

КОНЪЮНКТУРНЫЕ ОПРОСЫ ПРЕДПРИЯТИЙ В СИСТЕМЕ СОВРЕМЕННОЙ СТАТИСТИКИ

Цухло С.В.¹

Аннотация

В статье рассматриваются возможности конъюнктурных опросов предприятий в условиях несовершенства официальной статистики и с учетом особенностей развития российской экономики в последние годы. На основе 25-летнего опыта Института экономической политики им. Е.Т. Гайдара (ИЭП) в области проведения и развития ежемесячных опросов промышленных предприятий показано, что этот источник данных способен дополнить результаты традиционной статистики, а в случае кризисов 2008–2009 гг. и 2015–2016 гг. – существенно превзойти их. Так, кризис 2008–2009 гг. был зарегистрирован опросами ИЭП на месяц раньше его официального признания, а особенности 2015–2016 гг. – отсутствие кризисного спада спроса, выпуска и занятости при уверенном контроле предприятий за запасами готовой продукции – были показаны уже в I кв. 2015 г. Гибкая организация конъюнктурных опросов ИЭП позволяет прямо измерять многие актуальные на современном этапе, но недоступные традиционной статистике явления. В 2012–2017 гг. результаты опросов ИЭП показали невысокую восприимчивость в девальвации рубля как защитной меры для отечественного производителя в условиях критической зависимости промышленности от импортного оборудования, комплектующих и сырья. По этой причине укрепление рубля в феврале 2015 г. считалось российскими предприятиями важнейшей антикризисной мерой, а оценка фактического влияния девальвации рубля на спрос, себестоимость и инвестиции в 2015–2017 гг. была всегда негативной.

Ключевые слова: статистика; российская промышленность; конъюнктурные опросы; российские кризисы; сводные показатели; девальвация; импортозамещение.

Статистические проблемы российской промышленности

Современный этап развития российской экономики требует взвешенных решений в области экономической политики, которые должны опираться на всесторонний анализ представительного набора статистических

¹ Цухло Сергей Владимирович – кандидат экономических наук, заведующий лабораторией конъюнктурных опросов, Институт экономической политики им. Е.Т. Гайдара. Адрес: Институт экономической политики им. Е.Т. Гайдара. 125993 Москва, Газетный пер., д. 3–5, стр. 1. E-mail: tsukhlo@iep.ru

данных. Поэтому последние являются важной частью системы государственного управления и должны соответствовать требованиям времени. Однако российская экономическая статистика, вступившая на путь реформирования вместе со всем обществом в начале 1990-х гг., пока не завоевала должного доверия со стороны экспертного сообщества и постоянно становится объектом критики. Очередная волна замечаний в адрес статистического ведомства закончилась передачей Федеральной службы государственной статистики в ведение Министерства экономического развития РФ в апреле 2017 г.². В связи с этим глава Минэкономразвития РФ Максим Орешкин заявил: «Считаю первостепенными три задачи: повысить качество статистических данных и их открытость, выйти на более высокий уровень доверия общества к статистике, снизить нагрузку на предприятия в части статистической отчетности. Указом президента устанавливается четырехмесячный срок на подготовку всех необходимых решений по переподчинению Росстата. Задача Минэкономразвития – за этот срок разработать новую стратегию развития российской статистики до 2024 года. Она будет разрабатываться открыто, совместно с экспертным сообществом, опираясь на лучшие международные практики»³.

Вместе с тем переподчинение статистического ведомства министерству, отвечающему за экономическое развитие страны, вызвало вполне обоснованные, на наш взгляд, опасения, что данные Росстата теперь будут лучше соответствовать интересам курирующего его ведомства (Алексашенко, 2017). Такой побочный прогноз переподчинения статистического ведомства может и не реализоваться, но избыточная решительность в реформировании современной отечественной статистики может привести к утрате сопоставимости имеющихся сейчас в распоряжении ведомства и пользователей временных рядов важнейших экономических показателей. Именно такой сценарий развития событий мы наблюдали уже дважды в XXI в.: при переходе с отраслевого классификатора промышленности ОКОНХ на ОКВЭД и с ОКВЭД на ОКВЭД2. Последний переход подвергся публичной критике министра Орешкина: «...с технической точки зрения оказался крайне неудачным проект перехода Росстата на новую методологию: в начале года возникли частые переносы сроков публикации, текущие оценки не всегда базируются на реальных отчетных данных»⁴. Утрата сопоставимости временных рядов индексов промышленного производства для сложного с точки зрения статистического наблюдения и болезненного для экономических властей периода 2014–2017 гг. заставляет аналитиков искать обходные пути (Каукин, Миллер, 2017).

Но даже в случае сохранения Росстатом идеальной сопоставимости рядов индексов промышленного производства пользователям данных «официального статистического учета» было бы крайне сложно понимать, что происходит в российской промышленности в последние годы. Причина – в ограниченности набора показателей официальной промышленной статистики. Ежемесяч-

² Указ Президента Российской Федерации от 03.04.2017 № 141 «О некоторых вопросах совершенствования государственного управления в сфере официального статистического учета».

³ Цит. по: ТАСС, <http://tass.ru/ekonomika/4153390> (дата обращения: 04.06.2018).

⁴ Цит. по: Интерфакс, <http://www.interfax.ru/business/554667> (дата обращения: 04.06.2018).

но (а точнее – в середине месяца, следующего за отчетным) Росстат публикует индекс промышленного производства, после чего аналитики и чиновники вступают в «борьбу за чистоту рядов» – чистят исходные временные ряды от сезонного и календарного факторов в попытке получить ответ на самый актуальный в последнее время вопрос: «Есть ли рост в российской промышленности?». На этом регулярная оценка положения дел в российской промышленности с использованием данных Росстата, как правило, заканчивается. Признать подобное положение дел даже удовлетворительным сейчас, в условиях сложно идентифицируемого состояния всей экономики и промышленности – в частности, вряд ли возможно. Такая ситуация заставляет экономические ведомства прибегать к альтернативным источникам данных по промышленности. В первую очередь – к конъюнктурным опросам предприятий⁵.

Суть конъюнктурных опросов предприятий

Конъюнктурные опросы (КО) появились в Германии осенью 1949 г. Опросы, начатые Институтом ИФО из Мюнхена (ifo Institute), имели тогда вполне прагматические цели: дополнить данные немецкой статистики (которая, по мнению немецких ученых-экономистов, не обеспечивала необходимого объема данных в первые послевоенные годы) и получать результаты с максимальной оперативностью, поскольку официальная статистика публиковалась с большим запаздыванием и подвергалась регулярным пересмотрам. Никто из сотрудников ИФО в конце 40-х гг. XX в. не предполагал, что эти опросы станут всемирно известным инструментом экономического анализа и своеобразной торговой маркой ИФО (Nerb, 2004). Теперь при упоминании аббревиатуры ИФО экономисты подразумевают в первую очередь опросы предприятий (Konjunkturtest Gewerbliche Wirtschaft) и результаты их анализа; другие направления деятельности этого института известны гораздо меньше.

Идея немецких экономистов была проста: они пытались получать данные об изменении основных показателей предприятий у руководителей предприятий напрямую, без «посредничества» органов государственной статистики.

Как ни странно, немецкие предприятия стали регулярно отвечать на такие анкеты, присыпаемые из неправительственного ИФО. И дело, скорее всего, было в том, что вместе с анкетой исследователи рассыпали на предприятия результаты предыдущего опроса. Эти результаты опережали данные официальной статистики, были интереснее по набору показателей и сопровождались анализом. Руководители предприятий по достоинству оценили оперативные данные о состоянии и перспективах немецкой промышленности. Важной особенностью опросов оказалась невысокая стоимость проведения и получения результатов. Последнее обстоятельство позволило

⁵ См., например: Доклад о денежно-кредитной политике. – Центральный банк РФ. – Выпуск № 3(19.). Сентябрь 2017. – С. 14–15; Комментарии по текущей экономической ситуации. Экономика. – Центральный банк РФ. – Выпуск № 8. Август 2017. – С. 4; Картина экономики в июле 2017 года. – Министерство экономического развития РФ. – Август 2017. – С. 4.

начать такие опросы даже научным институтам при небольших бюджетах и сохранять их в сложных экономических условиях (Boguszewski, 2008). Таким образом, «машина опросов ИФО» оказалась вполне жизнеспособной.

Уже через несколько лет, в 1950-е гг., новый источник экономических данных получает признание в других странах: аналогичные опросы начинаются в Италии, Франции, Бельгии, Великобритании, Японии, ЮАР и т.д. Разворачивание опросов в новых странах обогащает практику их проведения и создает потребность в гармонизации (унификации) опросов в разных странах с целью получения сопоставимых результатов, возможности проведения сравнительного анализа и построения производных индикаторов для групп стран. Первые шаги по гармонизации КО были сделаны в Европе уже в 1960-е гг. (European Commission, 1997). Естественно, что они имели отношение только к европейским странам. С тех пор понимание полезности опросов и использование их результатов разными потребителями в европейских странах существенно продвинулись. Опросы начали проводиться в новых секторах экономики. Развитие и гармонизация опросов в неевропейских странах стали задачей Организации экономического сотрудничества и развития (ОЭСР). С 1990-х гг. ОЭСР прилагает усилия по вовлечению в международную систему КО стран бывшего СССР (OECD, 1997).

Конъюнктурные опросы являются источником специфической информации. Они содержат данные о том, как экономические агенты оценивают (воспринимают) объективные условия своего существования и как это субъективное восприятие объективных условий «возвращается» на рынок в виде фактических действий экономических агентов и их планов (прогнозов). В этом смысле КО обеспечивают доступ к информации, которая не может быть собрана через традиционные системы статистического наблюдения. Последние описывают объективные изменения экономических явлений, опросы же показывают, как экономические агенты интерпретируют и оценивают эти изменения. Оба типа информации важны для экономического анализа и для самих агентов.

Для КО была разработана простая анкета, не предполагающая ответов в цифровой форме. Респондентам предлагалось оценить изменение выпуска, цен или спроса в терминах «рост», «нет изменений», «снижение». Такая форма ответов должна была, по мнению разработчиков, способствовать тому, что на анкету будут отвечать сами руководители предприятий, не передавая ее для заполнения из-за наличия количественных вопросов своим подчиненным (Theil, 1955). А поскольку на анкету действительно отвечали, как правило, руководители предприятий, т.е. люди, обладающие сведениями не только о фактической динамике, но и планирующие изменение выпуска или цен, то появилась возможность собирать сведения о планах и прогнозах предприятий. Кроме сведений о фактических или возможных изменениях основных показателей деятельности предприятий в анкету были включены вопросы об оценках ряда индикаторов, предполагающих ответы в терминах «выше нормы», «нормальный», «ниже нормы». В такой шкале предприятиям предлагалось оценивать, например, запасы готовой продукции или запасы сырья и материалов.

Количественных вопросов в анкете КО быть не должно. Однако потребности экономического анализа заставили организаторов опросов пойти на включение таких вопросов в анкеты, но – при существенных ограничениях и в предельно мягкой (для респондентов) форме. Первым ограничением стало минимальное количество таких вопросов. Вторым – вопросы должны задаваться о показателях, значения которых хорошо известны потенциальным респондентам из числа руководителей предприятий, которым, чтобы ответить, не требуется обращаться к отчетности или прибегать к помощи других сотрудников. По этим причинам в анкету КО рекомендуется включать два количественных вопроса: о текущей загрузке производственных мощностей и о месяцах обеспеченности предприятия нормальной работой. Первый вопрос измеряется количеством процентов, второй – количеством месяцев. Но даже в этих вопросах респондент имеет право на свое собственное мнение и не обязан воспроизводить цифры из отчетности предприятия. Такая возможность должна обязательно предоставляться респонденту, чтобы не вызвать затруднения, тем более отказа от участия в опросах. Сложность ответа на количественные вопросы стала одной из причин снижения частоты включения вопроса о загрузке мощностей в опросах ИФО (Ruppert, 2007).

Таким образом, в ходе КО собирается почти только качественная информация, а не количественные данные, типичные для обычной статистической отчетности предприятий. В результате такая анкета имеет несколько особенностей. Во-первых, она включает небольшое количество вопросов и, следовательно, не требует от респондента много времени на заполнение. Во-вторых, вопросы анкеты КО касаются основных показателей деятельности предприятия, которые хорошо известны руководителям предприятий, что тоже способствует быстрому и комфортному для респондента заполнению анкеты (OECD, 2003). Это особенно важно при проведении ежемесячных опросов. В-третьих, подавляющая часть вопросов анкеты касается только направления изменения показателей и не требует вписывания цифр. Такие формулировки вопросов и ответов снижают опасения респондентов, связанные с раскрытием коммерческой тайны. В-четвертых, то, что показатели являются общеизвестными и форма ответов на них простая, позволяет респонденту заполнить анкету самостоятельно, без обращения к документам или другим сотрудникам предприятия. В-пятых, постоянный набор вопросов анкеты и панельная организация опросов (т.е. участие в опросах одних и тех же респондентов) тоже способствуют быстрому заполнению анкеты. В-шестых, быстрое и комфортное для респондентов заполнение анкеты позволяет организатору опросов оперативно собирать анкеты и получать результаты опросов. При хорошей работе почты или использовании электронных каналов связи оперативность выдачи результатов может возрасти еще больше. В-седьмых, формулировки вопросов и ответов должны быть привычны и понятны для респондентов, а не для организатора опросов (OECD, 2002). В-восьмых, цели опроса и последующее использование его результатов должны быть совершенно ясны для участников опроса (OECD, 2003). Любое сомнение респондента в честности или порядочности организатора опроса ведет к умышленному искажению отве-

тов, пропуску отдельных ответов или просто к незаполнению всей анкеты. Но если организатору опросов удастся установить доверительные и необременительные (для респондентов, конечно) отношения с руководителями предприятий, то он получает в свое распоряжение качественный канал оперативного сбора принципиально новой информации.

Основная часть результатов каждого КО получается в виде долей предприятий, выбравших один из ответов – «рост», «нет изменений», «снижение», или один из ответов из набора «выше нормы», «нормальный», «ниже нормы». Результаты отдельного опроса с набором таких вопросов и ответов малоинформативны, поскольку дают представление только о том, сколько предприятий и как изменило выпуск в текущем месяце или сколько предприятий и как собирается изменить цены в следующие месяцы. Однако картина принципиально меняется, когда такие опросы проводятся ежемесячно в течение достаточно длительного периода времени (несколько лет), т.е. накапливаются временные ряды долей предприятий, которые сообщали о каждом из трех возможных изменений основных показателей предприятия, причем как уже произошедшем, так и предполагаемом. Но здесь возникает проблема восприятия и интерпретации одновременно трех рядов ответов на каждый анкетный вопрос.

Для представления результатов КО в более простом и обозримом виде используется, как правило, баланс ответов, который рассчитывается как разность долей ответов «рост» и «снижение» или долей ответов «выше нормы» и «ниже нормы». Баланс может принимать значения от -100 (абсолютно все респонденты выбрали ответ «снижение» или «ниже нормы») до +100 (абсолютно все респонденты выбрали ответ «рост» или «выше нормы»). Как видно из этой простой формулы, ответы «нет изменений» или «норма» в расчете баланса не используются. По мнению экспертов ОЭСР, такая потеря информации не очень существенна в случае КО. Если все-таки потребность в этом показателе возникает, его можно приводить на одном графике с балансом (OECD, 2003). Баланс стал вычисляться по результатам КО не сразу.

Распространение результатов КО является неотъемлемой составляющей деятельности любого национального организатора опросов. Причем в тех случаях, когда опросы основаны на добровольном участии предприятий, распространение результатов в части их возврата респондентам становится критически важной деятельностью, поскольку без интереса предприятий-участников к возвращаемым результатам само существование опросов может оказаться под вопросом. Первоначально основной целью КО был сбор информации об условиях бизнеса в интересах участников опросов (что объясняло организацию опросов преимущественно торговыми ассоциациями). Сейчас результаты КО имеют гораздо более широкое использование различными категориями пользователей. Важными получателями результатов считаются государственные органы, исследовательские организации, международные организации, средства массовой информации и другие заинтересованные потребители. Но предприятия остаются основными потребителями результатов КО. Они получают детальные данные с разбивкой по секторам, что позволяет предприятиям оценивать ситуацию

на своих рынках не только собственными глазами, но и видеть ее с точки зрения своих конкурентов, иметь данные не только о фактических изменениях, но и о прогнозах и планах, существующих в отрасли.

Для стран, начинающих КО, важность распространения их результатов объясняется еще и тем обстоятельством, что перед организатором опросов стоит задача получения доли на информационном рынке. Новый вид экономической информации, каким в первые годы являются КО почти для всех потенциальных потребителей, должен постепенно стать привычной составляющей потока экономических данных, как это уже стало в большинстве стран Западной Европы. Для стран с переходной экономикой организатору опроса приходится преодолевать еще и особенности образовательной подготовки части чиновников и аналитиков, привыкших работать исключительно с традиционной статистикой и не воспринимающих всерьез возможность применения в экономическом анализе результатов опросов вообще и тем более таких непривычных показателей, как оценки запасов и прогнозы производителей. Впрочем, с естественным течением времени и сменой поколений чиновников и аналитиков восприимчивость к результатам КО со стороны этих категорий потенциальных потребителей будет расти, а экономические кризисы и консервативность официальной статистики станут лучшим аргументом в пользу использования КО.

Конъюнктурные опросы ИЭП

Впервые конъюнктурный опрос российской промышленности по европейской гармонизированной программе на территории Российской Федерации был проведен Институтом экономической политики в марте 1992 г. Сначала опросы проводились с шагом в два месяца для проверки и отладки технологической цепочки, а с сентября 1992 г. они проводятся ежемесячно. В мае 2017 г. ИЭП провел юбилейный, 300-й опрос российской промышленности.

Все опросы ИЭП проходят по классической схеме. Анкеты очередного и результаты предыдущего опросов ежемесячно высылаются на предприятия. Респонденты ИЭП находятся на всей территории Российской Федерации – от Балтийского моря до Тихого океана. Единственным мотивом для предприятий принимать участие в наших опросах являются заинтересованность в получении результатов предыдущих опросов и понимание полезности этих опросов для других «потребителей». Никаких административных рычагов для вовлечения предприятий в опросы ИЭП и их удержания в панели не используется, поскольку у ИЭП их просто не существует.

В основу организации конъюнктурных опросов ИЭП было положено несколько простых принципов. Во-первых, за основу была взята европейская гармонизированная программа опросов. Это позволило сразу решить проблему списка вопросов анкеты и обеспечить сопоставимость результатов как со странами, давно проводящими такие опросы, так и со странами бывшего СССР и Восточной Европы, только начавшими опросы примерно в те же годы. Данный подход обеспечил признание результатов ИЭП в Организации экономического сотрудничества и развития. Во-вторых, дизайн анкеты

был изначально сделан предельно простым и дружелюбным к респондентам. За основу взята анкета Конфедерации британской промышленности, любезно предоставленная главой опросного подразделения этой организации Джонатаном Вудом (Jonathan Wood). Выбранный дизайн позволял легко создавать и модернизировать анкеты. В-третьих, все программное обеспечение было выбрано максимально простым и массовым с целью обеспечения легкости обучения персонала и устойчивости функционирования всей «производственной цепочки». Это полностью себя оправдало, поскольку за все 25 лет опросов не возникало сколько-нибудь серьезных или неисправимых проблем в этой области. В-четвертых, выбранный в 1992 г. принцип накопления и хранения исходных данных позволил решать все возникающие задачи обработки результатов конъюнктурных опросов. В том числе самую болезненную для большинства аналитиков – переход с классификатора ОКОНХ на классификатор ОКВЭД, а затем на ОКВЭД2. В результате временные ряды результатов опросов ИЭП с 1992 г. по настоящее время могут строиться по всем трем отраслевым классификаторам одновременно. Заметим, что решение задачи перехода с одного классификатора на другой было лишь побочным результатом использования выбранной в 1992 г. платформы хранения данных, она разрабатывалась для целей максимально полного использования возможностей результатов ежемесячных конъюнктурных опросов.

Важным фактором получения надежных и достоверных результатов КО является установление обратной связи с респондентами. Во время каждого опроса руководители предприятий получают бланк анкеты, который необходимо заполнить, и результаты предыдущего опроса. Обязательное регулярное возвращение обобщенных результатов всем организациям, которые приняли участие в опросе, – это единственная возможная форма поощрения к участию в обследованиях. Схема «индивидуальные ответы – обобщенные итоги» сводит на нет вероятность умышленного искажения данных, возвращаемых предприятиями в ИЭП. Прямое общение с руководителями предприятий позволяет включать в анкету вопросы о таких показателях, которые не могут быть измерены традиционной статистикой, но, несомненно, отслеживаются менеджерами: помехи росту производства, ожидания, оценка уровня конкуренции на рынках сбыта, оценка последствий девальвации рубля и проблемы импортозамещения.

Поскольку изначально ИЭП при развертывании системы КО ориентировался на европейскую гармонизированную программу, то решение проблемы с начальным (базовым) списком вопросов анкеты было очевидно. Это позволило ускорить начало опросов и уделить больше внимания другим, нетипичным для научной организации и поэтому критичным для нового проекта аспектам. Вопросы анкеты делятся на три смысловых блока. Первый – фактические изменения основных показателей по шкале «рост», «нет изменений», «снижение». Второй блок – субъективная оценка показателей по шкале «выше нормы», «нормальный», «ниже нормы». Третий блок – ожидаемые изменения показателей в терминах «возрастет», «не изменится», «снизится». Основные вопросы задаются ежемесячно, другая часть – ежеквартально, некоторые – раз в полгода или раз в год.

Опыт уже первых лет проведения КО дал основания для модификации европейской гармонизированной анкеты (при сохранении базовых вопросов), которая существенно увеличила ее информационный потенциал в условиях российской экономики. Последующие годы и этапы развития российской экономики в целом и промышленности в частности еще больше обогатили состав вопросов конъюнктурной анкеты. Кризисы российской экономики (дефолт 1998 г., кризисы 2008–2009 гг. и 2015–2016 гг.) стали реальным испытанием и для набора вопросов анкеты, и для организации опросов. Но в каждый кризис (и предкризисные периоды тоже) ИЭП проверял опросы «полевым» опытом мониторинга ситуации в российской промышленности. В результате такой подготовки ИЭП сумел показать особенности прохождения российской промышленности через кризис 2015–2016 гг.

Возможности конъюнктурных опросов предприятий

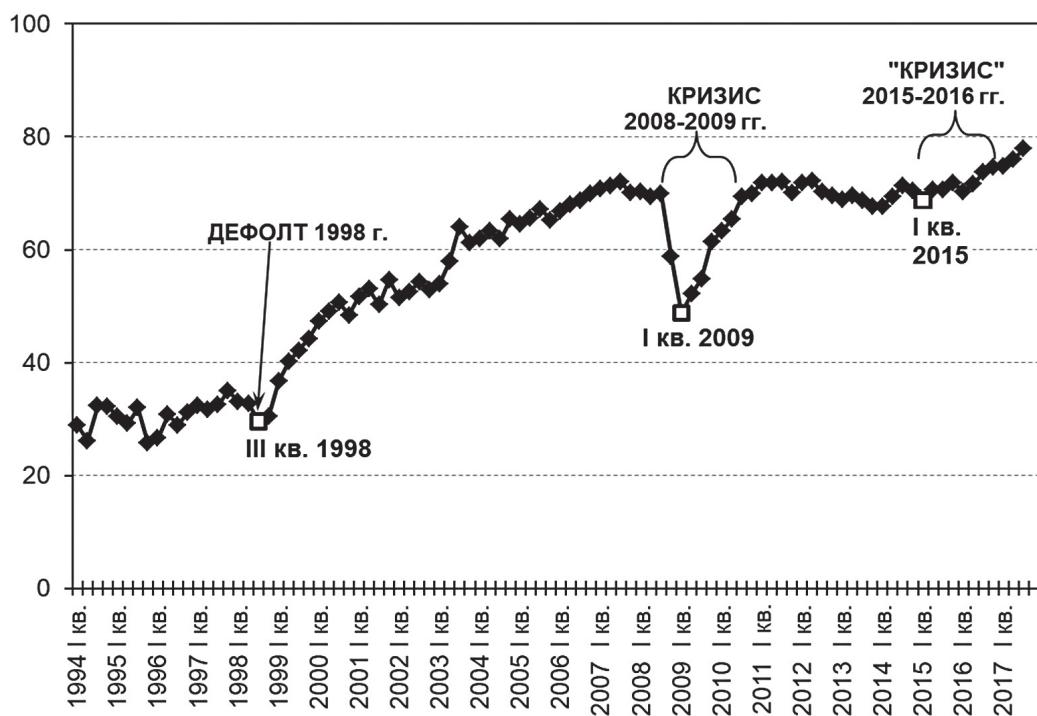
Кризис 2015–2016 гг. оказался необычным для российской промышленности. Абсолютное большинство индикаторов опросов ИЭП не показало ничего кризисного в динамике и оценке состояния промышленных предприятий. Ни изменения спроса, ни изменения выпуска, ни изменения занятости не продемонстрировали никакого кризисного обвала в начале 2015 г. Аналогичная некризисная картина была получена и при анализе оценок предприятиями (по шкале «выше нормы», «нормальные», «ниже нормы») объемов спроса, объемов запасов готовой продукции, текущей занятости, имеющихся мощностей. Опросы не зарегистрировали в 2015 г. (даже в начале года) привычного кризисного снижения удовлетворенности спросом, взлета избыточности запасов готовой продукции, занятости и мощностей. С каждым месяцем кризисного 2015 года становилось ясно, что события в российской промышленности развиваются как-то непривычно – предприятия не видели ничего критического, кризисного в состоянии отрасли. Однако анализ отдельных показателей опросов ИЭП не позволял сформировать наглядную картину положения дел в российской промышленности. В такой ситуации был разработан и выведен на рынок новый производный индикатор на основе отдельных показателей (вопросов) анкеты КО – Индекс адаптации (нормальности) российской промышленности.

Индекс строится как среднее арифметическое доли нормальных оценок шести показателей: спроса, запасов готовой продукции, запасов сырья, имеющихся производственных мощностей, текущей занятости, финансово-экономического положения предприятий. Институт экономической политики им. Е.Т.Гайдара собирает весь набор таких оценок с 1994 г. Индекс рассчитывается ежеквартально. Интерпретация Индекса адаптации (нормальности) проста – он показывает степень адаптации российской промышленности к текущим экономическим условиям. Или: насколько нормальными являются текущие условия функционирования для российской промышленности. Этот простейший (но использующий своеобразный набор исходных данных) сводный показатель позволил, тем не менее, предельно наглядно оценить (описать) состояние российской промышленности в течение исто-

рически длительного и уникального периода нашей новейшей экономической истории, в том числе в 2015–2016 гг. Заметим, что до недавнего времени потребности в таком сводном показателе для анализа положения дел в российской промышленности не было, хотя все необходимые данные и возможность расчета были всегда.

Рисунок 1

**Индекс адаптации (нормальности) промышленности,
1994–2017 гг., % (доля предприятий, оценивающих
свои показатели как «нормальные»)**



Источники: Здесь и далее – расчеты автора.

Индекс адаптации (нормальности) показал, что кризис 2015–2016 гг. не воспринимался российской промышленностью как полноценный (привычный) кризис на фоне преддефолтного периода и кризиса 2008–2009 гг. Наш индикатор оставался в 2015 г. в коридоре обычных некризисных значений 69–72%, т.е. от 69 до 72% предприятий российской промышленности оценивали свое состояние как «нормальное» в течение первого кризисного года (см. рис. 1). При этом в конце 2015 г. Индекс нормальности вновь достиг исторического максимума в 72%, который ранее регистрировался только в 2011–2012 гг. Следующий (2016) кризисный год оказался еще более удивительным. Российская промышленность смогла поднять уровень своей адаптации к текущим экономическим условиям до 75%, что стало очередным рекордом показателя. Но в 2017 г. предприятия решили не останавливаться на достигну-

том: на этапе выхода из кризиса 2015–2016 гг. уровень адаптации продолжал увеличиваться и достиг уже 78%. Новый показатель позволяет сделать три вполне определенных вывода о характере кризиса 2015–2016 гг. в российской промышленности. Во-первых, события этих двух лет не воспринимались российской промышленностью как кризисные. Большинство предприятий считало их нормальными – в прямом смысле этого слова (и наши измерения это подтвердили). Во-вторых, вялотекущий характер кризиса 2015–2016 гг. позволил промышленности прекрасно адаптироваться к реалиям экономической действительности и даже достичь новых рекордов. И в-третьих, с таким кризисом российская промышленность определенно еще не сталкивалась.

Наши выводы о характере кризиса 2015–2016 гг. существенно расходятся с представлениями большинства чиновников и аналитиков. И причина такого расхождения лежит в том, что промышленная статистика Росстата до сих пор является общепризнанным (единственным) источником данных об этой отрасли, несмотря на все проблемы и претензии, которых с каждым годом становится все больше.

При этом стоит заметить, что динамика Индекса адаптации (нормальности) в 1994–2014 гг. полностью укладывается в сложившиеся (устоявшиеся) представления о состоянии отрасли до начала 2015 г. К условиям первых лет экономических реформ в 1994–1998 гг. смогли адаптироваться только 26–35% предприятий. После августовского дефолта 1998 г. наступает период устойчивого улучшения положения российских промышленных предприятий, в ходе которого Индекс достигает 71% (в середине 2007 г.). Общепризнанный кризис 2008–2009 гг. буквально обрушивает оценку предприятиями нормальности экономических условий на 21 процентный пункт за IV кв. 2008 г. и I кв. 2009 г. Со II кв. 2009 г. Индекс демонстрирует уже восстановление положения дел в российской промышленности, которое завершается в III кв. 2010 г. достижением 69% уровня адаптации. До начала 2015 г. Индекс пребывает в интервале 69–72%. В этом же интервале Индекс пребывает и в первые шесть кризисных кварталов – до середины 2016 г.

Таким образом, конъюнктурные опросы ИЭП продемонстрировали неожиданные для большинства пользователей данных Росстата особенности кризиса 2015–2016 гг. в российской промышленности. Предыдущий кризис, 2008–2009 гг., тоже был лучше «отмониторен» конъюнктурными опросами, чем данными официальной статистики. Но если сейчас стояла задача вскрытия качественных особенностей прохождения российской промышленности через кризисные для страны 2015–2016 гг., то осенью 2008 г. конъюнктурными опросами решалась задача как можно более оперативного мониторинга состояния промышленности. И опять опросы ИЭП оказались тогда лучше (т.е. оперативнее) данных Росстата.

Напомним, осенью 2008 г. в воздухе витало ожидание кризиса, и определенно увеличивался спрос на опережающие индикаторы. Однако данные Росстата по промышленности публиковались в лучшем случае в середине месяца, следующего за отчетным. Результаты конъюнктурных опросов ИЭП озвучивались в последний день отчетного месяца или в первый день (первые дни) следующего месяца. В такой ситуации лаборатория конъюн-

ктурных опросов ИЭП (тогда ИЭПП – Института экономики переходного периода) перешла на еженедельный график публикации результатов опросов, но – в краткой форме Индекса промышленного оптимизма ИЭП. Впервые этот Индекс был опубликован 22 октября 2008 г. и показал, что ситуация в промышленности балансирует между оптимизмом (положительные значения Индекса) и пессимизмом (отрицательные значения). Газета «КоммерсантЪ» так оценила новый опросный показатель ИЭП: «Несмотря на то, что пессимизм промышленников еще и правда не стал всеобщим, оптимизм исчезает с беспрецедентной скоростью. Вероятно, это и есть главное объяснение, почему ИЭПП решил предложить новый оперативный инструмент экономического анализа. События на рынках развиваются так быстро, что запаздывание статистической информации может оказаться критичным для оценки и принятия решений» (Николаева, 2008).

Первые опросные итоги кризисного ноября 2008 г. были подведены ИЭПП уже 18 ноября. Фронтальный обвал выпуска (основного индикатора положения дел в отрасли) осторожно был нами описан так: «Первый расчет ноябрьского значения Индекса показал резкий рост пессимизма в российской промышленности. Значение Индекса снизилось сразу на 33,8 пункта и достигло 38,2. Такого низкого значения Индекса в последефолтный период не было ни разу, а в преддефолтный – близкие значения регистрировались только в 1995–1996 гг.». Хотя еще оставалась надежда, что надвигающийся кризис будет мягким: «Уверенно говорить о выборе из сценариев “обвала” и “посадки” на основании этих данных (о потреблении электроэнергии. – *Авт.*) по-прежнему нельзя, пока возможно констатировать лишь то, что по состоянию на 24 ноября (последние данные) говорить о реализации сценария “обвала” нет оснований» (Бутрин, 2008). При этом попытка (как потом оказалось – неудачная) использовать для оперативного мониторинга данные о потреблении электроэнергии обосновывалась следующими соображениями: «Скорость изменения ситуации в экономике не позволяет в оперативном режиме (с точностью до недели) говорить о развитии ситуации в промышленности. Для этого в острой фазе кризиса недостаточно сводок Росстата. Конъюнктурные опросы и опережающие индексы также не слишком эффективны» (Бутрин, 2008).

Сомнения в достоверности данных опросов ИЭП того периода звучали и со стороны академической науки. По мнению директора одного из институтов, «микросчет» экономических процессов в разрезе недель и даже месяцев «бессмысленен», а статистика Росстата, которую собирает «полмиллиона человек», не показывает никакого спада в промышленности⁶. Заметим, что это заявление было сделано 7 ноября 2008 г., т.е. уже в первом и самом тяжелом месяце того «классического» общепризнанного кризиса.

Впрочем, глава статистического ведомства в декабре 2008 г. все же заявил, что Федеральная служба государственной статистики РФ с 2009 г. будет проводить подекадный мониторинг ряда важнейших экономических показателей в стране. Результаты этого мониторинга будут представлять-

⁶ См. <https://www.bfm.ru/news/5673>

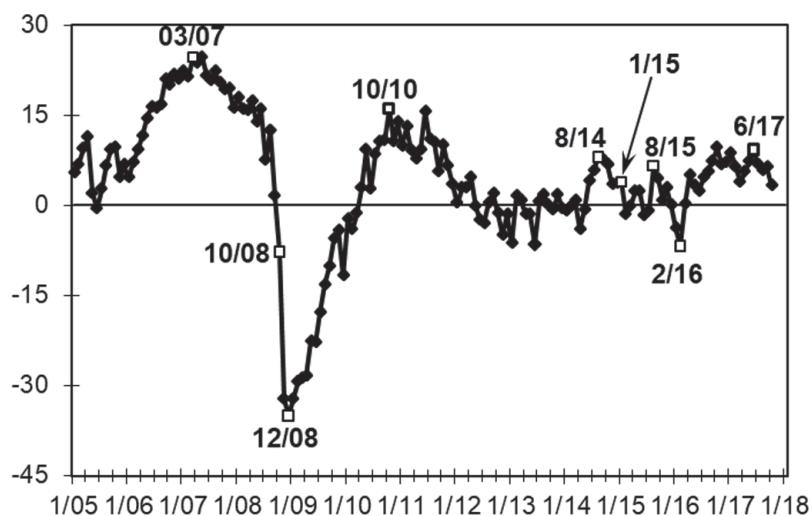
ся в различные правительственные комиссии⁷. Вопрос их обнародования тогда не был решен. Однако никаких следов (или упоминания) нового подекадного мониторинга производства важнейших видов промышленной продукции, цен производителей, цен на ряд важнейших потребительских товаров, задолженности по зарплате и состояния трудовых ресурсов до сих пор обнаружить не удалось.

Скорее всего, такой мониторинг действительно сложная работа для традиционной статистики. Но опросная статистика, как показывает 25-летний опыт Лаборатории конъюнктурных опросов ИЭП, вполне может решать такие задачи. Мониторинг кризисов 2008–2009 гг. и 2015–2016 гг. позволил проверить на практике разные показатели и режимы распространения данных опросов. В результате сейчас итоги опросов российской промышленности публикуются ИЭП именно подекадно.

Индекс промышленного оптимизма ИЭП, раньше всех зарегистрировавший кризис 2008–2009 гг., прекрасно «отработал» и в кризис 2015–2016 гг. Этот производный индикатор показал, что никакого кризисного обвала в российской промышленности в начале 2015 г. не было (см. рис. 2). Показатель весь первый кризисный год пребывал в обычном для предыдущих некризисных лет интервале значений, чаще даже бывая положительным, чем отрицательным. Худшей точкой последнего кризиса для российской промышленности стал февраль 2016 г., когда предприятия окончательно убедились, что обещанного им «отскока от дна кризиса» в 2015 г. не произошло, кризис становится затяжным, как и выход из него. Но уже к апрелю 2016 г. российская промышленность смогла восстановить прежний и совсем некризисный уровень оптимизма, который она сохраняет до конца 2017 г.

Рисунок 2

**Индекс промышленного оптимизма ИЭП,
2005–2017 гг.**



⁷ См. <http://www.rbc.ru/rbcfree/news/20081223151627.shtml>

Однако оперативность и возможность рассчитывать сводные (и удобные для восприятия) показатели – не единственное достоинство опросной статистики. Этот источник данных заставляет порой совсем по-иному взглянуть на устоявшиеся представления о российской промышленности. Проиллюстрируем этот тезис на актуальных (если не сказать – болезненных) для предприятий и экономической политики проблемах девальвации рубля и импортозамещения.

Наши опросы 2014 г. (апреля и декабря) показали критическую зависимость российских промышленных предприятий от импортного оборудования, комплектующих, сырья. В апреле 2014 г., когда, напомним, термины «девальвация» и «импортозамещение» не входили в лексикон основной массы политиков, экономистов и производственников, 40% предприятий признали, что они не смогут отказаться от закупок импорта ни при каком повышении цен на него. Тогда этот результат воспринимался спокойно и имел больше академическое значение, чем политическое. По воле случая в точности такой же вопрос был включен и в декабрьскую (2014 г.) анкету и – что удивительно! – показал в точности такие же результаты: около 40% предприятий по-прежнему были не готовы отказаться от закупок импорта ни при каком повышении цен на него. Даже в условиях самой сильной после августа 1998 г. девальвации рубля, когда скачок цен на импорт перешел из гипотетического сценария в реальность.

Следующим удивительным результатом стали итоги февральского (2015 г.) опроса промышленных предприятий о наиболее эффективных тогда, в начале кризиса 2015–2016 гг., антикризисных мерах. Отечественные производители, которым положено было радоваться девальвации рубля вследствие неизбежного переключения потребителей с подорожавшего импорта на российские аналоги, на первое место в числе рассматриваемых в тот период чиновниками антикризисных мер поставили укрепление рубля. Тогда за него проголосовали 58% предприятий – столько же, сколько и за снижение налогов. А за продолжение девальвации в феврале 2015 г. выступили только 2% предприятий (см. рис. 3). Однако этот результат 2015 г. полностью стыкуется с итогами опросов 2012–2014 гг. об эффективности антикризисных мер в случае возможной и регулярно обсуждавшейся в тот период «второй волны кризиса». За гипотетическую (тогда) резкую девальвацию рубля в межкризисный период высказывались только 3% предприятий, за плавную девальвацию – 12%.

Вполне определенное отношение российской промышленности к девальвации рубля заставило нас начать в 2015–2017 гг. мониторинг влияния курса рубля на основные показатели деятельности предприятий и нужные для промышленности изменения его курса.

По прямым оценкам предприятий, самую сильную зависимость от курса рубля имеет себестоимость российской продукции: независимость своих издержек от курса рубля признавали в среднем за три года мониторинга только 11% предприятий. При этом промышленности удалось снизить зависимость издержек от курса рубля только на 9 процентных пунктов: с 93% в 2015 г. до 84% в 2017 г. Направление влияния девальвации рубля на себестоимость российской продукции вполне (в абсолютном большинстве случаев) определенно – увеличение. Об этом в 2015 г. сообщили 72% и по 67%

предприятий в 2016 и 2017 гг. Снизить издержки (за счет удачного перехода на более дешевые российские аналоги) удалось только 1–2% предприятий. А еще 19% предприятий сообщили о том, что девальвация рубля не сказалась на величине их издержек в силу, видимо, использования заменителей без увеличения их цен. В такой ситуации российская промышленность логично демонстрирует максимальную востребованность в укреплении курса рубля именно для снижения своих издержек. Этот результат был получен нами и в 2015, и в 2016, и в 2017 гг. Особенно велика была потребность в укреплении рубля в январе 2016 г., когда курс национальной валюты оказался самым слабым для всего постдевальвационного периода. Тогда о необходимости роста курса рубля для снижения себестоимости продукции заявили 78% предприятий.

Рисунок 3

Оценка промышленными предприятиями эффективности новейших антикризисных мер, февраль 2015 г., %



Российской промышленности, несмотря на традиционные представления, не удалось в итоге добиться роста внутреннего спроса на свою продукцию в результате девальвации декабря 2014 г. Все три года нашего мониторинга балансы влияния обесценения рубля на внутренние продажи, по оценкам предприятий, были отрицательными и постепенно увеличивали свое негативное влияние с -6 до -15 пунктов. При этом большинство предприятий (более 60%) считает, что внутренний спрос на производимую ими продукцию либо не зависит от курса рубля, либо не изменился под влиянием его колебаний. Максимальный рост спроса на российскую продукцию под влиянием девальвации пришелся на 2015 г. и был отмечен 17% предприятий. Однако к 2017 г. доля таких предприятий снизилась до 11%. Последнее объясняется как укреплением курса рубля, так и постепенной адаптацией покупателей к новым экономическим условиям. А вот негативное (кризисное) воздействие девальвации рубля на внутренний спрос, опять же по оценкам предприятий, демонстрировало, скорее, обратную динамику (отмечались последовательно 23, 25 и 26% предприятий) или по крайней мере было стабильным.

Это неожиданное для теоретиков обстоятельство предопределило потребность практиков (руководителей российских промышленных предприятий) в укреплении рубля для стимулирования роста внутреннего спроса на собственную (российскую) продукцию. Особенно велика была эта потребность в январе 2016 г., когда курс национальной валюты был самым низким для всех месяцев 2014–2017 гг., а мы по воле случая именно в январе 2016 г. задали вопрос о предпочтительном для российской промышленности изменении этого курса для роста внутреннего спроса на российскую промышленную продукцию. На основе опыта первого постдевальвационного и кризисного года, когда курс рубля продемонстрировал и максимум, и минимум (которые до сих пор «не побиты»), более половины (52%) российской промышленности высказалось за укрепление курса рубля. А ослабление курса для роста внутреннего спроса тогда нужно было только 12% предприятий. Сейчас (все-таки в условиях укрепления курса в 2017 г. и начинающегося, возможно, выхода из кризиса) потребность в дальнейшем усилении курса рубля стала меньше – только 27% предприятий нуждаются в нем для роста внутреннего спроса на свою продукцию. Но дальнейшее укрепление оставалось самым востребованным изменением курса национальной валюты для роста внутреннего спроса в 2017 г.

Столь же определенное изменение курса нужно российской промышленности и для роста инвестиций. Все годы нашего мониторинга промышленность заявляла, что укрепление рубля будет стимулировать капитальные вложения на предприятиях. Особенно велика была доля таких оценок традиционно в начале 2016 г., когда курс был особенно слаб, а промышленность впервые после вступления России в войну санкций и обвала инвестиционных планов стала избавляться от инвестиционного пессимизма. Тогда 73% предприятий заявили, что им нужно укрепление рубля для роста инвестиций, и только 8% нуждались в его ослаблении для стимулирования капиталовложений. В марте 2017 г., когда инвестиционные планы промышленности продемонстрировали кризисный и положитель-

ный максимум, а среднемесячный устанавливаемый Банком России курс рубля составил 58 руб., дальнейшее укрепление рубля могло бы стимулировать инвестиции почти у половины российской промышленности, а ослабление – у 11% предприятий. Баланс влияния курса на инвестиции по-прежнему остается определенно в пользу укрепления рубля.

В качестве заключения к мониторингу проблем девальвации и импортозамещения стоит привести комментарий к одной из статей газеты «Ведомости»: «Сам производственник и могу с уверенностью сказать, что дешевый рубль нужен только правительству, чтобы было легче латать дыры в бюджете. Для производства дешевый и постоянно меняющийся рубль губителен. Постоянны скачки спроса (в том числе и на экспорт) не способствуют четкому планированию технологических процессов. Все разговоры о том, что слабый рубль способствует увеличению экспорта, ошибочен, так как он только на время дает преимущества производителю, но приходит время, когда необходимо производить техническое обслуживание оборудования, а там все расходники за евро, я уже не говорю о постоянной модернизации производства, без которой нормальное производство умрет уже через пять лет. Наши товары должны быть конкурентны при курсе в 50–55 руб/дол, иначе работайте над снижением себестоимости путем модернизации производств, а не ждите дешевого рубля, чтобы однократно сорвать куш на экспорте»⁸.

Подводя итог 25-летней истории конъюнктурных опросов в российской экономике, можно сделать следующие выводы. Во-первых, этот источник данных «состоялся» и с каждым годом (тем более – кризисным) приобретает все больший авторитет. Сейчас результаты конъюнктурных опросов явно или неявно используются всеми экономическими ведомствами. Во-вторых, конъюнктурные опросы обладают определенными преимуществами по сравнению с официальным статистическим учетом. Особенно в российских условиях. К их числу можно отнести: оперативность, гибкость организации и состава показателей, возможность мониторинга показателей, недоступных традиционной статистике. В-третьих, результаты опросов способны существенно расширить прямое описание экономических реалий. В-четвертых, классическая схема организации опросов предполагает участие в опросах руководителей предприятий по экономической вертикали, что позволяет собирать оценки, представления, прогнозы лиц, принимающих решения на предприятиях. В-пятых, та же классическая схема организации опросов предполагает распространение результатов среди участников опросов. Это обстоятельство в условиях ограниченности набора и доступности анализа показателей официальной статистики определенно способствует снижению неясности текущей экономической ситуации и ее перспектив среди предприятий.

Вместе с тем конъюнктурные опросы имеют и ограничения. Они не способны заменить традиционную количественную статистику, поскольку

⁸ См.: <https://www.vedomosti.ru/comments/economics/articles/2016/05/31/643040-krepkii-rubl#/hcm=1464678622516330>

собирают данные в порядковой шкале. По этой же причине попытки включения в анкету классических цифровых показателей приводят к отказу предприятий от участия в опросах или к передаче функций заполнения анкет на нижний должностной уровень. Однако понимание «формата» конъюнктурных опросов и обучение респондентов в рамках панельной организации опросов способны частично преодолеть эти ограничения.

ЛИТЕРАТУРА

1. Алексашенко С. Министр против цифр: почему Росстат не стоит подчинять Минэкономразвития // РБК. Мнения. – 2017. URL: <http://www.rbc.ru/opinions/economics/23/03/2017/58d37f2e9a79477818f9f974> (дата обращения: 06.06.2018).
2. Бутрин Д. Принудительная энергоэффективность // Коммерсантъ. – № 217 (4034). – 28.11.2008.
3. Каукин А., Миллер Е. Новая методика Росстата и динамика отраслевых индексов производства в начале 2017 года // Мониторинг экономической ситуации в России. Тенденции и вызовы социально-экономического развития. – 2017. – № 11 (49). – С. 16–21.
4. Николаева Д. Оптимизм средних компаний стремительно снижается // Коммерсантъ. – № 194 (4011). – 24.10.2008.
5. Boguszewski P. Some Remarks on Business Surveys in the National Bank of Poland // The Use of Surveys by Central Banks. IFC Bulletin. 2008. N. 30. P. 104–114.
6. European Commission. The Joint Harmonised EU Programme of Business and Consumer Surveys // European Economy. Directorate-General for Economic and Financial Affairs, Brussels 1997. N. 6.
7. Nerb G. Survey Activity of the Ifo Institute // The Use of Ifo Survey Data in Business Cycle and Monetary Policy Analysis, Physica Verlag. 2004. P. 1–15.
8. OECD. Business Tendency Surveys – A Handbook. OECD. Paris. 2003.
9. OECD. Development of Business and Consumer Surveys in Central and Eastern Europe: Summary of Workshops 1991–1996 // OECD/GD(97)84. OECD. Paris. 1997.
10. OECD. Measuring the Non-Observed Economy – A Handbook. OECD. Paris. 2002.
11. Ruppert W. Business Survey in Manufacturing // Handbook of survey-based business cycle analysis. Elgar, Cheltenham. 2007. P. 19–32.
12. Theil H. Recent Experiences with the Munich Business Test (An Expository Article) // Econometrica. 1955. April. P. 184–192.

BUSINESS TENDENCY SURVEYS IN THE SYSTEM OF MODERN STATISTICS

Sergey V. Tsukhlo

Ph.D, Head of Business Surveys Department,
Gaidar Institute for Economic Policy.
Address: 3–5, build. 1, Gazetny Lane,
125993 Moscow, Russian Federation.
E-mail: tsukhlo@iep.ru

Abstract

The article examines the opportunities of business tendency surveys of enterprises in condition of official statistics imperfection considering the specifics of the development of Russian economy in recent years. Based on the 25-year experience of the Gaidar Institute for Economic Policy in the field of conducting and developing monthly surveys of industrial enterprises, it is shown that this data source is able to supplement the results of traditional statistics, and in the case of 2008–2009 crises, and 2015–2016 – significantly surpass them. So, the crisis of 2008–2009 was registered by IEP surveys a month before its official recognition, and especially in 2015–2016 – the absence of a crisis recession in demand, output and employment, with confident control of enterprises for finished products – were already shown in the first quarter of 2015. The flexible organization of the business surveys of the IEP allows one to directly measure many of the actual phenomena that are relevant at the present stage, but which are not available to traditional statistics. In years 2012–2017, the results of IEP surveys showed a low demand for devaluation of the ruble as a protective measure for the domestic producer in the context of a critical dependence of the industry on imported equipment, components and raw materials. For this reason, the strengthening of the ruble in February 2015 was considered by Russian enterprises to be the most important anti-crisis measure and the assessment of the actual impact of the ruble devaluation on demand, costs and investments in 2015–2017 were always negative.

Keywords: statistics; Russian industry; business surveys; Russian crises; aggregated indicators; devaluation; import substitution.

Citation: Tsukhlo, S.V. (2018). Kon'yunkturnye oprosy predpriyatiy v sisteme sovremennoy statistiki [Business Tendency Surveys in the System of Modern Statistics]. *Public Administration Issues*, no 2, pp. 30–49 (in Russian).

REFERENCES

1. Boguszewski, P. (2008). Some remarks on business surveys in the National Bank of Poland. *The use of surveys by central banks, IFC Bulletin*, no 30, pp. 104–114.
2. European Commission (1997). The Joint Harmonised EU Programme of Business and Consumer Surveys. *European Economy*, no 6, Directorate-General for Economic and Financial Affairs, Brussels.

3. Nerb, G. (2004). Survey Activity of the Ifo Institute. In: J. Sturm, T. Wollmershauser (eds). In: *Ifo Survey Data in Business Cycle and Monetary Policy Analysis*. Heidelberg: Physica, pp. 1–15.
4. OECD (1997). *Development of Business and Consumer Surveys in Central and Eastern Europe: Summary of Workshops 1991–1996*. OECD/GD(97)84, OECD, Paris.
5. OECD (2002). *Measuring the Non-Observed Economy – A Handbook*. OECD, Paris.
6. OECD (2003), *Business Tendency Surveys – A Handbook*. OECD, Paris.
7. Ruppert, W. (2007). Business Survey in Manufacturing. In: Goldrian G. (ed.) *Handbook of Survey-Based Business Cycle Analysis*. Cheltenham: Edward Elgar Publishing, pp. 19–32.
8. Theil, H. (1955). Recent Experiences with the Munich Business Test (An Expository Article). *Econometrica*, April, pp. 184–192.
9. Aleksashenko, S. (2017). Ministr protiv tsifr: pochemu Rosstat ne nado podchinyat' Minekonomrazvitiyu [The Minister against Figures: Why it is not Need to Subordinate Rosstat to the Ministry of Economic Development]. *RBC, Opinion*. Available at: <http://www.rbc.ru/opinions/economics/23/03/2017/58d37f2e9a79477818f9f974> (accessed: 6 June, 2018).
10. Butrin, D, (2008). Prinuditelnaya energoeffektivnost' [Compulsory Energy Efficiency]. *Kommersant*, no 217(4034), 28, November.
11. Kaukin, A. & Miller, E. (2017). Novaya metodika Rosstata i dinamika otrazhennykh indeksov proizvodstva v nachale 2017 [Rosstat's New Methodology and the by-Industry Movement Patterns of Production Indices in Early 2017]. *Monitoring of Russia's Economic Outlook: Trends and Challenges of Socio-Economic Development*, no 11, vol.49, June, pp. 16–21.
12. Nikolaeva, D. (2008). Optimizm srednikh kompaniy stremitel'no snizhaetsya [The Optimism of the Medium-Sized Companies is Rapidly Declining]. *Kommersant*, no 194 (4011), 24, October.