

ГОСУДАРСТВЕННЫЙ УНИВЕРСИТЕТ
ВЫСШАЯ ШКОЛА ЭКОНОМИКИ

В.А. Бессонов

**АНАЛИЗ КРАТКОСРОЧНЫХ ТЕНДЕНЦИЙ
В РОССИЙСКОЙ ЭКОНОМИКЕ:
КАК РАССЕЯТЬ «ТУМАН НАСТОЯЩЕГО»?**

Препринт WP2/2010/05

Серия WP2

Количественный анализ в экономике

Москва
2010

- Б 53 **Бессонов, В. А.** Анализ краткосрочных тенденций в российской экономике: как рассеять «туман настоящего»? : Препринт WP2/2010/05 [Текст] / В. А. Бессонов ; Гос. ун-т – Высшая школа экономики. – М.: Изд. дом Гос. ун-та – Высшей школы экономики, 2010. – 36, [1] с. – 150 экз.

Рассматриваются причины невысокого качества анализа краткосрочных тенденций в современной российской экономике. Эти причины, по нашему мнению, обусловлены как состоянием российской экономической статистики, так и устоявшимися в среде аналитиков и воспроизводимыми системой образования не вполне адекватными представлениями о технике анализа краткосрочных тенденций. Специфика переходной экономики и особенности протекания кризисных процессов также существенно затрудняют анализ краткосрочных тенденций. Рассматриваются возможные последствия обсуждаемых проблем и формулируются предложения по их преодолению.

УДК 330.3
ББК 65.013

Ключевые слова: временной ряд; экономический индекс; сезонная корректировка; переходная экономика; кризис; краткосрочные тенденции; экономическая статистика.

Классификация JEL: C43, C82, E32, O47.

Препринты Государственного университета – Высшей школы экономики размещаются по адресу: <http://www.hse.ru/org/hse/wp>

© Бессонов В. А., 2010
© Оформление. Издательский дом
Государственного университета –
Высшей школы экономики, 2010

1. Введение¹

Анализ экономической динамики бывает связан с исследованием тенденций, развивающихся на интервалах времени различного масштаба – от самых длинных до самых коротких, которые позволяют проводить имеющиеся статистические данные. Среди задач анализа экономической динамики особую важность имеет исследование краткосрочных тенденций. Это обусловлено, по крайней мере, двумя обстоятельствами. Во-первых, такой анализ необходим для мониторинга экономической ситуации, т.е. для идентификации в режиме реального времени текущих тенденций в экономике, что требуется для принятия оперативных решений экономическими агентами. Во-вторых, высокочастотные составляющие несут основную часть информации, содержащейся во временном ряде. Следовательно, они наиболее информативны, содержательно насыщены.

Начавшийся в 2008 г. кризис еще более повысил актуальность мониторинга экономической ситуации, поскольку принятие решений в динамичных условиях кризиса требует своевременного и адекватного представления об интенсивно изменяющейся экономической ситуации. Вместе с тем с началом кризиса проблемы в этой области заметно обострились. Возник бросающийся в глаза разрыв в оценках текущей экономической ситуации аналитиками и политиками, и, в особенности, – в оценках ближайших перспектив ее развития. Так, осенью 2008 г. недвусмысленные сигналы о начале интенсивного спада в российской экономике чередовались с рассуждениями о России как о «тихой гавани». На протяжении основной части 2009 г. звучал широчайший спектр мнений – от утверждений о том, что ниж-

¹ Работа представляет собой расширенный вариант доклада автора на секции «Индексы и проблемы агрегирования» Российского экономического конгресса 10 декабря 2009 г. Работа выполнена в Лаборатории исследования проблем инфляции и экономического роста Государственного университета – Высшей школы экономики (ГУ ВШЭ) в рамках программы фундаментальных исследований ГУ ВШЭ в 2009–2010 гг. Автор признателен Э.Ф. Баранову, И.Б. Воскобойникову, В.Е. Гимпельсону, Э.Б. Ершову, Р.И. Капелюшникову, А.В. Полегаеву и Р.М. Энтову за плодотворные обсуждения и полезные замечания.

няя точка спада пройдена и началось быстрое восстановление, до панических заявлений о непрекращающемся спаде, чреватом в ближайшее время самыми неблагоприятными последствиями. В 2010 г. обсуждения позитивных изменений многих экономических показателей сопровождались разговорами о неизбежности второй волны спада. Повышение цен на гречку и другие крупы, вызванное засухой лета 2010 г., породило едва ли не апокалиптические прогнозы. На протяжении кризиса в суждениях аналитиков о текущих тенденциях не наблюдалось ничего, хотя бы отдаленно напоминающего консенсус, не говоря уже о перспективах развития экономики.

Сложившееся положение дел, характеризующееся крайне высоким уровнем неопределенности в понимании текущих тенденций в экономике, можно назвать «туманом настоящего», по аналогии с «туманом будущего» или с «туманом войны»². В этих условиях у экономических агентов отсутствует достоверная информация о текущей экономической ситуации, причем разброс оценок параметров, характеризующих эту ситуацию, чрезвычайно широк, а сами оценки крайне нестабильны во времени. Принятие решений в таких условиях напоминает вождение автомобиля в густом тумане по извилистой дороге. Неопределенность, а порой и искаженность, представлений об экономической ситуации способствует резкому снижению эффективности принимаемых решений.

Говоря о сведениях, получаемых на войне и являющихся основой для принимаемых решений, знаменитый военный теоретик К. фон Клаузевиц писал: «Стоит лишь вникнуть в природу этой основы, в ее недостоверность и шаткость, чтобы почувствовать, как хрупка зиждящаяся на ней постройка войны, как легко она может рухнуть и похоронить нас под своими обломками»³. Представляется, что подобное можно сказать и о качестве сведений о текущих тенденциях развития нашей экономики, с той лишь разницей, что войны и, соответственно, противника, заинтересованного в искажении информации, у нас сейчас нет.

«Туман настоящего» был и раньше, но с началом нынешнего кризиса он сгустился и стал особенно плотным. По нашему мнению, в его основе лежат три группы объективных причин. Первую группу

² См., например, (Плэтт, 1958).

³ См. (Клаузевиц, 2000), часть 1, глава 6.

образуют исторические причины, связанные с тем, что на протяжении значительной части XX века в экономике России доминировали плановые начала, а не рыночные. Спрос на анализ экономической конъюнктуры отсутствовал многие десятилетия. Поэтому к началу рыночных реформ в нашей стране не оказалось ни подготовленных кадров, ни задела работ в данной области, имелись серьезные проблемы с экономической статистикой и с системой подготовки кадров. Причины второй группы обусловлены тем, что переходная экономика является более сложным объектом анализа по сравнению с более стабильными развитыми рыночными экономиками. В переходной экономике происходят гораздо более интенсивные количественные изменения и глубокие качественные (поэтому она и называется переходной), что существенно затрудняет проведение измерений. Таким образом, задачи анализа краткосрочных тенденций в переходной экономике более сложны, а возможности их решения более скудны. Следствием этого является невысокое качество мониторинга экономической ситуации. Проблемы качества мониторинга не столь заметны в условиях стабильного экономического подъема, но в условиях начавшегося в 2008 г. кризиса, особенности протекания которого образуют третью группу причин, усложняющих задачу анализа краткосрочных тенденций, они становятся очевидными.

В работе рассматриваются проблемы, в совокупности формирующие «туман настоящего». Обсуждаются причины их возникновения и чрезвычайной устойчивости в современной российской экономике. Рассматриваются возможные последствия обсуждаемых проблем и формулируются предложения по их преодолению.

2. Как следует проводить анализ краткосрочных тенденций и как его проводят в России

Рассмотрение причин резкого снижения достоверности результатов мониторинга экономической ситуации начнем с краткого описания стандартной техники анализа краткосрочных тенденций⁴. Для этого используют экономические временные ряды с наименьшим из доступных шагом по времени. На практике это ряды помесечной (реже – квартальной) динамики. Ряды более высокой частоты офи-

⁴ Подробнее см., например, (Бессонов, 2003).

циальная статистика обычно строит лишь для отдельных показателей, которые в совокупности не дают общей картины, а данные годовой динамики не содержат информации о краткосрочных тенденциях.

Хотя ряды помесечной динамики являются основным источником информации о краткосрочных тенденциях в экономике, изменения уровней этих рядов обычно не позволяют получать выводы о краткосрочных тенденциях непосредственно, без проведения расчетов. Причина этого в том, что в динамику таких рядов могут вносить существенный вклад календарные, сезонные и нерегулярные флуктуации, не несущие информации о краткосрочных тенденциях. Масштаб этих флуктуаций зачастую значительно превышает совокупный вклад всех остальных факторов в динамику показателя. Это особенно характерно для переменных типа потока, к числу которых относятся показатели выпуска, инвестиций, доходов, расходов, объемов торговли и т.п.

Поэтому для проведения анализа краткосрочных тенденций из исходного временного ряда экономического показателя необходимо удалить (элиминировать) календарную, сезонную и нерегулярную составляющие с тем, чтобы по динамике компоненты тренда и конъюнктуры, получившейся в результате описанной декомпозиции исходного временного ряда, сделать выводы о краткосрочных тенденциях. Эта составляющая динамики рассматривается как информативная применительно к задачам анализа краткосрочных тенденций.

При этом выводы о краткосрочных тенденциях вблизи актуального конца временного ряда (т.е. для самых последних периодов времени, для которых имеются данные) делают с особой осторожностью, поскольку по мере приближения к краю ряда точность оценок уровней компоненты тренда и конъюнктуры значительно снижается. Это обусловлено тем, что наиболее свежие оценки анализируемого показателя обычно являются предварительными и впоследствии уточняются, а также тем, что для получения оценок уровней компоненты тренда и конъюнктуры для внутренних (удаленных от краев) членов временного ряда может быть использована информация как для всех предшествующих им, так и для всех последующих за ними периодов времени, тогда как при получении оценок уровней компоненты тренда и конъюнктуры для крайних точек информация для будущих периодов времени еще не бывает доступна.

Этот эффект снижения точности оценок уровней компоненты тренда и конъюнктуры вблизи актуального конца временного ряда получил название эффекта влияния хвостом. Такое название обусловлено тем, что по мере того, как с течением времени становятся доступными все новые члены исходного ряда и уточняются предварительные оценки, последовательные оценки компоненты тренда и конъюнктуры демонстрируют неустойчивость вблизи правого края («вливают хвостом»), постепенно стабилизируясь по мере удаления от него.

Такова, в самых общих чертах, стандартная техника анализа краткосрочных тенденций. Она сложилась и стала общепринятой (в том числе и в России) еще в начале XX века⁵. С тех пор ее развитие шло в двух направлениях. Первое направление состоит в совершенствовании экономической статистики с целью обеспечения большей сопоставимости уровней временных рядов показателей. Несопоставимость уровней экономических временных рядов может возникать, в частности, из-за того, что такие ряды в большинстве случаев не являются результатами непосредственной регистрации данных, а получаются агрегированием огромного объема исходных данных. Такое агрегирование предполагает учет исходных данных по некоторым выборкам с некоторыми весами, проводимый обычно в несколько этапов по мере построения показателей все более высокого иерархического уровня. Соответственно, динамика экономических показателей бывает обусловлена не только исходными данными, но и способами их агрегирования. Другими словами, важно не только *что* агрегировать, но и *как*. Порой особенности методики и/или ее изменения приводят к заметному ухудшению сопоставимости уровней временного ряда экономического показателя. В этом случае проведение корректного анализа краткосрочных тенденций становится проблематичным вне зависимости от используемой техники анализа.

Например, временной ряд экономического показателя может демонстрировать неинформативные ступенчатые изменения уровней, либо масштаб и форма сезонных колебаний на разных участках временного ряда экономического индекса могут заметно отличаться из-за различий в составе корзины товаров-представителей и весов.

⁵ См., например, (Ритц, 1927), (Бобров, 1930), (Конюс, 1933).

Проблема этого направления состоит в том, что, поскольку экономика является развивающейся системой, то с течением времени становится неизбежным уточнение методик построения экономических показателей с целью их адаптации к происходящим изменениям (скажем, обновление состава корзин товаров-представителей и соответствующих им весов), при этом далеко не всегда имеется возможность уточнения ретроспективных оценок показателей по измененной методике. В результате длинные ряды показателей экономической динамики не могут быть построены иначе, как сцеплением сегментов, рассчитанных по различающимся методикам. Поэтому необходим поиск компромисса между взаимно противоречивыми требованиями адаптации методики к изменяющимся реалиям и обеспечения сопоставимости во временной области. Этот блок проблем относится к предмету экономической статистики.

Второе направление развития стандартной техники анализа краткосрочных тенденций состоит в совершенствовании методов декомпозиции экономических временных рядов, позволяющих более точно идентифицировать и элиминировать календарную, сезонную и нерегулярную составляющие с тем, чтобы не допускать их просачивания в оценку компоненты тренда и конъюнктуры.

За последний век было разработано большое число алгоритмов календарной и сезонной корректировки, наиболее распространенными из которых к настоящему времени являются X-12-ARIMA⁶ и TRAMO/SEATS⁷.

Проблема здесь состоит в том, что задача декомпозиции одного временного ряда на несколько временных рядов, соответствующих составляющим динамики, строго говоря, математически не является корректной. Дело в том, что сезонные волны могут эволюционировать с течением времени, порой достаточно интенсивно. В такой ситуации возникает принципиальная неопределенность относительно того, на счет какой составляющей динамики (сезонной, нерегулярной или компоненты тренда и конъюнктуры) следует отнести флуктуацию исходного временного ряда. Эта проблема особенно остра для членов временного ряда вблизи его актуального конца. Проведение декомпозиции временного ряда возможно лишь с привлече-

⁶ См. (Findley et al., 1998).

⁷ См. (Gomez, Maravall, 1996).

нием некоторых априорных допущений относительно свойств составляющих динамики, соответственно, динамика получающихся оценок составляющих динамики зависит от этих допущений. Проблемы декомпозиции экономических временных рядов относятся скорее к области анализа данных, чем к области экономической статистики. Другими словами, это проблемы адекватной обработки и содержательной интерпретации тех данных, которые поставляет экономическая статистика.

Проведение анализа краткосрочных тенденций экономической динамики с использованием стандартной техники вынуждает решать отмеченные проблемы экономической статистики, совершенствовать методы декомпозиции экономических временных рядов, а также заниматься созданием и ведением баз данных. Все это требует определенной квалификации в разных областях и связано с немалыми издержками. Но эти издержки неизбежны, поскольку нет иного способа понять, как развиваются краткосрочные тенденции и, в частности, какова текущая экономическая ситуация. На эти издержки можно взглянуть и по-другому – как на стабильный спрос на проведение работ по совершенствованию экономической статистики и аналитики и на предоставление услуг высшего образования по подготовке специалистов в соответствующих областях. Издержки же снижения качества принимаемых экономическими агентами решений, обусловленного недостоверностью их представлений о текущей ситуации в экономике в случае использования неадекватной техники анализа, заведомо несопоставимо выше.

По нашему мнению, ключевой проблемой, приводящей к резкому снижению качества анализа краткосрочных тенденций в современных российских условиях, является то, что описанная выше стандартная техника используется недостаточно широко. Вместо нее в среде российских статистиков, экономистов и аналитиков чрезвычайно широко распространена иная, предельно примитивная и заведомо неадекватная техника. Эта техника состоит в анализе динамики данных по отношению к аналогичному периоду (месяцу, кварталу) предыдущего года. Другими словами, вместо того, чтобы для исследования краткосрочных тенденций показателя x_t анализировать динамику оценки его компоненты тренда и конъюнктуры \tilde{x}_t , проводят анализ динамики показателя $I_t = x_t/x_{t-12}$ для месячных и $I_t = x_t/x_{t-4}$ для квартальных данных. Причем значения этого пока-

зателя интерпретируются так же, как и темпы роста компоненты тренда и конъюнктуры исходного ряда $I_t = \tilde{x}_t / \tilde{x}_{t-1}$, т.е. если при использовании месячных данных $x_t / x_{t-12} > 1$, то делается вывод о том, что в месяце t имеет место рост, если $x_t / x_{t-12} = 1$ — стабилизация, а если $x_t / x_{t-12} < 1$ — спад.

Смысл анализа данных по отношению к аналогичному периоду предыдущего года состоит в том, чтобы избавиться от влияния сезонного фактора, не неся издержек использования стандартной техники. Вместе с тем очевидно, что эта техника не является сколько-нибудь полноценной заменой стандартной техники анализа краткосрочных тенденций⁸. Так, в показателе $I_t = x_t / x_{t-12}$ полностью удаляется лишь неизменная мультипликативная сезонная волна. В общем же случае, когда сезонная волна не является неизменной в мультипликативном представлении, происходит ее частичное просачивание в этот показатель, влияющее на его динамику и, следовательно, на получаемые содержательные выводы.

Помимо этого, в показатель $I_t = x_t / x_{t-12}$ просачивается и календарная составляющая, причем масштаб просачивания календарной составляющей может быть гораздо большим, чем сезонной. Так, если в текущем месяце 22 рабочих дня, а в аналогичном месяце предыдущего года — 20, то это означает, что фонд рабочего времени в сопоставляемые месяцы различается на 10%, что, как правило, по абсолютной величине превышает масштаб годовых изменений экономических показателей⁹, т.е. превышает масштаб месячных изменений уровня компоненты тренда и конъюнктуры на порядок.

Наконец, описываемая техника анализа привносит примерно полугодовой лаг, т.е. поворотные точки идентифицируются с полугодовым запаздыванием. Другими словами, смена краткосрочной тенденции компоненты тренда и конъюнктуры временного ряда исход-

ного показателя (например, начало спада или переход от спада к подъему) будет идентифицирована лишь примерно через полгода после того, как она произошла. Причина этого состоит в том, что отношение $I_t = x_t / x_{t-12}$ показывает изменение показателя x_t за год от месяца $t-12$ до месяца t , которое наилучшим образом отражает темпы роста середины этого интервала времени, а не его правого края. Если бы вместо показателя $I_t = x_t / x_{t-12}$ использовался показатель $I_t = x_{t+6} / x_{t-6}$, то полугодового смещения поворотных точек не возникло бы, но такой показатель нельзя было бы построить для последних 6 месяцев, т.е. он не давал бы ничего для анализа текущей ситуации в экономике.

Несмотря на всю очевидность приведенных соображений, описанная техника анализа имеет в современной России чрезвычайное распространение, а ее недостатки многими аналитиками не осознаются. Распространен даже анализ экономической динамики на основе данных нарастающим итогом с начала года. Примеры использования такой техники нередко можно встретить даже в публикациях в академических журналах, не говоря уже об аналитических материалах и средствах массовой информации.

Повсеместное распространение описанных примитивных и заведомо неадекватных приемов анализа краткосрочных тенденций способствует не только систематическому искажению представлений экономических агентов о текущей ситуации в российской экономике, но и осознанию происходящих в ней изменений со значительными задержками во времени. Возникающую в результате привнесения таких задержек ситуацию с мониторингом текущих тенденций можно проиллюстрировать следующим образом. Представим, что вместо прозрачного лобового стекла в автомобиле установлен монитор так, что водитель видит на нем то же, что он видел бы через стекло, но с некоторым запаздыванием. Очевидно, что у него возникнут проблемы с принятием решений, причем тем более серьезные, чем более значительно запаздывание. Если к этому добавить искажения и неполноту картины, получаемой водителем через монитор, получим ситуацию, очень похожую на ту, в которой в российской экономике принимаются оперативные решения.

⁸ Подробнее см. (Бессонов, 2003).

⁹ Заметим, что именно эта ситуация имела место в сентябре 2008 г., т.е. в начале нынешнего кризиса в российской экономике. Во многих комментариях рост промышленного производства в сентябре 2008 г. по отношению к соответствующему периоду предыдущего года на 6.3% после роста аналогичного показателя в августе лишь на 4.7% трактовался как свидетельство улучшения ситуации в российской экономике, несмотря на то, что в сентябре 2008 г. было 22 рабочих дня, а годом раньше — 20, тогда как в августе 2008 г. был 21 рабочий день, а годом раньше — 23 рабочих дня.

3. Почему сложилось такое положение

Возникает естественный вопрос: почему то, что было хорошо известно российским специалистам в первой трети прошлого века и широко и успешно ими использовалось на практике, оказалось в значительной мере утраченным теперь? Почему произошла удручающая примитивизация техники анализа краткосрочных тенденций в экономике?

По нашему мнению, причины этого следует искать в непростой истории XX века, на протяжении которого российская экономика претерпела два переходных периода — от рыночной экономики к плановой в окрестности 1930 г. и обратно после 1990 г. Шесть десятилетий (примерно с 1930 г. по 1990 г.) задачи анализа экономической конъюнктуры (и вообще, задачи, типичные для анализа рыночной экономики) в России не были актуальными в силу планового характера ее экономики. Советские статистика и аналитика были ориентированы в первую очередь на контроль хода выполнения плана, т.е. на решение других задач, предъявляющих иные требования к статистическим данным и методам получения содержательных выводов на их основе.

Задача оперативного контроля за ходом выполнения плана решалась путем сопоставления отчетных показателей с плановыми. Поскольку планирование велось по принципу «от достигнутого», предполагающему определенный рост плановых заданий по отношению к предшествующему году, то естественным способом контроля хода выполнения плана было сопоставление данных за отчетный месяц или квартал с данными за аналогичный период предшествующего года. Простым и вполне адекватным способом контроля выполнения плана было и сопоставление данных нарастающим итогом с начала текущего года с аналогичными данными предыдущего года.

Поскольку планирование велось на годовой основе, то годовые оценки рассматривались как итоговые, их построению уделялось основное внимание. Месячные же и квартальные данные при этом рассматривались лишь как промежуточные итоги года, не имеющие особой самостоятельной ценности. Интерес к ним, проявляемый на протяжении отчетного года, в значительной мере утрачивался после появления итоговых годовых оценок. Бытовало мнение, в соответ-

ствии с которым «месячная цифра — однодневка, а годовая живет века».

Таким образом, хотя месячные и квартальные данные рассматривались как весьма полезное подспорье в контроле исполнения планов, построения длинных временных рядов сопоставимых показателей высокой частоты для решения этой задачи не требовалось. Требования сопоставимости данных, накладываемые задачей контроля хода исполнения плана, были гораздо слабее, чем те, которые накладывает задача анализа экономической конъюнктуры, — было достаточно лишь обеспечения сопоставимости показателей для соответствующих месяцев или кварталов отчетного года и предшествующего ему. В результате объединение месячных или квартальных данных во временную последовательность хотя и позволяло получить временной ряд, но не гарантировало сопоставимости его уровней.

Для контроля хода выполнения плана не было необходимости и в применении методов декомпозиции экономических временных рядов и других методов анализа экономической конъюнктуры, не были нужны и специалисты, владеющие этими методами¹⁰. Поэтому в нашей стране с переходом к плановой экономике методы анализа экономической конъюнктуры перестали использоваться и развиваться, а соответствующие кадры более не готовились. Подчеркнем, что доминирование техники анализа, основанной на сопоставлении данных отчетного периода с данными аналогичного периода предыдущего года, является закономерным следствием логичной и последовательной ориентации отечественной статистики и аналитики на решение задач поддержки принятия решений в плановой экономике. Ориентация на такие задачи пронизывает статистику и аналитику сверху донизу — формы статистического наблюдения, методики агрегирования данных, способы опубликования статистических показателей, правила интерпретации результатов, содержание универси-

¹⁰ Так, С.П. Бобров, автор, по нашему мнению, лучшей для своего времени отечественной монографии (Бобров, 1930), посвященной анализу экономической динамики, был репрессирован, после чего занимался поэтическим переводом и писал научно-популярные книги для школьников. В экономическую статистику он не вернулся. Н.С. Четвериков, известный своими работами в области анализа экономической динамики, сотрудничавший, в частности, с Н.Д. Кондратьевым, также был репрессирован и на десятилетия выбыл из профессионального сообщества. Этот перечень может быть значительно продолжен, см., например, (Клюкин, 2010).

тетских учебников. Все это совершенно адекватно, но лишь для той эпохи, которая уже ушла.

Немаловажно и то, что в плановую эпоху объем доступных исследователям статистических данных был весьма скудным, методики построения статистических показателей не публиковались, количественные исследования, основанные на реальных данных, не приветствовались. Все это существенно повлияло на характер отечественных экономических исследований, в которых сформировался бросающийся в глаза перекос в пользу теоретических построений или сугубо вербальных рассуждений в ущерб количественным исследованиям экономических реалий, опирающимся на фундамент статистических данных.

В результате Россия вошла в период рыночных реформ, не имея ни задела работ в данной области, ни подготовленных кадров, ни специалистов, способных готовить эти кадры. Государственные статистика и аналитика к началу реформ не были ориентированы на потребности рыночной экономики. Не было даже некоторых разделов статистики, необходимых в рыночной экономике (таких, например, как статистика цен и статистика безработицы). Не строились временные ряды показателей, необходимых для анализа краткосрочных тенденций (скажем, ряды месячной динамики индексов промышленного производства), не было баз данных, ориентированных на решение задач, связанных с анализом экономической конъюнктуры. Наконец, не было и спроса на корректный анализ экономической конъюнктуры, поскольку потенциальные заказчики не были знакомы со стандартной техникой и не умели интерпретировать результаты ее применения.

Применительно к недолгой истории современной российской рыночной экономики эту группу причин, приводящих к снижению качества анализа краткосрочных тенденций, естественно связывать с начальными условиями.

Сложившаяся за шесть десятилетий развития собственным путем, в отрыве от мирового опыта, ситуация обладает колоссальной инерцией. Это обусловлено не только тем, что менталитет действующих статистиков, экономистов, политиков сформировался в плановую эпоху под воздействием решения адекватных ей задач, но и крайней инерционностью системы высшего образования. Готовить кадры под изменившиеся задачи могут лишь те специалисты, которые имеют

опыт решения этих задач. Но самостоятельное, вне системы высшего образования, приобретение опыта требует значительного времени и издержек. Требует времени и разработка адекватных учебных программ и подготовка новых учебников. Результатом же проблем в данной области является воспроизводство специалистов (в том числе и преподавателей), ориентированных на реалии ушедшей эпохи, что, порождая порочный круг, способно значительно усиливать эту инерцию.

4. К чему приводит ориентация на задачи ушедшей эпохи

Описанная выше подмена одной техники анализа экономической динамики другой, ориентированной на решение задач ушедшей плановой эпохи, помимо систематического искажения представлений экономических агентов о текущей ситуации в российской экономике, имеет и другие, менее очевидные, последствия. Рассмотрим некоторые из них.

Подмена техники анализа способствует консервации существующих и возникновению новых проблем российской экономической статистики. Статистика, с которой Россия вступила в рыночные реформы, была ориентирована на потребности плановой экономики. Для адаптации советской экономической статистики к требованиям российской рыночной экономики было необходимо пройти большой путь. Для этого, в свою очередь, необходим адекватный спрос на статистику со стороны ее потребителей. Аналитики, занятые проведением мониторинга текущих тенденций в экономике, формируют значительную часть этого спроса, в особенности – в части показателей месячной динамики.

Широкое распространение примитивной техники анализа искажает спрос на статистические показатели. Так, стандартная техника анализа экономической динамики требует использования длинных временных рядов. Соответственно, единицей информации на всех этапах построения, хранения, распространения, обработки информации и визуализации результатов должен являться временной ряд. Анализ же краткосрочных тенденций на основе показателей по от-

ношению к аналогичному периоду предыдущего года основан на интерпретации результатов парных сопоставлений, т.е. сопоставлений значений показателя в двух периодах. В этом случае требуется не временной ряд (единый объект сложной структуры), а большое количество числовых величин (много объектов простой структуры), соответствующих результатам парных сопоставлений. При построении временного ряда естественным требованием является обеспечение максимально возможной степени сопоставимости его уровней. При получении же результатов парных сопоставлений важно лишь обеспечить сопоставимость значений показателя в сравниваемые периоды. Это гораздо более слабое требование, не предполагающее обеспечения сопоставимости всех уровней временного ряда. В результате снижается степень сопоставимости данных во временной области. Временной ряд, полученный механическим объединением результатов парных сопоставлений, может не обеспечивать необходимой точности анализа краткосрочных тенденций даже с применением корректной техники анализа.

Временной ряд является единым, развивающимся, никогда не устаревающим объектом, тогда как совокупность результатов парных сопоставлений представляет собой огромное число статичных, не развивающихся, объектов. С течением времени интерес к этим объектам проходит, что способствует их утрате. Временной ряд подобен растущему дереву, а совокупность результатов парных сопоставлений — его клеткам. Анализ с применением стандартной техники требует всего «дерева», тогда как примитивная техника концентрирует внимание лишь на отдельных его «клетках», выпуская «дерево» как целое из поля зрения. Поэтому обсуждаемая подмена стандартной техники анализа примитивной препятствует формированию с течением времени длинных временных рядов сопоставимых показателей. Представляется, что это является одной из причин того, что в России (как до этого и в Советском Союзе) до сих пор нет публикаций, подобных «Historical Statistics of the United States»¹¹, покрывающих в максимально возможной мере если не столетия, то хотя бы последние десятилетия существования государства. Нет и практики опубликования в Интернете длинных временных рядов макроэкономических показателей, хотя бы отдаленно напоминающей, например,

¹¹ См. (Carter et al., 2006).

практику ежемесячного опубликования в США временных рядов индексов потребительских цен с января 1913 г. по отчетный месяц или индекса промышленного производства с января 1919 г. также по отчетный месяц.

Стандартная техника анализа краткосрочных тенденций требует проведения расчетов с использованием программ обработки данных (эконометрических, графических). Поэтому ряды должны храниться в электронном виде с тем, чтобы можно было с минимальными издержками передавать их в соответствующие программы. Это вынуждает создавать базы данных, ориентированные на временные ряды и программы их обработки, и вести постоянную работу по поддержанию таких баз данных в актуальном состоянии. Анализ же результатов парных сопоставлений, не требуя проведения расчетов, позволяет обходиться без организации таких баз данных. Это способствует консервации архаичных стандартов бумажной формы опубликования результатов, что резко увеличивает издержки корректной работы с временными рядами¹².

Способы опубликования официальных данных в настоящее время ориентированы на примитивную технику анализа. Данные публикуются в виде отношений к предыдущему периоду, отношений к соответствующему периоду предыдущего года, а порой и нарастающим итогом с начала текущего года по отношению к данным нарастающим итогом с начала предыдущего года. Показатели в базисной форме, необходимые для проведения корректного анализа, как правило, не публикуются, поскольку примитивная техника анализа их не требует. Декомпозиция временных рядов либо не проводится вовсе, а если проводится, то ее результаты зачастую публикуются лишь в графическом виде, что делает практически невозможным их использование в рамках стандартной техники. Таким образом, способы опубликования официальных данных навязывают использование неадекватной техники анализа экономической динамики и препятствуют применению стандартной, что способствует воспроизводству проблемной ситуации. В то же время аналитики, работающие в рамках стандартной техники, вынуждены самостоятельно восстанавливать по официальным публикациям длинные временные ряды и самостоятельно проводить их декомпозицию. Использование для это-

¹² Подробнее см. (Бессонов, 2009b).

го разных алгоритмов или хотя бы разных параметров алгоритмов порождает дополнительный разброс в оценках краткосрочных тенденций экономической динамики.

Ориентация на примитивную технику анализа способствует возникновению проблем с методиками построения показателей экономической динамики, что снижает качество мониторинга краткосрочных тенденций. Так, разные формы представления показателей экономической динамики могут рассчитываться по-разному, что приводит к рассогласованиям между ними. Вместо того чтобы рассчитывать отношения к предыдущему месяцу x_t/x_{t-1} и к аналогичному периоду предыдущего года x_t/x_{t-12} делением соответствующих уровней временного ряда показателя x_t , их порой рассчитывают независимо друг от друга агрегированием данных по товарам-представителям. В результате оценка x_t/x_{t-12} , получаемая перемножением последовательных значений x_t/x_{t-1} , может заметно отличаться от официально опубликованной. Это может происходить по двум причинам. Первой причиной может быть уточнение между периодами t и $t-12$ состава корзины товаров-представителей и весов, с которыми они учитываются при агрегировании. Если ориентироваться на примитивную технику анализа, основанную на использовании результатов парных сопоставлений, то кажется вполне логичным использовать оценку x_t/x_{t-12} , полученную агрегированием данных по единой корзине и единой системе весов. Это кажется тем более логичным, что при использовании примитивной техники необходимы именно показатели в виде x_t/x_{t-12} , тогда как показатели в виде x_t/x_{t-1} ею игнорируются. Поэтому возникающие рассогласования оценок не порождают проблем в рамках этой техники. Но с точки зрения стандартной техники анализа сама возможность расхождений между разными формами представления одного и того же показателя выглядит абсурдной¹³.

Второй причиной возникновения рассогласований между разными формами представления показателей экономической динамики является уточнение с течением времени предварительных оценок по-

¹³ Многие десятилетия статистические службы развитых стран строят базисные временные ряды сцепленных индексов, получаемых путем «сшивки» сегментов временных рядов, построенных по различающимся методикам. На основе рядов сцепленных индексов могут быть рассчитаны другие формы представления показателей, согласующиеся между собой по построению. Свойства сцепленных индексов давно и хорошо изучены. См., например, (Forsyth, Fowler, 1981).

казателей. При ориентации на результаты парных сопоставлений имеется несколько вариантов внесения таких уточнений: можно уточнять показатели по отношению к предыдущему периоду, по отношению к аналогичному периоду предыдущего года, данные нарастающим итогом по отношению к аналогичным данным предыдущего года, все эти показатели вместе или любые их комбинации. Уточнение всех показателей — трудоемко, а уточнение не всех порождает рассогласования между ними. На практике порой уточнения в оперативном режиме вносят лишь в показатели по отношению к аналогичному периоду предыдущего года (так делают, например, при построении индексов промышленного производства), которые, будучи наиболее ценными для примитивной техники анализа, не могут быть использованы в рамках стандартной техники. Уточнения же в данные по отношению к предыдущему периоду вносят существенно позднее, поскольку примитивная техника не требует использования этих данных. Это снижает качество мониторинга текущих тенденций, поскольку стандартная техника может быть применена лишь к уже устаревшим данным. Если бы уточнялись уровни базисных временных рядов, то подобных проблем не могло бы возникнуть в принципе.

Построение показателей экономической динамики зачастую предполагает проведение досчетов для того, чтобы учесть информацию, дополнительную по отношению к той, которая содержится в помесечных или квартальных данных для товаров-представителей. При ориентации на временные ряды базисных показателей досчеты проводят так, чтобы не привнести «ступенек» и прочих искажений краткосрочных тенденций динамики показателя¹⁴. При построении же совокупности парных сопоставлений такое требование не накладывается (поскольку оно имеет смысл лишь для временных рядов), что способно приводить к искажениям краткосрочных тенденций¹⁵, следствием чего может быть получение неверных содержательных выводов.

Таким образом, искажение требований к показателям экономической статистики, возникающее в результате доминирования примитивной техники анализа краткосрочных тенденций, посылает неверные сигналы статистикам, лишает экономическую статистику не-

¹⁴ Подробнее см. (Bloem, Dippelsman, Mæhle, 2001).

¹⁵ Подробнее см. (Бессонов, 2005).

которой части адекватных ориентиров ее развития, что способствует не только консервации существующих проблем, но и возникновению новых.

Еще одно следствие обсуждаемой подмены техники анализа состоит в подавлении адекватного спроса на аналитику. Прimitивная техника предполагает оперирование числовыми величинами (результатами парных сопоставлений). Получение выводов на их основе (скажем, сравнение x_t/x_{t-12} с единицей) тривиально, оно не требует ни квалификации, ни издержек. Лицо, принимающее решения, как бы далеко оно ни было от проблематики анализа краткосрочных тенденций, в состоянии с этим справиться самостоятельно, без привлечения аналитиков. Применение же стандартной техники требует определенного уровня квалификации и связано с издержками, поэтому требует участия аналитиков, формирует спрос на их услуги. Таким образом, подмена техники переносит решение задачи анализа краткосрочных тенденций с уровня аналитиков (которые не нужны для анализа столь простых объектов, как число, в отличие от более сложных объектов, таких как временной ряд) на уровень руководства (т.е. не на тот уровень) и сводит ее к заведомо упрощенной постановке, которая не может быть адекватной уже в силу своей крайней примитивности. Это способствует атрофированию аналитики, что, в свою очередь, искажает спрос на экономическую статистику и образование. В результате лица, принимающие решения, зачастую оказываются не в состоянии воспринимать результаты стандартной техники анализа краткосрочных тенденций. Все это также способствует консервации проблемной ситуации.

Наконец, примитивизация анализа краткосрочных тенденций приводит к тому, что вопросы такого анализа находятся на далекой периферии в учебных курсах экономической статистики и эконометрики (если вообще присутствуют в них). В результате применение не вполне подготовленными в данных вопросах пользователями процедур декомпозиции экономических временных рядов, которые включены ныне в стандартные эконометрические пакеты, зачастую приводит к серьезным ошибкам. К числу наиболее часто встречающихся проблем такого рода можно отнести неполное или избыточное удаление сезонной составляющей, т.е. ее просачивание в сезонно скорректированный ряд (скажем, при использовании сезонных фиктивных переменных в ситуации, когда сезонная волна заметно эво-

люционирует), который затем используется в эконометрической модели, построение модели с авторегрессионными членами по сезонно скорректированному ряду (любой уровень которого по построению зависит, вообще говоря, от всех уровней исходного ряда, т.е. содержит информацию как о прошлом, так и о будущем), в частности, проведение анализа причинности по Гренджеру по сезонно скорректированным данным.

5. Почему во время кризиса «туман» сгустился

Помимо рассмотренных выше исторических причин снижения качества мониторинга краткосрочных тенденций в современной российской экономике, существуют еще две, обусловленные протекающими в ней двумя процессами. Первый из них — переходный процесс, начавшийся во второй половине 1980-х гг., кульминация которого пришлась на 1990-е гг. На фазу затухания этого сравнительно длительного процесса наложился другой процесс, связанный с начавшимся в 2008 г. экономическим кризисом. Интерференция этих двух процессов в значительной мере определяет измерительную специфику современной российской экономики. Обсудим, в чем она состоит и какое влияние оказывает на качество анализа краткосрочных тенденций.

Важнейший элемент российской измерительной специфики последних двух десятилетий¹⁶ состоит в том, что переходный процесс является быстротекущим по сравнению с процессами стабильного экономического развития. Переходные процессы в системах самой разной природы вообще являются быстротекущими по сравнению с процессами стабильного развития. На протяжении последних двух десятилетий российская экономика демонстрирует гораздо более интенсивное изменение большинства экономических показателей по сравнению с относительно стабильными экономиками развитых стран. Это позволяет охарактеризовать российскую переходную экономику как экономику быстрых изменений, и это существенно отличает ее с измерительной точки зрения от более стабильных эконо-

¹⁶ Российская измерительная специфика переходного периода более подробно рассмотрена в (Бессонов, 2003, 2005).

мик. Применительно к анализу краткосрочных тенденций резкое ускорение протекания процессов в переходной экономике означает, что экономическая ситуация способна изменяться весьма динамично, что требует от экономических агентов более оперативного реагирования, а от статистиков — более частого обновления методик, что способно снижать степень сопоставимости данных.

Резкая интенсификация процессов в российской переходной экономике приводит к увеличению темпов изменения многих показателей, при этом увеличение интенсивностей протекания различных процессов является различным. Это проявляется, в частности, в том, что российский переходный период сопровождается значительными структурными сдвигами, под которыми здесь понимается изменение со временем пропорций между ценами и/или объемами производства различных товаров и услуг. Так, цены на одни товары за годы реформ выросли в несколько раз сильнее, чем на другие, а производство одних видов продукции снизилось на порядок и более, тогда как производство других значительно возросло. Интенсивные структурные сдвиги наблюдаются не только на всем периоде реформ, но и на любых его подпериодах¹⁷. Существование такого рода эффектов давно не является секретом для специалистов, работающих с реальными данными. Так, И. Фишер еще в начале XX в. писал, что «в периоды войн, кризисов или каких-либо иных, возмущающих народное хозяйство, факторов, рассеяние цен обычно очень увеличивается»¹⁸. Представляется, что переживаемый российской экономикой переходный период относится именно к таким периодам.

Масштабные структурные сдвиги способствуют существенному снижению точности сводных экономических индексов. Это можно пояснить на следующем примере. Представим две ситуации. В первой в условиях высокой инфляции пропорции между ценами на отдельные товары и услуги остаются неизменными, т.е. все индивидуальные индексы демонстрируют одинаковую динамику. Во второй ситуации при тех же темпах инфляции пропорции между ценами на отдельные товары и услуги со временем существенно изменяются, т.е. совокупность индивидуальных индексов в базисном представле-

нии в этом случае образует широкий пучок, «веер», тогда как в первом случае все они совпадали или образовывали узкий «жгут». Таким образом, обеим ситуациям соответствует одинаковый рост цен в среднем, но в первой ситуации структурных сдвигов нет или они малы, а во второй — велики. Это единственное различие может существенно влиять на точность сводного индекса цен. В первой ситуации выбор способа агрегирования и весов не может повлиять на динамику сводного индекса цен (в качестве сводного в этой ситуации можно даже использовать любой из индивидуальных индексов). Но во второй ситуации это влияние, очевидно, может быть очень существенным, причем с увеличением масштаба структурных сдвигов (т.е. с расширением «веера» индивидуальных индексов) оно усиливается. Таким образом, точность измерений в случае интенсивных структурных сдвигов может быть существенно ниже, чем в их отсутствие.

Для анализа краткосрочных тенденций особую важность представляет то обстоятельство, что интенсификация изменений цен и количеств сопровождается интенсификацией изменений структуры соответствующих совокупностей¹⁹, а это в свою очередь приводит к снижению точности сводных индексов. В результате именно тогда, когда сводный индекс представляет наибольший содержательный интерес, он имеет наименьшую точность. Экономика, как жеманная барышня, наиболее тщательно скрывает именно то, что особенно интересует наблюдателя.

Следующий элемент измерительной специфики, порой чрезвычайно затрудняющий анализ краткосрочных тенденций экономической динамики, состоит в том, что высокая интенсивность изменений в российской переходной экономике приводит к тому, что все составляющие динамики экономических временных рядов могут быть подвержены быстрой эволюции. Наиболее серьезные проблемы связаны с аномальной интенсивностью эволюции сезонных волн²⁰. Интенсивная эволюция сезонных волн способствует тому, что часть сезонной волны (с положительным или отрицательным знаком) при проведении декомпозиции попадет в сезонно скорректированный ряд, что приводит к искажению краткосрочных тенденций. Такое просачивание сезонной составляющей в компоненту тренда и конъю-

¹⁷ Подробнее см. (Бессонов, 2005, глава 4).

¹⁸ См. (Фишер, 1928, с. 84).

¹⁹ См., например, (Parks, 1978).

²⁰ Многочисленные примеры масштабной эволюции сезонных волн рассмотрены в (Бессонов, 2003).

юнктуры может привести к неадекватной содержательной интерпретации краткосрочных тенденций, практически не влияя на интерпретацию более долгосрочных тенденций. Особые проблемы при этом возникают при мониторинге текущих тенденций, поскольку интенсификация эволюции составляющих динамики приводит к тому, что оценки компонент тренда и конъюнктуры временных рядов российских экономических показателей переходного периода «виляют хвостом» значительно сильнее, чем оценки соответствующих компонент в стабильных экономиках.

Таким образом, переходная экономика является более сложным объектом анализа по сравнению со стабильными (непереходными) экономиками развитых стран.

Второй процесс, затрудняющий анализ краткосрочных тенденций в современной российской экономике, обусловлен начавшимся в 2008 г. кризисом. Порождаемая им измерительная специфика во многом аналогична трансформационной, но выражена более отчетливо, более плотно «спрессована» во времени. Этот кризис является весьма скоротечным, что проявляется в высоких темпах изменения многих показателей. Его особенностью является селективный, очаговый характер спада. Производство ряда видов продукции резко снизилось, а затем столь же резко возросло, тогда как производство многих других не претерпело значительных изменений²¹. Это свидетельствует о чрезвычайно высокой интенсивности сопровождающих кризис структурных сдвигов. Наблюдается и заметная эволюция сезонных волн ряда агрегированных показателей, что обусловлено, в частности, структурными сдвигами – сезонность совокупности индивидуальных индексов, продемонстрировавших наибольшее снижение, отличается от сезонности совокупности остальных индивидуальных индексов.

Во время кризиса данные оперативной статистики подвержены особо частым и значительным уточнениям, что способно резко снижать точность идентификации текущих тенденций. Так, первоначальная оценка динамики инвестиций в основной капитал с конца 2009 г. до середины 2010 г. дважды весьма существенно уточнялась,

²¹ Подробнее см. (Бессонов, 2009а). Похожие измерительные проблемы имели место и во время кризиса 1998 г., см. (Бессонов, 2005).

всякий раз значительно изменяя наши представления о тенденциях последнего полугодия.

Наложение этих двух процессов – долгосрочного трансформационного и краткосрочного кризисного – еще более усугубило и без того непростую ситуацию с анализом краткосрочных тенденций. «Туман» не только сгустился, но и стал более заметным в силу того, что во время кризисов всегда обостряется спрос на аналитику. Проблемы мониторинга текущих тенденций, порождаемые примитивной техникой анализа, стали очевидными.

6. Как рассеять туман

Рассеется ли туман сам собой или для этого необходимо что-то делать? Не сгустится ли он еще сильнее, превратившись в плотный занавес? Попробуем ответить на эти вопросы.

Как обсуждалось выше, возникновение «тумана настоящего», по нашему мнению, обусловлено тремя группами причин. Первую группу, которую применительно к нынешнему недолгому периоду развития российской экономики на рыночных началах естественно связывать с начальными условиями, образуют исторические причины, вторую группу – элементы трансформационной измерительной специфики, а третью – особенности протекания начавшегося в 2008 г. кризиса. Поэтому и меры по ослаблению тумана будем обсуждать в разрезе этих трех групп.

Что касается начальных условий, то кажется естественным ожидать снижения с течением времени их влияния на российскую аналитику и статистику, т.е. рассчитывать на то, что ситуация рано или поздно выправится. Вместе с тем проведенный выше анализ возможных последствий ориентации на задачи ушедшей эпохи показывает, что это «рано или поздно» может очень сильно различаться в зависимости от действий сообщества аналитиков, исследователей, статистиков, вовлеченных в процесс анализа краткосрочных тенденций. Рыночная экономика требует, вообще говоря, другой аналитики и другой статистики, чем экономика плановая. Соответственно, влияние начальных условий будет снижаться лишь по мере того, как будут осваиваться и распространяться адекватные задачам рыночной эко-

номики методы и адаптироваться к изменившимся требованиям статистика. Инерция же будет препятствовать исправлению ситуации.

Применительно к задаче мониторинга экономической ситуации такая адаптация означает, прежде всего, ориентацию на использование временных рядов в качестве единственно адекватной задаче анализа экономической динамики структуры данных на всех этапах сбора информации, ее хранения, обработки, анализа и визуализации. Для корректного анализа экономической динамики статистический показатель совершенно недостаточно строить лишь как совокупность результатов парных сопоставлений, механически объединенных во временную последовательность. Требование обеспечения сопоставимости во временной области должно рассматриваться как необходимое условие на всех этапах построения временного ряда. Соответственно, и методики построения показателей экономической динамики должны быть методиками построения временных рядов, а не методиками проведения сопоставлений лишь между двумя периодами времени – базисным и текущим. В методиках явным образом должны оговариваться вопросы сцепления рядов индексов, построенных по различающимся корзинам и весам, обеспечения сопоставимости во временной области при проведении досчетов и при согласовании месячных и квартальных оценок с годовыми и т.п.

Следующим важным моментом исправления ситуации, по нашему мнению, должно являться кардинальное изменение отношения к данным помесечной и квартальной динамики, которые в нашей стране традиционно рассматриваются лишь как промежуточные итоги года, не имеющие особой самостоятельной ценности. До тех пор, пока будет сохраняться недооценка важности этих данных, которые являются единственным источником информации о краткосрочных тенденциях, не будет и надежды на существенное улучшение качества мониторинга.

Представляется, что важным шагом в направлении улучшения качества данных помесечной и квартальной динамики было бы введение практики построения и опубликования максимально возможно длинных временных рядов индивидуальных индексов по максимально широкой номенклатуре и в удобном для последующей электронной обработки виде с открытым доступом через Интернет. Практика показывает, что большие массивы оперативных данных неизбежно содержат ошибки. При анализе временных рядов инди-

видуальных индексов многие такие ошибки (например, резкие неинформативные выбросы, неинформативные нули, перераспределения уровней показателя между соседними месяцами, сдвиги уровня, обусловленные утратой сопоставимости данных) легко могут быть идентифицированы, причем чем грубее ошибка, тем легче ее идентифицировать и, соответственно, исправить. В ситуации, когда эти данные доступны лишь крайне узкому кругу статистиков и аналитиков, едва ли можно надеяться на «вычищение» этих ошибок. Обеспечение же широкого доступа к таким данным обеспечит обратную связь, будет стимулировать спрос на временные ряды и тем самым способствовать не только улучшению качества исходных данных, но и распространению адекватных методов их анализа.

Поскольку данные помесечной и квартальной динамики играют ключевую роль в обеспечении качества мониторинга экономической ситуации и несут гораздо больше информации по сравнению с рядами годовой динамики, то для кардинального улучшения положения в этой области такие данные должны рассматриваться не как «заворки» экономической статистики, а как ее сердцевина. Пока же, как представляется, месячные и квартальные ряды являются «гадким утенком» российской статистики. Не самое лучшее положение с этими данными порождено, по нашему мнению, не столько нехваткой ресурсов, сколько менталитетом, инерцией мышления.

Для того чтобы развитие российской статистики двигалось в направлении все более полного соответствия потребностям задач, которые ставит рыночная экономика, в частности, потребностям задач анализа краткосрочных тенденций, необходим адекватный спрос со стороны потребителей статистической информации. Всякий показатель экономической статистики является инструментом решения некоторых задач. Как и любой другой инструмент, он зависит от тех задач, для решения которых предназначен. Круг таких задач и предъявляемые ими требования к статистическим показателям едва ли могут быть полностью определены статистиками самостоятельно, без самого активного участия пользователей статистических данных. Представляется, что сообщество потребителей статистической информации должно играть важную роль в разработке стратегических вопросов развития российской статистики и формировании официальной позиции по общим методологическим проблемам статистики. Если экономисты и аналитики не формируют адекватного спро-

са, то справедливо ли предъявлять претензии к статистикам? Проблема усугубляется тем, что в России основным заказчиком статистики традиционно является государство в лице его экономических ведомств и в первую очередь – Министерства экономического развития. Это резко снижает возможности влияния на ситуацию остальных потребителей статистической информации. Представляется, что выработка механизмов формирования адекватного спроса на статистику заслуживает самого серьезного внимания.

Наконец, нельзя недооценивать роль, которую могла бы сыграть (или не сыграть) система высшего образования. Обсуждаемые проблемы могут быть решены там же, где они были созданы – в учебной аудитории²². Этот блок вопросов заслуживает серьезного обсуждения.

Говоря о российской трансформационной специфике, т.е. о второй группе причин, формирующих «туман настоящего», следует отметить, что интенсивность трансформационных процессов в российской экономике сейчас явно снижается. В этом смысле переходный процесс находится в фазе затухания, вместе с ним постепенно исчезает и российская измерительная специфика. Это, с одной стороны, упрощает проведение измерений в российской экономике, а с другой – вынуждает совершенствовать действующие методики построения экономических показателей с целью приближения их к стандартам, принятым в развитых странах со стабильными экономикой. Так, на повестку дня в обозримой перспективе неизбежно встанут вопросы внедрения метода двойного дефлятирования в практику построения показателей Системы национальных счетов, метода непрерывной инвентаризации для построения рядов динамики основных фондов, более широкого использования процедуры дефлятирования данных о выпуске в текущих ценах при построении индексов количеств, использования данных об отработанных человеко-часах, потребленной электроэнергии и прочих подобных заменителей (**proxies**) **вместо данных о выпуске конечной продукции** в натуральном выражении, внедрения более совершенных индексных формул, совершенствования методов построения систем

²² В этом контексте уместно вспомнить приписываемые О. фон Бисмарку знаменитые слова о том, что Германию создал прусский школьный учитель, как и фразу герцога Веллингтона о том, что битва при Ватерлоо была выиграна на спортивных площадках Итона.

весов экономических индексов, внедрения современных методов согласования динамики временных рядов показателей месячной динамики с соответствующими показателями в годовом выражении, совершенствования методов проведения досчетов, широкого использования методов декомпозиции экономических временных рядов, построения гедонических индексов и многие другие. Будет происходить постепенный отказ от методических компромиссов, неизбежных в период «бури и натиска».

Совершенствование же методик, как уже отмечалось, не всегда является благом, поскольку может вести к утрате сопоставимости уровней одного и того же временного ряда, которые построены по различающимся вариантам методик. В качестве примера, достойного учебников, приведем переход с начала 2005 г. к разработке показателей в структуре видов деятельности ОКВЭД от ранее действовавшей структуры отраслей ОКОНХ. Несмотря на то что ОКВЭД, будучи гармонизированным с международными стандартами, обладает преимуществами перед ОКОНХ, при переходе на новый классификатор не были восстановлены ретроспективные временные ряды показателей необходимой длины (так, данные по производству ВВП в структуре ОКВЭД доступны лишь с 2002 г.), что и породило проблему. Таким образом, усовершенствования методик порой заметно снижают сопоставимость данных во временной области и в этом смысле они способны ухудшать качество статистики.

Другой хрестоматийный пример того же рода – совсем свежий. В январе 2010 г. Росстатом осуществлен переход на Общероссийский классификатор продукции по видам экономической деятельности (ОКПД), гармонизированный со Статистической классификацией продукции по видам деятельности в Европейском экономическом сообществе, что привело к значительному снижению степени сопоставимости системы индексов промышленного производства (а следовательно, и всех индикаторов экономического роста более высокого уровня агрегирования, вплоть до оценок динамики ВВП в постоянных ценах), что на какое-то время резко затруднило анализ краткосрочных тенденций экономического роста, тем самым заметно сгустив «туман настоящего».

Таким образом, грядущее совершенствование многих методик, обусловленное постепенной утратой российской экономикой ее трансформационной специфики, способно в обозримом будущем

породить серьезные проблемы анализа экономической динамики. Для того, чтобы их избежать (или хотя бы снизить их остроту), представляется необходимым проводить детальные обсуждения предстоящих изменений методик построения экономических показателей с их потребителями, в частности, обсуждения в академической среде. Смену официальной методики едва ли можно считать лишь внутренним делом статистической службы.

Наконец, грядущее совершенствование методик будет формировать спрос на исследовательские и консультационные услуги в области экономической статистики, при этом совершенно неочевидно, что сообщество исследователей и аналитиков окажется в состоянии этот спрос удовлетворить. Проблема в том, что спрос в данной области является весьма специфическим и чрезвычайно узким — его в значительной мере формирует лишь один Росстат. Для возможности получения заказов в этой области от потенциальных исполнителей требуются многолетние значительные инвестиции в чрезвычайно специфический человеческий капитал, который едва ли может быть востребован в иной области. Отдача от таких инвестиций связана с высокими рисками. В этих условиях едва ли можно надеяться на то, что рынок сформирует достаточное количество специалистов необходимой квалификации²³. Проблему усугубляют действующие механизмы конкурсного отбора, дающие возможность фирмам-однодневкам, демпингуя, выигрывать конкурсы на выполнение статистических работ. Возникает ситуация провала рынка, для ликвидации которой требуется вмешательство государства. Представляется целесообразной разработка принципов долгосрочной государственной политики в области подготовки кадров и организации работ в этой чрезвычайно специфичной области. Невысокое качество вновь создаваемых методик способно породить серьезные проблемы анализа экономической динамики на многие годы.

Что же касается кризисов типа начавшегося в 2008 г., т.е. третьей группы причин, формирующих «туман настоящего», то они были и будут. Поэтому лучшее, что здесь можно предложить, это — исследо-

²³ Представляется, что именно по этой причине подготовкой специалистов высокого уровня в интересах национальных статистических служб и повышением их квалификации занимаются в основном международные организации — в масштабах всего мира спрос более стабилен, к тому же такие организации сами способствуют его формированию, что обеспечивает постоянной работой их сотрудников.

вать измерительную специфику таких кризисов и заранее понять, что следует делать и чего делать не следует в части измерений при наступлении очередного такого кризиса. Представляется, что во время таких кризисов следует по возможности воздерживаться от существенных изменений методик. Так, уже упомянутый переход с начала 2010 г. на ОКПД, по нашему мнению, в связи с начавшимся кризисом следовало перенести на более поздний срок. Завершение проводившегося в плановом режиме длительного процесса подготовки смены классификатора случайно совпало по времени с очередным экономическим кризисом. В результате возникновения ситуации, напоминающей смену лошадей на переправе, возможности анализа краткосрочных тенденций экономического роста на некоторое время резко сократились.

Вместе с тем кризисы способны не только создавать проблемы анализа экономической динамики, но могут и способствовать их решению. Дело в том, что во время кризисов резко обостряется спрос на адекватный мониторинг текущих тенденций в экономике, что формирует «окно возможностей» для решения проблем в этой области. По завершении же кризиса и после возобновления устойчивого экономического роста (как это было после кризиса 1998 г.) этот спрос сокращается и «окно возможностей» закрывается. Восприимчивость лиц, от которых зависит решение проблем в данной области, снижается по мере осознания ими факта улучшения ситуации в экономике. Повышение мировых цен на экспортируемое Россией сырье также весьма способствует снижению интереса к проблемам аналитики и статистики, что можно рассматривать как одно из проявлений ресурсного проклятья. Неоптимальность принимаемых экономическими агентами в «тучные годы» решений не сразу приводит к очевидным негативным последствиям. Кризис изменяет эту ситуацию, что позволяет говорить о его очистительной роли применительно, в том числе, к статистике и аналитике.

Литература

Бессонов В.А. (2003) Введение в анализ российской макроэкономической динамики переходного периода. М.: Институт экономики переходного периода, 2003.

Бессонов В.А. (2005) Проблемы анализа российской макроэкономической динамики переходного периода. М.: Институт экономики переходного периода, 2005.

Бессонов В.А. (2009а) О тенденциях развития российской экономики в контексте мирового кризиса // Экономическая политика. 2009. № 1. С. 59–68.

Бессонов В.А. (2009б) Взгляд на российскую статистику со стороны пользователя // Вопросы статистики. 2009. № 5. С. 50–61.

Бобров С.П. (1930) Экономическая статистика: введение в изучение методов обработки временных рядов экономической статистики. М.; Л.: Госиздат, 1930.

Клаузевиц К. (2000) О войне. М.: Логос, 2000.

Клюкин П.Н. (2010) Конъюнктурный институт в лицах: биографический очерк // Избранные труды Кондратьевского Конъюнктурного института. М.: Экономика, 2010.

Конюс А.А. (1933) Экономическая конъюнктура // Энциклопедический словарь Русского библиографического института Гранат. 7-е изд. М., 1933. Т. 51. С. 220–264.

Фишер И. (1928) Построение индексов. Учение об их разновидностях, тестах и достоверности. М.: ЦСУ СССР, 1928.

Плэтт В. (1958) Информационная работа стратегической разведки. М.: Иностранная литература, 1958.

Ритц Г.Л. (ред) (1927) Математические методы в статистике. М.: Экономическая жизнь, 1927.

Bloem A.M., Dippelsman R.J., Mæhle N.Ø. (2001) Quarterly National Accounts Manual: Concepts, Data Sources, and Compilation. Washington: IMF, 2001.

Carter S.B., Gartner S.S., Haines M.R., Olmstead A.L., Sutch R., Wright G. (eds.) (2006) Historical Statistics of the United States. Millennial Edition. N.Y.: Cambridge University Press, 2006.

Findley D.F., Monsell B.C., Bell W.R., Otto M.C., Chen B.-C. (1998) New Capabilities and Methods of the X-12-ARIMA Seasonal-Adjustment Program // Journal of Business and Economic Statistics. 1998. Vol. 16. No. 2. P. 127–152.

Forsyth F.G., Fowler R.F. (1981) The Theory and Practice of Chain Price Index Numbers // Journal of the Royal Statistical Society, Ser. A. 1981. Vol. 144. Part 2. P. 224–246.

Gomez V., Maravall A. (1996) Programs TRAMO (Time series Regression with Arima noise, Missing observations, and Outliers) and SEATS (Signal Extraction in Arima Time Series). Instructions for the User, Working Paper 9628, Research Department, Banco de Espana, 1996.

Parks R.W. (1978) Inflation and Relative Price Variability // Journal of Political Economy. 1978. Vol. 86. No. 1. P. 79–95.

Bessonov, V. A.

Analysis of short-term trends in the Russian economy: how to clear the “fog of present” away? : Working paper WP2/2010/05 [Text] / V. A. Bessonov ; The University – Higher School of Economics. – Moscow: Publishing House of the University – Higher School of Economics, 2010. – 36, [1] p. – 150 copies. (in Russian)

The reasons of sharp deterioration of the analysis of short-term trends in the Russian economy are considered. These reasons are caused both a current state of the Russian economic statistics, and a wide distribution of the inadequate technique of analysis of short-term trends. Specific character of the economy in transition and current crisis complicate the problem as well. Possible consequences of the issues discussed are considered, and proposals to overcome them are formulated.

Keywords: time series; index number; seasonal adjustment; transitive economy; crisis; short-term trends; economic statistics.

JEL Classification: C43, C82, E32, O47.

Препринт WP2/2010/05

Серия WP2

Количественный анализ в экономике

Бессонов Владимир Аркадьевич

**Анализ краткосрочных тенденций в российской экономике:
как рассеять «туман настоящего»?**

Выпускающий редактор *А.В. Заиченко*

Технический редактор *Ю.Н. Петрина*

Отпечатано в типографии Государственного университета –
Высшей школы экономики с представленного оригинал-макета.
Формат 60×84 1/16. Бумага офсетная. Тираж 150 экз. Уч.-изд. л. 2,2
Усл. печ. л. 2,09. Заказ № . Изд. № 1193

Государственный университет – Высшая школа экономики.
125319, Москва, Кочновский проезд, 3
Типография Государственного университета – Высшей школы экономики.

Тел.: (495) 772-95-71; 772-95-73

