

ЖУРНАЛ
НОВОЙ
ЭКОНОМИЧЕСКОЙ
АССОЦИАЦИИ

№ 2 (14)

Проблемы
экономической теории

Исследование
российской экономики

Вопросы
экономической политики

Горячая тема

Научная жизнь

2012

Москва

Главные редакторы

В.М. Полтерович, А.Я. Рубинштейн

Редакционная коллегия

Ф.Т. Алескеров (зам. главного редактора)	Е.Ш. Гонтмахер	Л.Н. Лыкова	О.Ю. Старков (ответственный секретарь)
В.И. Аркин	Л.М. Григорьев	В.Д. Матвееenko	В.Л. Тамбовцев
Е.В. Балацкий	Е.Т. Гурвич (зам. главного редактора)	Я.Ш. Паппэ	Л.А. Фридман
Л.Б. Вардомский	С.М. Гуриев	А.А. Пересецкий	Т.В. Чубарова
А.А. Васин	В.И. Данилов	В.В. Попов	О.А. Эйсмонт
В.Е. Гимпельсон	В.Е. Дементьев	В.В. Радаев	К.В. Юдаева
М. Ю. Головнин (зам. главного редактора)	И.А. Денисова	А.В. Савватеев	А.А. Яковлев
	А.М. Либман	С.А. Смоляк	

Редакционный совет

А.Г. Аганбегян	И.И. Елисеева	В.Л. Макаров	А.И. Татаркин
А.А. Аузан	В.В. Ивантер	П.А. Минакир	Н.П. Шмелев
Р.С. Гринберг	О.В. Иншаков	А.Д. Некипелов	М.А. Эскиндаров
В.И. Гришин	Г.Б. Клейнер	Н.Я. Петраков	И.Ю. Юргенс
А.А. Дынкин	Я.И. Кузьминов	С.М. Рогов	

© Журнал Новой экономической ассоциации, 2012

Зарегистрирован Федеральной службой по надзору в сфере связи,
информационных технологий и массовых коммуникаций (Роскомнадзор)
Свидетельство о регистрации средства массовой информации ПИ № ФС77-37276 от 19 августа 2009 г.

ISSN 2221-2264

От редакционной коллегии

В январе 2009 года создана Новая экономическая ассоциация и зарегистрирован ее печатный орган – Журнал Новой экономической ассоциации. Главная цель и ассоциации, и журнала – объединить усилия всех российских экономистов, работающих в Российской академии наук, в высших учебных заведениях, в аналитических центрах, для повышения качества российских экономических исследований и образования.

Журнал публикует статьи как теоретического, так и эмпирического характера по всем направлениям экономической науки. Приветствуются междисциплинарные разработки и экономические исследования, использующие методы других наук – физики, социологии, политологии, психологии и т.п. Особое внимание предполагается уделять анализу процессов, происходящих в российской экономике.

Журнал будет реагировать на самые острые проблемы, возникающие в мировой и российской экономике. в связи с этим создана специальная рубрика – «Горячая тема», где будут, в частности, помещаться материалы круглых столов, организованных журналом.

Планируется также публикация рецензий и новостных материалов, посвященных научной жизни в России и за рубежом.

Все рассматриваемые статьи подвергаются двойному анонимному рецензированию. При принятии решения о публикации единственным критерием является качество работы – оригинальность, важность и обоснованность результатов, ясность изложения. Принадлежность автора к тому или иному общественному движению, защита в статье тезисов, характерных для того или иного политического течения, не должны влиять на решение о публикации или отвержении статьи.

Журнал выходит ежеквартально. Как только позволят финансовые условия, мы продолжим публикацию переводов статей на английский язык.

Журнал включен ВАК Минобрнауки России в Перечень ведущих рецензируемых научных журналов и изданий, в которых должны быть опубликованы основные научные результаты диссертаций на соискание ученой степени доктора и кандидата наук.

Содержание

Проблемы экономической теории

- 10 Е.С. Куценко**
Зависимость от предшествующего развития в сфере пространственного размещения производительных сил – плохая новость для эмпирических исследований агломерационных эффектов
- 27 Е.Р. Горяинова
Т.И. Слепнёва**
Методы бинарной классификации объектов с номинальными показателями

Исследование российской экономики

- 51 Е.А. Федорова
И.Я. Лукасевич**
Индекс давления на валютный рынок (EMR): особенности развивающихся рынков
- 67 О.Г. Васильева**
Вредит ли изобилие природных ресурсов инвестициям в образование?
Случай российских регионов

Вопросы экономической политики

- 83 А.К. Соловьев**
Проблемы формирования страховой пенсионной системы России
- 102 А.Ю. Чепуренко**
Что такое предпринимательство и какая политика в отношении предпринимательства нужна России? (Заметки на полях работ современных зарубежных классиков)

Горячая тема

Круглый стол:
Экономика культуры:
новый ракурс старых проблем

- 126 А.Я. Рубинштейн**
Вступительная заметка
- 128 М.В. Матецкая**
Концепция отрасли культуры в научных исследованиях: обзор основных подходов и методик оценки

- 132 В.Л. Тамбовцев**
Причины «болезни издержек» Баумоля: низкая производительность или культурные стереотипы?
- 135 Ю.В. Автономов**
Эластичность спроса на исполнительское искусство по цене и доходу: основные результаты эмпирических исследований
- 138 Т.В. Абанкина**
Многоканальное финансирование культуры и искусства: зарубежный опыт
- 141 Е.А. Хаунина**
«Процентная филантропия» – дополнительный финансовый ресурс для организаций социально-культурной сферы
- 144 В.Ю. Музычук**
Перспективы развития культуры в России в свете Стратегии-2020 и проекта Федерального закона «О культуре в Российской Федерации»
- 147 С.Н. Горушкина**
О некоторых аспектах культурных потребностей населения России

150 М.И. Жабский
Конкурентоспособность российского кинематографа

153 М.Л. Магидович
Петербургские филармонические традиции сквозь призму современных потребительских практик

158 А.Я. Рубинштейн
Тенденции и закономерности потребления услуг организаций исполнительских искусств

Научная жизнь

166 В.Ю. Музычук
Отчет о научной конференции «Актуальные проблемы экономики и социологии культуры» (Москва, 18 апреля 2012 г.)

169 Академику В.Л. Макарову – 75 лет
Наши поздравления !

Contents

Problems of Economic Theory

- 26 E.S. Kutsenko**
Path Dependence in Spatial Distribution of Economic Activity: Bad News for Empiric Research of Agglomeration Effects
- 49 E.R. Goryainova**
T.I. Slepneva
Binary Classification of Objects with Nominal Indicators

Studies of the Russian Economy

- 66 Ye.A. Fedorova**
I.Ya. Lukasevich
Index of Exchange Market Pressure (EMP): Specifics of Emerging Markets
- 81 O.G. Vasilyeva**
Does Abundance of Natural Resources Impair Investments in Education? Case of Russian Regions

Issues of Economic Policy

- 101 A.K. Solovyev**
Problems of the Insurance Pension System Formation in the Russian Federation
- 124 A.Yu. Chepurenko**
What is Entrepreneurship and What Entrepreneurship Policy Does Russia Need? (Marginal Notes on Works of Modern Foreign Classics)

Hot Topic

Round table:
Economics of Culture:
New View On Old Problems

- 126 A.Ya. Rubinstein**
Introductory Note
- 128 M.V. Matetskaya**
Concept of Cultural Branches in Research: Summary of Basic Approaches and Valuation Methods

- 132 V.L. Tambovtsev**
Reasons for Baumol's Cost Disease:
Low Productivity or Cultural Stereotypes?
- 135 Yu.V. Avtonomov**
Elasticity of Demand for Performing Art at Price and Income:
Basic Results of Empiric Research
- 138 T.V. Abankina**
Multi-channel Financing for Culture and Art: International Experience
- 141 E.A. Khaunina**
Percentage Philanthropy as Additional Financial Resource for Social and Cultural Sphere
- 144 V.Yu. Muzychuk**
Development Prospects for Russia's Culture in light of Strategy 2020 and Federal Law Draft "On Culture in the Russian Federation"
- 147 S.N. Gorushkina**
Some Aspects of Cultural Needs in Russia
- 150 M.I. Zhabsky**
Competitiveness of Russian Cinema

- 153 M.L. Magidovitch**
Petersburg's Philharmonic Traditions in Light of Modern Consumer Practice
- 158 A.Ya. Rubinstein**
Trends and Regularities of Consumption in the Performing Arts

Academic Affairs

- 166 V.Yu. Muzychuk**
Summary of Research Conference "Crucial Issues of Economics and Sociology of Culture" (Moscow, April 18, 2012)
- 169 Academician V. L. Makarov's 75-th Anniversary:**
Our Congratulations

Проблемы экономической теории



Е.С. Куценко

Зависимость от предшествующего развития в сфере пространственного размещения производительных сил – плохая новость для эмпирических исследований агломерационных эффектов

Е.Р. Горяинова

Т.И. Слепнева

Методы бинарной классификации объектов с номинальными показателями

Е.С. Куценко

Институт статистических исследований и экономики знаний,
НИУ ВШЭ, Москва

Зависимость от предшествующего развития в сфере пространственного размещения производительных сил – плохая новость для эмпирических исследований агломерационных эффектов

Считается, что в рыночной экономике концентрация производительных сил формируется там, где агломерационные эффекты максимальны. Однако на самом деле эта научная идеализация далека от реальности. Агломерационные эффекты меняются гораздо быстрее, чем пространственное размещение производительных сил. Данный феномен хорошо описывается теорией зависимости от предшествующего развития.

Несмотря на это, в эмпирических работах, оценивающих влияние агломерационных эффектов, до сих пор предполагается, что концентрация предприятий или занятости является хорошей замещающей переменной для агломерационных эффектов.

Ключевые слова: агломерационные эффекты, кластеры, зависимость от предшествующего развития, инновации.

Классификация JEL: R12, O12, B0, O30.

1. Опыт эмпирических оценок агломерационных эффектов

Существует большой массив эмпирических исследований влияния агломерационных эффектов¹ на те или иные показатели социально-экономического развития региона. Чаще всего в качестве зависимой переменной выбирают производительность, добавленную стоимость, занятость, уровень заработных плат, число выданных патентов (патентных заявок).

Начало эмпирических работ по данной теме положили статьи Д. Шефера (Shefer, 1973) и Л. Свейкаускаса (Sveikauskas, 1975). В обзорной работе К. Бодри и А. Шифарова (Beaudry, Schiffauerova, 2009) проанализировали большое число эмпирических работ. В результате положительные значимые MAR-эффекты подтвердились в 47% случаев (в 10% случаев MAR-эффекты демонстрируют как положительное, так и отрицательное значимое влияние; в 24% – только отрицательное значимое влияние; в 19% случаев эффекты кластеризации незначимы). Что касается эффектов урбанизации, то положительное значимое влияние последних было обнаружено в 45% случаев, как положительное, так и отрицательное значимое влияние – в 10%, только отрицательное – в 7%. Наконец, незначимыми эффекты урбанизации оказались в 37% случаев (табл. 1). Более развернутая информация по некоторым эмпирическим работам представлена в табл. 2.

¹ Под эффектами агломерации принято понимать эффекты двух типов: эффекты кластеризации (они же эффекты локализации, они же MAR-эффекты) и эффекты урбанизации (чаще всего под ними понимают Джейкобс-эффекты). Оба данных эффекта являются факторами совместной локализации организаций. Однако если эффект кластеризации ведет к локализации предприятий в общей сфере деятельности, то эффект урбанизации проявляется в концентрации на одной территории организаций вообще, безотносительно, существует ли между ними тематическая близость.

Таблица 1

Результаты обзора эмпирических работ, направленных на оценку влияния MAR- и Джейкобс-эффектов

Результаты	MAR		Джейкобс		MAR		Джейкобс	
	Число исследований	%	Число исследований	%	Число использованных переменных*	%	Число использованных переменных*	%
Только позитивный	23	34	26	39	51	47	56	45
Позитивный и негативный	24**	36	24**	36	11***	10	13***	10
Позитивный или частично позитивный****	47	70	50	75	62	57	69	56
Незначимый	2	3	15	22	20	19	46	37
Только негативный	18	27	2	3	26	24	9	7
Всего	67	100	67	100	108	100	124	100

* Каждая независимая переменная, используемая для измерения эффектов агломерации, с каждой зависимой переменной считается как отдельная переменная.

** Одновременно позитивный и негативный (или незначимый) результат может быть получен для разных зависимых переменных, временных периодов, видов деятельности и регионов в рамках одного исследования.

*** Как позитивный, так и негативный (или незначимый) результат, полученный для разных зависимых переменных, временных периодов, видов деятельности и регионов, считается как одна переменная.

**** Получен хотя бы один положительный результат (сумма двух предыдущих строк: только положительный результат и смешанный – положительный и отрицательный результаты).

Источник: Beaudry, Schiffauerova, 2009, p. 321.

Несмотря на их значительное число, на данный момент эмпирические работы в данной сфере выглядят обособленными и не могут претендовать на то, чтобы в целом подтвердить или опровергнуть гипотезу о влиянии внешних экономий (прежде всего на производительность). Де Грут с коллегами, изучив множество эмпирических работ, делают вывод, что результаты этих исследований во многом определяются выбором зависимой и независимой переменных, в том числе – каким образом были сконструированы переменные внешних экономий, какие были выбраны контрольные переменные. Также значимо влияет на результат выбор страны и временного периода исследования (De Groot, Poot, Smit, 2009). Заметим, что помимо этого на результат серьезно влияет масштаб региона, в котором оцениваются внешние экономии (если в качестве объекта исследования выступает регион, а не фирма).

Если говорить о суммарной количественной оценке влияния внешних экономий на производительность, то эластичность произ-

Таблица 2

Исследования влияния агломерационных эффектов

Источники	Объект анализа	Зависимая переменная	Подтвержде- ние влияния на зависимую переменную эффекта лока- лизации	Подтвержде- ние влияния на зависимую переменную эффекта урба- низации
Henderson, Kuncoro, Turner, 1995	Восемь промышленных отраслей в США (в 1970 и 1987 г.)	Темп роста заня- тости в отрасли	+	+
Baptista, Swann, 1999	Фирмы в сфере инфор- мационных технологий в 39 штатах США и 14 регионах Великобрита- нии в 1988 и 1991 г.	Рост фирмы (представлен- ный ростом за- нятости)	+	–
Glaeser, Kal- lal, Scheink- man et al., 1992	170 городов США между 1956 и 1987 г.	Рост занятости	–	+
Combes, 2000	341 регион во Франции (с 1984 по 1993 г.)	Рост занятости	–	+
Almeida, 2005	Производственные фирмы в 275 регионах Португалии с 1985 по 1994 г.	Рост заработных плат	+	–
Anastasso- va, 2006	Районы Великобрита- нии (Local Authority Dis- trict) в 1998 и 2003 г.	Почасовые заработки	(MAR- эффекты не рассматри- вались)	+
Gao, 2004	Добывающие и обра- батывающие отрасли в 28 провинциях Китая в 1985–1993 гг.	Рост выпуска	–	–
Vorobyev, Kislyak, Davidson, 2010	10,663 предприятия из всех субъектов Россий- ской Федерации раз- личных видов деятель- ности (2001–2005)	Рост прибыли	+	+
Martin, Mayer, May- neris, 2008	Фирмы во Франции с 1996 по 2004 г. (всего 94 573 наблюдения)	Добавленная стоимость (по фирмам)	+	–

Окончание таблицы 2

Источники	Объект анализа	Зависимая переменная	Подтверждение влияния на зависимую переменную эффекта локализации	Подтверждение влияния на зависимую переменную эффекта урбанизации
Henderson, 2003	Производства ² в США в 1972–1992 гг.	Производительность	+	+
Lindqvist, 2009	Регионы ЕС	Экономическое благосостояние (ВВП на душу населения, валовая добавленная стоимость и средний уровень заработной платы)	–	+
Lindqvist, 2009	Регионы ЕС	Инновационная активность (число выданных патентных заявок)	+	–
Feldman, Audretsch, 1999	Города США	Появление новых промышленных товаров	–	+
Paci, Usai, 1999	784 региона Италии	Число патентных заявок	+	+
Porter, 2003	172 региона США	Число патентных заявок	+	
Greunz, 2004	153 региона Европы	Число патентных заявок	+	+

Источник: составлено автором.

водительности по размеру города (Джейкобс-эффекты) и по размеру отрасли в регионе (MAR-эффекты) чаще всего лежит между 3 и 8% (Martin, Mayer, Mayneris, 2008, p. 2).

На самом деле это не так много, как можно было бы ожидать исходя из теоретических работ. На этом основании ряд авторов делают вывод о том, что государственное вмешательство в процесс территориального размещения и усиления агломерационных эффектов излишне. Такого рода государственные политики (прежде всего кластерная) являются политиками второго порядка. Проблемы (провалы рынка), на решение которых они направлены, изучены слабо; сами эти политики сложно реализовать, а выгоды, которые они приносят, сравнительно невелики. Следовательно, к политикам такого рода следует прибегать, когда более насущные и простые решения уже имеются (Duranton, 2009, p. 43).

² Речь идет именно о производствах, а не о фирмах. Расположение фирмы определяется местом регистрации юридического лица и может не совпадать с месторасположением производств, принадлежащих данной фирме. В. Хендерсон анализирует статистику именно по производствам.

Вместе с тем во всех известных автору эмпирических работах агломерационные эффекты измеряются по масштабу концентрации производительных сил³. Иными словами, если в регионе наблюдается сравнительно большая концентрация фирм или занятости в определенной сфере деятельности (относительно других исследуемых регионов), то делается вывод о том, что агломерационные эффекты в данном регионе/виде деятельности относительно велики. По мнению автора, измерение агломерационных эффектов на основе использования показателей, отражающих фактическое территориальное распределение экономических агентов, является некорректным. Для доказательства этой идеи рассмотрим более подробно вопросы размещения экономических агентов (производительных сил), с одной стороны, и пространственного распределения агломерационных эффектов, с другой.

2. Размещение производительных сил и агломерационные эффекты

Производительные силы, под которыми в данном случае понимаются немобильные (земля, природные ресурсы, здания, дороги и другие элементы инфраструктуры) и относительно немобильные (прежде всего рабочая сила) факторы производства, распределяются в пространстве неравномерно. Степень неравномерности зависит от вида деятельности, в котором задействованы производительные силы⁴.

Экономической причиной, лежащей в основе рассматриваемой неравномерности, являются различия в преимуществах, которые вслед за А. Маршаллом (Маршалл, 1920) принято называть внешними экономиями (по аналогии с внутренней экономией от масштаба производства) или агломерационными эффектами. Внешней эта экономия является потому, что она рождается за рамками каждой отдельной фирмы, в процессе взаимного дополнения фирмами друг друга. Если для максимизации внутренней экономии руководство фирмы должно ответить на вопросы, «сколько» и «как» производить, то для максимизации экономии внешней – «где располагаться?» и «с кем и как взаимодейство-

³ Справедливости ради необходимо отметить, что в рамках этой же методологии автор настоящей статьи исследовал тему выявления кластеров в регионах России (подробнее см. <http://promcluster.ru/index.php/cluster-map.html>). В данном исследовании развивался подход, предложенный первоначально М. Портером, а затем использованный в исследовании Европейской кластерной обсерватории (<http://www.clusterobservatory.eu/index.html>).

⁴ Традиционно выделяют торгуемые и местные виды деятельности. Под местным (local) видом деятельности понимается такой вид деятельности, занятость в котором пропорциональна численности населения. Характерной чертой местных видов деятельности является их ориентация преимущественно на местный спрос. Примерами таких видов деятельности являются общи медицинские услуги, бытовые услуги, неспециализированная розничная торговля, производство и реализация некоторых строительных материалов. В торгуемых (traded) видах деятельности занятость не пропорциональна численности населения и зависит от большого числа факторов, определяющих локализацию предприятий торгуемых отраслей. При этом такие отрасли, размещаясь гораздо более неравномерно, ориентированы на межрегиональную и международную торговлю. В качестве примеров можно привести самолетостроение, автомобилестроение, производство фильмов, металлургию, межрегиональный и международный туризм и др.

вать?»⁵. Как и внутренняя, внешняя экономия позволяет фирмам, которые ее получают, быть при прочих равных более производительными (и, следовательно, конкурентоспособными).

Как мы отметили ранее, на данный момент принято выделять два типа агломерационных эффектов: кластеризации (локализации, MAR-эффекты) и урбанизации. На самом деле под эффектами локализации и урбанизации понимается ряд внешних экономий. Каждая из таких экономий имеет разную значимость (вес) для различных видов деятельности. Некоторые из этих экстерналий легко интериоризируются фирмами (например, экономия на транспортных издержках), другие (прежде всего связанные с инновациями) – требуют определенных усилий. Более того, как и экстерналии других видов, агломерационные экстерналии могут быть не только положительными, но и отрицательными. В этом случае они представляют собой центробежные эффекты, заставляющие рациональную фирму покинуть данное местоположение и/или вид деятельности. Для примера рассмотрим направленность и типы внешних экономий, относящихся к эффекту локализации, т.е. рождающихся в процессе концентрации специализированных производительных сил (табл. 3).

Таблица 3

Направленность и тип внешних экономий, относящихся к эффекту локализации

Направленность внешней экономии Тип внешней экономии	Центростремительные эффекты	Центробежные эффекты
Производственная эффективность	– экономия на транспортных издержках (вследствие близости поставщиков и покупателей); – преимущества от развитого рынка труда; – преимущества совместного доступа к специализированной инфраструктуре (немобильной); – преимущества от разнообразия и специализации (в том числе снижение объема требуемого для организации бизнеса капитала, а также возможность использования специализированного оборудования)	– увеличение стоимости немобильных факторов производства (прежде всего земли, помещений, человеческих ресурсов)

⁵ Заметим, что внешняя экономия тесно связана с внутренней. Дело в том, что для предприятий, у которых высокая экономия на масштабе, острее всего проблема расположения. Экономия на масштабе более всего очевидна в видах деятельности, ориентированных на выпуск больших партий стандартизированной продукции, связанных со значительными инвестициями в специфические активы (инфраструктура, здания, оборудование). Как правило, это торгуемые виды деятельности, представленные крупным бизнесом (олигополии, естественные монополии и пр.). Вследствие эффекта масштаба такие предприятия заинтересованы концентрировать свои производства в минимальном числе регионов. Таким образом, для таких производств наиболее актуальной является задача поиска места с максимальными внешними выгодами.

Окончание таблицы 3

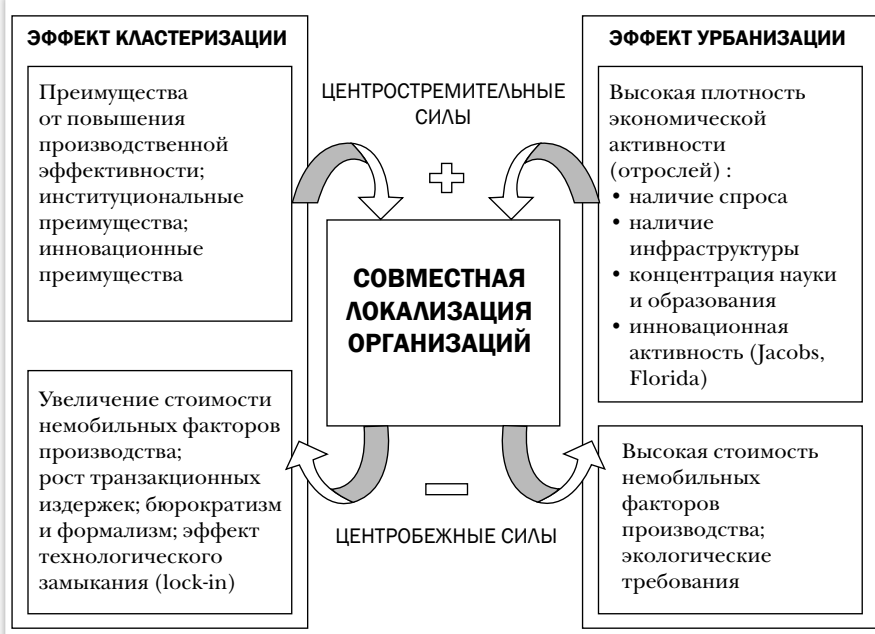
Направленность внешней экономии Тип внешней экономии	Центростремительные эффекты	Центробежные эффекты
Институциональ- ные преимущества	<ul style="list-style-type: none"> – снижение издержек получения новой информации о покупателях, контрагентах, конкурентах и их продукции; – снижение информационных транзакционных издержек вследствие институционализации взаимодействий; – снижение прочих транзакционных издержек вследствие существования развитого специализированного транзакционного сектора; – получение выгод от совместных проектов 	<ul style="list-style-type: none"> – устаревание институтов (которые перестают соответствовать новым реалиям), в том числе проблема бюрократизации, формализма; – рост транзакционных издержек (вследствие увеличения количества самостоятельных фирм в одной местности одной сферы деятельности); – увеличение стоимости местных транзакционных благ (прежде всего легальной и нелегальной защиты прав собственности, включая откуп от чиновников, бандитов и силовиков)⁶
Инновационные преимущества	<ul style="list-style-type: none"> – снижение издержек доступа к новым знаниям (вследствие того, что новые знания имеют значительную скрытую (tacit) часть и эффективно распространяются лишь путем личного контакта); – снижение издержек создания нововведений (вследствие распространения нового знания, концентрации его носителей); – увеличение скорости внедрения нововведений за счет формирования инновационного окружения; – увеличение инновационности фирм за счет «входящих» инноваций других фирм; – повышение инновационной активности вследствие повышенной конкуренции (отрицательный стимул) 	<ul style="list-style-type: none"> – эффект технологической блокировки (lock-in)

Источник: по данным автора.

⁶ Очень часто успешное развитие кластера приводит к тому, что он привлекает особое внимание и интерес людей, которые специализируются на распределительной деятельности, что приводит, по сути, к разграблению и исчезновению этого кластера. Историк Дж. Мокир обобщает эту закономерность, вводя понятие отрицательной институциональной обратной связи: «Отрицательная институциональная обратная связь охватывает политические и социальные изменения, выступающие результатом экономического роста, который идет на спад или даже меняет направление на противоположное. На протяжении большей части истории однозначно наблюдалась тенденция, согласно которой грабители и туеядцы слетались на богатство, извлекаемое из экономического роста, как мухи на мед. Успешные в торговом и промышленном отношении регионы (например, Северная Италия, Нидерланды, Бельгия и Люксембург) и группы (например, евреи и меннониты с рейнских земель) возбуждали зависть и жадность менее удачливых или не столь обеспеченных ресурсами соседей. Предприимчивость, усердие и изобретательность создавали внутри групп возможности для рентоориентированного поведения субъектов, которые находили политику или насилие более прибыльными, чем усердная работа. Региональный успех, торговый и финансовый, манил сборщиков налогов, пиратов, захватчиков и склонных к банкротству заемщиков. Вместе с тем он порождал (в почти диалектической манере) средства своей собственной гибели. Наиболее явной формой отрицательной институциональной отдачи до 1815 г. стала, несомненно, война. Часто экономический рост коварно провоцировал эти конфликты» (Мокир, 2006, с. 8).

Среди преимуществ, связанных с урбанизацией, выделяют развитую городскую инфраструктуру; относительно большой рыночный потенциал, формируемый со стороны фирм различных видов деятельности; непосредственную близость научных и образовательных учреждений. Классическим эффектом урбанизации являются инновационные преимущества, связанные с перекрестной диффузией инноваций, когда множество различных видов деятельности формирует необходимый уровень разнообразия для инноваций⁷.

Центростремительные и центробежные эффекты кластеризации и урбанизации представлены на рисунке.



Рисунок

Центростремительные и центробежные эффекты, влияющие на пространственное распределение хозяйствующих субъектов

Эффекты кластеризации и урбанизации могут по-разному влиять на различные виды деятельности. Компании в одних из них более подвержены эффектам урбанизации, в других – эффектам кластеризации. Существует гипотеза, согласно которой эффект урбанизации более значим для новых высокотехнологичных видов деятельности. Данным видам деятельности требуется высокодиверсифицированное городское окружение. В процессе взросления отрасли знания в ней формализуются, технологии стандартизируются, а зависимость от новых идей падает. В этой связи стоимость расположения в городе становится неоправданной, более значимым будет эффект кластеризации. Вследствие этого предприятия в зрелых отраслях перемещаются

⁷ Таким образом, люди и фирмы в совершенно разных видах деятельности обогащают друг друга новыми идеями, возможно, даже осознанно не ставя перед собой таких целей.

в города, меньшие по размеру и более специализированные экономически (Duranton, Puga, 2001; Neffke, Henning, Boschma et al., 2008). Попытки эмпирически проверить эту гипотезу дали противоречивый результат⁸.

Как бы то ни было, считается, что именно суммарный агломерационный эффект (эффекты локализации плюс эффекты урбанизации) определяет уровень концентрации производительных сил в определенном виде деятельности в определенном регионе. А изменения в агломерационных эффектах должны вызывать соответствующие изменения в размещении производительных сил.

3. Причины устойчивости территориального размещения производительных сил

В результате ряда событий (научно-технический прогресс, резкое снижение транспортных издержек, включение страны в ВТО и пр.) относительная привлекательность региона для предприятий может измениться (предположим, сойти на нет). Это означает снижение относительного агломерационного эффекта в определенном виде деятельности / регионе. Данные изменения, как мы уже указали, должны привести к соответствующему изменению в размещении производительных сил. В рассматриваемом случае фирмы должны покинуть данный регион и/или вид деятельности и переместиться в регион и/или вид деятельности, где суммарный агломерационный эффект выше. Однако в реальности не стоит торопиться делать такие прогнозы: изменения в размещении производительных сил связаны с издержками и осуществляются достаточно медленно, с большим временным лагом.

Наиболее актуальными в настоящее время для многих видов деятельности являются инновационные преимущества от агломерации (см. табл. 3). Однако инновационные преимущества краткосрочны, поэтому их необходимо постоянно поддерживать. И даже в этом случае агломерация, в которой находится фирма, с течением времени может начать тормозить ее инновационное развитие⁹.

⁸ С одной стороны, действительно, множество промышленных стандартизированных видов деятельности (текстильная промышленность, металлургия, автомобильная промышленность, лесоперерабатывающая промышленность) располагается неравномерно, тяготея к небольшим специализированным городам (Black, Henderson, 2003). А такие виды деятельности, как производство дизайнерской одежды, издательская и типографская деятельность, финансовые и бизнес-услуги, исследовательская деятельность, наоборот, располагаются преимущественно в больших городах (Kolk, 1999). Исследования В. Хендерсона с коллегами 1995 г. в целом подтвердили эту гипотезу (точнее, были обнаружены значимые положительные MAR-эффекты для зрелых отраслей, а также значимые положительные MAR-эффекты и Джейкобс-эффекты в отношении новых отраслей (Henderson, Kuncoro, Turner, 1995)).

⁹ Существует гипотеза, согласно которой географически сконцентрированные фирмы демонстрируют непропорционально высокий уровень инновационной активности на этапе роста отрасли. И наоборот. Компании, не входящие в кластеры, более инновационны на более поздних стадиях развития отрасли (Menzel, Fornahl, 2007, p. 5). Причиной упадка инновационной активности является недостаток разнообразия в кластере, который не дает возможности возникнуть новым идеям. С течением времени интеллектуальные модели (mental model) поведения совместно локализованных игроков все в большей степени приближаются и фокусируются на успешной в прошлом траектории. Возникает эффект блокировки. Эмпирические исследования показали, что технологическое разнообразие (heterogeneity) существует на разных этапах жизненного цикла отрасли, однако пространственное размещение этого разнообразия меняется: в рамках штата на ранних этапах жизненного цикла и между штатами на этапе зрелости. Другими словами, компании постепенно сходятся в сфере технологий в рамках штата и остаются разнородными при межрегиональных сравнениях (Rigby, Essletzbichler, 2006).

Поэтому в реальной жизни возможны ситуации, когда суммарный агломерационный эффект является отрицательным, однако географическая концентрация фирм в определенной сфере деятельности продолжает существовать. Возможна и обратная ситуация, когда новые возможности (в плане экономии на производственных издержках, получения институциональных и инновационных преимуществ) не используются, так как не поддерживаются процессами перемещения производительных сил.

Несмотря на существование рыночной экономики (даже если бы мы находились в ситуации совершенной конкуренции), территориальное размещение производительных сил может оказаться устойчиво неоптимальным. При этом «выбраться» из этой ситуации в краткосрочном периоде практически невозможно.

Описанная ситуация, по мнению автора, очень похожа на зависимость от предшествующего развития (эффект колеи) (David, 1985; Arthur, 1994; Margolis, Liebowitz, 1998). Данная зависимость была выявлена для технологий и институтов. Однако она также хорошо описывает процессы инерции в размещении производительных сил. То есть первоначальное, зачастую достаточно случайное размещение является устойчивым и с трудом изменяется, даже если оно со всей очевидностью становится неэффективным.

В табл. 4 рассмотрены факторы, объясняющие устойчивость неэффективных равновесий в отношении технологий, институтов, а также пространственного размещения¹⁰.

Таблица 4

Факторы зависимости от предшествующего развития (эффекта колеи)

Факторы зависимости от предшествующего развития (в сфере технологий)	Факторы зависимости от предшествующего развития (в сфере институтов)	Факторы зависимости от предшествующего развития (в сфере пространственного размещения)
Техническая взаимозависимость	Институциональная взаимозависимость	Взаимозависимость специализированных производительных сил
Рост отдачи от масштаба	Сетевые эффекты	Рост внешней экономии при увеличении концентрации производительных сил
Долговечность капитального оборудования (квази необратимость инвестиций)	Квази необратимость первичной социализации (или социального капитала)	Квази необратимость первичного территориального размещения
Неравномерность роста отдачи технологии	Неравномерность роста отдачи института	Неравномерность роста внешней экономии

Источники: Латов, 2005; в последнем столбце – выводы автора.

¹⁰ В основе данного рассмотрения лежат классические причины Path Dependency, касающиеся технологий. Их интерпретация в отношении институтов предложена Ю.В. Латовым (Латов, 2005). Автор, в свою очередь, добавляет интерпретацию этих причин в отношении пространственного размещения.

Рассмотрим описанные в таблице факторы подробнее.

Взаимозависимость специализированных производительных сил. Фирма (особенно производственная) находится не в вакууме, она тесно взаимодействует со специализированной инфраструктурой, специализированными поставщиками, специализированной рабочей силой. Такую фирму тяжело вырвать из ее окружения (кластера). Перемещение одной фирмы может быть невозможно или затруднено без перемещения всего окружения. Здесь также часто накладывается и технологическая взаимозависимость (так как локализованные фирмы в связанных видах деятельности скорее всего выпускают технологически совместимую продукцию). Однако технологическая взаимозависимость не объясняет полностью взаимозависимость локализованных производительных сил. Важной может оказаться культурная, языковая общность, одно (похожее) образование, общий социальный капитал, включенность в систему личных связей (например, наличие семьи и друзей снижает мобильность рабочей силы).

Рост внешней экономии при увеличении концентрации производителей сил. Внешняя экономия, получаемая совместно локализованными предприятиями, растет при увеличении числа этих предприятий. Так, П. Кругман указывает, что фирма, размещая свое производство на территории с максимальным рыночным потенциалом, в свою очередь, увеличивает рынок для своих поставщиков. Возникает так называемый кумулятивный процесс – наличие одних отраслей увеличивает рыночный потенциал для других отраслей (Krugman, 1992, р. 7–9)¹¹. Дело, конечно, не только в рыночном потенциале. Очевидно, что концентрация фирм в определенной отрасли связана также с развитием специализированных инфраструктур, привлечением поставщиков, квалифицированной рабочей силы. Это факторы способствуют внешней экономии и, таким образом, повышению производительности совместно локализованных фирм.

Даже если концентрация фирм потеряла со временем инновационные конкурентные преимущества (в результате технологической блокировки), вполне возможно, что масштабы самой концентрации позволяют получать значительную внешнюю экономию других типов, прежде всего связанную с экономией издержек производства. В этом случае локализованные фирмы будут следовать естественной для них стратегии ценового лидерства. Если такая продукция (низкое качество при низкой цене) востребована рынком, то такая концентрация может существовать и даже развиваться на фоне того, что существуют более эффективные (с точки зрения долгосрочных конкурентных преимуществ) формы территориального размещения.

Квазинеобратимость первичного территориального размещения. Стабильность территориального размещения во многом связана с тем, что последнее предполагает инвестиции в недвижимость. При этом (и это важно) речь идет не о покупке квартиры или дачи

¹¹ Это логика как раз объясняет устойчивость северного промышленного пояса в США, с одной стороны, и устойчивое отставание южных штатов, с другой.

(относительно ликвидное вложение), а об инвестициях в специфические активы (строительство заводов, специализированной инфраструктуры, монтаж тяжелого оборудования и пр.), т.е. активов, альтернативное использование которых гораздо менее выгодно и связано с большими потерями.

Конечно, в некоторой конкретной ситуации (исходя из соотношения выгод и затрат, а также специфичности активов) фирма вполне может поменять местоположение, купив или построив завод¹² в другом месте. Однако в масштабах всей экономики такая мобильность ограничена¹³. Скорее всего предприятия будут менять свое местоположение лишь после того, как специфические инвестиции, сделанные при их местоположении, будут амортизированы. Заметим, что продолжительность службы промышленных и непромышленных зданий и сооружений лежит в основе выделенных Н.Д. Кондратьевым длинных волн экономической конъюнктуры. Таким образом, радикальное изменение в размещении производительных сил общества возможно раз в 50–70 лет. В современных условиях скорее всего эти сроки сократились, но они все равно остаются весьма продолжительными.

Неравномерность роста внешней экономики. В ситуации, когда существуют конкурирующие регионы со схожей специализацией, довольно сложно определить, какой из них окажется перспективнее в будущем. Более того, разные внешние эффекты (центростремительные силы) могут постепенно терять свою актуальность. Поэтому рациональный выбор с течением времени может привести к неоптимальному размещению производительных сил. На самом деле, конечно, это не причина самоподдержания технологий и институтов, а, скорее, объяснение того, почему люди ошибаются в выборе наилучшей технологии или института для внедрения (т.е. почему они попадают в ловушку зависимости от предшествующего развития). Данный вопрос представляет самостоятельный интерес. Его мы рассмотрим в заключительной части нашей статьи.

4. Возможные причины провалов рынка в сфере пространственного размещения производительных сил

Итак, мы рассмотрели причины того, почему изменения существующего территориального размещения производительных сил подвержены значительной инерции. Помимо этого большой интерес представляет поиск причин того, почему территориальное размещение вдруг оказалось неоптимальным (т.е. несоответствующим центростремительным и центробежным силам). Важно понять не только то, почему существующую неоптимальную ситуацию сложно изменить, но и то, как в эту неоптимальную ситуацию чаще всего попадают.

¹² Предположим, речь идет именно о промышленном производстве, а не о производстве услуг (например, информационных или консалтинговых). В последнем случае смена местоположения связана с меньшими издержками, поэтому производительные силы являются более мобильными.

¹³ Понятно, что если все экономические агенты решат уехать из какого-то места, то стоимость объектов, которые они продают, может очень существенно упасть, а стоимость объектов, которые нужно купить на новом месте, либо стоимость строительства на этом новом месте, наоборот, может существенно вырасти.

По мнению автора, существует несколько фундаментальных причин.

1. Ошибки в оптимизации. В этом случае фирма, осуществляющая размещение, учитывая факторы внешней экономии, тем не менее размещает производительные силы неоптимальным образом. Теоретически данная причина является следствием фундаментальной неопределенности и ограниченной рациональности экономических агентов. Фирмы и люди могут не обладать всей информацией о конкретных внешних эффектах, характерных для той или иной территории, и об их точных размерах. Соответственно в условиях неопределенности решения экономических агентов могут быть неоптимальными.

В некоторых случаях данный провал рынка становится провалом государства, когда последнее занимается размещением производительных сил. Именно такая ситуация наблюдалась в Советском Союзе. Обращаясь к опыту СССР, необходимо отметить, что в общем в то время размещение происходило достаточно рационально и близко к оптимальному (с точки зрения актуальной на тот момент экономии на производственных издержках). Однако были и ошибки. Не отвлекаясь на частные случаи, отметим системную проблему. В СССР предприятия не учитывали в своих издержках цену земли, на которой они располагались (Gregory, Stuart, 1998, p. 133). Вследствие этого недооценивались центробежные эффекты, связанные с ценой земли, зданий и сооружений. Примерами такой недооценки является размещение крупных промышленных предприятий в центре города Москвы. Поскольку цена земли не учитывалась, а транспортные издержки при таком размещении относительно небольшие (в силу близости рынка), то такие предприятия, можно предположить, были планомерно прибыльными. В современной России данные предприятия либо разорились, либо увидели, что сдача помещений и земли в аренду более прибыльна, чем собственная производственная деятельность.

2. Несоответствия территориального размещения существующим центростремительным и центробежным силам заключаются в изменении приоритетных типов внешней экономии. Оптимальное размещение производительных сил может оказаться неоптимальным в случае изменения приоритетов.

Возвращаясь к примеру Советского Союза, отметим, что государство, принимая решение о размещении производства, ориентировалось прежде всего на экономию производственных издержек. Однако в современной экономике на первый план постепенно выходят инновационные преимущества. С точки зрения этого критерия доставшееся нам в наследство размещение производительных сил зачастую является неэффективным.

3. Изменение макроэкономических факторов. Радикальное изменение макроэкономического фона происходит, как правило, в результате изменения границ государства, изменения в балансе сил

между региональными и федеральными властями, включения страны в различные группы стран по экономическим причинам. Например, в СССР размещение производительных сил планировалось исходя из существующих на тот момент размеров страны. Когда же страна развалилась, то оказалось, что размещение производительных сил неоптимально с точки зрения множества суверенных государств. Связанные производственными цепочками предприятия оказались в различных государствах, в различных налоговых, административных и прочих условиях, что сильно затруднило сотрудничество.

Ослабление федеральных властей России в 1990-е годы привело к фрагментации рынка страны, когда каждый регион оказывал преференции своим производителям и усложнял условия для «чужих». Стремление оптимизировать территориальное размещение производительных сил в рамках одного отдельного региона находится в противоречии с задачей оптимизации такого размещения в масштабах страны.

Включение страны в различные международные экономические союзы расширяет возможности оптимизации размещения производительных сил. Однако вместе с тем возникают существенные риски того, что страна потеряет привлекательность для размещающих свои производства фирм по многим перспективным и стратегически важным видам деятельности¹⁴.

4. Рационально действующая фирма отказывается от оптимизации своего размещения, так как это требует коллективного действия в условиях высоких транзакционных издержек. Эту проблему описывает Г. Дурантон (Duranton, 2009, p. 14), называя ее проблемой координации (хотя ее также можно назвать проблемой коллективного действия).

Предположим, что фирма размещена неоптимально. Пусть концентрация производительных сил, к которой относится фирма, будет больше оптимального размера (т.е. центробежные силы, связанные с ценами на землю, недвижимостью, заработными платами персонала, больше, чем центростремительные). Пусть альтернативные концентрации также характеризуются неоптимально большим размером. В этой ситуации было бы рационально повысить равномерность распределения производительных сил (фирм) в данной сфере деятельности, уменьшив размер концентраций и увеличив их число.

Однако каждая фирма в отдельности (или каждый занятый) не захочет одна переехать в другое место с целью формирования новой концентрации производительных сил, так как первоначально эта концентрация будет слишком небольшой и не сможет генерировать необходимую внешнюю экономию (тогда как переезд потребует затрат). Для формирования новой концентрации или оптимизации уже существующих размеров необходимы согласованные действия множества фирм и людей. Индивидуальные, несогласованные действия каж-

¹⁴ Так, например, формирование ЕС и продолжающаяся до сих пор экономическая интеграция европейских стран расширяют границы относительно однородного макроэкономического пространства, на котором хозяйствующие субъекты размещают свои производства исходя из существующих агломерационных эффектов. Тем самым происходит усиление формирующихся и существующих европейских кластеров за счет территорий с менее значимыми центростремительными эффектами.

дой фирмы неэффективны. Более того, может так получиться, что издержки по согласованию коллективного действия со стороны инициативной фирмы превысят будущие выгоды этого экономического агента от повышенной внешней экономии вследствие оптимизации территориального размещения.

Заключение

Несмотря на то что агломерационные эффекты, безусловно, фундаментально определяют территориальное размещение производительных сил, тем не менее может существовать значительное несоответствие между агломерационными эффектами и размещением производительных сил. Можно сказать, что в долгосрочной перспективе наблюдается полное соответствие между размещением производительных сил и агломерационными эффектами и никаких провалов рынка нет. Однако в реальной жизни мы постоянно находимся «в краткосрочном периоде», в котором чаще всего такое соответствие не наблюдается.

Вместе с тем в современных эмпирических работах, посвященных оценке агломерационных эффектов, этот факт не принимается во внимание: агломерационные эффекты по-прежнему оцениваются на основе использования показателей, отражающих фактическое территориальное распределение экономических агентов. Это приводит к тому, что в анализ включаются пространственные концентрации производительных сил, не отражающие значительные положительные агломерационные эффекты. В итоге полученные оценки смещаются в сторону занижения влияния агломерационных эффектов на показатели инновационной активности и экономического благосостояния.

Таким образом, полученные многими исследователями результаты о слабом влиянии агломерационных эффектов не могут считаться удовлетворительными, а сделанные политические выводы являются поспешными.

Литература

- Латов Ю.В.** (2005). Мы живем не в лучшем из миров! (популярное изложение QWERTY-номики и исследований Path Dependence). [Электронный ресурс] Материалы конференции «20 лет исследования QWERTY-эффектов и зависимости от предшествующего развития», Москва. Режим доступа: <http://ecsocman.edu.ru/text/16213114/>, свободный. Загл. с экрана. Яз. рус. (дата обращения: февраль 2012 г.).
- Маршалл А.** (1920). Принципы экономической науки. [Электронный ресурс] Режим доступа: http://www.gumfak.ru/econom_html/marshall/marsh31.shtml, свободный. Загл. с экрана. Яз. рус. (дата обращения: апрель 2012 г.).
- Мокир Дж.** (2006). Меркантилизм, Просвещение и Промышленная революция. [Электронный ресурс] // *Экономический вестник Ростовского государственного университета*. Т. 4. № 1. Режим доступа: <http://ecsocman.edu>.

ru/data/180/879/1219/journal4.1-2.pdf, свободный. Загл. с экрана. Яз. рус. (дата обращения: апрель 2012 г.).

- Almeida R.** (2005). Local Economic Structure and Growth. World Bank Policy Research Working Paper 3728.
- Anastassova L.** (2006). Productivity Differences and Agglomeration Across Districts of Great Britain. Working paper series (ISSN 1211–3298).
- Arthur W. B.** (1994). Increasing Returns and Path Dependence in the Economy. Ann Arbor: University of Michigan Press.
- Baptista R., Swann G.M.P.** (1999). A Comparison of Clustering Dynamics in the US and UK Computer Industries // *J. of Evolutionary Econ.* Vol. 9(3). P. 373–399.
- Beaudry C., Schiffauerova A.** (2009). Who's Right, Marshall or Jacobs? The Localization Versus Urbanization Debate // *Research Policy.* Vol. 38. P. 318–337.
- Black D., Henderson J.V.** (2003). Urban Evolution in the US // *J. of Econ. Geography.* Vol. 3 (4). P. 343–372.
- Combes P.-P.** (2000). Economic Structure and Local Growth: France, 1984–1993 // *J. of Urban Econ.* Vol. 47(3). P. 329–355.
- David P.A.** (1985). Clio and the Economics of QWERTY // *American Econ. Rev.* Vol. 75. № 2.
- Duranton G.** (2009). California Dreamin': The Feeble Case for Cluster Policies. [Электронный ресурс] Working paper. Режим доступа: <http://individual.utoronto.ca/gilles/Papers/Cluster.pdf>, свободный. Загл. с экрана. Яз. англ. (дата обращения: апрель 2012 г.).
- Duranton G., Puga D.** (2001). Nursery Cities // *American Econ. Rev.* Vol. 91. P. 1454–1477.
- Feldman M.P., Audretsch D.B.** (1999). Innovation in Cities: Science-Based Diversity, Specialization and Localized Competition // *European Econ. Rev.* Vol. 43(2). P. 409–429.
- Gao T.** (2004). Regional Industrial Growth: Evidence from Chinese Industries // *Regional Science and Urban Econ.* Vol. 34(1). P. 101–124.
- Glaeser E.L., Kallal H.D., Scheinkman J.A.** et al. (1992). Growth in cities // *J. of Political Econ.* Vol. 100(6). P. 1126–1152.
- Gregory P.R., Stuart R.C.** (1998). Russian and Soviet Economic Performance and Structure. Chicago: Addison-Wesley Longman, Inc.
- Greunz L.** (2004). Industrial Structure and Innovation – Evidence from European Regions // *J. of Evolutionary Econ.* Vol. 14(5). P. 563–592.
- Groot H. de, Poot J., Smit M.J.** (2009). Agglomeration Externalities, Innovation and Regional Growth: Theoretical Perspectives and Meta-Analysis. In: «*Handbook of Regional Growth and Development Theories*» Capello R., Nijkamp P. (eds.). Cheltenham: Edward Elgar.
- Henderson V.** (2003). Marshall's Scale Economies // *J. of Urban Econ.* Vol. 53. P. 1–28.
- Henderson V., Kuncoro A., Turner M.** (1995). Industrial Development in Cities // *J. of Political Econ.* Vol. 103 (5). P. 1067–1090.
- Kolko J.** (1999). Can I Get Some Service Here? Information technology. Service industries, and future cities. Mimeo. Harvard University.
- Krugman P.A.** (1992). Dynamic Spatial Model. [Электронный ресурс] NBER Work-

- ing paper series (Working paper № 4219). Режим доступа: <http://math.stanford.edu/~lekheng/krugman/nber/w4219.pdf>, свободный. Загл. с экрана. Яз. англ. (дата обращения: апрель 2012 г.).
- Lindqvist G.** (2009). *Disentangling Clusters: Agglomeration and Proximity Effects*. Dissertation for the Degree of Doctor of Philosophy, Ph.D. Stockholm: Stockholm School of Economics.
- Margolis S.E., Liebowitz S.J.** (1998). Path Dependence. In: «*The New Palgrave Dictionary of Economics and Law*». Ed. by P. Newman. L.: Macmillan.
- Martin P., Mayer T., Mayneris F.** (2008). Spatial Concentration and Firm-Level Productivity in France. [Электронный ресурс] CEPR Discussion paper N 6858. Режим доступа: <http://idea.uab.es/worcogeo/54.pdf>, свободный. Загл. с экрана. Яз. англ. (дата обращения: апрель 2012 г.).
- Menzel M.-P., Fornahl D.** (2007). Cluster Life Cycles – Dimensions and Rationales of Cluster Development. [Электронный ресурс] Jena Economic Research Papers. Режим доступа: <http://www.papers.ssrn.com>, свободный. Загл. с экрана. Яз. англ. (дата обращения: апрель 2012 г.).
- Neffke F., Henning S. M., Boschma R.** et al. (2008). Who Needs Agglomeration? Varying Agglomeration Externalities and the Industry Life Cycle. Working Paper, Utrecht University, the Netherlands.
- Paci R., Usai S.** (1999). Externalities, Knowledge Spillovers and the Spatial Distribution of Innovation // *Geojournal*. Vol. 49(4). P. 381–390.
- Porter M.** (2003). The Economic Performance of Regions // *Regional Studies*. Vol. 37(6–7). P. 549.
- Rigby D. L., Essletzbichler A.** (2006). Technological variety, Technological Change and a Geography of Production Techniques // *J. of Econ. Geography*. Vol. 6. P. 45–70.
- Shefer D.** (1973). Localization Economies in SMA's: A Production Function Analysis // *J. of Urban Econ.* Vol. 13(1). P. 55–64.
- Sveikauskas L. A.** (1975). The Productivity of Cities // *Quarterly J. of Econ.* Vol. 89(3). P. 393–413.
- Vorobyev P.V., Kislyak N.V., Davidson N.B.** (2010). Spatial Concentration and Firm Performance in Russia. Kiev: EERC.

Поступила в редакцию 16 января 2012 года

E.S. Kutsenko

Institute for Statistical Studies and Economics of Knowledge,
National research university Higher School of Economics, Moscow

Path Dependence in Spatial Distribution of Economic Activity: Bad News for Empiric Research of Agglomeration Effects

It is considered that concentrations of economic activity in the market economy are formed according to the balance of agglomeration effects. Actually this scientific idealization is far from a reality. Agglomeration effects change much faster, than spatial distribution of economic activity. This phenomenon can be well described by the path dependency theory.

Despite such problems it is supposed in empirical papers that concentration of the enterprises or employment is a good proxy variable for agglomeration effects.

Keywords: *spatial distribution of economic activity, agglomeration effects, path dependency.*

JEL Classification: R12, O12, B0, O30.

Е.Р. Горяинова

НИУ ВШЭ, Москва

Т.И. Слепнёва

МАИ, Москва

Методы бинарной классификации объектов с номинальными показателями

Рассматривается задача классификации респондентов на классы принимающих и не принимающих участие в благотворительных пожертвованиях. Построено оптимальное (в байесовском смысле) решающее дискриминантное правило разделения объектов на два класса в условиях, когда все признаки наблюдаемых объектов измеряются в номинальной шкале и между этими признаками есть зависимости. Методами ROC-анализа проведено сравнение разработанного классификатора с «наивным» байесовским классификатором, классификатором, основанным на методе опорных векторов, а также с реализованными в пакете SPSS классификаторами, использующими бинарную логистическую регрессию и дискриминантное правило Фишера. Результаты ROC-анализа показали, что предложенное правило имеет более высокое качество классификации респондентов, чем все перечисленные выше правила.

Ключевые слова: дискриминантный анализ, решающее правило, байесовское решение, линейное правило Фишера, бинарная логистическая регрессия, метод опорных векторов, ROC-кривая, показатель AUC.

Классификация JEL: C38, Z13.

Введение

Задача дискриминантного анализа – это задача классификации объектов, каждый из которых характеризуется многомерным показателем X по двум (или нескольким) классам. При этом требуется, чтобы каждый класс был представлен своими типичными объектами. Набор показателей типичных представителей классов называется *обучающей выборкой*. Используя ее, надо построить правило дискриминации, которое позволяет распознавать, к какому классу относится объект, не вошедший в обучающую выборку. Такие задачи актуальны для экономических исследований, например при классификации стран или предприятий по их экономическим показателям. Известно об успешном решении таких задач в медицине при классификации пациентов на классы здоровых и больных (Zweig, Campbell, 1993; Schlisterman, Perkins, Li, 2005), в политологии при классификации сенаторов по фракциям по итогам их голосования (Ким, Мьюллер, Клекка, 1989, с. 84–87) и в психологии. В последнее время методы дискриминантного анализа стали активно применяться в кредитном скоринге при классификации предполагаемых заемщиков банка на кредитоспособных и некредитоспособных (Паклин, Орешков, 2010).

Известно оптимальное (в минимаксном и байесовском смысле) решение такой задачи в случае, когда закон распределения совокупности показателей X для каждого класса является многомерным гауссов-

ским (Ивченко, Медведев, 2010, глава 7; Дронов, 2003, глава 9). Этим решением является прогностическое правило Фишера. Несмотря на то что данное правило оптимально для нормальной модели, его часто используют и в ситуациях, когда семейство распределений показателей X неизвестно.

Однако если такое правило можно реализовать в случаях, когда распределение показателей X «похоже» на гауссовское, то в ситуациях, когда наблюдения характеризуются показателями, измеренными в номинальной шкале, это правило неприемлемо. Это связано с тем, что переменные, измеренные в номинальной шкале (например, регион проживания, пол или род деятельности респондента), несравнимы. Важно отметить, что любые показатели, которые измеряются в количественной шкале, могут быть переведены в номинальную шкалу. Например, возраст респондента можно измерять не годами, а категориями: младшая (18–34 года), средняя (35–54 года) и старшая (55 и более лет) возрастные группы. Более того, часто возникают ситуации, когда респонденты не готовы или отказываются указать такой количественный показатель, как размер доходов семьи, однако готовы сказать, к какой категории, описывающей материальное положение семьи, они могут себя отнести. Поскольку при проведении социологических и психологических исследований большая часть показателей измеряется в качественной шкале, то в этой ситуации оптимальное решающее дискриминантное правило будет отличаться от правила Фишера.

В работе (Ивченко, Медведев, 2010, глава 7) показано, что построение оптимального решения в случае произвольного распределения показателя X представляется достаточно сложным. Однако показатели, измеренные в номинальной шкале, могут быть описаны многомерным полиномиальным распределением. Это обстоятельство позволяет найти оптимальное в байесовском смысле решение задачи. Байесовское правило, построенное в предположении независимости компонент вектора показателей X , получило в теории машинного обучения название «наивного» байесовского классификатора (Mirkin, 2011). В задаче, которая рассматривается в данной работе, некоторые компоненты вектора X являются зависимыми.

Помимо байесовского оптимального решения следует отметить еще два подхода к решению задачи классификации – метод опорных векторов Вапника (Vapnik, 1995) и метод логистической регрессии, позволяющий оценивать условную вероятность принадлежности объекта к классу при заданных значениях показателя X (Hosmer, Lemeshov, 2000).

Все обсуждаемые в этой работе методы относятся к линейным алгоритмам классификации.

Работа имеет следующую структуру. В разд. 1 описана задача разделения респондентов на классы принимающих и не принима-

ющих участие в благотворительных пожертвованиях (по данным Центра исследований гражданского общества и некоммерческого сектора НИУ ВШЭ). В разд. 2 дана математическая постановка описанной социологической задачи, кратко представлены такие известные линейные классификаторы, как дискриминантное правило Фишера, классификатор, использующий бинарную логистическую модель, метод опорных векторов Вапника и «наивный» байесовский классификатор. Затем в разд. 2.6 построено оптимальное (в байесовском смысле) решающее правило классификации объектов с номинальными зависимыми признаками. В разд. 3 решена задача классификации респондентов с помощью описанных в разд. 2 решающих правил, обсуждены достоинства и недостатки рассматриваемых классификаторов в данной задаче. В разд. 4 методами ROC-анализа проведен сравнительный анализ качества классификации построенного правила, учитывающего зависимость компонент вектора показателей, с правилами, рассмотренными в разд. 2.

1. Классификация респондентов на группы участвующих и не участвующих в благотворительных пожертвованиях

Центром исследований гражданского общества и некоммерческого сектора НИУ ВШЭ была разработана анкета (Мерсиянова, Якобсон, 2009), состоящая из более чем ста вопросов, характеризующих социально-демографическое положение и качество жизни респондента, его отношение к благотворителям и благотворительной деятельности. Затем была составлена репрезентативная выборка из 1600 респондентов и проведен социологический опрос. Теперь по результатам опроса необходимо построить такое классифицирующее правило, которое по социально-демографическим характеристикам респондента позволило бы определить его принадлежность (или непринадлежность) к группе людей, принимающих участие в благотворительных пожертвованиях. Отметим, что аналогичную классификацию можно провести, используя в качестве характеристик респондента показатели качества его жизни (например, удовлетворенность жизнью в целом, семьей, работой, досугом, друзьями). Однако смешение в одной модели объективных социально-демографических характеристик и субъективных характеристик качества жизни нецелесообразно.

Обозначим через K_1 – класс респондентов, участвующих в благотворительных пожертвованиях, а через K_2 – не участвующих. В качестве ключевой переменной, определяющей разделение респондентов на классы, выберем переменную Y , которая будет принимать значение «класс K_1 », если респондент на вопрос анкеты: «Как часто за последние 2–3 года вам приходилось делать благотворительные пожертвования, лично давать незнакомым нуждающимся людям, включая просящих милостыню, деньги?» – давал ответ: 1) «занимаюсь этим посто-

янно»; 2) «занимался этим несколько раз»; 3) «занимался этим один раз»; и значение «класс K_2 », если респондент давал ответ «не делал» или «затрудняюсь ответить».

Первый важный шаг при проведении классификации – это отбор показателей, которые являются наиболее специфичными для качественного разделения на классы. Очевидно, что включение в дискриминантное решающее правило малоинформативных переменных не только усложняет вычисления, но может и заметно ухудшить качество классификации, так как каждый малоинформативный показатель несет в себе достаточно большую долю «шума». В качестве информативных показателей целесообразно выбрать переменные, распределение которых в классах K_1 и K_2 сильно различается. Другими словами, эти переменные имеют значимую статистическую связь с переменной Y , определяющей принадлежность респондента к классу. Для выявления зависимости между номинальными переменными применим критерий χ^2 . Используя процедуру пакета SPSS, получаем, что на уровне значимости менее 0,001 отвергнута гипотеза о независимости переменной Y с переменными X_1 (пол респондента), X_2 (тип населенного пункта, в котором проживает респондент), X_3 (федеральный округ проживания), X_4 (возраст респондента), X_5 (образование респондента).

Интересно отметить, что гипотезу о независимости Y и переменной «материальное положение» можно отвергнуть только на уровне значимости 0,102. Поэтому можно сказать, что материальное положение не является той характеристикой, которая определяет желание респондента совершать благотворительные пожертвования. Результаты теста χ^2 представлены в табл. 1. В последнем столбце приведены коэффициенты Крамера, измеряющие силу связи показателей с переменной Y .

Таблица 1

Результаты теста χ^2

Признаки	Значение статистики	Число степеней свободы, l	Значение квантили $\chi^2_{0,95}(l)$	Уровень значимости, которому соответствует вычисленное значение статистики	Значение коэффициента Крамера
Пол респондента	11,684	1	3,84	< 0,001	0,085
Тип населенного пункта	18,293	4	9,49	< 0,001	0,107
Федеральный округ	32,213	6	12,59	< 0,001	0,142
Возраст	24,418	2	5,99	< 0,001	0,124
Образование	24,906	3	7,81	< 0,001	0,125

Итак, в результате отбора признаков классификация респондентов будет проводиться по следующим переменным, градации (категории) которых указаны в скобках:

- 1) пол респондента (мужской, женский);
- 2) тип населенного пункта (Москва или Санкт-Петербург; город с населением более 500 тыс. человек; город с населением 100–500 тыс. человек; город с населением менее 100 тыс. человек; село);
- 3) федеральный округ проживания (Центральный федеральный округ; Северо-Западный федеральный округ; Южный федеральный округ; Приволжский федеральный округ; Уральский федеральный округ; Сибирский федеральный округ; Дальневосточный федеральный округ);
- 4) возраст (младшая возрастная группа 18–35 лет; средняя возрастная группа 36–54 года; старшая возрастная группа 55 лет и старше);
- 5) образование (ниже среднего; среднее общее; среднее специальное; высшее).

Отметим также, что помимо определения дискриминантных признаков при помощи критерия χ^2 можно прибегнуть и к экспертному выбору набора показателей, а после проведения классификации исследовать однородность каждого показателя во вновь полученных классах. Если распределение некоторого показателя не имеет статистически значимого различия в классах, то можно сделать вывод о нецелесообразности включения этого показателя в список переменных, определяющих попадание объекта в ту или иную группу.

2. Описание методов классификации объектов

Формализуем описанную социологическую задачу и кратко рассмотрим следующие известные методы классификации:

- 1) дискриминантное правило Фишера;
- 2) алгоритм, использующий бинарную логистическую регрессию;
- 3) метод опорных векторов Вапника;
- 4) «наивное» байесовское правило для упрощенной модели,

а затем построим оптимальный байесовский классификатор для объектов с зависимыми номинальными показателями.

Пусть проведено наблюдение над n объектами, каждый из которых характеризуется m -мерным вектором признаков $X = (X_1, \dots, X_m)$. Про каждый исследуемый объект известно, что он относится к классу K_1 или к классу K_2 . Набор показателей X представителей классов K_1 и K_2 является обучающей выборкой объема $n = n_1 + n_2$, где n_1 и n_2 – число представителей классов K_1 и K_2 соответственно. Предполагается, что в случае, когда объект принадлежит классу K_i , $i = 1, 2$, распределение случайного вектора признаков X этого объекта принадлежит параметрическому семейству P_{θ_i} , $\theta_i \in \Theta$, с разными значениями параметров

θ_1 и θ_2 . Параметры θ_1 , θ_2 неизвестны, но могут быть оценены по обучающей выборке.

Задача состоит в том, чтобы по реализации $x = (x_1, \dots, x_m)$ вектора признаков $X = (X_1, \dots, X_m)$ вновь поступившего на исследование объекта определить класс K_i , $i = 1, 2$, к которому этот объект следует отнести. То есть требуется построить решающее правило $\delta(x)$, которое ставит в соответствие каждому наблюдению $x = (x_1, \dots, x_m)$ одно из значений множества решений $D = \{d_1, d_2\}$, где решение d_i означает, что объект x определен в класс K_i , $i = 1, 2$.

Решающее правило определяется дискриминантной функцией $\gamma = \gamma(x)$ следующим образом:

$$\delta(x) = \begin{cases} d_1, & \text{если } \gamma(x) \geq c; \\ d_2, & \text{если } \gamma(x) < c, \end{cases} \quad (1)$$

где c – некоторое пороговое значение.

Таким образом, всякое дискриминантное правило $\delta(x)$ порождает разбиение выборочного пространства на две непересекающиеся области W_1 и W_2 , где $W_i = \{x : \delta(x) = d_i\}$.

Перейдем к рассмотрению классифицирующих правил, позволяющих решить сформулированную задачу.

2.1. Прогностическое правило Фишера

Построение этого правила основано на предположении о том, что показатели X объектов класса K_1 имеют многомерное гауссовское распределение $N(m_1, V)$, показатели объектов класса K_2 – многомерное распределение $N(m_2, V)$, ковариационные матрицы V этих распределений одинаковы, а векторы средних m_1 и m_2 различны. Тогда дискриминантная функция оптимального (в смысле минимума байесовского риска) правила (Ивченко, Медведев, 2010, глава 7; Дронов, 2003, глава 9) имеет вид

$$\gamma(x) = \hat{V}^{-1}(\hat{m}_1 - \hat{m}_2)'(x - 0,5(\hat{m}_1 + \hat{m}_2)),$$

где $\hat{m}_1, \hat{m}_2, \hat{V}$ – оценки неизвестных параметров распределений $N(m_1, V)$ и $N(m_2, V)$, построенные по обучающей выборке. Если ковариационные матрицы в разных классах различаются, то в качестве оценки \hat{V} обычно выбирают усредненную оценку $\hat{V} = 0,5(\hat{V}_1 + \hat{V}_2)$, где \hat{V}_1 и \hat{V}_2 – оценки ковариационных матриц в классах K_1 и K_2 . Пороговая константа c в формуле (1) для правила Фишера имеет вид

$$c = \ln(\hat{\pi}_2 / \hat{\pi}_1) = \ln(n_2 / n_1),$$

а правило Фишера реализовано в пакете программ SPSS.

2.2. Правило, основанное на модели бинарной логистической регрессии

Опишем процедуру классификации, используя модель бинарной логистической регрессии (Hosmer, Lemeshov, 2000). Пусть переменная Y , определяющая принадлежность респондента к классу, принимает значение 1, если респондент относится к классу K_1 , и значение 0, если респондент относится к классу K_2 .

Рассмотрим регрессионную модель вида

$$P(Y = 1 | X = x) = \frac{\exp(b_0 + b_1 x_1 + \dots + b_m x_m)}{1 + \exp(b_0 + b_1 x_1 + \dots + b_m x_m)}, \quad (2)$$

где $X = (X_1, \dots, X_m)$, $x = (x_1, \dots, x_m)$, а b_0, \dots, b_m – неизвестные параметры регрессионного уравнения. Регрессионные коэффициенты уравнения (2) можно оценить методом максимального правдоподобия (ММП). Имея оценки $\hat{b}_0, \dots, \hat{b}_m$ неизвестных параметров b_0, \dots, b_m уравнения (2), решающее правило строят следующим образом:

$$\delta(x) = \begin{cases} d_1, & \text{если } \exp(\hat{b}_0 + \sum_{i=1}^m \hat{b}_i x_i) / \left[1 + \exp(\hat{b}_0 + \sum_{i=1}^m \hat{b}_i x_i) \right] \geq 0,5; \\ d_2, & \text{если } \exp(\hat{b}_0 + \sum_{i=1}^m \hat{b}_i x_i) / \left[1 + \exp(\hat{b}_0 + \sum_{i=1}^m \hat{b}_i x_i) \right] < 0,5. \end{cases} \quad (3)$$

Другими словами, респондента с реализацией признаков $x = (x_1, \dots, x_m)$ следует определить в класс K_1 , если оценка условной вероятности попадания в этот класс при таком значении x будет не меньше 0,5.

В пакете программ SPSS построение оценок регрессионного уравнения (2) и классификационное правило (3) реализованы в процедуре Regression Binary Logistic.

2.3. Метод опорных векторов¹

Рассмотрим метод опорных векторов (Vapnik, 1995), который хорошо зарекомендовал себя при классификации объектов с количественными показателями. Этот метод основан на построении такой разделяющей гиперплоскости H , чтобы объекты из разных классов были удалены от нее на максимально далекое расстояние. В случае линейно разделяемой выборки удается найти не только разделяющую гиперплоскость, но и разделяющую полосу, в которую не попадают обучающие объекты, а H проходит по середине этой полосы. Задача построения гиперплоскости H и разделяющей полосы сводится к нахождению константы b и вектора $w = (w_1, \dots, w_m)$, такого, что норма $\langle w, w \rangle$ минимальна и при этом выполняется n неравенств-ограничений: $y_i (\langle w, x_i \rangle - b) \geq 1$, $i = 1, \dots, n$, где i – номер объекта; $y_i = 1$,

¹ Удачное изложение метода опорных векторов имеется в (Воронцов, 2007).

если объект $x_i = (x_{i1}, \dots, x_{mi})$ принадлежит классу K_1 ; $y_i = -1$, если объект $x_i = (x_{i1}, \dots, x_{mi})$ принадлежит классу K_2 . Неравенства задают условие непопадания объектов в разделительную полосу, ширина которой равна $2/\langle w, w \rangle$. Тогда оптимальная гиперплоскость H описывается уравнением $\langle w, x \rangle = b$, разделяющая классы полоса представлена множеством $\{x: -1 \leq \langle w, x \rangle - b \leq 1\}$, а величина $\rho_i = y_i (\langle w, x_i \rangle - b)$ – это отступ объекта x_i от границы классов. Решающее правило имеет вид

$$\delta(x) = \begin{cases} d_1, & \text{если } \langle w, x \rangle - b \geq 1; \\ d_2, & \text{если } \langle w, x \rangle - b \leq -1. \end{cases}$$

В рассматриваемой задаче, как и в большинстве практических задач, выборка не является линейно разделимой, и условие непопадания объектов в полосу может быть нарушено. В этой ситуации вводят неотрицательные переменные η_i , $i = 1, \dots, n$, определяющие величину ошибки на объекте $x_i = (x_{i1}, \dots, x_{mi})$. Затем находят b и вектор w из условия минимума функционала $0,5\langle w, w \rangle + C \sum_{i=1}^n \eta_i$ при ограничениях $y_i (\langle w, x_i \rangle - b) \geq 1 - \eta_i$, $\eta_i \geq 0$, $i = 1, \dots, n$. Здесь $C \sum_{i=1}^n \eta_i$ – суммарный штраф за ошибки классификации, а C – некоторый управляющий параметр, который позволяет находить компромисс между максимизацией ширины разделяющей полосы и минимизацией суммарной ошибки. Параметр регуляризации C должен задаваться пользователем.

Сформулированная задача является задачей квадратичного программирования и имеет единственное решение. Функция Лагранжа имеет вид

$$L(w, b, \alpha, \beta) = 0,5\langle w, w \rangle - \sum_{i=1}^n \alpha_i [y_i (\langle w, x_i \rangle - b) - 1] - \sum_{i=1}^n \eta_i (\alpha_i + \beta_i + C),$$

где $\alpha_1, \dots, \alpha_n$ – переменные, двойственные к w , а β_1, \dots, β_n – переменные, двойственные к η_1, \dots, η_n .

Учитывая необходимое условие экстремума, получим, что $w = \sum_{i=1}^n \alpha_i y_i x_i$, $\sum_{i=1}^n \alpha_i y_i = 0$, $\alpha_i + \beta_i = C$. В силу неотрицательности β_i имеем $0 \leq \alpha_i \leq C$.

Объекты x_i , для которых $\alpha_i > 0$, называют опорными векторами. Таким образом, вектор w определяется только опорными векторами.

Классификационное правило метода опорных векторов будет следующим:

$$\delta(x) = \begin{cases} d_1, & \text{если } \langle w, x \rangle - b \geq 0; \\ d_2, & \text{если } \langle w, x \rangle - b < 0. \end{cases}$$

Важно отметить, что множество опорных векторов можно разделить на две группы. К первой группе относятся объекты x_i , для которых $0 < \alpha_i < C$ и $\rho_i = 1$, ко второй – объекты x_i , для которых $\alpha_i = C$, а $\rho_i < 1$. Объекты первой группы лежат на границе разделительной полосы и классифицируются верно, объекты второй группы попадают внутрь разделительной полосы. Последние называются опорными нарушителями и могут быть классифицированы правильно, если $0 \leq \rho_i < 1$, или неправильно, если $\rho_i < 0$. Если объекты из разных классов сильно «перемешаны», будет возникать большое число опорных нарушителей и качество классификации может ухудшиться. Чтобы избежать этого, вводят преобразование $\phi(x)$ пространства признаков X в новое пространство Z более высокой размерности. Цель такого преобразования – получение в новом спрямляющем пространстве Z линейно разделимой выборки $\phi(x_i)$, $i = 1, \dots, n$. Если обучающая выборка непротиворечива, то найдется пространство размерности не более n , в котором выборка будет линейно разделима. Скалярное произведение в пространстве Z определяется ядерной функцией (ядром) $K(x, y) = \langle \phi(x), \phi(y) \rangle$ при условии, что пространство Z наделено скалярным произведением. К сожалению, общие методы построения ядер и спрямляющих пространств до сих пор не разработаны. И подбор ядра надо проводить для каждой конкретной задачи.

2.4. Оптимальное байесовское правило для номинальных дискриминантных признаков

Пусть известно, что каждый признак X_l , $l = 1, \dots, m$, измеряется в номинальной шкале и имеет z_l градаций (категорий). Например, пусть признак X_l обозначает образование респондента. Тогда X_l имеет четыре градации: образование ниже среднего; среднее образование; среднее специальное образование; высшее образование. Таким образом, при проведении одного наблюдения (опросе одного респондента) каждый признак X_l , $l = 1, \dots, m$, может принимать одно из z_l возможных значений, а реализацией $x_l = (x_{l1}, \dots, x_{lz_l})$ признака X_l будет вектор размера z_l , состоящий из $z_l - 1$ нуля и одной единицы. Причем если единица стоит на месте j , то это означает, что в данной реализации признак X_l принял градацию номер j . Случайный вектор X_l , который имеет указанную структуру, можно описать полиномиаль-

ным распределением (Королюк и др., 1978, глава 6.4) с параметрами $(1, p_{11}, \dots, p_{1z_l})$, где p_{11}, \dots, p_{1z_l} – вероятности появления в одном опыте градаций $1, \dots, z_l$ соответственно. При этом параметры распределения p_{11}, \dots, p_{1z_l} различны для класса K_1 и класса K_2 . Обозначим через $p_{j,(i)}$, $l=1, \dots, m$; $j=1, \dots, z_l$; $i=1, 2$, вероятность того, что признак X_l респондента из класса i имеет категорию номер j . Тогда распределение признака X_l , $l=1, \dots, m$, для каждого респондента описывается полиномиальным распределением с параметрами $(1, p_{1l,(1)}, \dots, p_{z_l,(1)})$, если респондент принадлежит к классу K_1 , и полиномиальным распределением с параметрами $(1, p_{1l,(2)}, \dots, p_{z_l,(2)})$, если респондент принадлежит к классу K_2 . Таким образом, распределение каждой компоненты случайного вектора $X = (X_1, \dots, X_m)$ – это многомерное полиномиальное распределение с указанными параметрами. Предполагая, что компоненты вектора X являются независимыми случайными величинами, получим, что распределение вектора X описывается произведением m полиномиальных распределений с соответствующими параметрами. Если компоненты вектора $X = (X_1, \dots, X_m)$ зависимы, то условную вероятность того, что признак X_l респондента из класса K_i имеет категорию номер j при условии, что произошло событие $\bigcap_{k=1}^{l-1} \{X_k = x_k\}$, обозначим $P_{(j|1, \dots, l-1),(i)}$.

Заметим, что вероятности $p_{(j|1, \dots, l-1),(i)}$ и $p_{j,(i)}$, $l=1, \dots, m$; $j=1, \dots, z_l$; $i=1, 2$, неизвестны, но при достаточно большой выборке могут быть оценены частотами $\hat{p}_{(j|1, \dots, l-1),(i)}$ и $\hat{p}_{j,(i)}$ появления соответствующих градаций по обучающей выборке. Вероятности попадания респондента в классы K_1 и K_2 можно оценить частотами

$$\hat{\pi}_1 = \frac{n_1}{n_1 + n_2}, \quad \hat{\pi}_2 = \frac{n_2}{n_1 + n_2} = 1 - \hat{\pi}_1.$$

2.5. «Наивный» байесовский классификатор

Рассмотрим оптимальное в байесовском смысле правило для классификации объектов, характеризующихся независимыми между собой номинальными признаками. Дискриминантная функция этого правила (Mirkin, 2011) имеет вид

$$\gamma(x) = \sum_{l=1}^m \sum_{j=1}^{z_l} x_{lj} \ln \frac{\hat{p}_{j,(1)}}{\hat{p}_{j,(2)}}, \quad (4)$$

в которой

$$x_{lj} = \begin{cases} 1, & \text{если у наблюдаемого респондента признак } X_l \text{ принял градацию номер } j; \\ 0 & \text{– в остальных случаях;} \end{cases} \quad (5)$$

$\hat{p}_{lj,(i)}$ – оценки соответствующих вероятностей $p_{lj,(i)}$, $l=1, \dots, m$, $j=1, \dots, z_l$, $i=1, 2$.

Пороговая константа этого правила совпадает с константой правила Фишера. В теории машинного обучения такое правило принято называть «наивным» байесовским классификатором. Следует отметить, что требование независимости показателей X_1, \dots, X_m является существенным при выводе этого правила.

2.6. Оптимальный байесовский классификатор для объектов с зависимыми показателями

В рассматриваемой задаче классификации респондентов условие независимости показателей X_1, \dots, X_m не выполняется. Поэтому построим оптимальный байесовский классификатор для объектов, характеризующихся номинальными признаками, которые могут быть зависимыми.

Теорема. В описанной выше модели байесовское решающее правило $\delta(x)$ имеет вид

$$\delta(x) = \begin{cases} d_1, & \text{если } \gamma(x) \geq \ln(\hat{\pi}_2 / \hat{\pi}_1); \\ d_2, & \text{если } \gamma(x) < \ln(\hat{\pi}_2 / \hat{\pi}_1), \end{cases} \quad (6)$$

где дискриминантная функция

$$\gamma(x) = \sum_{j=1}^{\tilde{z}_1} x_{1j} \ln \left(\frac{\hat{p}_{1j,(1)}}{\hat{p}_{1j,(2)}} \right) + \sum_{l=2}^m \sum_{j=1}^{\tilde{z}_l} x_{lj} \prod_{k=1}^{l-1} \prod_{i=1}^{\tilde{z}_k} x_{ki} \ln \frac{\hat{p}_{(lj|1, \dots, l-1), (1)}}{\hat{p}_{(lj|1, \dots, l-1), (2)}}, \quad (7)$$

в которой x_{lj} , $l=1, \dots, m$; $j=1, \dots, z_l$, определены формулой (5), а $\hat{\pi}_2$, $\hat{\pi}_1 = 1 - \hat{\pi}_2$ – оценки вероятностей попадания в классы K_2 и K_1 соответственно.

Следствие 1. Если в обучающей выборке число респондентов в классах K_1 и K_2 одинаково, то $\hat{\pi}_1 = \hat{\pi}_2 = 0,5$ и решающее правило имеет вид

$$\delta(x) = \begin{cases} d_1, & \text{если } \gamma(x) \geq 0; \\ d_2, & \text{если } \gamma(x) < 0. \end{cases}$$

Следствие 2. Если компоненты вектора X являются независимыми, то дискриминантная функция (7) совпадает с функцией (4).

Доказательство теоремы. Пусть $L(d, \theta)$ – функция потерь, определяющая потери от неправильной классификации объектов, а значения этой функции $L(d_j, \theta_i) = l(j|i)$, $j, i=1, 2$ – потери, которые имеют место в случае, когда объект из класса K_i отнесен к классу K_j . Естественно считать, что $l(1|1) = l(2|2) = 0$, т.е. при пра-

вильной классификации потери равны нулю. Определим функцию риска $R(\delta) = (R_1(\delta), R_2(\delta))$, где $R_i(\delta) = M[L(\delta(X), \theta_i)]$.

Вычисляя математическое ожидание, получим $R_i(\delta) = \sum_{j=1}^2 l(j|i)p(j|i)$, где $p(j|i) = P_{\theta_i}(X \in K_j)$ – вероятность того, что объект из класса K_i будет помещен в класс K_j . Тогда $R(\delta) = (l(2|1)p(2|1), l(1|2)p(1|2))$.

Таким образом, значение риска $R_i(\delta)$ характеризует средние потери, которые имеют место при классификации по правилу δ объекта из класса K_i .

Пусть известно априорное распределение $\pi = (\pi_1, \pi_2)$, где π_i – вероятность того, что произвольный наблюдаемый объект принадлежит классу K_i , $i = 1, 2$. Тогда байесовский риск определяется следующим образом (Ивченко, Медведев, 2010):

$$r(\delta) = \sum_{i=1}^2 R_i(\delta)\pi_i = \sum_{j=1}^2 \sum_{i=1}^2 l(j|i)p(j|i)\pi_i = l(1|2)p(1|2)\pi_2 + l(2|1)p(2|1)\pi_1. \quad (8)$$

Решающее правило δ^* , при котором байесовский риск (8) минимален, т.е. $\delta^* = \arg \min_{\delta} r(\delta)$, называется байесовским решением в задаче классификации. Найдем данное решение, считая, что $l(1|2) = l(2|1) = 1$.

Согласно теореме Байеса, апостериорные вероятности $\pi_i(x)$, $i = 1, 2$, классов при условии $X = x$ равны

$$\pi_i(x) = \pi_i P(x \in K_i) / \sum_{j=1}^2 [\pi_j P(x \in K_j)], \quad i = 1, 2.$$

Таким образом, если объект x отнести к классу K_1 (т.е. $\delta(x) = d_1$), условное математическое ожидание функции потерь при условии $X = x$ будет

$$\begin{aligned} M(L(\delta(X), \theta) | X = x) &= \sum_{i=1}^2 L(d_1, \theta_i)\pi_i(x) = \\ &= l(1|2)\pi_2 P(x \in K_2) / \left\{ \sum_{j=1}^2 \pi_j P(x \in K_j) \right\} = \\ &= \pi_2 P(x \in K_2) / \left\{ \sum_{j=1}^2 \pi_j P(x \in K_j) \right\}, \end{aligned} \quad (9)$$

а если объект x отнести к классу K_2 (т.е. $\delta(x) = d_2$), то

$$M(L(\delta(X), \theta) | X = x) = \pi_1 P(x \in K_1) / \left\{ \sum_{j=1}^2 \pi_j P(x \in K_j) \right\}. \quad (10)$$

Заметим, что знаменатели в выражениях (9) и (10) совпадают, и функция $r(\delta)$ достигнет минимального значения, если решающее правило $\delta^*(x)$ будет построено следующим образом:

$$\delta^*(x) = \begin{cases} d_1, & \text{если } \pi_1 P(x \in K_1) \geq \pi_2 P(x \in K_2); \\ d_2, & \text{если } \pi_2 P(x \in K_2) \geq \pi_1 P(x \in K_1). \end{cases}$$

Таким образом, область W_1 имеет вид

$$W_1 = \left\{ x : \frac{P(x \in K_1)}{P(x \in K_2)} \geq \frac{\pi_2}{\pi_1} \right\} = \left\{ x : \ln \frac{P(x \in K_1)}{P(x \in K_2)} \geq \ln \frac{\pi_2}{\pi_1} \right\}. \quad (11)$$

Вычислим вероятность того, что наблюдение $x = (x_1, \dots, x_m)$, где каждая компонента x_l , $l = 1, \dots, m$, является вектором размерности z_l , попадает в класс K_i , $i = 1, 2$.

Как было показано выше, каждая компонента случайного вектора $X = (X_1, \dots, X_m)$ имеет полиномиальное распределение. Согласно полиномиальному закону распределения (Королюк и др., 1978, глава 6.4), вероятность того, что в одном опыте признак X_l , $l = 1, \dots, m$, примет значение x_l , где $x_l = (x_{l1}, \dots, x_{lz_l})$, а x_{lj} определено в (5), равна

$$P(X_l = x_l) = \frac{1!}{x_{l1}! \dots x_{lz_l}!} p_{l1}^{x_{l1}} p_{l2}^{x_{l2}} \dots p_{lz_l}^{x_{lz_l}} = \prod_{j=1}^{z_l} p_{lj}^{x_{lj}}.$$

Если компоненты X_1, \dots, X_m вектора X независимы, то

$$P(X = x) = \prod_{l=1}^m P(X_l = x_l) = \prod_{l=1}^m \prod_{j=1}^{z_l} p_{lj}^{x_{lj}},$$

а вероятность принадлежности наблюдения $x = (x_1, \dots, x_m)$ классу K_i вычисляется следующим образом:

$$P(x \in K_i) = \prod_{l=1}^m \prod_{j=1}^{z_l} p_{lj,(i)}^{x_{lj}}. \quad (12)$$

Если же компоненты X_1, \dots, X_m вектора X зависимы, то вероятность $P(X = x) = P(X_1 = x_1, \dots, X_m = x_m)$ следует вычислять согласно формуле умножения вероятностей

$$P(X = x) = P(X_1 = x_1) \prod_{l=2}^m P \left(X_l = x_l \mid \bigcap_{k=1}^{l-1} \{X_k = x_k\} \right).$$

Таким образом, по формуле умножения имеем

$$P(X = x) = \prod_{j=1}^{z_1} p_{1j}^{x_{1j}} \prod_{l=2}^m \prod_{j=1}^{z_l} p_{(lj|1, \dots, l-1)}^{x_{lj}}.$$

Оценивая в последнем выражении неизвестные условные и безусловные вероятности появления градаций признаков в каждом классе соответствующими частотами и подставляя в (11), получим, что

$$W_1 = \left\{ x : \sum_{j=1}^{z_1} x_{1j} \ln \left(\hat{p}_{1j,(1)} / \hat{p}_{1j,(2)} \right) + \sum_{l=2}^m \sum_{j=1}^{z_l} x_{lj} \prod_{k=1}^{l-1} \prod_{i=1}^{z_k} x_{ki} \ln \frac{\hat{p}_{(j|1, \dots, l-1), (1)}}{\hat{p}_{(j|1, \dots, l-1), (2)}} \geq \ln \frac{\hat{\pi}_2}{\hat{\pi}_1} \right\}, \quad (13)$$

а для независимых компонент, согласно (11) и (12) –

$$W_1 = \left\{ x : \sum_{l=1}^m \sum_{j=1}^{z_l} x_{lj} \ln \frac{\hat{p}_{lj,(1)}}{\hat{p}_{lj,(2)}} \geq \ln \frac{\hat{\pi}_2}{\hat{\pi}_1} \right\}.$$

3. Результаты классификации респондентов

В имеющейся выборке 780 респондентов относятся к группе принимавших участие в благотворительных пожертвованиях, а 820 – к группе не принимавших участие в благотворительных пожертвованиях. Таким образом, оценки вероятностей попадания респондентов в классы K_1 и K_2 соответственно равны 0,4875 и 0,5125.

При проведении классификации в качестве обучающей выборки будем использовать все имеющиеся наблюдения. В классификационных таблицах рассматриваемых решающих правил будут представлены доли верно и неверно классифицированных по классам K_1 и K_2 респондентов.

Классификация, основанная на прогностическом правиле Фишера и учитывающая различие ковариационных матриц в классах, получена при помощи процедуры Discriminant пакета программ SPSS. Соответствующая классификационная таблица представлена в табл. 2. Процент верных классификаций составляет 56,3%.

Таблица 2

Классификационная таблица правила Фишера

Истинная группа	Результат классификации	
	Класс K_1	Класс K_2
Класс K_1	0,585	0,415
Класс K_2	0,459	0,541

Классификация, использующая модель бинарной логистической регрессии (правило (3)), получена с помощью процедуры Regression Binary Logistic пакета программ SPSS. Результаты приведены в классификационной табл. 3. Процент верно классифицированных респондентов составляет 59,3%.

Таблица 3

Классификационная таблица правила, использующего модель бинарной логистической регрессии

Истинная группа	Результат классификации	
	Класс K_1	Класс K_2
Класс K_1	0,573	0,427
Класс K_2	0,389	0,611

К достоинствам этого метода классификации следует отнести то, что имеется возможность проверки значимости как каждого отдельного регрессионного коэффициента, так и уравнения регрессии в целом. Согласно критерию отношения правдоподобия, регрессионная модель (2) с выбранными регрессорами X_1, \dots, X_5 оказалась значимой, значимо отличаются от нуля все коэффициенты b_1, \dots, b_5 , а при попытке включения в число регрессоров переменной «материальное положение» оказалось, что соответствующий ей регрессионный коэффициент незначимо отличается от нуля.

Недостаток этого метода заключается в том, что поиск оценок МП параметров b_0, \dots, b_m осуществляется итерационным методом, так как система уравнений правдоподобия является нелинейной по b .

Перейдем к классификации по методу опорных векторов. В качестве преобразования $\varphi(x)$ естественно выбрать (Вапник, Червоненкис, 1974, глава 3) преобразование, переводящее m -мерный вектор признаков x в бинарный вектор $\tilde{x} = (x_{11}, \dots, x_{1z_1}, \dots, x_{m1}, \dots, x_{mz_m})$ размерности $z = z_1 + \dots + z_m$, где z_l – число категорий у признака X_l , а $x_{lj}, l = 1, \dots, m; j = 1, \dots, z_l$, определены формулой (5).

К сожалению, рассматриваемая нами задача классификации респондентов осложнена тем, что обучающая выборка является противоречивой, так как 10% респондентов, имеющих одинаковые признаки $x = (x_1, \dots, x_5)$, относятся к разным классам. Это означает, что нельзя найти такое преобразование $\varphi(x)$, которое перевело бы имеющуюся выборку в линейно разделимую, а указанные 10% объектов заведомо будут опорными нарушителями.

Решая описанную выше задачу квадратичного программирования в среде MATLAB, выбирая указанное преобразование $\varphi(x)$ и параметр регуляризации $C \geq 5$, мы получили 58,13% верно классифицированных объектов. Результаты этой классификации представлены в табл. 4. Если не осуществлять преобразование пространства признаков X и рассматривать функцию ядра, равную скалярному произведению, то процент верных классификаций составляет 56,31% и практически совпадает с тем, который дает дискриминант Фишера. Попытка применения гауссовой ядерной функции в данной задаче не привела к улучшению классификации.

Таблица 4

Классификационная таблица правила, основанного на методе опорных векторов

Истинная группа	Результат классификации	
	Класс K_1	Класс K_2
Класс K_1	0,667	0,333
Класс K_2	0,50	0,50

Проведем классификацию, используя «наивное» байесовское правило, основанное на дискриминантной функции (4). Для того чтобы вычислить функцию (4), необходимо оценить параметры распределения отобранных показателей в каждом классе. Этими параметрами являются вероятности p_j событий, состоящих в том, что признак X_l респондента имеет категорию номер j . Известно, что несмещенными и сильно состоятельными оценками вероятностей событий являются частоты появления этих событий.

Реализации оценок параметров $p_{j,(i)}$, $l = 1, \dots, m$; $j = 1, \dots, z_l$; $i = 1, 2$, распределений дискриминантных переменных для классов K_1 и K_2 приведены в табл. 5–9.

Таблица 5

Оценки параметров распределения переменной X_1 (половая принадлежность респондента)

Класс	$\hat{p}_{11,(i)}$	$\hat{p}_{12,(i)}$
Класс K_1 ($i = 1$)	0,4064	0,5936
Класс K_2 ($i = 2$)	0,4915	0,5085

Таблица 6

Оценки параметров распределения переменной X_2 (тип населенного пункта, в котором проживает респондент)

Класс	$\hat{p}_{21,(i)}$	$\hat{p}_{22,(i)}$	$\hat{p}_{23,(i)}$	$\hat{p}_{24,(i)}$	$\hat{p}_{25,(i)}$
Класс K_1 ($i = 1$)	0,0962	0,2026	0,2115	0,2026	0,2872
Класс K_2 ($i = 2$)	0,1159	0,1659	0,1683	0,178	0,372

Таблица 7

Оценки параметров распределения переменной X_3 (федеральный округ проживания)

Класс	$\hat{p}_{31,(i)}$	$\hat{p}_{32,(i)}$	$\hat{p}_{33,(i)}$	$\hat{p}_{34,(i)}$	$\hat{p}_{35,(i)}$	$\hat{p}_{36,(i)}$	$\hat{p}_{37,(i)}$
Класс K_1 ($i = 1$)	0,2295	0,1038	0,1385	0,2564	0,1205	0,0846	0,0667
Класс K_2 ($i = 2$)	0,2927	0,0878	0,1805	0,172	0,0939	0,0768	0,0963

Таблица 8

Оценки параметров распределения переменной X_4 (возраст респондента)

Класс	$\hat{p}_{41,(i)}$	$\hat{p}_{42,(i)}$	$\hat{p}_{43,(i)}$
Класс K_1 ($i = 1$)	0,3577	0,4038	0,2385
Класс K_2 ($i = 2$)	0,3585	0,3049	0,3366

Таблица 9

Оценки параметров распределения переменной X_5
(образование респондента)

Класс	$\hat{P}_{51,(i)}$	$\hat{P}_{52,(i)}$	$\hat{P}_{53,(i)}$	$\hat{P}_{54,(i)}$
Класс K_1 ($i = 1$)	0,0577	0,25	0,4103	0,2821
Класс K_2 ($i = 2$)	0,1061	0,311	0,361	0,222

Подставляя найденные оценки в функцию (4) и определив пороговую константу $c = \ln(\pi_2 / \pi_1) = \ln(n_2 / n_1) = \ln(820 / 780)$, проводим классификацию и получаем процент верных классификаций, равный 59,625%.

Результаты классификации, основанной на «наивном» байесовском правиле (4), использующем упрощенную модель, представлены в табл. 10.

Таблица 10

Классификационная таблица «наивного» байесовского правила

Истинная группа	Результат классификации	
	Класс K_1	Класс K_2
Класс K_1	0,615	0,385
Класс K_2	0,422	0,578

Напомним, что «наивный» байесовский классификатор является оптимальным в смысле минимума байесовского риска (8) только при условии независимости дискриминантных признаков.

В рассматриваемой задаче имеется зависимость между показателями X_1 (пол респондента) и X_4 (возраст респондента); между X_2 (тип населенного пункта, в котором проживает респондент) и X_3 (федеральный округ проживания); между X_5 (образование респондента) и X_4 , X_3 , X_2 . Поэтому применим разработанное решающее правило классификации (6)–(7), которое оптимально и для зависимых номинальных признаков.

Для вычисления дискриминантной функции (7) требуется оценить в каждом классе безусловные вероятности p_{1j} , $j = 1, \dots, z_1$, и p_{2j} , $j = 1, \dots, z_2$ (эти оценки представлены в табл. 5, 6), условные вероятности $P_{(3,j|2)}$, $P_{(4,j|1)}$ и $P_{(5,j|2,3,4)}$, где $j = 1, \dots, z_1$.

Оценками условных вероятностей являются «условные» частоты появления соответствующих событий. Оценки условных вероятностей $P_{(3,j|2)}$ для классов K_1 и K_2 представлены в матрицах размера $(z_3 \times z_2)$:

$$\hat{p}_{(3;j2),(1)} = \begin{pmatrix} 0,0615 & 0,0346 & 0 & 0 & 0 & 0 & 0 \\ 0,0026 & 0 & 0,0205 & 0,1 & 0,0462 & 0,0321 & 0,001 \\ 0,0551 & 0,0282 & 0,0295 & 0,0308 & 0,0321 & 0,0141 & 0,0218 \\ 0,05 & 0,018 & 0,0269 & 0,0539 & 0,0244 & 0,0128 & 0,0167 \\ 0,0603 & 0,0231 & 0,0615 & 0,0718 & 0,0179 & 0,0256 & 0,0269 \end{pmatrix},$$

$$\hat{p}_{(3;j2),(2)} = \begin{pmatrix} 0,0854 & 0,0305 & 0 & 0 & 0 & 0 & 0 \\ 0,0378 & 0 & 0,0256 & 0,0402 & 0,0171 & 0,0305 & 0,0146 \\ 0,0463 & 0,0146 & 0,0402 & 0,0293 & 0,0061 & 0,0085 & 0,0232 \\ 0,0463 & 0,0207 & 0,0244 & 0,0171 & 0,0317 & 0,0061 & 0,0317 \\ 0,0768 & 0,0219 & 0,0902 & 0,0854 & 0,0390 & 0,0317 & 0,0269 \end{pmatrix},$$

а оценки условных вероятностей $p_{(4;j1)}$ для классов K_1 и K_2 – в матрицах размера $(z_4 \times z_1)$:

$$\hat{p}_{(4;j1),(1)} = \begin{pmatrix} 0,1603 & 0,1974 \\ 0,1692 & 0,2346 \\ 0,0769 & 0,1615 \end{pmatrix}, \quad \hat{p}_{(4;j1),(2)} = \begin{pmatrix} 0,1939 & 0,1646 \\ 0,1646 & 0,1402 \\ 0,1329 & 0,2037 \end{pmatrix}.$$

Оценка условных вероятностей $p_{(5;j2,3,4)}$ является громоздкой и содержит большое количество нулевых значений, поэтому мы ее здесь не приводим.

Результаты классификации, основанной на правиле (6)–(7), приведены в табл. 11. Процент верных классификаций составляет 65,302%.

Таблица 11

Классификационная таблица оптимального байесовского правила

Истинная группа	Результат классификации	
	Класс K_1	Класс K_2
Класс K_1	0,599	0,401
Класс K_2	0,293	0,707

4. Сравнительный анализ классификационных решающих правил

Для сравнения различных дискриминантных правил необходимо выбрать некий инструмент, позволяющий оценивать качество классификации. Удобным средством оценки качества классификационного правила является метод, основанный на анализе так называемой операционной характеристической кривой ROC (Receiver Operating Characteristic – функциональные характеристики приемника). Традиционный ROC-анализ (Паклин, Орешков, 2010; Файнзильберг, Жук, 2009) предусматривает сравнение таких операци-

онных характеристик правила, как чувствительность (доля респондентов, которые верно отнесены правилом к классу K_1) и специфичность (доля респондентов, которые верно отнесены правилом к классу K_2). Интегральной характеристикой оценки качества правила является площадь под ROC-кривой.

При построении кривой нас не интересует то, как построен непосредственно алгоритм классификации, т.е. правило рассматривается как «черный ящик», который на основании информации об объекте принимает одно из двух решений – d_1 или d_2 . Для того чтобы построить ROC-кривую, проводится «экзамен» на обучающей выборке и результаты «экзамена» представляются в классификационной таблице (табл. 12).

Таблица 12

Результаты тестирования по обучающей выборке

Истинный результат	Результат тестирования	
	Решение d_1 «относится к классу K_1 »	Решение d_2 «относится к классу K_2 »
«Относится к классу K_1 »	TP	FN
«Относится к классу K_2 »	FP	TN

Примечание. В таблице приняты следующие обозначения: TP (true positive) – число правильных результатов «относится к классу K_1 » (истинноположительный результат); TN (true negative) – число правильных результатов «относится к классу K_2 » (истинноотрицательный результат); FP (false positive) – число респондентов, ошибочно отнесенных к классу K_1 (ложноположительный результат); FN (false negative) – число респондентов, ошибочно отнесенных к классу K_2 (ложноотрицательный результат).

По данным табл. 12 вычисляются операционные характеристики правила:

$$\text{а) чувствительность (sensitivity) } S_E = \frac{TP}{TP + FN};$$

$$\text{б) специфичность (specificity) } S_p = \frac{TN}{TN + FP}.$$

Имея эти характеристики, можно представить результаты «экзамена» в двумерном ROC-пространстве, в котором по оси ординат откладываются значения S_E , а по оси абсцисс – значения $1 - S_p$. Таким образом, классифицирующее правило (бинарный классификатор) с фиксированными операционными характеристиками S_E и S_p отображается точкой в ROC-пространстве.

Изменяя пороговое значение c в классификационном правиле (1), будем получать новые последовательности точек (S_E, S_p) в ROC-пространстве. Отсюда вытекает следующий алгоритм построения экспериментальной ROC-кривой:

- 1) отсортировать наблюдаемые значения дискриминантной функции $\gamma(x)$ в порядке убывания;
- 2) последовательно уменьшать (с некоторым шагом) порог c , перемещаясь вниз по списку отсортированных значений $\gamma(x)$, и по экзаменационной выборке наблюдений вычислять соответствующие пары значений S_E и S_p ;
- 3) отобразить полученные таким образом последовательности точек (S_E, S_p) в ROC-пространстве.

ROC-пространство дает наглядное графическое представление о диагностической ценности правила и позволяет сравнивать качество различных правил.

Для сравнения качества различных классифицирующих правил удобно использовать интегральную характеристику AUC (Area Under Curve) – площадь под ROC-кривой. Понятно, что величина AUC определяет среднюю чувствительность теста \bar{S}_E при возможных значениях специфичности $0 \leq S_p \leq 1$ или среднюю специфичность теста \bar{S}_p при возможных значениях чувствительности $0 \leq S_E \leq 1$. Ситуация, при которой ROC-кривая совпадает с диагональю (в этом случае $AUC = 0,5$), соответствует случайному угадыванию. И правило с такими характеристиками является бесполезным. Для идеального правила величина $AUC = 1$. Поэтому считается, что чем ближе AUC к единице, тем качественнее правило. Традиционно принята (Паклин, Орешков, 2010; Файнзильберг, Жук, 2009) следующая экспертная шкала для значений AUC , по которой можно судить о качестве модели (табл. 13).

Таблица 13

Характеристики модели по значению AUC

Интервал AUC	Качество модели
0,9–1,0	Отличное
0,8–0,9	Очень хорошее
0,7–0,8	Хорошее
0,6–0,7	Среднее
0,5–0,6	Неудовлетворительное

Следует отметить, что показатель AUC не содержит никакой информации о чувствительности и специфичности модели и предназначен скорее для сравнительного анализа нескольких моделей.

При построении ROC-кривой правила воспользуемся встроенной функцией пакета SPSS. В качестве проверяемой переменной выбирается вектор значений дискриминантной функции, получаемый при помощи разработанной программы; в качестве переменной состояния – переменная, обозначающая истинную группу рассматриваемого

респондента; в качестве значения переменной состояния – значение, которое соответствует положительному значению дискриминантной функции. Графики ROC-кривых для правила, реализованного в процедуре Discriminant пакета SPSS (правило А), «наивного» байесовского правила (правило В), описанного в настоящей статье оптимального байесовского правила (правило С) и правила, основанного на использовании логистической регрессии, реализованного в процедуре Regression Binary Logistic пакета SPSS (правило D), представлены на рисунке. Площади под кривыми представлены в табл. 14.

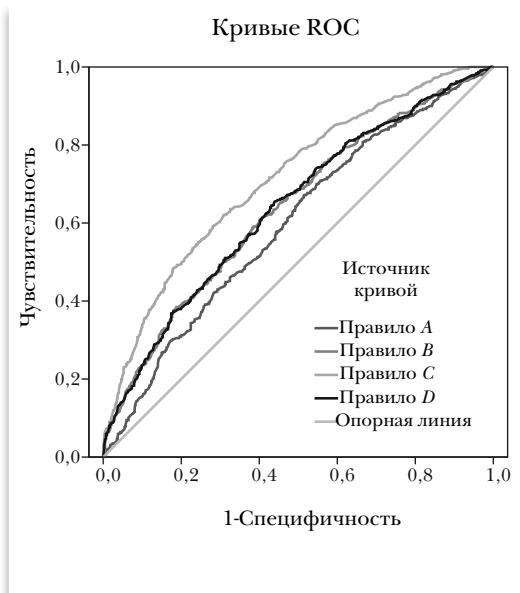


Рисунок.
Графики ROC-кривых

Таблица 14

Значения показателя AUC

Правило	A	B	C	D
Показатель AUC	0,597	0,639	0,713	0,640

Как видно из результатов, представленных в табл. 14, качество модели, основанной на оптимальном байесовском правиле, характеризуется как «хорошее», тогда как качество правил «наивного» байесовского классификатора и логистической регрессии характеризуется как «среднее». Модель, основанная на линейном классификаторе Фишера, является «неудовлетворительной».

Заключение

В работе сформулировано дискриминантное правило бинарной классификации объектов, характеристики которых измеряются в номинальной шкале и могут быть зависимыми. Показана оптимальность (в смысле минимума байесовского риска) предложенного правила. Важно отметить, что оно является достаточно простым в алгоритмическом отношении и не требует оценивания и обращения ковариационной матрицы наблюдений или решения оптимизационных задач. Однако при большом числе связей между признаками может оказаться затруднительным оценивание условных вероятностей.

В реальной задаче разделения респондентов на классы это правило показало более высокое качество классификации по сравнению

с другими правилами. Согласно экспертной шкале ROC-анализа его качество оценивается как «хорошее». Не так хорошо зарекомендовали себя «наивный» байесовский классификатор и бинарная логистическая регрессия, их качество классификации оценивается как «среднее». Важно отметить, что использование модели логистической регрессии позволяет не только классифицировать объекты, но и оценивать вероятности попадания объектов в классы, а также проверять значимость дискриминантных переменных. Оценивая вероятность попадания в класс респондента с заданными характеристиками, исследователь имеет возможность выявить модальную категорию респондентов этого класса. Это означает, что с помощью логистической регрессии можно описать наиболее вероятный «социально-демографический портрет» респондента, участвующего в благотворительных пожертвованиях.

«Наивный» байесовский классификатор оптимален только при условии независимости признаков. Несмотря на то что это условие в рассматриваемой задаче не выполняется, качество «наивного» байесовского классификатора практически совпадает с качеством классификатора, основанного на логистической регрессии. «Наивное» байесовское правило имеет самый простой алгоритм классификации среди всех рассмотренных здесь правил.

Чуть хуже двух предыдущих классификаторов показал себя метод опорных векторов. Причиной этого, на наш взгляд, является наличие большого числа опорных нарушителей, появление которых связано со спецификой выборки. К недостаткам алгоритма опорных векторов следует отнести неоднозначность выбора ядерной функции и параметра регуляризации.

Неудовлетворительное, согласно шкале ROC-анализа, качество имеет линейное правило Фишера. Это объясняется тем, что правило Фишера оптимально для показателей, имеющих многомерное гауссовское распределение, а показатели респондентов имеют полиномиальное распределение.

Таким образом, зная такие объективные социально-демографические характеристики респондента, как пол, возраст, образование, федеральный округ и тип населенного пункта проживания, можно построить качественный прогноз относительно участия (или неучастия) этого респондента в благотворительных пожертвованиях.

Литература

- Вапник В.Н., Червоненкис А.Я.** (1974). Теория распознавания образов (статистические проблемы обучения). М.: Наука.
- Воронцов К.В.** (2007). Лекции по методу опорных векторов. [Электронный ресурс] Курс лекций. Режим доступа: <http://www.ccas.ru/voron/download/SVM.pdf>, свободный. Загл. с экрана. Яз. рус. (дата обращения: 2011 г.).

- Дронов С.В.** (2003). Многомерный статистический анализ. Барнаул: Изд-во Алт. гос. ун-та.
- Ивченко Г.И., Медведев Ю.И.** (2010). Введение в математическую статистику. М.: URSS.
- Ким Дж.-О., Мьюллер Ч.У., Клекка У.Р.** и др. (1989). Факторный, дискриминантный и кластерный анализ / Под ред. И.С. Енюкова. М.: Фин. и стат.
- Королюк В.С.** и др. (1978). Справочник по теории вероятностей и математической статистике. М.: Наука.
- Мерсиянова И.В., Якобсон Л.И.** (2009). Практики филантропии в России: вовлеченность и отношение к ним населения. М.: Издательский дом ГУ ВШЭ.
- Паклин Н.Б., Орешков В.И.** (2010). Бизнес-аналитика от данных к знаниям. Спб.: Питер.
- Файнзильберг Л.С., Жук Т.Н.** (2009). Гарантированная оценка эффективности диагностических тестов на основе усиленного ROC-анализа // *Управляющие системы и машины*. № 5. С. 3–13.
- Hosmer D., Lemeshov S.** (2000). Applied Logistic Regression. N.Y.: Wiley.
- Mirkin B.** (2011). Core Concepts in Data Analysis: Summarization, Correlation, Visualization. L.: Springer.
- Schlisterman E.F., Perkins N.J., Liu A.** et al. (2005). Optimal Cut-point and Its Corresponding Youden Index to Discriminate Individuals Using Pooled Blood Samples // *Epidemiology*. Vol. 16. P. 73–81.
- Vapnik V.N.** (1995). The Nature of Statistical Learning Theory. N.Y.: Springer-Verlag.
- Zweig M.H., Campbell G.** (1993). Receiver-Operating Characteristic (ROC) Plots: a Fundamental Evaluation Tool in Clinical Medicine // *Clinical Chemistry*. Vol. 39. № 4. P. 561–577.

Поступила в редакцию 01 сентября 2011 года

E.R. Goryainova

National Research University “Higher School of Economics”, Moscow

T.I. Slepneva

Moscow Aviation Institute, Moscow

Binary Classification of Objects with Nominal Indicators

In this work a problem is studied of classification of respondents into classes accepting and not participation in a charity actions. An optimal (in Bayes sense) decisive discriminant rule of division of objects on two classes is constructed for the case when all indicators of observable objects are measured in a nominal scale, and there are signs of dependence between them. Using ROC-analysis methods, comparison of the developed rule with a rule implemented in the software package SPSS (Fisher’s discriminant rule), «naive» Bayesian classifier, a rule based on support vector machines (SVM) method and implemented in SPSS package binary logistic regression classifier is made. Results of the ROC-analysis have shown that the proposed rule has higher quality than all other mentioned rules of classification of respondents.

Keywords: *discriminant analysis, solving rule, Bayes solution, Fisher’s linear rule, binary logistic regression, support vector machines method, ROC-curve, AUC indicator.*

JEL classification: C38, Z13.

Исследование российской экономики



Е.А. Федорова

И.Я. Лукасевич

Индекс давления на валютный
рынок (ЕМР): особенности
развивающихся рынков

О.Г. Васильева

Вредит ли изобилие
природных ресурсов
инвестициям в образование?
Случай российских регионов

Е.А. Федорова

ВЗФЭИ, Москва

И.Я. Лукасевич

ВЗФЭИ, Москва

Индекс давления на валютный рынок (ЕМР): особенности развивающихся рынков

В статье рассматриваются методологические подходы к определению индекса давления на валютный рынок и области их применения. Рассчитывается индекс давления на валютный рынок для 49 развитых и развивающихся стран, раскрываются особенности применения индекса для анализа интеграционных процессов в экономике. Результаты могут использоваться при разработке государственной антикризисной политики.

Ключевые слова: *антикризисная политика, индекс валютного давления, развивающиеся страны, российский финансовый рынок.*

Классификация JEL: G01, G15.

1. Введение

Развивающиеся страны особенно подвержены рискам, связанным с нестабильностью финансовой системы. Периоды финансовой нестабильности, предшествующие кризису, могут иметь основные общие элементы. Затраты, которые несет экономика во время финансовых кризисов, стали объектом многочисленных исследований и построения таких моделей, которые позволили бы распознать нарастание предкризисных явлений и дать экономическим агентам время на их преодоление. Таким образом, для предотвращения развертывания кризиса необходим мониторинг состояния финансовой системы страны, в том числе по некоторому набору кризисных индикаторов, позволяющих на регулярной основе анализировать ее стабильность.

В настоящее время появилось множество исследовательских работ, посвященных изучению финансовых кризисов, как в зарубежной, так и в отечественной литературе. Однако существует ряд проблем, которые требуют более серьезного рассмотрения. Например, не совсем понятно, каким образом идентифицировать сам кризис. В рамках данной работы был построен и проанализирован кризисный индикатор – индекс валютного давления (*exchange market pressure, ЕМР*) для различных стран, в том числе и для России, позволяющий формально идентифицировать кризисные ситуации. Тема является актуальной, так как МВФ в 2009 г. предложил использовать индекс финансового стресса (*IMF financial stress index*) для стран с развивающейся экономикой, и ЕМР входит в него в качестве одного из пяти показателей.

Одной из главных задач последних исследований финансовых кризисов является построение единого кризисного индекса, который обеспечивал бы надежное предупреждение периодов финансовой нестабильности в экономике. В исследованиях таких ученых, как

(Eichengreen, Rose, Wyplosz, 1995, 1996; Kaminsky, Lizondo, Reinhart, 1998; Kaminsky, Reinhart, 1999), получены различные конструкции раннего предупреждения кризисных ситуаций в экономике в виде индекса давления на валютный рынок. Этот показатель обычно представляет собой средневзвешенное значение темпа обесценения национальной валюты (обычно по сравнению с долларом США, в номинальном или реальном выражении), ежемесячного изменения величины резервов иностранной валюты (в процентном выражении) и ежемесячного изменения процентной ставки.

Высокий уровень ЕМР отражает избыточное предложение на валютном рынке, если государственные органы осуществляют пассивную государственную политику, т.е. воздерживаются от принятия необходимых мер, направленных на снижение предложения. Пассивная государственная политика означает, что центральный банк не вмешивается в регулирование обменного курса. Цели государственной политики могут касаться внутреннего рынка (инфляция и объем производства продукции) или внешнего рынка (текущий платежный баланс или объем официальных международных резервов).

2. Методология исследования

Рассмотрим теоретические и эмпирические исследования построения индекса валютного давления. В многочисленных исследованиях применяются различные подходы к построению индекса валютного давления. В методологии определения индекса возникает ряд вопросов. Например, следует ли включать сюда процентную ставку и если следует, то в какой форме: разности или уровня первого порядка? Следующий вопрос, связанный с использованием концепции ЕМР, заключается в том, какие веса использовать для объединения составляющих? Каждый автор предлагает свой методологический подход к расчету индекса валютного давления, представленный ниже.

1. **Г. Камински и К. Рейнхарт** (Kaminsky, Reinhart, 1999). Их подход к определению ЕМР индекса можно свести к формуле

$$EMPI_{i,t} = \frac{\Delta e_{i,t}}{e_{i,t}} - \frac{\sigma_e}{\sigma_r} \frac{\Delta r_{i,t}}{r_{i,t}}, \quad (1)$$

где $EMPI_{i,t}$ – индекс давления валютного рынка для страны i в период t ; $e_{i,t}$ – курс обмена валюты страны i к валюте базовой страны за период времени в период t ; σ_e – стандартное отклонение обменного курса ($\Delta e_{i,t} / e_{i,t}$); $r_{i,t}$ – иностранные международные резервы страны i в период t , и σ_r является стандартным отклонением изменения иностранных международных резервов ($\Delta r_{i,t} / r_{i,t}$).

2. **Г. Камински, С. Лизондо и К. Рейнхарт** (Kaminsky, Lizondo, Reinhart, 1998). Данная модификация включает номинальную ставку, ЕМР выглядит следующим образом:

$$EMPI_{i,t} = \frac{\Delta e_{i,t}}{e_{i,t}} - \frac{\sigma_e}{\sigma_r} \frac{\Delta r_{i,t}}{r_{i,t}} + \frac{\sigma_e}{\sigma_{int}} \Delta i_{i,t}, \quad (2)$$

где $\Delta i_{i,t}$ – номинальная процентная ставка в стране i за период времени t ; σ_i – стандартное отклонение величины изменения номинальной процентной ставки $\Delta i_{i,t}$.

Индекс ЕМР увеличивается с обесценением национальной валюты, уменьшением иностранных резервов и ростом номинальных процентных ставок.

3. **Б. Эйхенгрин, А. Роуз и К. Виплош** (Eichengreen, Rose, Wyplosz, 1995, 1996). Индекс давления на валютный рынок в этом случае определяется как

$$EMPI_{it} = \frac{1}{\sigma_e} \times \frac{\Delta e_{i,t}}{e_{i,t}} - \frac{1}{\sigma_{res}} \left(\frac{\Delta res_{it}}{res_{it}} - \frac{\Delta res_{USi}}{res_{USi}} \right) + \frac{1}{\sigma_i} (i_{it} - i_{USi}), \quad (3)$$

где σ_{res} – стандартное отклонение разницы между $(\Delta res_{it} / res_{it})$ и $(\Delta res_{USi} / res_{USi})$; i_{it} – номинальная процентная ставка страны i в период t ; i_{USi} – номинальная процентная ставка базовой страны в период t ; σ_i – стандартное отклонение разницы $(i_{it} - i_{USi})$, res_{it} – отношение международных валютных резервов к денежной массе (M1) страны i в период t .

4. **Дж. Сакс, А. Торнелл и А. Веласко** (Sachs, Tornell, Velasco, 1996). Их модифицированный индекс давления на валютный рынок имеет вид:

$$EMPI_{it} = \left(\frac{1/\sigma_e}{(1/\sigma_e + (1/\sigma_r) + (1/\sigma_i))} \right) \frac{\Delta e_{i,t}}{e_{i,t}} - \left(\frac{1/\sigma_r}{(1/\sigma_e + (1/\sigma_r) + (1/\sigma_i))} \right) \frac{\Delta r_{i,t}}{r_{i,t}} + \left(\frac{1/\sigma_i}{(1/\sigma_e + (1/\sigma_r) + (1/\sigma_i))} \right) \Delta i_{i,t}. \quad (4)$$

Можно сделать ряд выводов из анализа модификации расчета ЕМР. До сих пор общим способом измерения ЕМР является средневзвешенная величина трех компонентов, а именно – изменения валютного курса, изменения процентной ставки и изменения объема резервов. Все работы, посвященные ЕМР, используют данный способ измерения ЕМР (либо тот или иной его вариант). Исследования отличаются друг от друга по способу использования компонента процентной ставки. Целью добавления процентной ставки в уравнении индекса ЕМР является определение валютной политики, проводимой для регулирования валютного курса. Центральный банк имеет в своем распоряжении различные валютные инструменты. При свободно плавающем валютном курсе только одна переменная компенсирует давление на валютный рынок – курс обмена валют. При любом другом режиме обмена валют появляются дополнительные переменные, компенсирующие давление, – например, процентная ставка и валютные интервенции.

Несколько авторов опускают процентную ставку, например Н. Фиесс и Р. Шанкар (Fiess, Shankar, 2009), а также Д. Вэймарк (Weymark, 1997). Исследования, учитывающие процентную ставку, используют разность первого порядка. Точнее сказать, А. Моуди и М. Тейлор (Mody, Taylor, 2007) используют только изменение внутренней процентной ставки, тогда как другие авторы используют разность между внутренней процентной ставкой и процентной ставкой в «эталонной» стране (США, Германии или группе стран, см. (Eichengreen, Rose, Wyplosz, 1995, 1996) и т.д.).

Где используется индекс валютного давления? Во-первых, данный индекс используется как кризисный индикатор оценки финансовой нестабильности (см., например, применение сигнального подхода с помощью данного индекса в работе (Трунин, Иноземцев, 2012)), о чем говорилось выше. Во-вторых, индекс валютного давления может использоваться для идентификации периода финансового кризиса в моделях бинарного выбора (пробит- и логит-моделях). Единица означает спекулятивную атаку или эпизод валютного кризиса, если рассчитанный для данного периода индекс EMP превышает или выходит за пределы определенных пороговых значений (Федорова, Безрук, 2011; Bussiere, Fratzscher, 2006).

Согласно традиционному подходу, финансовый рынок страны испытывает давление, если индекс EMP превышает определенную границу, т.е.

$$Crisis = \begin{cases} 1, & \text{если } EMP_{it} > \beta\sigma_{EMP} + \mu_{EMP}; \\ 0 & \text{– в противном случае,} \end{cases} \quad (5)$$

где σ_{EMP} – стандартное отклонение индекса давления на финансовом рынке; μ_{EMP} – среднее значение индекса.

Другими словами, финансовый кризис проявляется тогда, когда давление на финансовом рынке оказывается «аномально высоким». Основная проблема данной методологии заключается в нахождении границы, определяющей критическое значение индекса. В (Eichengreen, Rose, Wyplosz, 1996), например, авторы предлагают в качестве границы применять среднее значение индекса, увеличенное на 1,5 стандартного отклонения (этот подход применяется в нашем исследовании). Другие авторы (Kaminsky, Reinhart, 2000) использовали в своих работах среднее значение индекса, увеличенное на 3 стандартных отклонения. Одним из современных подходов является нахождение критического значения индекса с помощью теории экстремальных значений, основанной на моделировании с помощью метода Монте-Карло (Pozo, Amuedo-Dorantes, 2003).

В-третьих, индекс валютного давления используют для оценки денежно-кредитной политики в рамках управления валютным курсом и для оценки адекватности валютных режимов. Индекс валютного давления также используют для оценки особенности кризисов в региональном разрезе (Mody, Taylor, 2007) и интеграционных процессов.

По нашему мнению, перевод ЕМР (exchange market pressure) на русский язык как «индекс валютного давления» или «индекс давления на валютный рынок» не вполне раскрывает суть данного индекса. Данный индекс применяется в более широком смысле и используется не только для анализа валютного рынка. Предлагается ввести иную трактовку «индекса финансового давления» или «индекса давления на финансовый рынок». Введение данного индекса обуславливается двумя причинами.

1. Более широкое использование индекса на практике. Индекс валютного давления применяется для идентификации не только валютных кризисов, но и банковских кризисов и общих негативных шоков в мировой экономике.
2. В составе индекса используются показатели не только валютного рынка, но и финансового.

3. Результаты расчета индекса валютного давления для развитых и развивающихся стран

В данной работе был рассчитан индекс давления на валютный рынок в соответствии с третьим подходом, описанным выше. Данный подход был выбран потому, что в соответствии с ним используются три основных компонента индекса давления на валютный рынок.

Для расчета индекса давления на валютный рынок использовались данные международной финансовой статистики (IFS) Международного валютного фонда¹. На рис. 1 представлен рассчитанный ежемесячно индекс ЕМР за период с февраля 1990 г. по июль 2010 г. по 49 странам (страны ОЭСР², развивающиеся страны³ и страны СНГ⁴).

На рис. 1 и рис. 2 представлено число стран, испытывающих кризис, в процентах от общего количества рассматриваемых стран. При этом график на рис. 1 построен по данным 49 стран, а на рис. 2 – по 9 странам СНГ. Можно отметить адекватное изменение индекса валютного давления кризисной ситуации в экономике. Большинство стран находилось в состоянии кризиса в 1997–1998 гг., 1998–1999 гг., а также в 2008 г., что соответствует азиатскому финансовому кризису, российскому финансовому кризису, а также мировому экономическому кризису 2008 г. Кроме того, часть стран была поражена кризисом в 1994–1995 гг., что соответствует мексиканскому кризису «текила». Последний финансовый кризис 2008 г. отличается от предыдущих кризисов масштабами распространения. Этот кризис охватывает наибольшее число стран: начиная с 1990 г. 60% исследуемых стран находилось в 2008 г. в кризисном состоянии.

Что касается стран СНГ, то данный регион является уникальным в смысле влияния на него мирового финансового кризиса 2008 г.

¹ Использовались следующие данные: line gf (валютный курс, среднее значение за период), line 60b (годовая ставка денежного рынка), line LL.D (международные валютные резервы).

² Австралия, Австрия, Бельгия, Великобритания, Германия, Голландия, Греция, Дания, Ирландия, Испания, Италия, Канада, Норвегия, Португалия, Финляндия, Франция, Швейцария, Швеция, Япония.

³ Аргентина, Бразилия, Израиль, Индонезия, Колумбия, Корея, Латвия, Малайзия, Мексика, Новая Зеландия, Перу, Польша, Румыния, Сингапур, Словакия, Словения, Таиланд, Турция, Филиппины, Шри-Ланка, ЮАР.

⁴ Азербайджан, Армения, Беларусь, Казахстан, Кыргызстан, Молдова, Россия, Таджикистан, Украина.

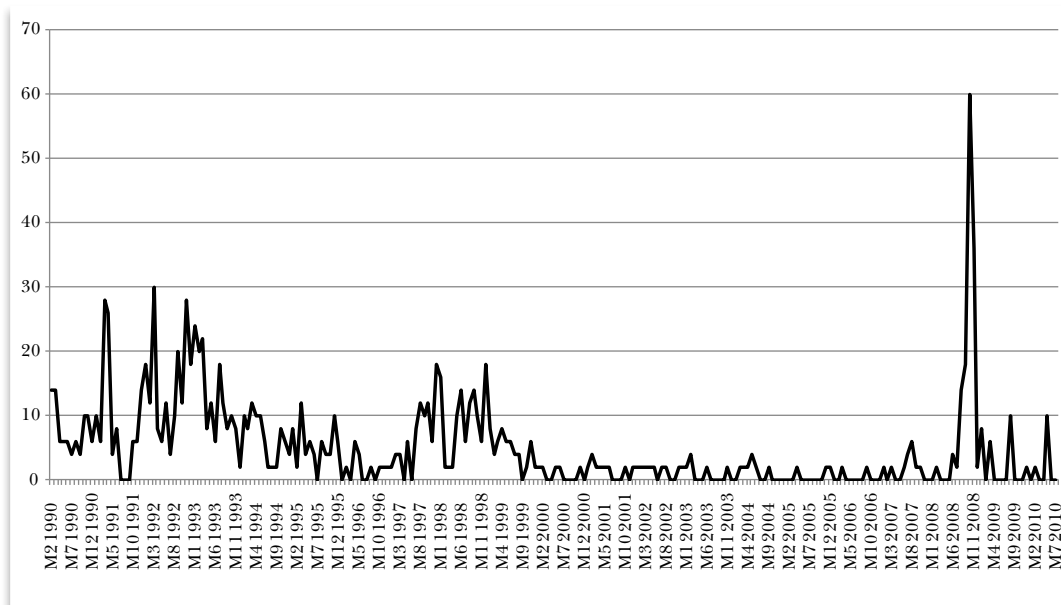


Рис. 1

Число стран, испытывающих финансовый кризис (в процентах от общего количества рассматриваемых стран): 49 стран ОЭСР, развивающихся стран и стран СНГ

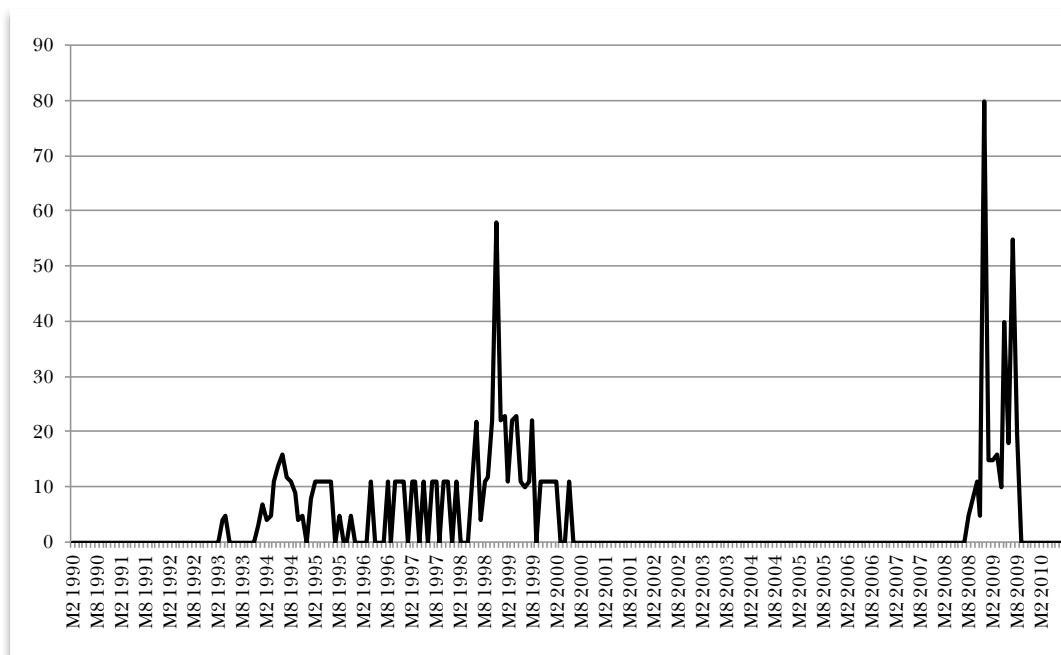


Рис. 2

Число стран, испытывающих валютный кризис (в процентах от общего количества рассматриваемых стран): 9 стран СНГ

Вследствие закрытости экономик отдельных стран и низкой интегрированности их в мировые финансовые рынки часть стран пострадала минимально, остальные же страны кризис затронул довольно существенно. Из рис. 2 следует, что от 55 до 80% стран СНГ испытывало давление на финансовые рынки в конце 2008 г. – первой половине 2009 г. Наиболее низкие значения ЕМР принадлежат Азербайджану, Туркменистану, Узбекистану. Россия, Украина и Армения пострадали от кризиса больше других стран региона.

На рис. 3 представлен ЕМР для России. Можно отметить, что в целом реальные кризисные ситуации соответствуют кризисным ситуациям, оцененным по индексу давления на валютный рынок. Для РФ кризисные ситуации соответствовали 1994, 1998 и 2008–2009 гг.

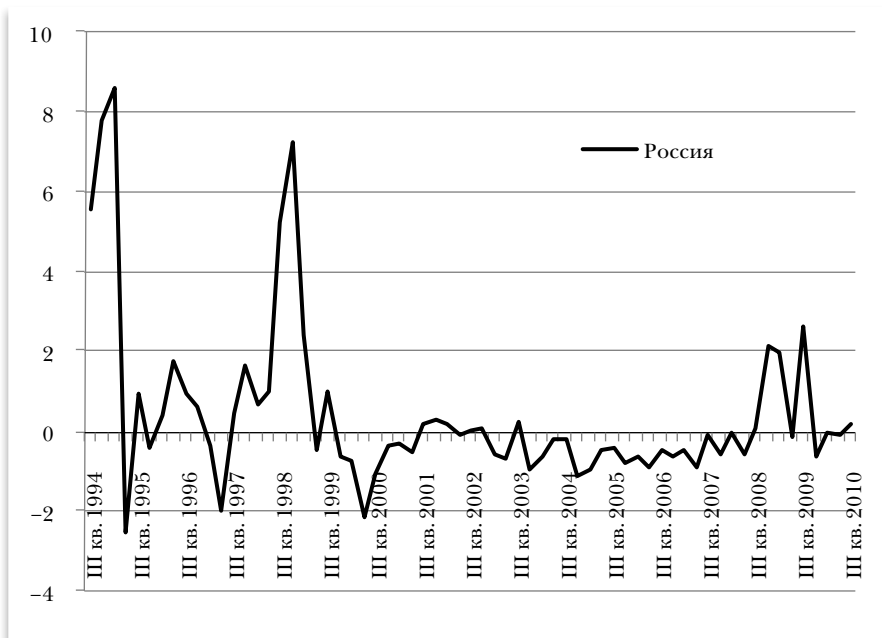


Рис. 3

ЕМР для России (данные на начало III квартала)

Для каждого периода причины финансовых кризисов могут быть иными. Кризис 1994 г. является скорее валютным, чем банковским. 11 октября 1994 г. произошло обвальное падение рубля по отношению к доллару, курс доллара вырос с 2833 до 3926 руб. Кризис 1998 г. западные ученые идентифицировали как банковский и валютный кризис в России. Так, по мнению Дж. Хале, К. Артета (Hale, Arteta, 2009), 8 месяцев 1998 г. идентифицированы как валютный кризис в России. Финский экономист Т. Комулайнен (Komulainen, 1999), изучивший кризис в России на фоне современных теорий валютных кризисов, пришел к выводу, что основной причиной российского кризиса был хронический дефи-

цит федерального бюджета. Совершенно противоположные выводы делают М.Ф. Монтеc и В.В. Попов: они считают, что в России не было монетизации бюджета, а сам дефицит в 1995–1998 гг. был подконтролен властям страны. Поэтому он не мог быть серьезным фактором провоцирования кризиса. Кризис 1998 г. также можно отнести к банковскому кризису. А. Демиргук-Кунт и Э. Детражиа (Demirgüç-Kunt, Detragiache, 1998) предложили свой способ определения кризиса как банковского. Ситуацию финансовой неустойчивости банковского сектора можно охарактеризовать как полномасштабный системный банковский кризис, если выполняется хотя бы одно из следующих условий:

- доля безнадежных ссуд в общей сумме активов банковского сектора превышает 10%;
- затраты на проведение мер по оздоровлению ситуации в отрасли составили более 2% ВВП;
- результатом проблем в банковском секторе стала национализация значительной доли банков;
- имели место массовые изъятия вкладов из банков («набеги» вкладчиков), применялись меры чрезвычайного характера (замораживание депозитов, объявление длительных «банковских каникул») или вводились в действие механизмы государственного гарантирования депозитов.

Такой подход позволил авторам Л. Ливен, Ф. Валенсия (Laeven, Valencia, 2008) выделить 31 банковский кризис из 546 наблюдений (23 из них произошли в развивающихся странах, а 8 – в развитых). Для России авторы выделили периоды банковского кризиса – 1995 г. и 1998–1999 гг. Таким образом, в рассматриваемом периоде, по сути, имели место два кризисных состояния, при этом они были в большей степени валютными, чем банковскими. Так как индекс ЕМР мгновенно реагирует на изменение валютной составляющей, поэтому для указанных периодов характерен более высокий всплеск.

Что касается кризисной ситуации 2008–2009 гг., то причины ее возникновения отличаются от кризисной ситуации 1998 г. Так, по мнению А. Навоя (Навой, 2009), их основными «новыми причинами» являются: усиление деградации потенциала российской промышленности в целом и машиностроения в частности, переход экономической активности от производственной сферы к сфере обращения и перераспределения общественного продукта, глубокие диспропорции в банковской системе, лавинообразное увеличение внешнего долга и т.д. Таким образом, можно сделать вывод о том, что в отличие от кризиса 1998 г., в большей степени порожденного обвалом валютного курса, кризисные явления 2008 г. имеют преимущественно системный характер. Однако при этом, как отмечает тот же автор, для кризиса 2008 г. характерна более эффективная государственная антикризисная политика, которая позволила замедлить рост кризиса. Масштабы девальвации в 2008 г. были существенно меньше по сравнению с 1994 и 1998 гг. Номинальный курс

рубля к доллару США с сентября по декабрь 2008 г. снизился лишь на 14%, тогда как в аналогичный период 1998 г. падение составило 66%. Поэтому кризисная ситуация 2008–2009 гг. оказалась менее выраженной, чем в 1998 г.

В табл. 1 представлены характеристики индексов ЕМР для всех стран, СНГ, развитых и развивающихся стран (не включающих СНГ).

Таблица 1

Общая характеристика индексов ЕМР для развитых, развивающихся стран и стран СНГ

Показатели	ЕМР (общий)	ЕМР (СНГ)	ЕМР (разви- тые)	ЕМР (развивающиеся страны, без СНГ)
Mean	0,645242	1,020623	0,206796	0,920409
Median	0,369197	0,560103	0,108167	0,544299
Maximum	14,883080	13,45010	8,354697	14,88308
Minimum	-7,998221	-5,321517	-7,998221	-6,298486
Std. Dev.	1,915860	1,996951	1,665941	2,021832
Skewness	1,194821	1,948623	0,166285	1,394088
Kurtosis	8,320288	10,21650	6,404378	7,647073
Jarque-Bera	5434,033	1589,169	759,5506	2091,333

На основании данных табл. 1 можно отметить, что среднее значение индекса давления на валютный рынок развивающихся стран значительно превышает среднее значение индекса ЕМР развитых стран. Волатильность индекса давления на валютный рынок развивающихся стран в 1,2 раза выше волатильности индекса для развитых стран. Данный факт означает, что развивающиеся страны немедленно реагируют на негативные шоки в мировой экономике. При этом можно отметить более ассиметричное распределение ЕМР для развивающихся стран, значения эксцесса отличны от нуля и довольно велики. Сравнение с показателями развитых рынков показывает, что для них характерно более симметричное распределение. Скошенность и эксцесс здесь также присутствуют, но масштаб явления значительно меньше.

Рассмотрим более подробно индекс давления на валютный рынок для отдельных стран. В табл. 2 представлены характеристики ЕМР для России, Германии, Великобритании, Японии для периода с III квартала 1994 г. по III квартал 2010 г.

Из анализа данных табл. 2 можно отметить, что волатильность индекса валютного давления для России (2,14) значительно превышает волатильность индексов валютного давления для Германии, Японии и Великобритании (1,28, 1,57 и 1,54). На рис. 4 представлены графики распределения индексов валютного давления для исследуемых стран.

Таблица 2

Общая характеристика индексов ЕМР для Великобритании, Германии, Японии и России

Показатели	Великобритания	Германия	Япония	Россия
Mean	0,594399	-0,239606	-1,631634	0,461614
Median	0,388873	-0,355760	-1,669325	-0,140514
Maximum	5,974087	4,091997	5,937967	8,633069
Minimum	-2,655877	-6,885520	-5,068698	-2,531076
Std. Dev.	1,504700	1,281091	1,569801	2,139844
Skewness	0,872951	-1,374706	1,514544	2,300211
Kurtosis	4,895801	14,19293	10,14646	8,326200
Jarque-Bera	17,98938	359,7773	163,1698	134,1499

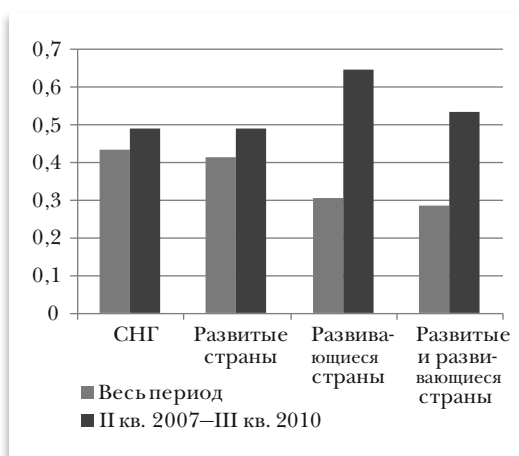


Рис. 4

Кросс-корреляция между индексами валютного давления для СНГ, развитых, развивающихся стран и на общей выборке

Если индекс валютного давления является индикатором кризисной ситуации, то их анализ позволяет выявить особенности кризисных ситуаций в экономике.

В дальнейшем нас интересует вопрос о причинно-следственных связях между индексами валютного давления развитых стран и России. В работе будет проверяться «эффект домино», или «каскадный эффект». В большинстве случаев принимается, что кризис распространяется от некоей «нулевой» страны (страны, где начался кризис) во все остальные страны. «Эффект домино», или «каскадный эффект», возникает в случае,

когда кризис из одной страны передается другой стране и они обе оказывают влияние на некоторую третью страну. П. Мэссон (Masson, 1999) предложил два общих подхода к определению причин распространения финансовых кризисов. Первый объясняет этот феномен торговой интеграцией и сходством макро-экономических параметров стран. Кризис «перетекает» между странами при изменении основных макроэкономических показателей. Такой способ передачи кризиса получил название «распространение, основанное на фундаментальных макроэкономических параметрах» (Eichengreen, Rose, Wyplosz, 1995, 1996). Второй подход связывает распространение финансовых кризисов с финансовой интеграцией, внешними эффектами, изменением поведения инвесто-

ров или других финансовых агентов. При этом кризис в одной стране может стать причиной кризиса в других, даже если у них неплохие макроэкономические показатели. Кризис распространяется, поскольку меняется либо «настроение рынка», либо интерпретация инвесторами экономической информации. Проверим данный эффект с помощью корреляционного анализа. В табл. 3 рассчитана корреляционная матрица между индексами валютного давления для исследуемых стран.

Самый высокий индекс корреляции – между индексами валютного давления Германии и Великобритании за весь период, что вполне объяснимо, поскольку страны находятся в одном регионе, имеют торговые и финансовые связи и поэтому – высокий уровень финансовой интеграции. Они одинаково реагируют на внешние негативные шоки и одновременно вступают в финансовый кризис. Финансовый рынок России является сегментированным, и поэтому имеется низкий уровень корреляции индекса валютного давления России с индексом ЕМР Великобритании (0,2), Германии (0,05) и Японии (0,08).

Что касается другого периода (II кв. 2007 г. – III кв. 2010 г.), то можно отметить значительные изменения: коэффициенты корреляции индексов валютного давления увеличились для всех стран. Произошло увеличение коэффициентов корреляции индексов валютного давления для России и Великобритании с 0,22 до 0,75; для России

Таблица 3

Корреляционная матрица между индексами валютного давления

Страны	Россия	Германия	Великобритания	Япония
Весь период				
Россия	1	0,05164	0,21522	0,07581
Германия	0,05164	1	0,4567	0,4654
Великобритания	0,21522	0,45673	1	0,39082
Япония	0,07581	0,4654	0,39082	1
II кв. 2007 г. – III кв. 2010 г.				
Россия	1	0,742710	0,74742	0,49504
Германия	0,74271	1	0,78899	0,35974
Великобритания	0,74742	0,78899	1	0,21351
Япония	0,49504	0,35974	0,21351	1
II кв. 2007 г. – III кв. 2010 г. с лагом в квартал				
Страны	Россия	Германия (-1)	Великобритания (-1)	Япония (-1)
Россия	1	0,3803	0,0400	0,0211
Германия (-1)	0,3803	1	0,805	0,3536
Великобритания (-1)	0,04000	0,805	1	0,1882
Япония (-1)	0,0211	0,3536	0,1882	1

и Германии – с 0,05 до 0,74 и для России и Японии – с 0,08 до 0,50. Это можно объяснить тем, что экономические и финансовые системы в мире становятся все более интегрированными благодаря быстрому расширению международной торговли товарами, услугами и финансовыми активами. Одновременно с усилением процессов экономической интеграции происходит повышение уровня и темпов финансовой интеграции. По данным результатам можно определить лаг для «перетока» последнего финансового кризиса, данный лаг находится в пределах трех месяцев. При этом лаг может быть и больше, чем три месяца. Эта гипотеза проверялась добавлением лага (-1) при расчете коэффициентов корреляции между индексами валютного давления исследуемых стран.

Рассчитанные коэффициенты корреляции индексов валютного давления значительно уменьшились для третьего варианта (см. табл. 3). Коэффициент корреляции индексов валютного давления Великобритании и России уменьшился с 0,74 до 0,04. Негативные шоки финансового рынка Великобритании практически сразу отражаются на финансовом рынке России и далее влияния не оказывают. Что касается Германии и России, то коэффициент корреляции валютных индексов изменился с 0,74 до 0,38. Мы можем объяснить данный факт тем, что основой финансовой интеграции является интеграция торговая (Федорова, 2011); объем внешней торговли между Россией и Германией практически в четыре раза больше, чем между Россией и Великобританией в 2010 г. И поэтому финансовая ситуация на рынках Германии отражается на финансовом рынке России не только немедленно, но и действует более чем три месяца.

Можно отметить, что российский финансовый рынок больше не является сегментированным и негативные ситуации на финансовых рынках Европы практически сразу отражаются на финансовом рынке РФ. Данный факт является одним из признаков проявления «эффекта домино», или «каскадного эффекта». Единой концепции, объясняющей скорость и направление распространения финансовых кризисов, а также каналов их передачи, на данный момент нет. Для каждого финансового кризиса характерны свои каналы распространения и особенности – в зависимости от региона и уровня развития затронутых кризисом стран. Основным каналом «перетока» ранних финансовых кризисов был торговый, при этом «эффект домино» подтвержден для кризиса 1998 г.

По результатам нашего исследования для последнего финансового кризиса лаг «перетока» финансового кризиса находится в пределах трех месяцев для российского финансового рынка.

Чтобы проверить гипотезу о наличии «эффекта домино», вначале были проведены тесты на стационарность (ADF, PP и KPSS-тест) ЕМР Германии и России. При анализе результатов теста Грейнджера на каузальность мы исходили из того, что для отклонения нулевой гипо-

Таблица 4

Результаты теста Грейнджера на каузальность

Нулевая гипотеза	F-statistic	Prob.
II кв. 2007 г. – III кв. 2010 г.		
ЕМР России does not Granger Cause ЕМР Германии	1,631	0,28
ЕМР Германии does not Granger Cause ЕМР России	3,584	0,10
II кв. 2007 г. – III кв. 2010 г. с лагом в квартал		
ЕМР России does not Granger Cause ЕМР Германии	2,685	0,18
ЕМР Германии does not Granger Cause ЕМР России	0,492	0,64

тезы на 10%-ном уровне значимости необходимо, чтобы p -значение для соответствующей пары показателей находилось в пределах до 0,1 (т.е. один из показателей должен находиться в данном пределе, а если оба показателя находятся в пределах до 0,1, то речь идет об их взаимном влиянии).

По результату теста Грейнджера на каузальность было выявлено влияние ЕМР Германии на ЕМР России без лага в период II кв. 2007 г. – III кв. 2010 г.; при лаге в квартал влияния индексов выявлено не было (см. табл. 4). Тест Грейнджера на каузальность подтвердил «эффект домино» с лагом в три месяца. Данный факт можно использовать при построении российской государственной антикризисной политики в части мониторинга финансовой нестабильности; можно рекомендовать рассчитывать ЕМР Германии в качестве кризисного индикатора. При повышении ЕМР Германии необходимо принимать соответствующие меры по предотвращению кризисных ситуаций в РФ.

«Эффект домино» был подтвержден для стран СНГ в работе Ю. Мироновой, в которой был проведен анализ механизма распространения российского кризиса 1998 г. Анализ свидетельствует о том, что российский кризис имел негативные последствия для многих соседних стран. Это неудивительно, принимая во внимание тот факт, что большинство стран СНГ сохраняло тесные торговые связи с Россией. Поэтому развитие реального и финансового секторов этих стран в значительной степени зависело от ситуации в России. В связи с вышеописанным можно отметить важность изучения индекса валютного давления не только для России, но и для других стран СНГ. Полученные в нашей статье результаты также подтверждаются результатами исследования Е.А. Федоровой и О.В. Безрук (Федорова, Безрук, 2011) – определения «эффекта домино» и каналов распространения финансовых кризисов для 49 развитых и развивающихся стран и для стран СНГ на основе логит-моделирования.

С помощью индекса ЕМР можно также оценить финансовую интеграцию. Коэффициент кросс-корреляции может использоваться как индикатор финансовой интеграции (см. например, (Bracker, Koch,

1999) и др.). Во многих работах рассматривается интеграция финансовых рынков с точки зрения перспективы повышения корреляций их доходностей. Чаще всего в них задействован показатель кросс-корреляции, рассчитанный через среднюю корреляцию по странам или периодам (Arshanapalli, Doukas, 1993).

В нашей статье рассчитывается кросс-корреляция между индексами валютного давления для стран СНГ, развитых и развивающихся стран (без СНГ) на общей выборке развитых и развивающихся стран за весь период и за период II кв. 2007 г. – III кв. 2010 г.

В целом можно отметить увеличение коэффициента кросс-корреляции для всей совокупности исследуемых стран, что подтверждает ранее выявленный факт усиления интеграционных связей между финансовыми рынками. Однако при этом развивающиеся и развитые рынки по-разному вовлекаются в глобализационные процессы в мировой экономике. Для развивающихся стран коэффициент кросс-корреляции за период II кв. 2007 г. – III кв. 2010 г. увеличился по сравнению со всем периодом с 0,3055 до 0,6495, т.е. больше, чем в 2,13 раза. Развивающиеся страны становятся частью мировой финансовой системы и все больше интегрируются между собой. Что касается стран СНГ, то в силу существовавшего в СССР единого народнохозяйственного комплекса эти страны и так находились на довольно высоком уровне интеграции, однако при этом финансовая связь между ними еще больше усилилась, хотя увеличение показателя оказалось незначительным и составляет всего 13,2%. Развитые страны также находятся на довольно высоком уровне интеграции, показатель которой тоже повысился, хотя и незначительно, – всего на 17%.

Хотелось бы отметить, насколько изменились интеграционные процессы между развитыми и развивающимися странами. Для последнего периода коэффициент кросс-корреляции вырос в 1,85 раза. Это означает, что мы находимся в едином финансовом пространстве, куда входят и развитые, и развивающиеся рынки. Интеграционные процессы на финансовых рынках усиливаются, любые негативные шоки в той или иной степени немедленно отражаются на финансовом состоянии экономик всех государств.

4. Заключение

В нашем исследовании рассмотрены основные теоретические подходы к расчету индекса давления на валютный рынок. Что касается практических аспектов, то в данной работе не только рассчитан индекс валютного давления для развитых и развивающихся стран, но и показано, как можно его использовать для анализа интеграционных процессов в экономике.

Были получены следующие результаты: доказано усиление финансовой интеграции для развитых и развивающихся стран, выявлен «эффект домино» для последнего финансового кризиса и опреде-

лен лаг распространения кризиса с помощью корреляционного анализа и теста Грейнджера на каузальность. Доказано влияние финансового рынка Германии на финансовый рынок России с лагом в три месяца.

Предлагается использовать индекс финансового давления и как кризисный индикатор: постоянное повышение индекса может означать ухудшение ситуации в экономике, снижение индекса может демонстрировать действенность мер антикризисной политики и т.д. По результатам нашего исследования при оценке ситуации в области финансовой стабильности в экономике РФ предлагается изучать индекс валютного давления не только на российском финансовом рынке, но и на финансовых рынках крупных развитых и развивающихся стран, в том числе и Германии. Так как любое негативное изменение индексов валютного давления крупных развитых и развивающихся стран практически немедленно отразится на финансовой сфере экономики РФ.

Литература

- Миронова Ю.А.** (2007). Распространение кризисов: теория и практика в приложении к кризису 1998 года. [Электронный ресурс] Проект 03-084. Режим доступа: <http://www.eeeg.ru>, свободный. Загл. с экрана. Яз. рус. (дата обращения: апрель 2012 г.).
- Навой А.** (2009). Российские кризисы образца 1998 и 2008 годов: найти 10 отличий // *Вопросы экономики*. № 2.
- Трунин П., Иноземцев Э.** (2012). Мониторинг финансовой стабильности, 2011 г. [Электронный ресурс] Режим доступа: http://www.iep.ru/index.php?option=com_bibiet&Itemid=50&catid=124&lang=ru&task=showallbib, свободный. Загл. с экрана. Яз. рус. (дата обращения: апрель 2012 г.).
- Федорова Е.А.** (2011). Развитие теории и практики финансовой интеграции фондовых рынков. М.: ВЗФЭИ.
- Федорова Е.А., Безрук О.В.** (2011). Анализ и оценка каналов распространения финансовых кризисов на развивающихся рынках // *Вопросы экономики*. № 7. С. 120–128.
- Arshanapalli B., Doukas J.** (1993). International Stock Market Linkages: Evidence from the Pre- and Post- October 1987 Period // *J. of Banking and Finance*. Vol. 17 (1). P. 193–208.
- Bracker K., Koch P.D.** (1999). Economic Determinants of the Correlation Structure Across International Equity Markets // *J. of Econ. and Business*. Vol. 51. P. 443–471.
- Bussiere M., Fratzscher M.** (2006). Towards a New Early Warning System of Financial Crises // *J. of International Money and Finance*. Vol. 25. P. 953–973.
- Demirgüç-Kunt A., Detragiache E.** (1998). The Determinants of Banking Crisis in Developing and Developed Countries // *IMF Staff Papers*. Vol. 45. P. 90–91.
- Eichengreen B., Rose A., Wyplosz C.** (1995). Exchange Market Mayhem: The Antecedents and Aftermaths of Speculative Attacks // *Econ. Policy*. Vol. 21. P. 249–312.

- Eichengreen B., Rose A., Wyplosz C.** (1996). Contagious Currency Crises: First Tests // *Scandinavian J. of Econ.* Vol. 98. P. 463–484.
- Fiess N., Shankar R.** (2009). Determinants of Exchange Rate Regime Switching // *J. of International Money and Finance.* Vol. 28. P. 68–98.
- Hale G., Arteta C.** (2009). Currency Crises and Foreign Credit in Emerging Markets: Credit Crunch or Demand Effect? // *European Econ. Rev.* Vol. 53. P. 758–774.
- Kaminsky G.L., Reinhart C.M.** (2000). On Crises, Contagion, and Confusion // *J. of International Econ.* Vol. 51. P. 145–168.
- Kaminsky G., Reinhart C.** (1999). The Twin Crises: The Causes of Banking and Balance-of-Payments Problems // *American Econ. Rev.* Vol. 89 (3). P. 473–500.
- Kaminsky G., Lizondo S., Reinhart C.** (1998). Leading Indicators of Currency Crises // *IMF Staff Paper.* Vol. 45 (1). P. 1–48.
- Komulainen T.** (1999). Currency Crisis Theories – Some Explanations for the Russian Case // *Экономический журнал ВШЭ.* Т. 3. № 1. С. 3–27.
- Laeven L., Valencia F.** (2008). Systemic Banking Crises: a New Database // *IMF Working Paper*, 08/224. International Monetary Fund, Washington.
- Masson P.** (1999). Contagion: Macroeconomic Models with Multiple Equilibria // *J. of International Money and Finance.* Vol. 18. P. 587–602.
- Mody A., Taylor M.P.** (2007). Regional Vulnerability: the Case of East Asia // *J. of International Money and Finance.* Vol. 26. P. 1292–1310.
- Pozo S., Amuedo-Dorantes C.** (2003). Statistical Distributions and the Identification of Currency Crises // *J. of International Money and Finance.* Vol. 22. P. 591–609.
- Sachs J.D., Tornell A., Velasco A.** (1996). Financial Crises in Emerging Markets: the Lessons from 1995 // *Brooking Papers on Economic Activity.* Vol. 1. P. 47–215.
- Weymark D.N.** (1997). Measuring the Degree of Exchange Market Intervention in a Small Open Economy // *J. of International Money and Finance.* Vol. 16. P. 55–79.

Поступила в редакцию 27 июля 2010 года

Ye.A. Fedorova

The All-Russian Distance Institute of Finance and Economics, Moscow

I.Ya. Lukasevich

The All-Russian Distance Institute of Finance and Economics, Moscow

Index of Exchange Market Pressure (EMP): Specifics of Emerging Markets

This article discusses the methodological approaches to the definition of the index of exchange market pressure, considers its application. EMP is calculated for 49 developed and emerging countries, particularly for the analysis of integration processes between the economies. The results can be recommended to develop the anti-crisis economic policy.

Keywords: *anti-crisis policy, index of exchange market pressure, developing countries, Russian financial market.*

JEL Classification: G01, G15.

О.Г. Васильева

Амурский государственный университет, ИЭИ ДВО РАН,
Благовещенск

Вредит ли изобилие природных ресурсов инвестициям в образование? Случай российских регионов¹

На основе панельных данных по российским регионам за 2004–2009 гг. получены оценки, свидетельствующие о том, что при прочих равных условиях (включая уровень душевого ВВП) подушевые расходы региональных бюджетов на образование тем ниже, чем богаче регион природными ресурсами. В то же время не было найдено связи между общим уровнем расходов на образование (включая расходы частных лиц) и тем, насколько богат регион природными ресурсами.

Ключевые слова: *человеческий капитал, образование, природные ресурсы, проклятие природных ресурсов.*

Классификация JEL: O13, O15, I28.

Введение

Гипотеза «проклятия» природных ресурсов означает, что темпы экономического роста в богатых природными ресурсами странах ниже, чем в странах, не обладающих их значительными запасами. В качестве одной из причин ресурсного «проклятия» исследователи называют низкие темпы накопления человеческого капитала в богатых природными ресурсами странах. Низкий уровень человеческого капитала ассоциируется с низкой производительностью труда и слабой способностью создавать и заимствовать инновации, низким уровнем социального капитала, плохими институтами в целом, высокой рождаемостью и т.п. Другими словами, с теми факторами, которые чаще всего называют в качестве причин низких темпов экономического роста.

Россия традиционно причисляется к наиболее богатым природными ресурсами странам, и, по мнению ряда исследователей, она не смогла избежать «проклятия» природных ресурсов. Однако российские регионы неоднородны с точки зрения как наделения их природными ресурсами, так и уровня социально-экономического развития, в том числе уровня расходов и качества образования². В данной работе мы используем эту вариацию в данных для оценки влияния изобилия природных ресурсов на государственные расходы на образование и уровень развития образования в российских регионах.

Наши результаты свидетельствуют о том, что расходы на образование консолидированных бюджетов российских регионов тем ниже, чем богаче регионы природными ресурсами. Оценки устойчивы к изменению показателей, используемых для измерения как природ-

¹ Работа выполнена при финансовой поддержке Российского гуманитарного научного фонда (проект 12-02-00111). Автор выражает благодарность К.Ю. Борисову, О.А. Эйсмонту и М.Алексееву за полезные обсуждения и комментарии.

² Расходы консолидированных бюджетов субъектов РФ на образование в расчете на 1 человека в возрасте старше 18 лет варьировали в 2009 г. от 4,4 тыс. в Магаданской области до 231 тыс. руб. на Чукотке. Доля участников ЕГЭ, набравших тестовые баллы выше 200 по трем предметам (в регионе в 2008 г. %), — от 0,38 в Ленинградской области и 0,45 в Амурской до 18,6 в Республике Марий Эл. (Регионы России, 2008 и др. годы; Численность участников ЕГЭ, 2008).

ных ресурсов, так и расходов на образование. Наши выводы согласуются с результатами, полученными другими авторами, использовавшими как субнациональные, так и макроданные. В то же время нам не удалось выявить статистически значимой связи между совокупным спросом на образовательные услуги (уровнем развития образования как отрасли) и природными ресурсами.

Таким образом, настоящее исследование оставляет некоторую неопределенность в отношении вопроса, вынесенного в заголовок. Тем не менее оно вносит вклад в дискуссию о связи изобилия природных ресурсов и аккумуляции человеческого капитала. Отличительной особенностью принятого подхода является изучение симптомов ресурсного «проклятия» на субнациональном уровне. Если основная часть ренты аккумулируется элитами на национальном уровне, то наблюдаются ли негативные эффекты, приписываемые изобилию природных ресурсов, на субнациональном уровне? Возможно ли, чтобы резиденты одного региона имели больше стимулов к инвестициям в человеческий капитал, чем в другом, а причиной, деформирующей их мотивацию, был разный уровень рентных доходов? Полученные результаты могут служить свидетельством того, что по крайней мере некоторые симптомы ресурсного «проклятия» наблюдаются не только на национальном, но и на субнациональном уровне.

Работа построена следующим образом. В разд. 1 приводится обзор литературы. В разд. 2 разъясняется методология исследования, включая описание данных, использованных для анализа. Основные результаты анализа содержатся в разд. 3. Выводы представлены в заключении.

1. Человеческий капитал и изобилие природных ресурсов: обзор литературы³

Почему природные ресурсы могут снижать стимулы к накоплению человеческого капитала? В литературе, исследующей «проклятие» природных ресурсов, было предложено несколько объяснений. Во-первых, так называемая «голландская болезнь», суть которой состоит в следующем (см., например (Corden, Neary, 1982)). Рост мировых цен на сырьевые товары или открытие новых месторождений приводит к притоку доходов от экспорта сырья, что в свою очередь вызывает укрепление национальной валюты и удешевление импорта готовой продукции. В результате отечественный обрабатывающий сектор сокращается, а доля добывающего сектора и сектора услуг в национальной экономике растет. Однако именно обрабатывающий сектор предъявляет основной спрос на квалифицированную рабочую силу. Сервисный сектор производит, как правило, неторгуемые услуги и не испытывает давления международной конкуренции, а значит, он менее чувствителен к качеству человеческого капитала. Добывающий сектор является капиталоемким и не создает большого числа

³ Более подробно обзор показателей, используемых для оценки инвестиций в человеческий капитал, представлен в (Васильева, 2011).

рабочих мест. Поэтому вызванная «голландской болезнью» деиндустриализация экономики может приводить к сокращению спроса на квалифицированную рабочую силу, тем самым снижая премию в оплате труда и стимулы домашних хозяйств инвестировать время и деньги в получение более высокого уровня образования.

Во-вторых, изобилие природных ресурсов часто ассоциируется с низким качеством политических и экономических институтов, что оказывает негативное влияние на стимулы к накоплению человеческого капитала как домашних хозяйств, так и государства в лице политиков и бюрократического аппарата. Так, если права собственности не защищены или защищены только права собственности элиты, а государство неподотчетно обществу, то предпринимательская деятельность становится менее привлекательной и более рискованной (Mehlum, Moene, Torvik, 2006). В таких условиях домашние хозяйства имеют более сильные стимулы участвовать не в производственной, предпринимательской деятельности, а в деятельности, связанной с перераспределением природной ренты. Соответственно они заинтересованы в большей степени в накоплении отношенческого капитала, позволяющего получить доступ к распределению ренты, и в меньшей степени – в аккумулировании человеческого капитала, поскольку инвестиции в образование не вознаграждаются должным образом через рост дохода.

В свою очередь, природная рента снижает зависимость государства, бюрократического аппарата и политических элит от поступления налогов и состояния остальной, несырьевой, части экономики, снижая тем самым уровень подотчетности и стимулы проведения политики, направленной на долгосрочный экономический рост, в том числе и делать инвестиции в человеческий капитал.

Попытки тестирования связи между ресурсным богатством и накоплением человеческого капитала предпринимались неоднократно. На первом этапе исследователи использовали макроданные по странам. Однако результаты, полученные на их основе, оказались неоднозначными. Так, в (Gylfason, 2001; Papyrakis, Gerlagh, 2007; Blanco, Grier, 2010) и ряде других исследований были получены оценки, подтверждающие существование отрицательной статистически значимой связи между богатыми природными ресурсами и накоплением человеческого капитала. В то же время в (Stijns, 2006) автор указал на чувствительность получаемых оценок к способу измерения как природных ресурсов, так и человеческого капитала, а другие авторы (Alexeev, Conrad, 2009) нашли свидетельства существования положительной связи между доходами от добычи природных ресурсов и накоплением человеческого капитала.

Одна из ключевых проблем использования агрегированных на уровне стран показателей состоит в том, что вариация в данных может быть объяснена многими не учтенными в регрессии факторами. Оценки на субнациональном уровне позволяют избежать многих про-

блем, связанных с пропущенными в межнациональных оценках переменными. Так, в ряде работ гипотеза ресурсного «проклятия» тестировалась на данных по США на уровне штатов и округов (Papyrakis, Gerlagh, 2007; Corey, 2009; James, Aadland, 2010). Полученные в этих работах результаты свидетельствуют о том, что симптомы «проклятия» природных ресурсов наблюдаются не только на национальном, но и на субнациональном уровне. В (Papyrakis, Gerlagh, 2007) приведено подтверждение тому, что изобилие природных ресурсов оказывает отрицательное влияние на расходы на образование в США на уровне штатов. При этом эти авторы называют образование главным источником отрицательного влияния изобилия природных ресурсов на экономический рост, приписывая ему 25% совокупного негативного воздействия природных ресурсов.

Автору известны две работы, авторы которых предприняли попытку исследовать некоторые симптомы ресурсного «проклятия» на субнациональном уровне в РФ (Мишура, 2010; Libman, 2011). В первой работе тестируется гипотеза существования зависимости между ростом численности чиновников, неравенством, бедностью и изобилием природных ресурсов в российских регионах. Вторая работа посвящена оценке связи природных ресурсов с качеством политических и экономических институтов. Нам неизвестны работы, где исследуется влияние природных ресурсов на накопление человеческого капитала в РФ. Данное исследование призвано заполнить этот пробел.

2. Данные и методы оценивания

В настоящей работе предпринята попытка проверить гипотезу о том, что чем более страна (или регион) богата природными ресурсами, тем меньше объем ее инвестиций в человеческий капитал в целом, в том числе меньше государственные расходы на образование. Для проверки этой гипотезы используются панельные данные по регионам России за 2004–2009 гг. Россия является одной из наиболее богатых природными ресурсами стран, однако обеспеченность ими сильно варьирует по российским регионам, так же как варьирует качество человеческого капитала и объемы инвестиций в образование. В данной работе эта пространственная неоднородность используется для оценки связи между изобилием природных ресурсов и расходами на образование. Отметим, что в отличие от стран регионы одной страны имеют общую историю, схожие климатические условия, их экономики функционируют в одинаковой (или близкой) институциональной среде, что существенно сужает перечень факторов, которые могли бы объяснить вариацию данных.

Кроме того, включение в модель для регионов фиксированных эффектов позволяет исключить влияние инвариантных особенностей регионов во времени, а учет временных фиксированных эффектов – общих для всех регионов трендов.

Таким образом, в работе тестируется модель

$$Y_{it} = \alpha_i + \gamma_t + \beta R_{it} + \phi X_{it} + \varepsilon_{it},$$

где i и t – обозначают регион и год соответственно; Y_{it} – расходы на образование в регионе; R_{it} – показатель богатства региона природными ресурсами; X_{it} – вектор контрольных переменных; α_i – фиксированные эффекты региона, γ_t – фиксированные эффекты года. Для учета возможной гетероскедастичности данных в работе использовались стандартные ошибки в форме Уайта.

Зависимые переменные. В литературе используются разные способы измерения инвестиций в человеческий капитал, такие, например, как среднее число лет, затраченное на получение образования взрослым населением, охват образованием населения соответствующих возрастов, доля грамотных среди взрослого населения, государственные расходы на образование.

Следует отметить, что такие показатели, как доля грамотных, число лет, затраченных на получение образования, охват образованием населения соответствующих возрастов, отражают в большей степени результаты накопления человеческого капитала, а не собственно расходы на него. Также в России практически нет вариации между регионами по показателям доли грамотного населения или охвата образованием населения соответствующих возрастов.

Кроме того, применение показателей, характеризующих общенациональные расходы на образование или их результаты, не позволяет оценить, в какой степени образование и связанные с ним расходы являются результатом решения домашних хозяйств, а в какой – государственного аппарата. Соответственно в каком случае причиной инвестиций в человеческий капитал является рыночная премия в оплате труда за более высокий уровень образования, а в каком – стимулы элит, политиков и бюрократического аппарата. При использовании региональных данных применение таких показателей становится еще более проблематичным, поскольку помимо домашних хозяйств и регионального правительства на накопление человеческого капитала может также влиять политика федерального правительства.

В свою очередь, показатель расходов регионального правительства на образование позволяет снять вопрос о том, кто ответствен за решения об уровне инвестиций в человеческий капитал. Однако возникает новый вопрос – не обусловлено ли сокращение (абсолютное или относительное) государственного финансирования в регионах, богатых природными ресурсами, его замещением частным образованием и расходами домашних хозяйств или федерального правительства?

Кроме того, использование одних только относительных показателей расходов на образование может приводить к ошибочному заключению. Так, в одном и том же регионе возможны высо-

кие среднедушевые показатели расходов на образование и низкие относительные.

Учитывая проблемы, возникающие в связи в перечисленными выше показателями, в нашей работе применены четыре показателя инвестиций в человеческий капитал: логарифм расходов бюджета на 1 одного жителя региона в возрасте до 18 лет⁴, доля расходов на образование в бюджете региона, доля расходов на образовательные услуги в ВРП и логарифм добавленной в образовании стоимости на душу населения. Первые два показателя позволяют оценить влияние избытка ресурсов на стимулы нести расходы на образование политиков и бюрократического аппарата в российских регионах. В свою очередь, показатель доли образовательных услуг в ВРП и логарифм добавленной стоимости в образовании на душу населения (отражающий стимулы как правительства, так и домашних хозяйств) позволят ответить на вопрос, вызывает ли рост ресурсной ренты снижение инвестиций в человеческий капитал в регионе в целом.

Объясняющие переменные. В литературе, посвященной «проклятию» природных ресурсов вопрос о том, как измерять богатство стран или регионов природными ресурсами, вызывает наиболее горячие дискуссии. С одной стороны, предметом обсуждения является вопрос о том, какие именно природные ресурсы следует принимать в расчет. Следует ли, например, учитывать все природные ресурсы, включая лес и землю, или ограничиться минеральными ресурсами или только некоторыми из них? Многие исследователи считают, что вред экономическому развитию наносят только так называемые «точечные» природные ресурсы, такие как нефть, газ, алмазы, другие минеральные ресурсы, в то время как так называемые «диффузные» природные ресурсы либо не оказывают статистически значимого влияния, либо это влияние положительное. С другой стороны, обсуждается вопрос о том, правильно ли использовать относительные показатели (такие, как доля добывающей промышленности в ВВП или доля экспорта сырьевых товаров в ВВП или совокупном экспорте) или следует использовать абсолютные показатели – природная рента или разведанные запасы на душу населения. Так, Дж. Сакс и А. Уорнер (Sachs, Warner, 2001) говорят о том, что следует использовать относительные показатели, так как нас интересует роль природных ресурсов в экономике, то, в какой мере она зависит от природной ренты.

В то же время у других исследователей относительные показатели вызывают ряд возражений. Так, размер доли добывающей промышленности в ВВП зависит от размера экономики в целом. Однако небольшой ВВП может быть обусловлен причинами, никак не связанными с природными ресурсами⁵. Результатом дискуссии об относительных или абсолютных показателях стало установление исследовате-

⁴ Рассчитано автором на основе данных о расходах на образование в регионах РФ и числе детей в регионе в возрасте до 18 лет.

⁵ См. более подробно (Alexeev, Conrad, 2009).

лями различий между «ресурсной зависимостью» и «ресурсным изобилием». В первом случае под «ресурсной зависимостью» понимается относительное значение сырьевой ренты в экономике страны. Считается, что именно ресурсная зависимость ассоциируется с низкими темпами экономического роста. Во втором случае речь идет об абсолютном размере ренты или разведанных запасах природных ресурсов в расчете на душу населения. Исследования показывают, что «изобилие природных ресурсов» далеко не всегда ассоциируется с низкими темпами экономического роста.

В работах, посвященных тестированию гипотезы «проклятия» природных ресурсов на субнациональном уровне, используются показатели «изобилия природных ресурсов» и «ресурсной зависимости». Так, при оценке влияния природных ресурсов на уровне регионов США в (Parygakis, Gerlagh, 2007; Cooley, 2009) была использована доля первичного сектора в ВРП и доля добывающей промышленности в ВРП⁶, а в (James, Aadland, 2010) – доля доходов в совокупных доходах первичного сектора. При изучении симптомов ресурсного «проклятия» в российских регионах в фокусе исследования находятся преимущественно «точечные» природные ресурсы: А. Либман (Libman, 2011) воспользовался физическими объемами добычи нефти и газа в угольном эквиваленте и отношением стоимости добытых нефти и газа к ВРП, а А. Мишура (2010) – долей экспорта продукции топливно-энергетического комплекса в ВРП.

В данной работе мы фокусируемся на оценке влияния точечных природных ресурсов на накопление человеческого капитала. При этом мы используем показатели, отражающие как изобилие природных ресурсов, так и ресурсную зависимость. Так, в качестве меры ресурсного богатства используется логарифм один плюс добавленная стоимость, полученная добывающей промышленностью в расчете на душу населения; для оценки ресурсной зависимости – доля добывающей промышленности в ВРП и доля экспорта продукции топливно-энергетического комплекса в ВРП.

Контрольные переменные. В качестве контролей в регрессии были включены логарифм ВРП на душу населения, логарифм доходов бюджета региона на душу населения, доля городского населения в общей численности населения, доля населения моложе 18 лет.

Все данные – в постоянных ценах 2003 г. Описательная статистика используемых показателей приведена в табл. 1. Во всех случаях оценивание производилось OLS, его результаты представлены в табл. 2, 3⁷.

⁶ А также ряд других показателей для проверки робастности результатов – доля первичного сектора в ВРП, доля сельского хозяйства в ВРП, объем производства в первичном секторе на душу населения, объем производства в первичном секторе на 1 км².

⁷ Результаты регрессий, предполагающих исключение наблюдений по Москве и Санкт-Петербургу, дают качественно схожие результаты, во всех случаях знаки при показателях ресурсного изобилия сохраняются, однако снижается их статистическая значимость.

Таблица 1

Описательная статистика

Показатели	Медиана	Максимальное значение	Минимальное значение	Стандартное отклонение
Доля расходов на образование в бюджете субъекта РФ	24,50	38,08	9,60	4,12
Логарифм расходов на образование в бюджете региона РФ на душу населения	2,86	4,87	0,11	0,88
Доля образовательных услуг в ВРП	4,00	14,4	1,10	1,84
Логарифм добавленной стоимости в образовании на душу населения	7,88	9,66	6,79	0,45
Доля экспорта продукции топливно-энергетического комплекса в ВРП	0,21	349,15	0,00	26,19
Доля добывающей промышленности в ВРП	1,65	59,90	0,00	11,55
Логарифм один плюс добавленная стоимость в добывающей промышленности региона на душу населения	6,71	12,66	0,00	2,79
Логарифм ВРП на душу населения	11,19	13,23	9,38	0,57
Логарифм доходов регионального бюджета на душу населения	2,68	5,69	1,84	0,53
Доля городского населения	69,16	100,00	25,89	12,66
Доля населения моложе 18 лет	16,15	33,60	12,30	3,34

Таблица 2

Оценка связи между расходами на образование регионального правительства и богатства природными ресурсами

Показатели	Доля расходов на образование в бюджете субъекта РФ			Логарифм расходов на образование в бюджете региона РФ на душу населения		
	Модель 1	Модель 2	Модель 3	Модель 4	Модель 5	Модель 6
Логарифм один плюс добавленная стоимость в добывающей промышленности региона на душу населения	-0,33*** (0,13)	-	-	-0,01*** (0,004)	-	-
Доля добывающей промышленности в ВРП	-	-0,06*** (0,01)	-	-	-0,003*** (0,001)	-
Доля экспорта продукции топливно-энергетического комплекса в ВРП	-	-	-0,009*** (0,003)	-	-	-0,0001 (0,0004)

Окончание таблицы 2

Показатели	Доля расходов на образование в бюджете субъекта РФ			Логарифм расходов на образование в бюджете региона РФ на душу населения		
	Модель 1	Модель 2	Модель 3	Модель 4	Модель 5	Модель 6
Логарифм ВРП на душу населения	1,21 (0,95)	2,26*** (0,87)	0,71 (0,80)	-0,06 (0,07)	-0,001 (0,07)	-0,06 (0,07)
Логарифм доходов регионального бюджета на душу населения	-5,22*** (1,36)	-5,40*** (1,28)	-4,84*** (1,30)	0,61*** (0,08)	0,60*** (0,08)	0,61*** (0,09)
Доля населения моложе 18 лет	0,23 (0,23)	0,25 (0,18)	0,33 (0,27)	0,01 (0,01)	0,01 (0,01)	-0,01 (0,01)
Доля городского населения	-0,08 (0,12)	-0,13 (0,12)	-0,09 (0,12)	-0,002 (0,004)	-0,005 (0,005)	-0,002 (0,005)
Региональные фиксированные эффекты	Да	Да	Да	Да	Да	Да
Фиксированные временные эффекты	Да	Да	Да	Да	Да	Да
Число наблюдений	474	474	474	474	474	474
R^2	0,90	0,90	0,90	0,99	0,99	0,99

Примечание. В скобках указано значение стандартной ошибки в форме Уайта; «***» помечены коэффициенты при переменных, статистически значимые на уровне 1%.

Таблица 3

Оценка связи предложения образовательных услуг в регионе и богатства природными ресурсами

Показатели	Доля образовательных услуг в ВРП			Логарифм добавленной стоимости в образовании на душу населения		
	Модель 7	Модель 8	Модель 9	Модель 10	Модель 11	Модель 12
Логарифм один плюс добавленная стоимость в добывающей промышленности региона на душу населения	-0,01 (0,04)	-	-	0,01 (0,01)	-	-
Доля добывающей промышленности в ВРП	-	-0,004 (0,009)	-	-	-0,004*** (0,001)	-
Доля экспорта продукции топливно-энергетического комплекса в ВРП	-	-	0,002 (0,002)	-	-	0,0006** (0,0002)
Логарифм ВРП на душу населения	-3,54*** (0,34)	-3,47*** (0,22)	-3,47*** (0,32)	-0,44*** (0,09)	-0,36*** (0,08)	-0,40*** (0,09)

Окончание таблицы 3

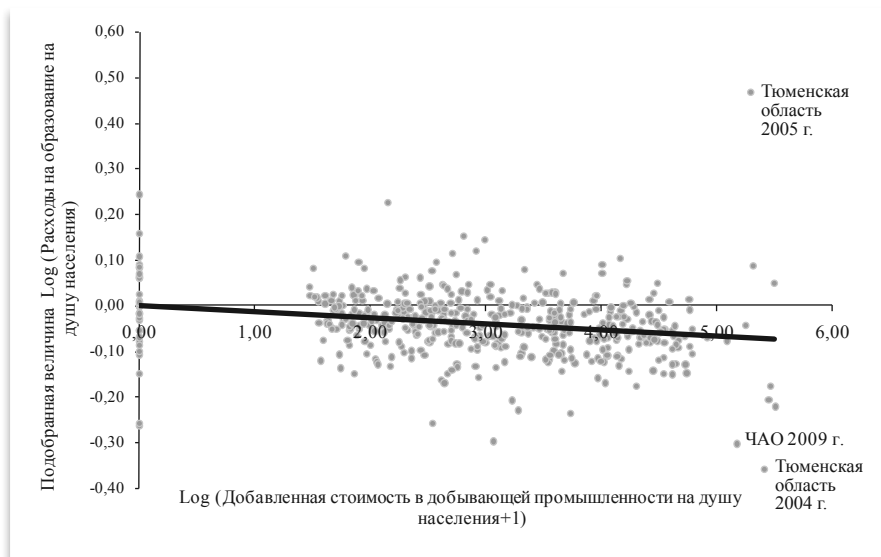
Показатели	Доля образовательных услуг в ВРП			Логарифм добавленной стоимости в образовании на душу населения		
	Модель 7	Модель 8	Модель 9	Модель 10	Модель 11	Модель 12
Логарифм доходов регионального бюджета на душу населения	0,69*** (0,19)	0,68*** (0,17)	0,62*** (0,16)	0,14*** (0,03)	0,14*** (0,03)	0,12*** (0,04)
Доля населения моложе 18 лет	0,04 (0,17)	0,04 (0,11)	-0,002 (0,14)	0,01 (0,01)	0,02*** (0,01)	-0,002 (0,01)
Доля городского населения	0,01 (0,01)	0,004 (0,02)	0,01 (0,01)	-0,01 (0,01)	-0,01 (0,01)	-0,01 (0,01)
Региональные фиксированные эффекты	Да	Да	Да	Да	Да	Да
Фиксированные временные эффекты	Да	Да	Да	Да	Да	Да
Число наблюдений	474	474	474	474	474	474
R^2	0,98	0,98	0,98	0,96	0,96	0,96

Примечание. В скобках указано значение стандартной ошибки в форме Уайта; «***», «**», «*» помечены коэффициенты при переменных, статистически значимые на уровне 1%, 5 и 10% соответственно.

3. Изобилие природных ресурсов и расходы региональных бюджетов на образование

Показатели ресурсного богатства и ресурсной зависимости дали качественно схожие оценки, свидетельствующие об отрицательной связи между государственными расходами на образование в субъектах РФ и природными ресурсами. На рисунке приведен пример диаграммы рассеивания, демонстрирующей отрицательную корреляцию между доходами региона от добычи природных ресурсов и расходами региональных бюджетов на образование. По горизонтальной оси отложен логарифм добавленной стоимости, производимой в добывающей промышленности в регионе в расчете на душу населения, а по вертикальной оси – подобранное (*fitted value*) на основе модели 4 из табл. 2 значение логарифма расходов региональных бюджетов на образование в расчете на душу населения.

В тех спецификациях, где оценивалась связь между *долей расходов на образование в региональном бюджете* и природными ресурсами, все полученные оценки коэффициентов при показателях ресурсного богатства значимы на уровне 1%. Однако сами значения коэффициентов, отражающие их экономическую значимость, невелики. Так, рост доли добывающей промышленности в ВРП на 1% сопровождается



Рисунок

Расходы на образование и доходы в добывающей промышленности в регионах России в 2004–2009 гг.

снижением доли расходов на образование в региональных бюджетах на 0,06%. Соответственно увеличение доли добывающей промышленности в экономике региона на одно стандартное отклонение (11,55%) приведет к сокращению доли расходов на образование в структуре регионального бюджета на 0,7%.

Оценки связи между переменными природных ресурсов и *среднедушевыми расходами региональных бюджетов на образование* в двух из трех спецификаций значимы на уровне 1%. Однако использование доли экспорта продукции топливно-энергетического комплекса в ВРП в качестве меры ресурсной зависимости показало отсутствие статистически значимой связи между этим показателем и среднедушевыми расходами региональных бюджетов на образование.

В отношении контролей были получены оценки, свидетельствующие о том, что уровень ВВП на душу населения в регионе, как правило, не оказывает статистически значимого влияния на расходы регионального правительства на образование. В то же время чем выше доходы регионального бюджета в российских регионах, тем выше расходы на образование в расчете на душу населения, но ниже их доля в совокупных расходах. Возрастная структура населения и уровень урбанизации региона не оказывают статистически значимого влияния на размеры инвестиций в человеческий капитал.

В целом полученные оценки негативной связи между расходами региональных бюджетов на образование и богатством региона природными ресурсами согласуются с результатами (Philippot, 2010;

Gylfason, 2001), полученными на основе агрегированных национальных данных. Оба исследователя показали, что доля государственных расходов на образование в ВВП тем меньше, чем выше зависимость страны от природных ресурсов. Кроме того, в (Philipot, 2010) также показано, что этот вывод справедлив не только для ресурсозависимых стран, но и для стран, богатых природными ресурсами.

Однако нами не было выявлено статистически значимой зависимости между показателями, отражающими богатство региона природными ресурсами, и *долей образования в ВРП* (табл. 3). Применение показателя *добавленной стоимости, произведенной в образовании, в расчете на душу населения* дало смешанные результаты. В одной спецификации была найдена отрицательная статистически значимая связь, во второй – положительная (хотя значение коэффициента очень невелико), а еще одна спецификация показала отсутствие связи между уровнем развития образования как отрасли экономики и природными ресурсами. Однако (Paryukakis, Gerlagh, 2007), используя аналогичные показатели для штатов США, нашли отрицательную зависимость между богатством региона природными ресурсами и совокупными расходами на образование.

Отсутствие устойчивой статистически значимой связи между природными ресурсами и долей образования в ВРП в России может быть связано с несколькими факторами. Во-первых, спрос на образовательные услуги, особенно спрос на высшее образование, формируется не только резидентами, но и населением, проживающим в других регионах. Особенно это справедливо для таких образовательных центров, как Москва, Санкт-Петербург, Новосибирск и др. В этом случае, возможно, изменение спроса на образовательные услуги в богатых природными ресурсами регионах будет вызывать изменение объема их предоставления в других регионах России.

Во-вторых, выявленные более низкие абсолютный и относительный уровни расходов регионального правительства на образование в богатых природными ресурсами регионах могут быть компенсированы более высокими расходами домашних хозяйств или федерального правительства. В результате изменится структура финансирования образования, а не совокупный спрос резидентов региона на образовательные услуги.

В отношении контрольных переменных отметим, что во всех наблюдается положительная, значимая на 1% связь между доходами бюджета субъекта РФ и уровнем развития образовательных услуг в регионе, в то время как коэффициенты при показателе ВВП на душу населения имеют отрицательный знак и также значимы на уровне 1%. Отрицательный знак при объясняющей переменной для доли сектора услуг в ВРП может означать, что удельный вес сектора услуг в структуре ВРП сокращается по мере роста размера экономики. Это может проис-

ходить как потому, что сокращается абсолютный размер сектора образования, так и потому, что другие сферы экономики растут быстрее.

Принимая во внимание, что мы использовали модель фиксированных эффектов, отметим, что отрицательный знак при логарифме ВРП на душу населения в случае, когда объясняемой переменной является логарифм среднедушевых общих расходов на образование, означает следующее. Чем больше значение отклонения доходов в регионе от среднего по всем регионам за весь период (после удаления из данных тренда), тем меньше значение отклонения от средних расходов на образование, и наоборот. Это не означает, что в более богатых регионах абсолютные значения расходов на образование меньше, а, скорее, свидетельствует о том, что неравенство между регионами по душевым расходам на образование меньше, чем по среднедушевым доходам.

Отметим, что возрастная структура населения, как и уровень урбанизации не оказывают статистически значимого влияния на развитие образования в российских регионах.

Полученные оценки, свидетельствующие об отсутствии статистически значимой связи между богатством региона природными ресурсами и размером сектора образовательных услуг, с одной стороны, и отрицательной связи между изобилием ресурсов и размером государственных расходов на образование, с другой, позволяют сделать некоторые выводы. Во-первых, отсутствие отрицательной связи между сектором образования и природными ресурсами может свидетельствовать о том, что природные ресурсы не влияют на стимулы домашних хозяйств к накоплению человеческого капитала, хотя косвенно это может свидетельствовать об отсутствии снижения отдачи на образование, вызванного доходами именно от экспорта природных ресурсов. Во-вторых, отрицательная корреляция между расходами региональных бюджетов на образование и изобилием природных ресурсов предполагает слабые стимулы у чиновников и политиков нести расходы на образование, которые не могут быть объяснены симптомами «голландской болезни». Следовательно, причину этой негативной связи между государственными расходами на образование на региональном уровне и изобилием природных ресурсов следует искать, скорее, в дизайне и качестве политических институтов, определяющих стимулы вкладывать в образование у бюрократии и политиков⁸.

Заключение

Наши результаты свидетельствуют о том, что рост доходов в добывающем секторе сопровождается снижением государственных расходов на образование как в абсолютном, так и в относительном выражении. В то же время не было найдено статистически значимой связи между объемом предоставляемых образовательных услуг и размером добывающего сектора в российских регионах.

⁸ Предварительные результаты, полученные в (Васильева, 2012), говорят о том, что если в регионе есть политическая конкуренция между местными и федеральными элитами, то природные ресурсы положительно влияют на расходы региональных бюджетов на образование, если в регионе сформировалась политическая монополия, то природные ресурсы отрицательно коррелируют с расходами на образование.

Полученные в работе выводы ставят вопрос о том, почему и в каких условиях бюрократия и политики при прочих равных тратят на образование меньше в регионах, богатых природными ресурсами, чем в регионах, более бедных природными ресурсами. Связано ли это с убывающей отдачей от инвестиций в образование (т.е. после достижения некоторого уровня среднестатистических расходов на образование рациональным является переключение на другие виды расходов, например, на развитие инфраструктуры или медицинское обеспечение) и/или обусловлено другими, например, политэкономическими факторами? Поиск ответа на этот вопрос – цель дальнейших исследований.

Другим значимым вопросом, оставшимся за рамками данной работы, является вопрос о связи между расходами домашних хозяйств на образование и изобилием природных ресурсов. Возможно, в регионах, богатых природными ресурсами, домашние хозяйства в большей степени участвуют в финансировании образования, чем в бедных регионах. Тогда полученные в данной работе результаты свидетельствуют лишь об иной структуре источников финансирования образования, а не о меньших стимулах у бюрократии и политиков в богатых ресурсами регионах накапливать человеческий капитал.

Литература

- Васильева О.** (2012). Изобилие природных ресурсов, политическая конкуренция и инвестиции в человеческий капитал. [Электронный ресурс] Доклад на XIII Апрельской международной научной конференции по проблемам развития экономики и общества. Режим доступа: <http://conf.hse.ru/2012/program>, свободный. Загл. с экрана. Яз. рус. (дата обращения: март 2012 г.)
- Васильева О.** (2011). Накопление человеческого капитала и изобилие природных ресурсов // *Вопросы экономики*. № 12. С. 66–77.
- Мишура А.** (2010). Ресурсозависимость и качество институтов в регионах России // *Журнал Новой экономической ассоциации*. № 6. С. 82–96.
- Регионы России (2008). Регионы России: Социально-экономические показатели. 2008: Статистический сборник. М.: Росстат.
- Численность участников ЕГЭ (2008). Численность участников ЕГЭ, получивших наивысший балл по нескольким предметам в 2008 г. [Электронный ресурс] Статистика российского образования. Режим доступа: http://stat.edu.ru/scr/db.cgi?act=TableFlds&t=ege_2008_16&tttype=1, свободный. Загл. с экрана. Яз. рус. (дата обращения: июль 2012 г.)
- Alexeev M., Conrad R.** (2009). The Elusive Curse of Oil // *Review of Econ. and Statistics*. Vol. 9. N 3. P. 599–616.
- Blanco L., Grier R.** (2010). The Effect of Natural Resource Dependence on Human and Physical Capital in Latin America. Working Paper. January.
- Corden W. M., Neary J. P.** (1982). Booming Sector and De-Industrialisation in a Small Open Economy // *The Econ. J.* Vol. 92. N 368 (Dec.). P. 825–848.
- Corey G.** (2009). Development in US States, Economic Freedom, and the «Resource

Curse». *Studies in Mining Policy*. Fraser Institute. [Электронный ресурс] Режим доступа: [Электронный ресурс] Режим доступа: <http://www.fraserinstitute.org>, свободный. Загл. с экрана. Яз. англ. (дата обращения: апрель 2010 г.)

Gylfason T. (2001). *Natural Resources, Education, and Economic Development* // *European Econ. Rev.* Vol. 45. № 4–6. P. 847–859.

James A., Aadland D. (2010). *The Curse of Natural Resources: An Empirical Investigation of U.S. Counties*. [Электронный ресурс] Режим доступа: <http://www.uwo.edu/>, свободный. Загл. с экрана. Яз. англ. (дата обращения: август 2010 г.)

Libman A. (2011). *Natural Resources and Sub-National Economic Performance: Do Economic or Political Institutions Matter?* [Электронный ресурс] // *Working paper, September 2011*. Режим доступа: http://papers.ssrn.com/sol3/papers.cfm?abstract_id=1702296, свободный. Загл. с экрана. Яз. англ. (дата обращения: февраль 2011 г.)

Mehlum H., Moene K., Torvik R. (2006). *Institutions and the Resource Curse* // *Econ. J.* Vol. 116. N 508. P. 1–20.

Papyrakis E., Gerlagh R. (2007). *Resource Abundance and Economic Growth in the United States* // *European Econ. Rev.* Vol. 51. № 4. P. 1011–1039.

Philippot L.M. (2010) *Are Natural Resources a Curse for Human Capital Accumulation?* [Электронный ресурс] // *CERDI Working Paper*. Режим доступа: <http://cerdi.org/uploads/sfCmsContent/html/333/Philippot.pdf>, свободный. Загл. с экрана. Яз. англ. (дата обращения: июль 2011 г.)

Sachs J.D., Warner A.M. (2001). *Natural Resources and Economic Development: The Curse of Natural Resources* // *European Econ. Rev.* Vol. 45. N 4–6. P. 827–838.

Stijns J.P. (2006). *Natural Resource Abundance and Human Capital Accumulation* // *World Development*. Vol. 34. № 6. P. 1060–1083.

Поступила в редакцию 31 марта 2012 года

O.G. Vasilyeva

Amur State University, Economic Research Institute, Russian Academy of Science Far East Branch, Blagoveshchensk

Does Abundance of Natural Resources Impair Investments in Education? Case of Russian Regions

Using panel data for Russian regions in 2004–2009, I find some evidence that everything else (including per capita GDP) being equal natural resource abundance is associated with lower public spending on education in Russian regions. Meanwhile I don't find any connection between the total (including private) spending on education and natural resources wealth.

Keywords: *human capital, education, natural resource, natural resource curse.*

JEL Classification: O13, O15, I28.

Вопросы экономической политики



А.К. Соловьев

Проблемы формирования
страховой пенсионной системы
России

А.Ю. Чепуренко

Что такое предпринимательство
и какая политика в отношении
предпринимательства нужна
России? (Заметки на полях
работ современных зарубежных
классиков)

А.К. СОЛОВЬЕВ

Пенсионный фонд Российской Федерации,
Департамент актуарных расчетов и стратегического планирования,
Москва

Проблемы формирования страховой пенсионной системы России

В процессе разработки «Долгосрочной стратегии социально-экономического развития России до 2030 г.» (Стратегия-2020) проблемы реформирования пенсионной системы нашего государства выдвинулись на передний план в качестве одного из главных макроэкономических факторов, значимость которого намного превышает валютную и нефтегазовую составляющие. В статье актуарно обосновываются реальные факторы, влияющие на развитие пенсионной системы РФ, и определяются перспективы устойчивости пенсионного бюджета на основе страховых принципов.

Ключевые слова: пенсионная система, страховая пенсионная система, пенсии застрахованных лиц, обязательства государства, доходы и расходы бюджета Пенсионного фонда Российской Федерации, страховые взносы, пенсионные накопления.

Классификация JEL: G230, I380.

1. Проблемы реализации страховой «Долгосрочной стратегии развития пенсионной системы России»

Основными причинами резко возрастающего значения пенсионной системы в развитии страны являются: во-первых, необходимость выполнения конституционных обязательств социального государства по преемственности накопленного пенсионного долга; во-вторых, неизбежность реформирования пенсионной системы на страховых принципах функционирования; в-третьих, выполнение международно установленных норм и требований по материальному обеспечению пенсионеров (Европейский кодекс социального обеспечения, Европейская социальная хартия, Конвенции МОТ № 102, 128 и др.), которые являются обязательными условиями признания нашей страны в качестве цивилизованного социально ориентированного государства.

Помимо перечисленных причин возрастающей значимости пенсионной системы, обусловленных национальными особенностями развития нашей страны, усиление влияния пенсионной системы на макроэкономическую стратегию обусловлено общемировыми процессами. Это в первую очередь глобальный демографический кризис, который вынудил развитые страны Запада еще в прошлом столетии не только реформировать свои пенсионные системы, но и адаптировать всю экономику к необходимости «содержания» неуклонно возрастающей армии нетрудоспособного населения.

Второй по значимости общепризнанной причиной является неизбежность систематических финансовых кризисов как неотъем-

лемых атрибутов рыночной экономики. В условиях глобализации финансовые кризисы вышли за пределы региональных экономик и приобретают глобальный характер, что повышает риски бюджетной устойчивости даже развитых государств. В этой связи обострилась научная дискуссия о «чрезмерной» нагрузке пенсионной системы на экономику страны в целом и на бизнес в частности. В целях решения этих проблем предлагаются различные инструменты «регулирования» как государственного пенсионного долга (накопленные пенсионные обязательства), так и самих пенсионных прав граждан.

Реформирование пенсионной системы России, ее преобразование из советской системы государственного пенсионного обеспечения в систему пенсионного страхования – насущная потребность, продиктованная развитием рыночных отношений.

Мировая практика доказала, что страховые механизмы способны обеспечивать адаптацию пенсионных систем к циклическому характеру рыночного развития. Одновременно с этим они позволяют преодолеть уравнищность различных видов пенсий, повысить реальный размер пенсий, не только создать условия для предотвращения финансовых кризисов пенсионной системы в связи со старением населения России, но и обеспечивать текущую финансовую устойчивость пенсионной системы

Страховая пенсионная реформа была начата в 2002 г. в целях обеспечения текущей финансовой устойчивости пенсионной системы, повышения реального размера пенсий и предотвращения кризиса пенсионной системы в связи со старением населения России. Введена трехуровневая структура пенсии, пенсионные права застрахованных лиц начали формироваться не только на распределительной, но и на накопительной основе. При этом источником формирования всех пенсионных прав являются страховые взносы (средства федерального бюджета, перечисляемые в бюджет ПФР, направляются исключительно на покрытие дефицита по выплате пенсий).

Современное пенсионное обеспечение развитых стран представляет собой сложную социально-экономическую систему, которая подвержена воздействию разнонаправленных факторов и эффективное регулирование которой является наиболее трудной стратегической задачей системы государственного управления.

В мировой практике наиболее известны две альтернативные формы пенсионного обеспечения: *солидарно-распределительная* и *индивидуально-накопительная*¹. Указанные экономические формы пенсионного обеспечения в самом общем плане *принципиально* отличаются тем, что в первом случае источником финансирования пенсионного обеспечения одного поколения граждан являются средства другого (следующего) поколения. Во втором случае финансовый источник своего пенсионного обеспечения каждый гражданин формирует самостоятельно в течение всего трудоспособного периода своей жизни.

¹ Подчеркнем, что речь идет о *всеобщем обязательном* государственном пенсионном обеспечении, а не о добровольном индивидуальном или корпоративном.

В свою очередь, солидарно-распределительная форма пенсионного обеспечения может на практике быть реализована через разные экономические механизмы: либо исходя из учета персонифицированных пенсионных прав каждого застрахованного лица, либо исходя из текущих общеналоговых бюджетных ресурсов. Различия между этими моделями имеют принципиальное значение, так как предусматривают разный экономический механизм солидарного перераспределения.

В современной мировой практике отсутствуют в *чистом виде* отмеченные выше экономические формы обязательного пенсионного обеспечения. В экономически *развитых* и социально ориентированных государствах в разных пропорциях обычно применяются все формы пенсионного обеспечения. Только в экономически *неразвитых* странах, в которых государство не может обеспечивать преемственность обязательств разных поколений и государственный бюджет не может участвовать в финансировании этих обязательств, ставят, как показывает история, безуспешные эксперименты индивидуально-накопительного пенсионного обеспечения: Чили, Боливия, Аргентина, Казахстан и т.п. (всего более двух десятков стран).

В нашей стране в ходе рыночной реформы государственная пенсионная политика последовательно проводит курс на *всеобщее обязательное* пенсионное обеспечение на основе *страховых принципов*.

1. Страховые принципы, как это предусматривает теория и показывает мировая практика, должны четко проявляться в двух базовых позициях.
2. Эквивалентность государственных пенсионных обязательств накопленным пенсионным правам застрахованных лиц.

Долгосрочная устойчивость (актуарная сбалансированность) пенсионной системы в течение всего страхового периода (в наших условиях – 70–80 лет, на Западе уже переходят к периоду 100–110 лет).

В соответствии с первым базовым страховым принципом реализация *«Стратегии долгосрочного развития пенсионной системы России»* как в накопительной, так и в распределительной составляющих обязательного пенсионного обеспечения, должна соблюдать установленное соотношение размера пенсии от «трудового участия» каждого застрахованного лица (*продолжительности стажа и суммы уплаченных страховых взносов*). Это положение должно обеспечивать экономическую заинтересованность каждого работника в активном участии в пенсионной системе и в дальнейшем окончательно ликвидировать уравнительный размер пенсии.

Другой базовый принцип – долгосрочную устойчивость и бездефицитность текущего бюджета всеобщего обязательного пенсионного страхования планировалось реализовать на следующих этапах долгосрочной стратегии пенсионной реформы. В соответствии с этими этапами принятая правительством РФ «Стратегия реформирования пенсионной системы на страховых принципах»² определила дальнейшие

² КДР-2020.

направления развития пенсионной системы, которая должна отвечать следующим требованиям:

- государственная **гарантия минимального уровня** материального обеспечения пенсионеров при наступлении страховых случаев (минимальный размер всех видов пенсии – не ниже ПМП³);
- долгосрочная **финансовая обеспеченность** страховых пенсионных обязательств по всем видам трудовых пенсий, т.е. актуарная (не только текущая – кратко- и среднесрочная, но и в течение всего «пенсионного цикла» – не менее 70 лет) сбалансированность пенсионного бюджета;
- **эквивалентность (актуарное соответствие)** государственных пенсионных обязательств накопленным (страховым) пенсионным правам застрахованных граждан.

Пенсионная реформа в отличие от реформ любого другого сегмента общества и экономики охватывает период жизни и деятельности как минимум двух поколений (а с учетом быстрого увеличения продолжительности жизни, может быть, и трех поколений). Поэтому с целью оценки и оперативного регулирования эффективности мероприятий по пенсионной реформе необходимо оперативно контролировать социальные и экономические результаты каждого мероприятия на каждом этапе. Последовательность конкретных мероприятий по реформе и их интенсивность должны выбираться исходя из критерия эффективности на основе актуарных расчетов. Актуарные расчеты позволяют оценить перспективы развития пенсионной системы РФ в условиях пенсионной реформы. Это тем более актуально в условиях возрастающих рисков глобального **финансового и демографического кризисов**.

Проблемы развития пенсионной системы России в условиях перехода на страховые принципы выдвигаются на передний план при формировании долгосрочной стратегии социально-экономического развития страны. Однако позиции различных экспертов существенно различаются как в оценке современной ситуации в отечественной пенсионной системе, так и в предложениях по ее совершенствованию (Аналитический доклад, 2010; Гурвич, 2011; Агапцов, Дегтярев, 2008; Доклад ЦСР, 2011; Аналитическая записка, 2007; Дмитриева, Петухова, Ушаков, 2010). Основные противоречия заключаются в оценке достигнутых результатов пенсионной реформы и уровня пенсионного обеспечения по сравнению с развитыми странами и международно признанными нормами. Одни считают главной проблемой сохранение завышенных пенсионных обязательств государства, которые не могут быть обеспечены финансовыми ресурсами, другие, наоборот, доказывают, что в результате реформы пенсионные права граждан были необоснованно урезаны с целью сокращения бюджетных расходов. Опираясь на выбранные приоритетные проблемы, предлагаются различные альтернативы выхода из грядущего пенсионного кризиса.

³ ПМП – прожиточный минимум пенсионера.

2. Проблемы развития пенсионной системы: реальные и мнимые

Текущее (после пенсионной реформы 2002–2010 гг.) состояние пенсионной системы Российской Федерации характеризуется тремя основными проблемами.

1. **Сохранение дефицита** страховой пенсионной системы в 1,1 трлн руб. в расчете на 2012 г., в 2020 г. – 2,4 трлн руб.
2. **Тенденция снижения коэффициента замещения** трудовой пенсии по старости утраченного заработка (%): в 2000 г. – 34; в 2008 г. – 26; в 2010 г. – 39; в 2020 г. – 35.
3. **Поддержание минимальных социальных гарантий** (среднегодовой размер всех видов трудовых и нетрудовых пенсий не должен быть ниже среднегодового ПМП), несмотря на то, что начиная с 2010 г. законодательно установлен механизм социальных доплат ко всем видам трудовых и социальных пенсий до текущего размера ПМП⁴.

Нерешенные проблемы пенсионной системы связаны с разными факторами, объективное выявление которых позволит выработать правильные решения для их преодоления. На первый взгляд выявленные проблемы непосредственно зависят от двух факторов:

- 1) низкого пенсионного возраста;
- 2) слабого развития накопительных форм пенсионного страхования.

Широкое распространение таких представлений вытекает из линейного сравнения отечественной пенсионной системы, страдающей многочисленными недостатками (низкий уровень материального обеспечения пенсионеров, финансовая необеспеченность пенсионных обязательств и т.п.), с преуспевающими западными пенсионными системами. Так, в частности, нормативный возраст выхода на пенсию в западных странах давно вышел на уровень 65 лет. Размер трудовой пенсии в странах ОЭСР достигает 50–70% среднестатистического заработка. При этом пенсионные фонды самостоятельно и устойчиво выполняют свои страховые обязательства.

Одновременно с этим во всех западных странах вклад накопительных форм пенсионного обеспечения становится все более и более весомым не только в формировании пенсионных прав граждан, но и в целом для экономики страны. Так, доля накопительных пенсий в замещении утраченного заработка зачастую превышает распределительную составляющую. Однако следует подчеркнуть, что абсолютное большинство национальных пенсионных систем применяет только добровольные или корпоративные формы пенсионных накоплений, но не всеобщие и принудительные.

Предлагаемые «универсальные инструменты» решения пенсионных проблем следует рассматривать в конкретных условиях каждой страны. Так, проблему возраста выхода на пенсию необходимо рассма-

⁴ В 2012 г. ПМП = 4,9 тыс. руб.

тривать в конкретном контексте демографического положения каждой страны (табл. 1), а проблему пенсионных накоплений следует рассматривать в макроэкономической системе каждой страны. Каковы же сопоставимые условия выхода на пенсию в нашей стране и за рубежом?

Таблица 1

Ожидаемая продолжительность жизни в Российской Федерации и за рубежом

Страна	Пенсионный возраст (лет), мужчин/ женщин	При рождении		При возрасте 65 лет	
		мужчин	женщин	мужчин	женщин
Российская Федерация	60/55	61,8	74,2	11,7	16,0
Страны ОЭСР*, в среднем	65/65	77,1	82,6	17,1	21,4
Австрия	65/60	77,5	83,1	17,6	21,0
Бельгия	65/65	77,1	82,6	17,3	21,0
Германия	65/65	77,4	82,7	17,4	20,7
Ирландия	66/65	77,4	82,1	17,1	20,1
Португалия	65/65	75,9	82,2	16,8	20,2
Великобритания	65/60	77,3	81,7	17,4	20,1
Финляндия	65/65	76,0	83,1	17	21,3
Франция	62/62	77,4	84,4	18,2	22,7
Швеция	65/65	79,0	83,1	17,9	20,8
Казахстан	63/58	60,7	72,6	11,4	15,8
Норвегия	67/67	78,0	85,1	17,8	22,6
Испания	65/65	74,4	83,4	17,6	21,9
Италия	60/57	74,7	83,7	17,8	22,1

*Источники: Eurostat Statistical books, 2007; Демографический ежегодник России, 2009.

Как видно из данных табл. 1, продолжительность жизни населения нашей страны в возрасте 65 лет в 1,5 раза ниже для мужчин и в 1,45 раза – для женщин по сравнению с развитыми странами. Особенно важно обратить внимание на то, что доживают до этого возраста только третья часть мужчин данного поколения и половина женщин. Что это означает для реализации принципов пенсионного страхования, предусмотренных международными конвенциями (Конвенция МОТ № 102 от 1952 г. и Социальный кодекс ОЭСР), которые требуют, чтобы обязательное пенсионное обеспечение **охватывало абсолютное большинство** граждан страны (а не только дожившее до пенсии *абсолютное меньшинство*)?

Сторонники выравнивания условий выхода на пенсию российских граждан и граждан западных стран были бы безусловно оправданны в *дореформенной пенсионной системе*, т.е. с госбюджетным (а не рыночно-страховым) механизмом финансирования, – когда размер пенсионных прав не зависел от «страховых отчислений», а зависел только от возможностей государственного бюджета.

Еще более наглядная картина складывается при сравнении страховых условий в России и странах ОЭСР при действующем в них пенсионном возрасте (табл. 2).

Таблица 2

Сравнение страховых условий в России и странах ОЭСР при действующем в них пенсионном возрасте

Страна	Пенсионный возраст мужчин/женщин, лет	От рождения, лет		Дожитие от пенсионного возраста, лет	
		мужчин	женщин	мужчин	женщин
Российская Федерация	60/55	61,8	74,2	14,1	23,6
Страны ОЭСР, в среднем	65/65	77,1	82,6	17,1	21,4

Сравнение показывает, что разрыв в дожитии мужчин при действующем возрасте 60 лет в России и 65 лет – на Западе сокращается почти на четверть. Но даже в действующих условиях демографические параметры нашей страны не позволяют воплотить базовый страховой принцип эквивалентности пенсионных прав и обязательств, который положен в основу установления требований к пенсионному возрасту со стороны МОТ.

Таким образом, даже действующая возрастная планка выхода на пенсию, которая «перешла» к нам от советской бюджетно-распределительной пенсионной системы, далека от западного уровня, поскольку охватывает около 2/3 мужского населения, что относительно адекватно Конвенции ОЭСР (при условии, что сравниваются разные действующие пенсионные возраста). Развитые страны повышают пенсионный возраст только тогда, когда абсолютное большинство населения (а не отдельная часть) доживает до реализации своих пенсионных прав в полном объеме.

Отсюда следует закономерный вывод, что даже нынешний возраст выхода на пенсию в нашей стране требует серьезной активизации позитивных демографических тенденций, которые позволят применить в пенсионной системе страховые механизмы в соответствии с международными требованиями.

Таким образом, поверхностное впечатление о том, что эффективность западных пенсионных систем обусловлена именно 65-летним

возрастом выхода на пенсию, является глубоким заблуждением: все пенсионные системы устанавливали возраст выхода на пенсию исходя из необходимости поддержания эквивалентности пенсионных прав и реализации обязательств, поскольку рост продолжительности жизни после выхода на пенсию не мог полностью обеспечиваться накопленными пенсионными правами⁵.

После наступления возраста старости не только мужчины, доживающие до пенсионного возраста, но и значительная часть женщин даже при действующем возрасте выхода на пенсию не имеют возможности реализовать свои накопленные пенсионные права путем получения трудовой пенсии. Проблему обоснования пенсионного возраста необходимо решать исходя из его страхового содержания, которое основано на обеспечении эквивалентности пенсионных прав застрахованного лица и пенсионных обязательств. При этом пенсионный возраст должен выполнять не ограничительную, а регулирующую функцию. Благодаря принципиальному изменению функции пенсионного возраста линейная задача экономии средств бюджета пенсионной системы отходит на второй план и достигается «автоматическая» долгосрочная сбалансированность пенсионной системы.

Актuarные расчеты наглядно подтверждают, что экономия от повышения пенсионного возраста касается лишь незначительного контингента застрахованных лиц и несущественно сокращает период пребывания на пенсии: во всех странах среднегодовое сокращение не превышало 2–3 мес./год, и – как следствие – растягивалось на десятки лет.

При этом закономерно возникает вопрос, куда же «исчезают» нереализованные (из-за краткости периода дожития части мужчин и незначительной части женщин) *пенсионные права* (следует это особо подчеркнуть – это не денежные средства, которые пошли непосредственно на выплату текущих пенсионных обязательств) в нынешней пенсионной системе? Ответ на этот вопрос показывает актуарный анализ: все «экономленные» на недожитии части населения до полной реализации их *пенсионных прав* автоматически перераспределяются в пользу сохраненных многочисленных льгот и привилегий различным категориям пенсионеров, т.е. на нестраховое перераспределение, масштаб которого к тому же систематически увеличивается⁶.

Это, с одной стороны, обуславливает необходимость увеличения размера страхового тарифа, а с другой (при хроническом недостатке тарифа даже для обеспечения страховой эквивалентности прав и обязательств) – усиливает нагрузку на федеральный бюджет: покрытие текущего дефицита ПФР. Таким образом, если отойти от поверхностного взгляда, выявляются реальные (а не мнимые – возраст) современные проблемы пенсионной системы – нестраховое перераспределение

⁵ На практике это выражается в том, что пенсионный возраст повышался в последнюю четверть прошлого века пропорционально росту демографических параметров продолжительности жизни и периода дожития с целью обеспечения соответствия периодов трудовой и нетрудовой деятельности.

⁶ Следует напомнить, что нестраховое перераспределение пенсионных прав осуществляется путем предоставления отдельным категориям застрахованных лиц и/или их работодателям, а также отдельным видам получателей пенсий так называемых льгот и привилегий, не предусмотренных общеустановленными нормами.

пенсионных прав, которое во всех странах с переходной экономикой было ликвидировано еще на первых этапах рыночной реформы вместе с другими, нерыночными механизмами пенсионного обеспечения (досрочниками, льготниками, пониженными тарифами и т.п.).

Проблему пенсионных накоплений надо погрузить в контекст макроэкономической системы нашей страны. Пенсионные накопления в нашей стране, как это ни странно, имеют давнюю историю. Так, система добровольных пенсионных накоплений существует уже два десятилетия, а обязательное накопление уже отметило свой десятилетний юбилей. Три года реализуется государственная программа стимулирования дополнительного обязательного пенсионного страхования – «программа государственного *софинансирования*». Все формы пенсионного накопления сопровождаются существенными льготами и привилегиями как для самих застрахованных, так и для их страхователей.

Однако результаты всех накопительных программ до сих пор предельно скромные. В *добровольном* пенсионном страховании участвуют чуть более 6 млн человек – это в основном работники крупнейших естественных монополий и государственных корпораций с зарплатой, кратно превышающей среднюю по экономике. В обязательном страховании принудительно участвуют все застрахованные лица соответствующих возрастов (свыше 70 млн человек, из которых около трети – «двухпроцентники»⁷ со средней суммой накоплений не более 10–11 тыс. руб.). Однако и полноценные участники обязательного накопления⁸ по состоянию на текущий год накопили не более 60–65 тыс. руб., включая инвестиционную доходность.

Ограниченную роль накопительной системы иллюстрируют сценарные расчеты, приведенные в табл. 3. В основу этого сценария была положена идея о том, что доходность пенсионных накоплений в будущем будет близка к темпам инфляции. При этом предположении оказывается, что накопительная прибавка к распределительной части пенсии в первое десятилетие не превысит 90–100 руб. в месяц (в текущих ценах), что не больше 1% общего размера пенсии. Только через 30 лет (в середине 2030-х годов) доля накопительной части приблизится к 10–12% распределительной пенсии. Таким образом, выплаты из распределительной системы окажутся в 9 раз больше, чем из накопительной, при том что соотношение между ставками отчислений в несколько раз меньше (лишь 2,3 : 1), а трансферт из федерального бюджета к этому моменту сходит на нет. Почему это происходит?

Таким образом, «очевидные» на первый взгляд инструменты – повышение пенсионного возраста и активизация пенсионного накопления – не могут решить пенсионные проблемы (дефицит бюджета, падение пенсионных прав, низкий уровень пенсий) России ни в настоящем, ни в долгосрочном будущем потому, что они *не затраги-*

⁷ То есть граждане, которые отчисляли на пенсионные накопления в течение первых трех лет по 2% от заработка.

⁸ То есть граждане, которые отчисляли по 6% от заработка.

Таблица 3
Относительная неэффективность накопительной части пенсии
(на примере работника с 30-летним стажем работы и средней заработной платой)

Показатели	2002	2003	2004	2010	2011	2015	2020	2025	2030	2035
Тариф страховых взносов, %	3	3	4	6	6	6	6	6	6	6
Годовая сумма страховых взносов по установленному тарифу, руб.	1 570	1 980	3 235	14 841	16 116	22 978	35 920	54 519	77 754	108 845
Коэффициент индексации РПК, раз	1,307	1,177	1,114	1,161	1,070	1,071	1,065	1,061	1,052	1,055
Номинальная доходность от инвестирования пенсионных накоплений, раз			1,03	1,06	1,06	1,05	1,04	1,03	1,02	1,02
Размер распределительной части пенсии, назначаемой из РПК, руб.	7	16	31	379	500	1 029	2 155	3 972	6 843	11 044
Расчетный размер накопительной части пенсии с учетом доходности, руб.				306	395	863	1 776	3 156	5 081	7 788
Потери размера пенсии (-), руб.				-73	-105	-166	-380	-816	-1 762	-3 256
Потери размера пенсии (-), %				-19,3	-21,1	-16,2	-17,6	-20,5	-25,7	-29,5

вают базовых факторов, которые определяют развитие любой пенсионной системы. Именно поэтому социально ориентированные страны Запада никогда не рассматривали эти инструменты как прямые регуляторы долгосрочной стабильности своих пенсионных систем, а только как составные элементы актуарной обеспеченности пенсионных обязательств. Предлагаем экономически обоснованный механизм решения накопленных пенсионных проблем России на основе формирования долгосрочной актуарной обеспеченности государственных пенсионных обязательств РФ.

3. Актуарное обоснование факторов и условий долгосрочной бюджетной устойчивости ПФР

На основе высказанных выше соображений причины современных проблем пенсионной системы предлагается классифицировать на первичные (базовые) и вторичные (косвенные).

Базовые причины, в свою очередь, следует подразделять на внутрисистемные и внесистемные (глобальные). *Внутрисистемные* охватывают факторы и процессы, происходящие в самой пенсионной системе, т.е. экономические и социально-правовые отношения между ее участниками (застрахованными лицами – страхователями – страховщиками). *Внесистемные* причины охватывают демографические факторы и макроэкономические процессы, которые непосредственно влияют на внутрисистемные отношения.

Проведенные пенсионные реформы, направленные на формирование страховой пенсионной системы, создали определенные предпосылки для проявления страховых механизмов в отношении между участниками пенсионной системы. Внутрисистемные процессы все еще не полностью адаптированы к функционированию рыночных экономических отношений в условиях страхования. Так, в частности, сохраняется комплекс *нестраховых элементов*, которые функционируют в страховой пенсионной системе, не имея эквивалентных источников обеспечения:

- значительное число пенсий, которые назначаются до наступления общеустановленного пенсионного возраста за работу в тяжелых и вредных условиях труда (списки № 1 и 2), в неблагоприятных районах Крайнего Севера и приравненных к ним местностях, за «выслугу лет» и др., не имеют целевого источника финансирования (*досрочные и льготные пенсии*);
- наличие большого объема пенсионных прав, сформированных в условиях предшествующих государственных пенсионных обязательств и программ (в период до 01.01.2002 г.);
- достижение минимальных социальных гарантий за счет необоснованного (*чрезмерного*) перераспределения страховых ресурсов;
- размер тарифа страхового взноса на финансовое обеспечение накопленных прав по обязательному пенсионному страхова-

нию в ущерб тарифу, направляемому на формирование будущих прав самого застрахованного лица;

- необоснованно низкий норматив минимальной *продолжительности страхового стажа* для реализации страховых пенсионных прав для назначения трудовой пенсии по старости – 5 лет, за который невозможно сформировать даже минимальный уровень пенсии;
- отсутствие требований по минимальной и нормативной стоимости годовой суммы взносов для формирования пенсионных прав (*цена страхового года*);
- необоснованно низкая величина предельной базы для начисления страховых взносов (около 1,6 среднего размера заработка), из которой «выпадает» практически пятая часть всего годового фонда заработной платы;
- *неэквивалентное возмещение* накопленных пенсионных прав (отсутствие в «пенсионной формуле» показателей, позволяющих учитывать стаж и период выплаты, изменение демографических и макроэкономических параметров);
- необоснованно высокий объем отчислений на формирование пенсионных накоплений будущих поколений пенсионеров, который ограничивает страховые права пенсионеров, с одной стороны, и не обеспечивает эквивалентного возмещения прав будущих пенсионеров, с другой;
- отсутствие страховых стимулов для самозанятого населения для формирования своих пенсионных прав (индивидуальные предприниматели уплачивают фиксированный взнос, который не обеспечивает даже уровень ПМП);
- и другие.

Однако внутрисистемные проблемы не являются единственной причиной, препятствующей воплощению базовых страховых принципов: бездефицитности бюджета и эквивалентности возмещения утраченного заработка (не менее 40%). Не менее весомый вклад вносят внешние причины: неблагоприятная демография и макроэкономика, которые не обеспечивают адекватных условий для полноценной реализации страховых принципов в пенсионной системе.

В частности, несмотря на высокий уровень инфляции, в долгосрочной перспективе сохраняется тенденция опережения темпов роста зарплаты при одновременном снижении числа рабочих мест. Одновременно с этим долгосрочная демографическая политика не позволяет рассчитывать сколько-нибудь серьезные изменения в соотношении численности трудоспособного и нетрудоспособного населения, что приведет в начале 2030-х годов к их равенству.

Перечисленные внутренние и внешние причины наглядно указывают направления, в которых надо двигаться для достижения базовых страховых принципов. Именно перечисленные направления следует считать первичными (базовыми).

Помимо *первичных* на развитие пенсионной системы оказывают влияние *вторичные (производные) проблемы*, которые зачастую на первый взгляд принимаются за базовые. Однако они не могут оказывать эффективного воздействия на систему.

Радикальное решение современных проблем возможно двумя методами:

- посредством ускорения реализации страховых принципов в пенсионной системе;
- либо трансформацией пенсионной системы в полностью бюджетную, предусматривающую в качестве источника финансирования всех выплат средства федерального бюджета (по типу «советской» системы пенсионного обеспечения, от которой отказались в 1990-е годы).

Нетрудно понять, что, приняв ориентацию на устранение вторичных причин, пенсионная система необратимо трансформируется в «советскую» систему бюджетного финансирования государственных пенсионных обязательств, а для преодоления первичных причин необходимо резко ускорить внедрение страховых принципов, поскольку большая часть современных проблем порождена именно затягиванием трансформации пенсионной системы России. Актуарные расчеты показывают, что переход на страховые механизмы должен осуществляться комплексно, а не фрагментарно и все страховые элементы пенсионной системы должны воплощаться синхронно, хотя и будут иметь разную продолжительность во времени.

Важно обратить внимание на то, что усиление страховых принципов пенсионной системы предусматривает *поэтапную* реализацию комплекса, содержащего *кратко- и долгосрочные* меры, направленные на:

- регулирование тарифной политики;
- совершенствование накопительного компонента пенсионной системы;
- реформирование досрочных и льготных видов пенсий;
- увеличение продолжительности периода формирования пенсионных прав;
- актуарную оптимизацию механизмов формирования пенсионных прав и реализацию пенсионных обязательств (пенсионная формула).

Краткосрочные меры включают:

- регулирование тарифной политики;
- ликвидацию всех пониженных тарифов страховых взносов в ПФР;
- участие застрахованных лиц в формировании пенсионных прав путем переноса части тарифа на заработную плату работников и др.

Долгосрочные меры предусматривают:

- вывод из распределительной части пенсионной системы в течение

переходного периода (не менее 15 лет) досрочных (льготных) пенсий (списки 1 и 2, Крайний Север, выслуга лет и т.п.). При этом застрахованные лица, не имеющие специального стажа (на момент начала реализации комплекса мер), должны быть переведены в специализированные пенсионные системы, где будут формировать свои досрочные права по специальным пенсионным программам на основе дополнительного тарифа сверх установленного для общих пенсионных прав;

- *усиление требований к условиям формирования пенсионных прав по стажу и страховым взносам.* Для этого актуарно обоснована необходимость нормативного регулирования «стоимости страхового года» и норматива страхового стажа. При этом стоимость года должна устанавливаться исходя из текущей потребности в выполнении накопленных пенсионных обязательств, а норматив трудового стажа устанавливаться исходя из периода дожития с целью обеспечения каждому гражданину возможности формирования пенсионных прав, соответствующих его уровню жизни в трудоспособный период;
- *стимулирование продолжения трудовой деятельности после достижения общеустановленного пенсионного возраста (без получения пенсии).*

Для обеспечения сбалансированности бюджета ПФР при необходимости могут быть применены дополнительные меры актуарной оптимизации формирования пенсионных прав и реализации пенсионных обязательств. Актуарная оптимизация предусматривает некоторую корректировку пенсионной формулы и механизма индексации как пенсионных прав (расчетного пенсионного капитала), так и назначенных пенсий исходя из наличия источников ее финансового обеспечения⁹, законодательного установления нормативного размера и изменения методологии исчисления коэффициента замещения в целях обеспечения сопоставимости его результатов с международными нормами.

4. Проблемы актуарной сбалансированности пенсионной системы

Рассмотренные методы регулирования страховой пенсионной системы позволяют подойти к выбору и обоснованию комплекса мероприятий, которые обеспечивают наибольшую эффективность пенсионной системы.

Актуарная оптимизация системы обязательного пенсионного страхования предусматривает комплексную реализацию базовых принципов пенсионного страхования и соответственно обеспечивает условия для долгосрочной стабилизации системы ПФР, одновременно

⁹ Весь пенсионный капитал, формирование которого осуществляется на протяжении трудовой деятельности застрахованного лица, должен быть скорректирован исходя из средневзвешенного (вместо текущего) индекса роста доходов ПФР или заработной платы в экономике (свыше 2,5–4,0 среднестатистического заработка) с последующей ежегодной индексацией по темпу роста средней заработной платы. Данная категория застрахованных лиц хотя и составляет менее 7–8% численности наемных работников, но имеет 15–17% общего фонда оплаты труда и при действующем потолке в 1,6 среднего заработка фактически лишена права на формирование адекватного размера трудовой пенсии. Это тем более важно, что в долгосрочной перспективе данная категория работников должна неуклонно возрастать.

требуя минимизации затрат со стороны федерального бюджета на завершение пенсионной реформы. Рассмотрим основные мероприятия актуарно обоснованной оптимизации.

В области тарифной политики:

- тариф страховых взносов устанавливается ежегодно исходя из потребности на выплату пенсий и для обеспечения финансовой устойчивости ПФР в долгосрочной перспективе. В пенсионных правах застрахованных лиц учитывается не более 16 процентных пунктов тарифа, в то время как вся оставшаяся часть тарифа должна направляться на страховое перераспределение;
- верхняя граница дохода, на который начисляются страховые взносы, должна устанавливаться исходя из необходимости включения в процесс формирования пенсионных прав не только низкодоходных, но и высокодоходных категорий граждан.

В области пенсионных накоплений экономическая эффективность обеспечивается при выполнении следующих условий: предоставление права добровольного выбора обязательного способа формирования пенсионных прав – распределительного или накопительного – при сохранении размера действующего тарифа либо ограничение минимального размера годового дохода для формирования накопительной части трудовой пенсии (не менее 2,5–3,0 среднестатистических заработков) с одновременным переносом страхового тарифа с работодателя на работника.

Для обеспечения эквивалентности пенсионных прав и обязательств предлагается начать рассчитывать статистически ожидаемую продолжительность жизни раздельно мужчин и женщин в момент назначения пенсии. Кроме того, необходимо предусмотреть применение корректировочных коэффициентов, которые учитывают:

- соотношение продолжительности страхового стажа застрахованного лица и нормативного страхового стажа в 30 лет;
- фактическое изменение демографической ситуации в стране, которое рассчитывается как отношение темпа роста численности пенсионеров в текущем году к среднему темпу роста численности пенсионеров за предшествующие 10 лет;
- фактическое изменение макроэкономической ситуации в стране, которое рассчитывается как отношение темпа роста доходов на СЧТП (без солидарного тарифа) в текущем году к среднему темпу роста доходов на СЧТП за предшествующие 10 лет.

Вывод из распределительной системы ПФР досрочных и льготных пенсий:

- для застрахованных лиц, начинающих трудовую деятельность на соответствующих рабочих местах, формируются пенсионные накопления за счет дополнительного тарифа страхо-

вых взносов с работодателей, имеющих места, дающие право досрочного выхода на пенсию в рамках профессиональных пенсионных систем;

- для застрахованных лиц, продолжающих трудовую деятельность на опасных и вредных рабочих местах, а также для финансирования выплат ранее назначенных всех видов досрочных пенсий по условиям труда (списки 1 и 2, Крайний Север, выслуга лет и т.п.) до достижения общеустановленного пенсионного возраста. Тариф устанавливается для всех работодателей – независимо от наличия рабочих мест, которые дают право досрочного выхода на пенсию.

Экономические и социальные результаты реализации актуарно обоснованного комплекса мер по оптимизации пенсионной системы до 2050 г. (табл. 4–6):

- при условии одновременной реализации всего комплекса актуарной оптимизации текущий дефицит исчезает, а **профицит бюджета ПФР** по распределительной составляющей составит 0,07% ВВП. В течение всего периода профицит бюджета ПФР прогнозируется в объеме не более 0,5% ВВП. Тариф страховых взносов в зависимости от колебаний демографической ситуации и макроэкономических условий будет понижен с 26 до 23%;
- солидарный **коэффициент замещения** трудовой пенсии по старости, рассчитываемый как соотношение среднего размера трудовой пенсии по старости и начисленной среднемесячной заработной платы в экономике, будет определяться для неработающих пенсионеров и для всех получателей пенсий по старости.

Для неработающих пенсионеров солидарный коэффициент замещения снизится по сравнению с 2011 г. (37,3%) на 8 процентных пунктов и составит в 2050 г. не менее 25%. Коэффициент замещения трудовой пенсии по старости для неработающих пенсионеров с учетом величины среднемесячной заработной платы в экономике, которая берется для начисления страховых взносов, имеет схожую динамику и составит к 2050 г. 39%. При этом индивидуальный *коэффициент замещения утраченного за 30 лет заработка в реальном выражении для новых назначений трудовой пенсии по старости для неработающих пенсионеров превысит 60%*.

Соотношение размера трудовой пенсии по старости и ПМП для неработающих пенсионеров к 2040 г. превысит 250%, а в 2050 г. составит 340% (против 2011 г. – 173,5%). Соотношение размера трудовой пенсии по старости и ПМП для численности получающих увеличится со 151% в 2011 г. до 298,5 % к 2050 г.

Таблица 4
Долгосрочный прогноз бюджета ПФР с учетом актуарной оптимизации. Показатели пенсионного обеспечения

Показатели	Годы									
	2010	2020	2030	2040	2050	2060	2070	2075		
Численность наемных работников, млн чел.	46,52	44,72	43,06	42,24	39,66	39,83	42,14	43,20		
Размер индексации (увеличения) пенсий:										
– страховой части трудовой пенсии, %	6,3	9,0	6,9	5,8	5,5	6,6	6,4	6,3		
Среднегодовая численность получателей трудовой пенсии, млн чел.	36,21	33,81	34,59	34,91	36,05	35,58	32,79	32,04		
Среднегодовой размер трудовой пенсии по старости, руб.	828	15 994	31 654	59 882	110 265	209 099	406 874	561 271		
В том числе:										
– размер фиксированного базового размера СЧТП	3 241	6 828	14 365	27 000	48 023	86 858	162 544	221 025		
– размер страховой части пенсий	4 587	9 165	17 298	32 882	62 242	122 241	244 330	340 247		
Среднегодовой рост трудовой пенсии по старости, %	147,3	108,5	106,5	106,3	106,0	107,1	106,7	106,6		
Соотношение размера трудовой пенсии по старости и ПМП, %	176,2	177,5	208,8	255,9	307	381	490	551		
Коэффициент замещения трудовой пенсии по старости, %	38,0	32,1	29,3	28,5	27,3	27,2	28,3	28,7		
Среднегодовой размер социальной пенсии, руб.	4 643	9 743	16 770	25 906	39 820	60 858	92 196	113 101		
Соотношение размера социальной пенсии и ПМП, %	104	108	111	111	111	111	111	111		
Эффективный тариф всего, %:	16,63	23,88	23,88	23,88	23,88	23,88	23,88	23,88		
– распределительной системы, %	13,81	23,30	23,17	23,13	23,13	23,13	23,13	23,13		
– накопительной системы, %	2,82	0,58	0,71	0,75	0,75	0,75	0,75	0,75		
Облагаемый фонд заработной платы, %	83,5	96,8	96,8	96,8	96,8	96,8	96,8	96,8		
Коэффициент замещения трудовой пенсии по старости, рассчитанный исходя из облагаемой СЗП, %	45,5	33,1	30,3	29,5	28,2	28,1	29,2	29,7		
Среднегодовой размер трудовой пенсии по старости с учетом невыплаты ФБР работающим пенсионерам, руб.	7 828	13 795	27 031	51 188	94 802	181 131	354 535	490 101		
В том числе:										
– размер фиксированного базового размера СЧТП	3 241	4 630	9 734	18 306	32 559	58 890	110 205	149 855		
– размер страховой части пенсий	4 587	9 165	17 298	32 882	62 242	122 241	244 330	340 247		
Среднегодовой рост трудовой пенсии по старости, %		108,3	106,4	106,3	106,0	107,1	106,8	106,6		
Соотношение размера трудовой пенсии по старости и ПМП, %	176,2	153,1	178,3	218,8	263,6	330,0	426,9	481,4		
Коэффициент замещения трудовой пенсии по старости, %	38,0	27,7	25,0	24,4	23,4	23,5	24,7	25,1		

Таблица 5
Прогноз финансовых результатов актуарной оптимизации. Распределительная составляющая бюджета ПФР

Показатели	Годы										
	2010	2020	2030	2040	2050	2060	2070	2075			
Текущие доходы – всего, млрд руб.	4 241	8 177	15 416	27 553	47 789	88 547	171 910	237 840			
Из них:											
– страховые взносы на страховую часть трудовой пенсии	2 836	6 076	12 629	24 032	43 426	82 867	163 741	227 904			
– трансферты из федерального бюджета (без средств на покрытие дефицита бюджета ПФР)	1 405	2 101	2 786	3 520	4 363	5 680	8 169	9 936			
Расходы – всего, млрд руб.	4 057	7 141	13 548	25 154	46 971	86 969	155 235	208 721			
Выплата трудовых пенсий – всего	3 135	5 682	11 943	22 044	42 188	79 659	143 846	194 390			
Из них:											
– фиксированный базовый размер пенсии	986	1 863	4 004	7 603	13 962	24 890	42 853	56 920			
– страховая часть трудовой пенсии	2 133	3 787	7 426	14 325	28 016	54 373	100 216	136 384			
Финансирование валоризации	518	775	1 000	922	555	208	61	29			
Выплаты пенсий по государственному обеспечению, доплат к пенсиям, дополнительного материального обеспечения, пособий и компенсаций за счет средств федерального бюджета	331	608	1 031	1 605	2 504	3 830	5 982	7 494			
Расходы на выплату федеральной социальной доплаты к социальной пенсии	2,5	5,9	12,2	23,0	40,6	0,0	0,0	0,0			
Финансовое и материально-техническое обеспечение текущей деятельности Фонда и его территориальных органов	86,1	127,8	258,6	496,0	949,2	1 792,3	3 236,5	4 373,8			
Выплата ДЕМО	10,0	1,4	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0			
Осуществление ЕДВ	370,3	531,9	740,4	968,0	1 262,5	1 641,6	2 125,1	2 413,8			
Дополнительные меры государственной поддержки семей, имеющих детей (материнский семейный капитал)	112,0	173	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0			
Расходы на выплату федеральной социальной доплаты к трудовой пенсии	6,0	5,6	3,1	1,9	1,0	0,0	0,0	0,0			

Таблица 6

Экономическая эффективность актуарной оптимизации, млрд руб.

Условия снижения дефицита бюджета ПФР	2014	2020
Увеличение базы начисления до 3,5 среднего заработка	370	520
Исключение досрочных пенсий из системы обязательного пенсионного страхования для застрахованных лиц (для вновь формирующих специальный стаж)	0	410
Увеличение пенсионного возраста (на 3 мес./год для мужчин и на 6 мес. ежегодно для женщин)	0	110
Корректировка пенсионной формулы с учетом эквивалентности прав и обязательств (по стажу, заработку, демографии, макроэкономике, дожитию и т.д.)	130	290
Актуарное регулирование тарифной политики с учетом пенсионных обязательств и требований долгосрочной устойчивости бюджета ПФР*	150	210
Всего	650	1540

*Тариф в 2020 г. – 23,2%.

Литература

- Агапцов С.А., Дегтярев Г.П.** (2008). Пенсионная реформа в России: цели и результаты. М.: Тиссо-Полиграф.
- Гурвич Е.Т.** (2011). Принципы новой пенсионной реформы // *Вопросы экономики*. № 4.
- Дмитриева О., Петухова Н., Ушаков Д.** (2010). Переход от распределительной пенсионной системы к накопительной: результаты и критерии эффективности // *Вопросы экономики*. № 4.
- Доклад ЦСР (2011). Предложения по развитию пенсионной системы в Российской Федерации. М.: Издательский дом «Ваш полиграфический партнер».
- Концепция долгосрочного социально-экономического развития (2008). Концепция долгосрочного социально-экономического развития Российской Федерации до 2020 года // *Собрание законодательства РФ*. 24.11.2008. № 47. Ст. 5489.
- Концепция реформы (1995). Концепция реформы системы пенсионного обеспечения в Российской Федерации // *Собрание законодательства РФ*. 14.08.1995. № 33. Ст. 3388.

Поступила в редакцию 16 декабря 2011 года

A.K. Solovyev

Pension Fund of the Russian Federation, Department of Actuarial Calculations and Strategic Planning, Moscow

Problems of the Insurance Pension System Formation in the Russian Federation

Underway “The Long-term strategy of social and economic development of Russia until 2030” (Stragedy-2020) pension system problems of our state were put at the forefront as one of the main macroeconomic factors which importance dramatically exceeds the currency and oil and gas components. In the article the real factors defining development of pension system of the Russian Federation are actuarially settled down, and perspectives of the pension budget stability in terms of insurance principles are defined.

Keywords: *pension system, insurance pension system, pension rights of insured persons, government liabilities, incomes and expenses of the budget of Pension Fund, Russian Federation, insurance contributions, pension accruals.*

JEL classification: G230, I380.

А.Ю. Чепуренко

НИУ ВШЭ, Москва

Что такое предпринимательство и какая политика в отношении предпринимательства нужна России? (Заметки на полях работ современных зарубежных классиков)

В статье в контексте ряда малоизвестных в российском экспертном сообществе исследовательских результатов последних десятилетий, содержащихся в работах ведущих зарубежных авторов, относительно роли предпринимательства, условий его развития и институционального дизайна государственной политики стимулирования предпринимательской и инновационной активности рассматриваются характеристики и перспективы малого и среднего предпринимательства и политики в отношении МСП в современной России.

Ключевые слова: *предпринимательство, политика в отношении предпринимательства, зарубежный опыт инновации, венчурный капитал, институты, Россия.*

Классификация JEL: M21, M38.

1. О чужом опыте и российских особенностях

На протяжении двух последних десятилетий предпринимательство (по преимуществу малое) и политика его поддержки со стороны государства занимают прочное, хотя и периферийное, место в российском политико-экономическом дискурсе. Трудно отделаться от впечатления, что смена команды социальных технологов и проектировщиков может в любой момент привести к смене приоритетов и механизмов государственной политики, о чем общество – включая и предпринимательские круги – узнает лишь задним числом. Ведь на протяжении последних 20 лет в России смены вех в экономической политике происходили в основном именно так. При этом вялотекущая дискуссия относительно важности малого предпринимательства и необходимости выработки действенной политики его поддержки в значительной мере была построена на мифах, заимствованных из западной литературы и практики 1970–1980-х годов. Не было и осознания того, что существует некий социетальный коридор, в котором в России только и может развиваться предпринимательство.

Поэтому следует прежде всего задаться вопросом: *где* (в каких обществах) и *когда* (при каких социально-экономических условиях, при каком типе развития) бывает востребован и активно развивается частный бизнес?

Опыт показывает, что частное предпринимательство, т.е. деятельность частных фирм, где владельцем и управляющим является одно лицо или небольшая группа лиц, а не крупных корпораций, развивается наиболее успешно прежде всего в странах с англосаксонской традицией права, основанных на принципах индивидуализма, с корот-

кой дистанцией власти, низким порогом боязни риска в обществе, устойчиво функционирующей системой институтов рынка и сравнительно хорошо образованным населением. Предпринимательство развивается также в странах со сравнительно поздним, но бурным развитием рыночной экономики, большим уважением к традициям и статусу ремесла, укорененными в обществе ценностями труда как человеческого предназначения, а собственности – как фундамента свободы бюргера, гражданина.

Россию, российское общество трудно отнести как к англосаксонской, так и к континентальной европейской традиции – с нашей большой дистанцией от власти, распространенным убеждением, что успех – результат везения и (или) связей, а не упорного труда, боязнью, что неудача в бизнесе принесет не полезный опыт, а несмываемую репутацию «неудачника», нашим традиционным волюнтаризмом и неуважением к человеческой личности... Не предприниматель-инноватор, а «начальник» – вот статусный идеал многих россиян. Нет, россияне вовсе не испытывают неуважения или презрения к предпринимателям (не путать с внезапно разбогатевшими бывшими партийно-комсомольскими функционерами), но в большинстве своем они отнюдь не стремятся ими стать. Иначе говоря, достаточных социокультурных предпосылок для развития предпринимательства в российском обществе пока не сложилось.

Возможно, поэтому на протяжении последних шести лет Россия неизменно оказывается среди 3–5 стран с самым низким уровнем общей предпринимательской активности населения, не превышающим 3,5–4,8% общей численности взрослого трудоспособного населения, по классификации «Глобального мониторинга предпринимательства» (Образцова, Чепуренко, 2008; Чепуренко и др., 2010).

Инновационное предпринимательство формируется в конкурентных рыночных экономиках интенсивного типа – в условиях, когда живой труд достаточно дорог, а потому возникают устойчивые импульсы обновлять технологии производства и расширять возможности вывода на рынок улучшающих инноваций, а также в экономиках с развитым консьюмеризмом – высокий платежеспособный спрос порождает стимулы создавать новые товары и услуги для удовлетворения запросов потребителей. В нашей стране в нынешних условиях дорогим является только труд «белых воротничков», достаточно трудно поддающийся интенсификации при помощи новых частичных технологий, а консьюмеризм как господствующий стиль жизни сформировался в двух столицах и некоторых других анклавах общества потребления. При этом российскую экономику не отнесешь к числу высококонкурентных – монополии и сами не нуждаются в инновациях, и всячески тормозят внедрение новшеств со стороны конкурентов. Выходит, и с этой точки зрения перспективы развития предпринимательства в современной России неважные.

Тем не менее сказанное вовсе не означает, что не следует знакомиться с зарубежным опытом и трудами ведущих специалистов по теории предпринимательства. Во-первых, для того, чтобы действовать методом «от противного», необходимо это «противное», т.е. чужой опыт, знать и понимать пределы его применения. Во-вторых, за последние 20–25 лет существенно изменились мировая экономика и общество, а соответственно и условия развития предпринимательства. Да и теория предпринимательства существенно обогатилась, в ней появились и новые выводы, основанные на эмпирических данных научных исследований, и целый ряд новых практических рекомендаций, ставящих под сомнение некоторые прежде очевидные истины.

Об этом убедительно свидетельствует знакомство с работами плеяды выдающихся современных исследователей, многие из которых удостоены Международной премии в области исследований предпринимательства и малого бизнеса, чьи работы публикуются в сборнике «Современные классики теории предпринимательства»¹ (Современные классики, 2012).

Начиная с 1996 г. Международная премия, основанная совместно Шведским центром изучения малого бизнеса (Swedish Foundation for Small Business Research – FSF) и Шведским агентством по экономическому и региональному росту (Swedish Agency for Economic and Regional Growth – NUTEK), присуждается ежегодно. С 2009 г. она называется Всемирной премией за исследования в области предпринимательства, а к проведению конкурса и определению победителя присоединилась еще одна организация – Институт исследований промышленных экономик (Research Institute of Industrial Economics – IFN).

К настоящему времени лауреатами премии стали более 20 выдающихся исследователей предпринимательства из США, Великобритании, Швеции, Италии. Подавляющее большинство лекций, прочитанных ими при получении премии, размещены на портале премии² либо опубликованы в «*Small Business Economics*».

Судя по всему, российские исследователи появятся в этой когорте еще не скоро. Во-первых, сам феномен предпринимательства стал формироваться в России лишь в конце XX в., во-вторых, те структурные деформации, которые отчасти отмечены выше, препятствуют развитию его классических форм в специфическом социально-экономическом контексте экономики. В данной связи с известными оговорками можно назвать буквально несколько работ (Яковлев, 2006; Юданов, 2007; Папшэ, Галухина, 2009; Долгопятова, 1995; Долгопятова, Ивасаки, Яковлев, 2009; Широкова, 2011; Виленский, 2007; Волков, 2002) и ряд самостоятельных исследований, проведенных под руководством или с участием этих авторов, – их можно назвать заметным вкладом не только в исследования этнографических особенностей отечественного предпринимательства, но и в теоретическое осмысление данного феномена.

¹ Издание подготовлено коллективом Лаборатории исследований предпринимательства НИУ ВШЭ при финансовой поддержке НИУ ВШЭ.

² См. материалы сайта www.e-award.org.

Крупных же фундаментальных исследований, основанных на солидной методической базе и репрезентативных данных, пока по существу почти нет – за исключением проекта «Глобальный мониторинг предпринимательства» (Образцова, Чепуренко, 2008) и ряда более локальных исследований.

2. Только ли малое прекрасно?

Современная теория предпринимательства – по преимуществу междисциплинарная область изучения *малого* предпринимательства. Так, американский профессор Арнольд Купер еще в середине 1960-х годов пришел к парадоксальным для мейнстрима выводам. Он утверждал, что носителями роста в современных экономиках становятся преимущественно малые фирмы, причем существует три основных фактора, которые могут объяснить преимущества малых фирм. Первый – квалификация, или наличие технических знаний, креативность и способность видеть сущность задачи. Средние способности технического персонала выше в малых фирмах по сравнению с крупными, так как малые исследовательские фирмы обычно нанимают людей, которые уже продемонстрировали свою компетенцию в больших фирмах, тогда как крупные фирмы чаще нанимают новичков – неопытных молодых инженеров. Второй фактор – отношение технического персонала к своей деятельности. В малых предприятиях персонал больше интересуется тем, во что обходится фирме отдельный проект, нежели в больших компаниях, поскольку малое предприятие (его финансово-экономические показатели, а значит – размеры сдельной оплаты и возможность продолжать работу по найму) в большей мере зависит от каждого проекта, и технические специалисты в малых фирмах более глубоко включены в их дела в целом. И последний момент – коммуникация и координация обычно быстрее, дешевле и эффективнее в малых фирмах, так как не возникает потребности в многочисленных согласованиях (Cooper, 1997).

До 1970-х годов в экономической литературе мейнстрима считалось, что причиной появления новых компаний становится повышенный уровень доходности – он побуждает новые фирмы входить в отрасль. Именно за счет появления в отрасли новых фирм складывается равновесие на рынке, цены устанавливаются на конкурентном уровне, причем каждая фирма стремится расти, стать больше. В тогдашней литературе малые фирмы рассматривались как менее эффективные, как зародыши больших корпораций, а цель создания малых фирм – копирование истории успеха крупных компаний, уже имеющих высокий статус на рынке.

Совершенно по-иному взглянул на дело видный американский экономист Золтан Акс (Acs, 1984) в работе, посвященной возникновению мини-заводов в сталелитейной промышленности США. Традиционные теории не могли объяснить, почему в отрасли, где даже лидирующие

фирмы проигрывали иностранным компаниям в доле на рынке, возникали мини-заводы. З. Акс утверждал, что новые фирмы входят на рынок не за тем, чтобы увеличить объем продукции, копируя большие компании, а потому, что они являются *агентами изменений*. Мини-заводы производили *другой* продукт, используя *другие* факторы и процессы производства. Малые фирмы – по крайней мере в некоторых ситуациях – вовсе не собирались действовать как уменьшенные копии крупных компаний, а стремились проявлять инновационную активность.

Далее З. Акс и Д. Одретч в серии работ в конце 1980-х – середине 1990-х годов несколько скорректировали этот тезис, придя к выводу, что некоторые отрасли более благоприятны для инновационной деятельности малых предприятий, в то время как другие поощряют инновационную активность крупных корпораций (Acs, Audretsch, 1988, 1990).

Уильям Боумол, выдающийся современный экономист, продолжая эту линию, обращает внимание на взаимодополнительность инновационной активности крупных и малых предпринимательских фирм: настоящие прорывы сегодня чаще обеспечиваются малыми стартапами, а дополнительный вклад, связанный с увеличением возможностей и возрастанием скорости распространения инноваций, – удел более крупных фирм. Поэтому инновационная политика государства должна быть направлена на сбалансированное развитие обоих этих секторов. Но важна и роль университетов, замечает У. Боумол и добавляет: «Для любой современной экономики, заботящейся о достижении этой цели, правильное понимание роли каждого из этих четырех секторов и знание тех условий, при которых их участие в общем процессе является эффективным, выступает своего рода дорожной картой политики содействия росту, осуществляемой государством» (Baumol, 2003).

В России много рассуждают о национальной инновационной системе, в реальности она пока еще не складывается в нечто единое: промышленная политика, инновационная политика, научная политика, поддержка предпринимательства – все они являются предметом попечения отдельных ведомств, существуют в значительной мере параллельно, а потому синергии не возникает. А прежний технологический режим воспроизводится, усиливая зависимость от нефтегазовых ресурсов.

Довольно мрачные среднесрочные перспективы мировой экономики – свидетельство исчерпания старых стратегий развития. В новых условиях подняться смогут те экономики, которым удастся сочетать преимущества международного разделения труда (отказ от производств с низкой добавленной стоимостью) с выращиванием своих центров совершенства – региональных специализированных кластеров, в которых малые и средние фирмы должны находить выгоды от «конкурентного сотрудничества».

В отличие от периода массового производства, ориентированного на усредненного потребителя, едва ли малый и средний бизнес, занимающийся традиционными видами деятельности (торговля, услуги населению и др.), в том числе стартапы, смогут выступить в роли агентов *таких* изменений – для этого они производят слишком малую добавленную стоимость, медленно растут, мало склонны к постановке амбициозных целей.

3. Нужно ли поддерживать самозанятых и начинающих предпринимателей?

Кризис, развернувшийся в 2008–2009 гг., заставил правительство России сформировать пакет неотложных мер, в числе которых оказалась и поддержка самозанятости лицами, потерявшими рабочее место. В целом такие пособия получили свыше 200 тыс. новых предпринимателей, за два года на программу поддержки самозанятости было выделено более 350 млрд руб., и эта мера была признана эффективной и продолжена после завершения острой фазы кризиса.

Возможно, здесь сказывается сравнительно недавнее прошлое: в начале – первой половине 1990-х годов именно самозанятость – в лице «челноков» – буквально вытаскивала российскую экономику и общество из тяжелейшего структурного кризиса. Именно тогда на плечи российских женщин среднего возраста с клеенчатыми баулами легла тяжелая ноша – обеспечить домохозяйства минимально необходимым объемом потребительских благ. И они решили эту задачу (см. подробнее (Капралова, Карасева, 2005)).

Но столь ли очевиден выигрышной – с точки зрения общественного эффекта – является такая политика? Американский профессор Скотт Шейн полагает, что «политики верят опасному мифу. Они думают, что стартовые компании – это некая волшебная пилюля, которая оживит депрессивные экономические районы, породит инновации, увеличит занятость и поспособствует многим другим полезным экономическим явлениям». Однако «большинство людей, организующих новый бизнес, не являются предпринимателями в широком смысле: они не создают растущих компаний, которые предоставляют все новые рабочие места и генерируют значительную добавленную стоимость. Скорее, они рассматривают свой бизнес как альтернативу занятости по найму, а доходы – как заменитель заработной платы. В результате такие компании скорее являются формой самозанятости, нежели создания фирм с высоким потенциалом роста» (Shane, 2009, p. 141–142).

Здесь американский экономист обратил внимание на важную вещь: отождествление бизнеса с самозанятостью. С одной стороны, формально между ними много общего – и тут, и там инициатор нового дела сам создает новую хозяйственную единицу, на свой страх и риск ведет экономическую деятельность, распознавая возможности для проведения сделок и операций.

С другой стороны, за этим и другими общими чертами скрываются различия. Если предприниматель стремится получить доход, превышающий суммарные вложения в дело, то у самозанятых – иные критерии эффективности. Как правило, они мотивированы на то, чтобы обеспечить себе и своей семье приемлемый уровень дохода (ориентированный на средний уровень заработной платы в регионе проживания или отрасли, в которой они работали до этого по найму). Это, с одной стороны, делает самозанятого менее требовательным к колебаниям конъюнктуры и динамике рыночных цен, но, с другой стороны, не порождает каких бы то ни было импульсов к росту и развитию дела.

Таким образом, если государство не делает различий между поддержкой самозанятости и поддержкой начинающих предпринимателей, оно по сути смешивает социальную политику (самозанятость – альтернатива поддержке безработных) с ориентированной на конечный макроэкономический эффект в виде экономического роста политикой поддержки предпринимательства.

Каков же вывод? «Воодушевляя все больше и больше людей начать собственный бизнес, не удастся увеличить экономический рост или создать достаточное количество рабочих мест, потому что стартапы в целом не являются источником жизни для экономики или инструментом увеличения занятости», – утверждает Шейн (Shane, 2009, p. 142).

4. Создают ли стартапы рабочие места?

Итак, поддержка стартапов не приводит к возникновению инновационных быстро растущих бизнесов, а потому нейтральна с точки зрения воздействия на экономический рост, но «как все знают», именно новые компании создают основное число новых рабочих мест, в отличие от существующих фирм. Однако молодые «компании со штатом от одного работника, возрастом до двух лет обеспечивали лишь 1% занятости в Соединенных Штатах. Напротив, фирмы с числом занятых от одного человека, но в возрасте старше 10 лет обеспечивали 60% занятости в США» (Shane, 2009, p. 144). По данным, опубликованным Бюро статистики труда США, в 2004 г. в США появилось 31,472 млн новых рабочих мест. В том же году было создано 580,9 тыс. новых фирм, в каждой из которых в среднем было нанято 3,8 работника. Таким образом, в 2004 г. новые фирмы предоставили 2 207 420 рабочих мест в США, или 7% общего числа рабочих мест, созданных за тот период (Bureau et al., 2008). И такая картина – не только в США (Davidsson, Delmar, 1998).

Но, возможно, с возрастом растет активность малых предприятий на рынке труда? К сожалению, это не так. И опять-таки эта тенденция характерна не только для США. «Исследования, проведенные в Швеции и Германии, также показывают, что кластер только что

созданных фирм нанимает больше людей в течение первого года, чем в любой другой последующий год» (Shane, 2009, p. 144).

Следовательно, во-первых, начинающие малые предприниматели создают вовсе не так много рабочих мест, как принято считать (даже в развитых рыночных экономиках, где роль малого бизнеса на рынке труда значительно выше, чем в России); во-вторых, по мере их взросления не происходит увеличения числа новых рабочих мест, созданных этими бизнесами (большинство из них – если они действительно развиваются по эффективному пути – наращивают производительность труда и обеспечивают все больший объем производимой стоимости относительно меньшим числом занятых). Но и это еще не все!

Оказывается, «чтобы получить всего лишь один бизнес, который будет давать работу как минимум одному работнику на протяжении десяти лет, необходимо 43 стартапа. А сколько рабочих мест будет у этого бизнеса в среднем через 10 лет после его образования? Ответ: для США – 9. Это означает, что 43 лицам нужно попытаться открыть свой бизнес, чтобы через 10 лет мы имели дополнительно 9 рабочих мест», – резюмирует американский экономист (Shane, 2009, p. 144–145).

Впрочем, выводы Шейна основываются главным образом на данных официальной статистики рынка труда. На самом деле картина, возможно, еще больше отличается от привычных представлений о роли стартового предпринимательства как источника дополнительных рабочих мест. Дело в том, что большинство (в США – до двух третей начинающих предпринимателей), «не завершив этот процесс, берутся за создание другого бизнеса», как замечает американский социолог Пол Рейнольдс. «Три-четыре попытки создания бизнеса приходится на каждый новый бизнес в сфере продажи товаров и услуг», – пишет он, причем «большинство из тех, кто включается в процесс создания бизнеса, – четыре из пяти – делают это, когда у них есть работа по найму или другой функционирующий бизнес. Вот почему высокий уровень предпринимательской активности не фиксируется в традиционных исследованиях рынка труда: ведь для большинства начинающих бизнес эта активность является дополнительной деятельностью...» (Reynolds, 2004).

Таким образом, на деле роль стартового предпринимательства в создании рабочих мест и росте экономики сильно преувеличена. Вкладывая средства в поддержку *любого* нового предприятия, государство использует ресурсы не самым эффективным образом. Это не означает, что на него не следует обращать внимания, как это было на протяжении почти 20 лет в постсоветской России, но означает, что не следует преувеличивать социально-экономический эффект от поддержки данного сектора. Скорее, нужно предоставить дополнительные ресурсы главным образом тем, кто *в состоянии* и *хочет* расти сам.

Разумеется, речь не идет о структурно застойных регионах или о моногородах. Но в них политика поддержки самозанятости и не должна рассматриваться как форма стимулирования бизнес-активности, а лишь как инструмент социальной политики, позволяющий временно смягчать наиболее острые и болезненные перекосы на рынке труда. Однако преобразования экономики региона или населенного пункта от них самих по себе ждать не следует!

В целом «следует сокращать стимулы к открытию бизнеса со стороны «нежелательных» предпринимателей (снижение объема трансфертных платежей со стороны государства, количества выдаваемых ссуд, налоговых льгот), чтобы не вовлечь все больше и больше людей в процесс организации новой фирмы. Так как типичная молодая компания более продуктивна, нежели типичная стартовая фирма, обществу выгоднее в экономическом отношении отказаться от политики, которая приводит к тому, что огромное число людей бросаются открывать бизнес, вместо того чтобы занимать вакантные рабочие места по найму» (Shane, 2009, p. 146). Иначе говоря, вывод, который напрашивается, довольно очевиден. Государства должны прекратить целевую поддержку «любых» новых фирм (разумеется, речь не идет о мерах общей политики по улучшению делового климата и работы институтов рынка – как раз им-то государство обязано уделять внимание постоянно!) и сосредоточиться на компаниях с высоким потенциалом роста. Именно в этом сегменте возможно в перспективе создание современных рабочих мест, исчисляющихся десятком миллионов.

Это тем более важно в России, если исходить из того, что модернизация является не очередным модным лозунгом, а императивом общественного развития: ведь в условиях модернизации рост производства будет обеспечиваться за счет повышения интенсивности и производительности труда, а значит, все большие объемы инвестиций будут притягивать все меньше живого труда.

5. Кого, зачем и как поддерживать?

Фирмы с высоким потенциалом роста, как правило, реализуют инновационные решения, связанные с оригинальной комбинацией ресурсов. Обычно «вычислить» их можно по патентной активности и приобретению лицензий.

Нет ничего удивительного в том, что среди таких фирм чаще всего встречаются «газели» (термин, введенный в специальную литературу Дэвидом Берчем в 1993 г.). Преимущества «газелей», называемых так за их способность расти устойчиво высокими темпами (не менее 4 лет подряд обеспечивая годовой прирост базовых финансовых показателей не ниже 20%), достаточно понятны. Именно они компенсируют скромный вклад в создание рабочих мест со стороны типичных стартапов, но относятся они по преимуществу к категории уже устоявшихся средних предприятий (Юданов, 2007).

Отсюда – важный практический вывод для политиков, которым «следует прекратить размазывать масло тонким слоем по всему бутерброду... Это подразумевает выделение и поддержку только тех немногих новых бизнесов, которые заведомо эффективнее существующих компаний» (Shane, 2009, p. 146).

Могут возразить: но мы же не знаем, какие из стартапов станут фирмами с высоким потенциалом роста, а какие – нет! Кто и как может безошибочно выделить «правильную» целевую группу?»

Как выясняется, такие агенты есть, но это не чиновники, а венчурные капиталисты – с их опытом, знанием рынка, чутьем на прорывные решения они умеют находить таких будущих «звездочек» из-под земли. Как показал Ян Макмиллан, венчурные капиталисты отнюдь не опираются только на интуицию и при этом вовсе не уделяют бизнес-планам столько внимания, сколько предписывается учебниками по бизнесу. На самом деле они систематически проводят оценку новых бизнесов по шести категориям риска:

- 1) риск конкуренции;
- 2) риск невозможности спасти вложенные средства в случае необходимости;
- 3) риск потерять весь вклад;
- 4) риск провала менеджмента (способен ли предприниматель к интенсивным управленческим усилиям и насколько хорошо он знает рынок);
- 5) риск провала бизнес-идеи (имеет ли предприниматель четкое представление о том, что надлежит делать, и обладает ли продукт рыночным потенциалом), и
- 6) риск провала лидерства (Landstrom, 1999).

Таким образом, у венчурных капиталистов есть свои алгоритмы мониторинга рынка инновационных идей и нахождения будущих «звездочек» рынка. Но самое главное – венчурный бизнес отвечает за последствия своих решений не выговором, не снижением квартальной премии, а потерей вложенных денег. Это – наиболее действенная страховка если не от неверных, то, во всяком случае, от умышлено неверных решений.

Именно выстраивание взаимодействия между государственными институтами развития и венчурной индустрией (ее зародышевые формы в России стали появляться до кризиса, и сейчас постепенно восстанавливаются), а не попытки самостоятельно разыскивать и поддерживать инновационные стартапы – вот задачи государства в области содействия предпринимательству с высоким потенциалом роста.

Государственным структурам, отвечающим за поддержку инновационного предпринимательства, следует довериться оценкам венчурных капиталистов и бизнес-ангелов и софинансировать их вложения либо создать условия для того, чтобы они могли привлекать заемный капитал на длительный период на достаточно льготных

условиях. То есть не изобретать «государственный велосипед», а присмотреться к опыту работы венчурных капиталистов, снабдить их длинными деньгами, расчистить юридические преграды на их пути. А также пропагандировать успех венчурной отрасли и вырастающих при ее поддержке фирм, формируя в обществе высокий престиж инноваторов и признание вклада частных венчурных фондов и компаний. А если венчурной индустрии еще нет – помочь ее быстрейшему становлению.

Об этом говорят труды американца Йоша Лернера (см., напр. (Gompers, Lerner, 2001)), крупнейшего специалиста в области экономики, основанной на венчурных инвестициях. Согласно приводимым им данным, 1 долл. венчурного капитала в США дает такой же выход инноваций, как 3 долл., затрачиваемых в виде традиционных расходов в рамках внутрифирменных расходов крупных компаний на НИОКР. При этом, хотя венчурные капиталисты финансируют в Америке всего лишь 1–2% новых бизнесов, доля начального финансирования, предоставленного именно венчурными капиталистами, возросла примерно с 10% в 1980 г. до более чем 50% в 2000 г.

Важно оптимальное соотношение между спросом и предложением венчурного капитала. Часто приходится сталкиваться с утверждениями, будто объем внешнего долгового финансирования слишком мал по сравнению с потребностями предпринимателей в финансировании. Между тем Й. Лернер и его соавтор П. Гомперс дали строгое эконометрическое доказательство того, что существует ограниченное предложение очень привлекательных предпринимательских проектов и что капитала, который мог бы выступить в качестве источника финансирования, в экономике в избытке (Gompers, Lerner, 2001). Иначе говоря, в развитой экономике предложение вовсе не является лимитирующим фактором.

А в России? Скорее, пока мы имеем дело с мизерным спросом, которому противостоит ограниченное, но постепенно растущее предложение венчурных инвестиций. Вопрос заключается в том, как запустить механизм, как сдвинуть дело с мертвой точки.

Как представляется, в России государство, выделив огромные по отечественным меркам средства институтам развития, не может получить от них адекватную отдачу, поскольку нет достаточного числа перспективных проектов. В этих условиях федеральный центр и некоторые регионы увидели свою задачу в том, чтобы подтолкнуть дело, занявшись оживлением предложения. Создаются технопарки и бизнес-инкубаторы, а различным институтам развития вменено поддерживать инновационные предпринимательские проекты в определенных секторах – нанотехнологии, технологии энергосбережения и проч.

Однако зарубежный опыт говорит в пользу другого подхода – со стороны спроса. Такой подход требует направить основные усилия на поддержку становления частной венчурной индустрии, а не на попытки

заниматься выращиванием инновационных стартапов. Сама венчурная отрасль – многослойные «заросли», в которых находится место и крупным венчурным фондам, и компаниям, работающим с довольно масштабными проектами, и незаметным бизнес-ангелам и их ассоциациям, которые готовы подхватить и помочь стать на ноги небольшим инновационным проектам – таким, которые с уровня государственных институтов развития неразличимы либо же издержки их выявления, оценивания и сопровождения оказываются слишком велики.

Содействие развитию венчурной индустрии – задача, которая требует государственных усилий. И здесь может пригодиться опыт, изученный зарубежными исследователями на примере стран с более длительной кредитной историей венчурной отрасли и историей содействия инновационному предпринимательству. Й. Лернер обращает внимание на ряд примеров позитивного государственного вмешательства, вызвавших рост венчурной индустрии, причем в период ее зарождения, что особенно ценно для сегодняшней России, а затем пошла цепная реакция роста уже инновационного предпринимательства. «Многие из первых венчурных фондов и ведущие посредники в отрасли, такие как юридические фирмы и информангентства, возникли как организации, ориентированные на финансирование в рамках программы SBIC («Поддержка инвестиций в малые компании»), а затем постепенно переориентировались на обслуживание независимых венчурных фондов... государственные программы играли важную роль в начале бурного роста практически всех основных рынков венчурного капитала по всему миру» (Lerner, 2009, p. 259).

Важно также то, что содействие инновационному предпринимательству через поддержку венчурной индустрии – это почти всегда создание условий не просто для поддержки отдельных проектов, но для выращивания альянсов фирм и формирования высокотехнологичных кластеров.

Второй важный момент – чтобы венчурным капиталистам было кого поддерживать, необходимо, чтобы субъекты экономики генерировали спрос на инновационные продукты. В нынешних условиях в России это едва ли могут быть домохозяйства, по причине того, что слишком малая их доля – всего лишь порядка четверти-трети – располагает доходами, достаточными для того, чтобы предъявить спрос на новые товары и услуги. Что касается крупного бизнеса, то его пока принуждают к инновациям в режиме «ручного управления». Гораздо меньше внимания уделяется формированию технологических коридоров. То, что и как сделано (переход на новые экологические стандарты в производстве бензина и энергосберегающие электролампы), показывает скорее ограниченность как стратегического видения, так и инструментов воздействия со стороны государства. Между тем без такого – косвенного, но в то же время неизбежного – воздействия со стороны «умного государства» на формирование технологической

политики и вообще восприимчивости к технологическим инновациям со стороны бизнеса невозможно запустить самоподдерживающийся спрос на инновационные технологии в российской экономике, страдающей голландской болезнью в российском варианте.

6. В одиночку или вместе?

В России как-то почти не уделяется внимания тому обстоятельству, что успешный малый и средний бизнес, как правило, не вырастает в одиночку – он требует соответствующей микросреды и очень часто находится в сложных отношениях «конкурентного сотрудничества» с другими такими же фирмами. В зарубежной литературе по теории предпринимательства, между тем, эта тема весьма пристально изучается, и ее изучение приносит отнюдь не только академические результаты.

Арнольд Купер, которого мы уже упоминали выше, еще в 1960-х – начале 1970-х годов ввел понятие «предприятие-инкубатор» для обозначения материнских фирм, от которых постепенно отпочковываются новые стартапы, а в середине 1980-х годов он же эмпирическим путем установил, что большая часть новых фирм открывались в географической близости к своим «организациям-инкубаторам». Оказалось, новые фирмы связаны со своими бывшими «инкубаторами» еще и видом бизнеса – особенно в отраслях высоких технологий.

Далее обнаружилось, что обычно стартапы возникали в той же местности, в которой их учредители были заняты раньше, т.е. «организации-инкубаторы» влияют на местоположение новых фирм, выступая в роли «якоря» для них. Причем новые технологические фирмы обычно начинают деятельность как группы взаимосвязанных компаний, что приводит к образованию кластеров новых технологических фирм.

При рассмотрении типа «фирмы-инкубатора» выяснилось также, что наряду с промышленными компаниями, «инкубаторами» для новых фирм, особенно в информационных и биотехнологиях, чаще выступали университеты и университетские клиники.

Хотя образование групп чаще возникает в случае с кластерами технологических стартапов, А. Купер установил, что предпринимательство вообще, а не только высокотехнологичное концентрируется в конкретных регионах и географических кластерах. Каковы выгоды от принадлежности к группе? А. Купер и его соавтор Т. Фолта выделяют несколько преимуществ вхождения в кластер:

- доступ к специализированной рабочей силе, специализированным материалам и капиталу;
- географическая близость может быть важна для «перелива знаний» – особенно так называемого скрытого знания;
- близость к потребителям и технической поддержке – местоположение внутри группы может привести к меньшим издержкам по поиску потребителей (Cooper, Folta, 2000).

Пол Рейнольдс, инициатор ряда крупномасштабных эмпирических исследований предпринимательства, специально изучал вопрос: какие региональные характеристики коррелируют с более высокими показателями численности стартапов? Им и его соавторами были установлены три обстоятельства, положительно влияющие на показатели «рождаемости» фирм: повышение спроса – по мере роста населения и доходов; доминирование малых фирм в их региональной популяции; степень плотности городской среды, т.е. возможности доступа к покупателям, источникам предложения и капитала, а также осведомленность о действиях конкурентов (Reynolds, Storey, Westhead, 1994).

Следовательно, эффективность поддержки возрастает, если осуществлять не просто меры поддержки отдельных стартапов с высоким потенциалом роста, а выращивать целый региональный куст, т.е. кластер. Такая поддержка вовсе не обязательно должна быть направлена на сами предпринимательские фирмы – скорее, это может быть инвестирование в точки роста знаний и компетенций – образовательную инфраструктуру, центры трансфера технологий. Далее – в закрепление и продвижение брендов, включая как меры сугубо маркетингового характера, так и предоставление субсидий и субвенций на формирование патентной защиты товарных марок и проч. Наконец, в создание площадок, где потенциальные и начинающие предприниматели могли бы общаться, приглядываться друг к другу, находить близких им по духу (в данной связи в литературе говорят о гомофилии (т.е. о принципе выбора партнеров исходя из сходства с ними по какому-либо основанию – дружба, обучение в одном учебном заведении и т.п.) как о базисе, на котором формируются предпринимательские команды) возможных партнеров и единомышленников – это могут быть соответствующие конкурсы, конференции, образовательные программы и т. д. В России сегодня этим мягким формам непрямого содействия предпринимательству уделяется явно недостаточно внимания.

7. Что делать с «прочими» предпринимателями?

Тот факт, что подавляющее большинство малых бизнесов – как начинающих, так и устойчиво функционирующих – вносят весьма скромный вклад в макроэкономический рост и социальную стабильность, как уже отмечалось, совсем не значит, что они не «нужны» и ими можно пренебречь. Уильям Боумол не случайно обращает внимание на важную роль имитаторов даже в высокоразвитых экономиках.

Но государство – вернее, органы, от его лица осуществляющие соответствующую политику, – должно использовать только такие меры, затраты на которые адекватны ожидаемой отдаче и которые как минимум не приводят к ухудшению условий хозяйствования.

Это прежде всего правила игры и прозрачные механизмы их применения – в области налогообложения, доступа к физической и энергетической инфраструктуре и т.д. Это – надежная денежно-

финансовая система. Это фискальная система, которая направлена не на быстрый отъем ресурсов у малых предпринимателей, а на достижения компромисса между задачами развития бизнеса и наполнения государственной казны. Это гражданское и хозяйственное право, действующее не избирательно, прозрачное для субъектов экономики. Это максимально простая и понятная система администрирования (регистрация, лицензирование, сертификация и проч.), которая не угнетает бизнес. В общем выстраивание прочной и надежной, а главное – предсказуемо действующей системы институтов, благодаря чему снижаются транзакционные издержки и открываются более широкие горизонты планирования хозяйственной деятельности для любого предпринимателя и для каждой предпринимательской фирмы.

Очевидно, что такие ситуации могут сложиться при двух условиях. Во-первых, когда основной объем налоговых поступлений от малого предпринимательства остается там, где находится сам источник налогообложения, т.е. на уровне местного самоуправления и регионов. Во-вторых, когда эти налоги образуют значимую долю соответствующих бюджетов. Только при соблюдении обоих условий местные власти начинают обходиться с бизнесом бережно. В России пока значительная часть налоговых поступлений уходит в федеральный бюджет, а поэтому у органов местного самоуправления не возникает побуждений эффективно содействовать малому и среднему бизнесу, скорее, всегда есть соблазн дополнительно его обременить – ради сиюминутных нужд развития территории или просто в стремлении немного пожить.

8. Знание против интересов

Все правительства любят рассуждать о «создании предпринимательских обществ», «максимизации вклада МСП в экономическое развитие», «повышении конкурентоспособности», о «создании рабочих мест» благодаря малому бизнесу. И при этом, как замечает британский исследователь Дэвид Стори, «ни одно государство не имеет ясного представления о наборе целей для каждого компонента государственной политики» (Storey, 1998).

Отчего правительства, не заявляя четко очерченных (и поддающихся оценке достижимости) целей, предпочитают формулировать некие перечни мер поддержки МСП, упаковывая их в соответствующие программы? Дело в том, что конечная цель правительств – вовсе не содействие предпринимательству, а завоевание голосов избирателей на ближайших выборах. А потому «в политике поддержки МСП присутствует очевидный политический элемент» (Storey, 1998).

В России 2000-х годов этот политический элемент присутствовал в менее явной форме – как в силу слабости и немногочисленности малого предпринимательства как группы избирателей, так и в силу равнодушия большинства граждан к тонким материям экономической политики государства.

Далее, предполагаемые цели могут объективно противоречить друг другу. Например, когда правительства говорят о создании новых рабочих мест, их основной проблемой на самом деле является вовсе не это, а снижение безработицы – цель, политически более важная, чем увеличение занятости. Использование МСП для создания новых рабочих мест может, однако, оказывать неоднозначное влияние на сокращение числа официально зарегистрированных безработных. Об этом свидетельствует, в частности, то обстоятельство, что в России в период довольно бурного экономического роста в 2000-х годах основной прирост рабочих мест наблюдался скорее в ненаблюдаемой экономике, чем на легально функционирующих предприятиях (Гимпельсон, Зудина, 2011, с. 53). Кроме того, МСП предлагают сравнительно много мест с неполной занятостью, а готовые на такие условия работники (обычно – женщины) редко регистрируются как безработные. Поэтому созданные рабочие места хотя и заполняются, но вовсе не теми, на кого ориентировались правительственные меры. Далее, известно, что основным источником найма для МСП являются личные знакомства, рекомендации от друзей и знакомых, а это означает, что рынок труда в данном секторе имеет довольно закрытый характер, т.е. мало пригоден как раз в качестве средства для смягчения безработицы.

Наконец, в технократическом правительстве всегда силен элемент межведомственных противоречий, обусловленных разными сферами ответственности соответствующих ведомств. Поэтому важно целеполагание в государственной политике, которое требует политической воли. Но не только...

9. Мониторинг или оценивание?

Государства, как следует из сказанного выше, должны четко сформулировать свой заказ на целеполагание в области поддержки малых предприятий. И если такая политика сформулирована, необходимо отслеживать эффективность ее реализации, т.е. осуществлять мониторинг проводимой политики и оценивать ее результаты. С оцениванием, однако, также возникают проблемы, и вовсе не технического характера.

Есть разница между мониторингом политики и оцениванием ее результатов. Оценивание должно с использованием строго формализованных подходов раскрыть меру воздействия политических мер и шагов на целевую область. Мониторинг же отражает просто степень выполнения принятых документов, а также восприятие предлагаемых инструментов участниками соответствующей программы и ее бенефициарами. Таким образом, мониторинг отражает исключительно представления участников политики. Оценивание, напротив, должно сопоставить их позицию и позицию групп, не включенных в рамки действия мер данной политики (контрольная группа). Разница между выявленными показателями по целевой группе и по

контрольной группе и может быть рассмотрена как реальное воздействие политики.

Когда государственные средства направляются на поддержку МСП, необходимо проводить оценивание реализуемых мер. Для этого должны быть установлены ясные и поддающиеся измерению цели. Очень часто цели либо не специфицированы, либо специфицированы настолько туманно, что они не могут быть использованы для оценки степени успешности политики.

Д. Стори убедительно продемонстрировал, что оценивание и мониторинг не идентичны. Более того, он выделил шесть необходимых шагов, из которых три относятся к сфере мониторинга, и три – к сфере оценивания эффективности политики.

Первый шаг выявляет исходные характеристики реализуемых программных воздействий. Например, она может определить количество фирм, которые участвовали в реализации выбранной меры, их отраслевое распределение, размер таких предприятий и, возможно, их региональное распределение. На втором шаге фирмы, которые участвовали в данных программах, делятся своим мнением о том, была ли польза от программ. На третьем шаге получателей поддержки спрашивают не просто о том, довольны ли они проводимой политикой, но также о том, повлияла ли она, по их мнению, на функционирование их предприятия. Обычно при этом проводится количественная оценка. Четвертый шаг позволяет начать анализ этого влияния через сравнение функционирования фирм, поддерживаемых государственной программой, и тех, которые ею не поддерживаются. Но поскольку в результате любые различия в результатах хозяйственной деятельности этих двух групп могут быть приписаны влиянию проводимой политики, возникает потребность в пятом шаге: на этом этапе следует выделить «контрольную группу», с которой сравниваются поддерживаемые предприятия. Поскольку многие меры поддержки малого бизнеса имеют селективный характер, то значительные ресурсы тратятся на процедуру выбора, поэтому необходимо убедиться, что отбор не приводит к смещению выборки. И чем больше обнаруженные различия зависят от самой процедуры отбора, тем значительнее дефляционный компонент политики, если она принимает во внимание только «наблюдаемые величины». В оценке эффекта смещения заключается шестой шаг оценивания политики.

К сожалению, сетует Д. Стори, большинство политических инициатив в странах ОЭСР чаще используют мониторинг, а не оценку. В его терминологии, оценивание редко продолжается далее третьего шага, а во многих случаях обрывается уже на первом шаге (Storey, 1998).

Почему? Во-первых, полный цикл оценивания государственной политики – вещь достаточно дорогостоящая, требующая привлечения весьма квалифицированных экспертов. Во-вторых, исполнительная власть всегда стремится продемонстрировать высокую эффективность

своей политики. Поэтому она либо уклоняется от процедур оценивания, либо склонна привлекать тех аналитиков, которые способны убедительно «продемонстрировать» основные эффекты политических мер, и игнорирует голоса более «въедливых» экспертов. Как пишет Д. Стори, «политики с... ограниченными бюджетами предпочитают «дешевые и восторженные» исследования» (Storey, 1998).

И это – в странах, где государство находится под более или менее плотным контролем со стороны гражданского общества и его институтов. Что же говорить о странах со сравнительно слабым гражданским обществом и высоким уровнем «самодостаточности» исполнительной власти! Например, в России за последние 20 лет не было выполнено по заказу государства, а не независимых (в большинстве – зарубежных) фондов *ни одной* работы с комплексной оценкой эффективности той или иной программы содействия развитию предпринимательства. Да и условий для такого оценивания нет: даже на сайтах ответственных за проведение соответствующей политики ведомств днем с огнем не найти сколько-нибудь полной и актуальной информации о реализуемых целевых программах.

Но только ли в боязни публичной критики дело?

10. Какое «предпринимательство» стимулирует государство?

Данные многочисленных исследований о факторах, оказывающих влияние на качество государственной поддержки, свидетельствуют, что «наиболее адекватные программы чаще всего реализуются в «богатых странах, с более гетерогенным населением и англосаксонской правовой традицией» (Lerner, 2009, p. 259). Поскольку Россию при всем желании не отнести к числу таковых стран, нужно очень внимательно относиться к усилению активности в области реализации дорогостоящих программ, в которых основным разработчиком, организатором и контролером выступает государственная бюрократия. Ибо здесь возникает проблема с госпрограммами, известная в теории как «захват регулятора» (regulatory capture).

Речь идет о том, что зачастую программы, нацеленные на стимулирование ранних предпринимателей, в итоге будут оказывать финансовую поддержку «друзьям государственных чиновников» (Braunerhjelm, Parker, 2010, p. 252). И не только потому, что слабы группы интересов, представляющие предпринимательское сообщество, как и другие ячейки гражданского общества, а государственная бюрократия ощущает себя не распорядителем бюджетных средств, а правящим классом. А еще и потому, что в рамках сложившейся в России социально-экономической системы существуют разительные различия между разными стратами предпринимательства – производительным, непроизводительным и деструктивным предпринимательством, в терминах уже упоминавшегося У. Боумола.

Причем именно та из них, которая наиболее полно выражает дух предпринимательства, – производительное предпринимательство, развивающееся за счет генерирования инновационной ренты, – в наименьшей мере может рассчитывать на благорасположение государственных структур. Тогда как другие, представляющие непроизводительное (получение прибыли за счет перераспределения активов – путем приватизации или слияний и поглощений) и деструктивное предпринимательство (то, что называют «силовым предпринимательством» в теории и что на практике является распространенной формой использования высокими чинами силовых и правоохранительных органов своих возможностей для принуждения предпринимателей к «крышеванию», а затем и переуступке бизнеса), пользуются им в полной мере. Источником нелегитимного дохода и тех, и других является вовсе не предпринимательская прибыль (инновационная рента), а рента политическая, т.е. доход от корыстного использования публичных благ.

У. Боумол в известной статье «*Предпринимательство производительное и непроизводительное/деструктивное*» (Baumol, 1990), а затем и в своей известной книге (Baumol, 1993) обращал внимание на то, что распределение между производительным и непроизводительным или даже деструктивным предпринимательством в значительной степени зависит от распространения системы «подкупа». Если институты таковы, что вести бизнес за счет органического роста на основе внедрения инноваций труднее, чем путем использования различных форм «подкупа» (для недружественных поглощений, извлечения политической ренты и т.п.), то предпринимательский потенциал общества приобретет соответствующую конфигурацию – среди предпринимателей будет все больше тех, кто станет стремиться не столько производить ради прибыли все новые и новые блага и услуги все более экономичным способом, сколько использовать иные возможности для получения прибыли (путем рейдерства и т.п.).

На наш взгляд, из этих рассуждений применительно к России следуют как минимум два вывода. Первый: в условиях неблагоприятного для производительного предпринимательства социально-экономического устройства некоторые действия государства, которые в уже сложившейся эффективной рыночной экономике являются стандартными средствами поддержки частного предпринимательства, – например, приватизация государственного имущества или стимулирование государственного заказа и государственных закупок – в специфических российских условиях приводят лишь к еще большему усилению рыночной власти непроизводительного предпринимательства, тесно сросшегося с государственной бюрократией, и к дальнейшей маргинализации предпринимательства производительного. Между тем именно на эти (по сути контрпродуктивные) меры по преимуществу нацелены различные программы поддержки предпринимательства (Чепуренко, 2010).

Второй: для того чтобы стандартный, доказавший свою эффективность в десятках зарубежных стран набор мер и механизмов поддержки производительного предпринимательства мог с успехом работать на подъем предпринимательства в России, необходимы объединенные усилия производительного предпринимательства, гражданского общества и способной возвыситься над сиюминутными рентными интересами части государственного аппарата, направленные на опережающую глубинную *модернизацию* и общества, и государственного аппарата.

Думается, что опыт «ручной настройки» убедил все стороны, что попытки решать задачи формирования институтов и агентов модернизации (вариант: создания инновационной экономики), опираясь главным образом на чиновничество, увенчались демонстрацией невозможности нарастить потенциал рыночной экономики в директивном порядке, не вовлекая важных акторов либо полностью их игнорируя. Поэтому наиболее прозорливая часть политической элиты *вынуждена* будет способствовать формированию более прочной базы поступательного развития экономики и общества (Яковлев, 2006).

Далее, невозможно не видеть, что нарастает недовольство условиями ведения бизнеса со стороны *среднего* предпринимательства. Часть руководителей динамично растущих средних фирм спрашивают себя: а почему бы не попытаться все-таки выстроить адекватную деловую среду в собственной стране, вместо того чтобы переносить свой бизнес за пределы России? Участие этой группы в деятельности созданных властью новых площадок формирования политических интересов может привести к изменению нынешнего положения, т.е. к рождению «умной» политики в отношении предпринимательства.

11. Заключение

Российскому экспертному и академическому сообществу, а также уполномоченным органам исполнительной власти и институтам развития следует воспользоваться теми знаниями, которые накоплены зарубежными специалистами, и учитывать их оценки – во избежание повторения чужих заблуждений и ошибок. В частности, критически отнестись к представлению о том, что малый бизнес является генератором рабочих мест, что следует поддерживать *любые* стартапы. Отнюдь не всегда, как оказывается, эта идея справедлива, есть отрасли, по определению более пригодные для развития скорее крупных предпринимательских фирм, а рабочие места, создаваемые стартовыми компаниями во множестве, так же во множестве и исчезают – в связи с высокой «смертностью» микро- и малого бизнеса. Далее, далеко не всегда оказывается эффективной поддержка отдельных предпринимательских проектов – правильнее создавать для них питательную среду, т.е. вкладывать средства в создание предприни-

матерских сетей и кластеров, причем действуя для этого «чужими руками», т.е. поддерживая частный «ангельский» и венчурный бизнес. Наконец, в целях экономии издержек и повышения отдачи следует внимательно отнестись к оцениванию эффективности любых государственных программ и политик (особенно теперь, когда «тучные годы» миновали), используя для этого стандартные процедуры.

Но изучая чужой опыт и данные, вовсе не нужно отказываться от правила «жить своим умом». Это связано, во-первых, с оценкой своеобразия социокультурных и макроэкономических условий, в которых существует российское предпринимательство и которые приводят к преобладанию в его составе непроизводительного и деструктивного предпринимательства. В этих условиях многие стандартные методы и механизмы поддержки предпринимательства – например, государственные закупки и государственный заказ, предоставление льгот определенным категориям и отраслевым группам бизнеса – могут приводить только к усилению коррупции. Гораздо большего можно добиться, снижая негативное восприятие собственных умений и навыков у потенциальных предпринимателей (через развитие сети разнообразных образовательных программ и продуктов), формируя предпринимательский *этнос* (через поддержку и продвижение «лучшего опыта» – умели же в СССР формировать и поддерживать образы «маяков производства!»), выстраивая технологические коридоры (для того, чтобы предпринимательские проекты с высокой добавленной стоимостью становились наиболее прибыльными) и создавая условия для развития выставочно-ярмарочной деятельности (России остро необходимы площадки для формирования и развития практики субконтракта между предпринимательскими фирмами разных размеров, отраслей, регионов).

Литература

- Виленский А.В.** (2007). Макроэкономические институциональные ограничения развития российского малого предпринимательства. М.: Наука.
- Волков В.В.** (2002). Силовое предпринимательство. СПб., М.: Летний сад.
- Гимпельсон В., Зудина А.** (2011). «Неформалы» в российской экономике: сколько их и кто они? // *Вопросы экономики*. № 10. С. 53–76.
- Долгопятова Т.Г.** (1995). Российские предприятия в переходной экономике: экономические проблемы и поведение. М.: Дело.
- Долгопятова Т.Г., Ивасаки И., Яковлев А.А.** (2009). Российская корпорация: внутренняя организация, внешние взаимодействия, перспективы развития. М.: Юстицинформ.
- Капралова Н.Л., Карасева Л.А.** (2005). Челночный бизнес в российской экономике: роль и оценка масштабов // *Экономический журнал ВШЭ*. Т. 9. № 3. С. 400–411.
- Образцова О., Чепуренко А.** (2008). Развитие российского частного предпринимательства в межстрановом сопоставлении // *Вопросы экономики*. № 8. С. 91–107.

- Паппэ Я.Ш., Галухина Я.С.** (2009). Российский крупный бизнес: первые 15 лет. Экономические хроники 1993–2008 гг. М.: ГУ ВШЭ.
- Современные классики (2012). Современные классики теории предпринимательства: лауреаты Международной премии за вклад в исследования предпринимательства и малого бизнеса / Под ред. А.Ю. Чепуренко. М.: Изд. дом НИУ ВШЭ.
- Чепуренко А.Ю., Образцова О.И., Алимова Т.А.** и др. (2010). Предпринимательская активность россиян в условиях кризиса // *Мир перемен*. № 3. С. 147–162.
- Чепуренко А.Ю.** (2010). Вместо заключения. Предпринимательство и федеральная политика. В кн. «*Теория предпринимательства в России: новые подходы и результаты: По материалам «Глобального мониторинга предпринимательства»* / Под ред. Т.А. Алимовой, О.И. Образцовой, А.Ю. Чепуренко. М.: ГУ ВШЭ. С. 235–266.
- Широкова Г.В.** (2011). Управление предпринимательской фирмой. СПб.: ВШМ.
- Юданов А.Ю.** (2007). Гении национального бизнеса // *Эксперт*. № 16. С. 33–41.
- Яковлев А.А.** (2006). Агенты модернизации. М.: ГУ ВШЭ.
- Acs Z.J.** (1984). *The Changing Structure of the U.S. Economy: Lessons from the Steel Industry*. N.Y.: Praeger.
- Acs Z.J., Audretsch D.B.** (1988). Innovation in Large and Small Firms: An Empirical Analysis // *American Econ. Rev.* Vol. 78(4). P. 678–690.
- Acs Z.J., Audretsch D.B.** (1990). *Innovation and Small Firms*. Cambridge, MA: MIT Press.
- Baumol W.** (1990). Entrepreneurship: Productive, Unproductive and Destructive // *J. of Political Econ.* Vol. 98(5). P. 893–921.
- Baumol W.** (1993). *Entrepreneurship, Management and the Structure of Payoffs*. Cambridge, MA: MIT Press.
- Baumol W.** (2003). Prize Lecture. [Электронный ресурс] Режим доступа: http://www.e-award.org/web/2003_William_J_Baumol_2.aspx, свободный. Загл. с экрана. Яз. англ. (дата обращения: апрель 2012 г.)
- Braunerhjelm P., Parker S.C.** (2010). Josh Lerner: Recipient of the 2010 Global Award for Entrepreneurship Research // *Small Business Econ.* Vol. 35(3). P. 245–254.
- Bureau of Labor Statistics (2008). [Электронный ресурс] Overview of Bureau of Labor Statistics Data. Режим доступа: <http://data.bls.gov/cgi-bin/surveymost?bls>, свободный. Загл. с экрана. Яз. англ. (дата обращения: апрель 2012 г.)
- Cooper A.C.** (1997). Reflections on Entrepreneurship. [Электронный ресурс] Режим доступа: http://www.e-award.org/web/1997_Arnold_C_Cooper.aspx, свободный. Загл. с экрана. Яз. англ. (дата обращения: апрель 2012 г.)
- Cooper A.C., Folta T.B.** (2000). Entrepreneurship and High-Technology Clusters. In: Sexton D.L., Landström H. (eds.) «*The Blackwell Handbook of Entrepreneurship*». Oxford: Blackwell Publishers.
- Davidsson P., Delmar F.** (1998). Zur Schaffung von Arbeitsplätzen nach Firmengröße und –alter // *Zeitschrift für Klein- und Mittelunternehmen*. B. 46. S. 219–233.

- Gompers P.A., Lerner J.** (2001). The Venture Capital Revolution // *J. of Econ. Perspectives*. Vol. 15(2). P. 145–168.
- Landström H.** (1999). Ian C. MacMillan's Contributions to Entrepreneurship and Small Business Research. [Электронный ресурс] Режим доступа: http://www.e-award.org/web/1999_Ian_C_MacMillan.aspx, свободный. Загл. с экрана. Яз. англ. (дата обращения: апрель 2012 г.).
- Lerner J.** (2009). *Boulevard of Broken Dreams: Why Public Efforts to Boost Entrepreneurship and Venture Capital Have Failed and What to Do about It*. Princeton, Princeton University Press. P. 259.
- Reynolds P.D.** (2004). Understanding Business Creation – Serendipity and Scope in Two Decades of Business Creation Studies. [Электронный ресурс] Режим доступа: http://www.e-award.org/web/2004_Paul_D_Reynolds.aspx, свободный. Загл. с экрана. Яз. англ. (дата обращения: апрель 2012 г.).
- Reynolds P.D., Storey D.J., Westhead P.** (1994). Cross-National Comparisons of the Variation in New Firm Formation Rates // *Regional Studies*. Vol. 28(4). P. 443–456.
- Shane S.** (2009). Why Encouraging More People to Become Entrepreneurs is Bad Public Policy // *Small Business Econ.* Vol. 33. P. 141–149.
- Storey D.J.** (1998). Evaluating the Impact of Public Policies to Support Small Businesses in Developed Economies. [Электронный ресурс] Режим доступа: http://www.e-award.org/web/1998_David_J_Storey.aspx, свободный. Загл. с экрана. Яз. англ. (дата обращения: апрель 2012 г.).

Поступила в редакцию 24 октября 2011 года

A.Yu. Chepurenko

National research university Higher School of Economics, Moscow

What is Entrepreneurship and What Entrepreneurship Policy Does Russia Need? (Marginal Notes on Works of Modern Foreign Classics)

The article analyses the characteristics of small and medium sized enterprises and state policy towards SME in modern Russia – in the context of some rather unknown for the Russian experts evidences of last decades, formulated in the works of leading world researchers concerning the role of entrepreneurship, its conditions of development and institutional design of the state policy to promote entrepreneurial activity and innovations.

Keywords: *entrepreneurship, entrepreneurship policy, foreign experience, innovations, venture capital, Russian institutions.*

JEL Classification: M21, M38.

Горячая тема



Круглый стол:

Экономика культуры: новый
ракурс старых проблем

А.Я. Рубинштейн

М.В. Матецкая

В.Л. Тамбовцев

Ю.В. Автономов

Т.В. Абанкина

Е.А. Хаунина

В.Ю. Музычук

С.Н. Горушкина

М.И. Жабский

М.Л. Магидович

А.Я. Рубинштейн

А.Я. Рубинштейн

ИЭ РАН, Москва

Вступительная заметка

Современная теория экономики культуры стала складываться в середине 1960-х годов после выхода в свет классического труда Вильяма Баумоля и Вильяма Боуэна «Исполнительские искусства – экономическая дилемма» (Baumol, Bowen, 1966). С тех пор наука располагает знанием о «болезни цен», суть которой заключается в том, что в секторах экономики с «отстающей производительностью» издержки производства растут быстрее, чем цены на конечный продукт (Globberman, Book, 1974; Neillbrun, 2003; Rubinstein, Baumol, Baumol, 1992; Schwarz, Greenfield, 1981; Baumol's Cost Disease, 1997; Рубинштейн, 1991, 2012). Следует отметить, что в последнее десятилетие наблюдается явный ренессанс теории Баумоля – появилось много работ, посвященных ее применению в макроэкономических исследованиях (Neck, Getzner, 2007; Nordhaus, 2008; Pomp, Vujic, 2008; Fernandez, Palazuelo, 2012).

Хотя культурная деятельность не занимает какого-либо заметного места ни в структуре бюджетов домохозяйств, ни в бюджетных расходах государства, эта сфера жизни людей была и останется в будущем одним из главных индикаторов развития общества. Так, предваряя дискуссию участников круглого стола, организованного журналом Новой экономической ассоциации, В.М. Полтерович сказал: «Культура – не только и не столько средство потребления, сколько цель развития человеческого общества». Может быть, в силу данной особенности мы встречаемся в этой сфере с явлениями, которые не столь характерны для других секторов экономики: с необычными закономерностями, с постоянными конфликтами, касающимися финансирования, с тем, что культура особенно чувствительна к методам управления и больше других страдает как от любых форм административно-командной системы, так и от другой крайности – разрушительных действий наивного и неквалифицированного либерализма.

Особенности культуры проявляются в товарах и услугах, которые производятся в данной сфере. Так, большинство культурных продуктов относится к классу мериторных благ, общественный спрос на которые превышает спрос индивидуумов и требует субсидирования со стороны государства (Musgrave, 1959, 1987; Экономика культуры, 2005, с. 159–197). И хотя в общем случае культурные блага не являются

«public goods», для них, как верно отмечает Рут Туувз (Towse, 2003), также характерно множество позитивных экстерналий, что в силу нескольких причин обуславливает целесообразность финансовой поддержки. Во-первых, все экономисты, как правило, признают, что распределение ресурсов с помощью механизма цен не может привести к производству социально желаемых товаров и услуг. Во-вторых, потребительский спрос не отражает полную стоимость этих товаров из-за информационной асимметрии: вкусы потребителей полностью не сформированы, и они не могут обладать полной информацией о культурных товарах (Towse, 2003, р. 7–9).

С учетом «болезни Баумоля» и объективной необходимости общественной поддержки культуры за многие годы были выдвинуты различные предположения о природе, принципах и методах финансирования организаций культуры. Среди наиболее часто встречающихся рецептов можно обнаружить рекомендации по бюджетному финансированию продуктов культуры, обладающих социальной полезностью, потребления культурных благ отдельными категориями населения, определенной номенклатуры услуг организаций культуры, их передвижных форм работы и даже пустующих мест в зрительных залах. В том или ином виде они представлены в многочисленных публикациях, посвященных этой проблематике, например: (Рубинштейн, 1991; Throsby, 2001; Handbook on the Economics, 2006).

В целом же определение размеров общественной поддержки и инструментов распределения бюджетных средств между организациями культуры является содержанием экономической составляющей культурной политики государства. При этом баланс общественного и частного финансирования в разных странах, обусловленный особенностями их культурной политики, сильно различается: в США, Японии, Великобритании, пропорции частного финансирования выше, чем в других европейских странах, а так же Канаде и Австралии (Towse, 2003, р. 10). Изучение позитивного опыта стран, достигших успехов в решении задач культурной политики, а также поиски новых источников финансирования культурной деятельности и формирование эффективной институциональной среды функционирования культуры и искусства – ключевые задачи экономики культуры.

По-прежнему недостаточно разработанными – и с позиций экономической науки, и с точки зрения культурной практики – остаются вопросы эффективности инвестиций в сферу культуры, измерения экстерналий (социальных выгод) культурной деятельности и степени достижения целей (которые сформулированы в культурной политике и на реализацию которых выделяются финансовые ресурсы), количественной оценки влияния культурных индустрий на рост ВВП и роли культуры и искусства в развитии человеческого капитала. Актуальными являются и междисциплинарные исследования потребительского спроса на продукты культуры и аудитории искусства, использующие социологические опросы, анализ статистических данных и эконометрические модели.

В той или иной мере все эти темы стали предметом обсуждения на круглом столе, который был организован журналом Новой экономической ассоциации 18 апреля 2012 г. (модератор – директор Государственного института искусствознания доктор искусствоведения Д.В. Трубочкин).

Литература

- Рубинштейн А.Я.** (1991). Введение в экономику исполнительского искусства. М.: Союзтеатр.
- Рубинштейн А.Я.** (2012). Эконометрическая модель «болезни цен» опекаемых благ в сфере культуры. М.: ИЭ РАН.
- Экономика культуры (2005). Учебник / А.Я. Рубинштейн (отв. ред.). М.: СЛОВО/SLOVO.
- Baumol W.J., Bowen W.G.** (1966). *Performing Arts: The Economic Dilemma*. N.Y.: The Twentieth Century Fund.
- Baumol's Cost Disease** (1997). *Baumol's Cost Disease: The Arts and Other Victims* / Towse R. (ed.). Cheltenham, Lyme: Edward Elgar.
- Fernandez R., Palazuelo E.** (2012). European Union Economies Facing «Baumol's Disease» within the Service Sector // *J. of Common Market Studies*. Vol. 50. Issue 2.
- March. P. 231–249.
- Globerman S., Book S.H.** (1974). Statistical Cost Function's for Performing Arts Organisations // *Southern Economic J.* Vol. 40. April. P. 668–671.
- Handbook on the Economics** (2006). *Handbook on the Economics of Art and Culture* / Ginsburgh A., Throsby D. (eds.). North-Holland: Elsevier Science.
- Heilbrun J.** (2003). Baumol's Cost Disease. In: «*A Handbook of Cultural Economics*». Cheltenham: Edward Elgar. P. 91–101.
- Musgrave R.A.** (1959). *The Theory of Public Finance*. N.Y., L.: Mc Graw Hill.
- Musgrave R.A.** (1987). Merit Goods. In: Eatwell J., Milgate M., Newman P. (eds.) «*The New Palgrave Dictionary of Economics*». L.: Macmillan.
- Neck R., Getzner M.** (2007). Austrian Government Expenditures: «Wagner's Law» or «Baumol's Disease»? // *International Business & Econ. Research J.* (IBER). Vol. 6. N 11. P. 49–66.
- Nordhaus W.** (2008). Baumol's Diseases: A Macroeconomic Perspective. *Contributions to Macroeconomics* // *The B.E. J. of Macroeconomics*. Vol. 8(1). Berkeley Electronic Press.
- Pomp M., Vujic S.** (2008). Rising Health Spending, New Medical Technology and the Baumol effect. *Rising Health Spending, New Medical Technology and the Baumol Effect*. CPB Netherlands Bureau for Economic Policy Analysis. December.
- Rubinstein A.J., Baumol W.J., Baumol H.** (1992). On the Economics of the Performing Arts in the Soviet Union and the USA: a Comparison of Data // *J. of Cultural Econ.* Vol. 16. N 2. P. 1–23.
- Schwarz S., Greenfield H.J.** (1981). The Facts First: A Reply to Baumol and Baumol // *J. of Cultural Econ.* Vol. 5. N 2. December. P. 85–87.
- Throsby D.** (2001). *Economics and Culture*. Cambridge: Cambridge University Press.
- Towse R.** (2003). Introduction. In: «*A Handbook of Cultural Economics*». Cheltenham: Edward Elgar. P. 3–14.

Поступила в редакцию 19 апреля 2012 года

М.В. Матецкая
НИУ ВШЭ, Санкт-Петербург

Концепция отрасли культуры в научных исследованиях: обзор основных подходов и методик оценки

Обзор инструментов оценки культурных отраслей в терминах культурных, социальных и экономических эффектов является предметом настоящей работы. Начиная со второй половины XX в. проблема оценки влияния культуры как фактора развития территорий и сообществ является предметом исследований в области экономики, социологии и культурной политики. Традиционно оценивается не только прямой вклад отраслей культуры в развитие экономики территорий, но и их влияние на решение проблем занятости населения, снижение уровня бедности и преступности; анализируется связь с системой образования, формированием человеческого капитала и др.

Начиная с 1980-х годов роль отраслей культуры оценивается в терминах функционального подхода: культура рассматривается как ресурс процессов развития и самоопределения сообществ, отмечается значение культурных ресурсов в экономических процессах и возрождении территорий (Segers, Huijgh, 2006, Cunningham, 2001). Предметом анализа становятся крупные культурные проекты, показатели качества жизни и рост благосостояния населения, брендинг территорий на основе культурного потенциала. Концептуальной основой экономического подхода стало функциональное понимание роли культуры в процессах городского развития, а базой для таких исследований – «новая экономическая модель» конкурентоспособности городов (Porter, 1995), индексы образа жизни и культурного многообразия (Landry, 2003; Hall, 1998), концепция креативного класса (Florida, 2004).

В рамках неоинституционального подхода осуществлялись попытки оценить неэкономические ценности культурных благ (Frey, 2003). Один из наиболее популярных подходов – рассмотрение культурных товаров и услуг через призму общественных благ. Вплоть до настоящего момента проводятся многочисленные исследования с применением традиционных методов оценки косвенных эффектов применительно к объектам культурного наследия (Navrud, Ready, 2002; Throsby, 2003, 2007; Noonan, 2003).

Отметим, что одной из основных целей данных подходов является обоснование участия государственных и общественных институтов в функционировании сферы культуры. Культура определялась как определенный

набор видов деятельности, чаще всего – как культурное наследие и «традиционные» виды культурной деятельности (исполнительное искусство, художественное творчество и др.). Значение культуры связывали с ощущением комфорта, характеристиками качества жизни (Michalos, 2005), оценивали через качество проведенного времени (Долгин, 2006), насыщение человеческой жизни символическим, эстетическим, образовательным и информационным видами ценностей (Throsby, 2001, Frey, 2003).

На сегодняшний момент основные подходы к оценке вклада отраслей культуры в экономические процессы могут быть представлены следующим образом (табл. 1).

Отметим, что начиная с 1970–1980-х годов культурная политика рассматривалась как подход к решению социальных проблем: активно развивались альтернативные культурные движения, преодолелся стереотип различия между «высокой» и массовой культурой. В европейских странах основными приоритетами стали культурные проекты, направленные на решение проблем атомизации населения в городах, расширение возможностей участвовать в культурной жизни для разных социальных групп. Развитие отраслей культуры в это время характеризуется следующими значительными этапами, отражающими две разноплановые тенденции. Во-первых, отрасли культуры развиваются в рамках государственного сектора экономики. Во-вторых, индустрия культуры активно развивается в коммерческих секторах (Hesmondhalgh, 2002, p. 108–135; Murdok, 2003, p. 15–22; Segers, Huijgh, 2006).

С развитием тенденций коммерциализации культуры правительства различных государств стали проявлять большую заинтересованность в формировании инструментария оценки вклада, который культура вносит в формирование социально-культурных аспектов жизни населения (например, культурной идентичности, толерантности и т.д.). С середины 1990-х годов идет активное обсуждение системы показателей, определяющих вклад отраслей культуры в развитие экономики, как на уровне городов и регионов, так и на уровне государств и межгосударственных институтов (Hawkes, 2001). Были созданы и начали работу различные организации и сетевые партнер-

Таблица 1

Оценка культуры в процессах экономических преобразований

Задачи государственной политики	Подходы к оценке и показатели	Примеры эффектов отраслей культуры
<p><i>Конкурентоспособность и рост:</i></p> <ul style="list-style-type: none"> • занятость, качество труда; • региональное развитие; • вклад в создание благосостояния; • развитие малого бизнеса; • развитие инноваций и знаний; • человеческий капитал, навыки, умения; • кооперация экономических субъектов; • развитие торговли 	<p>Расходы и доходы в отраслях культуры</p> <p>Число занятых в отраслях культуры</p> <p>Размещение трудовых ресурсов</p> <p>Расходы частного и государственного сектора в сфере культуры</p> <p>Анализ культурных проектов методом «затраты–результат»</p> <p>Анализ эффективности отрасли</p> <p>Условно-опросные методы относительно готовности платить за культурные блага (WTP, CVA)</p> <p>Оценка мультипликаторов</p> <p>Сетевой анализ (SNA)</p>	<p>Возрастание ставок на недвижимость (здания и объекты), относящуюся к культурному наследию</p> <p>Участие частного сектора в развитии культуры</p> <p>Увеличение расходов жителей и туристов на потребление культурных благ</p> <p>Создание рабочих мест, предприятий, добавленной стоимости в сфере культуры</p> <p>Миграция людей (концепция творческого класса)</p> <p>Разнообразие и повышение профессионализма работников</p> <p>Развитие культурных кластеров</p> <p>Проекты государственно-частного партнерства</p>

Источник: подготовлено автором на основе данных (Evans, 2005, p. 971–972).

Таблица 2

Оценка культуры в процессах преобразования городской инфраструктуры

Задачи государственной политики	Подходы к оценке и показатели	Примеры эффектов культурных отраслей
<p><i>Устойчивое развитие:</i></p> <ul style="list-style-type: none"> • рациональное использование земельных, природных и культурных объектов; • повышение качества жизни населения; • развитие публичных пространств; • разнообразие культурного и природного ландшафта; • сохранение культурного наследия; • обеспечение доступности культурных благ; • возрождение и благоустройство городских пространств и инфраструктуры 	<p>Показатели, характеризующие уровень качества жизни</p> <p>Оценка альтернативных способов использования земельных участков, недвижимости</p> <p>Составление списков, рейтингов и объектов культурного наследия</p> <p>Классификация зон и территорий</p>	<p>Освоение неиспользуемых зданий под культурные проекты (студии, музеи, галереи, лофты)</p> <p>Использование публичных пространств (снижение вандализма, чувство безопасности)</p> <p>Доступность культурного потребления снижает транспортные расходы, отрицательные внешние эффекты на окружающую среду</p> <p>Преобразования окружающей среды через публик арт, архитектуру, ландшафт</p>

Источник: Evans, 2005, p. 971–972.

ства в сфере развития культурных процессов (например «Creative cities network»,), разработаны основополагающие документы в области формирования культурной политики и развития культурной сферы (UCLG, 2004, 2009; UNESCO, 2011; UNCTAD, 2011). Один из самых популярных подходов был основан на оценке отраслей культуры с точки зрения вклада в создание ВВП и анализе статистических показателей отрасли (число занятых в отрасли, организаций в сфере культуры, посетителей организаций культуры и т.д.) (табл. 2).

Одной из основных проблем, не решенных до сих пор, остается фрагментарность исследований, оценивающих значение культурных отраслей в социально-экономических процессах развития современных городов (Evans, 2005). Исследователи также отмечают, что не может быть единой логики оценки культурных проектов для малых и крупных городов (Lim, 1993), методики оценки вклада в развитие территорий всегда должны учитывать контекст и специфику конкретной ситуации.

В начале 2000-х годов ситуация все больше усложняется по сравнению с предыдущим периодом (Segers, Huijgh, 2006; Pratt, 2005). Изменения в процессах культурного производства ускорились, а именно: 1) усложнились отношения между частными и государственными организациями культуры; 2) изменяются критерии и инструменты для государственных инвестиций и поддержки культурных мероприятий; 3) увеличиваются различные категории «культурного или творческого предпринимательства»; 4) растет конкуренция на мировом рынке культурной и символической продукции; 5) становятся актуальными тенденции концентрации и расширения сферы бизнеса в отраслях культуры; 6) осваиваются новые каналы распространения культурного контента, технологий его создания и воспроизведения (Гордин, Хорева, Матецкая, 2011).

При этом рост культурного потребления демонстрирует две противоречивые модели. С одной стороны, время, которое человек тратит на потребление культурных и информационных услуг дома, постоянно растет, отражая так называемый феномен одомашнивания культуры (рост так называемого *home entertainment*) (Garnham 1990, p. 158–159). С другой стороны, потребители все чаще заинтересованы в коллективном опыте потребления культурных благ и услуг через участие в крупномасштабных проектах всех видов, фестивалях, интерактивных мероприятиях (табл. 3). Все аспекты жизни становятся экономикой впечатлений, а досуг – ее центральной частью (Пайн, Гилмор, 2005).

Таким образом, за последнее десятилетие произошли значительные изменения в подходах к оценке вклада культуры в экономическое развитие общества. Очевидное изменение современной культурной политики многих государств состоит в переходе к оценке эффективности отраслей культуры не только с экономической точки зрения, но и в терминах «ценностей», которые культура и искусство имеют сами по себе, а не только в функциональном значении (Gray, 2010). Традиционные экономические методы измерения доли отраслей культуры в производстве валового внутреннего продукта дополняются методиками измерения более широких экономических и социальных факторов.

В качестве инструментов выявления и оценки роли отраслей культуры в развитии городского пространства ключевыми выступают инструменты картирования. Методика картирования предполагает выявление творческих организаций и проектов, которые востребованы потребителями, интересны с точки зрения развития бизнеса, влияют на развитие территорий. Тенденцией последних лет является понимание творческих организаций и проектов, в том числе отраслей культуры как инфраструктуры для создания продуктов и услуг с высокой долей оригинальности, инновационности и креативности. Новые подходы к оценке деятельности организаций культуры имеют и новый фокус исследований, в качестве критериев влияния отраслей культуры на жизнь современного общества выступают не

Таблица 3

Оценка культуры в процессах социальных преобразований

Задачи государственной политики	Подходы к оценке и показатели	Примеры эффектов культурных отраслей
<p><i>Социальная включенность:</i></p> <ul style="list-style-type: none"> ● социальная сплоченность; ● здоровый климат в обществе; ● формирование идентичности граждан; ● формирование и развитие социального капитала; ● возможности управления и участия граждан в культурных процессах; ● обеспечение культурного разнообразия; ● сохранение и создание общегосударственного культурного наследия 	<p>Посещаемость, участие в культурной деятельности</p> <p>Уровень преступности</p> <p>Ощущение комфорта и счастья</p> <p>Показатели здоровья, арт-терапия</p> <p>Образование новых социальных сетей</p> <p>Улучшение качества проведения досуга</p> <p>Снижение уровня социальной изоляции</p> <p>Снижение антисоциального поведения</p> <p>Участие добровольцев в культурных проектах</p>	<p>Рост потребления культурных услуг (приобщение жителей к участию в культурной жизни)</p> <p>Вытеснение антисоциальных практик различными видами культурной деятельности</p> <p>Индивидуальное и коллективное самовыражение</p> <p>Изменение образа, представления о месте и о людях</p> <p>Государственно-частные проекты, развитие общественных инициатив, волонтерство</p>

Источник: Evans, 2005, p. 971–972.

столько экономические показатели, сколько их интегрированность во все аспекты жизни людей.

Литература

- Долгин А.Б.** (2006). Экономика символического обмена. М.: ИНФРА-М.
- Пайн П.Дж., Гилмор Дж.Х.** (2005). Экономика впечатлений. Работа – это театр, а каждый бизнес – сцена. М.: Вильямс.
- Гордин В.Э., Хорева Л.В., Матецкая М.В.** (2011). Диссеминация культурных ценностей и продуктов: коммерческий и некоммерческий подходы // *Известия Санкт-Петербургского университета экономики и финансов*. Т. 4. С. 42–50.
- Cunningham S.** (2001). From Cultural to Creative Industries: Theory, Industry, and Policy Implications // *Culturelink* (Special Issue). P. 19–32.
- Evans G.** (2005). Measure for Measure: Evaluating the Evidence Of Culture's Contribution to Regeneration // *Urban Studies*. Vol. 42. P. 959–983.
- Florida R.** (2004). *The Rise of the Creative Class*, 2nd ed. N.Y.: Basic Books.
- Frey B.** (2003). *Arts and Economics: Analysis and Cultural Policy*. Berlin: Springer.
- Garnham N.** (1990). *Capitalism and Communication, Global Culture and the Economics of Information*. L., Newbury Park, New Delhi: SAGE Publications.
- Gray C.** (2010). Analysing Cultural Policy: Incongruously Plural or Ontologically Compatible, *International Journal of Cultural Policy*. Vol. 16. P. 215–30.
- Hall P.** (1998). *Cities and Civilization: Culture, Innovation, and Urban Order*. L.: Weidenfeld & Nicholson.
- Hawkes J.** (2001). *The Fourth Pillar of Sustainability*. Cultural Development Network. Melbourne.
- Hesmondhalgh D.** (2002). *Cultural Industries*. L.: SAGE Publications.
- Landry C.** (2003). *The Creative City: A Toolkit for Urban Innovators*. L.: Earthscan.
- Lim H.** (1993). Cultural Strategies for Revitalizing the City: a Review and Evaluation // *Regional Studies*. Vol. 27(6). P. 589–594.
- Michalos A. C.** (2005). Arts and the Quality of Life: An Exploratory Study // *Social Indicators Research*. Vol. 71. P. 11–59.
- Murdock G.** (2003). Back to Work: Cultural labor in altered times. In: «*Cultural Work: Understanding the cultural industries*» / Beck A. (ed.). L.: Routledge. P. 15–35.
- Navrud S., Ready R.C.** (2002). Valuing Cultural Heritage: Applying Environmental.
- Noonan D.** (2003). Contingent Valuation of Cultural Resources: A Meta-Analytic Review of the Literature // *J. of Cultural Econ.* Vol. 27. P. 159–176.
- Pratt A.C.** (2005). Cultural Industries and Public Policy: An oxymoron // *International J. of Cultural Policy*. Vol. 11. P. 31–44.
- Porter M.E.** (1995). The Competitive Advantage of the Inner City // *Harvard Business Review*. May/June. P. 55–71.
- Segers K., Huijgh E.** (2006). Clarifying the Complexity and Ambivalence of the Cultural Industries. Working paper Centre for Studies on Media and Culture (Cemeso).
- Throsby D.** (2001). *Economics and Culture*. Cambridge: Cambridge University Press.
- Throsby D.** (2003). Determining the Value of Cultural Goods: How Much (or How Little) Does Contingent Valuation Tell Us? // *J. of Cultural Econ.* Vol. 27. P. 275–285.
- Throsby D.** (2007). Regional Aspects of Heritage Economics: Analytical and Policy // *Issues Australasian J. of Regional Studies*. Vol. 13(1). P. 21–30.
- UNCTAD (2011). *Creative Economy Report 2008*. [Электронный ресурс] Режим доступа: http://www.unctad.org/en/docs/ditc20082cer_en.pdf, свободный. Загл. с экрана. Яз. англ. (дата обращения: апрель 2012 г.).
- UNESCO (2011). *Creative Industries – UNESCO Culture*, UNESCO. [Электронный ресурс] Режим доступа: http://portal.unesco.org/culture/en/ev.php-URL_ID=35024&URL_DO=DO_TOPIC&URL_SECTION=201.html, свободный. Загл. с экрана. Яз. англ. (дата обращения: апрель 2012 г.).
- UCLG (2004). *United Cities and Local Governments*. In: «*Agenda 21 for culture*». Barcelona: City of Barcelona and UCLG.
- UCLG (2009). *United Cities and Local Governments*. In: «*Culture and sustainable development: Examples of institutional innovation and proposal of a new cultural policy profile*». Barcelona: City of Barcelona and UCLG.

Поступила в редакцию 23 апреля 2012 года

В.Л. Тамбовцев

МГУ им. М.В. Ломоносова, Москва

Причины «болезни издержек» Баумоля: низкая производительность или культурные стереотипы?

Одной из базовых закономерностей современной экономики культуры является так называемая «болезнь издержек» (cost disease), открытие которой принадлежит У. Баумолю и У. Боуэну (Baumol, Bowen, 1966). Суть этого феномена заключается в том, что для ряда видов художественной культуры, таких как театр, исполнительское музыкальное искусство и т.п., издержки соответствующей деятельности растут быстрее, чем цены, по которым удается продавать потребителям билеты, обеспечивающие доступ к непосредственному восприятию этой деятельности, т.е. процессов игры актеров, музыкантов, певцов¹. Как следствие, само существование организаций, продающих услуги исполнительского характера, оказывается под вопросом: их деятельность не окупается за счет продаваемых билетов, они вынуждены обращаться за финансовой поддержкой к государству, к частным меценатам, пытаться формировать себе целевой капитал (endowment) и т.п.

Отсутствие окупаемости за счет исключительно продажи билетов объясняется при этом, в частности, *особым характером* тех благ, доступ к которым регулируется ценой билета (см., например (Fullerton, 1991)). Эти блага квалифицируются как *социально значимые* (merit goods)². Согласно исходной трактовке этого понятия его автором Р. Масгрейвом (Musgrave, 1957) к этой категории относятся те блага, которые индивиды или общество должны потреблять исходя из понятия нужды (need), а не способности и готовности за них платить. Такое понимание, однако, явно противоречит фундаментальной категории *суверенитета потребителя* (см. обсуждение проблемы, например, в (D'Amico, 2009; Mann, Gairing, 2010) и др.), что привело впоследствии к его переосмыслению. В непатерналистской трактовке социально значимые блага определяются как *частные блага*, потребление которых дает *значительные внешние эффекты*, невольные потребители которых не оплачивают производителям за достигающиеся им даром природы их благосостояния.

Существование общественных благ и наличие у ряда благ масштабных внешних эффектов со времен А. Пигу (Pigou, 1920) использовались для оправдания государственного вмешательства в экономические процессы посредством введения тех или иных схем налогообложения-субсидирования. Только после публикации знаменитой статьи Р. Коуза «Проблема социальных издержек» (Coase, 1960) внешние эффекты стали трактоваться как источники координационных проблем, которые могут быть устранены без внешнего вмешательства, но путем *частных* переговоров. При этом было показано, что такие переговоры могут интернализировать не только негативные (как в ситуации с землепашцем и скотоводом), но и некоторые позитивные экстерналии (как в ситуации с садоводом и пчеловодом) (Cheung, 1973).

Специфика примера, детально проанализированного С. Ченом, заключается в том, что позитивные экстерналии в нем имеют взаимный характер: фактически имеет место совместное производство комплексного блага. Кроме того, в ситуации технологического взаимодействия садовников и пчеловодов, рассмотренной С. Ченом, могут быть рассчитаны (оценены) количественные оценки взаимовлияния, которые и являются основанием для формирования рыночных цен, позволяющих включить внешние эффекты в параметры заключаемых сделок.

Однако для ситуаций, в которых отсутствует как совместное производство (иначе говоря, взаимозависимость выгод, получаемых производителем экстерналии и ее бенефициаром, деятельность которого производит свои экстерналии для «исходного» производителя), так и возможность количественной оценки «наносимого» эффекта, переговорный механизм координации не может не давать сбоев. Ведь в подобных ситуациях (моделируемых известной притчей о Ходже Насреддине, с которого потребовали плату за то, что он наслаждался запахом похлебки) стороне-бенефициару не делалась

¹ При этом в секторе продажи носителей информации, отражающих названные процессы (аудиозаписи концертов, видеозаписи спектаклей и т.п.), такого опережения явно не наблюдается.

² Этот англоязычный термин переводится также как «окупаемые блага» (Рубинштейн, 2009).

оферта относительно приобретения экстерналии, так что и нет оснований для заключения какого-либо договора (см., например (Barnett, 1986, p. 287–289)).

Необходимо отметить, впрочем, что в недавних публикациях А. Пората (Pogat, 2008, 2009) были высказаны предложения о введении в правовую систему доктрины «расширенного обязательства возмещения» (expanded duty of restitution), в соответствии с которой не только производитель негативных экстерналий обязан компенсировать пострадавшему его издержки, но и бенефициар обязан оплатить производителю позитивной экстерналии ту часть его издержек, которая соответствует полученным им «непрошеным выгодам» (unrequested benefits).

Перевод обсуждаемых проблем в правовую плоскость немедленно ставит вопрос о *доказательной базе* полученной выгоды: была ли выгода вообще, каковы ее размеры, была ли она порождена именно действиями производителя или иными причинами и т.д. Очевидно, без надежного ответа на эти вопросы у суда нет оснований принуждать гипотетического бенефициара выплачивать потенциальному производителю положительного внешнего эффекта какие-либо компенсации.

После этого краткого экскурса в экономическую теорию мы можем вернуться к «болезни издержек».

Исходное объяснение данного феномена его открывателями заключалось в том, что в отличие от других секторов экономической деятельности в сфере исполнительских искусств рост производительности труда в принципе отсутствует. Действительно, на «изготовление» симфонии, написанной в XIX в., т.е. исполнение ее оркестром, в XXI в. уходит столько же времени и требуется столько же музыкантов, как в момент ее первого исполнения, хотя для подавляющего большинства других видов продукции за два века и сроки изготовления, и необходимое число работников сократились во много раз. Позднее к этому объяснению было добавлено также и то обстоятельство, что заработная плата в сфере исполнительских искусств имеет тенденцию следовать за ростом средней заработной платы в экономике (Heilbrun, 2003), поскольку эта сфера вынуждена конкурировать за работников с другими сферами на едином рынке труда.

Эмпирическая проверка комплексного объяснения «болезни издержек» была недавно предпринята на данных по отечественным театрам, концертным организациям и музеям А.Я. Рубинштейном. Расчеты, проведенные им на уникальной базе данных по этим учреждениям за двадцать лет, вполне подтвердили, что в РФ данная закономерность имеет место. По мнению автора, расчеты «позволили установить *макроэкономическую природу* «болезни цен» (Рубинштейн, 2012, с. 62).

С нашей точки зрения, у «болезни издержек» может быть и иное объяснение. «Живое» исполнение музыкальных или драматургических произведений, непосредственное восприятие художественных или исторических артефактов в музеях и картинных галереях, безусловно, отличается для *некоторых* слушателей и зрителей от восприятия копий (аудио- и видеозаписей, репродукций и т.п.). Для них это блага гораздо более высокого качества, чем все разновидности копий, при схожести информационных функций и оригиналов, и копий.

Однако блага более высокого качества вполне закономерно будут иметь и более высокую цену (хотя бы потому, что их производство требует более высоких издержек). Это означает, что спрос на оригиналы могут (и будут) предъявлять лишь те индивиды, которые: а) ощущают или хотят продемонстрировать, что ощущают различия между ними и копиями; б) готовы оплатить свою часть издержек их производства. Если соответствующий сегмент рынка качественных эстетических благ окажется достаточно велик, продажа билетов по *равновесным ценам* будет вполне покрывать издержки, и «болезнь издержек» излечится сама собой. Если платежеспособный спрос на тот или иной оригинал окажется невелик, его производитель вынужден будет уйти с рынка – в полном соответствии со «стандартной» экономической теорией.

Что мешало такому поведению производителей качественных эстетических благ (оригиналов)? По нашему мнению, это прежде всего *культурные стереотипы* самих производителей, оценивающих свой успех или неудачу *не объемом доходов*, а размерами своей *аудитории* (числом слушателей, зрителей, посетителей)³. Как представляется, отказ от этих стереотипов – надежное лекарство от «болезни издержек».

³ Источники таких стереотипов могут быть весьма разнообразными, но их анализ не входит в задачи этой статьи. В РФ, как представляется, наибольший вклад в их формирование внесла культурная политика времен СССР с ее лозунгом «Искусство принадлежит народу» и культуртрегерскими устремлениями «железной рукой» приобщить массы к высокому искусству.

Но как же быть с позитивными экстерналиями потребления качественных эстетических ценностей (и с платой за их невольное получение со стороны государства и частных спонсоров)? Насколько нам известно, для качественных эстетических благ сколь угодно надежные доказательства существования подобных экстерналий *отсутствуют* (в отличие, например, от сферы образования, см., например (McMahon, 2004)⁴). Если подобные доказательства в будущем появятся, вполне оправданным станет и пересмотр рецептов для лечения «болезни издержек».

Означает ли сказанное, что мы выступаем за отказ от государственных субсидий и средств частных спонсоров в сфере исполнительских искусств, музеев и т.д.? Ни в коем случае: если такого рода субсидии делаются добровольно или являются следствием сознательно проводимой государственной политики, нет никаких оснований подвергать их какой-то критике (разве что за не слишком большие размеры). Однако для обоснования этих внерыночных выплат не следует привлекать нерелевантные проблеме доводы экономической теории.

Литература

- Рубинштейн А.Я.** (2009). К теории рынков опекаемых благ. Статья 1. Опекаемые блага и их место в экономической теории // *Общественные науки и современность*. № 1. С. 139–153.
- Рубинштейн А.Я.** (2012). Опекаемые блага в сфере культуры: признаки и последствия «болезни цен». М.: Институт экономики РАН.
- Barnett A.** (1986). A Consent Theory of Contract // *Columbia Law Review*. Vol. 86. P. 269–321.
- Baumol W.J., Bowen W.G.** (1966). *Performing Arts: The Economic Dilemma*. N.Y.: The Twentieth Century Fund.
- Cheung S.N.S.** (1973). The Fable of the Bees: An Economic Investigation // *J. of Law and Econ.* Vol. 16. № 1 (Apr.). P. 11–33.
- Coase R.** (1960). The Problem of Social Cost // *J. of Law and Econ.* Vol. 3 (Oct.). P. 1–44.
- D'Amico D.** (2009). Merit Goods, Paternalism, and Responsibility. Paper presented at XXI Conference «Public Choice and Political». Pavia, Università. 24–25 September.
- Fullerton D.** (1991). On Justifications for Public Support of the Arts // *J. of Cultural Econ.* Vol. 15. N 2. P. 67–82.
- Heilbrun J.** (2003). Baumol's cost disease. In: Towse R. (ed.) «*Handbook of cultural economics*». Cheltenham: Edward Elgar. P. 91–101.
- Mann S., Gairing M.** (2010). Does Libertarian Paternalism Reconcile Merit Goods Theory with Mainstream Economics? // *Forum for Social Econ. Online First*TM. 31 December (forthcoming).
- McMahon W.W.** (2004). The Social and External Benefits of Education. In: G. Johnes, J. Johnes (eds.) «*International handbook on the economics of education*». Cheltenham: Edward Elgar. P. 211–258.
- Mueller N.** (2007). (Mis-)Understanding Education Externalities. MPRA Paper N 5331. March.
- Musgrave R.A.** (1957). A Multiple Theory of Budget Determination // *Finanz Archiv*, New Series. Vol. 17. N 3. P. 333–343.
- Pigou A.C.** (1920). *The Economics of Welfare*. L.: Macmillan.
- Porat A.** (2008). Expanding Restitution: Liability for Unrequested Benefits. The University of Chicago. The Law School. Public Law and Legal Theory WP N 202. January.
- Porat A.** (2009). Private Production of Public Goods: Liability for Unrequested Benefits // *Michigan Law Review*. Vol. 108 (November). P. 189–227.

Поступила в редакцию 18 марта 2012 года

⁴ Впрочем, существует и достаточно обоснованная критика используемых подходов (Mueller, 2007).

Ю.В. Автономов
НИУ ВШЭ, Москва

Эластичность спроса на исполнительское искусство по цене и доходу: основные результаты эмпирических исследований

Спрос на культурные блага, в частности исполнительское искусство, является одним из наиболее популярных предметов эмпирических исследований в экономике культуры. Однако, как констатирует Б. Симэн, автор наиболее тщательно проведенного обзорного исследования, посвященного изучению спроса на исполнительское искусство (Seaman, 2005, 2006), несмотря на все более изощренные усилия социологов, психологов, маркетологов и экономистов, литература, посвященная этому направлению исследований, все еще содержит множество загадок.

Эмпирические исследования спроса на исполнительское искусство в большинстве своем делятся на две категории – опросы, стремящиеся выявить демографические характеристики театральной, оперной, балетной или иной аудитории¹, и эконометрические исследования, пытающиеся оценить эластичность спроса по собственной цене, доходу и (весьма редко) цене предполагаемых субститутгов, о результатах которых и пойдет в основном речь.

У экономистов нет единого априорного мнения о том, насколько спрос на исполнительское искусство эластичен по цене, и поляризация мнений по этому вопросу тесно связана с тем, стоит ли относить исполнительское искусство к товарам роскоши или нет. С одной стороны, принимая во внимание историю и данные ранних эмпирических исследований (например, (Ford Foundation, 1974; Book, Globerman, 1975; Americans and the Arts, 1976; DiMaggio, Useem, 1978; Throsby, Withers, 1979; West, 1985)), можно заметить, что основная аудитория консерваторий и филармоний, театра и балета представляет собой общественную элиту в терминах образования, дохода и профессии. И, следовательно, исполнительское искусство, не относящееся к популярным жанрам, является скорее предметом (и това-

ром) роскоши. С точки зрения микроэкономики отсюда следует, что спрос на исполнительское искусство может оказаться эластичным по цене.

С другой стороны, есть некоторые теоретические основания предполагать, что спрос на исполнительское искусство неэластичен по цене. Среди таких факторов можно назвать формирование у зрителей художественного вкуса (привычки), несовершенство информации, ведущее к тому, что цена билета на спектакль или концерт воспринимается неискушенной публикой как сигнал о его «качестве», а также эффект Веблена, когда присутствие на некотором спектакле или концерте выступает для зрителя средством демонстрации социального статуса².

Имеющиеся на текущий момент эконометрические результаты поддерживают скорее вторую точку зрения. Из 29 эконометрических исследований, в которых оценивалась ценовая эластичность спроса на исполнительское искусство, она оказалась больше единицы лишь в четырех работах, еще пять работ содержали смешанные результаты, где спрос оказывался эластичным лишь для отдельных организаций, категорий зрителей, периодов времени или форм искусства³.

Однако интерпретировать результаты большей части этих исследований можно лишь с большой осторожностью в силу агрегированного характера данных. Например, во многих из них зависимая переменная – это число посетителей одного или нескольких театров, деленное на численность населения соответствующего города или области. В качестве показателей уровня образования или дохода рассматриваются средние для этого города или области величины, а цена рассчитывается как общая выручка за некоторый период, деленная на число проданных билетов. При этом неиз-

¹ При этом в одной части исследований опрашиваемые представляют собой случайную выборку, в другой опрашиваются непосредственно посетители концертов и спектаклей. В последнем случае исследователю легче получить необходимую информацию – но возникают определенные искажения, связанные с самоотбором меломанов, балетоманов и т.д.

² Хотя последний фактор вряд ли оказывает существенное влияние на посещаемость большей части спектаклей и концертов, он может быть весьма значимым для спроса на уникальные, «знаковые» события.

³ Сводную таблицу, характеризующую основные результаты исследований эластичности спроса на исполнительское искусство, можно найти в (Seaman, 2006, p. 425).

бежно игнорируется тот факт, что билеты разных категорий продаются по разным ценам, что спрос на места в партере и на галерке предъявляют люди, как правило, с совершенно разным уровнем дохода, социальным статусом, образом жизни и т.п.

Среди авторов, работавших с более детализированными данными, можно упомянуть Поммерене и Кирхгасснера (Pommerehne, Kirchgassner, 1987), деливших потребителей на группы по уровню дохода (спрос оказался эластичным, причем менее эластичным он был для потребителей с высоким доходом). Шиммельпфенниг, изучая спрос на балет (Schimmelpfennig, 1997), отдельно рассматривал спрос на места в партере, бельэтаже и амфитеатре, обнаружив удивительно высокую ценовую эластичность спроса даже на самые дорогие места, которые должны были бы приобретаться обеспеченными балетоманами. В исследованиях (Felton, 1989; 1994–1995) потребителей делили на покупателей абонементов и всех остальных посетителей. Результаты оказались противоречивыми: в более раннем исследовании спрос был относительно эластичнее у первых, в более позднем – у вторых, хотя у обеих групп эластичность оказалась меньше единицы. В других исследованиях (например, (Coring, Levy, 2002)) спрос оказывался эластичным или неэластичным в зависимости от местоположения театра. Таким образом, интуитивное подозрение, что при работе с более дезагрегированными данными спрос будет более эластичным, не подтверждается однозначно.

Результаты не слишком надежны и в отношении эластичности спроса по доходу. Во многих статистических и эконометрических исследованиях аудитории исполнительского искусства острым вопросом является неизбежная взаимозависимость между образованием и уровнем дохода – двумя из важнейших факторов, определяющих спрос на искусство. В какой степени на частоту посещения спектаклей и концертов влияет именно образование зрителя, а в какой – его доход? Ранние статистические исследования свидетельствовали о значительно более сильном влиянии уровня

образования⁴. Наиболее убедительно это было показано в исследовании Фонда Форда (Ford Foundation, 1974, Vol. II), где, например, для респондентов с одинаковым (высоким) уровнем дохода частота посещений театра была на 21% выше у более образованных людей (для респондентов с одинаково низким уровнем дохода эта разница составляла 25%). Когда же авторы сравнивали ответы респондентов с одинаково высоким/низким уровнем образования, частота посещений у более обеспеченных зрителей была лишь на 8% больше для высокого и на 12% выше – для низкого уровня образования.

Аналогичные результаты были получены для посещения концертов классической музыки, оперы и балета, и фактически эти результаты оказывались несколько иными только в случае кино, где образование и уровень дохода влияли на частоту посещения в одинаковой степени. Среди недавних исследований комментаторы последнего опроса SPPA⁵ отмечали, что образование коррелирует с интенсивностью посещений спектаклей и концертов сильнее, чем любой другой демографический фактор (National Endowment for the Arts, 2004, p. 19). Этот результат подтверждается регрессионным анализом в работе Питерсона и коллег (Peterson, Hull, Kern, 2000), которые, используя данные SPPA 1997 г., показали, что образование почти везде оказывалось самым надежным предиктором спроса. В целом же эконометрические данные в этом отношении противоречивы: из 12 эконометрических исследований, учитывавших и влияние образования, и влияние дохода, в четырех преобладало влияние образования, в трех – влияние дохода, а результаты остальных были неоднозначными (Seaman, 2006, p. 441)⁶.

Что касается перекрестной ценовой эластичности спроса на исполнительское искусство, как констатируют Леви-Гарбуа и Монмаркетт, пока что даже попытки определить, что выступает субститутом по отношению к исполнительскому искусству, приносили смешанные результаты (Lévy-Garboua, Montmarquette, 2003). Чаще всего в качестве

⁴ Ранние эконометрические исследования также свидетельствуют о том, что влияние этих двух переменных очень трудно разделить. Так, в двух наиболее тщательных, по мнению Симэна, эконометрических исследованиях (Mooge, 1966; Withers, 1980), где значимость дохода оказалась весьма низкой, уровень образования не был включен в число регрессоров.

⁵ SPPA (Survey of Public Participation in the Arts) – одно из наиболее детализированных опросных исследований аудитории исполнительского искусства, которое проводит и публикует каждые два года Национальный фонд искусств США.

⁶ Последние исследования (например, (Zieba, 2009)) показывают, что при изучении эластичности спроса по цене и доходу важно учитывать не только денежный доход, но и общую стоимость свободного времени, которым располагает человек. С учетом этой компоненты в составе дохода эластичность спроса на исполнительское искусство по доходу ощутимо возрастает (однако образование в этой работе в число регрессоров не входило).

субститута выбиралось кино⁷, но, как пишет Симэн, «можно с уверенностью утверждать, что у нас мало эмпирических свидетельств в пользу того, что кино является реальным субститутом исполнительского искусства» (Seaman, 2006, p. 450). Несомненно, самым известным примером оценки перекрестной эластичности спроса на исполнительское искусство является работа Гапинского (Gapinski, 1986), который оценивал спрос на услуги 13 организаций, среди которых были концертные залы, драматические, оперные и балетные театры. Основным выводом его исследования состоял в том, что различные формы исполнительского искусства действительно являются субститутами по отношению друг к другу и, хотя для 10 из 13 организаций перекрестная эластичность была меньше единицы, она везде была отрицательной⁸.

Подводя итоги, можно сказать, что почти за полвека эмпирического изучения спроса на исполнительское искусство экономистам удалось недвусмысленно подтвердить лишь немногие из тех гипотез, которые они выдвигали по отношению к этому предмету исследования. Фактически мы можем быть уверены лишь в том, что кривые спроса на исполнительское искусство имеют отрицательный наклон (свидетельства о противоположном можно отнести на счет того, что цена выполняет роль индикатора качества), что исполнительское искусство относится к нормальным благам (но необязательно к товарам роскоши) и что спрос на исполнительское искусство имеет положительные коэффициенты перекрестной эластичности по цене некоторых благ.

В отношении ряда важных вопросов – в частности, проверки и теоретической интерпретации низкой ценовой эластичности спроса, эластичности спроса по доходу, субститутов и комплементов исполнительского искусства, а также взаимовлияния традиционных социально-экономических факторов, определяющих спрос, и переменных, характеризующих стиль жизни потребителя, – мы до сих пор находимся в состоянии неопределенности. Несмотря на это, за последние несколько десятков лет ис-

следователи спроса на исполнительское искусство достигли определенного прогресса, и развить его, представляется, помогут не большие размеры выборок⁹ или использование более тонких эконометрических методов, а прежде всего применение дезагрегированных данных, более аккуратное вычленение эффектов дохода и замещения при оценке соответствующих эластичностей и повышенное внимание к теоретической основе (в частности, моделированию зависимости от прошлого потребления) для спецификации моделей спроса.

Литература

- Americans and the Arts (1976). Americans and the Arts: A Survey of the Attitude Toward and Participation in the Arts and Culture of the United States Public. N.Y.: National Research Center of the Arts, Inc.
- Book S.H., Globberman S.** (1975). The Audience for the Performing Arts. Toronto: Ontario Arts Council.
- Corning J., Levy A.** (2002). Demand for Live Theater with Market Segmentation and Seasonality // *J. of Cultural Econ.* Vol. 26. P. 217–235.
- DiMaggio P., Useem M.** (1978). Social Class and Arts Consumption: The Origin and Consequences of Class Differences in Exposure to the Arts in America // *Theory and Society*. Vol. 5. P. 141–161.
- Felton M.V.** (1989). Major Influences on the Demand for Opera Tickets // *J. of Cultural Econ.* Vol. 13. P. 53–64.
- Felton M.V.** (1994–1995). Evidence of the Existence of the Cost Disease in the Performing Arts // *J. of Cultural Economics*. Vol. 18. P. 301–312.
- Ford Foundation (1974). The Finances of the Performing Arts. Vol. II: A Survey of the Characteristics and Attitudes of Audiences for Theater, Opera, Symphony, and Ballet in 12 US Cities. N.Y.: Ford Foundation.
- Gapinski J.H.** (1986). The Lively Arts as Substitutes for the Lively Arts // *American Econ. Review*. Vol. 76. P. 20–25.
- Lévy-Garboua L., Montmarquette C.** (1996). A Mi-

⁷ Интересно, что исследователи, оценивающие спрос на кино, не считают исполнительское искусство товаром-субститутом, так как первое географически распространено гораздо шире, чем последнее.

⁸ Стоит также упомянуть об интересном косвенном подходе к оценке отношений взаимозамещения/ взаимодополнения культурных благ, впервые примененном Прието-Родригесом и Фернандесом-Бланко (Prieto-Rodriguez, Fernández-Blanco, 2000). Пытаясь ответить на вопрос, являются ли классическая и популярная музыка товарами-заменителями или их слушатели – просто разные люди, они оценивали корреляцию остатков в регрессионных уравнениях спроса на эти виды музыки. Некоторые их результаты позволяют заключить, что высокое и популярное искусство, скорее, дополняет, чем заменяет, друг друга (подробнее см. (Seaman, 2005, p. 120–122)).

⁹ В некоторых из известных исследований размер выборки был весьма солидным. Например, Леви-Гарбуа и Монмаркетт (Lévy-Garboua, Montmarquette, 1996) использовали выборку в 8000 человек; в работах ряда авторов (Peterson, Hull, Kern, 2000; Globberman, Book, 1977; Montgomey, Robinson, 2005) выборки содержали 17 135, 13 750 и 8000 респондентов соответственно.

- croeconometric Study of Theater Demand // *J. of Cultural Econ.* Vol. 20. P. 25–50.
- Lévy-Garboua L., Montmarquette C.** (2003). Demand. In: «*A Handbook of Cultural Economics*» / Towse R. (ed.). Cheltenham, UK.: Edward Elgar. P. 201–213.
- Montgomery S.S., Robinson M.D.** (2005). Take Me Out to the Opera: Are Sports and Arts Complements? Evidence from the Performing Arts Research Coalition Data. Presented at the 8th International Conference on Arts and Cultural Management (AIMAC). Montreal. July 3–6.
- Moore T.G.** (1966). The Demand for Broadway Theater Tickets // *Review of Econ. and Statistics.* Vol. 48. P. 79–87.
- National Endowment for the Arts (2004). 2002 Survey of Public Participation in the Arts. Research Division Report N 45. National Endowment for the Arts. Washington, DC.
- Peterson R.A., Hull P., Kern R.** (2000). Age and Arts Participation: 1982–1997. Research Division Report N 42. National Endowment for the Arts, Washington, DC.
- Pommerehne W., Kirchgassner G.** (1987). The Impact of Television on the Demand for Cinema and Theatre Performances. In: «*Economic Efficiency and the Performing Arts*» / Grant N.K. et al. (eds.). Akron: Association for Cultural Economics. P. 44–61.
- Prieto-Rodríguez J., Fernández-Blanco V.** (2000). Are Popular and Classical Music Listeners the Same People? // *J. of Cultural Econ.* Vol. 24. P. 147–164.
- Schimmelpfennig J.** (1997). Demand for Ballet: A Non-Parametric Analysis of the 1995 Royal Ballet Summer Season // *J. of Cultural Econ.* Vol. 21. P. 119–127.
- Seaman B.A.** (2005). Empirical Studies of Demand for the Performing Arts. Non-profit Studies Program Working Paper NP 05-03. Andrew Young School of Policy Studies, Georgia State University.
- Seaman B.A.** (2006). Empirical Studies of Demand for the Performing Arts. In: «*Handbook on the Economics of Art and Culture*» / Ginsburgh A., Throsby D. (eds.). Vol. I. Amsterdam: North-Holland.
- Throsby D., Withers G.** (1979). The Economics of the Performing Arts. N.Y.: St. Martins.
- West E.G.** (1985). Subsidizing the Performing Arts. Catharines: Ontario Economic Council.
- Withers G.** (1980). Unbalanced Growth and the Demand for the Performing Arts: An Econometric Analysis // *Southern Economic J.* Vol. 46. P. 735–742.
- Zieba M.** (2009). Full-Income and Price Elasticities of Demand for German Public Theatre // *J. of Cultural Econ.* Vol. 33(2). P. 85–108.

Поступила в редакцию 1 апреля 2012 года

Т.В. Абанкина
НИУ ВШЭ, Москва

Журнал НЭА
№2 (14), 2012
С. 138–141.

Многоканальное финансирование культуры и искусства: зарубежный опыт

В каждой стране на основе выбора финансовых методов, форм и механизмов складывается собственная модель многоканального финансирования сферы культуры и искусства. Она формируется в рамках национальной модели бюджетирования и определяется ее спецификой, в частности, степенью централизации или децентрализации государственного управления, характером бюджетных отношений между разными уровнями власти и бизнесом, социальной ориентацией и предпочитаемыми методами государственного регулирования экономики. Серьезное влияние на принципы и модель финансирования оказывают такие факторы, как сложившееся отношение государства к культуре и искусству, особенности государственной политики в этой сфере, уро-

вень развития благотворительности, спонсорства и меценатства.

В большинстве развитых европейских стран бюджетное финансирование остается одной из главных форм поддержки сферы культуры и искусства. Однако затраты на эти нужды в бюджетах стран составляют сравнительно небольшую часть их совокупных расходов – доля расходов на культуру и искусство колеблется по разным странам от 0,2 до 5%. В России доля расходов на культуру в консолидированном бюджете составляла в последние годы около 2,0–2,5%. В целом особенности странового распределения бюджетных расходов на культуру по различным уровням власти в значительной мере предопределяются степенью централизации государственного управления и сложивши-

мися национальными традициями. В централизованных унитарных государствах, например в Швеции, преобладающую роль продолжает играть центральный бюджет, тогда как в федеративной Германии (ФРГ) его экономические функции в основном ограничиваются сферой финансирования эфирного вещания и зарубежных культурных мероприятий.

Центральные бюджеты европейских стран поддерживают сферу культуры и искусства по нескольким каналам:

- в форме прямого финансирования;
- при помощи системы межбюджетных общих и целевых трансфертов субнациональным бюджетам;
- на основе совместного участия в финансировании органов власти разного уровня;
- через независимые посреднические структуры;
- с использованием механизмов партнерства на основе смешанного государственно-частного финансирования.

Прямое финансирование организаций культуры имеет место во всех странах, но наиболее широко оно распространено в европейских унитарных государствах, где можно встретить его следующие основные формы:

- полное финансирование текущих издержек и капиталовложений;
- специальные целевые трансферты;
- гранты организациям культуры;
- индивидуальные гранты.

Прямое полное финансирование расходов и капиталовложений – одна из старейших форм государственной поддержки сферы культуры. В настоящее время она применяется в немногих странах и только в отношении отдельных организаций культуры (например, национальных музеев, архивов, библиотек, эфирного вещания).

Специальные целевые трансферты обычно используются в рамках национальных программ развития культуры. Так, во Франции осуществляется программа перестройки и модернизации коммерческих отраслей культуры, нацеленная на финансовое оздоровление организаций культуры, развитие их предпринимательской деятельности, качественное обновление технической базы и выпускаемой продукции. В рамках бюджета Министерства культуры была создана специальная «бюджетная линия», обеспечившая субсидирование следующих отраслей культуры: производства короткометражных фильмов, цирков, изобразительного искусства, промышленного дизайна, танцевального искусства, фотографии.

Более распространенной формой прямой государственной поддержки являются гранты, предоставляемые как организациям, так и отдельным работникам культуры на условиях, существенно различающихся по странам. Многообразие грантов характерно для шведской системы финансирования сферы культуры. Организации культуры пользуются в Швеции следующими видами грантов:

- договорной грант, размер которого определяется соглашением между государственным органом и организацией культуры, заключаемым на год;
- грант, устанавливаемый по результатам труда (по нормам субсидирования на единицу готового продукта и услуги);
- грант, связанный с нормативными издержками производства, называемый базисным или формульным. Этот грант рассчитывается как определенная доля (обычно 55%) нормативных затрат на заработную плату, которые утверждаются для каждой категории организаций (театров, оркестров, региональных музеев и библиотек). Грант не имеет отношения к фактическим расходам организаций на оплату труда и численности их штатов, которые определяются ими самостоятельно. Он гарантирует лишь некий уровень занятости в отраслях культуры в данном регионе.

Во многих странах широкое распространение получили гранты, содержащие условия встречного финансирования. В Европе этот механизм впервые начал применяться в Великобритании, а затем и в странах континентальной Европы. Задачей подобных грантов является не только улучшение финансового положения организаций культуры, но и содействие их адаптации к рыночной среде. Они побуждают их внедрять корпоративные методы управления, стимулируют повышать уровень самообеспечения за счет развития коммерческой деятельности, а также привлекать негосударственные финансовые источники. Например, в Великобритании действует специальная программа поддержки организаций культуры, по которой они получают грант в размере от 5 тыс. до 250 тыс. ф. ст. при условии встречного финансирования 1 : 2.

В условиях финансового кризиса сфера культуры субсидируется также в рамках более широких социально-экономических программ, финансируемых совместно из центральных и территориальных бюджетов (программы регионального развития, повышения занятости, помощи малому бизнесу, реконструкции городской хозяйственной инфраструктуры,

профессионального обучения и переподготовки кадров), а также на основе совместного финансирования отдельных организаций культуры и инвестиционных проектов. Во Франции в целях организации совместного финансирования сферы культуры ежегодно заключаются трехсторонние контракты (центр – регионы – территории). Финансирование сферы культуры на основе партнерского участия государства и корпоративных спонсоров становится в Европе в условиях кризиса все более заметной формой субсидирования, что способствует значительному притоку средств из частного сектора.

Во многих странах наряду с бюджетным финансированием получило распространение государственное финансирование из внебюджетных фондов, формирование которых оправдывалось «особыми потребностями» отраслей культуры в финансовых средствах и «национальными интересами». Традиционным источником таких фондов (например, в Финляндии, Норвегии и Ирландии) стали поступления от национальных лотерей, лото, спортивных тотализаторов. Средства фондов использовались для финансирования не только культуры, но и спорта. Киноискусство было одной из первых отраслей культуры, для финансирования которой стали создаваться специальные фонды. Ресурсы фондов формировались за счет поступлений из центрального бюджета, а также налогов на радио- и телевизионные компании, кинопрокат и из других специальных налогов.

В рамках модели многоканального финансирования культуры и искусства большое значение в европейских странах отводится специфическим налоговым и другим парафискальным источникам финансирования. Наряду с обычными налогами для сферы культуры характерны также специфические формы обложения, обусловленные особенностями формирования доходов в этой сфере. Одним из таких специфических налогов, применяемым повсеместно, является лицензионная плата за радио и телевидение. Поступления от сбора такого налога в первую очередь направляются на развитие самих организаций эфирного вещания. Но в некоторых странах, например в Австрии, в дополнение к обычной лицензионной плате введена надбавка, называемая «культуршиллинг», поступления от которой используются для субсидирования «живого» искусства и культуры. Эти средства обеспечивают финансирование 15% совокупных государственных расходов Австрии на искусство и 25% – на культуру. В ряде стран (Франции и странах Северной Европы) применяется такой специфический налог, как отчисление 1% стоимости строительства госу-

дарственных учреждений на приобретение произведений изобразительного искусства.

В зарубежных странах сфера культуры и искусства традиционно пользовалась значительными налоговыми преференциями, что было связано со спецификой творческого труда и особой общественной значимостью создаваемого им продукта. Налоговые методы финансирования культуры стали еще шире применяться, когда резкое ухудшение состояния бюджетов в большинстве стран привело к определенной переориентации их государственной политики от прямых к косвенным инструментам регулирования экономики. Система налоговых льгот обычно распространяется как на отдельных работников и производителей товаров и услуг, так и на финансовых «доноров» культуры. В ее задачи входит прежде всего стимулирование роста производства и обеспечение разнообразия товаров и услуг культурного назначения, поддержание стабильных цен в сфере культуры в соответствии с социальной и культурной политикой и содействие притоку в нее негосударственных финансовых ресурсов.

С развитием коммерческой деятельности организаций культуры все более заметную роль в их финансировании стал играть банковский кредит. Государство содействует в получении банковских ссуд, предоставляя организациям культуры гарантии по кредитам. В Европе киноиндустрия традиционно пользовалась государственными гарантиями по кредитам, предоставляемыми национальными фондами кино. Кроме того, во Франции, Италии, Германии были созданы государственные структуры, предоставляющие гарантии по кредитам различным коммерческим отраслям культуры. Во Франции эту задачу выполняет Институт финансирования кино и отраслей культуры, образованный государственными и частными банками, в Великобритании – Национальный фонд развития, кредитующий производство фильмов.

Итак, анализ зарубежного опыта многоканального финансирования культуры и искусства позволяет сделать ряд выводов.

1. В каждой стране формируется своя модель многоканального финансирования сферы культуры и искусства, адекватная ее национальной системе бюджетного устройства, принципам распределения полномочий между уровнями власти и традициям государственной и частной поддержки этой сферы. В то же время всем странам присущ единый подход к культуре как к фактору не только духовного, но и экономического прогресса общества. При всем многообразии ее отраслей и различий их экономического положения сфера культуры и искусства рассматривается как единый важ-

ный сектор национальной экономики, развитие которого требует от государства комплексного подхода. Формирование цельной концепции государственного регулирования и поддержки этой сферы является необходимой предпосылкой обеспечения эффективной национальной политики в данной области.

2. В мире накоплен значительный арсенал инструментов финансовой поддержки отраслей культуры и искусства. Выбор видов, форм и методов частно-государственного субсидирования, а также их сочетание зависят от характера избранной модели многоканального финансирования, а также от приоритетов и задач текущей культурной политики.

3. Создание благоприятных условий для развития творчества предполагает определенную защищенность от прямого вмешательства управленческого аппарата. Это достигается путем формирования обширной независимой

сети посредников, состоящей из различных профессиональных ассоциаций, фондов, общественных институтов, которые самостоятельно решают вопросы распределения средств, выделенных государством и бизнесом на развитие культуры.

4. Развитие многоканального финансирования, партнерских межбюджетных и государственно-частных форм финансирования – лучший способ удовлетворения постоянно растущих потребностей сферы культуры и искусства в финансовых ресурсах, особенно в условиях хронического дефицита государственного бюджета, наступившего в период финансового кризиса. Успешность государственных мер поддержки сферы культуры и искусства во многом зависит от эффективности использования потенциала частного спонсорства и меценатства.

Поступила в редакцию 22 февраля 2012 года

Е.А. Хаунина

ФГБНИУ «Государственный институт искусствознания», Москва

«Процентная филантропия» – дополнительный финансовый ресурс для организаций социально-культурной сферы

Журнал НЭА
№2 (14), 2012
С. 141–143.

В большинстве европейских стран в последние два десятилетия применяются разнообразные экономические инструменты поддержки культуры: совершенствуются механизмы налоговой политики¹, развиваются дополнительные источники финансирования (поступления от лотерей и азартных игр, доходных отраслей культуры, специальных налогов и т.п.). Российская система налогообложения предусматривает ограниченный набор мер и стимулов для поддержания и развития культуры и искусства. Несмотря на то что в 2006 г. был принят ФЗ № 275 «О порядке формирования и использования целевого капитала некоммерческих организаций», в целом за последнее десятилетие нормативно-правовое обеспечение внебюджетных источников финансирования культуры в России не претерпело существенных положительных изменений, так как отсутствуют преференции для благотворителей и действенные механизмы инвестиций в культуру. В мире же развитие институциональной инфраструктуры благотворительной деятельности идет по пути

возникновения новых форм, которые позволяют привлечь к донорству значительное число физических лиц (Мерсиянова, Якобсон, 2010).

В связи с этим особый интерес представляет выявление определенной части общественных доходов, которые могут быть направлены как государственному, так и некоммерческому сектору культуры, например, путем механизма выделения доли налоговых средств граждан. Данный подход реализуется в модели «процентной филантропии» (percentage philanthropy), основанной на так называемом принципе «налогового назначения». Законодательство предоставляет налогоплательщику право самостоятельно или путем подачи заявления в налоговые органы перечислять часть уплачиваемой суммы (обычно от 0,5 до 2%) налога на доходы физических лиц в пользу какой-либо бюджетной или некоммерческой организации, имеющей право на получение такого рода пожертвований (Проблемы налогообложения некоммерческих организаций в России, 2007). При этом налоговая

¹ В настоящее время во Франции установлено 13 видов специальных налогов в области культуры и около 40 льгот для разных видов культурной деятельности.

нагрузка на налогоплательщика не уменьшается, а всю процедуру перевода средств выполняют налоговые органы.

Такая практика получила распространение в Венгрии, Литве, Польше, Румынии, Словакии и Италии. В 1996 г. Венгрия стала первой страной, которая внедрила модель «процентной» филантропии, за ней последовала Словакия в 2002 г., затем Польша ввела 1%-ную систему, а Литва в 2004 г. ввела 2%-ный налог. В Румынии законопроект «об 1%» вступил в силу с 2005 г.

В Венгрии был принят специальный закон (Act CXXVI of 1996, 2006), наделивший физические лица правом требовать от налогового органа перечислять 1% суммы их налога на доходы физических лиц, уплаченного в прошлом налоговом периоде, указанным ими бюджетным или некоммерческим организациям, в том числе и в сфере культуры. Налогоплательщики могут сделать соответствующие отчисления при заполнении налоговой декларации, поставив отметку в специальном приложении. Налоговые органы перечисляют выделенные суммы после того, как получатель доказывает свою правомочность, а отправитель при этом остается анонимным.

В Литве налоговое законодательство позволяет гражданам направлять 2% суммы уплаченного подоходного налога бюджетным или некоммерческим организациям, при этом существующая процедура отчислений не ограничивает число получателей. Особенность практики «процентной филантропии» в Словакии заключается в том, что она разрешена как для физических лиц, так и для юридических лиц в размере 2% суммы налога, уплаченного в предыдущем налоговом периоде. До 2007 г. в Польше налогоплательщики должны были самостоятельно перечислить 1% своего налога через банк или почтовые отделения. Действующее законодательство упростило процедуру для граждан, возложив эту обязанность на налоговые органы.

С 2006 г. налоговое законодательство (Act CXXVI of 1996, 2006) Италии также позволяет гражданам самим выбирать, на какие общественно полезные цели отчислять 0,5% суммы их налога на доходы физических лиц. Среди возможных направлений поддержки: НКО социальной направленности, университеты, организации культуры и др. Данная модель² позволяет налогоплательщику

выбрать конкретное учреждение культуры, которое соответствует установленным критериям (Financing the Arts, 2006, p. 33–34).

Остановимся лишь на некоторых основных вопросах, которые могут возникнуть, если будет принято принципиальное решение о внедрении института «процентной филантропии» в налоговую систему России. Следует отметить, что налог на доходы физических лиц (НДФЛ) играет значительную роль в формировании доходов бюджетов всех уровней³. В связи с этим наверняка потребуются решить вопрос о методе исчисления вводимого процента налога. Подходы могут быть следующими: для получения данных отчислений устанавливается дополнительный процент к действующей ставке 13% или сумма отчислений образуется путем вычета 1% из существующей налоговой ставки. В первом случае увеличение ставки НДФЛ будет способствовать привлечению новых источников финансирования социально-культурного сектора, не требуя каких-либо государственных затрат, но за счет дополнительного обременения налогоплательщиков. При этом общественная оценка увеличения налогового бремени скорее всего будет негативной. Второй вариант, действующий в перечисленных выше странах, может вызвать негативное отношение на государственном уровне, но в данном случае процентные отчисления физических лиц можно рассматривать как одну из форм косвенной поддержки третьего сектора (Кнац, Сборников, Тисленко, 2010).

Опыт стран Центральной и Восточной Европы свидетельствует о том, что лишь часть налогоплательщиков пользуется своим правом перечисления процента налога в пользу конкретной организации-получателя⁴. В таком случае можно создать специальный фонд, который будет формироваться за счет средств налогоплательщиков, не выбравших конкретную организацию. Распределение денежных средств из такого фонда можно организовать на условиях предоставления грантов и иных форм поддержки.

Следующий важный аспект – определение направлений и конкретных организаций, в пользу которых возможно перечислять доли налоговых поступлений. Как отмечают специалисты, в этом случае «стоит говорить о системном определении таких организаций, т.е. список организаций, из которого частное

² В основе западноевропейской модели (Италия, Испания) отчислений с подоходного налога был заложен принцип финансовой поддержки католической церкви и в значительно меньшей степени – социально-культурных нужд.

³ В 2011 г. поступления от НДФЛ в структуре КБ РФ составили 21%, или 1995,81 млрд руб.

⁴ В Венгрии лишь 35% всех налогоплательщиков используют эту возможность.

лицо может выбрать адресата, должен определяться централизованно и быть ограниченным» (Кнац, Соборников, Тисленко, 2010). При этом выбор конкретной организации (или нескольких организаций) должен лежать непосредственно на налогоплательщике. Применение в России модели «процентной филантропии» должно основываться на условии добровольного отчисления процентов дохода, что позволит сохранить основные принципы осуществления благотворительной деятельности в соответствии с гражданским и налоговым законодательством.

Необходимо решить, какой орган будет уполномочен определять соответствие той или иной организации социально ориентированным признакам, а также вести реестр указанных организаций, вносить в него соответствующие изменения. Данная проблематика связана с введением в России понятия «социально ориентированные НКО»⁵ и определением общественно полезной деятельности. Среди допустимых видов деятельности социально ориентированных НКО также обозначена деятельность в области культуры.

Модель «процентной филантропии» помогает решить три важные задачи: во-первых, она предоставляет гражданам право участвовать в администрировании части своего налога, во-вторых, постепенно увеличивает ресурсы организаций социально-культурной сферы и, в-третьих, развивает культуру благотворительности среди налогоплательщиков. Несмотря на перечисленные позитивные аспекты, надо учитывать, что функционирование данного механизма связано и с рядом потенциальных проблем, например на начальном этапе – с высокими расходами на администрирование отчислений наряду с небольшими объемами поступлений на поддержку самих организаций-получателей и т.п.

В заключение отметим, что «процентная филантропия» не заменяет других форм пожертвований и не останавливает их развитие. Благотворительная деятельность приобретает еще одну форму, которая при правильно выстроенной системе будет поддерживать деятельность организаций социально-культурного сектора в России. В связи с этим необходимо исследовать возможность введения института «процентной филантропии» в России с учетом необходимых законодательных и иных институциональных изменений.

Литература

- Кнац Ю., Соборников И., Тисленко Д.** (2010). «Процентная филантропия»: о возможности введения в России налога на содержание некоммерческих организаций. [Электронный ресурс]. Режим доступа: http://tmbv.info/index.php?option=com_content&view=article&id=7323:l-r-&catid=331:2010-08-03-08-28-12&Itemid=400, свободный. Загл. с экрана. Яз. рус. (дата обращения: апрель 2012 г.).
- Мерсиянова И., Якобсон Л.** (2010). Потенциал и пути развития филантропии в России. М.: Издательский дом ГУ ВШЭ.
- Проблемы налогообложения (2007). Проблемы налогообложения некоммерческих организаций в России. Научные труды № 108Р / Рук. авт. кол. С. Синельников-Мурылев, И. Трунин. М.: ИЭПП.
- Программа поддержки (2011). Программа поддержки социально ориентированных НКО Министерством экономического развития РФ. [Электронный ресурс] Министерство экономического развития Российской Федерации. Социально ориентированные некоммерческие организации. Режим доступа: <http://www.economy.gov.ru/minrec/activity/sections/socorientnoncomorg/index>, свободный. Загл. с экрана. Яз. рус. (дата обращения: апрель 2012 г.).
- Act CXXVI of 1996 (2006). [Электронный ресурс] On the Use of a Specified Amount of Personal Income Tax in Accordance with the Taxpayer's Instruction. Legge 27 December 2006. N 296. Режим доступа: <http://www.ecnl.org/index.php?part=13materials&datasent=1&topic=120&category=&keyword=> свободный. Загл. с экрана. Яз. англ. (дата обращения: апрель 2012 г.).
- Financing the Arts (2006). Financing the Arts and Culture in the European Union: Brussels, European Parliament. [Электронный ресурс] Режим доступа: http://www.culturalpolicies.net/web/files/134/en/Financing_the_Arts_and_Culture_in_the_EU.pdf, свободный. Загл. с экрана. Яз. англ. (дата обращения: март 2012 г.).
- Поступила в редакцию 27 марта 2012 года*

⁵ ФЗ от 05.04.2010 г. № 40-ФЗ «О внесении изменений в отдельные законодательные акты Российской Федерации по вопросу поддержки социально ориентированных некоммерческих организаций».

В.Ю. Музычук

ИЭ РАН, Москва

Перспективы развития культуры в России в свете Стратегии-2020 и проекта Федерального закона «О культуре в Российской Федерации»

14 марта 2012 г. была представлена окончательная версия обновленной Стратегии социально-экономического развития страны до 2020 г. «Стратегия-2020: Новая модель роста – новая социальная политика» (Стратегия-2020, 2012), подготовленная экспертным сообществом во главе с НИУ ВШЭ и РАНХиГС. Как известно, Стратегия-2020 призвана заменить «Концепцию социально-экономического развития Российской Федерации на период до 2020 г.» (Концепция-2020, 2008), принятую Правительством РФ в конце 2008 г. в самом начале мирового финансового кризиса.

В Стратегии-2020 декларируется, что «задача восстановления и закрепления сравнительных преимуществ в области образования и культуры является первоочередной для стратегии развития России как с позиции обеспечения экономического роста, так и для устойчивости социальной политики» (Стратегия-2020, 2012, с. 5). Однако в отличие от своей предшественницы в ней отсутствует как таковой раздел, посвященный перспективам развития сферы культуры и искусства в России до 2020 г. В почти 900-страничном документе, определяющем главный вектор социально-экономического развития страны до 2020 г., упоминание о культуре сведено к минимуму.

В Стратегии-2020 говорится, что «новая социальная политика должна полнее учитывать интересы тех слоев общества, которые способны реализовать потенциал инновационного развития. <...> С культурной точки зрения это люди с высшим образованием, относящиеся к креативному классу (по меньшей мере потенциально)» (Стратегия-2020, 2012, с. 4). Однако развитие креативности в представленном документе ассоциируется исключительно с инновационным мышлением и предпринимательскими способностями, абстрагируясь от важнейшей роли культуры в творческом процессе, лежащем в основе креативности.

Перспективы развития культуры сводятся лишь к «реструктуризации прямых бюджетных расходов на культуру, кинематогра-

фию и СМИ» (пункт *е*) в рамках «обеспечения устойчивости федерального бюджета». Объем финансирования культуры и кинематографии представляет собой статичную величину на протяжении всего временного диапазона действия Стратегии-2020 в размере 0,6% ВВП, причем не в расходах консолидированного бюджета РФ, а в расходах бюджета «расширенного Правительства» (Стратегия-2020, 2012, с. 135). Для сравнения: в Концепции-2020 (п. 3.5) предполагалось, что «реализация инновационного варианта развития экономики приведет к увеличению расходов бюджетной системы на культуру, кинематографию и СМИ с 0,7 (в 2007 г.) до 1,5% ВВП (в 2020 г.) (Концепция-2020, 2008, с. 64).

Между тем нельзя не признать, что ознакомление с текстом Стратегии-2020 расставило точки над «i» в отношении перспектив развития отечественной культуры, заложенных в законопроекте № 617570-5 «О культуре в Российской Федерации» (далее по тексту – Законопроект). 21 октября 2011 г. он был внесен на рассмотрение в Госдуму РФ¹, призванный заменить закон Российской Федерации от 09.10.1992 № 3612-1 «Основы законодательства Российской Федерации о культуре» (далее по тексту – Основы законодательства о культуре)².

Стилистика Законопроекта целиком и полностью отвечает сложившейся в настоящее время практике рамочного законодательства, когда в процессе унификации законодательства все законы разрабатываются по одному и тому же шаблону, при котором тонкости юриспруденции превалируют над содержательной стороной закона.

Более того, процедура внесения Законопроекта в Государственную думу продолжает порочную практику рассмотрения и последующего утверждения законов без подготовленного пакета подзаконных актов. Практика отечественного законодательства не раз демонстрировала, как принятые подзаконные акты напрочь перечеркивали дух и букву основного закона.

¹ Законопроект подготовлен совместно с комитетом по культуре Госдумы РФ под председательством Г.П. Ивлиева и Российским институтом культурологии под руководством К.Э. Разлогова.

² Следует отметить, что Законопроект не проходил процедуру широкого общественного обсуждения, в том числе на специально отведенном для этого интернет-портале, как это было в случае с законопроектами «О полиции» и «Об образовании».

Несмотря на то, что, по мнению разработчиков, Основы законодательства о культуре от 1992 г. устарели и не отвечают современным реалиям, *формулировки основных понятий и содержательных статей в основном заимствованы из старого закона*. При детальном ознакомлении с текстом Законопроекта *не покидает острое ощущение пустоты и выхолащивания его основного содержания*.

Нельзя не отметить, что при подготовке Законопроекта разработчики учли ряд требований профессионального сообщества. Среди несомненных достоинств законопроекта – *возможность бесплатного получения второго высшего образования в сфере культуры и искусства (п. 2 ст. 43), введение конкурсной основы для получения среднего профессионального образования творческой направленности (п. 2 ст. 43)*.

Одним из безусловных достоинств Законопроекта является попытка реанимировать важнейшую норму старого закона о том, что *«основой реализации государственных гарантий сохранения и развития культуры в Российской Федерации является бюджетное финансирование сферы культуры»* (п. 2 ст. 49). Правда, эта норма Законопроекта не подкреплена в дальнейшем никакими конкретными обязательствами государства.

Законопроект поражает обилием нечетких, обтекаемых формулировок, которые позволят в будущем трактовать диаметрально противоположно одни и те же нормы закона. Речь, в частности, идет о ст. 11, определяющей гарантии государства на право «пользования организациями культуры и доступа к культурным ценностям», в соответствии с которой органы государственной власти Российской Федерации *«инвестируют средства и (или) создают условия для инвестирования средств»*. Подобные обтекаемые формулировки применяются в отношении важнейших государственных решений в сфере культуры: создания организаций культуры, развития инфраструктуры сферы культуры (подп. 2 п. 2 ст. 11); развития информационных и коммуникационных технологий в сфере культуры (подп. 1 п. 2 ст. 11); создания баз данных по культурному наследию и текущей культурной деятельности (подп. 10 п. 2 ст. 11). Наличие подобных формулировок в Законопроекте чревато тем, что финансовые обязательства государства могут быть низведены лишь до уровня «создания условий для инвестирования средств».

Примечательно, что «развитие информационных и коммуникационных технологий в сфере культуры, особенно телевидения и Сети интернет» имеет, по всей видимости, более приоритетное значение

(подп. 1 п. 2 ст. 11), чем создание организаций культуры и развитие инфраструктуры сферы культуры (подп. 2 п. 2 ст. 11). Это находит подтверждение в тексте Стратегии-2020.

Обращает на себя внимание и тот факт, что в представленном Законопроекте *расходы на культуру по-прежнему не являются защищенной статьей бюджета*. Законопроект ограничивается казенными формулировками: «Расходные обязательства Российской Федерации, субъектов Российской Федерации и муниципальных образований в сфере культуры определяются в соответствии с бюджетным законодательством Российской Федерации» (п. 2 ст. 49). О масштабах бюджетного финансирования, предусмотренных Законопроектом, можно судить по следующей законодательной норме: «Расходы федерального бюджета на культуру ежегодно устанавливаются федеральным законом о федеральном бюджете на очередной финансовый год *на основе норматива минимальной бюджетной обеспеченности этих расходов*, устанавливаемого Правительством Российской Федерации» (п. 3 ст. 49). По аналогии устанавливаются нормативы минимальной бюджетной обеспеченности расходов на культуру в субъектах РФ (п. 4 ст. 49). Пункты 3 и 4 ст. 49 могут стать «ахиллесовой пятой» нового закона о культуре, так как установление нормативов минимальной бюджетной обеспеченности расходов на культуру авторитарным решением чиновников без процедуры широкого общественного обсуждения способно «свести на нет» все позитивные стороны Законопроекта. Причем, что понимается под нормативом минимальной бюджетной обеспеченности расходов на культуру, в Законопроекте не раскрывается.

Вызывает серьезные опасения декларируемое в Законопроекте *введение минимальных социальных стандартов в сфере культуры*: «В Российской Федерации устанавливаются государственные минимальные стандарты в сфере культуры – единые на всей территории Российской Федерации требования к объему и качеству предоставления определенного вида бесплатных услуг в сфере культуры гражданам Российской Федерации *на минимально допустимом уровне* для обеспечения реализации установленных в Конституции Российской Федерации отдельных социальных гарантий и прав граждан в сфере культуры, финансируемых из бюджетов всех уровней бюджетной системы Российской Федерации» (п. 3 ст. 11). Если введение минимальных социальных стандартов в образовании пусть и с трудом, но поддается логическому объяснению, то этого нельзя сказать в отношении минималь-

ных социальных стандартов в сфере культуры в условиях деградации культурного уровня общества, ухудшения условий доступности культурных ценностей для широких слоев населения.

Признание исключительной роли творческого работника в культурной деятельности не нашло отражения в тексте Законопроекта. Перечень государственных гарантий творческим работникам предельно лаконичен: «Федеральные органы государственной власти, органы власти субъектов Российской Федерации, а также органы местного самоуправления в рамках своей компетенции *вправе* предоставлять индивидуальные гранты; учреждать именные премии за особые достижения в сфере культуры; устанавливать надбавки к должностным окладам творческих работников; устанавливать повышенные тарифные ставки специалистам государственных организаций культуры, в том числе работающим в сельской местности; осуществлять иные меры государственной поддержки» (ст. 25). Настораживает рекомендательный характер государственных гарантий, чреватый необязательностью их выполнения³.

Следует отметить, что Законопроект демонстрирует свою изолированность от общей канвы законодательных новаций последнего времени. Речь, в частности, идет о таких понятиях, как *начальное профессиональное образование и послевузовское профессиональное образование в сфере культуры и искусства* (п. 2 ст. 12), которые как класс отсутствуют в проекте нового закона «Об образовании в Российской Федерации» в связи с упразднением этих звеньев в отечественной системе образования⁴.

Следует отметить, что утверждение законопроекта № 617570-5 «О культуре в Российской Федерации» запускает механизм принятия огромного массива подзаконных актов, что создает большие возможности для произвола чиновников в одной из ключевых сфер общественного устройства.

Если разработчики Законопроекта анонсировали его как совершенно новый закон о культуре, то на поверку оказывается,

что он представляет собой далеко не лучшую компиляцию законодательных норм из разных редакций все тех же, по их мнению, устаревших Основ законодательства РФ о культуре от 1992 г.

Финансовые обязательства государства в лице норматива минимальных расходов бюджета в свете представленной Стратегии-2020 закрепляют за культурой как «ресурсом инновационного развития» пресловутый остаточный принцип ее финансирования.

Для привлечения дополнительных источников финансирования сферы культуры в Законопроекте должна быть четко зафиксирована политика налогового протекционизма в сфере культуры, прописаны конкретные механизмы ее реализации.

Законопроект должен содержать реальные государственные гарантии работникам сферы культуры и искусства, предварительно одобренные профессиональным сообществом.

В целом складывается впечатление, что основной посыл представленного в Госдуму РФ проекта федерального закона «О культуре в Российской Федерации» сводится лишь к одному: «Можно все, но... за свой счет!».

Литература

Стратегия-2020 (2012). Итоговый доклад о результатах экспертной работы по актуальным проблемам социально-экономической стратегии России на период до 2020 года «Стратегия-2020: Новая модель роста – новая социальная политика». [Электронный документ] Режим доступа: <http://2020strategy.ru/documents/32710234.html>, свободный. Загл. с экрана. Яз. рус. (дата обращения: апрель 2012 г.)

Концепция-2020 (2008). Концепция долгосрочного социально-экономического развития Российской Федерации на период до 2020 года. [Электронный документ] Режим доступа: <http://www.ifar.ru/ofdocs/rus/rus006.pdf>, свободный. Загл. с экрана. Яз. рус. (дата обращения: апрель 2012 г.)

Поступила в редакцию 29 апреля 2012 года

³ Как известно, ФЗ о монетизации льгот существенным образом урезал государственные гарантии творческим работникам в Основах законодательства РФ о культуре. В представленном Законопроекте нет ни намека на возврат этих важнейших аннулированных государственных гарантий работникам сферы культуры.

⁴ Проект Федерального закона «Об образовании в Российской Федерации».

С.Н. Горюшкина

Министерство культуры Московской области

О некоторых аспектах культурных потребностей населения России

В настоящее время благодаря новым системам коммуникации происходит проникновение разных культурных образцов и моделей, культурных практик и стилей в повседневный жизненный обиход. Молодежь является наиболее активной социальной группой, потребляющей услуги в сфере досуга, она также более восприимчива к новым культурным форматам. Рассмотрим основные тенденции формирования культурных потребностей молодежи на основе анализа эмпирических исследований, проведенных Центром социологических исследований РАГС¹.

Данные опроса выявили тот факт, что интересы молодежи в сфере культуры концентрируются на зрелищно-развлекательных формах, таких, как кино и современная поп-музыка, причем интересы молодых людей определяются уровнем их образования, наличием свободного времени и уровнем развития культурной инфраструктуры. Так, не посещают профессиональный театр более половины (53,7%) респондентов. В то время как 28,6% сельской молодежи в возрасте 15–17 лет и 31,8% в возрасте 18–19 лет еженедельно посещают дискотеки и клубы. Однако городская молодежь такого же возраста ходит в клубы значительно реже (еженедельно посещают клубы и дискотеки 11,0% горожан 15–17 лет и 9,6% 18–19 лет) (Результаты, 2010, с. 36–49). В целом на основе материалов опроса можно высказать предположение, что учреждения культуры не являются для молодежи России популярным местом проведения свободного времени. Традиционные формы обслуживания населения зачастую уже не соответствуют реальным запросам молодежи, а «набор стандартных услуг, из которого формируется “предложение”, как правило, имеет два крайних полюса выражения: рынок “высокого и значимого” в противовес “развлекательному и зрелищному”» (Астафьева, 2010, с. 27).

В целях выявления культурных предпочтений «развлекательного и зрелищного»

обратимся к статистике динамики билетного рынка. По оценке компании «Экспресс-Обзор», в 2008 г. размер билетного рынка России (кинотеатры, театры, мюзиклы и концерты) в стоимостном выражении показал значительный рост – более 37% в рублях и более 40% – в долларах. Посетителями культурно-зрелищных мероприятий стали 155 млн человек (Билетный рынок, 2011), музеев – 80,8 млн человек (РСЕ, 2010, с. 76), а число читателей библиотек составило 54,316 млн человек (Культура России, 2010, с. 194).

По данным ВЦИОМа, каждый пятый россиянин никогда не был в театре. Каждый второй россиянин (48% опрошенных) сообщил, что «когда-то» был в театре, но не посещал его довольно долго. Основной причиной, по которой наши соотечественники не ходят в театры, является отсутствие театра рядом с местом проживания. На отсутствие свободного времени сослались 17% опрошенных. Театр вообще не интересует 16% участников опроса. На дороговизну билетов пожаловались 14% респондентов, а 4% предпочитают смотреть театральные постановки по телевизору. И еще 4% респондентов ответили, что не ходят на спектакли потому, что у них в городе нет хороших театров².

На основании этих данных можно предположить, что на формирование интереса к театральному искусству в значительной степени влияют такие социальные факторы, как географическая и ценовая доступность. Мнение об отсутствии хороших театров и предпочтение телевизионного репертуара пусть косвенно, но свидетельствует о недостаточно высоком качестве театрального продукта, а также о низком качестве театрального маркетинга.

Рассмотрим данные ВЦИОМа о посещении музеев. Более половины россиян (53%) последний раз были в музее несколько лет назад. Каждый пятый (20%) сообщает, что вообще никогда не был в музее. Те, кто никогда

¹ См. результаты выборочного социологического опроса молодежи «Культурные потребности молодежи в контексте современных социокультурных изменений», который был проведен в конце 2009 г. Единичей наблюдения в массовом социологическом опросе являлись респонденты, представляющие население Российской Федерации в возрасте от 15 до 29 лет включительно. Выборочная совокупность опрошенных отражает долю молодежи, проживающей в центрах субъектов РФ, в средних, малых городах и сельских населенных пунктах. Объем выборочной совокупности – 1050 человек (Результаты, 2010, с. 36–49).

² По данным ВЦИОМа. В опросе приняли участие 1600 человек в 153 населенных пунктах в 46 областях, краях и республиках России (Каждый пятый россиянин, 2008).

не был в музее, чаще встречаются среди селян (28%), пожилых (28%) и неквалифицированных рабочих (32%). Заметно возросла и доля тех, кто отметил, что «нет желания ходить в музей», – с 26 (в 2008 г.) до 35%³. Если совместить результаты опроса ВЦИОМа с результатами социологического исследования, проведенного Музеями Кремля (Пахомова, 2009), то можно говорить об их идентичности, а значит, и об объективности полученных результатов.

Проанализируем роль библиотек в формировании культурных потребностей населения. По данным ВЦИОМа, каждый второй респондент сообщил, что последний раз был в библиотеке несколько лет назад (50%). Чаще это жители столиц (60%), мужчины (52%), россияне с начальным и средним специальным образованием (53 и 54% соответственно). Между тем 15% наших сограждан никогда не были в библиотеке. Отсутствие времени – главная причина, по которой наши сограждане редко или практически никогда не бывают в библиотеках (39%). Заявили о том, что не любят читать, 17%. В качестве других аргументов участники опроса приводят неудовлетворенность библиотечными фондами, отсутствие в них интересной литературы, а также наличие домашней библиотеки (по 9%), использование более современных источников информации (например, интернета) или отсутствие библиотеки в месте проживания (по 7%)⁴. Таким образом, очевидно, что современное состояние библиотечного обслуживания не удовлетворяет потребностям пользователей в источниках информации, находящихся в библиотеках. Существенными факторами являются проблема физической доступности и отсутствие современных форм продвижения библиотечных услуг.

Следует отметить, что тенденция снижения интереса к библиотеке не соответствует мировой практике. Так, в Америке, к примеру, в библиотеки записано 68% населения, и наблюдается тенденция увеличения интереса к чтению, что можно проследить на примере статистики отдельных публичных библиотек в США. Заметно вырос интерес к чтению во Франции. Книга составляет половину (51%) развлекательных покупок, намного больше, чем DVD и видеофильмы (20%), а также музыкальные CD (15%) и видеоплееры (14%)⁵. Неуклонно растет число читателей в библио-

теках Финляндии и Китая (Инькова, Пурник, 2008). Мировая тенденция в целом свидетельствует о том, что в современном мире библиотека является востребованным социальным институтом, для развития которого используются современные архитектурные и дизайнерские решения, информационно-коммуникационные технологии, инновационные формы работы.

В России вопрос изучения культурных потребностей населения образует проблемную зону, поскольку инициативные исследования ВЦИОМа и других институтов отличаются фрагментарностью по времени и выборке культурных зон и слоев населения.

Анализ раздела «Проведение НИОКР в сфере культуры» ФЦП «Культура России (2001–2005 гг.)», «Культура России (2006–2011 гг.)» свидетельствует о том, что социологические исследования касались только изучения влияния отрасли на развитие общества в контексте рыночных отношений. Однако они, как и исследования социологических институтов, не имели масштабного и системного характера. О системном мониторинге тенденций запросов населения можно говорить только в части, касающейся книгоиздания и чтения (исследования Роспечати), а также посещения кинотеатров. Исследования этих сегментов потребительского спроса обусловлено прежде всего необходимостью регулирования рыночных процессов.

Вместе с тем на уровне субъектов Российской Федерации наблюдается интерес к исследованию тенденций культурных потребностей населения. Активная и многоплановая работа ведется в этом отношении в Иркутской (Окладникова, Рубцова, 2008) и Свердловской областях (Вишневский, Шапко, 2005), Красноярском крае (Бутова, 2004). Большое внимание уделяется изучению досуговых предпочтений жителей села в Белгородской области, Алтайском и Ставропольском краях, в Чувашской Республике. Вопросы этнокультурности изучаются в Ставропольском крае, Республике Мордовия, Республике Карелия (Досуговые предпочтения, 2004). Но это, скорее, исключение из правил, которое все так же характеризуется фрагментарностью выборки по времени и культурным сегментам.

Показатели государственного статистического наблюдения со всей очевидно-

³ По данным ВЦИОМа (<http://wciom.ru/index.php?id=1#>).

⁴ По данным ВЦИОМа. Инициативный всероссийский опрос проведен 23–24 мая 2009 г. Опрошено 1600 человек в 140 населенных пунктах в 42 областях, краях и республиках России. Статистическая погрешность, как сообщает пресс-служба ВЦИОМа, не превышает 3,4% (http://rnd.cnews.ru/liberal_arts/news/line/index).

⁵ См. материалы сайта <http://www.bienvenue.ru/>.

стью говорят, что государственные институты направляют свои усилия прежде всего на поддержку инфраструктуры, которая призвана выполнять функции сохранения и распространения культурных ценностей. Поэтому индикаторы наблюдения и связаны с количеством сети, ее материальными и финансовыми характеристиками. А доля потребительских характеристик в общем объеме показателей деятельности учреждений культуры незначительна и составляет в среднем 10–20% исходной информации.

В свою очередь, потребительские характеристики связаны в основном с охватом (читатели, зрители, посетители мероприятий), который учитывается опять же с целью определения эффективности использования материальных и финансовых ресурсов собственника и учредителя (наполняемость залов, число пользователей). Важной проблемой является и то, что потребительские характеристики результатов деятельности государственной и муниципальной сети учреждений культуры не оказывают влияния на ее финансовые результаты. Ввиду того, что условием финансирования всегда была сетевая единица, она и остается основным объектом статистического наблюдения, в котором показатель посещений иллюстрировал объем затрат на потребительскую единицу. Важно и то, что объем и структура сети «привязаны» к демографическим показателям для создания инфраструктуры, но не связаны с культурными запросами населения.

Не уделяя должного внимания анализу тенденций рынка услуг культуры, думается, что невозможно создать базовую основу для выработки стратегий развития, соответствующих запросам современного общества знаний. В то время как системное изучение культурных потребностей способно оказать положительное влияние на решение задач государственного регулирования культурных процессов, обеспечение опережающего развития перспективных тенденций, соответствующих направленности реформ, позволит максимально обеспечить сохранение традиций и сбалансировать интересы различных культурных сообществ.

Литература

Астафьева О.Н. (2010). Культурные потребности современной молодежи: смена приоритетов. В сб.: «Культурные потребности молодежи: динамика в условиях социокультурных изменений». Материалы научно-методологического семинара «Культура и культурная политика». Вып. 8. М.: РАГС. С. 27.

Билетный рынок России 2004–2010 гг. (кино, театры, концерты, мюзиклы). Режим доступа: [Электронный ресурс] Режим доступа: <http://marketing.rbc.ru/research/56294997667-1508.shtml>, свободный. Загл. с экрана. Яз. рус. (дата обращения: апрель 2012 г.).

Бутова Т.Г. (2004). Маркетинговые технологии формирования и реализации культурной политики муниципальных органов власти // *Вестник Красноярского гос. ун-та. Серия «Гуманитарные науки»*. № 6. С. 96–101.

Вишневский Ю.Р., Шапко В.Т. (2005). Культурные запросы населения и оптимизация управления деятельностью учреждений культуры. Информационно-аналитические материалы социологического исследования. Свердловская область, лето-осень 2003 г. М.: ИМХО.

Досуговые предпочтения населения (2004). Досуговые предпочтения населения: региональная практика. Сборник материалов ГРДНТ. М.: ИМХО.

Инькова Л.М., Пурник А.В. (2008). Знакомимся с публичными библиотеками Финляндии. [Электронный ресурс] Режим доступа: <http://vmo.rgub.ru/foreign/review/finland.php>, свободный. Загл. с экрана. Яз. рус. (дата обращения: апрель 2012 г.).

Каждый пятый россиянин (2008). Каждый пятый россиянин никогда не был в театре. [Электронный ресурс] Режим доступа: <http://lenta.ru/news/2008/04/15/theatre/>, свободный. Загл. с экрана. Яз. рус. (дата обращения: апрель 2012 г.).

Культура России (2010). Информационно-аналитический сборник. 2010 год. М.: ФГУП «ГИВЦ Минкультуры России».

Окладникова А.В., Рубцова Н.В. (2008). Исследование востребованности театральных услуг молодежной аудиторией // *Маркетинг в России и за рубежом*. № 3 (65). С. 8–20.

Пахомова Е.И. (2009). Музеи Кремля: ожидания посетителей и информационные услуги музеев // *Мониторинг общественного мнения*. № 4. Режим доступа: [http://wciom.ru/fileadmin/Monitoring/92/2009_4\(92\)_11_Pahomova.pdf](http://wciom.ru/fileadmin/Monitoring/92/2009_4(92)_11_Pahomova.pdf), свободный. Загл. с экрана. Яз. рус. (дата обращения: апрель 2012 г.).

Результаты выборочного социологического опроса (2010). Результаты выборочного социологического опроса молодежи «Культурные потребности молодежи в контексте современных социокультурных изменений» // *Социология культуры*. № 1. С. 36–49.

РСЕ (2010). Российский статистический ежегодник. 2010: Статистический сборник. М.: Росстат.

Поступила в редакцию 11 мая 2012 года

М.И. Жабский

Государственный институт искусствознания, Москва

Конкурентоспособность российского кинематографа¹

О дефиците конкурентоспособности отечественного кино сегодня не говорит разве что только ленивый. Какова, однако, количественная картина дефицита в динамике и статике? Как выглядит кинематографическая Россия в этом отношении на фоне Европы и нет ли у нее возможности существенно повысить свою конкурентоспособность?

До недавнего времени отечественное кино в принятом на Западе организационно-экономическом смысле индустрией не являлось. Соответственно оно не было готово к успешному функционированию в условиях открытого мирового рынка. При всем том по воле исторических судеб российское кино в начале 1990-х годов на собственной территории оказалось один на один с зарубежными киноиндустриями. Последствия не заставили себя ждать. Тотчас обнаружился огромный дефицит его конкурентоспособности, вызвавший цепную деструктивную реакцию в других звеньях кинопроцесса.

Положение стало выправляться в «нулевые» годы. Если в 2002–2003 гг. доля российского кино в суммарных кассовых сборах за год составляла соответственно 6,1 и 4,8% (Киностатистика, 2008, с. 16), то в 2004–2005 гг. – уже 13,4 и 29,5%. Это были годы прорыва отечественного кино к зрителю. Закрепить успех, однако, не удалось. Напротив, началась полоса постепенного снижения конкурентоспособности – снижение кассовых сборов с 29,5 (в 2005 г.) до 25,5 (в 2008 г.) (Киностатистика, 2009, с. 35) и 21,5% (в 2009 г.) (Динамика основных показателей, 2012). Далее последовали их резкое снижение (15,3% в 2010 г.) и легкий всплеск (16,3% в 2011 г.). Россияне принесли в кинокассу в 2011 г. более 1,2 млрд долл. США, из них только 193 млн долл. – на показ отечественных картин. Особого оптимизма на будущее статистика, как видим, не внушает.

Вряд ли добавит оптимизма и попытка в поиске истины сравнить статистические показатели России и стран Европы (табл. 1), где примерно в каждой второй стране доля национального кино на внутреннем рынке ниже 15,1%, а в каждой третьей – не превышает 5%. Лишь одна страна, Турция, удерживает за собой половину кинотеатрального

рынка. Несколько стран довольствуются третьей-четвертой частью. Все европейские кинематографии, кроме турецкой, повержены конкурентной мощью Голливуда, а их зрительские аудитории обращены им в свою кинематографическую веру. Российское кино, доля которого на рынке в 2011 г. была чуть выше 15%, по конкурентоспособности выглядит одновременно и хуже и лучше многих других, что обычно бывает с середняками. Это гораздо меньше того, чего можно было бы ожидать от российского кино в свете его истории.

Таблица 1

Годовая доля и число новых стопроцентно национальных фильмов (+ копродукция) на внутреннем рынке европейской страны

Страна	Доля на рынке, %		Число фильмов (2009 г.)
	2009 г.	2010 г.	
Турция	50,9	52,9	69
Франция	36,8	35,5	137 + 93 = 230
Чехия	25,6	34,8	21 + 12 = 33
Италия	24,4	32,0	101 + 32 = 133
Финляндия	15,0	27,0	12 + 8 = 20
Норвегия	20,6	23,2	–
Великобритания	16,7	22,6	71 + 22 = 93
Дания	17,29	22,0	14 + 14 = 28
Швеция	32,7	21,0	36
Германия	27,4	16,8	142 + 78 = 220
Нидерланды	17,4	15,8	27 + 11 = 38
Польша	21,5	12,9	31 + 11 = 42
Испания	15,4	12,2	134 + 51 = 186
Болгария	1,0	8,7	8 + 3 = 11
Греция	15,6	8,6	20 + 5 = 25
Латвия	4,3	6,9	4 + 2 = 6
Словения	1,8	6,3	3 + 1 = 4
Швейцария	3,5	5,4	–
Австрия	8,0	5,0	7 + 10 = 17
Венгрия	8,7	4,8	22 + 5 = 27
Литва	0,9	3,6	5 + 1 = 6
Словакия	12,4	2,8	1 + 12 = 13
Румыния	3,0	2,2	11 + 7 = 18
Эстония	2,0	2,0	2 + 4 = 6
Португалия	2,7	1,9	9 + 5 = 14
Ирландия	0,2	1,3	8 + 12 = 20
Хорватия	1,6	0,8	–

Источник: составлено автором по материалам из интернета.

¹ Подготовлено при финансовой поддержке Российского фонда фундаментальных исследований (проект 10–06–00015).

По данным на 2009 г. компанию середняков, к которой принадлежит Россия, составляли Германия, Чехия, Италия, Польша, Норвегия, Нидерланды, Дания, Великобритания и Испания. Табл. 2, составленная по материалам доступной нам статистики (Focus, 2010), показывает, что за каждой указанной в ней страной скрывается уникальное созвездие рамочных объективных и субъективных факторов конкурентоспособности. Объяснить или свести уровень конкурентоспособности к какому-то одному фактору невозможно. Относится это, в частности, к числу ежегодно создаваемых фильмов, возведенном в российской кинополитике в ранг главного условия успеха. Цифры, однако, опровергают распространенное представление о существовании некоего ключевого «конкурентоспособного объема». В качестве одного из факторов конкурентоспособности число фильмов играет определенную позитивную роль. Обращаясь к табл. 1, заметим в этой связи, что страны с долей на рынке свыше 15% сняли в 2009 г. 28–220 фильмов, а не преодолевшие эту 15%-ную планку – 4–27 фильмов.

Имеются, однако, и факты, говорящие о другом. Доля национальных фильмов на внутреннем рынке Германии и Чехии в 2009 г. была примерно одинаковая (соответственно 27,4 и 25,6%), а объемные показатели прямотаки несопоставимые: 220 против 33 фильмов

(табл. 2). Италия и Россия продемонстрировали одинаковый уровень конкурентоспособности (24,4 и 23,9%) при совершенно разных объемах производства (133 и 78 фильмов). То же самое можно сказать о Великобритании и Испании: доля национальных фильмов на рынке соответственно составляла 16,7 и 15,4%, а объем их производства – 93 и 186 фильмов. Напрашивается вывод, что присутствует и такой фактор, как *качество фильмов по критериям зрительского рынка*. Оно-то, как видим, и бьет их число. Требуется рациональный баланс обоих показателей.

Развитие национальной кинематографии зависит от емкости внутреннего кинорынка. Но и его влияние неоднозначно. Так, доля национальных фильмов в Великобритании и Дании на их внутренних рынках примерно одинаковая, хотя емкость кинорынка одной страны более чем в семь раз выше емкости другой (табл. 2).

Емкость национального кинорынка при всем том остается одним из факторов конкурентоспособности. Сравним в этом отношении страны с долей национальной кинопродукции выше и ниже 15,1% на внутреннем рынке. В первом случае, если исключить показатели Чехии как маргинальное одноразовое событие, емкость национального кинорынка заключается в интервале 155,5–1472 млн долл. США, во втором – в интервале 15,9–211 млн долл. США.

Таблица 2

Доля стопроцентно национальных фильмов и копродукции на кинотеатральном рынке европейских стран, равная 15,1–30%, и некоторые определяющие ее факторы (2009 г.)²

Страна	Доля национальных фильмов, %	Число национальных фильмов	Число национальных хитов	Число американских хитов	Бокс-офис, млн долл. США	Население, млн чел.	ВВП на 1 жителя, долл. США
Германия	27,4	220	4	15	1357	81,9	37307
Чехия	25,6	33	3	7	65,5	10,5	16684
Италия	24,4	133	7	14	940,1	59,8	33253
Россия	23,9	78	7	13	735,7	141,4	8230
Польша	21,5	42	2	8	218,1	38,1	10583
Норвегия	20,6	–	3	5	165,5	4,9	70644
Нидерланды	17,4	38	2	7	279,5	16,6	44259
Дания	17,29	28	3	6	192	5,5	52815
Великобритания	16,7	93	3	19	1472	61,2	32798
Испания	15,4	186	3	16	928,5	46,1	30251

² В Германии, Чехии, Италии, России, Великобритании и Испании число национальных и американских хитов рассчитано в пределах 20 самых кассовых картин. По остальным странам расчеты выполнены в пределах первой десятки фильмов.

Аналогичный вывод можно сделать и относительно роли еще двух факторов – численности населения страны и размера валового внутреннего продукта в расчете на одного жителя. Показательны следующие факты. Среди стран с долей национальных фильмов на рынке в пределах 15,1–30% Россия по численности населения оказалась на первом месте (141,4 млн чел.), а по «душевой» величине ВВП – на последнем (8230 долл. США). Норвегия, напротив, стоит на последнем месте по численности населения (4,9 млн чел.) и на первом – по показателю ВВП (70 644 долл. США). При этом в 2009 г. доля национальных фильмов на внутреннем рынке была весьма близкой.

Пример Турции, а также Индии, Японии или Южной Кореи показывает, что сегодняшний исход конкурентной борьбы российского кино на внутреннем рынке не фатален. Сравнение России с этими странами дает основание полагать, что даже 30%-ная доля национальной кинопродукции в общем объеме посещаемости и кассовых сборов – далеко не предел. Напротив, и этот цифровой показатель напоминает о необходимости уяснения и реализации латентно существующих возможностей повышения конкурентоспособности.

В сфере кинополитики России, располагающейся в Европе и Азии, необходимо оглядываться как на Запад, так и на Восток. И если искать истину путем такого двойного сравнения, то можно прийти к следующим выводам. Стремиться, например, к 51%-ной доле российских фильмов на внутреннем кинотеатральном рынке, возможно, слишком оптимистично. Но вот принципиально ограничиваться 15–25%, напротив, уж точно слишком пессимистично. Рациональная цель, как и сама Россия в географическом и культурном отношении, заключается где-то посередине. Это – примерно 40% внутреннего кинотеатрального рынка. Под целевую планку на такой высоте в ближайший период и должна выстраиваться практическая кинополитика во всем комплексе ее конкретных проявлений.

При соответствующем желании достичь столь высокую цель вполне реально. Россия – территория, где смыкаются и взаимно проникают в некоем синтетическом единстве культуры Запада и Востока. Поэтому герой американского кинозрелища, являющийся главным конкурентом европейских и российских фильмов, в качестве объекта идентификации и проекции для широкой массы россиян при прочих равных условиях менее привлекателен, чем для европейцев. Сказываются различия в ментальности и уровне инициативы у личности,

в соотношении пассивно-созерцательного и практически активного контакта с миром, в соотношении материальных и духовных ценностей, установок на целерациональное и ценностно-рациональное действие и т.д.

Большее культурное сопротивление потенциального российского зрителя является не последней причиной того, что доля национальных фильмов в общих кассовых сборах в славном 2005 г. была близка к лучшим показателям в Евросоюзе, чего, однако, нельзя считать о профессиональном уровне создаваемых картин. Значит, за то, что доля российского кино на рынке некогда составляла 29,5%, надо благодарить также зрителя, правда, не забывая, что его вкусы в значительной мере уже глобализованы и эта его реакция во многом обусловлена отечественными фильмами с американской физиономией («Ночной дозор», «Дневной дозор» и др.). В кинохозяйстве многое можно поправить, в частности, внося больше рациональности в кинопредпринимательство и государственную поддержку кинопроцесса в целом. Практическая кинополитика должна конструктивно строиться на знании *закономерностей* кинопроцесса. И не на келейно-бюрократическом, а на научном знании.

Мысль о том, что в кинопроцессе существуют закономерности, которые не видны без применения научной оптики, но их важно знать и использовать, уместно проиллюстрировать примером. Наши расчеты по материалам открытых источников показывают, что в кассовом выражении потенциала конкурентоспособности годовой массив российских фильмов выстраивается согласно *статистической закономерности*. Так, в 2011 г. фильмы из списка Топ-20 на 85% вмещали потенциал конкурентоспособности всех показанных за год российских фильмов. В свою очередь фильмы Топ-10 на 81% покрывали кассовые сборы по Топ-20, а фильмы Топ-5 – на 68% сборы по Топ-10, фильм Топ-1 («Высоцкий. Спасибо, что живой») – на 29% сборы Топ-5. И еще. Фильм Топ-1 имел большую кассу, чем остальные несколько десятков картин.

Обратимся теперь к статистике за 2010 г. Вся касса российского кино на 93% покрывалась сборами от фильмов Топ-20. Кассовые сборы по Топ-20 на 82% содержались в сборах Топ-10. Содержание кассы Топ-10 на 67% оказалось в кассе Топ 5, а кассы Топ-5 – на 27% в кассе фильма Топ-1.

В 2009 г. список Топ-20 обеспечивал 93% сборов всех российских фильмов. В кассе Топ-10 оказалось 83% кассы Топ-20, в Топ-5 – 68% кассы Топ-10, наконец, в Топ-1 – 24% сборов по списку Топ-5. Касса фильма Топ-1 оказалась

богаче суммарной кассы всех фильмов ниже Топ-20 (21,92 млн долл. против 12,427 млн долл.).

По итогам трех лет вырисовывается резюмирующая закономерность. На Топ-20 приходится 85–93% кассовых сборов всех российских фильмов за год, на Топ-10 – 81–83% кассы Топ-20, на Топ-5 – 67–68% кассы Топ-10, на Топ-1 – 24–29% кассы Топ-5. Сборы фильма Топ-1 превышают суммарные сборы примерно полсотни фильмов, оказавшихся за пределами Топ-20. В порядке верификации сформулированной закономерности риском утверждать, что обозначенные курсивом цифровые показатели – довольно точный прогноз будущих итогов 2012 г. Впрочем, время покажет.

Итак, по потенциалу конкурентоспособности массив российских фильмов, созданных за год, закономерно выстраивается в виде пирамиды. Если не фиксировать ее госбюджетными скрепами, она неизбежно рухнет. Большая ее часть рассыплется. Направляется оправдательная ссылка: российское кино – сверхрискованный бизнес. Однако просчитывались ли риски при создании основной массы фильмов, которые оказались под вершиной пирамиды? Из года в год мы находим здесь одну и ту же удручающую картину. Не потому ли, что для многих продюсеров главная проблема риска состоит в том, удается ли им, получив безвозмездную бюджетную помощь, кормиться за счет производства, а не проката фильма?

Даровое конкурентное преимущество и конкурентоспособность на рынке – реалии трудно совместимые. Вот мы и имеем то, что имеем. И это – свидетельство еще одной закономерности, которую важно держать в уме. Поскольку в силу объективной необходимости она приводится в действие за счет денег налогоплательщиков, то делать это надо непременно с оглядкой на неизбежные негативные последствия. Имеется в виду применение рационального комплекса мер их нейтрализации.

Литература

- Киностатистика-2007 (2008). Ежегодник о киноотрасли России. М.: МАКС Пресс.
- Киностатистика-2008 (2009). Ежегодник о киноотрасли России. М.: Роликс.
- Динамика основных показателей сборов 2008–2011 годов [Электронный ресурс] // *Бюллетень кинопрокатчика*. (2012). № 1–2. С. 37. Режим доступа: <http://www.kinometro.ru/doc/pdf/bulletin66-67.pdf>, свободный. Загл. с экрана. Яз. рус., (дата обращения: апрель 2012 г.).
- Focus (2010). World Film Market Trends. Strasbourg, France: European Audiovisual Observatory, 2010. [Электронный ресурс] Режим доступа: http://www.obs.coe.int/online_publication/reports/focus2010.pdf, свободный. Загл. с экрана. Яз. англ. (дата обращения – 20 октября 2011 г.).
- Поступила в редакцию 13 апреля 2012 года*

М.Л. Магидович

РГПУ им. А.И. Герцена, Санкт-Петербург

Петербургские филармонические традиции сквозь призму современных потребительских практик¹

Журнал НЭА
№2 (14), 2012
С. 153–158.

По прогнозам Томаса Хаманна (Университет Лихтенштейна), «без проведения активных, совместных с культуртрегерами мероприятий по образовательной и культурной политике спрос на концерты классической музыки в ближайшие тридцать лет упадет приблизительно на 36%» (Hamann, 2005, p. 10). Проблема падения интереса к концертам академической музыки, по утверждению директора Westchester Graduate Campus Университета Лонг-Айленд в Нью-Йорке Б. Колб, становится магистральной для орке-

стров Европы и Северной Америки (Колб, 2003). Процесс «старения» постоянной аудитории, лежащий, по мнению автора, в корне проблемы, отчетливо наблюдается и в России. Это подтверждают представленные ниже результаты эмпирического исследования социально-демографических характеристик, мнений и предпочтений слушателей Санкт-Петербургской академической филармонии им. Д.Д. Шостаковича². Сбор данных проводился в марте–июне 2011 г. на 15 концертах.

¹ Исследование и статья подготовлены при финансовой поддержке ЦФИ НИУ ВШЭ «Инновационные формы взаимодействия культурного наследия и творческих индустрий», ТЗ-56 (руководитель В.Э. Гордин).

² Руководитель – д.с.н. М.Л. Магидович, обработка данных проведена совместно с М.А. Ерофеевой и П.А. Петренко.

Целью первого этапа исследования стало описание публики Большого зала Санкт-Петербургской филармонии (далее – БЗФ) с точки зрения ее социальных черт: характера и форм потребления художественной культуры, музыкальных предпочтений, мотивации посещения филармонии, социально-демографических характеристик. Наличие в современном поле культуры многообразия организаций и форм культурного потребления приводит к их взаимовлиянию и взаимодействию (Ильин, 2011). Однако соединение инновации и традиции может не только способствовать наращиванию капитала поля, символическому и культурному взаимообогащению участвующих в культурном обмене субъектов, но и оказывать пагубное влияние на институты культурного наследия. Изменение способа потребления культурного наследия элиминирует саму его суть, заключающуюся в передаче от поколения к поколению форм культуры, созданных предшествующими поколениями и воспринимаемых в современном мире как нечто ценное и почитаемое. В то же время сознательное отмежевание институтов культурного наследия от инновационной деятельности творческих индустрий также может иметь негативные последствия, например процесс «старения» публики, регулярно посещающей концерты академической музыки и падение интереса к ней среди молодежи (Колб, 2003; Лебрехт, 2005; Namann, 2005). Следовательно, необходим поиск оптимальных путей взаимодействия культурного наследия и творческих индустрий.

Основная гипотеза заключалась в предположении, что большинство постоянных посетителей БЗФ ориентированы на традиционные формы потребления культурных продуктов. На первом этапе на основе проведения полуструктурированных интервью с публикой была создана информационная база эмпирических данных, описывающая посетителей БЗФ. Проведенные интервью были нацелены на получение как количественной (формализованное интервью), так и качественной (элементы стандартизированного «открытого» интервью) информации о социальных чертах слушателей. Для отбора информантов была использована случайная систематическая выборка. Посещение концертов разного плана и пространственное размещение интервьюеров в различных зонах (первые ряды, середина зала, задние ряды, боковые ряды, хоры, фойе, буфет, гардероб) обеспечивали репрезентативность выборки. По окончании опроса к обработке данных были допущены результаты интервью 249 посетителей, что составляет не менее 20% посетителей концерта БЗФ при

полном зале. По частоте посещения слушатели филармонии были дифференцированы на две категории: «постоянных» – посетивших БЗФ четыре раза и более в сезон, и всех остальных – «ситуативных». В результате из числа опрошенных было выявлено 89 постоянных и 160 ситуативных посетителей (рис. 1).

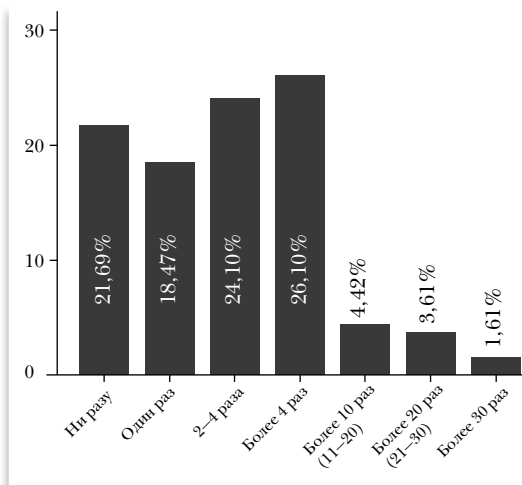


Рис. 1

Частота посещения концертов в сезон

Как показали результаты исследования, в целом аудитория Санкт-Петербургской академической филармонии обладает некоторыми схожими социально-демографическими характеристиками. Большинство постоянных и ситуативных слушателей Санкт-Петербургской филармонии сами не практиковались даже в любительском искусстве (63,22 и 63,75% соответственно), что нехарактерно для развитых стран, где наибольшую часть публики составляют сами деятели искусства – любители и профессионалы. Эту специфику отечественной публики можно объяснить заслугами и традициями советской системы общего образования, где в обязательную программу средней школы входила история академической музыки и ее прослушивание, а в СМИ планомерно велась активная просветительская деятельность в области музыкальной культуры (рис. 2, 3).

Для того чтобы определить, есть ли различия в характеристиках публики концертов, в которых участвуют известные исполнители, по признакам наличия опыта деятельности в сфере искусства, мы выделили наиболее однородную группу концертов с известными исполнителями. В нее вошли три фортепианных концерта со следующими солистами: Григорий

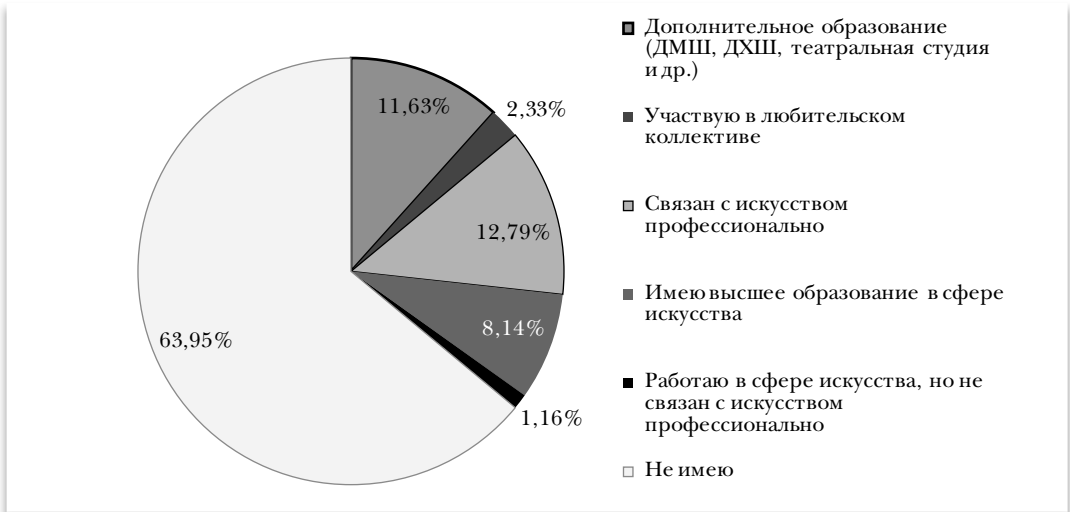


Рис. 2

Опыт деятельности в сфере искусства (постоянные посетители)



Рис. 3

Опыт деятельности в сфере искусства (ситуативные посетители)

Соколов, Андрей Коробейников, Юлианна Авдеева. Анализ показал, что если выступают известные исполнители, в зале присутствует больше слушателей, получивших художественное образование, и профессионалов (рис. 4).

Большинство постоянных и ситуативных слушателей имеют высшее образование (70,1% постоянных и 67,5% ситуативных), причем профили образования также в большей степени оказываются сходными. Соответственно среди постоянных и ситуативных слушателей чаще отмечалось техническое (34,8 и 28,3%) или гуманитарное (30,3 и 25,8%) образование.

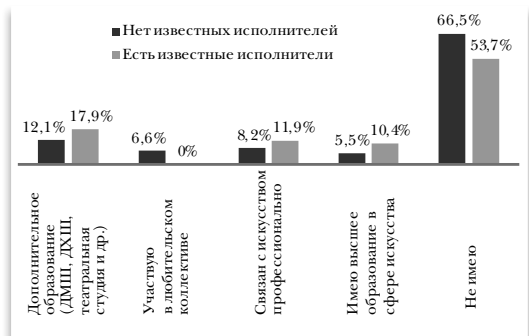


Рис. 4

Опыт деятельности в сфере искусства посетителей концертов с участием известных исполнителей

В области дохода между постоянными и ситуативными посетителями нет существенных различий: большинство из них имеют средний доход, однако при более детальном анализе стало ясно, что постоянные посетители обладают более низким доходом, чем остальные слушатели (рис. 5). Это подтверждается далее и данными занятости посетителей.

Самую многочисленную группу постоянных посетителей БЗФ из выделенных в категории «занятость» составили пенсионеры (41,7%). Вторую по величине группу образуют специали-

на втором месте отмечали любовь к академической музыке (20,6%), а на третьем – желание послушать любимых композиторов (17,7%) (рис. 6).

Различия в мотивации посещения филармонии, представленные на рис. 6, свидетельствуют о различных смыслах, которыми разные группы слушателей БЗФ наделяют посещение концертов. Для постоянных слушателей более значимыми оказываются мотивы, связанные с их диспозицией в пространстве поля искусства (любовь к академической музыке,

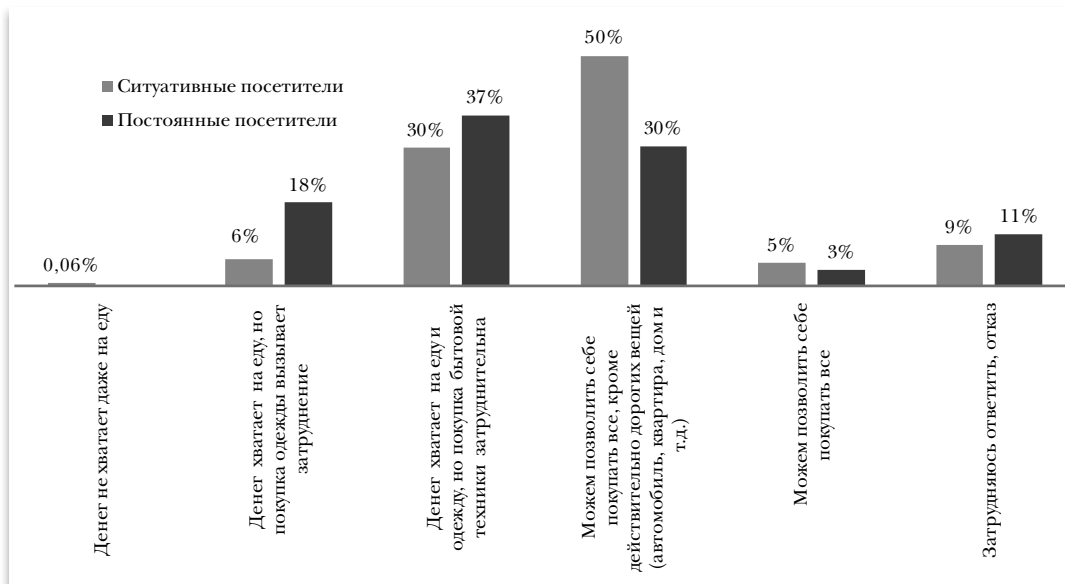


Рис. 5

Доход

сты, работающие по найму в области культуры, науки, образования и здравоохранения (26,7%). Среди ситуативных слушателей филармонии преобладают студенты (23,3%), далее значатся группы пенсионеров (18,5%) и работников по найму в области культуры, науки, образования и здравоохранения (также 18,5%).

Среди основных причин посещения Санкт-Петербургской филармонии слушатели чаще всего называли любовь к классической музыке (24,9%), желание послушать музыку любимых композиторов (18,5%) и возможность повысить свой культурный уровень (16%). Причем постоянные слушатели чаще других основным мотивом называли любовь к академической музыке (32,2%), желание послушать любимых композиторов (20,3%) и возможность улучшить настроение (14,4%). Ситуативные слушатели причиной посещения филармонии чаще всего называли желание повысить свой культурный уровень (21,3%),

желание послушать любимых композиторов и исполнителей), а также воспроизводство привычной культурной практики (привлекает атмосфера). Для ситуативных посетителей наибольшим значением обладают мотивы, связанные с желанием приблизиться к полю, присвоением символического капитала («неким знанием или, точнее, узнаванием или неузнаванием») (Бурдые, 2002), маркирующим статус (повысить свой культурный уровень). В целом решающими факторами при выборе концерта для респондентов чаще всего выступают: программа концерта (26,7%), имя исполнителя (25,7%) и совет друзей (12,9%). На доминирующую мотивацию посещения конкретного концерта значительно влияет участие известного исполнителя. Для выделенной группы концертов известных исполнителей решающим фактором при выборе оказалось имя исполнителя (41,8%), менее значимыми были программа концерта (24,1%) и советы друзей (13,4%). Для



Рис. 6

Мотивация посещения

остальных концертов имя исполнителя оказалось на третьем месте (14,3%), уступив советам друзей (19,2%) и программе концерта (25,3%).

Для проверки основной гипотезы исследования анализ полученных эмпирических данных проводился на основании значимости критерия возраста для релевантных переменных. На рис. 7 видно, что среди постоянных слушателей 79% находятся в возрастной группе от 41 года и старше, тогда как из ситуативных посетителей в эту возрастную группу попадают только 24% слушателей из общего числа опрошенных (41% ситуативных слушателей).

В отношении предпочитаемых принципов организации концертов академической музыки можно выделить три различные возрастные группы, несмотря на то, что большая часть представителей этих групп отдают предпочтение традиционным формам (63% всех опрошенных). Молодежь (16–28 лет) более лояльно относится к инновативности и креативности как формам организации концертов академической музыки, под которыми можно понимать манипуляции с пространством сцены и зала, варьирование времени проведения концерта и его длительности, использование средств мультимедиа, усиление теа-

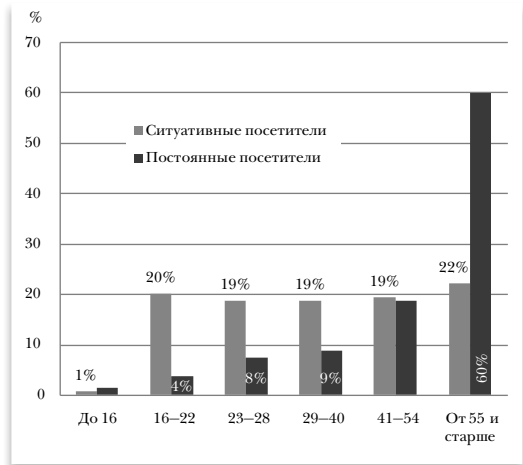


Рис. 7

Возраст

трализации и интерактивности во время концертного исполнения. В этой группе наиболее важные принципы организации концертов (традиционность, академические формы организации или инновация, креативность) распределяются практически одинаково (около 40% для обоих принципов). Уровень лояльности заметно уменьшается с возрастом (табл. 1).

Таблица 1

Наиболее важные принципы в организации концертов филармонии

Возрастные категории, лет	Традиционность, академические формы организации, %	Иновационность, креативность, %
16–22	43,8	40,6
23–28	42,4	36,4
29–40	61,6	17,6
41–54	79,1	11,6
Старше 55	75,0	5,0

Среди посетителей средней возрастной группы (29–54) и представителей пенсионного возраста (старше 55), составляющих большую часть постоянной аудитории филармонии, четко прослеживается склонность к классическим формам потребления академической музыки как части культурного насле-

дия, что подтверждает основную гипотезу исследования.

Литература

- Бурдые П.** (2002). Формы капитала // *Экономическая социология*. Т. 3. № 5.
- Ильин В.И.** (2011). Креативный консюмеризм как тренд современного потребления // *Журнал социологии и социальной антропологии*. Т. XIV. № 5 (58). С. 41–55.
- Колб Б.** (2003). Исследование аудитории Лондонского филармонического оркестра. [Электронный ресурс] // *Art-менеджер*. № 2(5). Режим доступа: <http://www.artmanager.ru/articles/howto/157-007.html>, свободный. Загл. с экрана. Яз. рус. (дата обращения: 03.10.2011 г.).
- Лебрехт Н.** (2005). Кто боится классической музыки? [Электронный ресурс] // *Русский журнал*. 19 апреля. Режим доступа: <http://old.russ.ru/perevod/20050419-pr.html>, свободный. Загл. с экрана. Яз. рус. (дата обращения: 03.10.2011 г.).
- Hamann Т.К.** (2005). Die Zukunft der Klassik // *das Orchester*. September. Seite 10. S.10–19. *Поступила в редакцию 16 апреля 2012 года*

А.Я. Рубинштейн
ИЭ РАН, Москва

Тенденции и закономерности потребления услуг организаций исполнительских искусств

Журнал НЭА
№2 (14), 2012
С. 158–164.

Уже почти полвека экономисты полагают знанием о «болезни цен», истоки которой кроются в феномене отставании производительности труда (Baumol, Bowen, 1966)¹. При этом кроме обсуждения различных вариаций излюбленного примера Баумоля о том, что в отличие от роста производительности в экономике производительность музыкантов, исполняющих квартет Бетховена, не меняется во времени, сам этот феномен не слишком часто становился объектом экономического анализа. Вместе с тем исследования показывают наличие в исполнительских искусствах ряда нетривиальных закономерностей (Рубинштейн, 2012). В связи с этим рассмотрим динамику

производительности труда в организациях исполнительского искусства (рис. 1). На этом графике можно заметить, что производительность труда в организациях исполнительского искусства не только отстает от роста средней производительности в экономике, но и имеет устойчивую понижательную тенденцию. Этот важный факт подтверждают расчеты и за более длительный период (табл. 1).

Данный факт можно проверить и на региональном уровне. Для этого достаточно воспользоваться 10%-ной выборкой из 80 регионов Российской Федерации, построенной на основе критерия относительной посещаемости театров на 1 тыс. жителей². В табл. 2 при-

¹ Отмечу, что в последнее десятилетие наблюдается явный ренессанс теории Баумоля, расширяются границы ее применения, включая и макроэкономические исследования (Neck, Getzner, 2007; Nordhaus, 2008; Pomp, Vujic, 2008; Fernandez, Palazuelo, 2012).

² При построении указанной выборки все регионы России, упорядоченные по числу посещений театров на 1 тыс. жителей, были разбиты на три группы (без Санкт-Петербурга и Москвы), представляющие низкий, средний и высокий уровни посещаемости театров. Четвертую группу составили регионы Санкт-Петербурга и Москвы. После этого из каждой группы были выбраны два региона со средними для данной группы характеристиками.

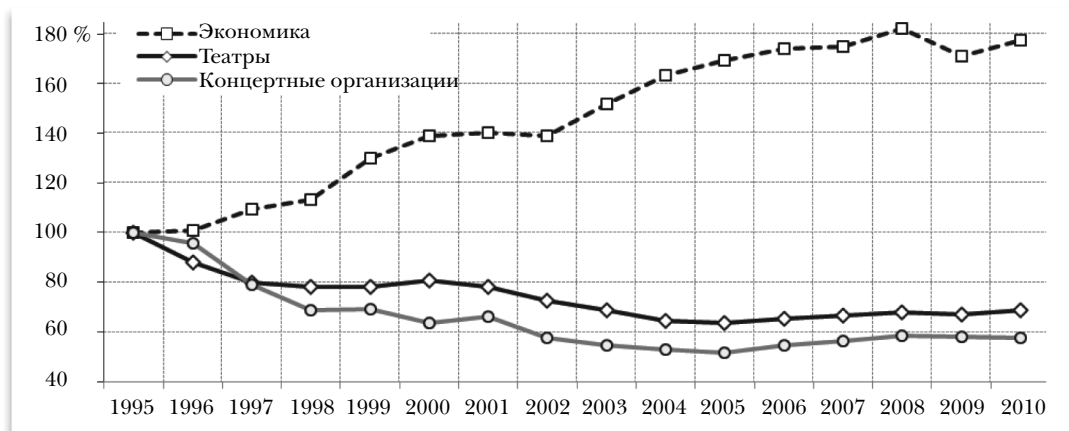


Рис. 1

Динамика производительности труда в театрах, концертных организациях и экономике (1995 г. = 100%)³

Таблица 1

Динамика производительности труда в исполнительских искусствах (среднегодовой темп прироста за период), %

Исполнительские искусства	Период	1971–1980	1981–1990	1991–2000	2001–2010	1971–1990	1991–2010	1971–2010
	Театры		-1,1	-2,1	-6,0	-1,5	-1,5	-3,3
Концертные организации		-3,4	-2,8	-7,8	-1,0	-2,6	-4,0	-2,3

Таблица 2

Некоторые характеристики регионов в 2010 г.

Выборка	Численность населения, тыс. чел.	Число театров	Производительность в театрах, посещений / чел.	Число посещений на 1 тыс. жителей
Краснодарский край	5161	5	333	87
Мурманская область	837	2	434	111
Курская область	1149	2	805	161
Хабаровский край	1400	5	350	213
Ярославская область	1306	5	464	221
Свердловская область	4394	17	442	248
Санкт-Петербург	4600	30	333	538
Москва	10563	90	305	566
Россия	141915	579	370	216

³ Для справки: производительность труда в организациях искусства была рассчитана в виде натурального показателя – число посещений за год в расчете на одного работника; производительность в экономике – объем ВВП (в ценах 1995 г.) в расчете на одного занятого в экономике.

ведены список выбранных регионов и их некоторые характеристики.

Графики на рис. 2–4 показывают, что снижение «театральной производительности» наблюдается во всех исследуемых регионах, кроме Курской области. Что же касается этой области, здесь наблюдается нетипичная для театральной России последних 20 лет ситуация: два театра данного региона, компенсируя неразвитость театральной сети и неудовлетворенный спрос населения, увеличили общее число спектаклей с 485 в 1995 г. до 725 в 2010 г. В целом можно утверждать (с точностью до репрезентативности выборки), что снижение производительности труда является общей тенденцией для российских театров (рис. 2–4).

Итак, мы сталкиваемся с фактом снижения производительности в исполнительских искусствах. Почему? Быть может, музыканты радикально «замедлили» исполнение квартета Бетховена или теперь они его играют впятером? Если оставить шутки в стороне, то в качестве объяснения этой сорокалетней тенденции выскажу несколько гипотез.

Одна из них состоит в том, что нисходящая динамика производительности труда в исполнительских искусствах обусловлена сокращением спроса на эти виды культурных благ, вызванным расширением возможностей проведения досуга в России и усиливающейся конкуренцией за свободное время и деньги населения. Распространение массовой куль-

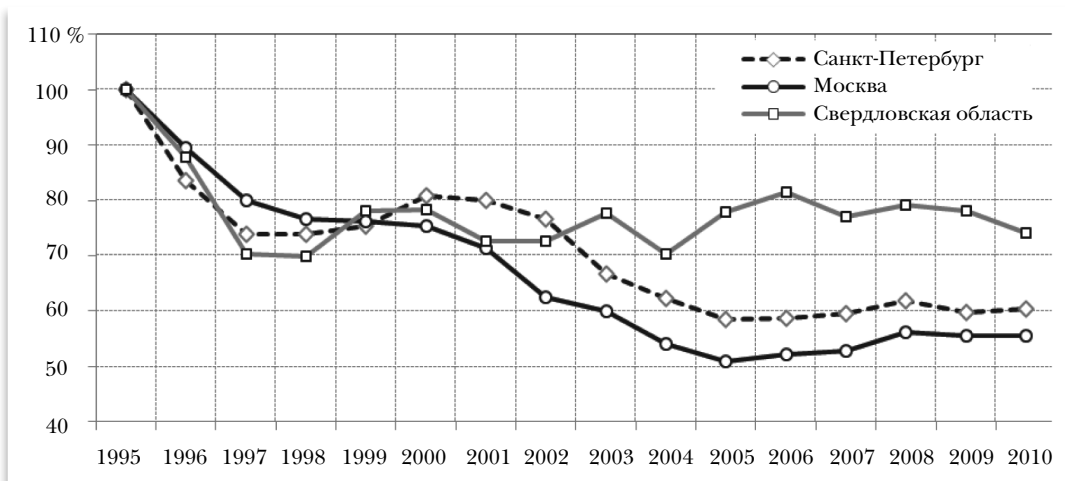


Рис. 2

Динамика производительности труда в театрах Санкт-Петербурга, Москвы и Свердловской области (1995 г. = 100%)

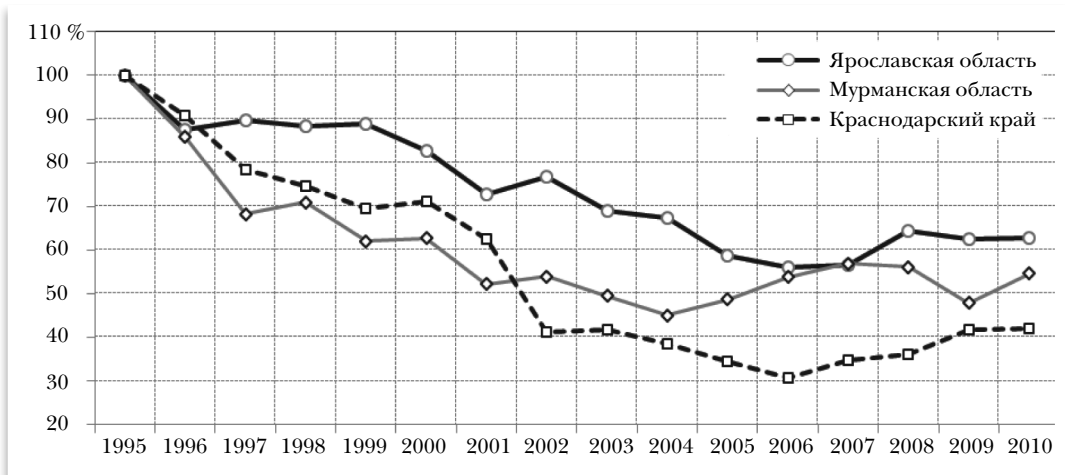


Рис. 3

Динамика производительности труда в театрах Ярославской, Мурманской областей и Краснодарского края (1995 г. = 100%)

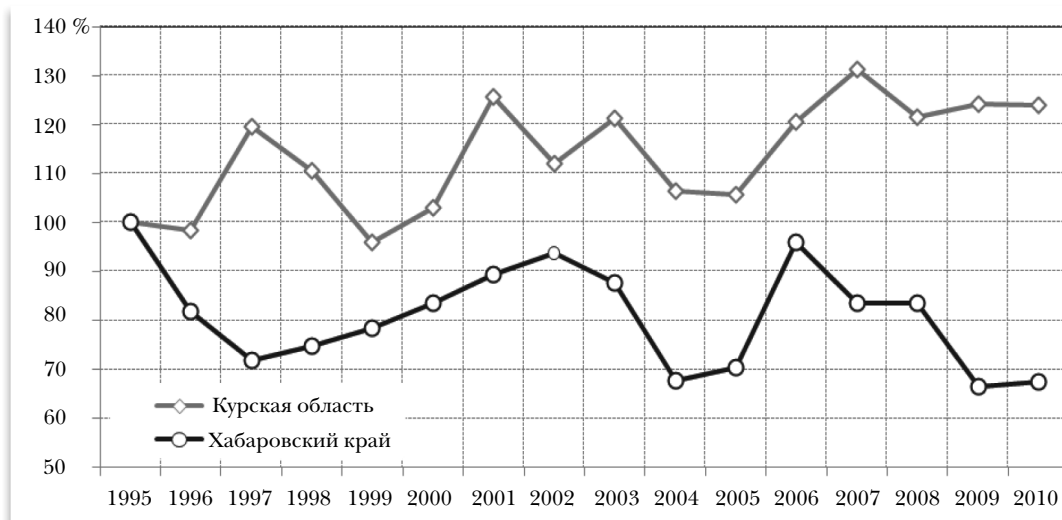


Рис. 4

Динамика производительности труда в театрах Курской области и Хабаровского края (1995 г. = 100%)

туры при одновременном росте домашних форм потребления искусства – развитие телевидения в 1970-е годы, аудио- и видеопроductов в 1980-е годы, компьютерных игр и интернета в конце XX и начале XXI столетия – представляет собой общую тенденцию, которая и определила снижающуюся динамику посещаемости спектаклей и филармонических концертов в России⁴. В подобном снижении уровня потребления живых видов искусства Россия, к моему личному сожалению, «догоняет» развитые страны Европы и Северной Америки.

Никак не оценивая данный факт, отмечу, что два «цивилизационных тренда» – процессы глобализации и ускоренного распространения компьютерных и информационно-коммуникационных технологий – принципиально трансформировали институциональную среду, изменив ценностные ориентации и нормы поведения в российском обществе, влияющие на художественные предпочтения и спрос на культурные блага. От того, сохранится ли эта тенденция в будущем, существенно зависят прогнозные оценки производительности труда в организациях искусства. Необходимо понять, в частности, достигнута ли уже нижняя граница посещаемости театров и концертных организаций, или это продолжающийся процесс, который наблюдается уже более сорока лет.

Без каких-то дополнительных соображений здесь не обойтись. Поэтому выскажу еще одну гипотезу. Думается, что действующие в предыдущие сорок лет процессы изменения

зрительского спроса под влиянием глобализационного тренда себя исчерпали или почти исчерпали. Можно ожидать, что в самой недалекой перспективе сформируется устойчивая структура зрительского спроса. Это предположение подтверждают и статистические данные (рис. 5). На графике видно, что начиная с 1995 г. наблюдаются определенный «слом» сорокалетней тенденции снижения посещаемости театров в России, ее трансформация в некий стационарный процесс с небольшими колебаниями вокруг отметки в 200 посещений на 1 тыс. жителей. Подобная ситуация наблюдается и в российских регионах (рис. 6–8).

Все это позволяет думать, что динамика посещаемости российских театров уже в самой ближайшей перспективе будет определяться влиянием других факторов. Сформулирую в связи с этим третью гипотезу, основанную на традиционных методах анализа спроса на культурные блага (Seaman, 2006; Автономов, 2011). Речь идет о гипотезе существования зависимости посещаемости театров от объема предложения театральных услуг, собственных цен на билеты и доходов населения, потребляющего культурные блага. Данную гипотезу можно проверить на основе эмпирических расчетов.

При ее проверке я воспользовался временными рядами в период 1996–2010 гг. При этом объем предложения и театральные цены представлены показателями числа спектаклей *Perf* и средней цены одного посещения *Price*. В качестве измерителей доходов населения были

⁴ Замечу, что социологи давно фиксируют в своих исследованиях снижение уровня потребления живых видов классического искусства (Театр как социологический феномен, 2009).

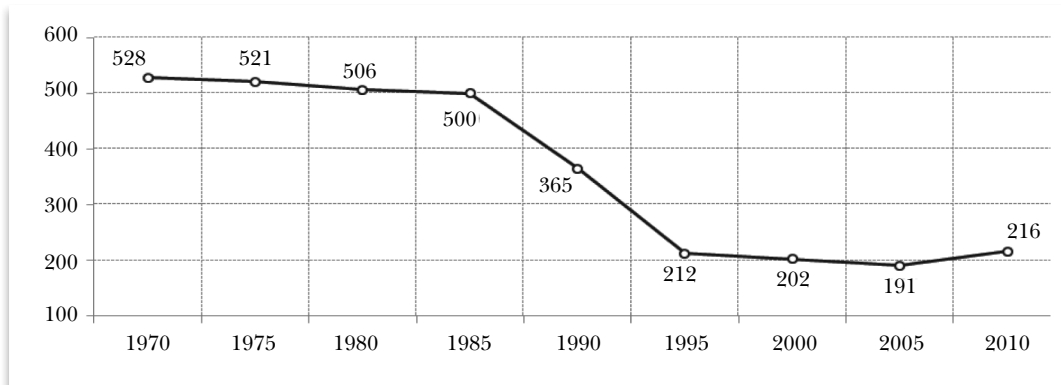


Рис. 5

Динамика посещаемости театров России (посещения на 1 тыс. человек)

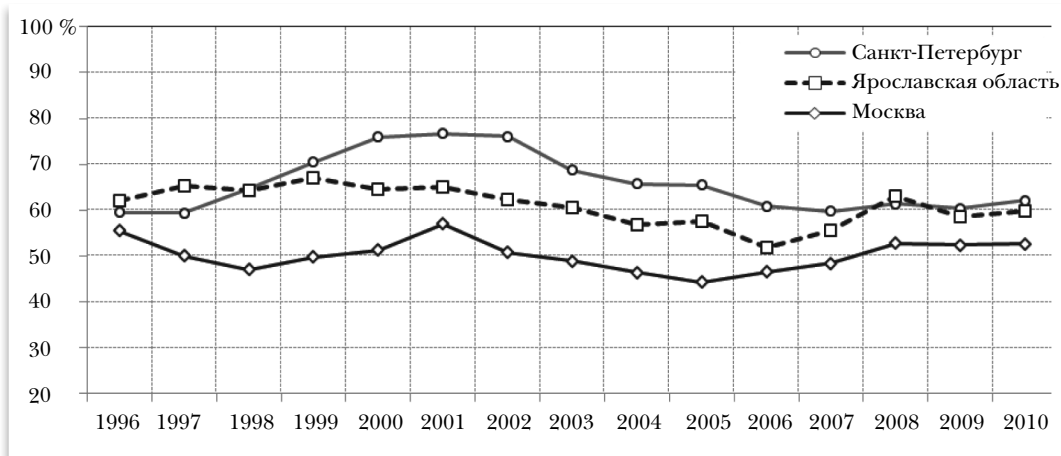


Рис. 6

Динамика посещаемости театров на 1000 жителей Санкт-Петербурга, Москвы и Ярославской области (1990 г. = 100%)

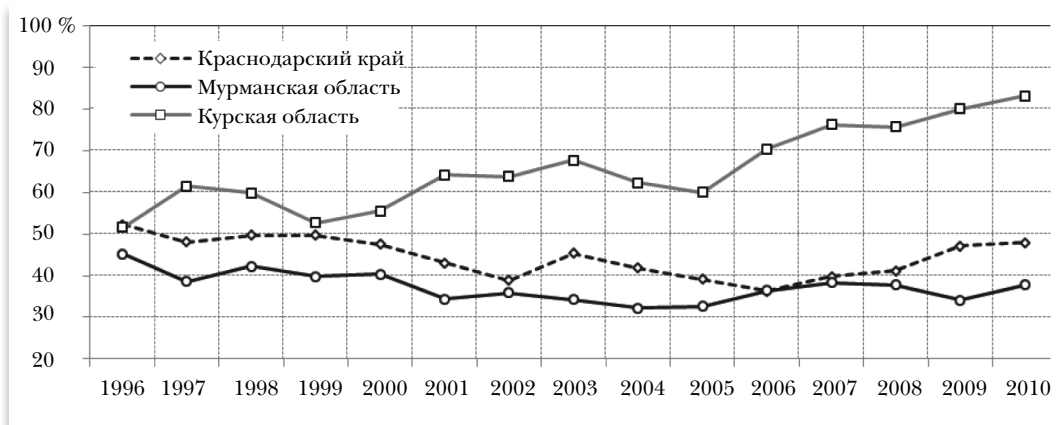


Рис. 7

Динамика посещаемости театров на 1000 жителей Краснодарского края, Мурманской области, Санкт-Петербурга, Москвы и Курской и Ярославской областей (1990 г. = 100%)

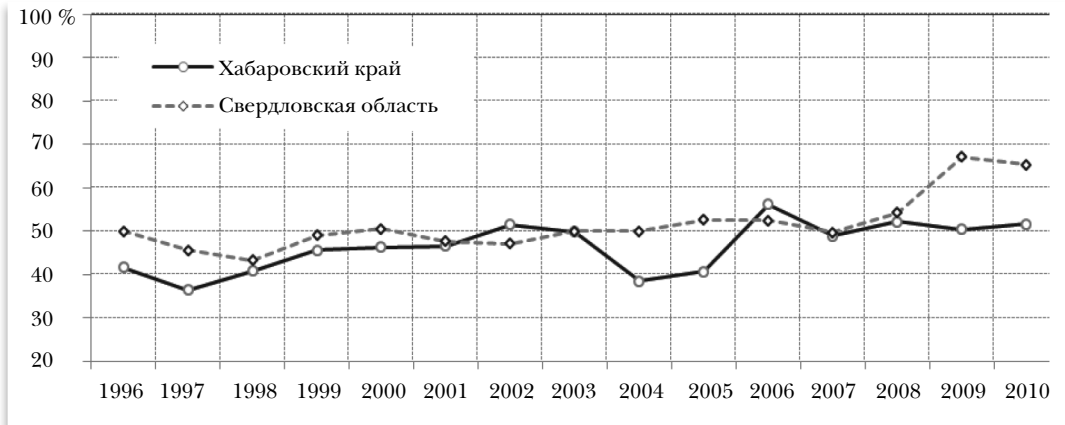


Рис. 8

Динамика посещаемости театров на 1000 жителей Хабаровского края и Свердловской области (1990 г. = 100%)

использованы два индикатора: *Salary* и *Sub*, характеризующие динамику номинальной среднемесячной заработной платы жителей региона и субсидий в текущих ценах на одного жителя региона, рассматриваемые в данной работе в качестве специфической формы их дохода⁵. По всем показателям были рассчитаны годовые темпы прироста, ставшие аргументами регрессионного уравнения, где в качестве зависимой переменной рассматривались годовые темпы прироста числа посещений театров Y^1 и их производительности труда Y^2 :

$$Y^1 = b^1_0 + b^1_1 Perf + b^1_2 Price + b^1_3 Salary + b^1_4 Sub + \xi^1,$$

$$Y^2 = b^2_0 + b^2_1 Perf + b^2_2 Price + b^2_3 Salary + b^2_4 Sub + \xi^2.$$

Оценка коэффициентов этого уравнения производилась на основе панельных данных совокупности 80 регионов Российской Федерации. Итоговые результаты эконометрических расчетов приведены в табл. 3.

Выполненные расчеты демонстрируют вполне ожидаемый результат – увеличение объема предложения театральных услуг способ-

Таблица 3

Оценки коэффициентов регрессионных зависимостей

Регрессоры	Число посещений, Y^1	Производительность труда, Y^2
Объем предложения – число спектаклей – <i>Perf</i>	0,813*** (0,022)	0,754*** (0,025)
Цена на билеты – средняя цена 1 посещения – <i>Price</i>	-0,197*** (0,013)	-0,156*** (0,015)
Номинальная заработная плата – <i>Salary</i>	0,137*** (0,028)	0,104*** (0,032)
Субсидия на 1 жителя – <i>Sub</i>	0,014** (0,007)	–
Свободный член	0,009 (0,008)	0,001 (0,009)
Число наблюдений	1198	1198
Adjusted R^2	0,55	0,43

Примечание. «***», «**», «*» – значимость (Prob) коэффициентов регрессии на уровне 1, 5 и 10% соответственно.

⁵ Указанные субсидии можно рассматривать в качестве потенциального дохода граждан, обеспечивающего потребление театральных услуг по пониженным ценам.

ствует росту посещаемости театров и их производительности. На это указывают статистически значимые на уровне 1% положительные коэффициенты при показателе числа спектаклей в каждом уравнении регрессии: $b_1^1 = 0,813$; $b_1^2 = 0,754$ (табл. 3).

Из этой же таблицы видно, что коэффициенты при показателе цен также статистически значимы на уровне 1% в обоих уравнениях регрессии и равны соответственно: $b_2^1 = -0,197$; $b_2^2 = -0,156$. Данный вывод отражает известные эмпирические результаты, согласно которым значения коэффициента эластичности спроса по собственной цене организаций исполнительских искусств являются отрицательными, относительно маленькими, но статистически значимыми (Gapinski, 1986, p. 20–25; Felton, 1992, p. 1–12; Moore, 1996, p. 79–87; Рубинштейн, 2012, с. 44).

Позитивное влияние на театральную посещаемость демонстрируют регрессоры, описывающие динамику дохода жителей регионов. Речь идет о коэффициентах при показателях заработной платы и бюджетных субсидий на одного жителя, которые в регрессии посещаемости театров оказались положительными и статистически значимыми на уровне 1 и 5%: $b_3^1 = 0,137$; $b_4^1 = 0,014$. При этом в регрессии производительности коэффициент при показателе бюджетных субсидий на одного жителя оказался статистически не значимым.

В целом можно утверждать, что рост предложения театральных услуг и повышение благосостояния населения в форме непосредственного увеличения заработной платы и в результате увеличения бюджетных субсидий на 1 жителя региона формируют положительную динамику посещаемости театров. В противоположном направлении действует рост цен на театральные билеты. При этом расчеты свидетельствуют, что даже в благоприятных для театров ситуациях, когда возникают условия для роста посещаемости и роста производительности труда, последняя все равно отстает от роста производительности в экономике (Рубинштейн, 2012).

* * *

Итак, несмотря на то, что «болезнь Баумоля», как и ее главный симптом – «феномен отставания производительности», – нигде не исчезают, можно в духе Хейлбруна (Heilbrun, 2003, p. 99), пусть и несколько в ином контексте, говорить о хороших новостях. Хорошей новостью можно считать то, что глобализационный фактор снижения спроса на продукты живого исполнительского искусства в России, похоже, исчерпан. Поэтому можно ожидать, что в дальнейшем спрос на культурные блага будет существенно в большей степени зави-

сеть от деятельности организаций исполнительских искусств, от их «производственной программы» и ценовой стратегии, а также от культурной политики государства, финансирующего данный вид опекаемых благ.

Литература

- Автономов Ю.В.** (2011). Эмпирические исследования спроса на культурные блага: исполнительское искусство и объекты культурного наследия (Научный доклад). М.: ИЭ РАН.
- Рубинштейн А.Я.** (2012). Опекаемые блага в сфере культуры: признаки и последствия «болезни цен» (Научный доклад). М.: ИЭ РАН.
- Театр как социологический феномен (2009). (Социология и экономика искусства: научное наследие) / Отв. ред. Н.А. Хренов. СПб.: Алтейя.
- Baumol W.J., Bowen W.G.** (1966). *Performing Arts: The Economic Dilemma*. N.Y.: The Twentieth Century Fund.
- Felton M.V.** (1992). On the Assumed Inelasticity of Demand for the Performing Arts // *J. of Cultural Econ.* Vol. 16. P. 1–12.
- Fernandez R., Palazuelo E.** (2012). European Union Economies Facing «Baumol's Disease» within the Service Sector // *J. of Common Market Studies*. Vol. 50. Issue 2. March. P. 231–249.
- Gapinski J.H.** (1986). The Lively Arts as Substitutes for the Lively Arts // *American Econ. Review*. Vol. 75. P. 20–25.
- Heilbrun J.** (2003). *Baumol's cost disease*. In: «A handbook of cultural economics». Cheltenham: Edward Elgar. P. 91–101.
- Moore T.G.** (1996). The Demand for Broadway Theater Tickets // *Review of Econ. and Statistics*. Vol. 48. P. 79–87.
- Neck R., Getzner M.** (2007). Austrian Government Expenditures: «Wagner's Law» or «Baumol's Disease»? // *International Business & Economics Research J.* Vol. 6. Issue 11. P. 49–66.
- Nordhaus W.** (2008). Baumol's Diseases: A Macroeconomic Perspective // *Contributions to Macroeconomics, Berkeley Electronic Press*. Vol. 8. Issue 1.
- Pomp M., Vujic S.** (2008). Rising Health Spending, New Medical Technology and the Baumol Effect. CPB Netherlands Bureau for Economic Policy Analysis. December.
- Seaman B.A.** (2006). Empirical Studies of Demand for the Performing Arts. In: Ginsburgh A., Throsby D. (eds.) «*Handbook on the Economics of Art and Culture*». Vol. 1. North-Holland: Elsevier Science.

Поступила в редакцию 05 апреля 2012 года

Научная жизнь



В.Ю. Музыкач

Краткий отчет о научной конференции
«Актуальные проблемы экономики
и социологии культуры»
(Москва, 18 апреля 2012 г.)

**Академику
В.Л. Макарову — 75 лет**

Наши поздравления!

В.Ю. Музычук

ИЭ РАН, Москва

Отчет о научной конференции «Актуальные проблемы экономики и социологии культуры» (Москва, 18 апреля 2012 г.)

В последнее время наметилось усиление внимания к проблемам экономики и социологии культуры. Во многом это обусловлено рядом законодательных новаций последних лет, которые негативно сказались на функционировании сферы культуры и искусства. Определенную лепту внесло и обсуждение проекта Федерального закона № 617570-5 «О культуре в Российской Федерации», представленного на рассмотрение в Государственную думу РФ в октябре 2011 г. Следует отметить, что запланированное на март слушание данного законопроекта в первом чтении так и не состоялось.

Отслеживая ситуацию, сложившуюся в социокультурном пространстве России, Журнал Новой экономической ассоциации выступил инициатором проведения конференции, посвященной актуальным проблемам экономики и социологии культуры.

18 апреля 2012 г. в Москве в Институте экономики РАН прошла первая ежегодная научная конференция «Актуальные проблемы экономики и социологии культуры», организованная Журналом Новой экономической ассоциации совместно с Институтом экономики РАН и Государственным институтом искусствознания.

В рамках работы конференции были проведены пленарное заседание «Культурная политика Российской Федерации в 2000-е годы» и круглый стол «Экономика культуры: новый ракурс старых проблем».

На конференции обсуждались следующие вопросы:

- институциональная среда культурной деятельности;
- законодательные новации в сфере культуры;
- проблемы статистики культуры;
- культурные индустрии;
- некоммерческие организации в сфере культуры;
- эмпирические исследования культурной деятельности;
- проблемы тестирования «болезни цен» Баумоля;
- социологические исследования в сфере культуры;
- экономика культуры и культурная политика: зарубежный опыт.

В работе конференции приняли участие свыше 40 человек, среди них – ведущие сотрудники ИЭ РАН, МГУ им. М.В. Ломоносова, НИУ ВШЭ, Государственного института искусствознания, Российского института культурологии, НИИ киноискусства, Российского университета театрального искусства (ГИТИС), Санкт-Петербургской государственной академии театрального искусства и представители Министерства культуры РФ, Министерства культуры Московской области, Комитета Совета Федерации РФ по науке, образованию, культуре и информационной политике, Союза музеев России, Союза театральных деятелей РФ, Школы-студии (института) им. В.И. Немировича-Данченко при МХАТ им. А.П. Чехова и других организаций.

С вступительным словом к участникам конференции обратился заместитель директора Института экономики РАН и заместитель главного редактора Журнала Новой экономической ассоциации д.э.н. **Михаил Юрьевич Головнин**, который изложил позицию редакционного совета Журнала НЭА в отношении необходимости широкого освещения социально-экономических проблем культуры на страницах журнала.

Заседание пленарной сессии «Культурная политика Российской Федерации в 2000-е годы» прошло под председательством заместителя министра культуры Российской Федерации **Екатерины Эдуардовны Чуковской**, выразившей заинтересованность Минкультуры России в необходимости поиска научного обоснования управленческих решений в сфере культуры и искусства.

Пленарная сессия открылась двумя докладами, отразившими деятельность профессиональных творческих союзов. С докладом «О Концепции развития театрального дела в Российской Федерации на период до 2020 г.» выступил секретарь СТД РФ, заведующий кафедрой Санкт-Петербургской государственной академии театрального искусства профессор **Лев Геннадьевич Сундстрем**, который рассказал об основных целях, этапах разработки и структуре Концепции развития театрального дела, а также сложностях согласования отдельных ее положений с представителями финансово-экономических ведомств. Заседание продолжилось докла-

дом эксперта Союза музеев России, членом-корреспондентом Российской академии художеств **Анны Сергеевны Колушаевой** «О Национальном докладе «Музеи России на рубеже десятилетий». В докладе прозвучала обеспокоенность современным состоянием музейной сферы, вызванная законодательными новациями последних лет, и сложившейся в связи с этим неблагоприятной институциональной средой, а также заинтересованность музейного сообщества в усилении взаимодействия с органами государственной власти по нивелированию негативных тенденций развития отечественной культуры.

Заведующий отделом социологии экранных искусств НИИ киноискусства, д.с.н., профессор **Михаил Иванович Жабский** выступил с докладом «Проекты модернизации кино в России», посвященным истории становления и развития отечественного кино. В докладе был сделан акцент на необходимости возрождения российского кинематографа путем производства социально значимых фильмов на основе ценностей национальной культуры.

Заместитель директора Российского института культурологии, к.ист.н., доцент **Алексей Григорьевич Васильев** рассказал участникам конференции об основных новациях и попытках совершенствования понятийного аппарата культуры, предпринятых при подготовке проекта Федерального закона «О культуре в Российской Федерации», а также об основных этапах его разработки и согласования с различными министерствами и ведомствами.

Вторая часть пленарной сессии была посвящена презентации ряда недавно вышедших научных изданий. Ведущий научный сотрудник отдела экономики искусства и культурной политики Государственного института искусствознания, к.ф.н. **Елена Петровна Костина** рассказала об идее создания и основных этапах подготовки книги «Культура России. 2000-е годы» (2012), посвященной памяти Бориса Юрьевича Сорочкина. Старший научный сотрудник отдела экономики искусства и культурной политики Государственного института искусствознания, к.иск., доцент **Александр Анатольевич Ушкарёв** представил книгу «Московский художественный театр. После столетия. Репертуар и публика» (2011), акцентировав внимание на методологии социологического исследования аудитории и репертуара МХТ, положенного в основу данного издания. Член бюро Чеховской комиссии Совета по истории культуры РАН, к.иск. **Татьяна Константиновна Шах-Азизова**, на протяжении многих лет работавшая рука об руку с Борисом Юрьевичем Сорочкиным,

рассказала об особенностях подготовки двух вышеупомянутых изданий.

Вторая часть конференции прошла в формате круглого стола. Работу круглого стола «Экономика культуры: новый ракурс старых проблем» модерировал директор Государственного института искусствознания, д.иск., профессор **Дмитрий Владимирович Трубочкин**.

С приветственным словом к участникам круглого стола обратился президент НЭА и главный редактор Журнала Новой экономической ассоциации академик РАН **Виктор Меевич Полтерович**.

Круглый стол открылся докладом, посвященным теоретическим аспектам экономики культуры. С докладом «Причины «болезни издержек» Баумоля: низкая производительность или культурные стереотипы?» выступил заведующий лабораторией институционального анализа экономического факультета МГУ им. М.В. Ломоносова д.э.н., профессор **Виталий Леонидович Тамбовцев**. Его весьма неоднозначный взгляд на трактовку экономических проблем культуры вызвал большой резонанс у участников конференции.

Также на круглом столе был заслушан доклад «Эластичность спроса на исполнительское искусство по цене и доходу: основные результаты эмпирических исследований» доцента факультета экономики НИУ ВШЭ к.э.н. **Юрия Владимировича Автономова**. В докладе был представлен обзор основных результатов западных эмпирических (преимущественно эконометрических) исследований, полученных в отношении базовых детерминант спроса на исполнительское искусство – цены и дохода.

Доклад научного сотрудника отдела экономики искусства и культурной политики Государственного института искусствознания **Екатерины Андреевны Хауниной** «Процентная филантропия – дополнительный финансовый ресурс для организаций социально-культурной сферы» вызвал неподдельный интерес у участников конференции, свидетельством чему послужила масса вопросов практического характера, заданных докладчику после выступления.

Законодательным новациям в сфере культуры был посвящен доклад заведующей сектором эффективности социальной сферы Института экономики РАН к.э.н. **Валентины Юрьевны Музычук** «Перспективы развития культуры в России в свете Стратегии-2020 и законопроекта «О культуре в Российской Федерации», в котором акцентировалось внимание на финансовом обеспечении и организационно-экономических аспектах функционирования сферы культуры.

Заместитель министра культуры правительства Московской области к.с.н. **Светлана Николаевна Горушкина** выступила с докладом «Услуги в сфере культуры как инструмент реализации государственной культурной политики», в котором она предприняла попытку обосновать терминологическую несводимость понятий «услуга в сфере культуры» и «результат творческой деятельности».

В докладе доцента кафедры менеджмента Санкт-Петербургского филиала НИУ ВШЭ к.э.н. **Марины Владимировны Матецкой** на тему: «Концепция творческих индустрий сквозь призму культурной политики» был представлен обзор основных подходов к анализу сектора культуры в экономической науке и методике оценки влияния культуры на социально-экономическое развитие общества.

С большим интересом участники конференции заслушали доклад директора Центра социологии искусства д.соц.н. **Марины Леони-**

довны Магидович «Петербургские филармонические традиции сквозь призму современных потребительских практик».

Проблемам статистики культуры был посвящен доклад ученого секретаря отдела экономики искусства и культурной политики Государственного института искусствознания **Евгении Александровны Дудкиной** «Статистика культуры в Российской Федерации: состояние и проблемы».

Участники конференции единодушно признали, что проведение конференции, посвященной актуальным проблемам экономики и социологии культуры, должно стать традицией и проходить на постоянной основе.

Участники конференции получили в подарок ряд научных изданий, посвященных проблемам экономики и социологии культуры.

Директор Государственного института искусствознания д.иск., профессор **Дмитрий Владимирович Трубочкин** подвел основные итоги работы конференции.

Поступила в редакцию 29 апреля 2012 года

Академику В.Л. Макарову – 75 лет

25 мая 2012 г. исполнилось 75 лет директору Центрального экономико-математического института РАН и Высшей школы государственного администрирования МГУ им. М.В. Ломоносова, президенту Российской экономической школы и декану факультета экономической теории Государственного университета гуманитарных наук, одному из руководителей Новой экономической ассоциации академику Валерию Леонидовичу Макарову.

В.Л. Макаров внес фундаментальный вклад в теорию экономической динамики и существенно расширил область ее применения. Его ранние работы посвящены анализу стационарных состояний и асимптотики модели Неймана–Гейла, весьма общей оптимизационной модели экономического развития. Ему удалось получить условия, при которых оптимальная траектория выходит на стационарный режим за конечное время (так называемую теорему о магистрали в сильнейшей форме). Вместе с А.М. Рубиновым Валерием Леонидовичем была развита общая теория суперлинейных точно-множественных отображений, ставшая удобным аппаратом изучения моделей экономической динамики. С помощью этой теории удалось получить весьма общие теоремы двойственности (теоремы о характеристике) для таких моделей. Все эти разработки были отражены в статьях, опубликованных в журналах «Доклады Академии наук СССР», «Успехи математических наук», а также в фундаментальной монографии «Математическая теория экономической динамики и равновесия», переведенной на английский язык и вышедшей в издательстве Springer-Verlag в 1977 г.

Одновременно с развитием абстрактной теории В.Л. Макаров совместно с Л.В. Канторовичем работали над прикладными аспектами моделирования экономической динамики. Их совместная статья «Оптимальные модели перспективного планирования» (1965) стала одним из краеугольных камней концепции оптимального планирования, развивавшейся советской экономико-

математической школой и послужила основой для создания методик по расчету эффективности капиталовложений.

Важные результаты были получены В.Л. Макаровым в теории экономического равновесия, являющейся одним из основных инструментов современной экономической науки. Им были сформулированы весьма общие условия существования равновесия (Journal of Mathematical Economics, 1981). Валерий Леонидович предложил микрообоснование конкурентного равновесия – модель договорных взаимодействий между агентами экономики – и показал, что ее устойчивые состояния Парето-оптимальны. Совместно с В.А. Васильевым Валерий Леонидович ввел понятия информационного равновесия и ядра, доказал их существование и указал оптимальные свойства (1984, 2006).

Еще одно достижение В.Л. Макарова – разработка модели двухслойной (в том числе двухвалютной) экономики применительно к условиям переходного процесса в России. Эта модель положена в основу его монографии (в соавторстве с М. Левиным и А. Рубиновым, 1993), перевод которой вышел в издательстве North-Holland в 1995 г.

Валерию Леонидовичу принадлежит ряд идей построения моделей равновесия, учитывающих инновации и передачу знаний. Эти идеи послужили исходным пунктом для многих исследований. Не забыты и другие, более ранние разработки Валерия Леонидовича; в частности, концепция договорных взаимодействий интенсивно развивается его учеником В.М. Маракулиным.

Валерий Леонидович возглавляет группу специалистов, совершенствующих разработанную им в 1999 г. вычислимую модель общего равновесия и использующих ее модификации для количественной оценки вариантов экономической политики и результатов институциональных преобразований в России. Недавно ряд расчетов был проведен на суперкомпьютере «Ломоносов».

В 2010 г. вышла в свет необычная книга «Социальный кластеризм», в которой В.Л. Макаров предлагает свой проект общественного переустройства.

Научно-организационная деятельность В.Л. Макарова поражает масштабами. Он главный редактор журнала «Экономика и математические методы», член редколлегии и редакционных советов многих журналов, включая и Журнал НЭА. А шесть лет назад Валерий Леонидович стал издавать интернет-журнал

«Искусственные общества».

Академик Макаров – избранный член международного Эконометрического общества (Fellow of Econometric Society). Он является лауреатом премии Совета министров СССР (1980) и премии Президиума РАН им. Л.В. Канторовича (1995), а в 2008 г. ему была присуждена престижная Демидовская премия «За выдающийся вклад в построение компьютерных моделей экономики знаний для решения современных проблем России».

Дорогой Валерий Леонидович!

**Примите наши самые теплые и искренние
поздравления с юбилеем!**

**Новая экономическая ассоциация
желает Вам крепкого здоровья,
счастья, успехов в достижении творческих
и профессиональных целей, благополучия
Вашим родным и близким!**

Журнал Новой экономической ассоциации

Дизайн

В. Валериус

Компьютерная верстка

О. Скворцова

Редактор

И. Шитова

Издатель: АНО «Журнал Новой экономической ассоциации»

Адрес редакции: 117218, Москва, Нахимовский проспект, 32, офис 1115.

Тел.: +7 (495) 637-69-59; Тел./ факс: +7 (495) 718-98-55

E-mail: gnea@inecon.ru; tizina@mail.ru

Подписано в печать: 18.06.2012

Формат: 70x108 1/16

Бумага офсетная: Печать офсетная

Уч-изд. л. 11,4

Тираж 700 экз.

Отпечатано в соответствии с предоставленными материалами

в ОАО «Первая Образцовая типография»

Филиал «Чеховский Печатный Двор»

Адрес: 142300, Московская область, г. Чехов, ул. Полиграфистов, д.1

Сайт: www.chpk.ru, E-mail: marketing@chpk.ru,

факс: 8 (496) 726-54-10, 8 (495) 988-63-87

Заказ № 536

Подписной индекс журнала в каталоге Агентства «Роспечать» 37158

Перепечатка материалов из «Журнала Новой экономической ассоциации» только по согласованию с редакцией.