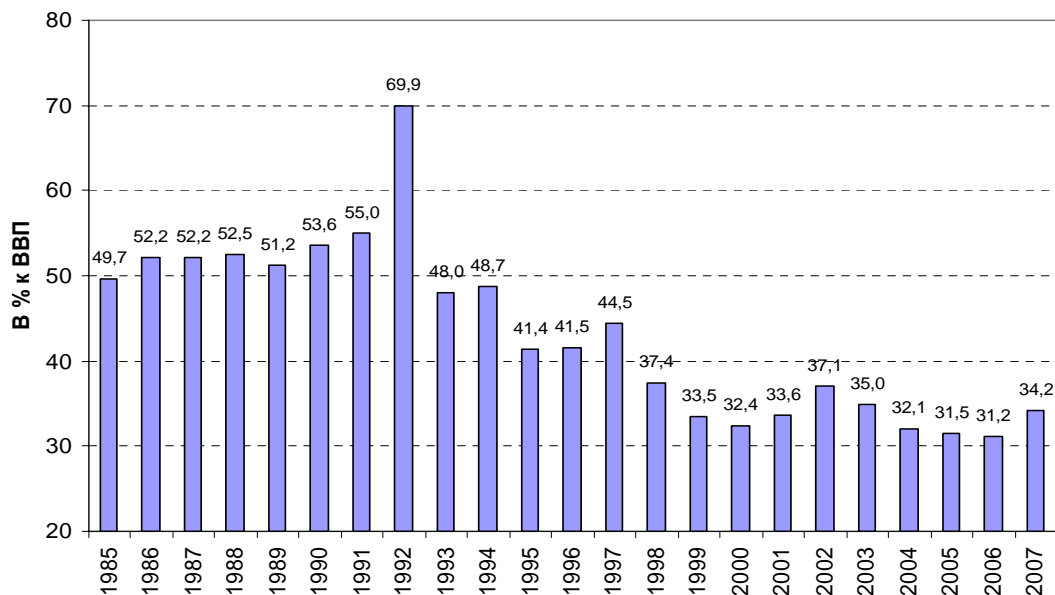


Статистическая ошибка маститого экономиста

В газете «Ведомости» 19 марта 2008 г. появилась статья А. Илларионова «Много шума. Для чего?». Выводы, изложенные в ней, вызывают некоторое недоумение, а методы анализа представляются весьма сомнительными. Так, обращает на себя внимание неожиданное утверждение о том, что рост государственных расходов на 3 п.п. ВВП в 2007 г. по сравнению с уровнем 2006 г. «скромнее роста государственных расходов на 15 п.п. ВВП – с 55% ВВП в 1991 г. до 70% ВВП в 1992 г., осуществленных Гайдаром 16 лет назад и вызвавших экономическую катастрофу 1992 г.» (курсив наш). Оставим на совести А. Илларионова слова об «экономической катастрофе», обратимся к цифрам.

Более развернутое сопоставление доли государства в ВВП за последние 22 года, каким оно – это сопоставление – представляется А. Илларионову, приведено в слайде к его выступлению на Московской межбанковской валютной бирже 21 марта 2008 г. (рис. 1).

Рис. 1. Государственные расходы в СССР и России в % к ВВП в 1985–2007 гг.



Источник: сайт Института экономического анализа - http://www.iea.ru/article/econom_rost/crisis.ppt.

Приведенные на рис. 1 цифры, особенно «выброс» показателя 1992 г., входят в явное противоречие с общеизвестными фактами: получается, что либеральное правительство Е.Т. Гайдара в 1992 г. вопреки всем канонам либерализма не уменьшало долю государства в экономике, а, напротив, резко ее увеличило. Получается, что доля государства в ВВП в первый год рыночных реформ существенно выросла по сравнению с аналогичным показателем в централизованно планируемой экономике, где роль государства априори должна быть выше, чем в рыночной экономике.

Все это не укладывается ни в сложившуюся научную и политическую парадигму (даже противники либеральных реформ – см, например, Львов Д.С. Путь в XXI век: Стратегические проблемы и перспективы российской экономики. – <http://www.leadnet.ru/lvov/lvov2.htm> – отмечают, что правительство Е.Т. Гайдара было ориентировано на сокращение бюджетного дефицита путем сокращения государственных расходов, а следовательно, и доли государства в экономике), ни в имеющиеся данные по

расходам на отдельные сферы государственной деятельности. Например, ассигнования на закупку вооружений сократились в 7,5 раза, централизованные капитальные вложения – в 1,5 раза, ценовые дотации – почти в 3 раза, практически полностью прекращалось безвозмездное финансирование иностранных государств (за исключением стран СНГ) и так далее, и тому подобное¹.

Что же произошло? Оказывается, представленные А. Илларионовым данные о доле государственных расходов в ВВП за разные годы на самом деле **не сопоставимы между собой**, потому что получены по трем принципиально различным методикам:

- период 1985–1991 гг. рассчитан на основании методологии Госкомстата СССР;
- период 1992–1994 гг. – на основании реконструкции государственных доходов и расходов Российской Федерации, приведенной в книге С.Г. Синельникова-Мурылева «Бюджетный кризис в России: 1985–1995 годы»², с поправкой на уточненный объем ВВП;
- период 1995–2007 гг. в целом совпадает с данными бюджетной статистики Минфина России.

Для пояснения – простейший пример. Представьте себе, что вчера среднесуточная температура воздуха была 15 градусов, а сегодня – 32 градуса. Стало теплее? Да, если и в тот, и в другой день температура воздуха измерялась, например, по Цельсию или Фаренгейту, или по Реомюру. Если же температуру вчера измеряли по Цельсию, а сегодня по Фаренгейту, то окажется, что произошло значительное похолодание (32 градуса по Фаренгейту – это 0 градусов по Цельсию). В университетах профессора предупреждают будущих статистиков: никогда не стройте статистические ряды из показателей, рассчитанных по разным методологиям, такие ряды не имеют смысла. Когда А. Илларионов говорит о том, что в 1992 г. рассматриваемый им показатель вырос с 55 до 70% ВВП, он совершает именно такую школярскую ошибку. Эти цифры несопоставимы!

К счастью, на самом деле приведенные А. Илларионовым 55% ВВП за 1991 г. есть с чем сравнить: в 1992 г. им соответствует показатель 33% ВВП, рассчитанный по той же методике и приведенный в упомянутой книге Синельникова. Значит, *доля государственных расходов в ВВП не увеличилась, а снизилась, и очень значительно – на 22 п.п.* При всем несовершенстве советской статистики, но все же в силу самой сопоставимости последних показателей, такой вывод не лишен смысла. А главное – соответствует здравому смыслу. Ибо вряд ли можно было бы ожидать, что смена административно-командной системы на систему рыночную повысит роль государства в экономике. Это – абсурд.

Казалось бы, на этом можно было бы поставить точку. Ну, совершил маститый экономист элементарную ошибку – с кем не бывает?

Но есть смысл разобраться с тем, откуда возник рассматриваемый парадокс. Объясняя приведенные им данные за 1992–1994 гг., А. Илларионов ссылается на работу С.Г. Синельникова-Мурылева «Бюджетный кризис в России: 1985–1995 годы». Он явно не принимает во внимание, что при реконструкции государственных доходов и расходов Российской Федерации, проведенной в этой книге, учитывались не только расходы, учтенные в месячных отчетах об исполнении бюджетов Российской Федерации Министерства Финансов, но и многие другие операции правительства, которые до 1992 г. по разным причинам не учитывались в бюджетной статистике.

Например, огромные по масштабам кредиты, предоставлявшиеся в 1992 г. Россией бывшим республикам Советского Союза (8,7% ВВП), отсутствовали в бюджетной статистике до 1992 г. Однако эти расходы могут показаться новой статьей российского

¹ Экономика переходного периода. Очерки экономической политики посткоммунистической России 1991–1997. – ИЭПП, Москва, 1998. – С. 105.

² Синельников С. Бюджетный кризис в России: 1985–1995 годы. – М: «Евразия», 1995. – С. 163–167, 171–176, 185–189.

бюджета по сравнению с ситуацией 1991 г. только человеку, слабо знакомому с экономической историей России и СССР. Россия и до начала реформ была донором (особенно в плане поставок энергоносителей) по отношению к большинству союзных республик. Сокращение подобных дотаций является серьезной политической проблемой, не решенной до конца и в настоящее время. В 1992 г. был сделан шаг по переводу данных отношений в денежную и возмездную форму. Вместо поставок товаров странам СНГ предоставлялись кредиты, с помощью которых они могли купить российские товары. Таким образом, никакого роста расходов по данному направлению на самом деле не произошло. Проблема донорства России по отношению к странам СНГ просто была оценена в денежном эквиваленте, и был предпринят первый шаг решения этой проблемы. Насколько он был успешен – отдельный вопрос, но к росту доли государства в экономике самой России это не имеет никакого отношения.

Если учесть финансовые операции правительства, которые не были отражены в бюджетной статистике не только в 1992–1994 гг. (см. Синельников С. «Бюджетный кризис в России: 1985–1995 годы»), но и в предшествующие годы, то может получиться, что доля государственных расходов в ВВП в период 1985–1991 гг. была существенно (на десятки процентов ВВП!) выше, чем это указано на *рис. 1*. Однако в условиях полного развала статистики в 1991 г. и существенных методологических отличий советской статистики от международных стандартов проведение подобной реконструкции для более ранних периодов оказалось затруднительным.

Представляется целесообразным во избежание дальнейших недоразумений с использованием приведенной в работе С.Г. Синельникова-Мурылева расчетной доли государственных расходов в ВВП (73,5%) показать, каким образом должна быть скорректирована данная оценка, чтобы ее можно было сопоставлять с другими периодами.

1) Отчисления в производственные внебюджетные фонды не являлись в полном смысле налогами. Начисленные суммы в значительной степени оставались на предприятиях³. Следовательно, далеко не все доходы и расходы внебюджетных фондов в 1992 г. следует учитывать при определении параметров консолидированного бюджета. Позднее была проведена определенная корректировка расходов и доходов внебюджетных фондов⁴. В результате оценка расходов внебюджетных фондов в 1992 г. была снижена на 5,9% ВВП с 13,4% ВВП до 7,5% ВВП.

2) Определенной коррекции с течением времени подвергся и показатель государственных услуг, предоставляемых народному хозяйству. Его снижение составило 2,6% ВВП с 16,6% ВВП⁵ до 14% ВВП⁶.

В результате этих двух корректировок получилось значение расходов консолидированного бюджета в 1992 г., равное 65,1% ВВП, что приведено в книге «Экономика переходного периода...1991–1997». Однако и эта цифра представляется не окончательной и не позволяет нам осуществлять сопоставление размеров государства в 1992 г. и в более поздние периоды. Необходимо проводить дальнейшие корректировки.

3) Курс рубля был существенно занижен по отношению к паритету покупательной способности (ППС), причем соотношение между номинальным курсом и ППС существенно изменялось на протяжении достаточно коротких промежутков времени⁷, в

³ Синельников С. Бюджетный кризис в России: 1985–1995 годы. – М.: «Евразия», 1995. – С. 169.

⁴ Экономика переходного периода. Очерки экономической политики посткоммунистической России 1991–1997. – ИЭПП, Москва, 1998. – С. 196–199.

⁵ Синельников С. Бюджетный кризис в России: 1985–1995 годы. – М.: «Евразия», 1995. – С. 165.

⁶ Экономика переходного периода. Очерки экономической политики посткоммунистической России 1991–1997. – ИЭПП, Москва, 1998. – С. 198.

⁷ Так, отношение инфляции к изменению номинального курса доллара за 1992 г. составило примерно 11 раз, что в определенной мере отражает снижение отличия между текущим курсом и паритетом покупательной

результате чего ряд показателей бюджетной статистики, первоначально номинированных в иностранной валюте, существенно завышался в процентах к ВВП. Такой показатель, как внешнее финансирование (11% ВВП), во многом определявший в начале 1990-х годов возможности государства по финансированию расходных обязательств, при применении не номинального валютного курса, а паритета покупательной способности рубля по отношению к доллару будет меньше в несколько раз, однако, не имея возможности использовать сколько-нибудь достоверные оценки паритета покупательной способности рубля, в работе «Бюджетный кризис в России: 1985–1995 годы», автор решил пользоваться номинальным курсом рубля, подчеркнув всю условность такой оценки⁸.

4) Аналогичные рассуждения применимы и к доходам государства от обязательной реализации части валютной выручки предприятий-экспортеров по заниженной обменной ставке рубля (2% ВВП), а также к расходам по субсидированию импорта за счет продажи валюты предприятиям-импортерам (примерно 10,5% ВВП) по завышенной обменной ставке. Оба показателя сильно завышаются вследствие применения для их оценки текущего курса рубля по отношению к доллару, а не паритета покупательной способности.

Учитывая, что оценить курс рубля, исходя из расчетного паритета покупательной способности рубля к доллару в 1992 г., представлялось затруднительным, в работе «Бюджетный кризис в России: 1985–1995 годы» не осуществлялась непосредственная переоценка доли государственных доходов и расходов в ВВП с учетом занижения курса рубля по отношению к паритету покупательной способности. Однако необходимо иметь в виду, что от 13% ВВП (внешнее финансирование плюс реализация части валютной выручки предприятий-экспортеров по завышенной обменной ставке рубля) до 23,5% ВВП (к предыдущим показателям добавляем субсидирование импорта за счет продажи валюты предприятиям-импортерам) государственных расходов требуют существенной переоценки из-за заниженного курса рубля. Поэтому показатели доходов и расходов консолидированного бюджета в 1992 г. несопоставимы с аналогичными показателями более поздних периодов.

5) Как было отмечено выше, кредиты, предоставлявшиеся в 1992 г. Россией бывшим республикам Советского Союза (8,7% ВВП), следует вычесть из общего результата расходов консолидированного бюджета, поскольку эти кредиты, повторим, никакого отношения к роли государства в экономике страны (к «величине государства» по известному выражению, принятому в среде либеральных экономистов) не имеют и не позволяют сопоставить расходы в 1992 г., например, с расходами в 1991 г. и даже с расходами 1994 г., поскольку к этому времени кредитование стран СНГ, как известно, прекратилось. В результате получим сумму расходов и ссуд за вычетом погашенных консолидированного бюджета в размере около 55% ВВП без учета влияния заниженного курса рубля.

6) В книге «Бюджетный кризис» отмечено, что автор не исключает «возможности того, что использовалась заниженная оценка ВВП за 1992 г.»⁹. Объем ВВП 1992 г., действительно, был пересмотрен в сторону увеличения с 18 063 млрд руб. до 19 006 млрд руб. Следовательно, скорректировав приведенную выше величину с учетом нового значения ВВП, получим, что сумма расходов и ссуд консолидированного бюджета за вычетом погашенных составила немногим более 50% ВВП без учета влияния заниженного курса рубля.

способности рубля: соответствующий рост реального курса рубля достаточно быстро уменьшал разрыв между номинальным курсом и ИПС.

⁸ Синельников С. Бюджетный кризис в России: 1985–1995 годы. – М: «Евразия», 1995. – С. 168.

⁹ Там же с. 168.

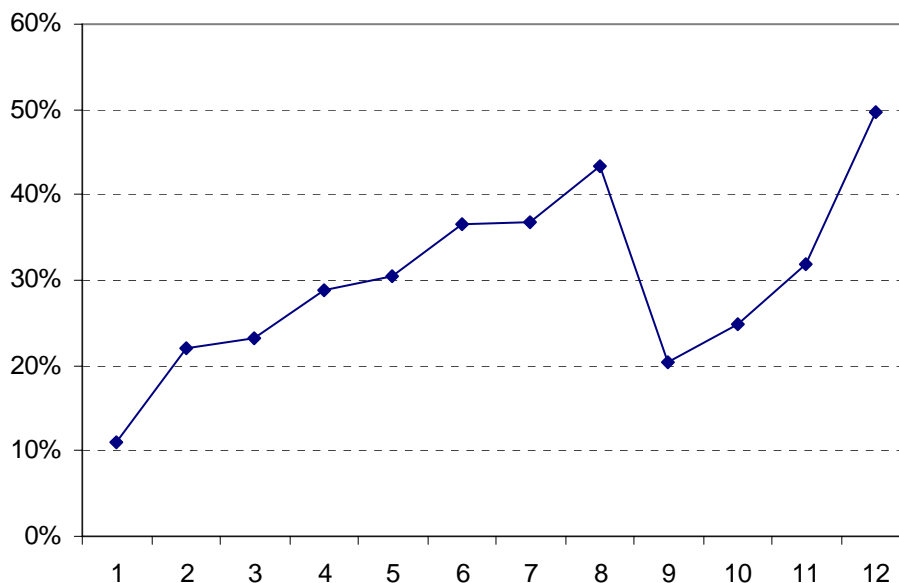
Отдельно можно рассмотреть еще один вопрос, затронутый А. Илларионовым: насколько велик «личный вклад» Е.Т. Гайдара, а также вклад его правительства в достижение «обнаруженной» критиком доли расходов консолидированного бюджета в ВВП 1992 г.

Во-первых, А.Н. Илларионов в интервью журналу «Континент» говорит: «Что происходит с бюджетным дефицитом? В 1992 г. он вырастает почти до 32% ВВП. Тридцать два процента ВВП – цифра немыслимая для государственных финансов мирного времени. В истории, похоже, нет других примеров, когда в мирных условиях наблюдался бы бюджетный дефицит такого размера». Несмотря на то, что цифра бюджетного дефицита существенно преувеличена из-за преувеличения значения величины бюджетных расходов (см. выше), в этой цитате есть один важный момент. В ней фигурирует словосочетание «мирное время». 1992 г. в России был далеко неординарным и немирным годом. Подробнее об этом сказано в книге И.В. Стародубровской и В.А. Мау «Великие революции от Кромвеля до Путина», где то, что в России происходило в те годы, характеризуется как революционный процесс. Для любого революционного процесса характерна политическая нестабильность и хронический бюджетный дефицит. Именно политические ограничения, постоянное балансирование правительства между продолжением реформ и отставкой не позволили в полной мере осуществить финансовую стабилизацию. Следовательно, некорректно сравнивать макроэкономические показатели во время революции и во время периода постреволюционной стабилизации – они принципиально несравнимы.

Во-вторых, 14 декабря 1992 г., как известно, произошла отставка Е.Т. Гайдара с поста исполняющего обязанности Председателя правительства. Именно в декабре 1992 г. наблюдалось резкое ослабление бюджетной политики. Одной из особенностей высокой инфляции является тот факт, что на годовые данные по многим показателям в значительной мере влияют данные последнего месяца. Если специально не учитывать влияние высокой инфляции на соотношение государственных расходов и ВВП в каждом месяце (с применением индивидуального дефлятора для каждого месяца), то при высокой инфляции получится, что рассматриваемое нами соотношение за год определяется в значительной степени тем, каким оно было в последний месяц.

Для пояснения данного тезиса можно рассмотреть статистику месячных отчетов об исполнении бюджетов в Российской Федерации Министерства Финансов за 1992 г. Несмотря на то, что в этой статистике (как мы указывали выше) не учитывались многие финансовые операции правительства, общие тенденции соотношения расходов консолидированного бюджета в ВВП в ней отражаются достаточно достоверно (рис. 2–3).

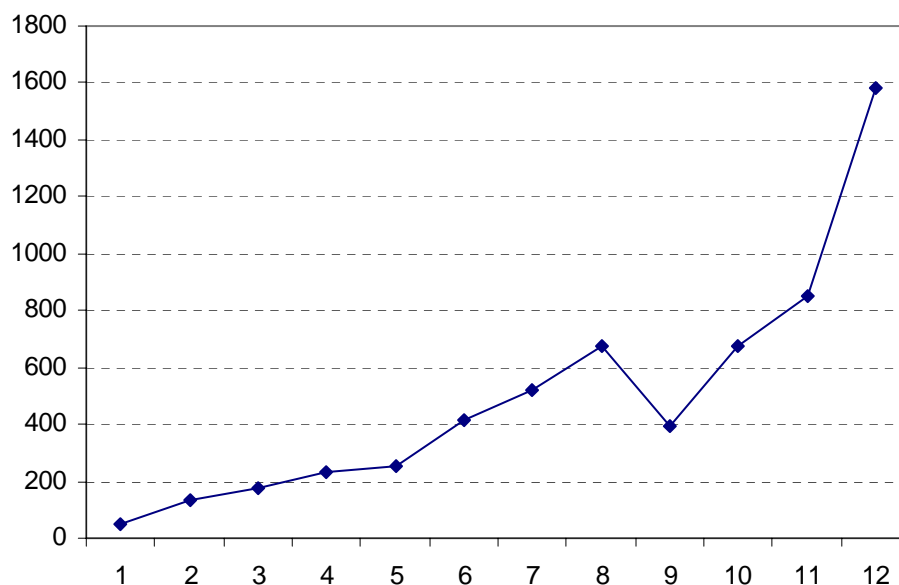
Рис. 2. Помесячное исполнение консолидированного бюджета России по расходам (графа «Итого расходы и ссуды за вычетом погашенных») в 1992 г., % ВВП



Источник: Министерство Финансов Российской Федерации.

Примечание: использованы значения отдельно за каждый месяц, а не накопленным итогом.

Рис. 3. Помесячное исполнение консолидированного бюджета России по расходам (графа «Итого расходы и ссуды за вычетом погашенных») в 1992 г., млрд руб.



Источник: Министерство Финансов Российской Федерации.

Примечание: использованы значения отдельно за каждый месяц, а не накопленным итогом.

Как видно из представленных на *рис. 2* данных, весь 1992 г. можно условно разбить на четыре подпериода: 1) период жесткой бюджетной политики зимы-весны 1992 г., когда бюджетные расходы не превышали 30% ВВП; 2) усиление популизма (после известных решений IV Съезда советов в апреле) и фактор сезонности летом 1992 г.; 3) ужесточение

бюджетной политики осенью 1992 г.; 4) дестабилизация бюджетной политики в конце года, когда даже по статистике Минфина России расходы консолидированного бюджета составили почти 50% ВВП.

Следовательно, год был очень разнородным по степени жесткости проводимой бюджетной политики и по доле государства в экономике. Однако, как видно из представленных на *рис. 3* данных, около 27% всех бюджетных расходов было осуществлено в декабре месяце. Следовательно, значительное влияние на долю расходов консолидированного бюджета в ВВП оказали именно декабрьские расходы, осуществленные уже после отставки Е.Т. Гайдара.

Таким образом, если мы скорректируем величину государственных расходов в январе–ноябре 1992 г. (когда события в той или иной степени зависели от политики, проводимой Е.Т. Гайдаром) в соответствии со всем вышеизложенным, может получиться картина, обратная той, которую нарисовал автор рассматриваемой нами статьи. Государственные расходы в январе–ноябре 1992 г. в процентах к ВВП существенно сократились по сравнению с уровнем 1991 г. Скажем осторожнее: могли сократиться, так как следует еще раз подчеркнуть, что 1991–1992 гг. были периодом крупнейшей экономической трансформации, а многие макроэкономические показатели (рост цен, курс рубля, объем производства) менялись настолько быстро, что сравнивать их среднегодовые значения представляется некорректным. Необходим анализ помесечной динамики. И даже в этом случае невозможно трактовать данные показатели «в лоб».

Если же отстраниться от спора о численных значениях тех или иных показателей, то критика автором рассматриваемой статьи Е. Гайдара – ключевой фигуры российских либеральных реформ – сводится к чисто мировоззренческой проблеме: там, где одни видят приговор, основанный на каких-то цифрах, пусть даже фальсифицированных, другие видят повод для дискуссии о сложностях переходного периода в России.

Л. Лопатников, В. Назаров, С. Синельников-Мурылев