by its participants.

The above mentioned regulatory, control and compliance documents can be viewed as a «cover» (or «shell») for its «contents» – the effective anti-fraud infrastructure in the market. Here one can refer to the anti-fraud infrastructure as specific software and hardware-based monitoring solutions for exchanges and for the regulator (Federal Department of Financial Markets, Russian stock market regulator), proper disclosure system, dedicated staff within market participants etc.

Therefore the development of an efficient control and monitoring system supported by thorough research work is highly topical. And one of the most important components of such a system is market abuse detection methods. The rest of the article includes the discussion of some aspects of this «ideal» monitoring system, a brief summary of the existing literature on the subject and the indicative example of one newly developed math approach.

## Preliminary comments

Every monitoring system consists of computational (numerical) analytical methods, visual analysis and implementation (operational) blocks. This article considers numerical procedures only, but the remaining parts of the system are also of high importance and have to be thoroughly investigated. The motivation for numerical methods is straightforward – they are the most relevant field for scientific research.

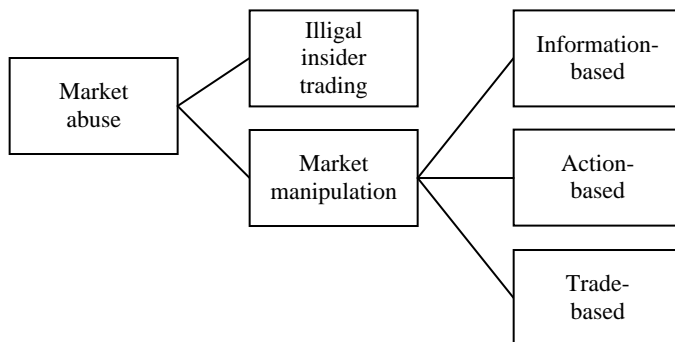
First of all, let us define the subject of the paper – non-typical transactions. The preliminary definition for the purpose of the papers is: «the exact transactions that were implemented on the market or were planned for the purpose which does not agree with the common sense and market wisdom or the implementation is not legal under the legislation applied». The definition covers not only market abuse cases but also those transactions that are «technical» mistakes, e.g. wrong order implementation. At the same time transactions which are the result of wrong information interpretation should be treated as «typical».

The definition should be viewed in association with generally accepted market abuse classification because every «non-typical transaction» is the result of some kind of abusive behavior on financial market.

Comments to fig. 1:

- Information-based manipulation is spreading false data and rumors about a company;
- Action-based manipulation is non-trading covert actions for the purpose of self-enrichment of a manipulator, e.g. felonious bankruptcy etc.;

- Trade-based manipulation is a wide-range of trading strategies aimed at illegal profiting from misleading other market participants.



**Fig. 1.** Market abuse classification

As can be seen from fig. 1 a non-typical transactions phenomenon is the result of illegal insider trades, trade-based market manipulation and technical mistakes occurring on the market. This view clarifies the notion and distinguishes it from [the] broad definition of «market abusive transactions». Thus any algorithmic methodology for detection of market abusive behavior eventually comes to a method for detecting illegal insider trades and trade-based manipulative actions of market participants.

So far we have defined the notion of non-typical transactions in contrast to «typical» ones. In reality every transaction can be attributed to either class by studying some of its parameters. So the detection procedure should clearly specify the list of these parameters, a computational or other suitable procedure to obtain them, a way to generate signals, and a method for interpretation of these signals.

## Existing literature survey

Insider trading phenomenon is well studied in existing empirical and theoretical research literature, and, surprisingly, it is not the case for market manipulation phenomenon.

There is a well-known debate about the consequences of insider trading for the market. Some say that it augments market efficiency by quickly introducing new information to the market, while others treat it as a serious abuse and claim that it must be prohibited in all forms. The solution for the debate is not so obvious for developed markets, like in USA or Europe. For an emerging market in Russia where there is

no sufficient market infrastructure and information allocation is highly asymmetrical the attitude towards insider trading is surely negative. As opposed to insider trading phenomenon there is no doubt about the harm of manipulators to the market: it is said to undermine the «fairness» of the market.

There are several reasons why for the purpose of construction of the detection procedure one should focus on research papers that analyze manipulative behavior. Firstly, in essence the insider behavior is covert and therefore difficult to detect. Manipulation strategies can be profitable if a lot of participants are engaged and so they can be observable.

Further, some research papers with a focus on detection of market manipulation are discussed.

There are 3 broad groups of detection methods.

The first group. Simple detection procedure that considers raw market data. The signal is generated when some predetermined indicator or coefficient deviates significantly from its «band» or authorized interval. This method is quite simple but flexible as it can be applied to almost every transaction series at every time interval. It is also model-independent.

The second group comprises procedures that utilize some statistical market models to forecast the market. The signal therefore is the statistically significant deviation from calculated «forecast» one step forward. The approach is described in [Minenna, 2003] and [Cholewiński, 2009] where authors use a time-series models to forecast stock parameters. Paper [Cholewiński, 2009] uses CAPM-like market model with autoregressive component and GARCH(1,1) errors. Paper [Minenna, 2003] utilizes the diffusion model to evaluate stock parameters like price, trade volume, market concentration.

The main advantage of this approach is that it is based on well-known statistical properties of time series and use strict criteria to generate signals. The main disadvantage is that this approach cannot be applied to classification of individual transactions within a trade session.

The third group comprises a variety of non-parametric methods and numerical algorithms. The core principle of the method is computation of a number of figures through an exactly defined algorithm, filtration of the results and graphical and numerical analysis. An example can be found at [Slama, 2008] where the authors utilize a sample entropy approach to classify transactions into «typical» and «non-typical» categories. This classification ability is the main advantage of the method. Comprehensive study of various non-parametrical algorithms can be found in [Öğüt et al., 2009]



where authors test classification power of four algorithms, namely: multiple discriminant analysis, logistic regression, artificial neural networks (ANN) and a support vector machine (SVM) approach. Results show that non-parametrical procedures (ANN and SVM) are more powerful with classification of manipulated and non-manipulated samples.

The main disadvantages of these approaches are the need to constantly and precisely calibrate the algorithm parameters and potential bias towards ambiguous signals of the system. Numerical algorithms need to be tested thoroughly before one can judge their effectiveness and put them into practice.

The bottom-line is that there is no clear answer as to what is the best numerical method. Therefore this topic is an abundant field for further research.

## **Assessment of the possible applications of the entropy coefficient to financial market analysis and non-typical transactions**

It has been mentioned that any numerical method for non-typical transactions detection incorporates: a number of parameters that can be used to classify all market transactions to either type, calibration procedure and explanation for different parameters values. One of the examples is the chaos approach. The chaos theory approach to financial market is quite new to date, first references and empirical studies can be found in the literature of 2000<sup>th</sup>. An interesting example can be found in [Pincus et al., 2004] where the authors propose some new coefficients and parameters for the market analysis and even valuation of various assets.

Due to the disadvantages of time-series methods mentioned earlier and Russian financial market specifics (e.g. low liquidity for most securities) the entropy approach has been chosen for this article. The parameter to be discussed is the sample entropy (SampEn). It is thoroughly discussed in [Slama, 2008] and [Reddy, Sebastian]. In [Slama, 2008] the authors try to develop the method to detect manipulative transactions. It is based on a presumption that when a manipulator enters the market he brings a sort of «regularity» into it, so the entropy of the market must decrease somehow. The authors considered a number of cases of proved manipulation and assessed the characteristics of entropy parameters. They conclude that signals are too ambiguous and the method requires further investigation.

## SampEn computation procedure

Entropy measures a degree of irregularity within the data. To numerically assess several different coefficients were developed. As it is stated in [Lake et al., 2002] the SampEn is the most unbiased estimator for the entropy on small samples and will be used for this paper.

The first step is to define basic parameters of raw market data, their computation formulas and so called data «scale». For illustrative purposes of this article two parameters were selected:

- Normalized return for two consecutive transactions (price incremental in %);
- Normalized transaction volume.

Scaling procedure can be applied to «smoother» data and eliminate seasonal effects by using non-overlapping averages instead of raw numbers. In order not to complicate the example scale level 1 has been chosen which is raw data without averaging.

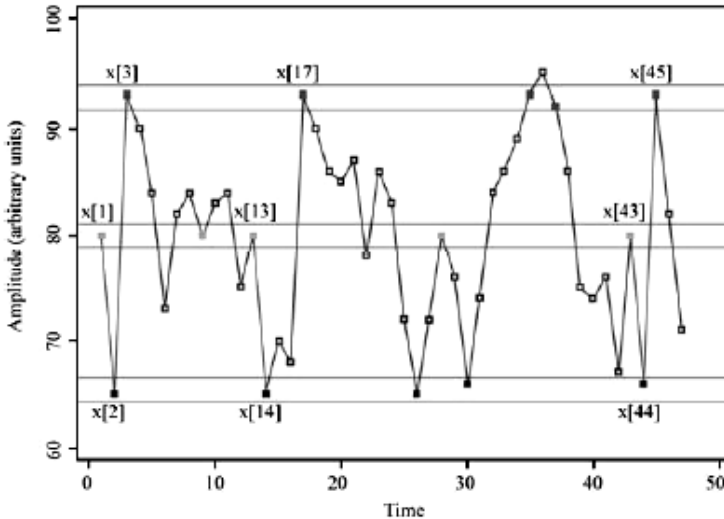
One can also utilize non-overlapping sampling procedure (different trade days), consider all the transactions for a period as one sample (without considering their timing) or construct a sample on rolling basis (estimation window of predetermined length).

Define  $X = \{x_1, \dots, x_n\}$  as a generated sample for entropy estimation. Individual elements correspond to either normalized return or transactions volume mentioned earlier. Let  $r = 20\%$  be sensitivity parameter and  $m = 2$  – subsequences length. Parameters « $r$ » and « $m$ » are chosen according to existing literature. Further research is needed to assess different variants for them.

Define  $u_m(i) = \{x_i, \dots, x_{i+m-1}\}$ , here  $1 < i < M - m + 1$ . In a case with  $m = 2$  and  $m = 3$  this would be two- and three-component vectors. Further for all  $i$  from  $1 < i < M - m + 1$  compute  $n(i, m, r)$  as a number of  $u_m(j), i \neq j$  that are «similar» to  $u_m(i)$ . «Similarity» can be in different ways but for simplicity reasons let us consider two vectors similar if corresponding coordinates differ not more than  $\pm r\%$ . Percentage is used because  $X$  consists of normalized data.

In fig. 2 vector (x1, x2) is similar to (x12, x14) and (x43, x44). For  $m = 3$  only vector (x1, x2, x3) is similar to (x43, x44, x45). Complete enumeration of all possible  $m$ - and  $(m + 1)$ -component vectors needed then and it is the main time-intensive part of the algorithm. Define  $A = \sum_{i=1}^{N-m} n(i, m, r)$  and  $B = \sum_{i=1}^{N-m-1} n(i, m+1, r)$  – number of all similar  $m$ - and  $(m + 1)$ -component vectors within sample  $X$ .

Define  $SampEn(m, r, N) = \log \frac{A}{B}$ .



**Fig. 2.** Illustration of vector similarity<sup>1</sup>

## Data

It was declared on 02/12/2011 that PepsiCo acquired WimmBillDann for a bulk of cash. For the purpose of this paper WimmBillDann securities behavior around 02.12.2010 has been analyzed. Estimation period is from 22/11/2010 till 08/12/2010. It is stated by SEC that some suspicious activity from 29/11/2010 till 02/12/2010 has been detected for WBD ADRs<sup>2</sup>. As ADRs intraday quotes data cannot be acquired, Russian stocks data is utilized instead for transactions that occurred on MICEX for the period.

The next section considers an example of entropy coefficient computation procedure.

<sup>1</sup> The graphics is analogous to [Slama, 2008] and [Chikwasha, 2009].

<sup>2</sup> <http://ma-journal.ru/news/77063>

## Results and discussion

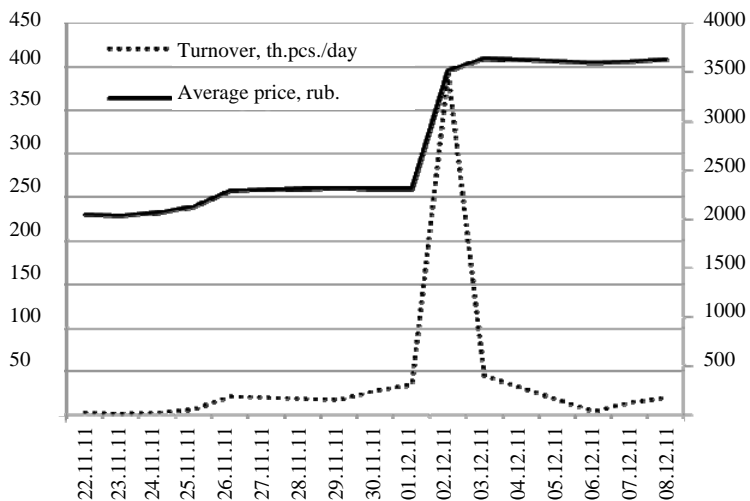
Descriptive statistics for the sample is in Table 1.

**Table 1.** Descriptive statistics for price incremental and transaction volume for WBD, 22/11/2010–08/12/2012

Date	Transactions number for the date	Turnover, pcs./day	Average price	Intraday standard deviation of price	Turnover for the date, mln. RUR	WA of price for the date	Average number of securities per transaction, pcs.	Standard deviation of the number of securities per transaction, pcs.	Average number of securities per transaction/st.dev(lag 1), %	Average price incremental, %	Standard deviation of price incremental	Average price incremental/st.dev(lag 1), %
22.11	144,0	2480	2044,8	10,2	5,1	2043,0	17,2	112,3		-0,000	4,94	
23.11	247,0	1940	2033,1	8,2	3,9	2028,2	7,9	47,0	7,0	0,001	2,78	0,03
24.11	97,0	2641	2064,5	16,5	5,5	2069,8	27,2	105,6	57,9	0,409	5,63	14,74
25.11	125,0	5941	2132,1	26,0	12,7	2143,8	47,5	126,9	45,0	0,512	6,57	9,09
26.11	332,0	21408	2287,8	54,8	49,5	2312,5	64,5	176,7	50,8	0,395	10,89	6,01
29.11	124,0	17748	2323,8	22,7	41,4	2334,1	143,1	387,4	81,0	0,443	10,39	4,07
30.11	137,0	28565	2312,4	14,5	66,1	2313,7	208,5	958,6	53,8	-0,307	7,47	-2,95
01.12	95,0	34471	2312,2	25,4	79,6	2308,4	362,9	1591,4	37,9	0,189	11,72	2,53
<b>02.12</b>	<b>4447,0</b>	<b>392605</b>	<b>3520,5</b>	<b>387,2</b>	<b>1289,9</b>	<b>3285,4</b>	<b>88,3</b>	<b>496,9</b>	<b>5,5</b>	<b>0,322</b>	<b>18,98</b>	<b>2,75</b>
03.12	1868,0	45015	3639,2	83,6	163,2	3624,5	24,1	93,6	4,8	-0,048	12,75	-0,25
06.12	252,0	4044	3600,8	16,9	14,6	3600,3	16,0	40,1	17,1	-0,206	7,31	-1,62
07.12	225,0	14698	3614,8	15,7	53,2	3619,5	65,3	168,1	162,9	0,053	7,78	0,73
08.12	177,0	20214	3628,8	9,9	73,4	3630,4	114,2	294,1	67,9	0,114	4,74	1,46

Proven information for the deal came to the market on 02/11/2010 and that was clearly reflected by the market in increased transactions price and volume (fig. 3). The average deal size in a number of securities traded increased too, which is the signal for increased market activity before the announcement. The main reason why this activity occurred before the announcement date is that there possibly were some market talks about the deal. The market «adapted» for this event. Also it should be noted that the difference in price between close intraday transactions diminished as can be seen in Table 1 (normalized price increment). This fact relates to market «smoothing» with increased liquidity and participants for WBD «in play».

Estimation for entropy coefficient is in Table 2.



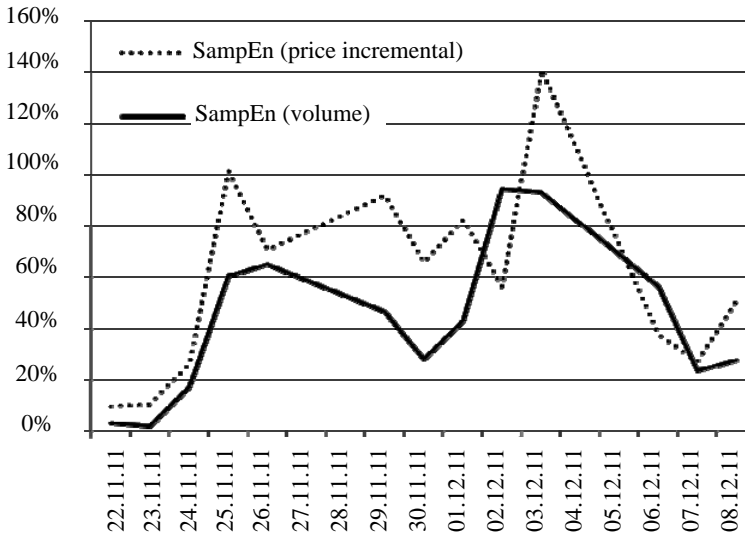
**Fig. 3.** Deal was announced on 02/11/2010. Average deal size and price increased prior

**Table 2.**

Entropy coefficient for price incremental and transaction volume for WBD, 22/11/2010 – 08/12/2012

Date	SampEn (price incremental), %	A	B	SampEn (volume), %	A	B
22.11	9,6	14148	14613	3,2	9826	8926
23.11	10,3	27612	28086	1,7	24195	21817
24.11	26,2	3408	4037	16,9	3263	2512
25.11	101,5	1908	3490	60,4	2219	804
26.11	70,6	3137	5996	64,8	6389	3155
29.11	92,0	2070	3300	46,6	2631	1049
30.11	65,7	4825	6363	27,7	4570	2369
01.12	82,2	1635	2506	42,7	1716	754
02.12	56,4	2020	5203	94,6	18380	10456
03.12	141,2	1506	3824	93,2	3934	959
06.12	37,7	3518	6171	56,2	20385	13980
07.12	27,2	10452	13200	23,3	12206	9297
08.12	50,9	6034	7941	27,5	6256	3762

Table 2 and fig. 4 show that entropy coefficients for both data types tend to increase prior to announcement and this can be seen as market becoming more «irregular».



**Fig. 4.** SampEn signals are too ambiguous

On 02/12/2010 when information for the deal reaches the market SampEn is close to 1. Afterwards the coefficient steadily decreases. Such signals are too confusing and no conclusions can be made due to this fact. It is quite useful to compare classic event-study approach to entropy coefficient behavior. It can be seen from fig. 5 that there are no statistically significant price movements prior to 02/11/2010 and also for that period SampEn coefficients show some significant fluctuations and tend to increase long before the announcement date.

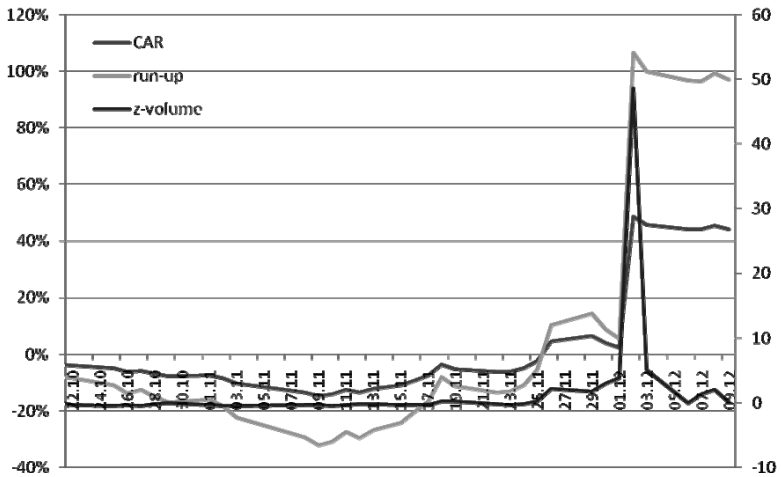


Fig. 5. Event-study basic parameters for the case discussed

## Conclusion

The main purpose of this paper was to introduce sample entropy approach and the coefficient computation procedure and try to estimate it for Russian market. The results are too confusing and the approach needs to be tested further to better understand its application. The computational algorithm was described in general, which is useful for further research.

Comparison of event-study parameters and SampEn behavior revealed that the entropy coefficients are more sensitive. These findings suggest the coefficient may be a candidate for some complex non-typical transactions detection procedure.

To conclude, let us outline the main differences of entropy approach in comparison with time-series based models. Econometric models can be readily applied and estimated parameters tested for significance. There is also no need to «educate» them. The crucial disadvantage is that the data structure is incorporated in the model and therefore some non-linear structural changes are hard to detect.

Entropy approach in contrast is aimed at assessing the characteristics of the data internal structure. One particular coefficient discussed so far – SamEn, but there are also other coefficients and numerical algorithms (some of them are mentioned in this paper). Micro structural approach with learning features seems to be sufficiently interesting to be thoroughly investigated and applied for Russian market analysis.

## References

*Chikwasha V.* Time-series Analysis Using Wavelets and Entropy Analysis // BMC Bioinformatics. 2009. Vol. 10. Jan. P. 32.

*Cholewiński R.* Real-time Market Abuse Detection with a Stochastic Parameter Model // Central European Journal of Economic Modelling and Econometrics. 2009. Vol. 284. P. 261–284.

*Lake D.E., Richman J.S., Griffin M.P. et al.* Sample Entropy Analysis of Neonatal Heart Rate Variability // American Journal of Physiology. Regulatory, Integrative and Comparative Physiology. 2002. Vol. 283. Sep. P. R789–797.

*Minenna M.* The Detection of Market Abuse on Financial Markets: A Quantitative Approach. 2003.

*Öğüt H., Doğanay M.M., Aktaş R.* Detecting Stock-price Manipulation in an Emerging Market: The Case of Turkey // Expert Systems with Applications. 2009. Vol. 36. Nov. P. 11944–11949.

*Pincus S., Kalman R.E.* Irregularity, Volatility, Risk, and Financial Market Time Series // Proceedings of the National Academy of Sciences of the United States of America. 2004. Vol. 101. P. 13709.

*Reddy Y., Sebastian A.* Parameters for Estimation of Entropy to Study Price Manipulation in Stock Market. (papers.ssrn.com)

*Slama M.* Trade-based Stock Price Manipulation and Sample Entropy. 2008.



Т.В. Теплова,  
Е.С. Шутова  
Национальный исследовательский  
университет «Высшая школа  
экономики»

# СОПОСТАВЛЕНИЕ МЕР РИСКА ДЛЯ ОБЪЯСНЕНИЯ ДОХОДНОСТИ ИНВЕСТИРОВАНИЯ НА ЛОКАЛЬНЫХ ФОНДОВЫХ РЫНКАХ ПЕРЕХОДНЫХ ЭКОНОМИК

---

В работе представлены результаты сопоставления различных мер риска для объяснения страновых различий доходности портфелей, построенных на основе фондовых индексов. Анализируется поведение доходности страновых портфелей акций на 13 фондовых рынках стран постсоветского пространства (России, Венгрии, Румынии, Казахстана, Украины, Болгарии, Эстонии, Литвы, Латвии, Словении, Словакии, Польши и Чехии). Задача исследования – сопоставить и выявить адекватные меры риска для объяснения вариации доходности по портфелям с позиции глобального инвестора на докризисном, кризисном и послекризисном периодах функционирования глобальной экономики. Сопоставляются как систематические меры риска («страновой бета», односторонние, моменты распределения высшего порядка – гамма и дельта), так и новые, интуитивные. Показано, что введение односторонних мер риска повышает объяснительную способность моделей «риск-доходность». Интуитивная мера риска «выигрышей и потерь» приемлема на периоде устойчивого роста экономики, но не может объяснить вариацию доходностей страновых портфелей в период кризиса.

## Введение

Последнее десятилетие ознаменовалось пристальным интересом аналитиков к изучению поведения рынков развивающихся стран. Отчасти это свя-

зано с тем, что по большинству развитых рынков (США, Европа) не наблюдаются положительные результаты инвестирования, о чем свидетельствует сопоставительная табл. 1. С другой стороны, включение в портфель индексов из развивающихся рынков капитала может существенно повысить результаты инвестирования.

**Таблица 1.** Сопоставительный анализ выгод инвестирования в фондовые индексы на разных временных отрезках. Годовая доходность инвестирования как средняя геометрическая, %

Возможные инвестиционные портфели	1996–2010 гг.	2000–2010 гг.	2005–2010 гг.	2008–2010 гг.
MSCI Emerging Markets Index	6,33	8,09	13,37	–2,59
MSCI Developed Markets Index (World Index), портфель из 24 фондовых индексов развитых стран мирового рынка: Австралия, Австрия, Бельгия, Канада, Дания, Финляндия, Франция, Германия, Греция, Гонконг, Ирландия, Израиль, Италия, Япония, Нидерланды, Новая Зеландия, Норвегия, Португалия, Сингапур, Испания, Швеция, Швейцария, Великобритания, США)	3,77	–0,94	1,52	–6,95
АС EUROPE Index (портфель из 21 фондового индекса 16 развитых стран Европы и еще 5 стран: Чехия, Венгрия, Польша, Россия, Турция)	7,46	6,67	5,94	16,05
EAFE index	2,56	–0,54	1,51	–9,72
MSCI EUROPE Index (16 развитых стран Европы)	7,34	6,54	5,65	15,47
S&P 500 (крупнейшие компании США)	5,17	–1,45	0,91	–6,72
DJ 30 (зрелые промышленные компании США)	5,92	0,19	1,53	–5,79
DAX, Германия	8,23	0,24	10,01	–6,74
KZKAK (2000–2010), Казахстан	NA	28,78	41,25	–13,35
RTS (Classic), Россия	22,20	22,26	17,92	–10,74
MICEX, Россия	23,72	24,47	20,47	–3,68

*Примечание:* все значения индексов переведены в доллары США для сопоставимости, соответственно, в таблице показаны годовые доходности в долларом выражении.

В табл. 1 для сопоставления приведены доходности двух крупных рынков стран переходных экономик (бывшего постсоветского пространства): России и Казахстана. Как видим, уровни доходности на порядок выше, чем по развитым странам. Открытым остается вопрос оценки рисков. Проблема в том, что риск может быть оценен по-разному и, соответственно, сопоставление выгод инвестирования не однозначно.

Моделированию поведения доходности на рынках развивающихся стран и сопоставлению мер риска посвящено в последние годы огромное число исследований. Кратко охарактеризуем работы, которые появились в последнее десятилетие и которые имеют прямое отношение к проводимому нами исследованию. Локальные фондовые рынки сопоставляются по уровню доходности и риску, при этом рассматриваются различные меры риска, способные объяснить вариацию доходности индексов с позиции глобального инвестора. Наиболее часто тестируются систематические меры риска, объясняющие поведение портфелей (страновых фондовых индексов) относительно глобального портфеля.

В работе [Girard, Omran, 2007] на примере 5 арабских стран (Египет, Иордания, Марокко, Саудовская Аравия и Тунис) показано, что модель CAPM с неизменными оценками бета не может объяснить различие доходностей рассматриваемых страновых активов (*cross-sections of stocks return*). Авторы рекомендуют аналитикам учитывать как фундаментальные характеристики компаний, входящих в выборку, так и страновые (рейтинговые) факторы риска (например, политического).

В работе [Hwang, Pedersen, 2002] показаны результаты тестирования трех моделей на основе конструкции CAPM по выборке 26 страновых индексов на 10-летнем временном горизонте (апрель 1992 – март 2002 гг.): с традиционным бета-коэффициентом и с двумя мерами одностороннего риска – LPM – CAPM (Lower Partial Moment CAPM) и ARM (Asymmetric Response Model). В работе сделан вывод, что по своей объясняющей способности традиционный бета-коэффициент не уступает альтернативным моделям формирования мер рыночного риска. На перекрестной выборке объясняющая способность традиционной CAPM достигла 80% на данных недельной и месячной доходности, и 55% – на данных дневной доходности. Значимых преимуществ асимметричных мер риска на уровне нескольких рынков капитала выявлено не было. Кроме того, проводя анализ, авторы разделили выборку 26 развивающихся стран по регионам, а затем разбили весь временной период наблюдений на два промежутка – до и после «азиатского кризиса» 1997 г. Именно это позволило показать значимое влияние локальных рисков на развивающихся рынках капитала, но не привело к доказательству преимуществ односторонних мер риска.

В работе [Estrada, 2002] для тестирования односторонней авторской меры систематического странового риска используются ежемесячные наблюдения о фондовых индексах 27 развивающихся стран из базы данных Morgan Stanley Capital за период 1988–2001 гг. Автору удалось показать преимущество односторонних мер риска над традиционными мерами в объяснении различий доходности по странам, особенно в период кризисных отрезков времени. Автор объясняет это наличием «вирусного эффекта» на финансовых рынках (рынки являются более интегрированными в случае кризиса, чем в случае экономического подъема, что и должны фиксировать односторонние меры риска по отношению к глобальному портфелю).

В исследовании [Collins, 2005] тестируются различные меры риска для 42 стран развивающегося рынка капитала: систематического (бета-коэффициент), общего (стандартное отклонение), идиосинкратического, одностороннего (одностороннее отклонение, односторонний бета-коэффициент и  $Var$ ), учитываются также показатели моментов распределения высшего порядка (*higher order moments*) – скошенности и эксцесса, а также характеристики размера рынка. Тестирование проводилось с помощью эконометрического метода (так же как и в большинстве подобных работ) с позиции глобального инвестора на пятилетнем временном промежутке (январь 1996 г. – июнь 2001 г.) по недельным доходностям. Вывод работы: бета-коэффициент (а следовательно, и модель CAPM) некорректно применять для всей совокупности развивающихся стран. Д. Коллинз утверждает, что нет единого показателя риска, который подходил бы для любой страны из группы развивающихся.

Тестирование трех односторонних мер риска ( $BL$ ,  $HB$ ,  $E-beta$ ) для 27 развивающихся рынков на отрезке 1995–2004 гг. проведено в работе Don U.A. Galagedera (2007). Показано, что для рынков с большой асимметрией распределения доходности (высокий коэффициент скошенности) наиболее приемлемой мерой систематического риска является  $HB-beta$ . Для рынков с наблюдаемыми существенными сверхнормальными доходностями преимущество над другими мерами риска имеет  $BL-beta$ .

Спред выгод и потерь ( $GLS$ ) Эстрады (2009)<sup>1</sup> – новая, интуитивная мера риска, которая тестировалась автором на выборке 49 стран (22 развитые и 27 развивающихся рынков капитала) и по 57 отраслевым индексам. Объяснительная способность новой меры сопоставлялась с традиционными систематическими мерами риска относительно *MSCI World index*. Автор доказывает, что легко рассчитываемая мера риска  $GLS$  применима для ранжирования портфелей, по-

---

<sup>1</sup> Изложение этой меры риска можно найти в работе [Теплова, 2011].

зволяет разграничить портфели низкого и высокого риска не хуже, чем стандартное отклонение или рыночный бета-коэффициент. Методология расчета различных односторонних мер риска, а также систематических моментов высшего порядка (гамма и дельта) с количественными оценками для активов российского рынка, с тестированием их объяснительной способности на трех временных горизонтах (до кризиса, в кризис и после кризиса) представлены в работах [Теплова, Шутова, 2010; Teplova, Shutova, 2010, 2011].

**Таблица 2.** Описательная статистика индексов для 2010 г.

Country	Ticker	T	AM, %	SD, %	Excess	Asymmetry
Estonia	OMXT index	51	0,5	3,3	3,44	1,06
Latvia	OMXR index	48	0,47	2,7	-0,25	0,09
Slovenia	SBITOP index	49	-0,2	1,7	1,09	-0,24
Lithuania	OMXV index	46	0,37	2,1	1,78	0,28
Russia	MICEX index	45	-0,1	2,6	0,82	-0,67
Slovakia	SAX index	48	-0,6	4	5,57	-1,67
Bulgaria	SOFIX index	48	-0,2	2,1	1,86	-0,37
Czech Republic	PX index	45	-0,7	2,9	5,05	-1,87
Ukraine	PFTS ukraine index	35	0	5,4	20,44	-3,99
Kazakhstan	KZKAK index	37	-0,3	3,3	1,71	-0,98
Romania	BET index	45	0	3,4	8,73	-1,9
Hungary	BUX index	43	-0,9	3,8	3,15	-1,26
Poland	WSE WIG index	44	0	1,9	1,17	-0,68

T – число периодов наблюдений; AM – средняя арифметическая недельная доходность, %, SD – стандартное отклонение недельной доходности, %; Excess, Asymmetry – оценки распределения вероятности доходности индексов.

Наше исследование строится на межстрановых сопоставлениях с целью понять, как различные меры риска объясняют вариацию доходности страновых портфелей с позиции глобального инвестора. Так как распределение доходности финансовых активов и портфелей по рассматриваемой нами выборке далеко от нормального (табл. 2), то сопоставление страновых фондовых индексов строится на анализе объяснительной способности следующих мер риска:

1) односторонние отклонения доходности от заданного бенчмарка (односторонние бета Hogan – Warren (1974), Bawa – Lindenberg (1977), Harlow –

Rao (1989), Estrada (2002, 2007) с различными уровнями отсечения (бенчмарка). Рассчитанные по странам оценки по двум временным периодам показаны в табл. 3 и 4);

2) моменты распределения третьего и четвертого порядков (асимметрия и эксцесс распределения доходности активов и портфелей), точнее, рассчитанные по фондовым индексам коэффициенты систематической асимметрии и эксцесса (гамма и дельта в табл. 3 и 4);

3) вероятность потерь и выигрышей в рамках меры риска X. Эстрады (*gain-loss spread – GLS* [Estrada, 2009], последний столбец в табл. 3 и 4.

**Таблица 3.** Показатели риска фондовых индексов стран постсоветского пространства на отрезке 2008–2009 гг.

Страна	Четыре момента распределения доходности фондового индекса				Односторонние меры риска (бенчмарк = средняя доходность по рынку)				Интуитивная мера риска GLS
	E(Ri), %, 2008–2009	beta	gamma	kurtosis	$\beta_i D$ Estrada with $\tau = \mu$	$\beta_i D$ HR with $\tau = \mu$	down-side gamma Estrada with $\tau = \mu$	down-side gamma HR with $\tau = \mu$	
Эстония	-0,72	0,24	1,82	0,23	0,38	0,33	0,38	0,37	2,69
Латвия	-0,44	0,17	-0,17	0,13	0,24	0,17	0,18	0,12	2,74
Словения	-0,99	0,24	0,12	0,19	0,28	0,23	0,22	0,19	2,64
Литва	-0,54	0,22	2,14	0,21	0,36	0,32	0,38	0,37	2,55
Россия	-1,11	0,85	0,79	0,78	0,84	0,84	0,8	0,8	4,59
Словакия	-0,25	-0,05	0,95	-0,11	0,06	0,01	0,03	0,01	3,09
Болгария	-1,25	0,27	3,16	0,16	0,46	0,4	0,46	0,43	1,38
Чешская Республика	-0,63	0,55	0,15	0,57	0,56	0,53	0,52	0,52	3,77
Украина	-0,87	0,44	0,6	0,43	0,5	0,45	0,46	0,45	4,18
Казахстан	-0,43	0,51	0,36	0,4	0,5	0,48	0,42	0,41	4,04
Румыния	-0,93	0,46	0,91	0,45	0,49	0,44	0,5	0,48	4,1
Венгрия	-0,65	0,53	0,72	0,61	0,58	0,52	0,57	0,54	3,5
Польша	-0,41	0,39	0,4	0,38	0,39	0,37	0,39	0,38	2,81

Таблица 4.

Показатели риска фондовых индексов стран постсоветского пространства в 2010 г.

Страна	Четыре момента распределения доходности фондового индекса				Односторонние меры риска (бенчмарк = средняя доходность по рынку)				Интуитивная мера риска GLS
	E(Ri), %, 2010	beta	gamma	kurtosis	$\beta_i D$ Estrada with $\tau = \mu$	$\beta_i D$ HR with $\tau = \mu$	down-side gamma Estrada with $\tau = \mu$	down-side gamma HR with $\tau = \mu$	
Эстония	0,5	0,24	0,47	0,36	0,44	0,35	0,41	0,38	2,12
Латвия	0,47	0,22	0,52	0,35	0,37	0,28	0,36	0,34	2,19
Словения	-0,17	0,15	0,34	0,27	0,26	0,23	0,28	0,27	1,26
Литва	0,37	0,27	0,37	0,3	0,35	0,33	0,33	0,33	1,55
Россия	-0,05	0,75	0,84	0,78	0,78	0,77	0,79	0,79	1,89
Словакия	-0,57	0,29	0,16	0,04	0,48	0,32	0,28	0,16	2,65
Болгария	-0,21	-0,01	0,43	0,08	0,16	0,07	0,18	0,13	1,44
Чешская Республика	-0,69	0,62	0,72	0,67	0,67	0,67	0,68	0,68	1,94
Украина	-0,02	0,93	2,19	1,44	1,25	1,2	1,49	1,47	2,85
Казахстан	-0,26	0,6	1,04	0,76	0,77	0,67	0,81	0,78	2,6
Румыния	-0,01	0,66	0,91	0,86	0,76	0,74	0,84	0,84	2,06
Венгрия	-0,89	0,8	0,84	0,84	0,83	0,81	0,84	0,83	2,66
Польша	-0,02	0,5	0,54	0,54	0,52	0,51	0,53	0,53	1,47

В работе тестируются следующие гипотезы.

1. Новая мера риска Эстрады *GLS* в лучшей степени объясняет изменение доходности портфелей (индексов) относительно глобального портфеля, чем традиционный коэффициент «странового бета».

2. На рынках, характеризующихся в целом асимметричным распределением доходностей акций и портфелей, большую роль играет фактор систематической скошенности в объяснении доходностей акций компаний.

3. Для рынков, характеризующихся островершинным распределением акций, более важное значение в объяснении вариации доходностей индексов имеет систематический эксцесс, чем традиционный коэффициент бета.

4. Односторонняя трактовка риска более продуктивна, когда распределение доходностей компаний не подчиняется закону нормального распределения. На временном периоде финансово-экономического кризиса (2008–2009 гг.) односторонние меры риска должны лучше объяснять различия доходностей по отдельным ценным бумагам и портфелям (например, ранжированным по размеру входящих активов или по возможностям роста – по мультипликатору «рыночная – балансовая оценка»:  $MV/BV$ ).

## Объект исследования и методология

Рассматриваются фондовые индексы 13 стран бывшего постсоветского пространства (России, Венгрии, Румынии, Казахстана, Украины, Болгарии, Эстонии, Литвы, Латвии, Словении, Словакии, Польши и Чехии), недельные доходности по ним. В качестве рыночного портфеля используется индекс MSCI EM по Восточной Европе (индекс рассчитывается с апреля 2002 г. и включает в себя 4 страновых индекса развивающихся рынков: Чехия, Венгрия, Россия, Польша). В работе исследуется четырехлетний период с января 2007 г. по декабрь 2010 г. Так как, по нашим оценкам, недельные данные дают наиболее устойчивые результаты, то рассматриваемые гипотезы тестируются на основе недельных данных на трех временных промежутках, включая кризисный период. В случае отсутствия необходимых данных были использованы цены закрытия индекса предыдущего дня.

В основе тестирования моделей объяснения различий в доходности активов используется двухшаговый алгоритм. Вначале для каждого рынка оцениваются вышеперечисленные меры риска, а затем средняя недельная доходность по рынку регрессируется на доходность глобального портфеля с оценкой объясняющей способности каждой меры риска в отдельности, попарно и в рамках многофакторных моделей. Тестируются как однофакторные, так и многофакторные модели (с введением, например, одностороннего бета, коэффициентов гамма и дельта, с заменой систематических мер риска на *GLS*).

## Результаты исследования

Результаты анализа мер риска показывают, что на разных временных горизонтах модели демонстрируют различия в объяснительной способности вариации доходности по отдельным акциям и портфелям. Страновые различия значимы. Традиционный неизменный коэффициент «странового бета» оказался статистически незначим для всех трех рассматриваемых временных периодов,



что согласуется с результатами работы [Girard, Omran, 2007]. Результаты тестирования лишь частично подтвердили первую гипотезу – в период докризисного роста (2007 г.) мера GLS лучше всего себя проявила в объяснении различий доходности по странам ( $R^2 = 26\%$ ) по сравнению с другими моделями (табл. 5).

**Таблица 5.** Сопоставление моделей для объяснения вариации доходностей портфелей

Период	2007 г.	2008–2009 гг.	2010 г.
Лучшая однофакторная модель	Model with Gain-Loss Spread	Model with downside gamma Estrada with $\tau = \mu$	–
$R^2$	26%	31%	–
Лучшая двухфакторная модель	–	Model with co-scewness and beta	Model with beta and co-kurtosis
$R^2$	–	42%	37%

Односторонняя трактовка риска превосходит традиционный бета по объяснительной силе. На кризисном отрезке 2008–2009 гг. и на отрезке посткризисного восстановления (2010 г.) двухфакторные модели, в которых бета-коэффициент дополнен либо систематической асимметрией, либо систематическим эксцессом, доминировали над остальными тестируемыми моделями, как по коэффициенту корреляции с доходностью, так и согласно критерию  $R^2$ .

## Литература

*Теплова Т.В., Шутова Е.С.* Моделирование систематического инвестиционного риска на разных этапах развития российского рынка капитала // XI международная научная конференция по проблемам развития экономики и общества / отв. ред. Е.Г. Ясин. Т. 1. М.: ГУ ВШЭ, 2010. С. 548–558.

*Теплова Т.В.* Трактовка риска в анализе соотношения «риск-доходность» на развивающихся рынках капитала // Управление корпоративными финансами. 2011. 1(43). С. 28–53.

*Collins D.* Measuring the Cost of Equity in Frontier Financial Markets: Working Paper. University of Cape Town, 2002.

*Estrada J.* Mean-Semivariance Behavior: Downside Risk and Capital Asset Pricing // International Review of Economics and Finance. 2007. 16. P.169–185.

*Estrada J.* The Gain-Loss Spread: A New and Intuitive Measure of Risk // Journal of Applied Corporate Finance. 2009. 21. Iss. 4. P. 104–114.

*Girard E., Omran M.* What Are the Risks When Investing in Thin Emerging Equity Markets: Evidence from the Arab World // Int. Fin. Markets, Inst. and Money. 2007. 17. P. 102–123.

*Iqbal J., Brooks R., Galagedera D.* Multivariate Tests of Asset Pricing: Simulation Evidence from an Emerging Market // *Applied Financial Economics*. 2010. 20(5). P. 381–395.

*Jagannathan R., Schaumburg E., Zhou G.* Cross-sectional Asset Pricing Tests // *Annual Review of Financial Economics*. 2010. 2. P. 49–74.

*Mamoghli C., Daboussi S.* Performance Measurement of Hedge Funds Portfolios in a Downside Risk Framework // *The Journal of Wealth Management*. 2009. 12 (2). P. 101–112.

*Teplova T., Shutova E.* An Empirical Re-examination of the Traditional and Downside CAPM Frameworks Before and After Crisis // *Corporate Finance in Bulgaria*. Sofia: New Bulgarian University, 2010. P. 73–88.

*Teplova T., Shutova E.* Higher Moment Downside Framework of Conditional and Unconditional CAPM in Russian Stock Market // *Eurasian Economic Review*. 2011. Fothcoming, Fall.

# ECONOMIC REQUIREMENTS OF MACROPRUDENTIAL REGULATION<sup>1</sup>

---

Although it has at least 30 years of history, macroprudential approach to financial regulation attracted wide attention only after the 2007+ financial crisis<sup>2</sup>. Until then it was thought that financial stability can be achieved by simultaneously attaining price stability at the macro level and by securing the soundness of individual banks at the micro level. However, recent developments indicated that focusing narrowly on banks at the individual level by omitting their system wide effects was methodologically unsound. The macroprudential approach to financial regulation is considered to fill this gap. In this approach, the regulatory authority (RA for short) is expected to take into account the macroeconomic implications of the decisions taken by individual banks.

The purpose of this note is to describe this process in a simple framework. In the first section the decision problem of a bank is formulated under microprudential regulation. The second section discusses systemic risk. It is argued that, for practical purposes, the systemic risk can be treated as a joint product of financial activity. In the third section the problem of incorporating macroprudential regulation to bank's decision problem is addressed. The fourth section focuses on an actual dispute between the policy makers and banks in Turkey, concerning macroprudential regulations. It is examined with some detail to show, first, that convincing banks to the necessity of macroprudential regulations require extra effort. Second, the identification of the proper authority responsible from designing and implementing macroprudential regulation requires attention. The paper concludes with some observations and suggestions.

---

The author is grateful to İzak Atiyas, Jamshed Ghandhi and Fatih Ozatay for their valuable comments and suggestions.

<sup>1</sup> Revised version of the paper presented in XII. Academic Conference on Economic and Social Development, organized by National Research University-Higher School of Economics, April, 5–7, 2011, Moscow.

<sup>2</sup> See, for example Brunnermeier, Crockett, Goodhart, Persaud and Shin (2009), Davis and Karim (2009), Goodhart (2010), Hanson, Kashyap and Stein (2011).

# A framework for microprudential regulation

Let  $\mathbf{x}^i$  denote the  $m$ -dimensional vector of financial instruments (goods) supplied by bank  $i$ . All banks know their outcome vector in the previous period, which is denoted by  $\mathbf{x}_{t-1}^i$ . For the sake of simplicity, it is assumed that banks first exchange messages with all market participants and base their actions on equilibrium messages. Let

$$\left\{ \eta_t^{ij} \right\}_{i,j \in I} \quad I = [1, \dots, n] \quad (1)$$

denote the set of equilibrium messages received by  $i$  and  $I$  is the set of all market participants which can be decomposed into two disjoint subsets:  $I_B$  the set of banks and  $I_{NB}$ , the set of non-bank market participants. The RA is assumed to send non-directed messages (i.e. sent same message to all participants) which are conveniently be referred to as «regulations»,  $\eta_t^0$ . Regulations can be considered as setting relations among the components of the outcome vectors of banks. Well know examples are the capital adequacy, liquidity and foreign exchange position ratios. By setting such ratios, RAs define sets of «permitted» outcomes for each bank<sup>3</sup>.

$$\mathbf{X}_{\eta^0}^i = \left\{ \mathbf{x}^i \mid \eta^0(\mathbf{x}^i) \leq b_{\eta^0} \right\}. \quad (2)$$

The «response function» of  $i$  can be formulated as a function of its outcome vector for the previous term and the set of equilibrium messages it received from other economic agents (i.e. other banks, customers etc.) and can be expressed as

$$\mathbf{x}_t^i = \varphi^i \left( \mathbf{x}_{t-1}^i, \left\{ \eta_t^{ij} \right\}_{i,j \in I} \right), \quad i, j \in I. \quad (3)$$

Assuming banks maximize their profits, and distinguishing the messages transmitted by the RA from others, their problem can be formulated in the following way

$$\max \pi^i(\mathbf{x}_t^i), \quad (4.1)$$

s.to

$$\mathbf{x}_t^i = \varphi^i \left( \mathbf{x}_{t-1}^i, \left\{ \eta_t^{ij} \right\}_{i,j \in I} \right), \quad i \in I_B, j \in I, \quad (4.2)$$

$$\mathbf{x}_t^i \in \mathbf{X}_{\eta^0}^i, \quad (4.3)$$

where  $\pi^i$  in (4.1) is the profit function of bank  $i$ <sup>4</sup>.

<sup>3</sup> This strength of this result depends on the nature of the banking system. Explicit regulation is more needed when banks are of universal type.

<sup>4</sup> Equations 4.1–4.3 describe bank as a single product firm that maximizes profit in a perfectly competitive environment. Obviously this is an oversimplification. Banks are multi-product firms

In this framework (4.2) expresses the self-imposed constraints of the bank. For the sake of simplicity it is assumed to reflect internal risk management rules of the bank. The second set of constraints, (4.3), is imposed by the regulation that transmits the RA's norms to secure the safety, soundness and stability of the individual bank in question<sup>5</sup>. Therefore banks, in maximizing their profits need to satisfy both their own and the RA's risk management constraints.

Under microprudential regulation, the RA approaches the problem from a partial equilibrium point of view and focuses only on preventing costly failure of banks. Therefore, it treats risk as an «exogenous phenomena» and advises the banks to satisfy certain conditions to manage their risks. Banks, on the other hand, apparently, do the same for they own sake. However, these two constraint sets are not the exact replicas of each other. Banks try to manage their risks, under the objective of maximizing their profits. The RA's concern, on the other hand, is not bank's profitability, but maximizing the well-being of banks' customers. It can be shown that this difference leads to different constraints on outcomes<sup>6</sup>. As discussed above both constraints are the results of similar attitudes towards risk management: Therefore, it is not surprising to observe that banks are quick to grasp the microprudential regulation, acknowledge its necessity even when they disagree with some of the specific rules.

It should also be notice that, (4.2) requires each bank to collect and process a large set of information. This may not be practical or even feasible. Therefore banks may ignore some of the available information and take into account only a subset of it<sup>7</sup>. The regulations (4.3), under credible RA assumption, may have a second function by endowing banks a guideline to screen information in defining their own constraints (4.2). This may be considered as a positive attribute, for the RA since it may

---

operating under different market structures. On the other hand, it is also quite restrictive to explain the behavior of such large and complex institutions within the framework of profit maximization hypothesis.

<sup>5</sup> In other words, (4.3) translates and adopts the regulation to the idiosyncratic conditions of the bank in question. Here, it is assumed that due to a set of factors (such as the existence supervision, credibility attributed to the RA by banks etc.) this translation/adoption is properly done.

<sup>6</sup> Financial fragility occurs when entrepreneurs' tendency to undertake investment projects with low net worth by relying heavily on external borrowing is coupled with the willingness of banks to finance them; see Minsky (1986) on this point. On In Bernanke and Gertler (1990), on the other hand, it is shown that financial fragility may eventually lead to low and inefficient investment. RA imposing its credit risk constraint on banks may prevent this outcome. It can be shown that a properly functioning RA's credit risk constraint will be tighter than the bank's. For a demonstration of this result under simplifying assumptions see Ersel (2003).

<sup>7</sup> This rationale behind such a behavior is examined by the «Rational Inattention Theory», which connects it to the finite-capacity channels of the economic decision makers, Sims (2011). On most common practice is to substitute a subset of information with proxies. Institutions, in order to defend themselves in case of a failure, prefer to rely on proxies that are widely used by their peers.

lead to a reduction in the cost of supervision. On the other hand, as more banks follow this route, their constraint sets become akin to each other and they may react in a similar manner to a change in risk they perceived.

An example may help to clarify the point mentioned above: Consider bank behavior through the business cycle: In the up phase of the cycle the risk perceived by banks as well as the RA, which practices microprudential regulation, decreases. Therefore the existing constraints (self and RA imposed) allow banks to expand their balance sheets. Banks, therefore, act procyclically and propagate the up turn. The reverse takes place when boom ends. A negative shock, similarly, amplified by the response of the banks and the consent of the RA. In both cases, eventually vulnerabilities may build-up and lead the financial system into crisis. The «2007+ financial crisis» made it clear that the pro-cyclical nature of the microprudential regulation increases the likelihood of a financial crisis by supplementing the reactions of the banks.

## **Joint product approach to the problem of systemic risk**

The term «systemic risk», despite its popularity, often is used without giving a precise definition. One of the very early definitions of the «systemic risk» was offered by Sean O'Connor (Bank of Canada), and adopted by the OECD Committee on Financial Markets: «*Systemic risk is the financial risk that arises from institutional and structural arrangements in markets which all participants (in the economy) must bear as a group*» [OECD, 1991, p. 14]. This definition clearly delineates the public good (in fact public «bad») nature of the systemic risk. Public good is an extreme form of externality and establishes a relation among economic agents that markets don't take into account. Therefore acknowledging in the existence and importance of systemic risk, inevitably requires a framework (or a mechanism) which is capable of dealing with the problems related to public goods<sup>8</sup>.

One way to introduce systemic risk as a «public bad» in banking is to conceptualize a financial instrument as a joint product of two characteristics. On the one hand a financial instrument is a financial service for the user (a private good characteristic) and, on the other hand it contributes to the systemic risk (public good characteristic). Using this convention, the relation between the operations of banks and the systemic risk can be described as follows.

---

<sup>8</sup> Public goods has a long history in economic theory that goes back to Knut Wicksell and Erik Lindahl and covers a wide range of issues, systemic risk is being only one of them. On the other hand the negative public good or «public bad» concept is used, notably, in environmental economics.

Bank customers enjoy a financial service when they have access to relevant financial instrument[s]. Therefore, financial instruments will be demanded as long as they satisfy needs of the customers. Similarly, banks will supply such instruments whenever they are profitable. In calculating the profitability of a financial instrument, banks will take relevant micro risks (such as default risk of the customer) into account. On the other hand, each financial transaction can be considered as contributing to the systemic risk. This may be negligibly small for a transaction involving one particular financial instrument. However, when the number of such financial transactions increase, their effect on the systemic risk may become important. Economic agents (banks and their customers) do not (and in most instances can not) take into account public good characteristic of the financial instruments into account. Therefore they, jointly, create an externality (positive or negative) for all market participants, and non of them can avoid from being affected.

Let's express the  $\delta$ -th component of the financial instrument vector supplied by  $i$ 'th bank,  $\mathbf{x}^i$ , as  $x_{\delta}^i$ ,  $\delta = 1, \dots, m$ . Define the following relations:

i) Financial service supplied by the  $x_g^i$ ,

$$v_g^i = \varphi^i x_g^i \quad \varphi^i > 0. \quad (5)$$

ii) Contribution of  $x_g^i$  to systemic risk

$$z_g^i = \lambda^i x_g^i \quad \lambda^i \geq 0^9. \quad (6)$$

Using these relations the financial services generated by bank  $i$  and its contribution to systemic risk can be expressed, respectively, as

$$v^i = \boldsymbol{\varphi}^i \mathbf{x}^i = \sum \varphi_{\phi}^i x_{\phi}^i, \quad (7)$$

$$z^i = \boldsymbol{\lambda}^i \mathbf{x}^i = \sum \lambda_{\phi}^i x_{\phi}^i, \quad (8)$$

where  $\boldsymbol{\varphi}^i$  and  $\boldsymbol{\lambda}^i$  are the corresponding conversion coefficient vectors.

The contribution of bank  $i$  to systemic risk can be expressed as

$$Z = Z_{-i} + z_i = Z_{-i} + \boldsymbol{\lambda}^i \mathbf{x}^i. \quad (9)$$

Let's express the well being of economic agent  $\tau$  by

$$W^{\tau} = W^{\tau}(\mathbf{x}^{\tau}, \mathbf{y}^{\tau}, Z). \quad (10)$$

In (10),  $\mathbf{x}^{\tau}$  is the vector of financial services and  $\mathbf{y}^{\tau}$  is the vector of non financial instruments that  $\tau$  enjoys.  $Z$ , on the other hand, is the systemic risk. The

---

<sup>9</sup> This formulation rules out financial instruments that reduce systemic risk. From practical point of view this assumption can easily be defended.

contribution of the first two variables at the right hand to the well-being of  $\tau$  is non-negative, while an increase in the systemic risk collectively and adversely affects all agents.

## **Introducing macroprudential regulation as a new constraint**

Macroprudential regulation is concerned with the stability of the financial system as a whole. It recognizes the general equilibrium effects, i.e. it takes into account the externalities created by banks through strong interdependencies among them as well as between the financial system and the rest of the economy. It should, however, be stressed that adoption of macroprudential regulation does not rule out microprudential measures. The RA's mission of safeguarding the well-being of the customers of banks remains unchanged<sup>10</sup>. Therefore macroprudential regulation can be incorporated into the model given by (4.1–4.3), through introduction of a new set of constraints, defined again in terms of the variables in its outcome function. As pointed out by many researchers the policy instruments of the authority that practices macroprudential regulation are not different from the ones that are used for microprudential regulation. However, the logic behind construction of this new constraint set is completely different. Under macroprudential supervision the RA is expected to estimate the combined effect of the individual institutions' actions, and its effect on the systemic risk. Consider the following example:

Suppose due to increase in perceived risk, a bank finds itself under the pressure of not sustaining its capital adequacy ratio, i.e. it needs to increase it. The bank can choose one of the following routes: it can either increase its capital or reduce its risky assets. Suppose it chooses the latter and reduced its credits. This is a perfectly sound decision and, under microprudential supervision, may be endorsed by the RA. Now suppose that a significant number of banks are under the same pressure and they all reduce their credit exposure. This may lead to sharp decline in credit supply and may adversely affect the financial soundness of the corporate sector. Banks, under these conditions, will respond by further curbing their credits, in order to contain their risks. This process may lead the economy into a credit crunch. As can be easily seen from this example what seems to be correct for individual banks is not the correct way out for the financial system as a whole. Notice further that through

---

<sup>10</sup> In general, RAs, have the authority of defining the characteristics and the mode of use of financial instruments. Depending on the legal system of the country, they can exercise their authority *ex ante* (classic continental European system) or *ex-post* (Anglo-American system). This practice can be considered as part of the microprudential regulation.



their combined actions, the banks also enhanced systemic risk. In other words, systemic risk needs to be treated as an «endogenous variable».

In the light of the discussion above RA needs to follow the following steps to fulfill its task: i) Aggregate individual data, ii) Examine the relations between macro financial and real variables, iii) Forecast the future values of the relevant macroeconomic variables, after taking into account the interactions among them, iv) Estimate and evaluate the systemic risk, v) Define policy decisions, at the macro level, to reduce systemic risk to the socially acceptable level, vi) Design regulations that translate macro policy decisions into signals (instructions/recommendations etc.) at the micro level.

Let  $\mathbf{x}_{t-1} = \sum_{i \in I} \mathbf{x}_{t-1}^i$  be the vector of aggregate financial variables and  $\mathbf{y}_{t-1}$  be the vector of real macro variables that the RA is interested in (i). Suppose the RA uses the model  $(\tilde{\mathbf{x}}_t, \tilde{\mathbf{y}}_t) = F(\{\mathbf{x}_{t-1}\}_{t \in T}, \{\mathbf{y}_{t-1}\}_{t \in T})$  to predict future values of the relevant macro financial and real variables, (ii & iii).

Define  $Z(\tilde{\mathbf{x}}_t, \tilde{\mathbf{y}}_t)$  as the risk function that the RA uses to estimate the «systemic risk» at time  $t$ . Suppose the RA defines the socially acceptable systemic risk level,  $\hat{Z}$ , (iv). The RA's problem is, then, to maximize the social welfare,  $W(\tilde{\mathbf{x}}_t, \tilde{\mathbf{y}}_t)$ <sup>11</sup>, subject to the macro model that gives the structural relations of the economy and the systemic risk constraint, (v).

$$\begin{aligned} & \text{Max } W(\tilde{\mathbf{x}}_t, \tilde{\mathbf{y}}_t), \\ & \text{s.to} \\ & (\tilde{\mathbf{x}}_t, \tilde{\mathbf{y}}_t) = F(\{\mathbf{x}_{t-1}\}_{t \in T}, \{\mathbf{y}_{t-1}\}_{t \in T}), \\ & Z(\tilde{\mathbf{x}}_t, \tilde{\mathbf{y}}_t) \leq \hat{Z}. \end{aligned} \tag{11}$$

Let the solution of the above problem be  $(\mathbf{x}_t^*, \mathbf{y}_t^*)$  and denote the corresponding systemic risk level as  $Z_t^* = Z(\mathbf{x}_t^*, \mathbf{y}_t^*)$ . The RA's next step is to design regulations in order to guide banks to realize  $\mathbf{x}_t^*$ , (vi). Depending on the heterogeneity of the banks such regulations may imply different constraints on different types of banks<sup>12</sup>. Therefore, the RA will be in the position of defining a function that clarifies the implications of the regulation for each type of bank. Suppose there are  $k$  different

<sup>11</sup> Here it is assumed that the regulatory body is able or has some guidelines, to derive social welfare from individual ell-being functions. Although it sounds like a technical problem, in practice it is not. Defining a social welfare function has profound politico-economic consequences and therefore it can hardly be left to the discretion of the RA.

<sup>12</sup> This is more than a theoretical possibility, since banks differ from each other with respect to their size, financial structures etc. In fact, one of the suggestions made within the Basel III framework was to make a distinction between «systematically important banks» and others.

types of banks (the set of different type of banks is denoted by  $K$ ), then for type-  $\kappa$  bank the RA will define a function that translates its objective defined in terms of estimated systemic risk and macro variables to a function defined in terms of the outcomes of individual banks. This can be expressed as

$$\xi_r^{i0}(\mathbf{x}^i)_{i \in \kappa} = \Psi^\kappa(\mathbf{x}_{t-1}, \mathbf{y}_{t-1}, Z^*), \quad \kappa \in K = [1, \dots, k]. \quad (12)$$

Notice that (12) invites in some serious problems. First, it requires the RA to devise an allocation rule to define precise constraints at the bank level based on macro considerations. Second under microprudential rule, the intermediary targets of the bank and the RA were the same, i.e. stability and the soundness of the individual bank. The reason why they end up with different constraint sets is related to their final concerns and not to their intermediary targets. This is not the case for (12). Here RA's objective is fundamentally different from that of the bank. RA's motive in inserting such a constraint is to contain the systemic risk, a macro level problem which, in general, is not an integrated in the individual bank's decision making framework. In fact, RA's problem is now to deal with endogenous risk which is due to negative externalities created by the complex webs of risk exposures and interdependencies that banks create. Therefore, banks will find it more difficult to understand the rationale behind such a constraint, especially it inevitably has to make distinction among different types of banks<sup>13</sup>. Finally, systemic risk is closely related to the business cycle. Under macroprudential regulation, on the other hand, RA is expected to design countercyclical measures. Therefore RA's regulations themselves, unless properly communicated, may be a source of uncertainty. This may have the potential of undermining the credibility of the RA.

Banks problem under macroprudential regulation, then, can be formulated as follows.

Let the

$$\mathbf{X}_{\xi^0}^i = \left\{ \mathbf{x}^i \mid \xi^0(\mathbf{x}^i) \leq b_{\xi^0} \right\} \quad (13)$$

denote the constraint set that is imposed on  $i$ 'th bank through macroprudential regulation. Then,  $i$ 'th bank's decision problem can be expressed as

---

<sup>13</sup> In this context, the RA will have to cluster banks into different subsets, according to their potential effects on the systemic risk. This is a challenging task for the RA since it differentiates banks using criteria which are not directly observable by them. This will make it difficult for the banks to comprehend the reasoning behind the regulation and may even consider RA as being arbitrarily discriminatory. This may inflict seriously harm the credibility of the RA. Therefore, the RA needs to be much more prudent in designing rules and pay more attention to the transparency.

$$\max \pi^i(x_t^i), \quad (14.1)$$

s.to

$$\mathbf{x}_t^i = \varphi^i \left( \mathbf{x}_{t-1}^i, \{\eta_t^{ij}\}_{i,j \in I} \right), \quad i \in I_B, j \in I, \quad (14.2)$$

$$\mathbf{x}_t^i \in \mathbf{X}_{\eta^0}^i \cap \mathbf{X}_{\xi^0}^i. \quad (14.3)$$

The difference between (4.1–4.3) and (14.1–14.3) lies in the last constraint. (4.3) reflects the constraints required by microprudential regulation whereas, (14.3) incorporates in constraints demanded under macroprudential regulation. Notice that (14.1–14.3) makes it clear that the implementation of the macroprudential regulation is through constraints imposed on individual banks. It is also clear from the above formulation that, the RA should devise appropriate constraints separately for each bank (or bank category) in order to attain efficiency.

## An example from Turkey

In early 2011, the policy makers in Turkey (the government and the central bank) alarmed by the fact that the country's current account deficit was becoming unsustainable. In order to prevent a new economic crisis, authorities decided to slow down the economy by curbing credit supply. The Central Bank of Turkey sharply increased the required reserve ratios uniformly for all banks. The banking community reacted negatively to this decision and stressed that they all comply the existing regulations. The response came from the deputy prime minister responsible from the economy. He argued that «it was their duty to take such measures in order to prevent financial instability».

This incident can be considered as a perfect example to illustrate the problem at hand.

i) The decisions taken by the authorities were aimed to contain systemic risk expressed as «financial instability». Therefore the measures should be considered within the scope of macroprudential regulations. Banks, on the other hand, were defending themselves by saying that they were complying perfectly well with the «microprudential regulations», which was irrelevant. However, this incident offers strong evidence in favor of the view defended in this paper that convincing banks to the necessity of macroprudential regulations is much more difficult than is in the case with microprudential regulations.

ii) The public good nature of systemic risk requires individualized rules such as different treatment of financial services and/or customers. In this incident authorities increased required reserve ratios across the banks, without taking into ac-

count the differences in bank's contribution to systemic risk. Consider the following example: Suppose bank A extends credits to exporters, whereas Bank B's credit customers are importers. Higher required reserves for both banks, when effective, will negatively affect both exports and imports. Instead, had authorities make a distinction between banks for their contribution to systemic risk, they can reduce imports without adversely affecting exports.

iii) The government's willingness to assume responsibility in this event can be interpreted in two different ways. First interpretation is that the government is not sincere in its stance on the independence of the Central Bank. The government's rhetoric was always in favor on the independence of the central bank. But in this incidence, the Central Bank's role was reduced to implementation of the decision taken by the government. Therefore its independence is not recognized by the government. A second interpretation is not as harsh as the first one. It can be argued that, the government assumed this responsibility because it doesn't consider macroprudential regulation within the jurisdiction of the Central Bank. In that case, what remains to be answered is whether the government can be considered as the correct authority responsible from macroprudential regulation or not. It is not difficult to see this will create a conflict of interest problem for the government since it is responsible from conducting economic policy. On the other hand, this incident also points out the need for developing an appropriate institutional framework to design and implement macroprudential regulation.

## Final comments

The above mentioned problem doesn't mean that the RA faces an impossible task. It is indeed true that, as expressed in (4.1–4.3), individual banks, in general, do not take into account the macro variables in making their decisions. Also, although they may closely follow what other banks in their peer group are doing<sup>14</sup>, they may still fail to incorporate this information systematically into their decision making process. Therefore they may make the «mistake» of taking systemic risk as given. What is really needed is to lead individual banks to realize that their own actions may affect the systemic risk level and, therefore, they need take the systemic risk as an endogenous variable in their outcome function. RA's mission is to find a way to lead banks to determine their outcomes, leaving the desired systemic risk level unchanged<sup>15</sup>. Transformation of bank's problem from (4.1–4.3) to (14.1–14.3) though

---

<sup>14</sup> Institutions can get away with mistakes they jointly make with their peers, but penalized for those mistakes they individually commit.

<sup>15</sup> As was pointed out in Hahn (2003), it is possible to find examples in economic theory, where individual decision makers, indeed, use macro information in making decisions at the micro level.

introduction of (12) aims at achieving it<sup>16</sup>. However, due to reasons indicated above, it may still be not easy to convince banks to abide by it. This, in practice, implies an increase in the cost of supervision<sup>17</sup>. The RA may enhance banks capability and willingness to take macro variables into account by explaining the importance of systemic risk and also following a transparent approach in its methodology in estimating systemic risk and in designing regulation<sup>18</sup>.

A second, but not secondary, problem is identifying the institution that will be in charge from implementing macroprudential regulation. Should it be the one of the existing supervisory and regulatory authorities or the central bank? Even if the technical competence of these institutions in their existing area of jurisdiction is taken for granted the problem still remains. In the microprudential regulation approach there was a well defined division of labor among central bank and regulatory and supervisory authorities. The central bank was made responsible from the price stability (macro dimension) and the regulatory and supervisory authorities from the soundness and stability of individual banks (micro dimension). Macroprudential approach, on the other hand, requires the RA to exhibit competence in both macro and micro dimensions.

The US seems to favor Federal Reserve to be in charge, whereas the European Union chose to establish a new body, «European Systemic Risk Board». For those countries that have «established democracies» such a choice may be based on convenience and/or traditions. However, for those countries where governments are still exhibit uneasiness towards the concept of «independent central bank», assigning RA's role to the central bank may easily be interpreted as creating an extremely

---

A well known example is the information given by the price indices. Such indices offer information concerning unobserved prices to individuals, and enable them to take into account the price movements in their decisions. However it must be admitted that the concept of «macro foundations of microeconomics» is neither as popular nor as developed as its reverse. On the positive side, however, it can be argued that, due to their relations with the central bank, banks are much more accustomed to consider macroeconomic variables (such as inflation rate) in taking their decisions. In fact, there is some evidence that indicate the significance of macroeconomic information in explaining individual bank behavior. See, for example, [Ersel, 2002].

<sup>16</sup> Notice that (13) is defined on clusters of banks and not on individual banks. The RA needs such clusters in order to distinguish banks with respect to their capabilities in affecting systemic risk. Such a clustering exercise requires the use of information revealed to the public. In other words, the RA need not use undisclosed, institution specific information for this purpose. However, this point can easily slip from the eyes of the observers and may inflict damage on the credibility of the RA. Therefore the RA should pay due attention in explaining its methodology in clustering banks.

<sup>17</sup> These points indicate that the achieving and sustaining credibility of the RA is much a more challenging task under macroprudential regulation.

<sup>18</sup> Transparency may also save the RA from a credibility loss, by inflicting disciplining itself against the temptation of arbitrarily increasing its discriminatory capability.

powerful institution that is capable of effectively constraining the policy choices of the government. Under these circumstances, it may be quite difficult to secure the «independence» of the central bank, which is proved to be valuable. Such an outcome, on the other hand, will also seriously undermine the much needed credibility of the central bank in implementing macroprudential regulation. Therefore, emerging democracies should consider establishing an independent authority, with the effective and fair participation of the central bank and the financial supervisory and regulatory authorities.

## References

*Bernanke B., Gertler M.* Financial Fragility and Economic Performance // Quarterly Journal of Economics. 1990. 105(1). P. 87–104.

Brunnermeier M., Crockett A., Goodhart C. et al. The Fundamental Principles of Regulation. Geneva Reports on the World Economy. 2009. 11.

*Davis E.P., Karim D.* Macroprudential Regulation – The Missing Policy Pillar. Keynote address at the 6<sup>th</sup> Euroframe Conference on Economic Policy Issues in the European Union, June 12. 2009.

*Ersel H.* Macroeconomic Information and the Role of Banks in its Transmission // Emerging Markets Finance and Trade. 2002. Vol. 38. № 4. July-August. P. 9–23.

*Ersel H.* Kredi Piyasası, Düzenleyici Yetke ve İktisat Politikası (Credit Market, Regulatory Authority and Economic Policy) // A.H. Köse, F. Şenses, E. Yeldan (eds.) Küresel Düzen-Birikim, Devlet ve Sınıflar. İstanbul: İletişim Yayınları, 2003. P. 73–92.

*Goodhart C.* The Role of Macroprudential Supervision. Paper presented at the Federal Reserve Bank of Atlanta 2010 Financial Markets Conference: Up from Ashes-The Financial System after the Crisis, May 12. 2010.

*Hahn F.* Macro Foundations of Micro-economics // Economic Theory. 2003. 21. P. 227–232.

*Hanson S., Kashyap A.K., Stein J.C.* A Macroprudential Approach to Financial Regulation // Journal of Economic Perspectives. 2011. Vol. 25 (1). Winter. P. 3–28.

OECD. Systemic Risks in Securities Markets. Paris: OECD, 1991.

*Sims C.* Rational Inattention and Monetary Economics // B. Friedman, M. Woodford (eds.) Handbook of Monetary Economics, 3A. Amsterdam: Elsevier, 2011. Ch. 4.

# АНАЛИЗ ВЛИЯНИЯ МАКРОСРЕДЫ НА ЭФФЕКТИВНОСТЬ ИЗДЕРЖЕК РОССИЙСКИХ БАНКОВ<sup>1</sup>

---

В последнее время наблюдается ужесточение конкуренции между финансовыми посредниками и, как следствие, снижение прибыли, получаемой банками от традиционных операций. В этих условиях для управления банком особенно важно располагать информацией не только о доходности банковских операций и издержках банков, но и о характеристиках среды, определяющих финансовый результат деятельности банков.

При эмпирическом исследовании эффективности работы коммерческих банков, наряду с влиянием факторов, специфических для банков, изучается воздействие и факторов макросреды на издержки банков. Факторы макроокружения характеризуют структуру и динамику рынка банковских продуктов и услуг, макроэкономические условия и др. Для российских банков данный вопрос становится все более актуальным, поскольку банки функционируют в разных регионах, которые, в свою очередь, существенно различаются по уровню социально-экономического развития.

Аналізу воздействия макроэкономических показателей на эффективность функционирования российских банков посвящено всего две работы. В первой из них оценивается влияние риска изменения процентных ставок, валютного и инфляционного рисков, реального валютного курса на техническую эффективность российских банков [Saner, 2004]. Во второй изучается взаимосвязь оптимального уровня прибыли и общего объема привлеченных депозитов и кредитов, денежного агрегата M2 и уровня безработицы [Павлюк, 2006].

---

<sup>1</sup> Автор благодарит Лабораторию анализа и выбора решений НИУ ВШЭ за частичную финансовую поддержку исследования. Автор также выражает благодарность Банковскому институту НИУ ВШЭ и Институту переходных экономик Банка Финляндии за возможность использования базы данных «Банки России» информационного агентства «Интерфакс» и базы данных «Регионы России» аналитической лаборатории «Веди», а также базы данных о филиальной сети крупнейших российских банков соответственно.

Учет информации о региональном присутствии российских банков, как правило, проводится путем использования дамми-переменных для каждого российского региона [Karas et al., 2010] или для столиц (г. Москва и г. Санкт-Петербург) [Головань и др., 2006, 2008; Styrin, 2005].

В данной работе выбор региональных переменных основан на исследованиях М. Дитча и А. Лозано-Вайвес [Dietsch, Lozano-Vivas, 2000], А. Касмана и С. Кирбас-Касмана [Kasman, Kirbas-Kasman, 2006], в которых для западноевропейских банков и восточноевропейских банков (преимущественно из стран с переходной экономикой) разработаны три группы факторов. Первая из них включает макроэкономические условия (в нашем случае – уровень денежных доходов на душу населения и объем отгруженной продукции в распределении электроэнергии, газа и воды или в обрабатывающих производствах), вторая – структуру и регулирование банковского сектора (в нашем случае – уровень финансового посредничества в регионах), третья – доступность банковских услуг<sup>2</sup>.

Оцениваемая в данной работе модель выглядит следующим образом:

$$\begin{aligned}
 \ln \frac{C}{w_1 k} = & a_0 + \sum_{i=1}^3 a_i \ln \frac{y_i}{k} + b_1 \ln \left( \frac{w_2}{w_1} \right) + r_q \ln \frac{q}{k} + \sum_{n=1}^3 \Psi_n z_n + \\
 & + \frac{1}{2} \sum_{i=1}^3 \sum_{j=1}^3 s_{ij} \ln \frac{y_i}{k} \ln \frac{y_j}{k} + \frac{1}{2} g_1 \left[ \ln \left( \frac{w_2}{w_1} \right) \right]^2 + \frac{1}{2} r_{qq} \left( \ln \frac{q}{k} \right)^2 + \\
 & + \sum_{i=1}^3 d_i \ln \left( \frac{w_2}{w_1} \right) \ln \frac{y_i}{k} + \sum_{i=1}^3 (\phi_i \cos(Y_i) + \omega_i \sin(Y_i)) + \\
 & + \sum_{i=1}^3 \sum_{j=1}^3 (\phi_{ij} \cos(Y_i + Y_j) + \omega_{ij} \sin(Y_i + Y_j)) + \mu_1 T + \frac{1}{2} \mu_2 T^2 + \\
 & + \mu_3 T \ln \left( \frac{w_2}{w_1} \right) + \sum_{i=1}^3 \tau_i T \ln \frac{y_i}{k} + \sum_{i=1}^2 \xi_i \ln r_i + \epsilon, \\
 Y_i = & 1,8\pi \left[ \frac{y_i}{k} - \min \left( \frac{y_i}{k} \right) \right] / \left[ \max \left( \frac{y_i}{k} \right) - \min \left( \frac{y_i}{k} \right) \right] + 0,1\pi,
 \end{aligned} \tag{1}$$

$$Y_i = 1,8\pi \left[ \frac{y_i}{k} - \min \left( \frac{y_i}{k} \right) \right] / \left[ \max \left( \frac{y_i}{k} \right) - \min \left( \frac{y_i}{k} \right) \right] + 0,1\pi, \tag{2}$$

где  $C$  – сумма расходов на персонал и обслуживание заемных ресурсов банка;  $a_0$  – свободный член;  $y_1$  – выданные кредиты;  $y_2$  – обязательства банка по де-

<sup>2</sup> Так как агрегирование социально-экономических характеристик регионов для каждого банка в данной работе осуществляется пропорционально количеству филиалов, которыми владеет банк, включая и его головной офис, третья группа факторов нами не рассматривается.



позитам клиентов из небанковского сектора (за исключением объема депозитов частных лиц);  $y_3$  – вложения в ценные бумаги;  $w_1$  – цена трудовых ресурсов;  $w_2$  – цена привлеченных ресурсов;  $q$  – резервы под кредиты и векселя небанкам;  $k$  – собственный капитал банка;  $T$  – временной тренд;  $r_1$  – соотношение объема выданных кредитов к величине привлеченных депозитов на региональном уровне;  $r_2$  – уровень жизни населения (или уровень деловой активности в регионах России)<sup>3</sup>;  $z_1, z_2, z_3$  – дамми-переменные соответственно для I, II и III кварталов;  $\varepsilon$  – совокупная случайная ошибка.

В результате оценки модели (1)–(2) было получено, что повышение уровня финансового посредничества в регионах является для банков затратным направлением деятельности. Однако наблюдается, что с ростом денежных доходов населения на душу населения издержки банков сокращаются. В качестве прокси-показателя, характеризующего уровень экономического развития регионов, дополнительно использовался объем отгруженных товаров, выполненных работ в обрабатывающих производствах и в распределении электроэнергии, газа и воды. Были получены эффекты, сравнимые с уровнем влияния доходов на душу населения на удельные издержки банков.

Выявленные эффекты не подтверждают направление воздействия факторов макросреды на издержки западно- и восточноевропейских банков [Dietsch, Lozano-Vivas, 2000; Kasman, Kirbas-Kasman, 2006]. Это означает, что при проведении межстранового сравнения эффективности издержек банков, включая российские банки, необходимо учитывать экономические факторы макросреды.

Таким образом, в работе показано влияние условий региональной среды на удельные издержки российских банков. Следовательно, обоснованное включение в функцию удельных издержек российских банков характеристик социально-экономического развития регионов позволяет улучшить качество и прогнозную силу построенной модели.

## Литература

Головань С.В., Карминский А.М., Пересецкий А.А. Эффективность российских банков с точки зрения минимизации издержек // Экономика и математические методы. 2008. Т. 44. № 4. С. 28–38.

Головань С.В., Карминский А.М., Пересецкий А.А. Факторы, влияющие на эффективность российских банков // Модернизация экономики и государство. В 3 кн. / отв. ред. Е.Г. Ясин. М.: Изд. дом ГУ ВШЭ, 2006. Кн. 3. С. 188–207.

---

<sup>3</sup> Так как наблюдается высокая корреляция между показателями, характеризующими уровень жизни и деловой активности, данные переменные использовались как альтернативные.

*Павлюк Д.В.* Модель эффективности деятельности российских банков // Прикладная эконометрика. 2006. № 3. С. 3–8.

*Caner S., Kontorovich V.* Efficiency of the Banking Sector in the Russian Federation with International Comparison // Экономический журнал ВШЭ. 2004. Т. 8. № 3. Р. 357–375.

*Dietsch M., Lozano-Vivas A.* How the Environment Determines Banking Efficiency: A Comparison between French and Spanish Industries // Journal of Banking & Finance. 2000. № 24. Р. 985–1004.

*Karas A., Schoors K., Weill L.* Are Private Banks More Efficient than Public Banks? // Economics of Transition. 2010. Vol. 18. Iss. 1. Р. 209–244.

*Kasman A., Kirbas-Kasman S.* Technical Change in Banking: Evidence From Transition Countries // International Journal of the Economics of Business. 2006. Vol. 13. № 1. Р. 129–144.

*Styrin K.* What Explains Differences in Efficiency Across Russian Banks? // EERC. 2005.

E. Glushkova  
Bank VTB, Moscow,  
A. Vernikov  
Higher School of Economics

# DOES STATE OWNERSHIP OF BANKS HINDER FINANCIAL DEVELOPMENT AND ECONOMIC GROWTH IN EMERGING MARKETS?

---

This paper provides empirical analysis of macroeconomic effects of state ownership of banks. The aim is to test one of the key findings of theoretical and empirical literature of 1990s and early 2000s, namely that sizeable state ownership of commercial banks hinders financial development and economic growth. We focus on several large emerging markets including BRIC countries (Brazil, Russia, India and China) and test several specific hypotheses for the period from 1995 through 2009. Our results suggest that positive or negative sign of the government ownership impact on financial intermediation and economic growth is not constant for all times but varies depending on the type of national economy (mature market or emerging market) and, within the emerging markets category, on the level of economic development. The impact is therefore heterogeneous and not homogeneous. This finding is in contrast with the established theory but in line with the most recent empirical literature.

## 1. Introduction

Influential article by La Porta, López-de-Silanes and Shleifer (2002) suggested that, other things being equal, a higher degree of government ownership of commercial banks hinders financial intermediation, economic growth and productivity. This viewpoint was broadly accepted and remained unchallenged over the past decade. However, recent empirical studies tried to test the validity of La Porta *et al.* findings and in most cases found mixed evidence or little evidence to existence of any universal rule linking state ownership of banks and economic growth. Andrianova, De-

metriades and Shortland (2009) discovered that introduction of explanatory variables featuring institutional development, such as the quality of the bureaucracy and the property rights protection, into similar regressions may render state ownership impact statistically insignificant. For more recent time period under analysis (i.e. for higher average development level) greater state presence in the banking industry may be argued to lead to higher long term growth rates of the economy even after controlling for the variables that feature institutional development.

In yet another interesting recent paper Körner and Schnabel (2010) argue that La Porta *et al.* did not take full account of cross-country differences in the panel. Within each country category grouped according to initial level of incomes, financial development and property rights protection, an assessment of effects from state ownership yields diverging results. Statistically significant negative impact of state ownership is found in countries with low level of development, whereas in countries with relatively high development indicators little or no such negative impact is registered. That leads Körner and Schnabel to suggest that the effects of state ownership of banks are not homogeneous for the entire sample of countries, therefore the scale and even the sign of such effects cannot be deemed as unambiguously proven.

This paper intends to further research the connection between state ownership of banks and economic development. We examine the case of a few large emerging markets, including the BRIC countries, to track the impact of state ownership on two key macroeconomic parameters: financial development and economic growth.

## **2. Our hypotheses, variables, data and model**

We test the following hypotheses concerning the effects of government ownership of banks.

*Hypothesis 1.* In line with the «development theory» of government banking, direct state involvement with banks allows to overcome scarcity of financial resources in the private sector as compared to the needs of financing sustainable economic growth and to mitigate some of the risks that private sector investors are not prepared to take. We thus anticipate government banking to influence financial depth measured by the ratios of Total bank assets/GDP; Total loans/GDP, and Household deposits/GDP with a positive sign.

*Hypothesis 2.* We try to proxy confidence and trust towards banks by 3 indicators, the foremost being the proportion between demand deposits and term deposits. We imply that lack of confidence in the viability of a specific bank and banking sys-

tem at large would force households to maintain high liquidity of their savings even at the expense of foregoing part of investment income. Hence a growing share of term deposits and falling share of demand deposits might signal about improving confidence and trust towards banks. According to public opinion polls, deposits in state-controlled banks are traditionally viewed by households as a safer instrument of savings than deposits in private commercial banks; therefore deeper government involvement might extend average tenors of deposits. We also test the impact of government bank ownership on monetary aggregates (money/(money + quasi-money), and broad money/base money). In the former case we expect a negative sign of the influence, and in the latter case a positive sign, the reason being that a falling share of base money and especially cash should indicate higher willingness to keep money in banks.

*Hypothesis 3.* If government banking really improves investment climate in poor countries, as argued by «development theory» of state banking, then it must reflect in lower transaction costs which we measure through interest spread (difference between average interest rates on bank loans and bank deposits).

*Hypothesis 4.* We proxy the impact of government banking on loans available to private sector through the ratio of loans to private sector/GDP. The sign is hard to anticipate because, on the one hand, state-controlled banks must promote lending, whereas, on the other hand, such lending will not necessarily benefit private sector but may instead focus on public sector projects and enterprises.

*Hypothesis 5.* In line with the «political theory» of government banking [La Porta *et al.* 2002], the government owns banks because it wants to control resource allocation in order to pursue its own political agenda. We plan to grasp a growing political influence on bank lending decisions through the indicator of loans to public sector/GDP.

*Hypothesis 6.* Previous literature suggests that government banking is associated with poor asset quality which we proxy by nonperforming loans/total assets, and loan-loss provisions/ total assets. The logic behind this assumption is that managers of state-owned banks do not have incentives for prudent risk management nor proper instruments to monitor their borrowers. The greater the market share of government banks, the more visible those detrimental effects must become.

*Hypothesis 7.* Political interference into resource allocation may be expected to lower social efficiency of lending. However the precise sign of the impact of government banking on economic development indicators is hard to predict. We try to measure the impact of state presence on economic development by several indicators namely Real GDP growth rates, Gross national income per capita, Gross fixed capital formation and Industrial production index.

The modeling of state-controlled banks' market shares relies on official data published by respective national central banks and the statistics used in earlier publications, e.g., Micco, Panizza, Yanez (2004). Market shares of state-controlled banks in Russia were computed according to methodology described in [Glushkova, Vernikov, 2009; Vernikov, 2009]. For other variables used in the modeling we take data published by the International Monetary Fund and respective country central banks.

We perform regression analysis of data panel for selected countries in two stages. At *Stage 1* we examine average macroeconomic effects of government banking in Brazil, China, India, Indonesia, Mexico and Pakistan for the period from 1995 through 2002. At *Stage 2* we leave in the panel only data for Brazil, China, India and Russia (BRICs), and the period is from 2001 through 2009. In view of substantial difference in average economic development levels for the two country-year panels (Table 1), a comparison of regression results between the «poor» versus «more advanced» economies would enable us to indirectly test the hypothesis about the heterogeneity of macroeconomic effects of state banking.

**Table 1.** Descriptive statistics

	1995–2002 (Brazil, China, India, Indonesia, Mexico, Pakistan), country-year average	2001–2009 (Brazil, China, India, Russia), country-year average
Total bank assets/GDP	16,7%	117,0%
Household deposits/GDP	14,0%	75,0%
Total loans/DP	7,9%	60,8%
Broad money/Base money	500%	350%
Interest spread	12,1%	13,2%
Real GDP growth rate	4,52%	6,35%
Gross national income per capita (USD)	2015	3490
Market share of state-controlled banks in total bank assets	58,0%	63,0%

Econometric estimation is applied to indicators featuring financial intermediation and economic growth. The general form of the regression *model* is:

$$DV_{it} = \alpha_{it} + \beta_1^{it} \cdot EV_1^{it} + \beta_2^{it} \cdot EV_2^{it} + \dots + \beta_n^{it} \cdot EV_n^{it} + \varepsilon,$$

where  $DV_{it}$  is the value of the analyzed indicator in the country  $i$  at the moment  $t$ ;  $\alpha_{it}$  is intercept, reflecting other country-specific variables not included in the data panel

but having impact on the value of the analyzed indicator;  $EV_1^{it} \dots EV_n^{it}$  is a vector of explanatory variables for country  $i$  at the moment  $t$ .

The model includes the following explanatory variables:

- market share of state-controlled banks in total bank assets in country  $i$  at the moment  $t$ , as proxy for *magnitude of government banking*;
- exports and imports to GDP ratio, as an indicator of *foreign trade openness* of the economy;
- foreign direct investment to GDP ratio, as an indicator of *investment openness*;
- top 3 banks share of total assets, as an indicator of *concentration* level in the banking sector;
- natural logarithm of total bank assets, reflecting the *size* of the banking industry (in regressions with each economic growth indicator as dependent variable);
- natural logarithm of real GDP at the moment  $t - 1$ , as an indicator of *starting level* for subsequent economic growth.

For each estimation we build three types of regressions, a pooled regression, a regression with random effects, and a regression with fixed effects. Our findings are based on the results of the most suitable fixed effects model.

### 3. Empirical results and their interpretation

Regression results for the first and the second country panels are presented in Tables 2 and 3 respectively.

With regard to *financial depth* for the country panel covering 1995–2002, we failed to identify statistically significant impact of government banking on the dynamics of such indicators as total assets/GDP or total loans/GDP. We did find positive influence on total deposits/GDP that reflects financial depth, propensity of households to save, and indirectly also trust towards banks.

The factor of *trust in the banking system* has positive influence on the total amount of household savings kept with banks in poorer countries. However, we found no empirical evidence that greater share of state-owned banks improves the breakdown of household deposits in favor of term deposits or improves the structure of the monetary aggregates.

**Table 2.**

Results of regression analysis, Stage 1:  
Brazil, China, India, Indonesia, Mexico,  
Pakistan (1995–2002)

Dependent variable	Explanatory variable: market share of state-controlled banks		
	Pooled regression	Random effects	Fixed effects
Financial intermediation			
Assets/GDP	∅	∅	∅
Loans/GDP	∅	∅	∅
Deposits/GDP	0,456348* [0,272745]	1,691028 [0,473603]	1,982113 [0,561883]
Broad money/ Base money	∅	∅	∅
Demand deposits/ Term deposits	-1127,131 [356,7268]	-1525,407 [78,71349]	∅
Loans to public sector/GDP	∅	∅	∅
Loans to private sector/GDP	0,453093 [0,116698]	0,375630* [0,196690]	∅
Loan-loss provi- sions/Assets	∅	∅	∅
Non-performing loans/Assets	-0,173551 [0,049196]	-0,141051 [0,055413]	∅
Interest spread	∅	∅	∅
Economic growth			
Gross fixed capi- tal formation ( <i>ln</i> )	∅	∅	∅
GNI per capita ( <i>ln</i> )	∅	-2,548155 [0,387589]	-2,550246 [0,405640]
Industrial pro- duction index	-53,74118 [11,86390]	∅	∅
Real GDP rates of growth	∅	-0,038034 [0,018933]	∅

∅ – there is no statistically significant effect.

[ ] – standard error.

\* significant at 10 percent level.



**Table 3.**Results of regression analysis, Stage 2:  
Brazil, China, India, Russia (2001–2009)

Dependent variable	Explanatory variable: market share of state-controlled banks		
	Pooled regression	Random effects	Fixed effects
Financial intermediation			
Assets/GDP	-0,244090 [0,027422]	-0,051855 [0,021328]	-0,097081 [0,019731]
Loans/GDP	∅	∅	∅
Deposits/GDP	∅	0,880216 [0,317933]	∅
Loans to public sector/ GDP	-0,284158 [0,055089]	∅	∅
Loans to private sector/ GDP	1,220993 [0,280808]	1,365729 [0,211852]	∅
Interest spread	-103,8904 [25,36648]	∅	∅
Money/(Money + Quasi-money)	1,560343 [0,248760]	∅	∅
Economic growth			
Gross fixed capital formation ( <i>ln</i> )	4,755127 [1,621202]	1,505526* [0,841421]	1,323494 [0,561923]
GNI per capita ( <i>ln</i> )	-1,614926 [0,519653]	∅	0,850673* [0,497743]
Real GDP rates of growth	∅	2,639847 [0,297806]	∅

∅ – there is no statistically significant effect.

[ ] – standard error.

\* significant at 10 percent level.

As far as *structural features of credit allocation* are concerned, our regression analysis did not reveal statistically significant dependency of the amount of lending to public no private sector effects from government ownership of banks. This leaves without statistical proof the relevance of the «development view» that in less advanced economies state-controlled banks play a key role in reallocating scarce financial resources towards the private sector.

We also failed to empirically prove the influence of state presence in the banking sector on the level of *transaction costs* in the economy measured by the interest spreads.

*Loan portfolio quality* is broadly believed to deteriorate when government engage in credit allocation because presumably state-controlled banks tend to finance inefficient economically unviable projects that are unattractive to private sector lenders. We, however, failed to see significant influence of government banking on the share of non-performing loans or loan-loss provisions in total assets for the country panel covering the period 1995–2002. The interpretation of this empirical result can be as follows. In the public sector, mistakes in credit allocation can be rectified by public resources; disclosure of impaired assets of state-owned banks may lack accuracy and completeness. Another interpretation may be connected to the effect described by Andrianova *et al.* (2009). State-owned banks might paradoxically be less exposed to extreme moral hazard resulting from excessive reckless use of derivatives than private banks because management motivation in state-owned banks is less closely tied to financial results.

Finally, for the first country panel referring to the period 1995–2002, a statistically significant negative influence on per capita gross national income was registered. But we did not discover any significant influence on real GDP growth rates, gross fixed capital formation or industrial production index.

With regard to the BRIC panel embracing 2001–2009, we discovered statistically significant negative impact on total bank assets/GDP, but no other significant impact on financial depth. We suppose that this reflects slower growth of financial sector dominated by state-controlled banks as compared to the entire economy's growth rates. In line with the first country panel no sizeable effects of state-ownership of banks on the term structure of the monetary aggregates are registered.

Thus, the mere fact of dominance of government banking in a BRIC countries is not necessarily an impediment to *financial depth* nor to higher rates of growth of bank lending. If this finding is true, then increased state involvement in the banking industry might be socially justified if qualitative change takes place. Such a change may imply a better sectoral breakdown and more efficient reallocation of loan between borrower types and/or market segments.

Similarly to the case of the first country panel we also failed to identify any significant impact of state involvement with banks in BRICs on *structural features of credit allocation* namely the ratios of total loans to public and private sectors of the economy to GDP. Hence, we see no solid proof to the argument of the «political theory» of government banking that state-controlled banks follow political guidelines in their credit allocation and explicitly favor public sector borrowers and projects. In BRIC countries the state-controlled banks act like quasi private banks in a number of cases, which is a good and a bad thing at the same time. Excessive investment in

infrastructure and other public sector projects may have an opportunity cost and lead to inefficient use of resources. However, pursuit of profitability by state-owned banks may distract these institutions from the fulfillment of their primary mission and might lead to unfair competition with private lenders.

Regression analysis did not demonstrate statistically significant influence of government banking on the width of interest spreads charged and paid by banks, so we cannot unambiguously argue that heavy government involvement in commercial banking reduces *transaction costs* in BRICs' economies. There might be two explanations to this: (a) interest rates on loans can remain high in view of the inherent risks of an emerging market such as financial fragility and low transparency of most borrowers, lack of property right protection, etc.; (b) if state-owned banks possess too much market power in a given economy (which is way too often the case), then lack or absence of competition will not force lending rates reduction even by financial intermediaries with lower funding costs.

The impact of government banking on *economic growth* and its selected elements for the case of fast-growing BRIC countries was the most intriguing regression. Importantly, the positive influence of government banking on per capita gross national income for the BRIC panel (2001–2009) is registered. Furthermore, the former statistically insignificant impact of state presence on another *economic growth* indicator – gross fixed capital formation – became positive and significant. It appears that for relatively more advanced emerging countries the government ownership of banks stops being a hindrance for *economic growth* and turns into an incentive in a number of cases; negative effects are eliminated or change their sign.

## 4. Conclusions

We performed econometric analysis of macroeconomic effects from government banking on economic and financial development in several large emerging markets to test the key conventional wisdom regarding the sign of impact (negative). Our main findings are as follows.

1. Looking at empirical evidence we cannot argue that regardless of a country's level of development greater market share of state-owned banks hinders *financial intermediation*. That was a core argument in [La Porta *et al.*, 2002]. We would partly concur with the «development theory» view that direct state involvement might improve certain features of the banking sector, with the proviso that it is relevant to the period of low level of economic development. For the case of more advanced economies no such positive effect is realized.

2. However, we tend to dissociate ourselves from the «development view» of government banking in poorer countries as soon as we regard *economic growth*. State-owned banks do not appear to create substantial positive value for economic growth when the starting level of development is *low* and may even be detrimental to some of the indicators. At the same time, in more advanced BRIC economies with solid growth rates the effect on some of the indicators becomes positive and statistically significant.

3. Our test empirically confirms the hypothesis by Körner and Schnabel (2010) that the impact of government banking is heterogeneous and not homogeneous for all countries. The scale and even the sign of this impact should not be taken for granted.

## References

*Andrianova S., Demetriades P., Shortland A.* Is Government Ownership of Banks Really Harmful to Growth?: University of Leicester Working Paper № 09/11, May 2009.

International Monetary Fund, *International Financial Statistics* (various issues). Washington, DC.

*Glushkova E., Vernikov A.* How Big Is the Visible Hand of the State in the Russian Banking Industry?: MPRA Paper № 15563, June 2009. Munich University Library.

*Glushkova E.* Government Banking: Empirical Study of Macroeconomic Effects // *Dengi i kredit*. 2010. 12. P. 24–31. [in Russian].

*Körner T., Schnabel I.* Public Ownership of Banks and Economic Growth – The Role of Heterogeneity: Preprints of the Max Planck Institute for Research on Collective Goods № 2010/41. Bonn, September 2010.

*La Porta R., López-de-Silanes F., Shleifer A.* Government Ownership of Banks // *Journal of Finance*. 2002. 57 (1). P. 265–301.

*Micco A., Panizza U., Yanez M.* Bank Ownership and Performance: Inter-American Development Bank Working Paper № 518. 2004.

*Vernikov A.* Russian Banking: The State Makes a Comeback?: BOFIT Discussion Papers DP 24/2009. Helsinki: Bank of Finland, 2009.

# TRACING THE IMPACT OF CENTRAL BANK LIQUIDITY INFUSIONS ON FINANCIALLY CONSTRAINED BANKS: EVIDENCE FROM A NATURAL EXPERIMENT

---

## 1. Introduction

When government-managed capital reallocations benefiting a particular group of banks occur, academics and policy makers often raise concerns about the necessity and consequences of such government interventions. Among others, Dell'Ariccia et al. (2008) and Kroszner et al. (2007) have dealt with this issue. They have demonstrated that industrial sectors that are more financially dependent on banks perform significantly worse than others during banking crises and that the magnitude of the real effect on these sectors caused by financial constraints is non-trivial. This paper seeks to explore this issue further and addresses the following questions: How effective are certain forms of government assistance in terms of distributing funds to distressed banks? Do government interventions help distressed banks to maintain lending to the real sector?

I investigate the effectiveness of government liquidity infusions into the banking system during financial distress. I look at the experience of the Russian banking system during the recent global financial crisis. Many Russian banks were heavily dependent on foreign borrowing prior to the crisis and were therefore directly affected by the sudden stop of external financing caused by the collapse of the Lehman Brothers in September 2008. In the aftermath of this event, the Russian Central Bank (CBR) allocated substantial financial assistance to domestic banks. Drawing on insights of Almeida et al. (2009) I use predetermined variation of foreign debt maturity across Russian banks in a period after the Lehman Brothers bankruptcy and identify a group of banks that were disproportionately affected by the sudden collapse of external financing due to inability to roll-over their foreign debt. Since decisions on long-term borrowing

were made *ex ante* and the crisis came unexpectedly, banks with a large fraction of foreign debt maturing during the shut down of the capital markets were more constrained than otherwise similar banks whose debt matured outside of the crisis event window. In a natural experiment setup, I compare affected and unaffected banks' participation in government bailout programs and their lending policies to different types of borrowers.

How significant was external financing for Russian banks? According to the CBR, foreign liabilities of the Russian banking sector accounted for 35% of country's total foreign debt in 2008. The growing financial globalization in recent decades has made it attractive for firms and banks from countries with less liquid capital markets to issue foreign currency debt in international capital markets. For example, using the comprehensive data on international syndicated loans, De Haas and van Horen (2008) report that Russian syndicated borrowing represented 33% of the global total in 2005–2008, when the US and the Euro-15 countries are excluded. After the capital account liberalization in July 2006, Russian banks increasingly borrowed in foreign currency from international capital markets by issuing Eurobonds and taking syndicated loans. Wholesale funding from foreign banks was also a significant source of financing.

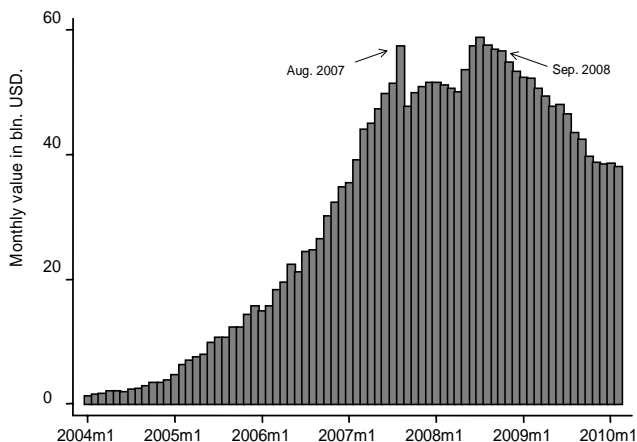
After the collapse of the Lehman Brothers in September 2008 and the subsequent shut down of international capital markets the inability of Russian banks to roll-over foreign debt became a concern for the CBR. It responded by heavy quantitative easing in two dimensions. On the one hand, it started selling its international reserves, which decreased from \$ 596,6 bln. in August 2008 to \$ 384,1 bln. in March 2009. On the other hand, it started ruble liquidity infusions into the banking system through newly established credit facilities. Against this background, I test whether Russian banks that were directly affected by the cut in external financing that followed the Lehman Brothers collapse bid more aggressively for CBR funding than other banks. Secondly, I investigate banks' lending policies with respect to different types of borrowers.

## **2. Background of Russian quantitative easing**

### **Foreign borrowing by Russian banks**

Capital account liberalization in 2006 combined with solid macroeconomic performance of Russia due to favorable terms of trade resulted in high foreign borrowing

by the private sector<sup>1</sup>. Figure 1 displays a spectacular growth of Russian banks' foreign liabilities until the beginning of the global financial crisis in August 2007, when Lehman Brothers filed for bankruptcy in September 2008.



**Fig. 1.** Aggregate value of banks' liabilities from Eurobonds and syndicated loans

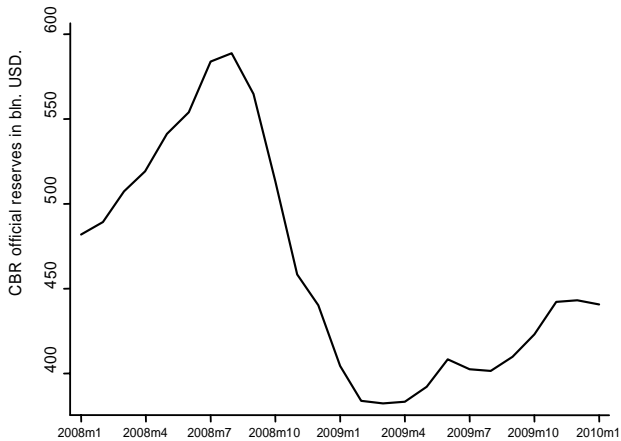
Source: Bloomberg, Cbonds.

## Interventions by the Central Bank of Russia

Following a sudden-stop of international capital flows in September 2008 the CBR became concerned with inability of banks to roll-over foreign debt. The simultaneous injection of rubles and dollars into the banking system allowed banks facing foreign debt roll-over problems to repay their foreign debt. This makes Russia an interesting case to study the impact of liquidity injections by monetary authority on financially constrained banking system.

---

<sup>1</sup> According to the CBR estimates foreign liabilities of the Russian banking sector represented 19% of total liabilities in August 2008, while individual deposits represented 24,5% of bank's liabilities.



**Fig. 2.** Average monthly level of official foreign exchange reserves of the CBR

*Source:* Central Bank of Russia.

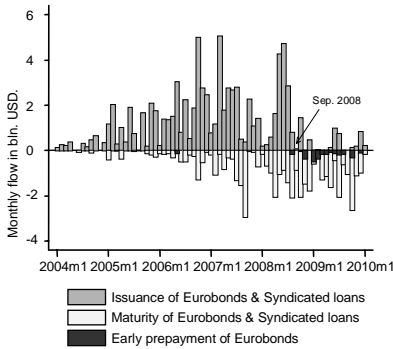
### 3. Data description

The data on banks' accounts has been compiled by the CBR on the basis of form 101 on monthly transactions submitted by individual banks. The two other sources of data are Bloomberg and Cbonds. These information agencies compile data on all Eurobonds and syndicated loans issued by Russian banks in 2004–2010.

I first ranked over 1000 Russian banks by their average asset size and picked the top 350. Secondly, using the CBR reports, I identified banks that have been licensed to conduct transactions with non-residents and had non-zero liabilities with respect to non-residents during the 1 year preceding the sudden stop. A total of 174 banks remained in the final sample.

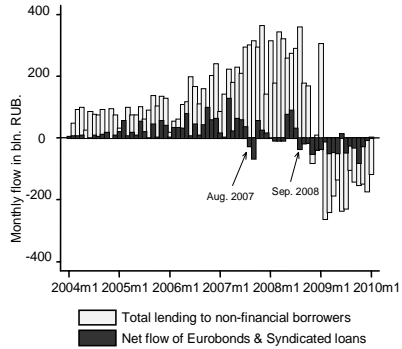
I divided my data on banks into two sub-samples. This was done with reference to the existing literature on empirical corporate finance, which holds that companies that have entered foreign capital markets are more transparent and safe than others [Schmukler, Vesperoni, 2006]. Accordingly, the first sub-sample includes large banks that issued Eurobonds or took syndicated loans and had them outstanding in August 2008 (36 banks), while the second sub-sample includes medium-sized banks that only borrowed from foreign banks through the interbank market (136 banks).





Source: Bloomberg, Cbonds

**Fig. 3.** Aggregate monthly flow of funds



Source: Bloomberg, Cbonds, CBR

**Fig. 4.** Net flow of foreign funds and total lending

## 4. Methodology

For the sub-sample of 38 banks that issued Eurobonds or took syndicated loans prior to September 2008 I use Bloomberg and Cbonds data on debt structure and calculate a Cumulative maturity flow of Eurobonds & syndicated loans over 1 year/Assets<sub>to</sub> where 1 year covers a period after the sudden stop (Sep. 2008 – Aug. 2009) and Assets<sub>to</sub> are taken at the beginning of the period (September 2008). Banks with average ratio of 9,5% are allocated to the «treated» group (17 banks), while all other banks are allocated to a «control» group (19 banks).

For the second sub-sample of banks that borrowed from foreign banks through the interbank money market I calculate Net long-term borrowing from Non-resident banks/Assets ratio for each bank in each month where Net interbank loans from non-resident banks with more than 3 month maturity are used. If during 1 year period preceding the sudden stop the average ratio 7,5% I allocate such bank to a «treated» group (26 banks). I use propensity score matching estimator and observable characteristics of banks to form a «control» group (26 banks) from the rest of the population<sup>2</sup>. By construction one would expect the treated group of banks to be more financially constrained relative to the control group in case of a sudden stop of external financing.

<sup>2</sup> The logit single nearest-neighbor specification without replacement is used for calculating the propensity score and Deposit/Asset, Credit to non-banks/Assets, Overdue credit/Assets ratios are used as observable characteristics for matching.

Using the difference-in-difference (D-in-D) estimator, I investigate if banks belonging to the «treated» group behaved differently from those in the «control» group.

$$Y_{it} = \alpha + \beta_1 TREAT + \beta_2 \tau + \beta_3 (\tau \cdot TREAT) + \beta_4 X_{it} + \varepsilon_{it}.$$

TREAT takes value 1 if bank belongs to a «treated» group and zero if control.  $\tau$  takes value 1 if observations belong to the 1 year time period after the sudden stop (September 2008 to August 2009) and zero if they belong to the 1 year time period before the stop (September 2007 to August 2008). The main coefficient of interest is on the interaction term  $\beta_3$ . It captures all variation in outcome variables specific to the treatments (relative to controls) in the period after the sudden stop (relative to the period before).

$X_{it}$  – represents a set of control variables: a dummy variables for state-controlled banks and for banks affiliated with the state enterprises, a size of a bank's assets relative the largest state-controlled bank and deposits-to-assets ratio.

$Y_{it}$  – represents outcome variables, which were motivated in the introduction.

In order to account for the small-sample bias, I report bootstrapped standard errors for all specifications as suggested by Horowitz (2004).

## 5. Empirical results

### Net borrowing from the Central Bank

Table 1 reports D-in-D estimates of net long-term borrowing from the CBR through its new credit facilities. The value of CBR credit that large and financially constrained banks received from the CBR after the sudden stop was 12% of their pre-crisis assets. The D-in-D estimate for this sub-sample is 4,5% and is significant at 10%<sup>3</sup>.

Estimates for mid-sized banks indicate that although banks in this category made active use of the CBR facility, the treated banks did not receive significantly more funding than banks in the control group.

### Lending to non-financial corporate borrowers

I separate loans granted by banks into three categories: 1) short-term lending (all loans below 1 year maturity); 2) medium-term lending (all loans between 1 and 3 years maturity); 3) long-term lending (all loans with maturity longer than 3 years).

---

<sup>3</sup> The negative sign here indicates an increase in liabilities.

**Table 1.**

**Estimation results**

		Pre-crisis year		Difference in pre-crisis year	Crisis year		Difference in crisis year	Difference-in-Difference
		Treated banks	Control banks		Treated banks	Control banks		
<b>Δ Net long-term borrowing from the CBR/Assets to</b>								
Maturity longer than 3 months	Large banks	-0,016 (0,012)	-0,022 (0,014)	0,006 (0,010)	-0,120 (0,030)	-0,081 (0,019)	-0,039* (0,023)	-0,045* (0,026)
	Medium banks	-0,001 (0,008)	0,001 (0,006)	-0,002 (0,004)	-0,036 (0,012)	-0,049 (0,015)	0,014 (0,016)	0,016 (0,016)
<b>Δ Total lending to companies/Assets to</b>								
Short-term (up to 1 year)	Large banks	0,087 (0,021)	0,083 (0,020)	0,004 (0,029)	-0,055 (0,028)	-0,057 (0,018)	0,002 (0,032)	-0,002 (0,038)
	Medium banks	0,151 (0,095)	0,077 (0,038)	0,074 (0,094)	-0,073 (0,049)	-0,075 (0,042)	0,001 (0,045)	-0,072 (0,103)
Medium-term (1 to 3 years)	Large banks	0,033 (0,011)	0,037 (0,017)	-0,004 (0,019)	0,031 (0,012)	0,031 (0,014)	-0,001 (0,013)	0,004 (0,022)
	Medium banks	0,048 (0,028)	0,037 (0,015)	0,037 (0,015)	0,037 (0,015)	0,055 (0,021)	-0,024 (0,024)	-0,035 (0,037)
Long-term (more than 3 years)	Large banks	0,017 (0,009)	0,015 (0,010)	0,002 (0,007)	0,021 (0,009)	0,007 (0,010)	0,014 (0,013)	0,012 (0,014)
	Medium banks	0,010 (0,018)	-0,003 (0,009)	0,013 (0,013)	-0,009 (0,015)	0,003 (0,008)	-0,012 (0,012)	-0,024* (0,014)
<b>Δ Total lending to individuals/Assets to</b>								
Short-term (up to 1 year)	Large banks	-0,004 (0,014)	0,008 (0,011)	-0,012 (0,016)	-0,027 (0,014)	-0,037 (0,018)	0,010 (0,012)	0,022 (0,022)
	Medium banks	0,044 (0,015)	0,026 (0,011)	0,018 (0,015)	-0,017 (0,011)	-0,004 (0,008)	-0,013 (0,008)	-0,031* (0,017)
Medium-term (1 to 3 years)	Large banks	0,031 (0,019)	0,071 (0,033)	-0,040 (0,030)	-0,035 (0,021)	-0,045 (0,030)	0,009 (0,019)	0,050 (0,035)
	Medium banks	0,057 (0,027)	0,012 (0,016)	0,045* (0,024)	-0,015 (0,021)	-0,013 (0,017)	-0,002 (0,012)	-0,046* (0,025)
Long-term (more than 3 years)	Large banks	-0,003 (0,006)	-0,017 (0,016)	0,014 (0,012)	-0,005 (0,006)	-0,012 (0,008)	0,007 (0,005)	-0,007 (0,012)
	Medium banks	0,000 (0,000)	-0,002 (0,002)	0,001 (0,001)	-0,001 (0,000)	-0,001 (0,000)	0,000 (0,000)	-0,001 (0,001)
<b>Δ Total lending to entrepreneurs/Assets to</b>								
All maturities	Large banks	0,013 (0,004)	0,005 (0,005)	0,008 (0,005)	-0,007 (0,003)	0,001 (0,004)	-0,008** (0,004)	-0,015*** (0,005)
	Medium banks	0,014 (0,005)	0,005 (0,004)	0,009 (0,006)	-0,009 (0,004)	-0,004 (0,003)	-0,006 (0,004)	-0,015*** (0,007)
<b>Δ Net total interbank money market position with non-residents/Assets to</b>								
All maturities	Large banks	-0,039 (0,035)	-0,033 (0,032)	-0,006 (0,036)	0,088 (0,029)	0,047 (0,023)	0,041* (0,025)	0,047 (0,043)
	Medium banks	-0,088 (0,033)	-0,014 (0,015)	-0,074** (0,029)	0,007 (0,019)	-0,005 (0,013)	0,013 (0,015)	0,087*** (0,033)

Note: Bootstrapped standard errors are reported in parenthesis.

\* Denotes significance at 10%; \*\* Denotes significance at 5%; \*\*\* Denotes significance at 1%.

There was a strong credit expansion in short-term lending across all groups of banks during the year preceding the sudden stop. It ranged from 8% to 15% of the assets banks held in September 2007. During the year after the sudden stop, growth turned negative. Depending on the group of banks, it ranged between  $-5,5\%$  and  $-7,5\%$  of their pre-crisis assets<sup>4</sup>. However, the D-in-D estimates are not statistically significant, which suggests that the decline in short-term lending to corporate borrowers was not different across treated and control banks.

The medium-term lending grew at the same pace in the pre-crisis and crisis periods (3–5% of initial assets). In this context, it should be noted that even if the demand for a new credit declines during a crisis, banks often restructure existing corporate debt, and firms tend to draw down the existing credit lines at banks. As a result, bank balance sheet data may even indicate credit expansion during a crisis [Ivashina, Scharfstein, 2010].

The estimates of long-term lending demonstrate that banking business in this maturity was anemic for all banks in both periods.

## Lending to individuals

The long-term lending parallels the results for corporate borrowers, i.e. non-significant growth across all banks for all periods. All action with respect to individual lending was concentrated in the medium-term maturity segment. The growth rates in the pre-crisis period were of the same magnitude as that of medium-term corporate lending (3 to 5% of initial assets). However, after the sudden stop, medium-term lending to individuals turned negative ( $-1,5\%$  to  $-4,5\%$  of assets), while medium-term corporate lending maintained the same pace as before<sup>5</sup>.

Short-term lending to individuals exhibited a similar boom and bust pattern for all banks.

---

<sup>4</sup> Industries that normally borrow on a short-term basis, such as retailers, represented a significant portion of the clients of Russian banks prior to the crisis. According to the July 2008 CBR Bulletin on Banking Statistics, bank lending to corporate borrowers was divided among different industries in the following way: 1) 26% retailers and wholesalers; 2) 20% manufacturing and commodity extraction; 3) 16% construction and real estate; 4) 8% electricity and transport; 5) 6,6% agriculture; 6) 23,4% other industries.

<sup>5</sup> The pre-crisis credit expansion to individuals in the medium-term maturity can be explained by the extraordinary boom in auto sales and auto loans issuance that Russia enjoyed at that time. According to PricewaterhouseCoopers (PwC), the volume of car sales in Russia exhibited the following dynamics: 2 million units in 2006, 2,8 million units in 2007 and in 2008, 1,4 million units in 2009. PwC reported that car sales in Russia exceeded sales in Germany in the first half of 2008, making Russia the biggest car market in Europe during that period. In July 2008, PwC issued a report entitled «Is Russia the Largest Car Market in Europe?» According to PwC estimates, 31% of car sales in 2008 were financed by bank loans. In 2009 this figure dropped to 10%. The average price of a car sold in Russia fell from \$21,7 thousands in 2008 to \$18 thousands in 2009.

## Lending to private entrepreneurs

Previous studies have offered many reasons to consider small firms as having weaker bank-client relationships than large corporate borrowers (e.g., [Gertler, Gilchrist, 1985; Gan, 2007]). This implies that this group of borrowers is less likely to restructure their previous debt and is more vulnerable to cuts in external financing. The results for total lending to private entrepreneurs provide a uniform picture for both sub-samples of banks and suggest that, even though financially constrained banks obtained more funding from the CBR than non-constrained banks, they still cut their lending to this group of borrowers who were less likely to restructure their previous debt<sup>6</sup>.

## Total net borrowing from non-resident banks

The CBR conducted quantitative easing through two channels. On the one hand, it injected ruble liquidity into domestic banks through its credit facilities. On the other hand, it sold one third its international foreign currency reserves.

In an environment where the ruble devalued by 30% with respect to USD, one would expect banks to decrease all foreign currency liabilities and accumulate foreign currency assets. Net position in relation to non-resident banks is a variable that tracks foreign currency assets of banks. I use the deposits of all maturities held by Russian banks in non-resident banks with a positive sign, as well as all liabilities to non-resident banks of all maturities with a negative sign.

Mid-sized treated banks have a higher ratio of long-term liabilities to non-resident banks in the pre-crisis year by construction. During the crisis period, the growth rate of deposits in non-resident banks exceeded the growth rate of liabilities for this group of banks (as indicated by the positive sign) during that period.

The net indebtedness of large banks in relation to non-residents grew by 3–4% of their initial assets in the pre-crisis year. After the crisis and the beginning of quantitative easing by the CBR, both treated and control groups of banks became net lenders to non-resident banks. The net position of treated banks in non-resident accounts grew by 8,8% of their initial assets, while growth for the control group was 4,7%.

---

<sup>6</sup> Unlike banks in industrialized countries, Russian banks lend a relatively small fraction of their loan portfolio to entrepreneurs (1,5% of assets).

## 6. Conclusion

Using data on foreign borrowing by Russian banks, I identify banks that were financially constrained at the onset of the sudden stop caused by the collapse of the Lehman Brothers in September 2008. In a natural experiment set-up, I trace the impact of liquidity infusions made by the CBR on banks' funding and lending decisions. I find that demand for CBR funding increased relatively more among banks that were affected by the sudden stop than among those that were not affected by it during the year following the crisis. This means that the government assistance, which was distributed in a way that allowed banks to choose how much funding to ask for, primarily went to banks that were most affected by the sudden stop.

The estimation results for non-financial corporate borrowers suggest that there was strong credit expansion across all banks during the year preceding the sudden stop. In the following year, all banks substantially cut short-term lending to corporate borrowers, but maintained positive growth in the medium-term maturity segment. The D-in-D estimates suggest that there was no significant variation across banks, which could be interpreted as tentative evidence that the CBR liquidity infusions helped financially constrained banks to sustain lending to corporate borrowers at the same level as unconstrained banks. Lending to entities that are expected to have weaker banking relationships, such as individuals and entrepreneurs exhibited a more pronounced boom and bust cycle.

I find that during the year that followed the crisis, when the CBR engaged in quantitative easing that involved domestic currency infusions into banks and sale of international reserves, all banks in my sample substantially increased their holdings of foreign currency on accounts in non-resident banks. This suggests that government assistance was used by banks not only for foreign debt repayment but also for foreign currency hoarding.

## References

- Almeida H., Campello M., Laranjeira B. et al.* Corporate Debt Maturity and the Real Effects of the 2007 Credit Crisis: NBER Working Paper 14990. 2009.
- Dell'Ariccia G., Detragiache E., Rajan R.* The Real Effects of Banking Crisis // *Journal of Financial Intermediation*. 2008. 17. P. 89–112.
- Gan J.* The Real Effects of Asset Market Bubbles: Loan- and Firm-Level Evidence of a Lending Channel // *The Review of Financial Studies*. 2007. 20. P. 1941–1973.
- Gertler M., Gilchrist S.* Monetary Policy, Business Cycles, and the Behavior of Small Manufacturing Firms // *Quarterly Journal of Economics*. 1994. 109. P. 309–340.

*De Haas R., van Horen N.* The Strategic Behavior of Banks during a Financial Crisis: Evidence from the Syndicated Loan Market. 2009. Mimeo.

*Horowitz J.* The Bootstrap // Handbook of Econometrics. 2004. Vol. 5. P. 3160–3178.

*Ivashina V., Scharfstein D.* Bank Lending during the Financial Crisis of 2008 // Journal of Financial Economics. 2010. 97. P. 319–338.

*Kroszner R., Laeven L., Klingebiel D.* Banking Crises, Financial Dependence and Growth // Journal of Financial Economics. 2007. 84. P. 187–228.

*Schmukler S., Vesperoni E.* Financial Globalization and Debt Maturity in Emerging Economies // Journal of Development Economics. 2006. 79. P. 183–207.

С.В. Головань

Российская экономическая  
школа,

А.М. Карминский,

А.А. Пересецкий

Национальный  
исследовательский  
университет «Высшая школа  
экономики»

# СОПОСТАВЛЕНИЕ РЕЙТИНГОВЫХ ШКАЛ АГЕНТСТВ НА ОСНОВЕ ЭКОНОМЕТРИЧЕСКОГО АНАЛИЗА РЕЙТИНГОВ РОССИЙСКИХ БАНКОВ

---

## Обзор литературы

Сопоставление рейтинговых шкал агентств в международной практике часто проводится с учетом факторов, которые принимают во внимание рейтинговые агентства при присвоении рейтингов объектам.

В работе [Morgan, 2000] исследуется различие в рейтингах, присваиваемых выпускам облигаций двумя агентствами, Moody's и S&P. При этом считается, что сами шкалы эквивалентны, а отличаются методики рейтингования.

Показано, что несовпадение рейтингов статистически связано с недостоверностью отчетности и непрозрачностью деятельности банка, предприятия. Наибольший процент несовпадений приходится на банки и страховые компании, при этом Moody's чаще выставляет рейтинги ниже, чем S&P. Разница между средними рейтингами, выставляемыми двумя агентствами, в четыре раза выше для банковского сектора, чем для типичного выпуска облигаций небанковского сектора.

В работе использовалась модель бинарного выбора для индикатора расхождения рейтинговых оценок (*disagreement*) с регрессорами: средний рейтинг двух агентств, срок до погашения, номинальная стоимость, а также тип эмитента (банк или нет). Вероятность несогласия возростала с ростом среднего рейтинга и срока до погашения и была выше для банков и страховых компаний, а уменьшалась с ростом размера выпуска. Модель подтвердила начальное предположение о негативном смещении в рейтингах, выставляемых Moody's.

В работе [Afonso, 2002] строились модели суверенных рейтингов Moody's и S&P. В качестве данных использовались рейтинги, присвоенные 81 стране в июне 2001 г. Примерно в 35% случаев рейтинги не совпадали, что было объяс-



нено авторами различием в методологии, а также стремлением соответствующего агентства увеличить свою долю на рынке путем присвоения более высокого рейтинга по сравнению с конкурентом. В работе использовались линейные регрессионные модели для простейшей линейной оцифровки рейтинга и для ее логистического преобразования. Качество прогноза суверенного рейтинга по этим моделям оказалось невысоким.

Авторы работы [Liss, Fons, 2006] анализируют сопоставление национальных рейтинговых шкал агентства Moody's с его глобальными рейтинговыми шкалами. Методика Moody's подразумевает, что самый высокий рейтинг по национальной шкале должен приравниваться к объекту с наименьшим риском в стране в соответствии с глобальной шкалой, а самые низкие рейтинги по обеим шкалам должны совпадать. Распределение же остальных рейтингов различно и зависит от страновых факторов, таких как, например, ограничение на регулирование.

Базельский комитет в выпущенном им консультационном документе (The New Capital Accord, 2001) предложил использовать кредитные рейтинги, присвоенные независимыми рейтинговыми агентствами (суверенные, банкам и компаниям), для оценки весов при взвешивании по рискам, приведя в качестве примера шкалу S&P. Также Bank for International Settlements привел еще две шкалы Moody's и Fitch, экспертно сопоставив их друг с другом и со шкалой S&P. Рейтингу AAA (S&P и Fitch) соответствует Aaa (Moody's), BBB (S&P и Fitch) – соответствует Baa3, C по всем шкалам совпадает, а D сопоставляется только у S&P и Fitch из-за отсутствия такой категории в третьей шкале.

В настоящее время в России задача сопоставления рейтингов различных рейтинговых агентств является актуальной и важной для практического применения рейтингов регулирующими органами [Карминский, Солодков, 2010].

Ассоциация региональных банков России провела попарное сравнение рейтинговых шкал российских и зарубежных рейтинговых агентств для 238 кредитных организаций.

Некоторые российские рейтинговые агентства также проводят свои сопоставления рейтинговых шкал. Так, например, Эксперт РА (2006), анализируя соответствие российских банков требованиям по размещению страховых резервов, в том числе провел сопоставление шкал трех международных агентств и шкалы своего агентства. В соответствии с Правилами страховые компании могут размещать до 40% своих страховых резервов в виде депозитов в банках с рейтингом не более двух уровней вниз от суверенного рейтинга Российской Федерации, но не ниже уровня BB-, Baa3, BB- (S&P, Moody's, Fitch соответственно),

который является фактически минимальной линией отсечения. В силу того, что сам Эксперт РА выставляет рейтинги по национальной шкале, его минимальный уровень риска совпадает с суверенным: A++ соответствует BBB и Baa2 (S&P, Moody's и Fitch), а B+ находится на линии отсечения.

РусРейтинг также провел сопоставление рейтинговых шкал основных международных рейтинговых агентств – S&P, Moody's, Fitch, а также российских – РусРейтинг, Эксперт РА, АК&М и Национального рейтингового агентства (НРА) в соответствии с разработанной им методикой [Хейнсворт, 2009]. Для сопоставления рейтинговых шкал была выделена некоторая составная шкала, сопоставляющая каждому банку арифметическое среднее значение простых оценок рейтингов, выставленных ему всеми агентствами.

Далее автор фактически оценивал парную регрессию оцифровки рейтинга на эту составную шкалу и таким образом устанавливал соответствие рейтинговых шкал. В результате получилось, что значению A+, выставяемому РусРейтингом, примерно соответствует BBB+ (Fitch) и BBB (S&P); Baa1 (Moody's) находится между BBB+ и BBB (Fitch) и BBB и BBB– (S&P); A++ (Эксперт) находится на уровне Baa3 (Moody's) и BB+ (S&P); A+ (АК&М) и ААА (НРА) – на уровне Ba1 (Moody's), BB (Fitch и S&P) и ближе к BBB+ (РусРейтинг). Заметим, что такой метод существенно зависит от оцифровки рейтингов. Оцифровка числами 1, 2, 3... навязывает равные расстояния между рейтинговыми градациями.

Саморегулируемая организация Национальная фондовая ассоциация (СРО НФА) также составила свои таблицы соответствия, но на основе опроса экспертов [СРО НФА, 2010]. Исходя из этих таблиц видно, что рейтинговые шкалы трех международных агентств сопоставлены традиционно: наилучшему рейтингу ААА (Fitch и S&P) соответствует Aaa (Moody's), а наихудшим С (Fitch и S&P) – C1, C2 (Moody's), RD и SD (Fitch и S&P) и D соответствует C3 (Moody's). Для РусРейтинга присваиваемый им наивысший рейтинг ААА соответствует AA– и Aa3 (Fitch, S&P и Moody's), а наихудшие С и D – RD/ SD и D/D (Fitch и S&P соответственно), а также C3 (Moody's). Шкалы трех оставшихся российских рейтинговых агентств выглядят схоже. Наилучшему рейтингу A++ (Эксперт и АК&М) и ААА (НРА) соответствует BBB– и Baa3 (Fitch, S&P и Moody's) и A– (РусРейтинг). Наихудшие рейтинги распределились следующим образом: С (Эксперт и АК&М) соответствует C– (НРА), RD и SD (Fitch и S&P), C3 (Moody's), С (РусРейтинг), а D соответствует D остальных агентств.

В серии работ группы авторов разработана методика и практика построения моделей рейтингов российских и международных банков и предприятий на основе эконометрических моделей упорядоченного множественного выбора (ordered probit, logit).

В отличие от линейных моделей результаты, полученные с использованием этих моделей, не зависят от способа оцифровки рейтинговых градаций (см., например: [Soest et al., 2003; Пересецкий и др., 2004; Карминский и др., 2005, 2006; Карминский, Пересецкий, 2007]).

Наиболее методологически правильным является подход к сопоставлению шкал через характеристики объектов. Было бы логичным попытаться оценить вероятности дефолтов, соответствующие тому или иному рейтинговому классу, и сопоставить рейтинговые классы агентств по вероятностям дефолта банков, принадлежащим этим классам. К сожалению, статистических данных по дефолтам российских банков недостаточно для такого сравнения.

В качестве альтернативы можно было бы использовать оценки вероятности дефолта банков, полученные по историческим данным о дефолтах банков и данных их балансов [Peresetsky et al., 2004; Карминский и др., 2005; Пересецкий, 2007, 2009]. (Заметим, однако, что такой подход заведомо уступал бы прямому сравнению рейтингов по тем же финансовым показателям банков на основе моделей рейтингов.)

Попытка сравнения рейтинговых шкал путем сравнения вероятностей дефолта была предпринята в работе [Смирнов, Шоломицкий, 2010]. Авторы построили 95-процентные интервальные оценки вероятностей дефолта для четырех российских рейтинговых агентств – РусРейтинг, Эксперт РА, АК&М и НРА. При этом использовался байесовский подход, учитывающий всю имеющуюся во время наблюдения информацию по банковским рейтингам. Построенные оценки были сопоставлены с оценками вероятностей дефолта. Однако после проведенных тестов было получено, что вероятности дефолта для разных рейтинговых категорий могут статистически не отличаться друг от друга из-за недостаточного объема статистики.

В работе [Пересецкий, 2009] была предложена методика сопоставления двух рейтинговых шкал на примере двух рейтингов агентства Moody's: рейтинга долгосрочных банковских депозитов в иностранной валюте и рейтинга финансовой устойчивости банков. Идея метода состоит в том, что строятся эконометрические модели каждого из рейтингов упорядоченного выбора, использующие финансовые показатели банков и макроэкономические индикаторы. Затем рассчитываются прогнозные значения латентных переменных двух моделей (фактически – рейтингов в непрерывной шкале). Далее подбирается монотонное нелинейное преобразование одной непрерывной шкалы в другую.

Задача сопоставления двух шкал является актуальной и в других областях (психология, социология, образование, спорт и др.)

В исследовании [Colman et al., 1997] сравниваются две шкалы (отличающиеся количеством градаций: 5 и 7) в области психологии. Предлагается два подхода: один – «наивный математический», связанный с умножением каждого балла на  $7/5$ , а второй – эмпирический, связанный с парной линейной регрессией одного рейтинга на другой.

В работе [Baltatescu, 2002] рассматривается сопоставление рейтинговых шкал степени удовлетворенности жизнью в социологических исследованиях. Первая состоит из 5 градаций, а вторая из 11. В качестве первого способа было предложено провести линейную трансформацию шкалы. В качестве второго способа использовался опрос студентов, которым предлагалось отметить их отношение к своей жизни (*life satisfaction*) по двум шкалам – графической и числовой. По полученным результатам эксперты проводили сопоставление, присваивая каждой градации какое-то интервальное значение.

Рожков (2006) рассматривает проблему перевода оценок студента при переходе им из университета одной страны в университет другой, использующий иную систему оценок. В качестве главного критерия сравнения градаций оценок предлагается их частота, т.е. относительное число студентов, получающих каждую из оценок. Такой подход может и хорош для сравнения шкал оценок равных по научному уровню университетов, но вряд ли применим даже для сравнения двух российских вузов.

## **Методика сопоставления рейтинговых шкал**

В данной работе предлагается оригинальная методика сопоставления двух рейтинговых шкал, присваиваемых некоторым объектам (банкам, фирмам, индивидуумам, студентам и т.п.). Методика рассматривается на примере рейтингов, присвоенных банкам различными рейтинговыми агентствами.

Рейтинговая шкала отображает мнение экспертов рейтингового агентства о состоянии банка. Это мнение основано на изучении балансовых отчетов банков, других характеристик финансового положения банка, состояния экономики страны, вероятности внешней поддержки со стороны крупных корпораций, государства и др.

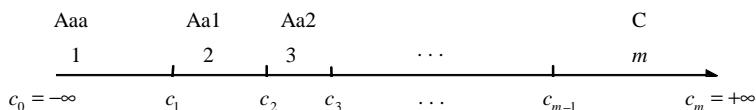
Таким образом, для того чтобы сопоставление двух рейтинговых шкал было объективным, оно не должно быть основано только на сопоставлении пар рейтингов, присвоенных каждому из банков двумя агентствами. Методика должна быть основана на сопоставлении финансовых и других показателей банков, учитываемых экспертами рейтинговых агентств при выставлении рейтинга.

Предлагаемая методика состоит из трех шагов и основана на идее, предложенной для сравнения двух рейтингов банков агентства Moody's в работе [Пересецкий, 2009].

**Шаг 1.** Строятся эконометрические модели упорядоченного множественного выбора (ordered probit, или logit) для каждого из двух рейтингов на основании данных по рейтингам банков и данным их финансовых и других показателей. При этом один и тот же набор показателей (факторов) используется в каждой из моделей. Методика и практика построения таких моделей описана в серии работ группы авторов.

Logit-модель упорядоченного выбора для рейтинга с  $m$  градациями имеет следующий вид:

$$\begin{cases} y_i^* = x_i' \beta + \varepsilon_i, \\ rating_i = r, \text{ если } c_{r-1} < y_i^* < c_r. \end{cases} \quad (1)$$



Здесь  $i$  – номер наблюдения (банк – время);  $r$  – градация рейтинга в цифровой шкале ( $1 \leq r \leq m$ , наивысшему рейтингу AAA присвоено значение 1);  $rating_i$  – значение рейтинга, присвоенного наблюдению  $i$  (данный банк в данный момент времени);  $x_i' \beta = x_{i1} \beta_1 + x_{i2} \beta_2 + \dots + x_{ik} \beta_k$  – линейная комбинация объясняющих факторов (показателей банка в момент времени, предшествующий с некоторым лагом моменту наблюдения рейтинга банка);  $k$  – число объясняющих факторов в модели;  $y_i^*$  – латентная (скрытая, ненаблюдаемая) переменная, фактически имеющая смысл рейтинга в «непрерывной» шкале (чем меньше ее значение, тем больше вероятность присвоения высшего рейтинга);  $c_0, c_1, \dots, c_{m-1}, c_m$  – «пороги отсечения» для преобразования «непрерывной» рейтинговой шкалы в дискретную шкалу;  $\varepsilon_i$  – случайная величина, имеющая логистическое распределение (*ordered logit*).

Модель (1) является существенно нелинейной, что и обеспечивает ее гибкость (независимость от способа оцифровки, возможность разных «расстояний» между рейтинговыми градациями). Параметры модели, вектор порогов  $c = (c_0, c_1, \dots, c_{m-1}, c_m)'$  и вектор коэффициентов  $\beta = (\beta_1, \dots, \beta_k)'$ , оцениваются методом максимального правдоподобия.

Модель (1) оценивается на данных по рейтингам двух рейтинговых агентств. Обозначим через  $y_i^*$  и  $z_i^*$  соответствующие непрерывные рейтинговые шкалы. Для двух моделей получаем оценки значений их параметров соответственно  $\hat{c}^{(1)}, \beta^{(1)}$  для первого рейтинга и  $\hat{c}^{(2)}, \beta^{(2)}$  – для второго.

Для более точной оценки параметров модели используются все наблюдения, для которых данный рейтинг присвоен, а не только те наблюдения, котрым одновременно присвоены оба рейтинга.

Поскольку рейтинговому агентству требуется некоторое время для анализа состояния банка, значения объясняющих факторов  $x_i$  берутся с лагом по времени, т.е. предшествуют наблюдению рейтинга на 1–2 квартала. Выбор лага производится экспертно, расчеты показали, что результат незначительно зависит от этого выбора.

**Шаг 2.** Для каждого наблюдения  $i$ , для которого имеются оба рейтинга, рассчитываются прогнозы значений «непрерывного» рейтинга для каждой из рейтинговых шкал,

$$\hat{y}_i^* = x_i^* \hat{\beta}^{(1)} = x_{i1} \hat{\beta}_1^{(1)} + \dots + x_{ik} \hat{\beta}_k^{(1)} \text{ и } \hat{z}_i^* = x_i^* \hat{\beta}^{(2)} = x_{i1} \hat{\beta}_1^{(2)} + \dots + x_{ik} \hat{\beta}_k^{(2)}.$$

Далее строится преобразование одной непрерывной рейтинговой шкалы в другую, т.е. подбирается нелинейная монотонная функция  $f(\cdot)$  такая, что  $\hat{y}_i^* = f(\hat{z}_i^*)$ . Функция выбирается нелинейной для того, чтобы не навязывать заранее вид зависимости непрерывных шкал. Монотонность является естественным предположением об адекватности рейтингов.

Поскольку априори функциональная зависимость между непрерывными рейтингами неизвестна, она аппроксимируется многочленом нечетной степени на диапазоне значений  $\hat{z}_i^*$ , т.е. по выборке банков, которым присвоен хотя бы один из двух рейтингов, оценивается регрессионное уравнение (2):

$$\hat{y}_i^* = \gamma_0 + \gamma_1 \hat{z}_i^* + \dots + \gamma_q (\hat{z}_i^*)^q + u_i, \quad (2)$$

откуда получаются оценки коэффициентов многочлена

$$\hat{f}(z) = \hat{\gamma}_0 + \hat{\gamma}_1 z + \hat{\gamma}_2 z^2 + \dots + \hat{\gamma}_q z^q.$$

**Шаг 3.** Преобразование (2) позволяет найти образ диапазона  $\hat{c}_{r-1}^{(2)} < z^* < \hat{c}_r^{(2)}$  непрерывного рейтинга  $z$ , соответствующего рейтинговой градации  $r$ , в непрерывной шкале первого рейтинга  $y_i^*$ , а именно

$$\left[ \hat{f}(\hat{c}_{r-1}^{(2)}), \hat{f}(\hat{c}_r^{(2)}) \right].$$

Далее положение этого интервала сопоставляется с точками отсечения первого рейтинга  $\hat{c}_s^{(1)}$  и производится соответствие дискретных рейтингов. Это соответствие не всегда взаимно-однозначное, ниже будут рассмотрены примеры.

Полученное таким образом соответствие, вообще говоря, может зависеть от выбора объясняющих факторов в модели (1) и степени полинома в (2). Также соответствие может зависеть от временного диапазона исходных данных, если изменялась методика одного из двух рейтинговых агентств. Однако, как показывает практика, при выборе достаточно адекватных спецификаций уравнения (1) получающиеся соответствия изменяются незначительно.

Методика позволяет также проводить и множественное сравнение, отображая все рейтинги в шкалу одного, выбранного как базовый «измеритель» (*numéraire*). При этом, конечно, полученное множественное сравнение может зависеть от этого выбора, т.е. процедура не инвариантна относительно выбора базового рейтинга. На практике рекомендуется в качестве базового рейтинга выбрать рейтинг агентства, которое наиболее авторитетно и которое присвоило рейтинги достаточно большому количеству банков. Последнее необходимо для снижения погрешности при множественном сопоставлении.

## Примеры применения методики

В расчетах используются данные по 10 рейтингам российских банков в течение периода с I квартала 2006 г. по IV квартал 2010 г. Соответствующие показатели квартальной финансовой отчетности были взяты по данным агентства Интерфакс. Также имеются данные по форме собственности банков. База данных подготовлена группой студентов ВШЭ (Василюк А.А., Сосюрко В.В.) под руководством А.М. Карминского.

В качестве объясняющих факторов в примере были выбраны следующие показатели:

$l\_ta$  – логарифм совокупных активов;

$npl\_ltr$  – просроченные кредиты/кредиты НБС-резидентам;

$d\_ta$  – депозиты НБС/совокупные активы;

$llp\_ltr$  – резервы под кредиты НБС/кредиты НБС-резидентам;

$pe\_ta$  – расходы на персонал/совокупные активы;

$c\_ta$  – собственный капитал/совокупные активы;

$n1$  – норматив достаточности капитала (Н1);

$n7$  – норматив максимального размера крупных кредитных рисков (Н7);

*for\_dum* – индикатор иностранного владельца;

*st\_dum* – индикатор государственного банка;

*n4* – норматив долгосрочной ликвидности банка (Н4).

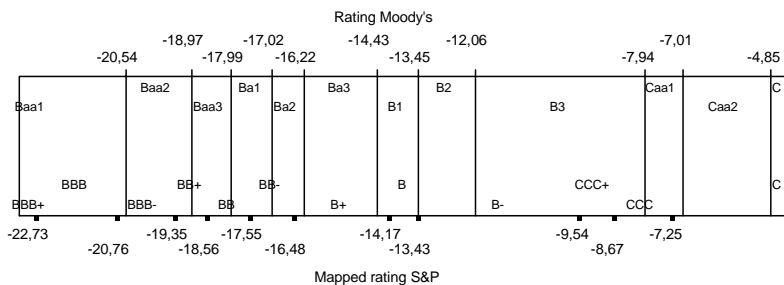
В качестве базового рейтинга выбран рейтинг агентства Moody's.

Приведем в качестве примера график (рис. 1) сопоставления рейтинга агентства S&P и Moody's при использовании данных за период 2007:I–2010:IV с лагом 1 квартал.

График следует читать следующим образом:

- градация B– (S&P) покрывает B2 и часть B3 по Moody's;
- градация B (S&P) примерно соответствует B1 (Moody's);
- градация B+ (S&P) примерно соответствует Ba3 (Moody's);
- градация BB– (S&P) примерно соответствует Ba2 и части Ba1 (Moody's);
- градация BB (S&P) примерно соответствует части Ba1 и части Baa3 (Moody's);

и так далее.



**Рис. 1.** Отображение шкалы S&P в шкалу Moody's, 2007:I–2010:IV

На рис. 2 приведено аналогичное соответствие, построенное по данным с III квартала 2009 г. по IV квартал 2010 г. (последние 6 кварталов). Соответствие несколько изменилось (в основном «на хвостах»), но в средней, наиболее интересной, области B3–Ba1 (по Moody's) изменения не очень значительные. Изменения могут отражать кризис 2008 г.

Поскольку имеется наличие сезонности в квартальных показателях банков, то, по-видимому, наименьший разумный период для оценивания моделей равен четырем кварталам. На рис. 3–11 приведены сравнения рейтинговых шкал по данным за четыре квартала 2010 г. (2010:I–2010:IV).



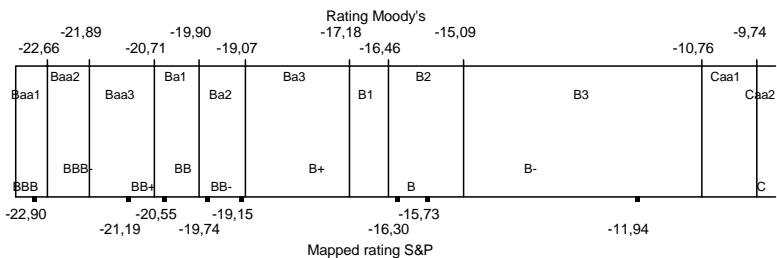


Рис. 2. Отображение шкалы S&P в шкалу Moody's, 2009:III–2010:IV

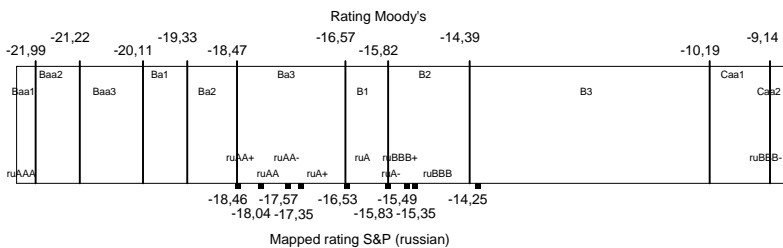


Рис. 3.

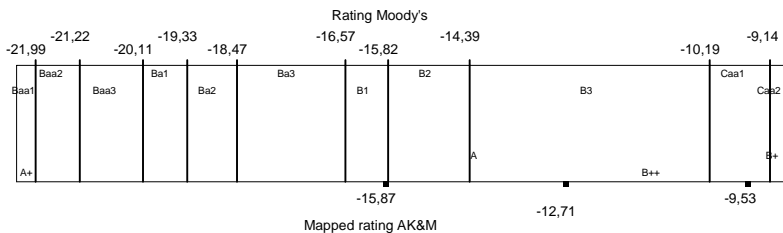


Рис. 4.

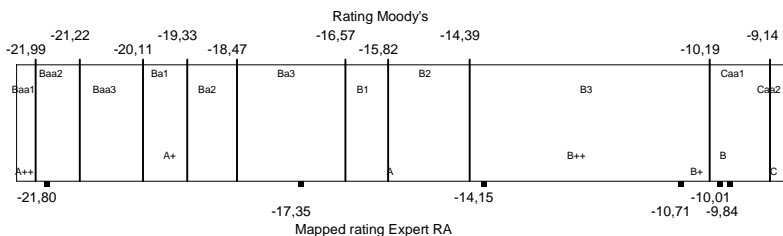


Рис. 5.

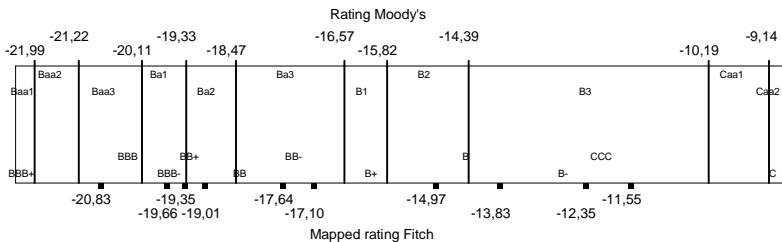


Рис. 6.

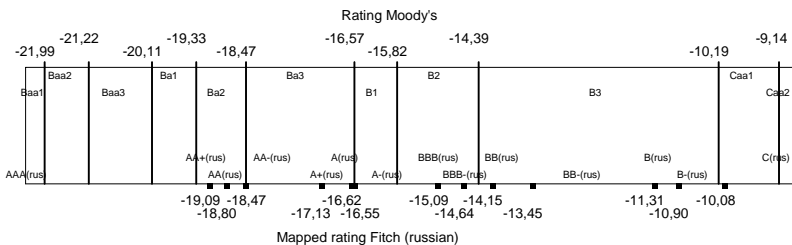


Рис. 7.

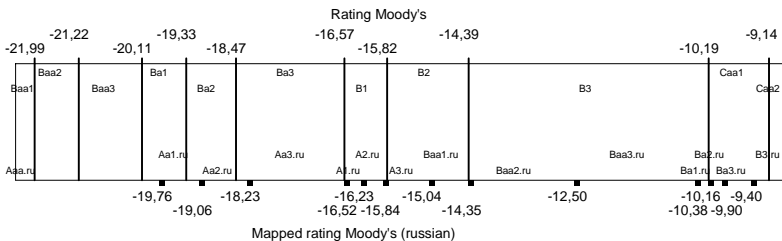


Рис. 8.

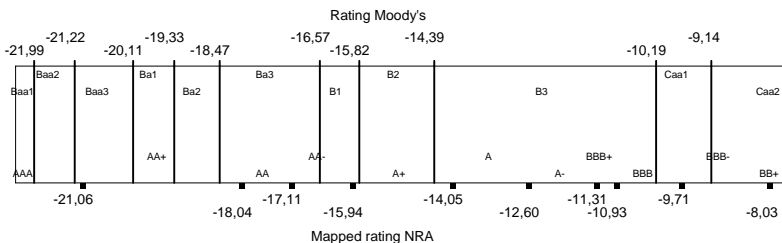


Рис. 9.

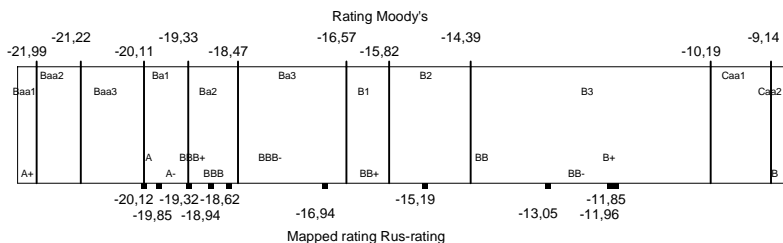


Рис. 10.

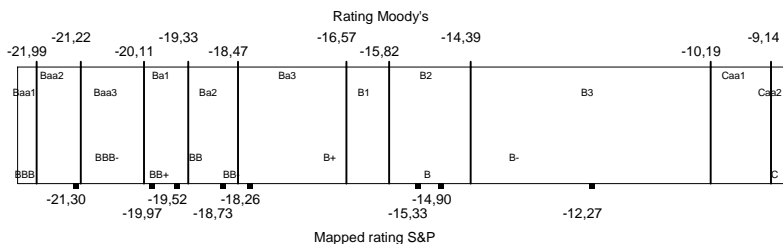


Рис. 11.

## Заключение

В работе предложена методика сопоставления 10 рейтинговых шкал агентств, присваивающих рейтинги российским банкам. Методика основана на сравнении рейтингов на основе их эконометрических моделей, построенных по финансовым и другим показателям банков.

Проведено тестирование методики на реальных данных по рейтингам российских банков и их квартальным показателям за период с I квартала 2006 г. по IV квартал 2010 г. Результаты сравнения несколько зависят от периода, что, видимо, объясняется двумя причинами: 1) кризис 2008 г. и 2) изменение методики присвоения рейтингов некоторыми агентствами.

Существенными отличиями предложенной методики от других известных способов сопоставления рейтинговых шкал являются: 1) методика использует не только сопоставление пар рейтингов, присвоенных каждому из банков агентствами, но принимает во внимание финансовые и другие показатели банков, учитываемые экспертами рейтинговых агентств при выставлении рейтингов; 2) ее результат не зависит от способа оцифровки рейтинговых шкал; 3) она не предполагает использование экспертных мнений (кроме уже включенных в рейтинги, присвоенные банкам экспертами рейтинговых агентств).

После некоторой доработки (более тщательный отбор факторов, включенных в модели рейтингов) методика может быть предложена к использованию в практической деятельности.

## Литература

*Карминский А.М., Пересецкий А.А.* Модели рейтингов международных агентств // Прикладная эконометрика. 2007. 1. С. 3–19.

*Карминский А.М., Пересецкий А.А., Головань С.В.* Модели рейтингов российских банков. Построение, анализ динамики и сравнение: Препринт РЭШ. № 2005/049. 2005.

*Карминский А.М., Пересецкий А.А., Головань С.В.* Моделирование вероятности дефолта российских банков с учетом макропараметров // Управление финансовыми рисками. 2005. 3. С. 43–57.

*Карминский А.М., Пересецкий А.А., Рыжов А.В.* Модели рейтингов банков для риск-менеджмента // Управление финансовыми рисками. 2006. 4. С. 362–373.

*Карминский А.М., Солодков В.М.* Единое рейтинговое пространство: проблемы и решения // Аналитический банковский журнал. 2010. 10. С. 58–64.

*Пересецкий А.* Измерение компоненты внешней поддержки рейтингов агентства Moody's // Прикладная эконометрика. 2009. 2. С. 3–23.

*Пересецкий А.А.* Методы оценки вероятности дефолта банков // Экономика и математические методы. 2007. 43(3). С. 37–62.

*Пересецкий А.А.* Эконометрические методы в дистанционном анализе деятельности российских банков. М.: ЦЭМИ РАН, 2009.

*Пересецкий А.А., Карминский А.М., ван Суст А.Г.О.* Моделирование рейтингов российских банков // Экономика и математические методы. 2004. 40(4). С. 10–25.

*Рожков Н.Н.* Система перезачета оценок успеваемости – инструмент поддержки академической мобильности // Университетское управление: практика и анализ. 2006. 5. С. 104–113.

*Смирнов С.Н., Шоломицкий А.Г.* Сопоставление качества рейтингов российских банков: Препринт ВШЭ WP16/2010/03. 2010.

СРО НФА. Протокол совещания Рабочей группы Комитета по рейтингованию. Выписка, июнь, 2010.

Хейнсворт Р. Сопоставимость уровней кредитных рейтингов, присвоенных разными агентствами // Деньги и Кредит. 2009. 12. С. 46–50.

«Эксперт РА» Новые правила размещения страховых резервов: требования к рейтингам банков. Аналитическая записка, май 2006.

*Afonso A.* Understanding the Determinants of Government Debt Ratings: Evidence for the Two Leading Agencies. Department of Economics at the School of Economics and Management, Technical University of Lisbon, Working Papers, № 2002/02. 2002.

*Batatescu S.* Problems of Transforming Scales of Life Satisfaction. Euromodule workshop, Presentation, 2002.

Basel Committee on Banking Supervision. The New Basel Capital Accord. Consultative Document, Bank for International Settlements, January, 2001.

*Colman A., Norris C., Preston C.* Comparing Rating Scales of Different Length: Equivalence of Scores from 5-point and 7-point Scales // Psychological Reports. 1997. 80. P. 355–362.

*Liss H., Fons J.* Mapping Moody's National Scale Ratings to Global Scale Ratings. Moody's Rating Methodology. December, 2006.

*Morgan D.* Rating Banks: Risk and Uncertainty in an Opaque Industry // American Economic Review. 2000. 92(4). P. 874–888.

*Peresetsky A., Karminsky A., Golovan S.* Probability of Default Models of Russian Banks. Bank of Finland, BOFIT Discussion Papers № 21/2004. 2004.

*Soest A.H.O., Karminsky A.M., Peresetsky A.A.* An Analysis of Ratings of Russian Banks. Tilburg University CentER Discussion Paper Series. № 85. 2003.

# **УПРАВЛЕНИЕ ИНВЕСТИЦИОННЫМ ПОТЕНЦИАЛОМ В РОССИЙСКОМ СТРАХОВОМ БИЗНЕСЕ: ТРАДИЦИИ, ИННОВАЦИИ ИЛИ НЕИСПОЛЬЗОВАННЫЕ ВОЗМОЖНОСТИ РОСТА?**

---

В современных условиях роль страхования как механизма управления различными рисками (имущественными, финансовыми, политическими и др.), необходимого для устойчивого функционирования экономики и особенно актуального в период посткризисного развития, безусловно, трудно переоценить. Стабильное развитие экономики во многом определяется состоянием инфраструктуры рынка, которая немислима без надежно функционирующей и устойчивой системы страхования, а одним из главных и определяющих факторов устойчивости страхового рынка является эффективность инвестиционной деятельности его участников – страховых компаний. Причем, с одной стороны, эффективное управление инвестиционным потенциалом страховщика способствует повышению рентабельности, платежеспособности и финансовой устойчивости конкретных страховых организаций (на микроуровне), а с другой – посредством активной инвестиционной деятельности страховых и перестраховочных компаний реализуется инвестиционная функция категории страхования, а именно, через вложения временно свободных денежных средств страховых резервов (и собственных средств) в различные активы и инструменты фондового и других рынков происходит финансирование экономики в целом (на макроуровне).

В условиях преодоления негативных последствий кризисных явлений 2008–2010 гг. проблема повышения эффективности инвестиционной деятельности страховых компаний и совершенствования системы управления инвестиционным потенциалом страхового рынка, в целом, приобретает особую актуальность.

Следует отметить, что эффективность инвестиционной деятельности российских страховщиков еще с начала демонополизации страхового рынка тра-

диционно считается очень низкой, хотя их инвестиционный потенциал (особенно в аспекте «длинных» денег) во многом превосходит потенциал других институциональных инвесторов. Данная проблема хотя и рассматривалась некоторыми российскими учеными (как правило, страховщиками-практиками), но является недостаточно разработанной, в том числе и потому, что в условиях выполнения всех требований государственного регулятора страхового рынка по размещению временно свободных денежных средств (страховых резервов и собственных средств) у страховщика фактически не остается возможности маневра по формированию эффективного инвестиционного портфеля с точки зрения оптимального сочетания доходности и риска.

По нашему мнению, причины низкой инвестиционной активности российских страховщиков и, как следствие, низкой эффективности их инвестиционной деятельности, связаны:

- с несовершенством действующего законодательства в области страхования, поскольку в условиях выполнения требований по инвестированию и соблюдения структурных соотношений активов, принимаемых в покрытие страховых резервов<sup>1</sup>, у страховщиков практически отсутствует возможность хеджирования рисков с помощью применения производных финансовых инструментов и, соответственно, формирования портфеля с более высокой доходностью;
- с неготовностью страховщиков использовать имеющиеся современные инструменты фондового и других рынков, продукты финансового инжиниринга, и адаптировать существующие методы управления инвестиционным портфелем к специфике страховых компаний.

С учетом практического отсутствия в российских страховых компаниях эффективных систем управления финансовыми рисками нами предлагаются следующие направления повышения эффективности управления инвестиционным потенциалом страховщика и совершенствования систем риск-менеджмента в страховом бизнесе в целом.

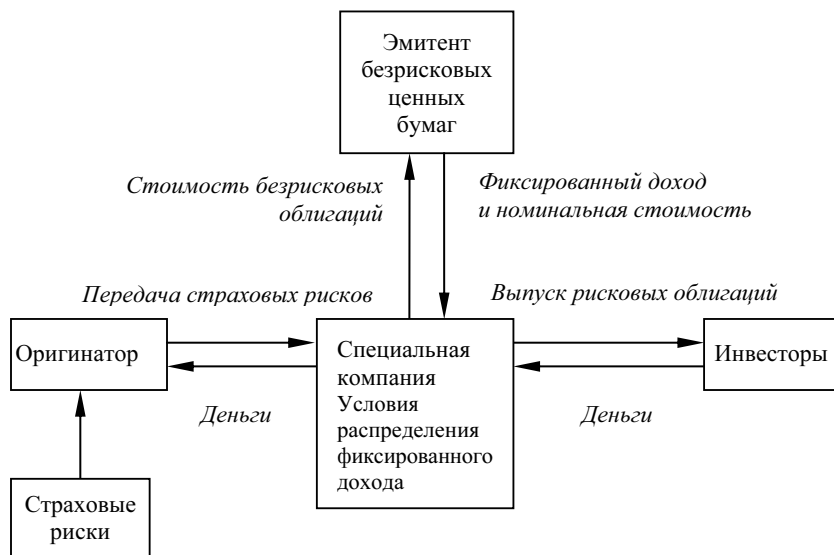
*1. Наиболее оптимальным инструментом снижения инвестиционного риска страховщика является секьюритизация страховых активов*, как с точки зрения стоимости и срока покрытия риска, так и с точки зрения возможности привлечения капитала.

Секьюритизацию страховых активов предлагается проводить по следующей схеме (рис. 1). Страховая или перестраховочная компания несет обязатель-

---

<sup>1</sup> Об организации страхового дела в Российской Федерации. Федеральный закон от 27 ноября 1992 г. № 4015-1 в редакции Федерального закона от 10 декабря 2003 г. № 172-ФЗ; Приказ МФ РФ от 8 августа 2005 г. № 100н «Об утверждении правил размещения страховщиками средств страховых резервов».

ства по рискам, принятым на страхование. Чтобы захеджировать данные риски, страховщик заключает договор со специальной компанией, по которому за фиксированную плату получает определенный доход при реализации риска (наступлении страхового события). Специальная компания выпускает облигации, основанные на страховых рисках, купон по которым является плавающим и зависит от наступления страхового события, и покупает безрисковые долговые бумаги, доход от которых – в соответствии с договором и условиями выпуска облигаций – будет распределяться между эмитентом (страховщиком) и держателями рисков облигаций.



**Рис. 1.** Схема секьюритизации в страховании

В отличие от обычных портфельных инвестиционных рисков риск катастроф абсолютно не зависит от динамики макроэкономического цикла, следовательно, принятие в портфель ценной бумаги, основанной на страховом риске, позволяет диверсифицировать вложения и взаимно погасить риски. Страховщик ставит на то, что если страховое событие все-таки произойдет, он гарантированно покроет убытки за счет привлеченных таким образом средств.

Подобная деятельность для страховщика не может расцениваться как чисто эмиссионная, так как это уже не просто торговля облигациями, а перераспределение риска за плату, близкое по своей сути к перестрахованию.

Секьюритизация имеет большие перспективы, так как увеличивает емкость страхового рынка и обеспечивает защиту от страховых рисков. При этом сокра-



щается (по сравнению с перестраховочными каналами) число ступеней перераспределения риска и затраты на его организацию и, следовательно, в конечном итоге уменьшается стоимость услуг для страхователей.

Таким образом, использование ценных бумаг, в основе которых лежат страховые риски, ведет к росту эффективности портфеля; их появление позволяет инвесторам конструировать нужные им портфели с меньшими затратами. Более эффективное распределение капитала по рискам приведет к тому, что на рынке сложится новое состояние равновесия, при котором все инвесторы окажутся в выигрыше.

2. *Модель управления инвестиционным портфелем страховщика.* В модели предлагается постановка многокритериальной задачи управления, где критериями являются максимизация доходности и минимизация риска при обеспечении необходимых уровней ликвидности, возвратности, доходности, диверсифицируемости, а также соблюдения структурных соотношений активов, принимаемых в покрытие страховых резервов (в соответствии с требованиями государственного регулятора).

В рамках построенной модели ограничимся рассмотрением портфеля, состоящего из пяти следующих активов (как показал анализ инвестиционных портфелей страховщиков УрФО, именно эти активы являются наиболее популярными при покрытии страховых резервов, в общем случае портфеля, состоящего из  $n$ -активов, задача решается аналогичным образом):

1) депозиты в банках, в том числе удостоверенные депозитными сертификатами; удельный вес в портфеле  $U_1$ , ожидаемая доходность  $P_p^1$ ;

2) государственные ценные бумаги; удельный вес в портфеле  $U_2$ , ожидаемая доходность  $P_p^2$ ;

3) векселя организаций; удельный вес в портфеле  $U_3$ , ожидаемая доходность  $P_p^3$ ;

4) корпоративные ценные бумаги – акции; удельный вес в портфеле  $U_4$ , ожидаемая доходность  $P_p^4$ ;

5) корпоративные облигации; удельный вес в портфеле

$$(1 - U_1 - U_2 - U_3 - U_4),$$

ожидаемая доходность  $P_p^5$ .

**Таблица 1.**

Показатели инвестиционной деятельности страховых организаций УрФО по группе «средние» страховщики, тыс. руб.

Наименование показателя	2006 г.	2007 г.	2008 г.	2009 г.	2010 г.
Страховые резервы	47824	44169	27166	18959	22042
Активы, принимаемые в покрытие страховых резервов					
Акции	3081	3178	3380	1841	1981
Госбумаги	1500	1500	1997	1895	–
Банковские депозиты	600	100	2600	–	–
Векселя	13989	8094	–	3956	11000
Вклады в УК ООО	600	600	–	–	–
Недвижимое имущество	5025	4678	1567	1895	2204
Доля перестраховщиков в СР	13495	17488	4452	7963	6314
Дебиторская задолженность перестраховщиков, перестрахователей	123	4416	406	39	361
Дебиторская задолженность страхователей	1345	1456	2456	6456	9466
Денежные средства	9521	4115	12764	1370	182

Инвестиции страховой организации в рамках модели характеризуются следующим набором показателей:

$CP$  – величина страховых резервов, определяющая стоимость портфеля, состоящего из  $n$  активов (в том случае, если инвестируются только средства страховых резервов); в общем случае стоимость портфеля  $P = CP + CC$ , так как инвестироваться могут еще и собственные средства ( $CC$ );

$A_i$  – стоимость  $i$ -го актива, принимаемого в покрытие страховых резервов;

$U_i$  – удельный вес  $i$ -го актива в стоимости портфеля,  $U_i = \frac{A_i}{P}$ ;

$P_p^i$  – ожидаемая доходность  $i$ -го актива;

$r_i$  – ожидаемый риск  $i$ -го актива, выражающийся стандартным отклонением.

По сути, показатель риска представляет собой отклонение фактической доходности актива от ожидаемой, причем учитываются отклонения как в меньшую, так и в большую стороны, но когда мы говорим о минимизации риска, то имеем в виду, конечно, вероятность возникновения отрицательного фи-

нансового результата, т.е. когда фактическая доходность актива, принятого в покрытие страховых резервов, оказалась ниже ожидаемой.

Тогда доходность портфеля будет определяться как средневзвешенная сумма доходностей входящих в портфель активов:

$$E(r) = \sum_{i=1}^n U_i \cdot P_p^i. \quad (1)$$

Ожидаемый риск портфеля будет представлять собой:

$$R = \sum_{i=1}^n \sum_{j=1}^n U_i \cdot U_j \cdot Cov_{ij}, \quad (2)$$

где  $Cov_{ij} = \frac{\sum_{k=1}^n (pi_k - \bar{pi})(pj_k - \bar{pj})}{n-1}$  – ковариация  $i$ -го и  $j$ -го активов;  $pi_k, pj_k$  – доходности активов  $i$  и  $j$  в  $k$ -ом случае;  $n$  – число случаев регистрации доходностей активов.

Требования, накладываемые на максимальный объем активов структурными соотношениями активов, принимаемых в покрытие страховых резервов (в соответствии с приказом Минфина РФ № 100н), запишем в виде ограничений:

$$U_i \cdot CP \leq c_i. \quad (3)$$

Функцию доходности обозначим  $F1(u_1, u_2, u_3, u_4)$ , функцию риска удобнее использовать с противоположным знаком:

$$F2(u_1, u_2, u_3, u_4) = -R(u_1, u_2, u_3, u_4).$$

Таким образом, приходим к следующей комбинированной задаче:

$$\begin{cases} F_1(u_1, u_2, u_3, u_4) \rightarrow \max, \\ F_2(u_1, u_2, u_3, u_4) \rightarrow \max, \\ (u_1, u_2, u_3, u_4) \in M. \end{cases} \quad (4)$$

В работе также предложен алгоритм решения статической и динамической многокритериальных задач и методика его применения в практической деятельности страховых компаний при формировании инвестиционного портфеля.

Автором проведен детальный анализ динамики портфельных инвестиций страховых компании Уральского федерального округа за период с 1 января 2003 г. по 1 января 2010 г., а также основных принципов инвестиционной по-

литики. Результаты исследовательской работы в этом направлении после применения предложенных выше моделей управления инвестиционным портфелем в ряде компаний выразились в существенном повышении эффективности инвестиционной деятельности, качества системы риск-менеджмента и уровня финансовой устойчивости страховой организации в целом.

3. *Методология комплексной (интегральной) оценки инвестиционных рисков, возникающих в страховом бизнесе.* Наибольшего эффекта в управлении инвестиционными рисками можно достичь, используя комплексный подход к их оценке и анализу, т.е. рассматривая различные группы рисков, возникающих в деятельности страховой организации, не абстрагированно друг от друга, а в совокупности, учитывая их взаимное влияние и динамику изменений.

Вообще риски, возникающие в таких финансовых институтах, как страховые компании (учитывая их двустороннюю подверженность различным рискам), можно классифицировать, как это представлено на рис. 2.



**Рис. 2.** Риски, возникающие в страховом бизнесе

Источник: [Слепухина, 2009].

Таким образом, все многообразие рисков, возникающих в деятельности страховых организаций, можно подразделить на две группы: страховые риски (принимаемые по договорам страхования и связанные с их обслуживанием) и финансовые риски (прямым образом не связанные со страховой деятельностью, но обычно сопровождающие процессы, являющиеся следствием проведения страховых операций).

Тогда совокупный размер риска, принимаемого по договорам страхования, будет вычисляться как сумма всех относительных рисков, связанных с обслуживанием договоров страхования, а также рисков внешней рыночной среды (риски внутренней рыночной среды не оказывают значительного влияния на деятельность страховой организации, поэтому ими в рамках предлагаемой методики оценки риска имеет смысл пренебречь), взвешенных с учетом влияния на оцениваемый абсолютный риск.

Пусть  $R_1$  – абсолютный риск, принимаемый по договорам страхования;

$R_2$  – абсолютный риск, связанный с обслуживанием договоров;

$R_3$  – абсолютный риск внешней рыночной среды;

$r_1$  – относительный риск, принимаемый по договорам страхования;

$r_2$  – относительный риск, связанный с обслуживанием договоров, причем

$$r_2 = a_1 \cdot r_{21} + a_2 \cdot r_{22} + a_3 \cdot r_{23},$$

где  $r_{21}$  – риск андеррайтинга;  $r_{22}$  – риск неэффективного перестрахования;  $r_{23}$  – риск формирования страховых резервов;

$r_3$  – относительный риск внешней рыночной среды, причем

$$r_3 = b_1 \cdot r_{31} + b_2 \cdot r_{32} + b_3 \cdot r_{33},$$

где  $r_{31}$  – риск ликвидности;  $r_{32}$  – процентный риск;  $r_{33}$  – валютный риск. Получим следующие формулы для вычисления абсолютных рисков:

$$R_1 = c_{11} \cdot r_1 + c_{12} \cdot r_2 + c_{13} \cdot r_3,$$

$$R_2 = c_{21} \cdot r_1 + c_{22} \cdot r_2 + c_{23} \cdot r_3,$$

$$R_3 = c_{31} \cdot r_1 + c_{32} \cdot r_2 + c_{33} \cdot r_3.$$

Весовые коэффициенты  $a_i$ ,  $b_i$ ,  $c_{ij}$  ( $i, j = 1, 2, 3$ ) определяются степенью влияния конкретных относительных рисков на вычисляемый абсолютный или относительный риски, т.е. например,  $c_{12}$  – это численное выражение влияния относительного риска  $r_2$ , связанного с обслуживанием договоров страхования, на величину абсолютного риска  $R_1$ , принимаемого по договорам страхования;  $a_1$  – численное выражение влияния относительного риска андеррайтинга на

общее значение относительного риска, связанного с обслуживанием договоров страхования.

В работе обосновано присвоение каждому весовому коэффициенту того или иного численного выражения и построены матрица  $C$  и вектора  $A$  и  $B$  весовых коэффициентов, а также для оценки значений относительных рисков  $r_{ij}$  проведен анализ конкретных показателей деятельности страховой организации, определенному диапазону значений которых поставлены в соответствие значения относительных рисков. В табл. 2 представлена оценка относительного риска андеррайтинга; значения других относительных рисков (формирования страховых резервов, процентного, валютного и других, не связанных со страховой деятельностью) определяются по аналогичной схеме.

**Таблица 2.** Оценка относительного риска андеррайтинга

Показатель	Значения относительного риска андеррайтинга			
	0,7 – зона критического риска	0,4 – зона повышенного риска	0,1 – зона удовлетворительного риска	0,01 – зона минимального риска
Оценка объекта страхования	Оценка произведена формально, особенности проигнорированы	Оценка произведена некачественно, особенности практически не выявлены	Особенности учтены частично	Учтены все особенности объекта, что нашло отражение в повышающих и понижающих коэффициентах
Установление и оценка страховых рисков	Не произведена должным образом, без оценки вероятности реализации рисков	Установлены не все риски, занижена вероятность реализации рисков	Риски определены, но по отдельным их видам занижена вероятность реализации	Определены все возможные риски, оценка вероятности их реализации произведена достаточно корректно
Оценка рисков обстоятельств	Оценка не произведена	Выявленные обстоятельства не оказывают влияния на вероятность наступления событий	Выявлены не все рисковые обстоятельства	Определены все рисковые обстоятельства, влияющие на вероятность наступления событий
Расчет страховых тарифов	Тариф рассчитан некорректно, в сторону занижения	Тариф рассчитан некорректно, не применены коэффициенты	Расчет в соответствии с Правилами, но учтены не все рисковые обстоятельства	Расчет в соответствии с Правилами, Методикой ФССН, с применением коэффициентов

Результаты применения предложенной методики комплексной оценки рисков в страховых компаниях УрФО позволяют сделать вывод, что она дает возможность выбрать приоритетные направления при решении проблемы управления рисками, т.е. те направления минимизации рисков, которые должны быть реализованы в первую очередь. Такой последовательный подход в решении проблемы управления рисками является, по нашему мнению, наиболее качественным и эффективным, поскольку, с одной стороны, акцент при выборе управления делается на риск с наибольшим абсолютным значением, а с другой, появляется возможность оптимизировать всю систему рисков. Это позволит страховщикам корректировать стратегии управления рисками таким образом, чтобы достигнуть наилучшего финансового результата в смысле наиболее оптимального сочетания показателей риска и доходности в частности и повышения уровня финансовой устойчивости в целом, что, безусловно, крайне важно в любом бизнесе, в особенности – в страховом.

## Литература

*Слепухина Ю.Э.* Инвестиционный портфель страховой организации: финансовый механизм формирования и управления. Екатеринбург: Изд-во АМБ, 2010.

*Слепухина Ю.Э.* Финансовые механизмы управления рисками в страховом бизнесе // Управление в страховой компании. 2009. № 1.

*Слепухина Ю.Э.* Финансовая устойчивость страховых организаций: теория, модели и методы управления рисками. Екатеринбург: Изд-во Уральского государственного экономического университета, 2006.

*Amram M., Kulatilaka N.* Real Options: Managing Strategic Investment in an Uncertain World. Boston, MA: Harvard Business School Press, 2008.

*Bierman H., Smidt S.* The Capital Budgeting Decision: Economic Analysis of Investment Projects. Upper Saddle River, NJ: Prentice Hall, 1993.

Environmental Risk Management and Insurance at Chevron Corporation. HBS case № 9-799-062, April 1999.

*Brennan M.J., Schwartz E.S.* Evaluating Natural Resource Investments // Journal of Business. 1985. 58 (2). P. 135–157.

*Brennan M.J., Trigeorgis L.* (eds.) Project Flexibility, Agency, and Competition: New Developments and Applications of Real Options. N.Y.: Oxford University Press, 2000.

*Broyles J.* Financial Management and Real Options. Chichester: John Wiley and Sons, 2003.

*Dixit A.K., Pindyck R.S.* The Options Approach to Capital Investment // Harvard Business Review. 1995. 73 (3). P. 105–115.

*Merkhofer M.* Decision Science and Social Risk Management: A Comparative Evaluation of Cost-benefit Analysis, Decision Analysis, and Other Formal Decision-aiding Approaches. Dordrecht: Reidel, 1987. P. 2.

# PARADISE POSTPONED? VENTURE CAPITAL EMERGENCE IN A TRANSITION ECONOMY

---

How does venture capital (VC) emerge in emerging and developing economies? This case study of an early Russian VC fund is used to extend a previous model exploring that question. VC emerges in a process consisting of four stages: enabling, coproducing, diffusing, and replicating. The Russian case shows that these stages are linked in a circular process, i.e. replicating can lead to enabling. VC emergence can also begin at any stage. A higher degree of public-private coproduction may outweigh the absence of a completed enabling stage, suggesting that strength in one stage can compensate for weakness in others.

## Principal topic

Understanding the venture capital (VC) emergence process has been of rapidly growing interest to scholars and practitioners. Many VC industries – particularly in developing and emerging economies – remain in a nascent state, and those industries that have emerged often contain organizational forms that vary significantly from those found in developed economies. Data from developed economies suggest that diffusion [Manigart, 1994], the efficient operation of the VC cycle [Gompers, Lerner, 1999], and enabling conditions [Gilson, 2003] are antecedents of active VC industries. More recent studies from emerging and developing economies argue that institutional factors [Bruton, Ahlstrom, Puky, 2009] and public-private coproduction [Lingelbach, Gilbert, Murray, 2008] may also shape the VC emergence process.

However, we still lack a general model of the VC emergence process based on a global dataset. Current attempts at such a model have incorporated data from Africa [Lingelbach et al., 2009], Latin America and Asia [Bruton et al., 2009], but have not yet considered VC emergence in transition economies – those in the process of transforming themselves from socialism to capitalism [Roland, 2000]. As VC emerged in Central and Eastern European economies, it has displayed both differen-



ces [Karsai et al., 1997, 1998; Farag et al., 2004; Klonowski, 2006] and similarities [Klonowski, 2005] with VC practice in developed economies. In one transition economy – Poland – the VC investment process varies from that in developed economies in the origination stage – where VCs source potential deals through the privatization process and by pro-active solicitation – and in the screening stage – where firm-specific screens are limited to investment size [Bliss, 1999]. Another study from Poland argued that VC emergence occurred in three stages – development, expansion, and correction [Klonowski, 2005].

Entrepreneurship in transition economies is constrained by access to finance [Pissarides, 1999], which leads to financing strategies such as serial entrepreneurship, business activity diversification [Smallbone, Welter, 2001], and external finance based on social networks [Batjargal, 2003]. Consequently, VC emergence has been shaped in part by networks of trust between VCs, intermediaries, and entrepreneurs [Batjargal, 2007a, 2007b]. The VC opportunity set in transition economies is also influenced by enabling conditions, such as the stock of opportunity-oriented entrepreneurs and the institutional environment. A rapid shift from socialism to market economies [Svejnar, 2002], high degrees of industrialization [Meyer, Peng, 2005], and the socialist legacy have produced lower levels of entrepreneurial development in transition economies than in other emerging economies at comparable income levels [Aidis, Estrin, Mickiewicz, 2008]. In these institutional settings entrepreneurs rely on ties to the state and, due to low initial domestic savings, cross-border investment in new ventures.

Despite our increasing knowledge about VC's antecedents in transition economies, process studies of VC emergence in this context remain few in number and are focused mainly at the fund level. In particular, we still know relatively little about VC emergence in one of the largest and most enigmatic transition economies – Russia. Unique financing strategies are suggested by the strategic experimentation of early post-communist Russian entrepreneurs, including partnerships with Western firms [McCarthy, Puffer, Naumov, 1997] and restructuring of privatized enterprises [Wright et al., 1998]. Despite unpromising institutional conditions, finance for Russian entrepreneurs is surprisingly robust, reflecting trade credit reliance [Cook, 1999] and a relatively healthy balance between informal investment availability and startup costs [Bosma, Levie, 2010]. An active Russian VC industry has existed since the mid 1990s.

The purpose of this paper is to build theory by extending an earlier model of VC emergence with Russian data. Specifically, I ask: how, if at all, does the VC emergence process in Russia differ from that in other transition, developing, and

emerging economies? I extend an earlier model of VC emergence [Lingelbach et al., 2009] and show that the emergence process is circular, consisting of four sub-processes in the following order: enabling, coproducing, diffusing, and replicating. VC emergence can commence with any one of these sub-processes. The Russian case demonstrates that emergence can begin with diffusion, without establishing enabling conditions. The resultant model provides a more complete account of VC emergence and suggests four possible entry points for institutional entrepreneurs wishing to establish a national VC industry.

## Method

I develop an exploratory case study consisting of both qualitative and quantitative data from the Russian VC industry, including previously unpublished archival data of an early and now closed fund (hereafter «Mercury»). This case is then compared with an earlier model of VC emergence developed from comparative case analysis using South African and Botswana data. The Russian case is believed to be particularly illuminating, because its transition status, French legal origin, and low rule of law and property rights scores can be contrasted with those of South Africa and Botswana. The Russian case is also unusually revelatory, due to the unique research access to previous unpublished fund-level data from a pioneering Russian VC fund. These data consist of financial statements, investment memoranda, and various internal and external communications. Taken together, they provide a complete written record of Mercury during the first three years of its operation. Additional secondary data sources include industry association and foreign donor evaluation reports.

The Russian case is then compared at both the country and fund levels with an earlier model of VC emergence [Lingelbach et al., 2009], from which an extended model of VC emergence is developed. The following table highlights the differences between the three cases on which the resultant model is based, demonstrating the broad range of institutional conditions on which the extended model is based:

Mercury was based in a large regional city, and foreign sources provided its initial round of capital. It was established in the early 1990s and raised a second round of financing – also from foreign sources – in the mid 1990s. Mercury was managed by both foreign and Russian staff and maintained friendly relations with the local government.

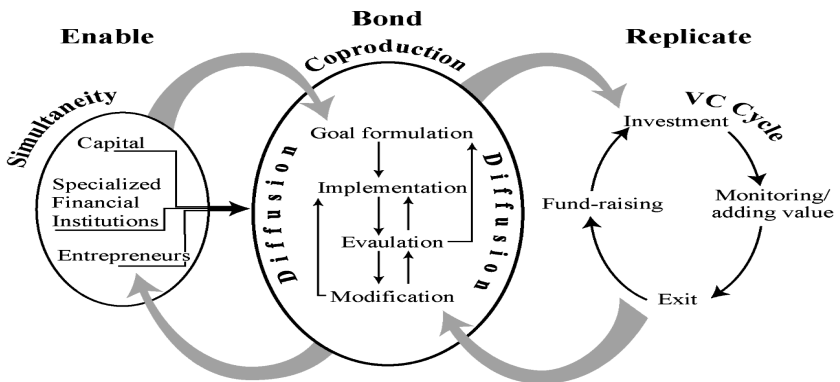
**Table 1.**

The Russia, South Africa, and Botswana cases compared

	Russia	South Africa	Botswana
Legal origin	French	English	English
GNI/capita (date of first VC activity and 2009), current USD	2900 (1993), 9340	3150 (1999), 5760	3220 (1997), 6260
Establishment date of national VC association	1997	1999	None established to date
Total entrepreneurial activity as % of labor force [Kelley, Bosma, Amoros, 2011]	3,9	8,9	NA
Rule of law score [Kauffmann, Kraay, Mastruzzi, 2006]	-0,89	0,17	0,65
Property rights score [Heritage Foundation, 2011]	40	50	70

## Results

An earlier model of VC emergence [Lingelbach et al., 2009] identified four stages in the emergence process: enabling, coproducing, diffusing, and replicating:



**Fig. 1.** The VC emergence process observed in Southern Africa

While Russia has been unable to establish and sustain the enabling process, the coproducing, diffusing, and replicating processes associated with VC emergence have been established to varying degrees. Low levels of opportunity-oriented entrepreneurship [Verkhovskaia, Dorokhina, 2010] limit the deal flow available to Russian VCs.

Russia’s VC industry began to operate in 1994, when foreign donors established funds both in Moscow and the regions. Foreign investment (primarily donor) represented 97% of limited partner capital during the period 1994–1997. The capital of these funds grew rapidly, but the level of investment for many of these funds was low from 1994 to 1997. For example, EBRD-related funds had invested \$33 million in 22 firms by mid-1997 [EBRD, 2006], while the Russian-American Enterprise Fund invested \$98 million in 28 firms as of September 30, 1998 [GAO, 1999]. Most donor-financed investments were private equity, rather than VC. The evolution of the industry can be seen in the following table:

**Table 2.** The Evolution of the Russian VC/PE industry, 1994–1996

	1994	1995	1996
Number of funds	11	19	27
Total capital under management (\$ billions)	1,1	1,4	2,1

Source: RVCA, 2004.

Subsequent net IRRs for those funds established by the EBRD (focusing on medium-sized firms) averaged 5% [EBRD, 2006].

Mercury diffused a «classic model» of VC investing into Russia and then began developing relationships with government organizations. After it failed to establish a productive working relationship with the national government, Mercury turned to the local government. In exchange for the establishment of a jointly managed charitable trust funded by Mercury, the local government agreed to relieve Mercury from any pressure by governmental or other actors. By recognizing that each actor brought complementary resources to their relationship, the local government and fund coproduced one of the first VC funds in post-communist Russia.

Mercury’s ability to raise a second round of capital in 1996 was one significant signal to other VC funds in Russia that this type of investing was at least plausible. Mercury’s first group of four investments was disbursed in early 1995 and involved newly private firms in a variety of low-tech industries. Most encountered serious problems soon after initial disbursements. Despite these difficulties, Mercury’s mana-

gers were able to develop a second set of investments – also mainly in low-tech industries – which were important to the investor which provided the second round of capital. Fig. 2 summarizes Mercury’s early history:

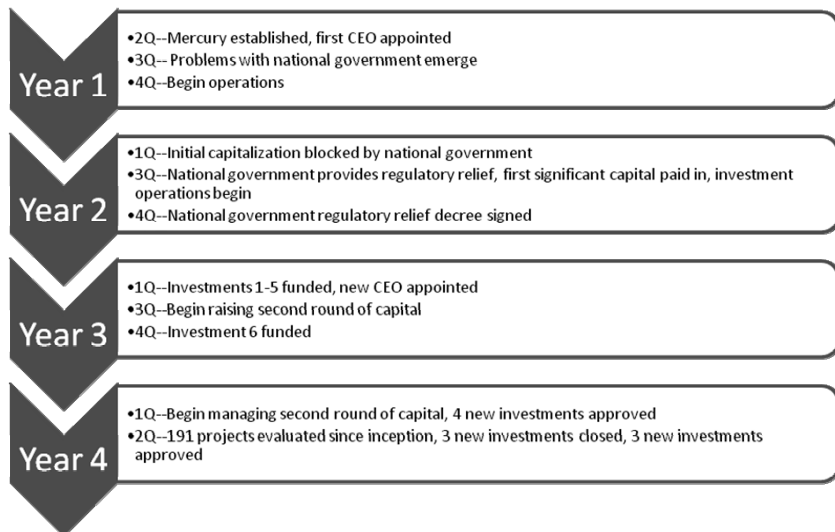


Fig. 2. Mercury chronology

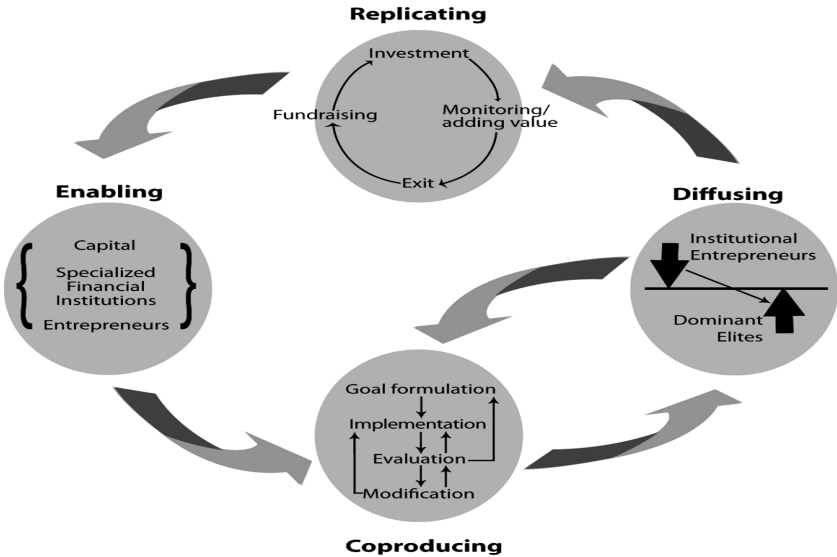
## Conclusions and implications

I extend an earlier model of VC emergence in WIEs. That model (Fig. 1) identified an emergence process consisting of four distinct and sequential sub-processes: enabling, diffusing, coproducing, and replicating [Lingelbach et al., 2009]. Based on data from the early period of Russian VC, a more complete model of VC emergence was developed.

In this model the sequential process depicted in Fig. 1 has been replaced by a cyclical one in which the same processes operate. This model accommodates and explains Russian VC data, in which the diffusing, coproducing, and replicating processes have operated *before* the enabling process. To date the Russian enabling process remains incomplete, largely due to an inability to generate sufficient stocks of opportunity-oriented entrepreneurs of the type required to meet VC’s requirements for near-term returns [Rumelt, 1987]. This model also indicates that the diffusing and coproducing processes influence one another.

The Russian data provide some clues that help explain why the model in Fig. 3 provides a better account of VC emergence. First, the coproducing process in Rus-

sia was more significant than that observed in earlier studies. Stronger public-private cooperation in VC emergence offset weaker enabling conditions in Russia, suggesting that stronger processes can offset weaker ones in VC emergence. Second, unlike in other studies of VC emergence in transition economies [Bliss, 1999], privatization was not a significant source of potential deals in the replicating subprocess.



**Fig. 3.** Venture capital emergence model

These findings suggest a rich future research agenda:

- Russia’s status as a transition economy is different than that of institutional contexts studied before, and its state-managed capitalism may reflect underlying differences in institutional factors [Puffer, McCarthy, 2007].
- Variance exists between transition, developing and emerging economies in the relative robustness of VC emergence sub-processes, and that the institutional change inherent in transition economies complicates and may slow the VC emergence process.
- The rapid establishment of the coproduction subprocess in Russia led to rapid replication of VC activity, leading to an active VC industry within four years of the first fund’s establishment and despite any successful exits. To the extent that investors are prepared to provide new capital to a VC industry without a significant track record of success – as has been the case in Russia – the Russian experience

suggests that VC can exist independent of a vibrant opportunity-oriented entrepreneurial sector. Investors in such a VC industry are likely to have more complex strategic objectives than simply maximizing risk-adjusted returns. As Russia embarks on another attempt to develop an internationally competitive high technology sector, these objectives may become more transparent. The possibility that Russia may develop large numbers of growth-oriented entrepreneurs *after* developing an active VC industry cannot be ruled out.

- The VC emergence model in Fig. 3 suggests four possible entry points for emergence. Emergence that commences with the enabling process represents a free market approach, while that commencing with coproducing represents a «government matters» perspective. Emergence that begins with diffusing characterizes a «top down» viewpoint, while that starting with replicating symbolizes a «supply creates demand». Taken together, these four entry points and the VC emergence model provide a richer description of historical experience in how VC emerges.

## References

- Batjargal B.* Social Capital and Entrepreneurial Performance in Russia: A Longitudinal Study // *Organization Studies* 2003. 24(4). P. 535–556.
- Batjargal B.* Comparative Social Capital: Networks of Entrepreneurs and Venture Capitalists in China and Russia // *Management and Organization Review*. 2007a. 3(3). P. 397–419.
- Batjargal B.* Network Triads: Transitivity, Referral and Venture Capital Decisions in China and Russia // *Journal of International Business Studies*. 2007b. 38. P. 998–1012.
- Bliss R.T.* A Venture Capital Model for Transitioning Economies: The Case of Poland // *Venture Capital*. 1999. 1(3). P. 241–257.
- Bosma N., Levie J.* Global Entrepreneurship Monitor: 2009 Global Report. Babson Park, MA and London, UK: Babson College and London Business School, 2010.
- Bruton G.D., Ahlstrom D., Puky T.* Institutional Differences and the Development of Entrepreneurial Ventures: A Comparison of the Venture Capital Industries in Latin America and Asia // *Journal of International Business Studies*. 2009. 40. P. 762–778.
- Cook L.D.* Trade Credit and Bank Finance: Financing Small Firms in Russia // *Journal of Business Venturing*. 1999. 14(5/6). P. 493–518.
- European Bank for Reconstruction and Development. 2006. Special Study: Regional Venture Funds Program – Russian Federation. ([www.ebrd.org](http://www.ebrd.org) on May 3, 2011).
- Farag H., Hommel U., Witt P., Wright M.* Contracting, Monitoring, and Exiting Venture Investments in Transitioning Economies: A Comparative Analysis of Eastern European and German Markets // *Venture Capital*. 2004. 6(4). P. 257–282.
- Gilson R.* Engineering a Venture Capital Market: Lessons from the American Experience // *Stanford Law Review*. 2003. 55. P. 1067–1103.
- Gompers P., Lerner J.* *The Venture Capital Cycle*. Cambridge, MA: MIT Press, 1999.
- Heritage Foundation. 2011 Index of Economic Freedom. ([www.heritage.org](http://www.heritage.org) on February 25<sup>th</sup>, 2011).

*Karsai J.* «The End of the Golden Age»: The Developments of the Venture Capital and Private Equity Industry in Central and Eastern Europe: Discussion Paper 2009/1. Budapest, Hungary: Institute of Economics, Hungarian Academy of Sciences, 2009.

*Karsai J., Wright M., Dudzinski Z. et al.* Screening and Valuing Venture Capital Investments: Evidence from Hungary, Poland and Slovakia // *Entrepreneurship and Regional Development*. 1998. 10(3). P. 203–224.

*Karsai J., Wright M., Filatotchev I.* Venture Capital in Transition Economies: The Case of Hungary // *Entrepreneurship Theory and Practice*. 1997. 21(4). P. 93–110.

*Kauffmann D., Kraay A., Mastruzzi M.* Governance Matters V: Aggregate and Individual Governance Indicators for 1996–2005: Working Paper. Washington DC: World Bank, 2006.

*Kelley D.J., Bosma N., Amoros J.E.* Global Entrepreneurship Monitor: 2010 Global Report. Babson Park, MA and Santiago, Chile: Babson College and Universidad del Desarrollo, 2011.

*Klonowski D.* The Evolution of the Venture Capital Industry in Transition Economies: The Case of Poland // *Post-Communist Economies*. 2005. 17(3). P. 331–348.

*Klonowski D.* Local Laws and Venture Capital Contracting in Transition Economies: Evidence from Poland // *Post-Communist Economies*. 2006. 18(3). P. 327–343.

*Lingelbach D.C., Gilbert E., Murray G.C.* The Rise and Fall of South African Venture Capital. Paper presented at the International Council for Small Business annual conference, Halifax, Canada, 2008.

*Lingelbach D.C., Gilbert E., Murray G.C.* Toward a Process Model of Venture Capital Emergence: The Role of Diffusion. Paper presented at annual meeting of Academy of Management: Chicago, IL, 2009.

*Manigart S.* The Founding Rate of Venture Capital Firms in Three European Countries (1970–1994) // *Journal of Business Venturing*. 1994. 9. P. 525–541.

*McCarthy D., Puffer S., Naumov A.* Partnering with Russia's New Entrepreneurs: Software Tsarina Olga Kirova // *European Management Journal*. 1997. 15(6). P. 648–657.

*Meyer K.E., Peng M.W.* Probing Theoretically into Central and Eastern Europe: Transactions, Resources, and Institutions // *Journal of International Business Studies*. 2005. 36. P. 600–621.

*Pissarides F.* Is Lack of Funds the Main Obstacle to Growth? EBRD's Experience with Small- and Medium-sized Business in Central and Eastern Europe // *Journal of Business Venturing*. 1999. 14(5/6). P. 519–539.

*Puffer S.M., McCarthy D.J.* Can Russia's State-managed, Network Capitalism Be Competitive? Institutional Pull Versus Institutional Push // *Journal of World Business*. 2007. 42. P. 1–13.

*Rumelt R.P.* Theory, Strategy, and Entrepreneurship // *The Competitive Challenge* / D. Teece (ed.) Cambridge, MA: Ballinger, 1987. P. 137–158.

Russian Venture Capital Association. *Obzor rynka pryamykh i venchurnykh investitsiy v Rossii (1994–2004)*. Saint Petersburg: RVCA, 2004.

*Smallbone D., Welter F.* The Distinctiveness of Entrepreneurship in Transition Economies // *Small Business Economics*. 2001. 16(4). P. 249–262.

*Svenjnar J.* Transition Economies: Performance and Challenges // *Journal of Economic Perspectives*. 2002. 16(1). P. 3–28.

United States General Accounting Office. *Enterprise Funds' Contributions to Private Sector Development Vary*. Washington, DC: GAO, 1999.

*Verkhovskaya O., Dorokhina M.* Global Entrepreneurship Monitor: Russia 2009. St. Petersburg: Graduate School of Management. St. Petersburg State University, 2010.

*Wright M., Hoskisson R.E., Filatotchev I. et al.* Revitalizing Privatized Russian Enterprises // *Academy of Management Executive*. 1998. 12(2). P. 74–85.



Н.И. Берзон,  
В.В. Мезенцев  
Национальный  
исследовательский  
университет «Высшая  
школа экономики»

# ПРИМЕНЕНИЕ СТРУКТУРНЫХ И РЕДУЦИРОВАННЫХ МОДЕЛЕЙ ДЛЯ ОЦЕНКИ КРЕДИТНЫХ ДЕФОЛТНЫХ СВОПОВ НА РОССИЙСКИЕ КОМПАНИИ

---

## Введение

Существует множество способов оценить кредитный риск компании, например, с помощью кредитных рейтингов общепризнанных рейтинговых агентств, либо с помощью внутренних систем ранжирования компаний по кредитному риску. Поскольку кредитный риск в широком смысле является вероятностью дефолта компании, то используя различные модели, такие как модель Альтмана, можно измерить кредитный риск в абсолютных величинах.

Но последний мировой финансовый кризис 2008–2009 гг. показал, что современные условия существования финансового рынка требуют других подходов и способов оценки кредитных рисков. Например, в сентябре 2009 г. Moody's понизило «Lehman Brothers Holdings Inc.» и его дочерние компании сразу на 10 пунктов – с A2 до B3, а вслед за Moody's Fitch понизил долгосрочный рейтинг дефолта эмитента с A+ до D. Значит, в какой-то момент рейтинг явно не отражал реального положения дел в компании, ее повышенных рисков.

На финансовом рынке существуют инструменты, которые отражают рыночную оценку кредитного риска какой-либо долговой ценной бумаги, корпоративной или государственной, или целого портфеля бумаг практически в режиме реального времени, – это кредитные дефолтные свопы (Credit Default Swap – CDS).

Существенный плюс CDS в том, что их одновременно и непрерывно оценивают сотни участников рынка, которые берут во внимание не только отчетность компании, ее кредитные рейтинги, какие-то другие фундаментальные оценки, но и всю вновь поступающую информацию. Это значительно увеличивает гибкость в оценке кредитного риска относительно использования

рейтингов или отчетности, поскольку последние обновляются, как правило, ежеквартально.

В отличие от облигаций, которые являются все же долговым инструментом, CDS в чистом виде являются рыночным инструментом оценки кредитного риска.

## Кредитный дефолтный своп

Кредитный дефолтный своп – это договор между двумя контрагентами, финансовыми институтами, по которому одна сторона выплачивает другой определенную сумму при наступлении кредитного события у третьей стороны или у определенного набора финансовых активов – базового портфеля. Кредитным событием может служить дефолт компании или государства, резкое снижение ее котировок, невыплата или задержка купона или номинала по облигациям, изменение кредитного рейтинга, реструктуризация задолженности. Таким образом, CDS по своей сути – страховка от потерь по финансовому инструменту.

Схема выпуска CDS представлена на рис. 1.

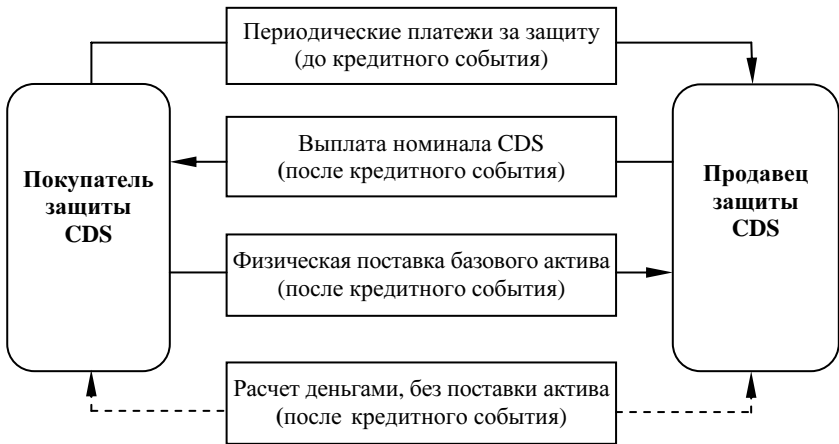


Рис. 1. Схема выпуска кредитного дефолтного свопа

В случае дефолта базового актива, на который выписан CDS, расчет может производиться физической поставкой базового актива покупателем защиты в обмен на номинал CDS либо денежным расчетом, когда продавец защиты выплачивает покупателю разницу между номиналом CDS и ликвидационной стоимостью базового актива (покрытием).

## Глобальный рынок CDS

Кредитные деривативы (или синтетическая секьюритизация) возникли в начале 1990-х годов. Изначально это были отелльные неизвестные широкой публике сделки, в которых одна сторона принимала на себя риски долгового портфеля другой в обмен на вознаграждение. Затем такие договоры стали полноценными финансовыми инструментами, а синтетическая секьюритизация – сегментом финансового рынка.

Бурный рост рынка CDS произошел прежде всего благодаря инвестиционным банкам, которые использовали данные инструменты в своей риск-стратегии. Первое время CDS действительно покупались для страховки базового актива от кредитного риска, а уже потом стали инструментом спекуляции – игрой на колебании кредитного спреда и спреда CDS. Именно спекуляции «раздули» рынок CDS, ведь спекулянты приобретали CDS на долг компании или государства на триллионы долларов, при совокупном долге самой компании или государства только в десятки или сотни миллиардов долларов.

Приведем динамику объема рынка CDS.

**Таблица 1.** Объем рынка CDS в 1997–2009 гг., трлн долл.

Год	BBA	ISDA
1997	0,18	–
1998	0,35	–
1999	0,586	–
2000	0,893	–
2001	1,189	0,918
2002	1,6	2,19
2003	2,69	3,78
2004	5,44	8,42
2005	12,43	17,1
2006	26	34,4
2007	45,46	62,2
2008	54,6	38,6
2009	31,2	30,4

## Рынок CDS на российские компании

Поскольку рынок кредитных свопов внебиржевой, и CDS – это отдельные сделки-контракты, а не целые эмиссии, как, например, у еврооблигаций, достаточно сложно определить объем рынка, его обороты, так как далеко не все маркетмейкеры предоставляют информацию по сделкам в открытый доступ.

Но очевидно, что рынок CDS на российские долговые инструменты и кредитный риск компаний существуют. Индикативные котировки можно найти в информационных системах, например Bloomberg, либо на различных сайтах по долговым инструментам – они строятся как усредненные индикативы нескольких игроков. Твердые котировки участники выставляют исключительно по запросу клиента, но на ликвидные инструменты спреда достаточно узкие, поэтому индикативы несущественно отличаются от цен реальных сделок.

Особенность рынка CDS на российские компании в том, что CDS есть только на те компании, еврооблигации которых обращаются на рынке. Этому можно найти несколько объяснений, но главное, на наш взгляд, в том, что рынок CDS представлен исключительно западными игроками, российские участники представлены на бутиковом уровне. CDS котируются в долларах или евро, поэтому интересны для хеджирования исключительно валютного долга, так как долги в рублях будут нести дополнительный валютный риск для западных участников. Кроме того, еврооблигации выпускаются на основе английского права, организаторами (*lead-manager*) являются исключительно известные и уважаемые финансовые институты, которые проводят тщательный анализ эмитента, а отчетность аудировается компаниями Big4. Таким образом, у западных игроков появляется определенная база для анализа кредитного качества эмитента и его долга.

В данный момент в обращении находится еврооблигации порядка 70 российских эмитентов, но CDS существуют только на 7–10 компаний, при этом относительно ликвидными являются только трех- или пятилетние CDS на Газпром, Сбербанк и ВТБ. Дефолтные свопы на такие компании, как Лукойл, Северсталь, Транснефть, Вымпелком, РЖД, ТНК-ВР, ТМК, Евраз или МТС, обладают гораздо меньшей ликвидностью, и сделки по некоторым из них иногда могут не проводиться месяцами. Перечисленный список компаний практически исчерпывающий, хотя CDS – инструмент внебиржевой, поэтому инвестбанк теоретически может оформить сделку и прокотировать CDS на любую компанию.

## Методы оценки дефолтного свопа

Существует ряд моделей и способов оценки кредитного дефолтного свопа.

1. Оценка CDS на основе стоимости хеджирования.
2. Модели оценки CDS, основанные на интенсивности дефолтов, или редуцированные модели.
3. Модели оценки кредитных инструментов на основе кредитного рейтинга.
4. Структурные модели оценки CDS или модели, основанные на стоимости фирмы.

Первые три способа не используют фундаментальные показатели компании, а лишь стоимость/доходность уже обращающихся инструментов, например, облигаций. Либо используют кредитный рейтинг, которым сам по своей сути оценочный показатель. То есть полученный с их помощью результат является производным от оценок других инструментов.

Структурные же модели в своей основе используют фундаментальные показатели компании: долговую нагрузку и волатильность акций компании, а также такой макроэкономический показатель, как безрисковая ставка. Таким образом, результаты, полученные с использованием структурных моделей, являются более обоснованными с точки зрения финансового положения самой компании, поскольку показатель долговой нагрузки и волатильность акций – показатели риска компании.

В рамках данной статьи мы рассмотрим редуцированные модели, использующие оценку интенсивности наступления дефолта, и структурные модели, увязывающие кредитные риски компании (стоимость CDS) и факторы риска компании (долговую нагрузку и волатильность).

## Редуцированные модели оценки CSD

Между ценой рискованной дисконтной облигации и вероятностью дефолта существует фундаментальная зависимость: стоимость дисконтной рискованной облигации равна стоимости аналогичной безрисковой, умноженной на вероятность дефолта. Данная зависимость была отражена в ряде работ западных авторов в конце 1990-х, например, Даса (Das), Мэтью и д'Херувилла (Mathieu, d'Heugouville) и Даффи (Duffie).

Суть данных моделей в том, что «справедливую» цену инструмента можно получить при равенстве ожидаемых потоков для продавца и покупателя

этого инструмента. Поскольку с помощью цен дисконтной рискованной и безрискованной облигации можно определить вероятность дефолта базового актива, то можно оценить вероятный денежный поток покупателя и продавца защиты. Единственный оценочный параметр в данном методе – коэффициент покрытия – часть номинала облигации, которую получает ее держатель при дефолте эмитента.

Все полученные стоимости потоков должны быть приведены к одному моменту времени с помощью безрискованной ставки. При этом должна быть учтена вероятность совершения платежа, или фактически вероятность дефолта в каждом отдельном периоде.

Оценка вероятности дефолта предполагает то, что спред между облигациями обусловлен только кредитным риском. Таким образом, временная структура спреда рискованной облигации относительно безрискованной является временной структурой вероятностей дефолта рискованной облигации.

Данный класс моделей использует два основных фактора, определяющих стоимость актива, в нашем случае CDS. Первый фактор – это интенсивность наступления дефолтов или кредитных событий  $\lambda$ , второй – процентная ставка  $r$ . Интенсивность наступления дефолта есть вероятность дефолта в единицу времени.

Также в редуцированных моделях оценки интенсивность и процентные ставки рассматриваются как стохастические величины. Иначе говоря, стоимость рискованной облигации выражается в виде

$$\bar{B}(0, T) = E \left[ e^{-\int_0^T r(s) + \lambda(s) ds} \right].$$

То есть как математическое ожидание функции процентной ставки  $r(s)$  и интенсивности дефолта  $\lambda(s)$  на сроке существования облигации, где и процентная ставка, и интенсивность дефолта – функции стохастические.

Данные модели должны быть откалиброваны под рыночные цены, т.е. отражать реальную ситуацию на рынке, чтобы полученные в результате оценки данные имели практическую значимость.

## **Структурные модели. Суть подхода Мертона**

В 1973 г. Блэк и Шоулз (Black & Scholes), а затем и Мертон (Merton) в 1974 г. предложили простую модель, которая обеспечивает связь кредитного

риска со структурой капитала фирмы. Изначально модель Блэка – Шоулза использовалась для оценки опционов, но именно Роберт Мертон впервые применил теорию опционов к проблеме оценки обязательств фирмы при наличии дефолта. Данная модель может применяться для оценки любых существующих на данный момент видов кредитных деривативов, в частности CDS.

Из корпоративных финансов известно следующее соотношение:

*Стоимость активов = Стоимость акционерного капитала + Стоимость долга.*

Также известно, что держатели долговых инструментов имеют первоочередное право на получение инвестированных в компанию средств, а только потом свои средства получают акционеры.

Таким образом, акционерный капитал – остаточная стоимость фирмы, т.е. то, что остается после выплаты долговых обязательств. Из этого следует, что оценка акционерного капитала может быть отрицательной величиной, если стоимость активов меньше долговых обязательств. В случае если существует акционерный капитал с отрицательной стоимостью, то акционеры могут избавиться от него без каких-либо издержек для себя.

Иначе говоря, держатели акций не реализуют опцион колл и оставляют фирму кредиторам. Так как стоимость активов меньше, чем величина долговых обязательств, требования кредиторов не будут полностью удовлетворены, означая дефолт для компании. Если стоимость фирмы превышает стоимость долга, то акционеры ее как бы выкупают у кредиторов за стоимость долга, в противном случае они оставляют фирму кредиторам и сделки «выкупа» фирмы не происходит, т.е. опцион колл не реализуется.

Следовательно, рисковый долг можно представить следующим соотношением:

*Рисковий долговой инструмент компании = Стоимость фирмы +  
+ Короткий опцион колл на акционерный капитал компании.*

Таким образом, оценка рискового долгового инструмента сводится к оценке опциона колл, а покупка защиты от дефолта сводится к покупке опциона пут, для оценки которого используется модель Мертона.

## **Детерминанты модели**

Прежде чем приступить к оценке CDS по модели Мертона, следует статистически проверить значимость детерминант модели. Поскольку если сами детерминанты статистически незначимы, т.е. не определяют кредитного спре-

да, то они не могут служить в качестве исходных параметров для оценки дефолтного свопа.

Проверка значимости детерминант производится на разных этапах – в «докризисный период» (январь 2006 г. – май 2008 г.) и «посткризисный период» (май 2009 г. – декабрь 2010 г.). Период острой фазы кризиса был убран из расчета, поскольку спреды были больше обусловлены паникой участников, общим взглядом на риски развивающихся рынков и дефолтных свопов, контрагентскими рисками, а не фундаментальными характеристиками компаний.

Данные по CDS включают в себя еженедельные котировки. Выбор значений пятилетнего CDS объясняется его наибольшей ликвидностью среди других CDS на российские компании. Проверка детерминант была проведена по каждой из шести компаний, CDS на которые мы оценим с помощью модели Мертона: Газпром, Сбербанк, ВТБ, Лукойл, Северсталь, Транснефть и МТС. Были построены регрессионные модели, сделана проверка на стационарность рядов с помощью теста Дикки – Фуллера (Dickey – Fuller), те ряды, которые были нестационарны, были преобразованы с помощью метода первых разностей. Также независимые переменные регрессии были проверены на мультиколлинеарность – коэффициенты корреляции оказались небольшими. Значения *p-value* и коэффициента детерминации  $R^2$  показали высокую значимость детерминант модели.

Результаты проверки значимости детерминант модели приведены в табл. 2.

**Таблица 2.** Детерминанты модели Мертона

Тестируемый фактор	Гипотеза	Результат эмпирической проверки	
		«докризисная» модель	«посткризисная» модель
Debt to Value Ratio	Модель Мертона подразумевает, что дефолт происходит в случае, если стоимость фирмы падает ниже стоимости ее долга. Следовательно, чем больше debt to value ratio, тем больше вероятность дефолта	Гипотеза подтвердилась	Гипотеза подтвердилась
Волатильность акций компании	Основываясь на теории опционов, цена опциона должна возрастать с ростом волатильности базового актива. Возросшая волатильность увеличивает вероятность дефолта, что в свою очередь увеличивает стоимость страховки от дефолта	Гипотеза подтвердилась	Гипотеза подтвердилась
Безрисковая ставка	Более высокая ставка ведет к большему ожидаемому темпу роста фирмы, что снизит вероятность дефолта и уменьшит кредитный спред	Гипотеза подтвердилась	Гипотеза подтвердилась



Таким образом, можно было использовать данные детерминанты для подсчета CDS с помощью структурной модели Мертона.

## **Результаты использования модели Мертона для расчета CDS на российские компании**

Поскольку детали построения модели и особенности расчета спреда весьма объемны, в данной статье мы приведем только общие выводы по результатам расчетов.

Кроме того, приведем сравнительную таблицу численных значений теоретического спреда CDS на Газпром и рыночных данных, а также коэффициенты корреляции между теоретическими спредами CDS на другие компании и их реальными значениями (табл. 3 и 4).

**Таблица 3.**

**Динамика спредов CDS**

Дата	Цена 5-летнего CDS	Merton (Газпром)
31.08.2009	370,434	297,955
30.09.2009	287,795	230,8709
30.10.2009	256,521	222,737
30.11.2009	281,433	248,0287
31.12.2009	257,228	219,8091
29.01.2010	268,081	229,7791
26.02.2010	253,257	242,5574
31.03.2010	206,779	181,6695
30.04.2010	204,007	171,1674
28.05.2010	278,842	197,1439
30.06.2010	288,844	184,1433
30.07.2010	245,318	209,4549

В целом, спреды CDS по семи компаниям оказались ниже реальных котировок. Стоит отметить, что присутствует сильная корреляционная зависимость между теоретическим спредом (модель Мертона) и реальными. Самый низкий из коэффициентов корреляции равен 62%. Это очень хороший результат для классической модели Мертона, которая не учитывает дивидендов, купонных выплат по долгу, а также структура заемного капитала представляется достаточно простой. Несмотря на эти ограничения, модель вполне может использоваться для оценки стоимости CDS.

**Таблица 4.**

Коэффициенты корреляции между теоретическими значениями и рыночными спредами

Компания	$\rho$
Газпром	0,78
Сбербанк	0,68
ВТБ	0,72
Лукойл	0,62
Северсталь	0,76
Транснефть	0,79
МТС	0,75

Кроме того, можно ввести поправочный коэффициент, который бы сдвигал котировки спреда выше по отношению к реальным данным, и таким образом рассчитывать справедливый спред по CDS и применять его в торговых стратегиях.

В заключение можно сказать, что модели оценки CDS, используемые для западных компаний, вполне применимы и для расчета стоимости CDS на российские компании.

## Литература

- Бэр Х.П.* Секьюритизация активов: секьюритизация финансовых активов – инновационная техника финансирования банков. Волтерс Клувер, 2007.
- Вриз Р.Ж.Ж., Анру П.* Секьюритизация и право. Волтерс Клувер, 2007.
- Altman E., Brady B., Resti A. et al.* The Link between Default and Recovery Rates: Theory, Empirical Evidence and Implication: Working Paper. 2003.
- Black F., Scholes M.* The Pricing of Options and Corporate Liabilities // Journal of Political Economy. 1973. P. 637–654.
- Bringo D., Mercurio F.* Interest Rate Models: Theory and Practice. Springer Finance, 2001.
- Cox J., Ross S., Rubinstein M.* Option Pricing: A Simplified Approach // Journal of Financial Economics. 1979. 7. P. 229–263.
- Das S.* (ed.) Credit Derivatives and Credit Linked Notes. 2<sup>nd</sup> ed. John Wiley & Sons, 2000.
- Hull J.C., White A.* Valuing Credit Default Swaps I: No Counterparty Default Risk // Journal of Derivatives. 2000. 8. P. 29–40.
- Merton R.* On the Pricing of Corporate Debt: The Risk Structure of Interest Rates // Journal of Finance. 1974. 29. P. 449–470.
- Schonbucher P.J.* A Libor Market Model with Default Risk. Bonn University, Working Paper. 2000.
- Vasicek O.A., Gong G.* Term Structure Modeling Using Exponential Splines // Journal of Finance. 1982.
- Zhou C.* An Analysis of Default Correlation and Multiple Defaults // Review of Financial Studies. 2001. 14 (2). P. 555–576.

**XII Международная** научная конференция по проблемам развития экономики и общества [Текст] : в 4 кн. / отв. ред. Е. Г. Ясин ; Нац. исслед. ун-т «Высшая школа экономики». — М. : Изд. дом Высшей школы экономики, 2012. — 1500 экз. — ISBN 978-5-7598-0950-0 (в обл.).

Кн. 1. — 642, [6] с. — ISBN 978-5-7598-0951-7 (кн. 1).

Сборник составлен по итогам XII Международной научной конференции по проблемам развития экономики и общества, организованной Национальным исследовательским университетом «Высшая школа экономики» при участии Всемирного банка и Международного валютного фонда и проходившей 5–7 апреля 2011 г. в Москве.

Обсуждаются две основные специальные темы: «Мировой экономический кризис и перспективы модернизации в России» и «Качество и образ жизни: изменение во времени и пространстве». Рассматриваются проблемы макроэкономики и экономического роста, гражданского общества и демократии, рынков труда, качества государственного управления, банков и финансов, вопросы демографии.

Для экономистов, социологов, юристов, политиков, а также студентов, аспирантов и преподавателей вузов. Книга может быть полезна всем, кто интересуется проблемами и перспективами реформирования российской экономики.

УДК 330.101.5(063)  
ББК 65.012

*Научное издание*

**XII Международная научная конференция  
по проблемам развития экономики и общества**

В четырех книгах

Книга 1

Зав. редакцией *Е.А. Бережнова*

Редактор *О.В. Осипова*

Художественный редактор *А.М. Павлов*

Компьютерная верстка и графика *Л.А. Моисеенко*

Корректор *О.В. Осипова*

Подписано в печать 12.01.2012. Формат 60×88 <sup>1</sup>/<sub>16</sub>

Печать офсетная. Гарнитура Times New Roman.

Усл. печ. л. 39,3. Уч.-изд. л. 34,4. Тираж 1500 экз. Изд. № 1481

Национальный исследовательский университет «Высшая школа экономики»

101000, Москва, ул. Мясницкая, 20

Тел./факс: (499) 611-15-52

Для заметок

---

Для заметок

---

Для заметок

---

