

Владимир Елаховский

ЗАО «ЭСТА Корп.»

О качестве официальной макроэкономической статистики

Время от времени в прессе встречаются публикации, содержащие критику Госкомстата по поводу допускаемых им недооценок либо переоценок при расчете важнейших макроэкономических показателей. При этом, на наш взгляд, упускается из виду условный характер агрегированных макроэкономических показателей — практика статистических измерений неизбежно сопряжена с огрублениями, досчетами, дооценками и т.п. Допускаем, что вполне можно установить направление ошибки, однако оценка ее величины будет не в меньшей степени условна, а значит, подвержена критике, чем оценка Госкомстата, который обладает уникальной широко разветвленной сетью наблюдения и является единственной организацией, по закону наделенной правом собирать статистическую информацию со всех субъектов хозяйствования.

Гораздо больше оснований для осторожного отношения к статистической информации, поставляемой Госкомстатом, появляется, когда периодически приходится сталкиваться с содержащимися в ней внутренними противоречиями, а также с пересмотрами ранее опубликованных значений за достаточно длинный предшествующий отрезок времени, подчас серьезно меняющими характер динамики показателей.

В дореформенный период официальная статистика публиковала главным образом годовые значения макроэкономических показателей, что вполне соответствовало медленному характеру их изменений и преимущественно исследовательскому интересу, который к ним проявлялся. Однако во время проведения реформ экономическая динамика приобрела гораздо более высокую подвижность, а потребность в оперативной информации резко возросла за счет стремительного увеличения количества хозяйствующих субъектов, принимающих само-

стоятельные инвестиционные решения. Поэтому можно было только приветствовать переход к практике ежемесячных публикаций значений макроэкономических показателей в самом начале периода реформ, хотя следует признать, что такой переход сопровождался ощутимым снижением качества статистических измерений.

И тому есть вполне объективные причины. Государственная статистика организационно сложилась совершенно в иных социально-экономических условиях, и потому была вынуждена спешно приспосабливаться к новым реалиям, стремясь догнать стремительно изменяющиеся события. Да и само по себе статистическое наблюдение за объектом, отличающимся повышенной подвижностью, всегда сопряжено со снижением качества измерений. Кроме того, на нем отрицательно сказывается и повышение оперативности при производстве статистической информации. К заданному сроку статистическая отчетность поступает далеко не от всех единиц наблюдаемой совокупности, что заставляет давать так называемые предварительные оценки, рассчитываемые на базе основного массива. Затем, после поступления остальных данных, производится корректировка, которая по своей величине должна быть сравнительно малой. Такой порядок корректировки задним числом оперативной статистической информации является общепринятой мировой практикой, и степень подобной корректировки применительно, в частности, к относительным показателям динамики, как правило, измеряется десятками долями процента. Ведь с увеличением степени корректировки смысл повышенной оперативности просто исчезает.

Особенность отечественной статистики заключается в том, что, помимо корректировок последних опубликованных значений, величины которых иногда выходит далеко

за рамки допустимой, Госкомстат пересматривает временные ряды, как правило, на год-два назад. Основанием для этого, очевидно, служит изменение методики расчета показателей, которое может, например, мотивироваться необходимостью расширения совокупности для более полного охвата явления или, наоборот, сужения с целью более четкого определения ее границ. При подобном пересмотре нельзя исключать возможности влияния субъективного фактора, особенно если принять во внимание, что принцип независимости статистики у нас никогда не стоял на ведущих позициях.

Временной ряд какого-либо показателя формируется по мере поступления очередных ежемесячных данных путем накопления, т.е. пересчета цепного темпа роста (по сравнению с предыдущим единичным периодом) в базисный (по сравнению с начальным единичным периодом). Однако периодический пересмотр Госкомстатом временного ряда цепных показателей заставляет производить соответствующий пересчет прежнего ряда, иногда приводящий к кардинальному изменению представления о характере текущей динамики.

Приведем несколько подобных случаев, которые свидетельствуют о необходимости более осторожного отношения к макроэкономической статистике.

Согласно первоначальным данным о динамике физического объема ВВП, накапливавшимся вплоть до ноября 1997 г., намечалось некоторое снижение объема ВВП за 1997 г. в целом (сравнение ВВП за январь — ноябрь текущего года с соответствующим периодом прошлого года показывало спад на 1%, и уровень прошлого года мог быть достигнут лишь при условии прироста ВВП в декабре более чем на 15% к ноябрю, что вряд ли могло произойти в конкретных экономических условиях того периода). В результате пересмотра данных за 1996—1997 гг. уровень ВВП в 1996 г. был несколько

понижен, а в 1997 г. — повышен, и тем самым был получен годовой прирост в размере 0,4%. Некоторое время спустя был проведен еще один пересмотр, повысивший эту величину до 0,8%. При этом в отдельные месяцы уровень реального ВВП поднялся почти на 10%, что безотносительно к направлению корректировки прямо говорит о низкой точности измерения этого показателя (рис. 1).

Подобные изменения годового итога в районе 100%-й отметки привели к тому, что вместо одного качественного состояния — спада — было получено другое — рост. Это позволило закладывать в основу бюджетного планирования на 1998 г. продолжение роста (бюджет 1998 г. рассчитывался исходя из 2%-го прироста ВВП), а значит, рассчитывать на увеличение доходов, обосновывающее увеличение расходов. Как известно, эти расчеты полностью были отвергнуты реальностью — экономическая ситуация и состояние государственного бюджета ухудшались уже с самого начала 1998 г., в то время как текущая экономическая политика исходила из перспектив увеличения бюджетных доходов.

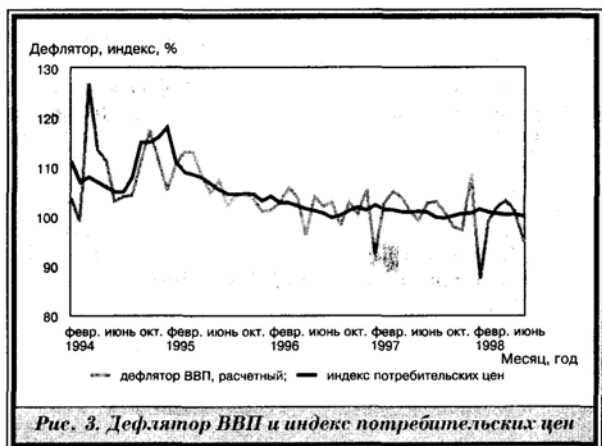
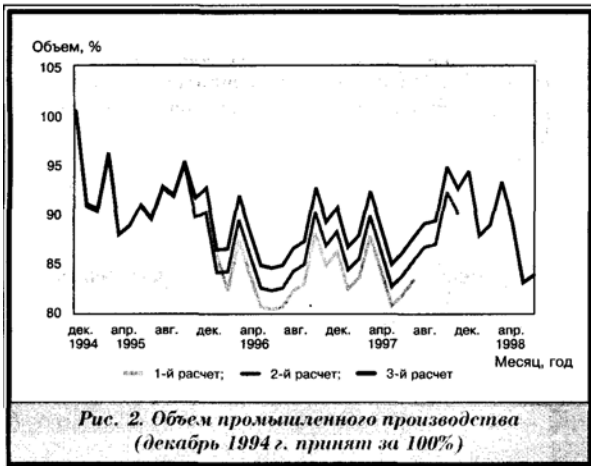
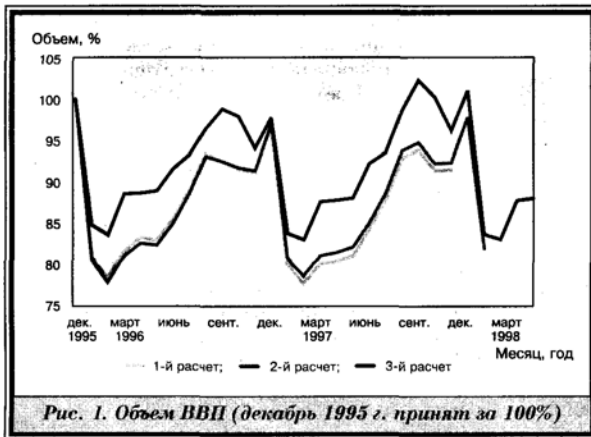
Похожий эффект произошел и при пересмотре динамики объема промышленного производства (рис. 2). Первоначально Госкомстат показывал незначительный прирост — 0,5% за январь — июль 1997 г. по сравнению с со-

ответствующим периодом предыдущего года. После первого пересмотра это значение возросло до 1,1%. Данный, уже пересмотренный, ряд выводил на годовую оценку прироста в 1,7%. Еще один пересмотр, произведенный уже в начале 1998 г., повысил годовой результат до 1,9%.

При рассмотрении динамики дефлятора ВВП, который легко исчисляется как отношение цепного месячного темпа роста номинального ВВП к соответствующему темпу роста реального ВВП, обращает на себя внимание, во-первых, широкий диапазон колебаний с глубоким уходом в отрицательную зону (в то время как столь значительного снижения уровня цен не наблюдалось), не согласующийся с относительно ровным поведением индекса потребительских цен — близкого родственника дефлятора ВВП, — во-вторых, противоречивость характеров годовой цикличности индекса потребительских цен и расчетного дефлятора ВВП (рис. 3). В декабре 1997 г. средний уровень цен на товары и услуги, включаемые в ВВП, резко возрастает (почти на 9%), а в январе 1998 г. — не менее резко падает (на 13%), тогда как индекс потребительских цен отличался сезонным эхом инфляционного скачка в январе 1992 г., в соответствии с которым его максимум ежегодно достигался именно в январе.

Скорее всего, эти расхождения объясняются несогласованностью методов расчета номинального и реального ВВП, важнейших показателей, служащих для принципиальных оценок экономического состояния и перспектив его изменения, а также использующихся для обоснования мер экономической политики. По нашему глубокому убеждению, отмеченные трудности при определении данного показателя, отличающегося предельно высоким уровнем агрегирования, обуславливаются тем, что в российских условиях он даже чисто технически не может с приемлемой точностью подсчитываться в ежемесячном режиме. Очевидно, зная это, Госкомстат в конце прошлого года отказался от публикации месячных данных о динамике ВВП, что следует признать вполне оправданным.

В конце прошлого года был произведен пересмотр данных о динамике инвестиций в основной капитал (рис. 4). Основное изменение произошло с сезонным спадом в январе, который стал оцениваться в 62—65% вместо прежних 75—79%. С учетом прочих изменений уровень данного показателя существенно повысился. Причем степень этого по-



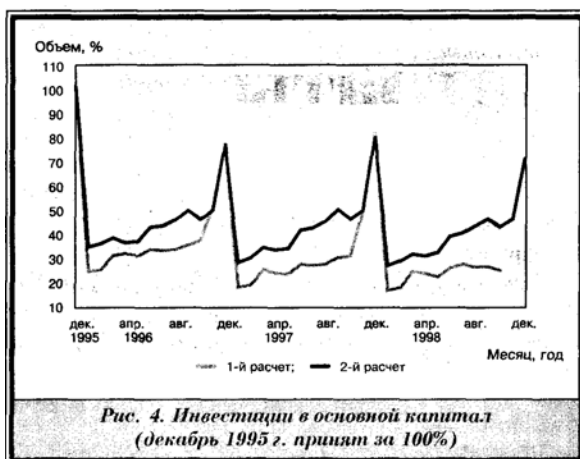


Рис. 4. Инвестиции в основной капитал (декабрь 1995 г. принят за 100%)

вышения по времени парастала. Если в начале 1996 г. уровень нового ряда превышал уровень пересмотренного ряда в 1,2 раза, то к концу 1998 г. — уже в 1,5 раза. В результате значительно уменьшилась величина спада в 1997 г. — с 13 до 4%. В 1998 г., правда, она снизилась незначительно.

Проведенные в конце 1997 — начале 1998 г. пересмотры ранее опубликованных значений последовательно два раза повышали уровень реального объема розничного товарооборота в 1997 г.

Что касается реальной зарплаты, то при первом пересмотре в 1997 г. был понижен уровень предшествующего года, а при следующем — уже в конце года — повышен текущий уровень. В 1998 г. был также повышен уровень реальных денежных доходов населения.

Любопытны результаты пересмотра данных о динамике численности безработных (рис. 5), произведенного в начале текущего года. В результате этого пересмотра характер изменения этого показателя в 1998 г. серьезно изменился. Внутригодовые колебания стали более значительными. В частности, во II квартале появился спад. Зато последующий рост оказался более быстрым, чем по прежним данным, что, очевидно, больше соответствовало протекавшему

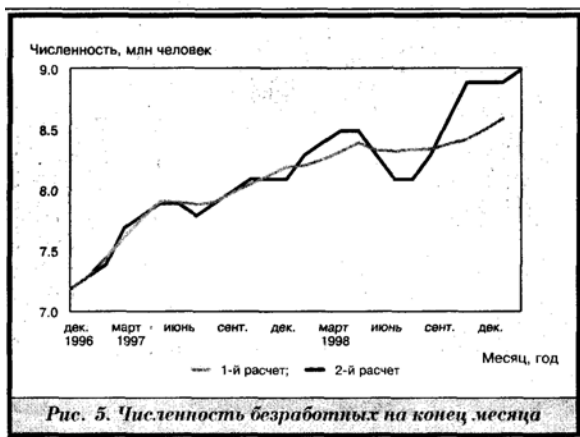


Рис. 5. Численность безработных на конец месяца

в этот период обострению кризисных процессов, и уровень показателя на конец года стал выше на 3,5% по сравнению с прежними данными.

Значительные изменения были внесены многочисленными пересмотрами в динамику показателей внешней торговли — величины корректировок достигают 30%, при том, что довольно часто встречаются случаи корректировки более чем на 10%.

Таким образом, проводимые время от времени пересмотры ранее опубликованных значений и степень возникающих вследствие этого изменений макроэкономических показателей серьезно ограничивают возможность адекватного оперативного анализа текущей экономической ситуации и проведения прогнозных расчетов. Аналитические результаты и содержательные обобщения приобретают условный характер, т.е. находятся в зависимости от того, будет ли изменена впоследствии опорная статистическая база, и если будет, то в какой мере. При этом приходится сознавать, что мера подобного изменения может быть настолько значительной, что полученные сегодня выводы потеряют какой-либо смысл.

В том случае, если макроэкономическая статистика используется в чисто исследовательских целях, очередная масштабная корректировка Госкомстата будет приводить всего лишь к изменению представления о состоянии экономики. Однако принятые в этих условиях инвестиционные решения, в отличие от статистических данных и аналитических выводов, неизмеримо труднее поддаются пересмотрам и корректировкам. Отмеченные нами проблемы с адекватностью отражения официальной статистикой реального положения дел в экономике косвенно ухудшают инвестиционный климат в России, поскольку не способствуют прозрачности экономической ситуации и предсказуемости ее развития.

Разумеется, все это не говорит о бесполезности информации Госкомстата. С точки зрения источников экономической статистики альтернатив ему не существует, поэтому сложившееся положение в данной области следует принимать как данность, подвергая ее исследованию на противоречивость. Довольно часто обнаруживаются противоречия между различными формами относительного представления одного и того же показателя (к предыдущему месяцу и к соответствующему месяцу предыдущего года), между цепными изменениями за период и общими изменениями за тот же период нарастающим итогом. Встречаются также случаи противоречивой динамики близких по смыслу показателей. Ведь обычно оперативной корректировке в первую очередь подвергаются показатели с наибольшей степенью агрегирования, что часто вызывает расхождение с показателями более низких уровней обобщения. Наличие противоречий, как правило, является сигналом предстоящего глубокого пересмотра, а следовательно, анализ на основе сегодняшних данных заведомо не может давать однозначных результатов.

Вероятно, осторожному восприятию отечественной статистики поможет осознание того, что, имея с ней дело, мы фактически анализируем не то или иное интересное нас явление само по себе, а лишь его статистическое отражение, и прогнозируем, по сути дела, не изменение явления непосредственно, а лишь то значение отражающего его показателя, которое впоследствии опубликует Госкомстат.