

«Цифромания» ресурсного «непроклятия». Пolemические заметки по поводу некоторых эконометрических исследований*

В.О. САДОВСКАЯ, Новосибирский государственный университет. E-mail: sadleriks@yandex.ru

В.В. ШМАТ, кандидат экономических наук, Институт экономики и организации промышленного производства СО РАН, Новосибирск.
E-mail: petroleum-zugzwang@yandex.ru

Свою статью мы решили посвятить некоторым щекотливым аспектам эконометрических исследований. Многие исследователи полагают эконометрию неким универсальным средством, с помощью которого можно решить чуть ли не любую мыслимую задачу из области экономики. Не беремся судить, каковы причины этого заблуждения. Мы всего лишь хотим – на примере исследований по весьма сложным и тонким проблемам ресурсозависимой экономики – правильно расставить акценты и показать, что математические методы и качественный анализ (логический и исторический) должны идти рука об руку, взаимно дополнять и обогащать, а не подменять друг друга. В противном случае слишком высоки риски получить пусть и «красивые», но бессмысленные или даже ошибочные результаты.

Ключевые слова: природные ресурсы, институты, факторы развития, ресурсное проклятие, социально-экономическое развитие, минерально-сырьевой комплекс, эконометрия, прогноз-аналитические методы

«Экономика – предмет трудный и требующий специальных знаний, но никто и никогда в это не поверит»

Джон Кейнс

Тезис о «ресурсном проклятии» уже примерно четверть века занимает умы ученых. Кто-то с завидным упорством продолжает доказывать истинность этого мифического тезиса, а кто-то все-таки пытается его опровергнуть. Что сделать непросто в связи с парадоксальностью тезиса, который звучит еще и как «парадокс изобилия». Парадоксы очень живучи – людям они нравятся, к ним привыкают, и всем очень хочется, чтобы парадоксальное оказалось правдой.

* Статья подготовлена в рамках исследований, проводимых при финансовой поддержке Российского научного фонда (проект № 14-18-02345).

Но если беспристрастно подойти к анализу причинно-следственных связей в экономике, можно без особого труда убедиться в справедливости следующего утверждения: ресурсное богатство и хорошие институты представляют собой два фундаментальных фактора, которые обеспечивают устойчивый экономический рост в долгосрочном историческом тренде. В сущности, это – политико-экономическая аксиома, не нуждающаяся в особых доказательствах.

Достаточно привести в пример США – самую богатую и экономически мощную страну мира, располагающую большим и разнообразным ресурсным потенциалом. На протяжении трехсот лет своей истории США (сначала будучи британской колонией, а затем независимым государством) в экономическом развитии опирались на освоение природных ресурсов. В XIX веке США «не стеснялись» быть сырьевым экспортером, вывозя в Европу хлопок, медь, уголь, нефть, и пр., но при этом динамично развивали собственные обрабатывающие производства. «Нефтяной бум» второй половины XIX столетия, который очень тщательно изучал Д.И. Менделеев, стал такой же неотъемлемой частью американской истории, как и «золотая лихорадка». Лишь в первые годы XX века доля готовых изделий в экспорте США превысила 50%-ю отметку, и в это же время американская экономика стала крупнейшей в мире, превзойдя по размерам совокупную экономику Британской империи².

Но это история, а что же сегодня? В настоящее время США располагают одним из наиболее мощных в мире минерально-сырьевых комплексов, который по величине создаваемой добавленной стоимости намного превосходит российский. Однако по вполне очевидным причинам ни у кого не повернется язык назвать американскую экономику ресурсозависимой.

Значит, дело не в ресурсах как таковых, а в структуре экономики. Что же заставляет нессырьевые отрасли развиваться быстрее ресурсоэксплуатирующих? И тут вспоминаются институты...

² Рассчитано по: *Avakov A. V. Two Thousand Years of Economic Statistics: World Population, GDP and PPP.* – N.Y.: Algora Publ., 2010. – 408 p.

**«В экономике всё влияет на всё,
причем более чем в одном отношении»**

A Dictionary of Economic Quotations

Не приходится сомневаться в том, что США (равно как и все наиболее развитые страны мира) обладают хорошими – с точки зрения экономического роста – экономико-политическими институтами. Но откуда эти хорошие институты взялись, какова история их зарождения и развития? Своими корнями они уходят в «недра» европейских монархий эпохи Позднего Средневековья, т.е. процесс эволюции нынешних либерально-буржуазных институтов длится уже пять-шесть столетий. Принципиально важным моментом является то, что зародились рассматриваемые институты в экономически наиболее развитых странах своего времени, которые, вдобавок, обладали серьезной военно-политической мощью, послужившей основой для построения крупнейших колониальных империй.

Из числа ведущих европейских держав Средневековья, пожалуй, только государства Пиренейского полуострова впоследствии оказались на «обочине» экономического и институционального прогресса. Конечно, можно утверждать, что виной этому стало «ресурсное проклятие», но вряд ли приток золота и серебра из вест-индских и прочих колоний был единственной причиной, вызвавшей упадок Кастилии и Португалии в то время, когда их северные соседи росли и крепили во всех отношениях. Попутно заметим, что Англия, Франция, Голландия (а позднее – Бельгия, Германия, Италия) тоже эксплуатировали свои колонии: вывозили сырье и рабов, использовали колониальные рынки для экспансии товаров из метрополий.

Разумно ли будет предположить, что столь же хорошие институты могут быстро сложиться в современных развивающихся странах с сырьевой экономикой, большинство из которых еще в первой половине XX века были колониями? Можно ли сказать, что какая-либо из развивающихся стран, получивших независимость всего лишь несколько десятилетий назад или даже в первой половине XIX века (как многие латиноамериканские государства), в процессе своего развития находилась и находится в таких же условиях, как когда-то ведущие европейские державы? Вряд ли... Подавляющее большинство развивающихся

стран пребывает на мировой периферии – это отнюдь не лидеры, а заведомые аутсайдеры (по крайней мере – «ведомые») в экономическом и политическом отношениях.

Таким образом, формирование институтов происходит в совершенно иной среде. Одно дело не спеша «устраивать» у себя хорошие институты, будучи мировым экономическим и военно-политическим лидером, как в свое время Великобритания, и совсем по-другому обстоят дела у стран типа Ливии, Алжира, Нигерии и т.д. и т.п. Налицо принципиальное отличие условий для институционального развития, каковое, справедливости ради, далеко не всегда можно назвать прогрессом. Но важно иметь в виду еще одно обстоятельство: нельзя рассматривать процесс становления институтов в любой отдельно взятой стране вне общего контекста международных экономико-политических взаимодействий.

***«Слаборазвитая страна бедна потому,
что у нее нет промышленности;
а промышленности у нее нет потому, что она бедна»***

Ханс Вольфганг Зингер

Процесс институционального, и не только, развития любой «периферийной» страны находится под сильным внешним воздействием, на которое многие исследователи почему-то не обращают внимания. Может быть, это попросту не укладывается в «прокрустово ложе» доказуемых теорий? По умолчанию полагается, что формирование национальных институтов Саудовской Аравии ли, Венесуэлы ли – это дело лишь этих стран, вне зависимости от характера и направленности международных институциональных взаимодействий. Для последнего же свойствен принцип «двух рук», причем «правая рука» (формальные институты) не ведает, что творит «левая» (неформальные институты).

Формальные институты, опосредованные функционированием разного рода международных организаций (ООН, ЮНКТАД, ЮНЕСКО, ВТО, МВФ и др.), призваны обеспечить всеобщий гуманитарный прогресс и экономическое развитие. А неформальные правила игры, сложившиеся еще в эпоху колониализма, «работают» в противоположную сторону – продолжают «обслуживать» интересы ведущих мировых держав, консервируют

разделение на «сильных» и «слабых», помогают «сильным» оставаться таковыми и руководить «слабыми» по своему усмотрению.

При таком раскладе «сильным мира сего» хорошие институты в развивающихся, а по сути эксплуатируемых в той или иной степени, странах, вообще говоря, не нужны. Можно обратиться к примеру Индии, которая освободилась от британского владычества и получила независимость в 1947 г. Безусловно, в Индии сложились сравнительно хорошие институты, и по уровню своего институционального развития она стоит выше большинства развивающихся стран. Но при этом «качество» индийских институтов несопоставимо с таковым в бывшей метрополии – Великобритании. Иными словами, «продвинутые» метрополии были заинтересованы в построении хороших институтов в своих колониях (прежде всего – крупнейших) лишь постольку и в той мере, в какой это было необходимо для обеспечения управляемости и поддержания всяческой стабильности в масштабах империй. В вопросах институционального развития характер взаимодействий между мировым «центром» и «периферией» остается таким же и сегодня, хотя нет уже ни метрополий, ни колоний.

К уровню экономического развития стран «третьего мира» это имеет весьма специфическое отношение. Если в порыве необузданной фантазии представить на миг, что в Нигерии сразу же после обретения независимости в 1960 г. появились хорошие институты, то вряд ли это позволило бы бывшей британской колонии стать богатой и процветающей к настоящему времени, хотя бы в сугубо статистическом измерении. За 50 лет независимости экономика Нигерии выросла вроде бы весьма внушительно – в 5,5 раза, но ведь и численность населения увеличилась в 3,5 раза (для сравнения: в Великобритании – в 3,1 и 1,1 раза, соответственно). «Ресурсное проклятие» Нигерии, являющейся одним из крупнейших мировых экспортеров нефти, реально состоит не в плохих институтах, а в том, что объем добычи нефти и газа в расчете на душу населения составляет всего лишь 920 кг нефтяного эквивалента (н.э.) – меньше, чем в Великобритании (1,1 т), и ниже среднемирового показателя. Нетрудно подсчитать: чтобы по статистическому среднедушевому ВВП Нигерия сегодня сравнилась с Великобританией, она должна иметь почти втрое больший по масштабам «нефтяной» сектор экономики.

Могла ли бедная – в прямом и переносном смысле – Нигерия развить необходимые для этого темпы роста в минувшие полвека? Отрицательный ответ должен быть принят как очевидный, иначе мы уйдем в область совершенно ненаучной фантастики. Апеллировать же, в порядке дискуссии, к примерам «азиатских тигров» представляется не вполне корректным, поскольку, скажем, Тайвань или Южная Корея даже полувековой давности – это отнюдь не африканские страны, застрявшие в своем развитии на полпути от родоплеменного первобытно-общинного строя к феодализму.

*«Со студенческих лет я руководствовался...
необходимостью постоянно связывать
теоретическую экономику или эконометрику
с проблемами реального мира...»*

Клейн Лоуренс

Аргументация и сторонников, и противников теории «ресурсного проклятия» в немалой степени строится на результатах количественного анализа факторов, влияющих на экономический рост. «Оружием» в этой «дуэли» зачастую является эконометрический анализ. Бесспорно, эконометрия – это сильное «оружие», мощный аналитико-прогнозный инструментарий, но обращаться с ним надо аккуратно, если не сказать больше – осторожно. Главное правило, на наш взгляд, состоит в том, чтобы не отрываться от реальной действительности, а в попытках выявить скрытые от непосредственного наблюдения зависимости – не упускать из виду очевидные (а потому – менее интересные).

Следует отметить, что даже ставшие классическими модели, на основе которых были сделаны выводы о негативном влиянии ресурсов на экономический рост (прежде всего в ведущих нефтеэкспортирующих странах), грешны пренебрежением к этому правилу. Например, ни в модели Сакса-Уорнера, ни в анализе Гюльфасона и Хекшера-Олина не нашлось места такому вполне очевидному фактору, как объем производства в сырьевом (нефтедобывающем) секторе. Лишь Ричард Оти, рассматривая пример Саудовской Аравии, вскользь упоминает о почти трехкратном сокращении объемов добычи нефти в главной «нефтяной монархии» мира в первой половине 1980-х годов. Продолжим: Кувейт, Ливия, Иран в начале 1980-х годов добывали нефти

второе меньше, чем десятью годами ранее; Венесуэла – в два с лишним раза; Нигерия – почти вдвое.

Сокращение объемов производства в основных нефтеэкспортирующих странах стало результатом, прежде всего, квотирования добычи в рамках ОПЕК, а не следствием истощения ресурсов или плохих институтов. Скорее наоборот, – способность стран-участниц ОПЕК проводить согласованную политику, направленную на поддержание стабильной рыночной конъюнктуры, свидетельствует об определенной силе национальных и межгосударственных институтов.

Если принять во внимание вполне очевидный фактор сокращения объемов производства и добавить к нему специфическое обесценение «нефтедолларов», тогда замедление экономического роста в Саудовской Аравии и в других странах-экспортерах нефти в 1970–1980-х годах (даже при высоких ценах на нефть) будет выглядеть более чем объяснимым не только логически, но и статистически. Учтем также, что динамика среднедушевого ВВП в странах Персидского залива находилась под влиянием быстрого роста населения, происходившего в основном из-за большого притока мигрантов: за 50-летний период начиная с 1960 г. численность населения Эмиратов увеличилась почти в 50 раз, Катара – в 20, Кувейта – в 12, Саудовской Аравии – в шесть раз. Сверхактивные миграционные процессы стали следствием «строительного бума» в рамках политики модернизации национальных экономик, стремления к диверсификации и к уходу от моноотраслевой сырьевой структуры. Цель такой политики вполне очевидна – ослабить зависимость от ресурсов и сделать экономику менее уязвимой. А средства и результативность, действительно, во многом определяются качеством институтов, причем не только национальных, но и внешних.

*«Статистика есть наука о том, как, не умея мыслить
и понимать, заставить делать это цифры»*

Василий Ключевский

Результаты эконометрического моделирования зачастую становятся беспомощными, если некорректно воспользоваться статистическими данными или решать некорректные задачи. Это можно отнести и к статье «Экономический рост

и институциональное развитие в нефтегазовых странах» в настоящем номере «ЭКО».

Начнем с того, что ее авторы И. А. Гринец и П. Ф. Казначеев подменяют понятие «экономический рост» категорией «уровень экономического развития», который измеряется величиной душевого ВВП в паритетных ценах³. Простейший эконометрический анализ свидетельствует, что значения показателя душевого ВВП в нефтегазовых странах сильно коррелируют с величиной добычи углеводородов на душу населения (коэффициент корреляции стремится к единице). На этом фоне корреляции с качеством институтов и другими факторами выглядят малозначимыми.

Другая серьезная уязвимость исследования специалистов РАНХиГС связана с формированием выборки нефтегазовых стран, что также приводит к некорректности результатов оценивания. К примеру, Тимор-Лесте, Мьянму, Кот-д'Ивуар, Чад, Судан, Камерун с их мизерными показателями добычи углеводородов на душу населения (от 0,1 до 3,5 т н.э.) вряд ли можно назвать «представительными» нефтегазовыми странами – тем более с позиций качества специализированных институтов. В глобальном же масштабе они являются мельчайшими производителями с долями в мировой добыче нефти и газа порядка 0,1%. Странно, что, включив в выборку ряд беднейших африканских государств, авторы упустили из виду Экваториальную Гвинею, которая в 1990-х и в начале 2000-х годов демонстрировала высочайшие темпы экономического роста, а по показателю душевого ВВП достигла среднего уровня стран Европейского союза.

При исследовании взаимосвязей в триаде «ресурсы – институты – экономика» не лишено смысла обратиться к примерам Великобритании, Нидерландов, Австралии, Бразилии, Аргентины, Китая, Вьетнама. Но все эти страны не соответствуют критерию ресурсообеспеченности (доле углеводородного сырья в общем объеме экспорта), выбранному авторами. Названный критерий является чрезвычайно уязвимым, поскольку в действительности служит мерой не столько обеспеченности ресурсами, сколько общего уровня экономического развития

³ В классических эконометрических моделях ресурсозависимости исследователи все-таки оценивали влияние ресурсных и иных факторов на темпы экономического роста, но не на величину душевого ВВП.

и диверсификации экономики. Можно снова вернуться к примеру Нигерии, которая экспортирует свыше 130 млн т углеводородов (84% в стоимости товарного экспорта), но при этом имеет показатели душевого потребления нефти всего лишь порядка 125 кг, что в 12 раз меньше среднемирового уровня. То есть, объективно говоря, у Нигерии нет никакого излишка ресурсов, а есть вынужденный экспорт по причине бедности и экономической отсталости.

Вообще же, результаты верификации нефтегазовых стран для целей эконометрического анализа всегда выглядят весьма условными, поскольку слишком значителен разброс показателей добычи углеводородов – абсолютных и в расчете на душу населения. Тем более, если речь идет об оценивании факторов, влияющих на уровень экономического развития. Как с этой точки зрения можно сопоставить, например, Россию, имеющую показатель душевой добычи нефти и газа менее 8 т н.э., и Норвегию с ее 38 т? Можно сказать, что Катар (107 т), Кувейт (52 т), Бруней (47 т) совсем выпадают из общего ряда, равно как и названные выше «микропроизводители», но уже с другой стороны. Это требует серьезных корректив в структуре анализа факторов, включая институциональные. Прямолинейный подход с неизбежностью приводит к получению ненадежных и некорректных результатов.

«Прогнозировать средние экономические показатели – все равно что уверять не умеющего плавать человека, что он спокойно перейдет реку вброд, потому что ее средняя глубина не больше четырех футов»

Милтон Фридман

В самом тонком вопросе – оценивании качества институтов – И. А. Гринец и П. Ф. Казначеев изначально пошли самым простым путем, взяв среднее арифметическое из «нескольких наиболее известных и цитируемых институциональных индексов». С таким же успехом общее состояние пациентов в клинике можно оценивать, выводя среднее арифметическое из индексов, показывающих температуру, артериальное давление, пульс и т. п.

Считаем нужным отметить, что в любой оценке качества институтов, в любом институциональном индексе есть что-то от лукавого. Например, что такое «экономическая свобода»

или «возможность для бизнеса» (doing business)? Вполне ли объективны универсальные критерии оценивания для всех стран и экономик – с разным уровнем развития и различной структурой? То, что хорошо для высокоразвитых стран, всегда ли является столь же хорошим для бедных и отсталых? Либеральность в экономике для большинства развивающихся государств практически равнозначна свободе для деятельности иностранного бизнеса, с которым местный бизнес зачастую попросту не в состоянии конкурировать. Это в полной мере относится и к нефтегазовой сфере. Но всегда ли свобода для иностранного бизнеса сочетается с национальными социально-экономическими интересами?

Поэтому во многих случаях индексы экономической свободы сами по себе ни о чем не говорят в силу разнонаправленности интересов иностранного бизнеса и принимающих государств. Защита национальных интересов, как правило, подразумевает ограничения для бизнеса (налоговые, регуляторные и проч.), что равнозначно уменьшению степени свободы. Правильнее говорить о разумном сочетании свободы и экономического национализма (в том числе ресурсного), когда институты выстраиваются таким образом, чтобы формировался наилучший баланс стимулов и ограничений, а в итоге – достигался консенсус интересов.

И. А. Гринев и П. Ф. Казначеев используют в своем эконометрическом анализе «квазипоказатели институционального развития» (по определению авторов). Исходя из чисто теоретических соображений, можно предположить, что лицензионный и налоговый режимы в нефтегазовой сфере, степень ее огосударствления сказываются на динамике процессов освоения ресурсов и привлечении инвестиций. Но попытки увязать качество специализированных институтов ресурсопользования с показателем, характеризующим общий уровень экономического развития (ВВП на душу населения), приводят к тому, что регрессионные модели с объясняющими квазипоказателями дают квазирезультаты по объясняемой переменной. Модели зависимостей с коэффициентами детерминации (R^2), равными 0,1 или 0,3, вряд ли можно признать что-либо объясняющими и обладающими доказательной силой без надлежащей интерпретации на предмет соответствия исходным данным и самих исходных данных.

*«Не в деньгах счастье»**Народная мудрость*

Вне зависимости от предмета доказательства – являются ресурсы «проклятием» или «благословением», какова при этом роль институтов – ограниченность эконометрического анализа по показателю ВВП состоит в том, что получаемые результаты ровным счетом ничего нам не говорят о распределении экономического богатства и о том, насколько его рост затрагивает различные слои населения. А вообще, зададимся в заключение вопросом – насколько важны богатство и экономическое процветание для населения той или иной страны? Делает ли богатство людей счастливыми?

В этой связи нам кажется любопытным взглянуть на Всемирный индекс счастья (Happy Planet Index), который, по замыслу организации New Economics Foundation, должен отражать «реальное» благосостояние наций – в противовес показателям, характеризующим уровень экономического и человеческого развития. Основная исходная посылка измерения индекса состоит в том, что конечная цель большинства людей – быть счастливыми и здоровыми, а не просто богатыми⁴.

Так вот, по оценке 2012 г., в первую десятку самых счастливых стран мира вошли отнюдь не самые богатые, экономически развитые и либерально-демократические: Коста-Рика, Вьетнам, Колумбия, Белиз, Сальвадор, Ямайка, Панама, Никарагуа, Венесуэла («нефтепроклятая») и Гватемала. Из экономически развитых стран наиболее высокое место занял Израиль (15-е), а всего же в первой «тридцатке» нашлось место только двум странам с высокоразвитой экономикой — вдобавок к Израилю, это Норвегия (22-е). Швейцария, имеющая самую конкурентоспособную по мировым меркам экономику, заняла 34-е место. Россия оказалась на 122-м месте, а США – на 105-м. Катар – самая богатая страна мира по статистически измеряемому ВВП на душу населения (128 тыс. долл. по ППС) занял лишь 149-е место из 151 между двумя беднейшими африканскими государствами – Чадом и ЦАР. Другие «нефтегазовые богатеи» с Ближнего Востока – Кувейт (143-е место) и Бахрейн (146-е) оказались лишь немного выше.

⁴ The Happy Planet Index. URL: [//www.happyplanetindex.org/](http://www.happyplanetindex.org/) (дата обращения: 09.03.2015).

При всей условности «индекс человеческого счастья», учитывающий ожидаемую продолжительность жизни, «ощущаемое» благополучие и уровень экологической безопасности, косвенно характеризует состояние всей совокупности национальных институтов – не только формальных, но и неформальных, включая обычаи, нравы, жизненные стереотипы и т.п. И он практически никак не коррелирует с показателями экономического богатства и ресурсной обеспеченности.

***«Трудность не в том, чтобы найти новые идеи,
а в том, чтобы освободиться от старых»***

Джон Кейнс

В качестве заключения хотелось бы отметить, что в наши дни эконометрический анализ ресурсозависимых экономик как таковой – это неплохой полигон для проверки и практического применения известных теоретических знаний. Но чтобы эконометрия дала новые научные «плоды», требуется не просто построение «перелицованных» формальных моделей на базе старых идей, а более глубокое осмысление и качественное понимание происходящих процессов в их сложном и противоречивом взаимопереплетении. Новые идеи не появляются на пустом месте, но им тесно и неуютно там, где слишком задержались идеи старые и уже во многом опровергнутые самой жизнью. Старые идеи должны освобождать место для новых, и тогда не придется сожалеть о непродуктивном применении постоянно развивающихся количественных методов исследования экономики, включая всеми нами любимую эконометрию!

От редакции: Учитывая сложность и неоднозначность проблем связи качества институтов с экономическим ростом, приглашаем читателей принять участие в их обсуждении на страницах журнала и на сайте «ЭКО» в Интернете (ecotrends.ru).