



Алексей Ведев, Директор Центра структурных исследований Института экономической политики имени Е. Т. Гайдара (Института Гайдара),
Генеральный директор аналитической лаборатории «Веди»

В нынешних условиях сложно переоценить важность неангажированного профессионального взгляда на рынок, который призвана дать независимая аналитика. Без нее невозможно принятие верных решений и объективной оценки рисков в современном мире. О том, что такое математическое моделирование и **для чего эксперту нужна независимость суждений**, мы беседуем с Директором Центра структурных исследований Института экономической политики имени Е. Т. Гайдара (Института Гайдара), Генеральным директором аналитической лаборатории «Веди» Алексеем Ведевым.

Алексей Ведев:

«Выработка оптимальной экономической политики — дело государственное»

— Алексей Леонидович, как структурирована жизнь российского экспертного экономического сообщества? Представляется, что серьезный мировой экономический дискурс существует по большей части вдали от России, по преимуществу в англоязычной среде. А что все-таки есть у нас?

— Экономическая наука — область чрезвычайно обширная. Я бы ни в коем случае не взял на себя смелость говорить о ней в целом. Моя специальность — математическое моделирование, и вот об этом предмете я готов поговорить.

Математическим моделированием я занимаюсь достаточно давно — с тех пор, как в начале 1985 г. пришел работать в ЦЭМИ¹.

Может быть, это время было не лучшим для советской хозяйственной системы, но в экономической науке той поры существовали, как ни удивительно, не только схоласты, транслировавшие марксистско-ленинские политэкономические концепции. Были также люди, стремившиеся все-таки заниматься реальными вещами. Живая экономическая мысль развивалась в нескольких направлениях, в том числе не теоретических, а прикладных, которые известны мне более предметно.

В частности, тогда в ЦЭМИ довольно много людей занималось экономическим моделированием,

индикативным планированием и математической экономикой. Математическое моделирование по определению имеет не узкоэкономический, а фундаментальный характер: это эффективный инструмент исследования любых сложных проблем, который может быть полезным в разной области. В том числе он служит основой для построения экономических моделей: в современных экономических исследованиях математические модели являются доминирующей формой.

Еще одно перспективное направление исследований было связано с планированием народного хозяйства. В современных терминах его назвали бы индикативным планированием. Имеет смысл заметить, что сейчас экономисты активно стремятся вернуть методы индикативного планирования в научный и практический обиход. Это происходит в том числе благодаря усилиям бывших сотрудников ЦЭМИ — например, Андрея Белоусова (Министр экономического развития России. — *Примеч. ред.*) и Андрея Клепача (Заместитель министра Минэкономразвития. — *Примеч. ред.*).

В целом тогда в ЦЭМИ был наработан значительный научный потенциал. К несчастью, он был утрачен в годы смуты (конец 1980-х — начало 1990-х). Террито-

¹ Центральный экономико-математический институт Академии наук СССР, ныне Российской академии наук (ЦЭМИ РАН), создан в 1963 г. по инициативе академика В. С. Немчинова на базе организованной им в 1958 г. Лаборатории экономико-математических методов. В качестве главной цели при создании института было провозглашено внедрение математических методов и ЭВМ в практику управления и планирования, создание теории оптимального управления народным хозяйством. Далее эта цель трансформировалась в развитие фундаментальной теории и методов моделирования экономики переходного периода, разработку экономико-математического инструментария и программно-алгоритмических средств анализа экономики. (*Примеч. ред.*)

риально сообщество базировалось в районе станции метро «Профсоюзная». Там, недалеко друг от друга, находилось несколько зданий, в которых размещались ключевые учреждения — Центральный экономико-математический институт (ЦЭМИ), Институт экономики и международных отношений, Институт научной информации по общественным наукам (ИНИОН), Институт социалистической системы. Здания, разумеется, никуда не делись и сейчас, но работавшие в них коллективы по большому счету уже прекратили свое существование. Осталась выжженная земля — не буквально, конечно.

Подавляющее большинство специалистов из научного пространства ушло: кто-то уехал из страны, кто-то стал чиновником, кто-то занялся бизнесом. Причем все люди, владеющие соответствующим аппаратом, получали профессиональную подготовку еще в СССР. Новых не появилось. Кто-то, конечно, остался и работает, но эти люди живут в основном на гранты, ориентированы на англоязычную аудиторию и работают по ее правилам. Сейчас людей, которые в России хотя бы пытаются что-то моделировать, можно посчитать по пальцам одной руки.

Недостаток даже простой физической численности профессионального сообщества очевиден.

— На качество разработок ЦЭМИ не влияла связь с плановой экономикой? В них была научная состоятельность и новизна?

— Тогда появлялись серьезные научные наработки, которые позже были просто утрачены. В ЦЭМИ развивалась, например, теория свободного материально-финансового баланса, которая сейчас стала очень актуальной. В ЕС пытаются это направление возродить, а американцы и голландцы его используют традиционно. В рамках системы национальных счетов есть отдельное направление — так называемые матрицы институциональных счетов.

Сейчас с учетом основных трендов — глобализации, укрупнения корпораций — специалисты все равно возвращаются к разработанным в ЦЭМИ методам индикативного планирования, межотраслевых и межсекторных связей, увязок балансов. И к прогнозированию, конечно.

Так или иначе, в экономике существует объективная потребность считать реальные потоки — финансовые и материальные, смотреть, насколько они сбалансированы, какие возникают структурные дисбалансы и как можно с ними бороться.

Вот простые примеры. Математическое моделирование позволяет понять природу банковского (или финансового) кризиса: как он возникает, сколько стоит его ликвидация, чем надо и можно пожертвовать, чтобы кризис не допустить. Возникает значительно больше ясности в вопросе размена между финансовым стимулированием экономики и структурными последствиями такого стимулирования, которые потом приводят к кризису.

Или, например, существует нужда в определении оптимальных темпов роста экономики. Говорят, что нужно 5—7% роста для того, чтобы Россия встала с ко-

лен. Но возникает вопрос: такие темпы — это хорошо? Или Россия на таких темпах поднимется — и сразу рухнет?

— То есть существуют модели, которые позволяют оценить стоимость кризиса достаточно точно? Дают возможность не на пальцах, не в гуманитарной логике, а в цифрах определить, что произошло и как из этого положения выходить?

— Гипотеза № 1: считать ситуацию лучше, чем не считать.

Гипотеза № 2: квалифицированно считать — лучше, чем приблизительно оценивать (на пальцах). Без сомнения.

Экономика — плохо формализуемая и сложная система, это известно. Поэтому нельзя однозначно утверждать, что существуют математические модели, исчерпывающе описывающие все параметры кризисов. Если бы они были, почему бы их не взять и не применить. Но существующие модели, хотя и не идеально эффективные, тем не менее способствуют поиску решений.

Один из провалов российской экономической политики за последние 20 лет состоял в том, что оценки были, во-первых, некачественными, безальтернативными, а во-вторых, их было мало или недостаточно. И, кроме того, в них было много субъективизма — именно оценок, а не расчетов.

В публичном пространстве бесконечно фигурируют ссылки на какие-то расчеты экспертных агентств, инвестиционных банков. Я не верю, что в этих организациях что-то высчитывается серьезно: в рамках их экспертных возможностей разве что общие прикидки на калькуляторе.

Вот классический пример: сейчас разработана долгосрочная программа социально-экономического развития РФ до 2030 г. (так называемая Программа-2030). Она содержит шесть (!) вариантов развития. Уже по одному этому индикатору видна порочность разработок в целом: ведь страна не может развиваться по шести вариантам, идти шестью дорогами сразу и одновременно. Причем речь, как мы понимаем, идет о ключевом документе.

Именно по качеству его проработки прекрасно видно состояние нашей экономической науки. По шести вариантам, во-первых, нельзя строить долгосрочные стратегии — развития банковского сектора, платежной системы, железных дорог и т. д. Во-вторых, все сценарии описаны с огромными допущениями. Например, по умолчанию предполагается, что мы не испытываем никаких ограничений по притоку иностранных инвестиций. А что если на самом деле мы такие ограничения испытываем? Или содержится молчаливое допущение, что у страны нет никаких ограничений по развитию банковской системы. А если ограничения есть?

Стратегий для финансового сектора в Программе-2030 нет вообще, финансы учитываются как внешний фактор, в рамках которого никаких ограничений тоже не существует. И все эти вещи, достаточно вопиющие, не обсуждаются.

С тех пор как МЭР опубликовало документ, в качестве слабой реакции на него последовали робкие замечания лишь двух учреждений: Высшей школы экономики и Института Гайдара. И всё. Не возникло профессиональной дискуссии, не появилось альтернативных расчетов — ничего вообще!

То есть принципиальный, важнейший документ, по которому страна будет жить очень много лет, создается в экспертном вакууме. Вот наилучшая иллюстрация состояния российской экономической науки.

— Музыканты играют как умеют?

— Этот было бы лучшим вариантом. А реальный — и худший — состоит в том, что делать необходимую работу просто некому. Модели некому считать, некому представлять альтернативные варианты. Причем, насколько я знаю, ни Минэкономразвития, ни Минфин не возражали бы против привлечения по схемам аутсорсинга экспертов, которые в состоянии посчитать альтернативные модели. Ведь совершенно очевидно, что гораздо правильнее принимать решения после того, как просмотрены, скажем, десять альтернативных решений и несколько раз проверены и перепроверены выводы. Но такого материала нет.

— Для существования экспертных центров нужна определенная база — кадровая, техническая, финансовая. Как может возникнуть такая структура?

— Реальная проблема состоит в том, что серьезные исследования надо поддерживать. Причем поддерживать загодя, а не за полчаса до того, как понадобится готовый результат. Для того чтобы эксперты были сейчас, на них надо тратить предыдущие 5—7 лет. Тратиться в широком смысле. Дать людям возможность учиться, стажироваться, делать реальные проекты. Наконец, профессионалы просто должны находиться в тонусе. Это означает, что разработанные модели должны быть запущены в оборот, востребованы. И тогда по совокупности получилось бы так, что в мае, после распоряжения вновь избранного Президента подготовить долгосрочную программу развития страны до 2030 г., экспертное сообщество объединилось с заинтересованными министерствами и стало такую программу делать. Но этого не происходит.

— В так называемых развитых странах экономические стратегии вырабатываются вместе с экспертным сообществом?

— Без сомнения! Используется огромное количество материалов, полученных по схемам аутсорсинга, причем аутсорсинг даже может быть политизированным. Имеется в виду, что в аналитической работе участвуют и люди, не разделяющие официальную идеологию. Но их количественные оценки принципиально важны. Следует рассматривать все мнения — именно для того, чтобы построить верную картину.

Еще одна классическая проблема состоит в том, что в России экономическую политику определяют несколько игроков: Министерство экономического развития, Минфин и Центральный банк. И каждое из этих ведомств имеет принципиально разные задачи, а также

принципиально разные индикаторы эффективности работы. Причем по ряду вещей позиции ведомств взаимно противоречивы: скажем, Минфин против дефицита бюджета, а МЭР, грубо говоря, за дефицит. В такой ситуации один из важнейших вопросов — выработка оптимальной экономической политики.

Или, например, возникает вопрос: каков может быть допустимый дефицит бюджета — 1, 2 или 5%? Это принципиально, это очень важно. Но сейчас проблема решается только в межведомственных дискуссиях и, я бы сказал, взаимном позиционировании. Речи о выработке оптимальной политики в этом бюрократическом противоборстве не идет.

Арбитрами в подобных дискуссиях могли бы быть люди со стороны. Но за такими арбитрами тоже должны стоять эксперты, рабочая аналитическая инфраструктура. У нас ничего этого нет.

К разработке Программы-2030 не привлекались и иностранные эксперты. При работе над стратегией-2020 все-таки были попытки привлечения иностранной экспертизы, хотя и в очень ограниченном количестве. Но подавались результаты этой экспертизы как протокол о намерениях, а не стратегия. С такого документа и спрос другой. Кроме того, насколько я знаю, большинство рекомендаций никак не использовались.

Поэтому фундаментальные исследования надо развивать. Я говорю это не как представитель заинтересованного цеха, а как объективный свидетель. В стране сейчас отсутствует возможность делать количественные оценки решений, принятых в области экономической политики. Их проработка ниже всякой критики. Ситуация кажется мне катастрофической.

— Откуда может продуцироваться заказ на такие разработки?

— Такой заказ может продуцироваться только из государственных источников.

Ведь катастрофа состоит еще в том, что у нас нет рынка независимых аналитических услуг. Вообще нет! Крупные корпорации аутсорсингом в этом смысле почти не пользуются. И, исходя из их методов корпоративного управления, им гораздо удобнее брать аналитиков на работу и таким образом инкорпорировать в свою структуру и подчинять, нежели проводить аналитические исследования на конкурсной основе.

Выходит, что через частные институты, через корпорации независимый аналитический рынок поддержки не получает. Так что он держится либо на государственных заказах, либо на иностранных грантах. Но сейчас поток грантов редеет, поэтому государство превращается в почти монопольного заказчика на рынке экономического моделирования и прогнозирования.

— Как можно побудить государство и крупные компании участвовать в этом рынке в качестве заказчиков?

— Всегда легче объяснять на примерах. Вот, скажем, Центральный банк два раза в год проводит слушания, связанные с обсуждением, в первом случае, докумен-

та «Основные направления кредитно-денежной политики», а во втором случае, годового отчета. И в том и в другом документе содержатся оценки финансового сектора и прогнозные оценки. На эту тему проходят слушания в Государственной Думе. Я являюсь их участником уже лет 16 — и вижу, насколько девальвировалась процедура. С каждым годом она становится все хуже и хуже. Последние 10 лет Дума рассылает материалы для слушаний Центробанку по различным инстанциям с просьбой на них отреагировать. Отзывы готовятся на добровольной основе, в результате их качество ухудшается, а самих отзывов становится все меньше.

Задача Минфина, который в этой ситуации оппонировал Центробанку, — подготовить конструктивную дискуссию. Но по существу дела «Основные направления денежно-кредитной политики» не обсуждаются, процедура обсуждения формальна.

Аналогичная ситуация — с трехлетним планом бюджета (этот документ готовится Минфином). Согласен, детали статей могут остаться темой для кулуарного обсуждения в комитетах парламента. Но основные направления воздействия параметров бюджета на макроэкономические индикаторы для обсуждения, казалось бы, обязательны. Однако такой дискуссии нет вообще.

Хотя она вполне могла бы быть организована. Можно выделять какие-то деньги и организовывать тендеры на подготовку замечаний и предложений.

Есть смысл тратить ресурсы для обсуждения трехлетних и долгосрочных прогнозов, ведь это стратегически важные документы.

— Но разве Центральный банк, допустим, заинтересован в том, чтобы платить деньги за подготовку критических замечаний в свой же адрес?

— Тогда должен быть заинтересован кто-то другой. Если Центробанк считает, что все хорошо, Минэкономразвития и Минфин придерживаются того же мнения, то нечего и пенять тогда на отсутствие в стране экономической мысли. Если все в высшей степени превосходно и советоваться по этому поводу ни с кем не надо, то экспертному сообществу в такой ситуации взяться, разумеется, неоткуда. Рыночными механизмами возникновение независимой экспертизы в нашей стране не организовать.

Выработка оптимальной экономической политики — дело государственное. Должны быть приложены волевые усилия государства. И тратиться на науку надо заходя, иначе ничего не будет.

— А крупные частные структуры не могут способствовать появлению рынка независимой экономической экспертизы?

— Сейчас они понемногу становятся лучше. Вот, например, проработал я четыре года в большом банке, именно в качестве главы аналитической службы. У этого банка было 9 млн клиентов — физических лиц и плюс к этому свыше 100 клиентов — юридических лиц. Разумеется, в такой ситуации он испытывал нужду в макроэкономических оценках и прогнозах.

Постепенно крупные структуры начинают осознавать потребность в качественной аналитике.

Но если существует шесть вариантов официальной долгосрочной государственной стратегии, то что могут насчитать эксперты отдельного банка в рамках такого количества? В этой ситуации корпорация в принципе не сможет выбрать понятный путь развития.

Кроме того, отсутствуют альтернативы: предполагается, что реально все будет происходить в строгом соответствии с прогнозами и расчетами Минэкономразвития, никак иначе. Зачем же тогда тратить деньги на собственную аналитику, ведь можно взять основные индикаторы с сайта МЭР. Излишне объяснять, что такая позиция приводит к ошибкам.

Кризис 2008—2009 гг. можно было и предвидеть, и пройти легче. В феврале 2008-го мы публично представляли обзор, который так и назывался «В тихой гавани: штормовое предупреждение». То есть мы прогнозировали кризис как минимум за 6—7 месяцев до его начала. Уйти от него крупным структурам было нельзя, конечно, но имелись возможности смягчить последствия.

Так что прогнозы предприятиям нужны. Но низкий уровень конкуренции делает среду существования более легкой для них. В том же банковском секторе основная конкуренция сейчас идет между Сбербанком и ВТБ, остальные просто отжаты. А если будет создан Роснефтебанк, то под контролем шести крупнейших государственных банков окажется около 80% активов всей банковской системы. И зачем тогда что-то считать? Учитывая, что из этих шести государственных банков два банка еще к тому же максимально используют административный ресурс. В такой ситуации ценность независимых исследований очень и очень девальвируется.

В целом положение все-таки становится лучше: интерес к аналитике у крупных структур появился, но он еще недостаточен.

На американском аналитическом рынке ситуация принципиально иная. (Знаю это по опыту, поскольку работал страновым экспертом в нью-йоркской компании Global Sources, которая продает страновые отчеты.) В США если аналитическая компания выпускает на рынок качественное исследование, то через месяц, максимум через три месяца, к ней неизбежно приходит коммерческий успех.

В России такое немыслимо. Фактически при любом качестве работы эксперты в конце концов получают предложение о переходе на работу — либо в государственный орган, либо в крупную коммерческую структуру. Понятно, что о независимой аналитике в такой перспективе речь не идет. Команда пересаживается в теплое место, у нее появляются средства к существованию. Все это хорошо, конечно. Но взамен она теряет независимость, не может развиваться в направлении group think, генерировать идеи. И, кроме того, с этого момента у нее никогда не будет самостоятельного коммерческого успеха. Это означает, что данная группа экспертов отныне потеряна не только для рынка, но и для объективных дискуссий. ■