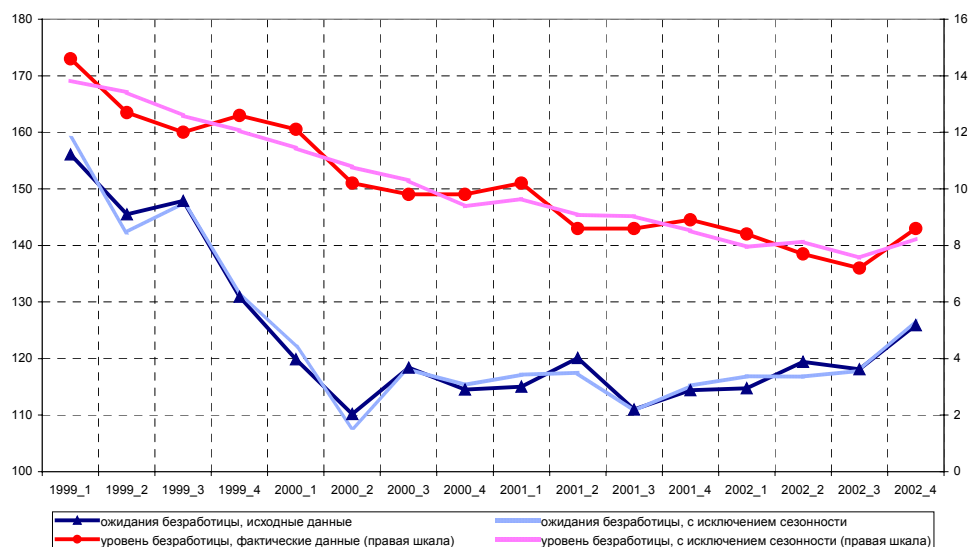


## ФОРМИРОВАНИЕ ОЖИДАНИЙ БЕЗРАБОТИЦЫ И ИХ ВЛИЯНИЕ НА ЭКОНОМИЧЕСКОЕ ПОВЕДЕНИЕ НАСЕЛЕНИЯ.<sup>1</sup>

**Цель проекта** - исследование механизма формирования ожиданий безработицы, а также взаимосвязей динамики ожиданий безработицы с потребительской и сберегательной активностью населения на базе анализа потребительских настроений и субъективных представлений о проблеме безработицы с использованием статистических данных о ситуации на рынке труда и уровне жизни населения.

Рис. 1. Динамика ожиданий и уровня безработицы



Источник: опросы ВЦИОМ, ГКС (ОНПЗ).

Индекс ожиданий безработицы строится на основе ответов респондентов на вопрос (задаваемого с января 1999г. 1 раз в 2 месяца): «Как Вы думаете, в ближайшие 12 месяцев безработных (людей, которые не имеют работу и ищут ее) будет больше, примерно столько же или меньше?» Индекс измеряется как разность ответов о том, что безработных в предстоящие 12 месяцев станет больше, и ответов о том, что их станет меньше, плюс 100.

### Теоретические аспекты формирования ожиданий.

Формирование ожиданий в целом зависит от двух общих факторов: входящей информации (informational inputs) и самого процесса трансформирования информации в ожидания ( $f$ ). Тогда ожидания безработицы можно определить в самом общем виде как:

$$Uex_t^{e_{t-1}} = f(I_{t-1}), \text{ где:}$$

$Uex$  – ожидания безработицы;

верхний индекс указывает на время, когда эти ожидания были сформированы;  
нижний индекс – период, на который распространяются ожидания.

$I$  – совокупность общей и частной информации, используемой людьми.

<sup>1</sup> Грант НИСП SP-02-1-02.

а) Различные адаптивные, экстраполятивные и самообучающиеся модели (т.е. модели первого класса – АЕ) могут быть суммированы следующим авторегрессионным представлением с распределенным лагом:

$$Uex_t^{e_{t-1}} = \alpha + \beta Uex_{t-i}^{e_{t-1-i}} + \gamma U_{t-i} + \zeta Z_{t-i} + \varepsilon_t, \text{ где:}$$

$Uex$  – ожидания безработицы;

$U$  – уровень безработицы;

$Z$  – совокупность других переменных;

$\varepsilon_t$  – стандартная ошибка

Значения коэффициентов и определяют характеристики различных моделей этого первого класса.

б) В модели *рациональных ожиданий* (RE) главное внимание фокусируется не на «прошлых» переменных, а на их «будущей реализации». В терминах уравнения это выглядит следующим образом:

$$U_t = \alpha + \beta Uex_t^{e_{t-1}} + \varepsilon_t, \text{ при этом } \alpha = 0; \beta = 1.$$

Мы будем тестировать модель рациональных ожиданий следующего вида, которая акцентирует внимание на оценке опережающей информации, содержащейся в ожиданиях:

$$U_t = \alpha + \beta Uex_{t-i} + \gamma U_{t-i} + \zeta Z_{t-i} + \varepsilon_t$$

## Результаты исследования.

I. Первая серия тестов посвящена анализу взаимосвязей между изменениями в уровне реальной безработицы и ее ожиданиями, исключая влияние других потенциальных факторов.

Таблица 1. Изменения в ожиданиях и уровне безработицы: оценка взаимосвязей

	Зависимая переменная: изменения в сезонносглаженном уровне безработицы, $\Delta U_t (seasadj)$		
Regression number	(1)	(2)	(3)
Constant	-.002	.005	-.314
Std. Error	(.176)	(.141)	(.258)
$\Delta U_{t-2} (seasadj)$	.574	.529	
Std. Error	(.315)	(.251)	
Sig. (p-value)	[.040]	[.022]	
$\Delta Uex_{t-2} (seasadj)$		.539	
Std. Error		(.010)	
Sig. (p-value)		[.020]	
$\Delta U_{t-4} (seasadj)$			-.181
Std. Error			(.438)
Sig. (p-value)			[.563]
$\Delta Uex_{t-4} (seasadj)$			.506
Std. Error			(.016)
Sig. (p-value)			[.131]
Adjusted R square	.269	.542	.100
Std. E. of estimate	.392	.310	.463

\* Временной интервал (t) – 1 квартал. Временной период – 1999:1 – 2002:4.

Другой метод оценки опережающей информации, содержащейся в ожиданиях, заключается в тестировании гипотезы о влиянии *будущих* (т.е. t+2) изменений в уровне безработицы на *текущие* ожидания. В качестве зависимой переменной используются уже данные об изменениях в ожиданиях безработицы (табл. 2).

**Таблица 2. Детерминанты ожиданий безработицы**

	Зависимая переменная: изменения в сезонносглаженных ожиданиях безработицы, $\Delta Uex_t (seasadj)$				
Regression number	(1)	(2)	(3)	(4)	(5)
Constant Sig.	.464 (2.560)	.406 (3.965)	7.208 (2.512)	.483 (1.912)	4.842 (2.430)
$\Delta U_{t-2} (seasadj)$ Sig. (p-value)		.159 [.623]			
$\Delta U_t (seasadj)$ Sig. (p-value)		-.347 [.378]			
$\Delta U_{t+2} (seasadj)$ Sig. (p-value)	.584 [.036]	.912 [.035]	.470 [.019]		
$\Delta GDP_t (seasadj)$ Sig. (p-value)			-.629 [.004]		-.439 [.038]
$\Delta EMPest_t$ Sig. (p-value)				.058 [.779]	
$\Delta GDPex_t (seasadj)$ Sig. (p-value)				-.730 [.003]	-.514 [.018]
Adjusted R square	.281	.341	.668	.489	.646
Sig.	.036	.124	.002	.007	.001

\* Временной интервал (t) – 1 квартал. Временной период – 1999:1 – 2002:4.

На следующем этапе мы попытались протестировать влияние других факторов на формирование ожиданий – как объективных, т.е. отражающих развитие экономики в целом, так и субъективных, отражающих личностное («частное») восприятие людьми экономических процессов.

В качестве объективного фактора использовались данные об изменениях в сезонносглаженном ВВП ( $\Delta GDP_t$ ).- уравнение 3 в табл.2.

В качестве субъективных факторов нами были привлечены:

- $\Delta GDPex_t$  - изменения в оценках населением перспектив развития экономики в ближайший год. (Ответы на вопрос: «Если говорить об экономических условиях в стране в целом, как вы считаете, следующие 12 месяцев будут для экономики страны хорошим временем или плохим?»). Индекс строится как разность положительных и отрицательных ответов плюс 100. Соответственно, рост индекса обозначает увеличение доли благоприятных мнений в обществе и, наоборот. Данные взяты как квартальные изменения.
- $\Delta EMPest_t$  - изменения в оценках людьми собственной занятости. В регулярных опросах потребителей, которые проводятся 1 раз в 2 месяца в рамках совместного проекта по измерению ИПН, задается вопрос об оценке людьми личного текущего материального положения и причинах их такой оценки. Спектр причин широк (он был «установлен» ранее путем включения «открытых вопросов»), но есть две, относящиеся непосредственно к занятости – положительные («кто-то из членов семьи стал больше зарабатывать, появилась дополнительная работа; кто-то из членов семьи вышел на работу (например, люди, закончившие обучение, безработные и т.п.)), и соответственно, отрицательные – «кто-то из членов семьи стал меньше зарабатывать, потерял дополнительные заработки; кто-то из членов семьи вообще потерял работу (в

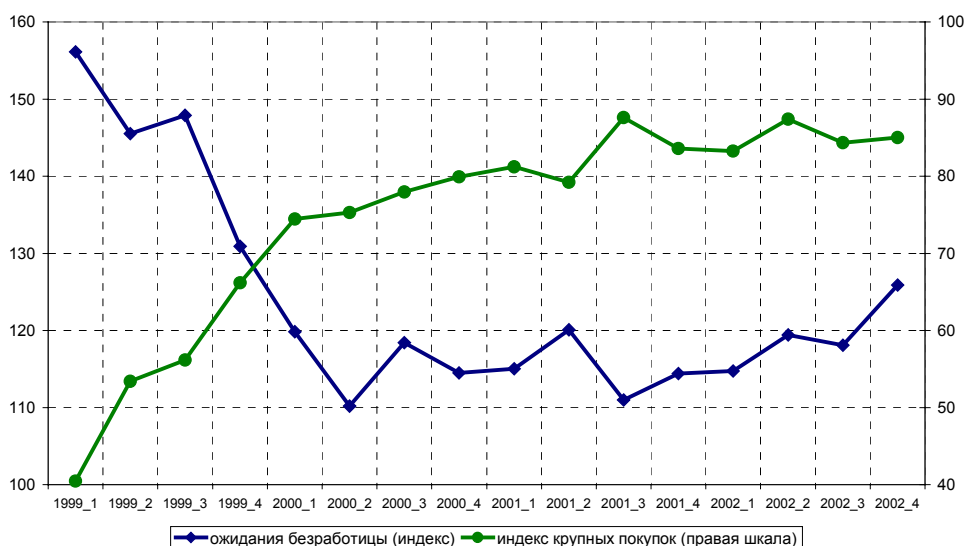
т.ч. вышел на пенсию)»). Для анализа был подсчитан индекс как разность отрицательных и положительных ответов. Соответственно, снижение индекса означает уменьшение доли неблагоприятных ответов относительно занятости, и, наоборот.

Основной *вывод*. Опросные данные об ожиданиях безработицы содержат в себе опережающую информацию. Построенная модель детерминант ожиданий безработицы показала значимость субъективных факторов их формирования (т.е. отражающих личностное, «частное» восприятие людьми экономических процессов). Наряду с тем, что реальные изменения в объемах ВВП, фиксируемые официальной статистикой, являются сами по себе значимым фактором, расчеты показывают, что в качестве важной детерминанты ожиданий безработицы выступают представления людей об изменениях экономической ситуации в стране в ближайшем будущем. И это еще раз подчеркивает наличие определенной рациональности в оценках людьми ситуации на рынке труда в будущем. Эти оценки основываются не только (и не столько) на изолированной «частной» информации (относительно собственной фактической занятости, например), но и на общеэкономическом «материале», «пропущенном», безусловно, сквозь призму личного опыта.

**II. Вторая задача проекта** состояла в исследовании ожиданий безработицы с точки зрения их влияния на потребительское и сберегательное поведение населения.

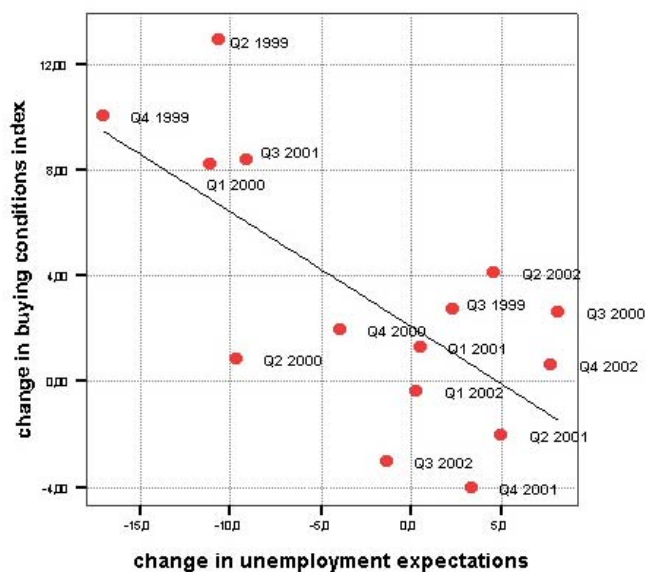
В качестве зависимой переменной мы использовали измеряемый в рамках программы ИПН показатель оценки людьми ситуации на потребительском рынке, или индекс крупных покупок. Он рассчитывается по формуле: из доли позитивных ответов (т.е. оценивающих экономические условия как благоприятные для приобретения товаров длительного пользования) вычитается доля негативных и к этой величине прибавляется 100, чтобы исключить появление отрицательных величин. Таким образом, индекс может изменяться в диапазоне от 0 до 200. Уже визуальный анализ динамики ожиданий безработицы и индекса крупных покупок показывает, что эти две кривые находятся в некоей противофазе.

**Рис.2. Динамика ожиданий безработицы и индекса крупных покупок**



Статистический анализ показал наличие сильной обратной связи между ожиданиями безработицы и оценками людьми ситуации на потребительском рынке.

Рис.3. Взаимосвязь ожиданий безработицы и индекса крупных покупок.



$$y = 2,096 - 0,683x$$

(1,003) (0,129)  
[,057] [,005]

$$R^2 = 0,425$$

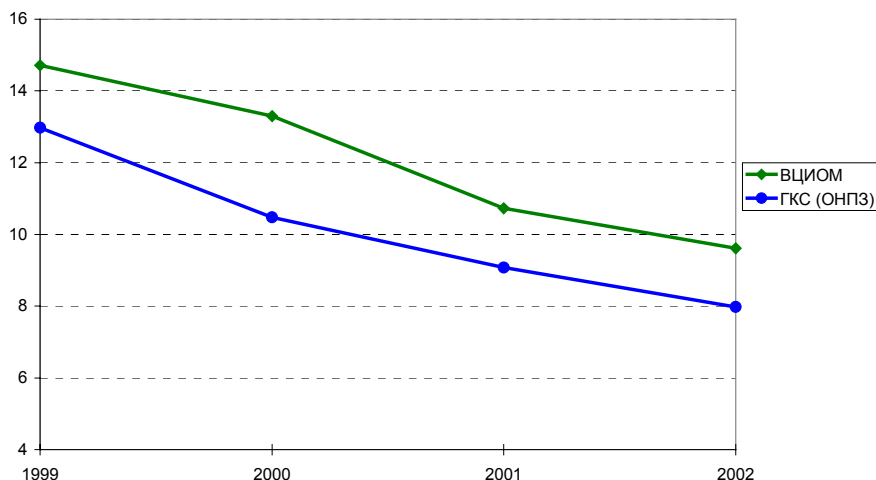
где:

x – индекс крупных покупок (квартальные изменения),

y – изменения в ожиданиях безработицы

III. Третья задача проекта заключалась в исследовании субъективных представлений населения о занятости и безработицы, которые, согласно гипотезе, не всегда соответствуют фактическому положению дел.

Рис.4. Оценка уровня безработицы по различным данным

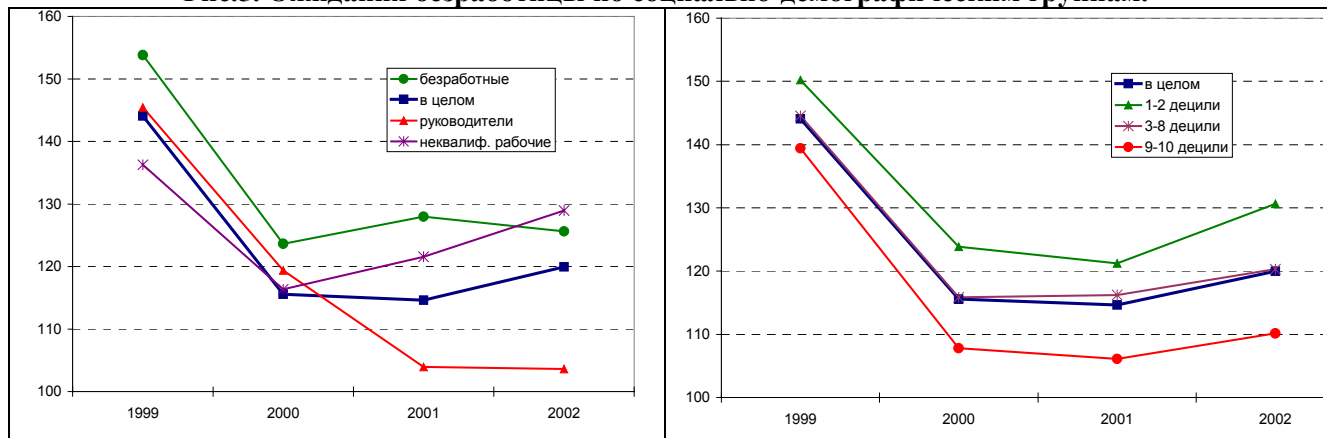


В чем истоки расхождений и каково их влияние на экономическое поведение населения? С этой целью в ноябре 2002г. в рамках проекта был проведен специализированный социологический опрос населения (включен дополнительный блок из 25 содержательных вопросов в регулярный замер ВЦИОМ).

Согласно данным опроса, 88% людей, оценивающих себя в качестве безработных, смогли бы приступить к предложенной им подходящей работе в течение ближайшей недели (а 12% ответили отрицательно, либо затруднились с ответом). Поисками работы занимались 80% безработных, каждый десятый же прекратил поиски, поскольку потерял надежду найти подходящую работу. А не имели заработка (от основной либо дополнительной работы) в предшествующем опросу месяце только 75% людей из тех, кто называет себя безработным. Одновременно же всем трем условиям МОТ удовлетворяет только 54% людей, идентифицирующих себя как безработные.

Иными словами, «смещения» - налицо, а степень согласованности реальной ситуации и самооценок людей в отношении безработицы далеко не абсолютна. В то же время эта самооценка человека (даже не соответствующая МОТ) оказывает влияние на его настроения, ожидания, и, соответственно, поведение. Анализ ожиданий безработицы в разрезе по социально-демографическим группам показывает, что лица, называющие себя безработными, отличаются завышенными ожиданиями, которые также характерны и для людей с наименьшими среднедушевыми доходами (респондентов 1-2 децилей)<sup>2</sup>.

**Рис.5. Ожидания безработицы по социально-демографическим группам.**



Кроме того, анализ данных проведенного опроса показал, что каждый четвертый работающий в настоящее время (или 13% населения в целом) имел опыт безработного существования в течение последних 10 лет (начиная с 1992г.). Это обстоятельство существенным образом сказывается на сегодняшних оценках людьми ситуации на рынке труда, их собственных перспектив и общеэкономических ожиданиях в целом.

**Таблица 3. Рынок труда: оценка ситуации и собственных перспектив**  
(ноябрь 2002г., в % по столбцам)

	работающие, не имевшие периодов безработного существования	в настоящее время работающие, но имевшие опыт безработного существования в течение последних 10 лет
Да, существует угроза значительного сокращения работников на нашем предприятии в ближайшее время	32	37
Да, я могу лично в ближайшее время потерять работу в связи с сокращением штатов или ликвидацией предприятия*	29	39
В случае потери работы я думаю, что смогу найти другое место работы по моей профессии	60	52
Да, среди моих родственников, друзей и знакомых есть безработные (люди, которые потеряли в последнее время работу и ищут ее)	51	67
Да, в последнее время люди стали больше опасаться потерять работу	41	46

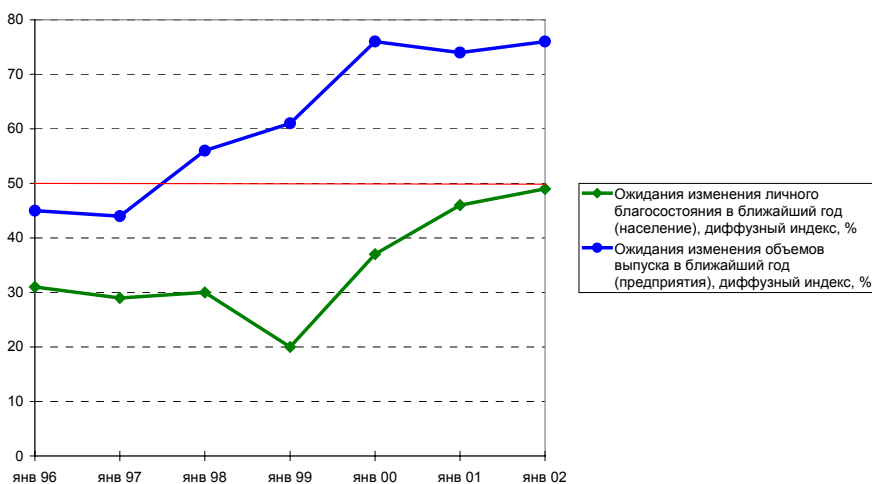
\* приводится сумма двух вариантов ответов «это очень вероятно» и «есть такая вероятность».

<sup>2</sup> Понятно, что эти категории частично пересекаются, согласно данным опроса в ноябре 2002г. 52% людей, идентифицирующих себя как безработные, принадлежали по уровню среднедушевых доходов к двум нижним децилям.

IV. Четвертая задача проекта заключалась в исследовании взаимосвязи между ожиданиями населения в отношении безработицы и доходов и ожиданиями руководителей предприятий (на основе опросных данных РЭБ) в отношении занятости и заработной платы.

1) Ожидания населения относительно изменения своего личного благосостояния в ближайший год являются значительно более пессимистичными по сравнению с ожиданиями предприятий относительно объемов своего выпуска<sup>3</sup> (рис.6).

**Рис.6. Динамика ожиданий населения и руководителей предприятий относительно изменения материального положения/объемов выпуска.**



Диффузный индекс (D) определяется по формуле,  $D = 0 \cdot A + 0,5 \cdot B + 1 \cdot C$ , где A – доля респондентов, ожидающих ухудшения материального положения (уменьшения объемов выпуска), B – доля респондентов, не ожидающих изменений, C – доля респондентов, ожидающих улучшения материального положения (увеличения объемов выпуска). Диффузный индекс может меняться от нуля (когда все респонденты прогнозируют ухудшение) до 100% (когда все респонденты ожидают улучшения).

2) Расчеты свидетельствуют, что такие показатели деятельности предприятий, как динамика выпуска, занятости и заработной платы не оказывают статистически значимого влияния на ожидания населения относительно своего материального положения.

3) Вместе с тем, включив в анализ большее число рядов, мы обнаружили, что, по крайней мере, три показателя обнаруживают признаки наличия связи, а именно:

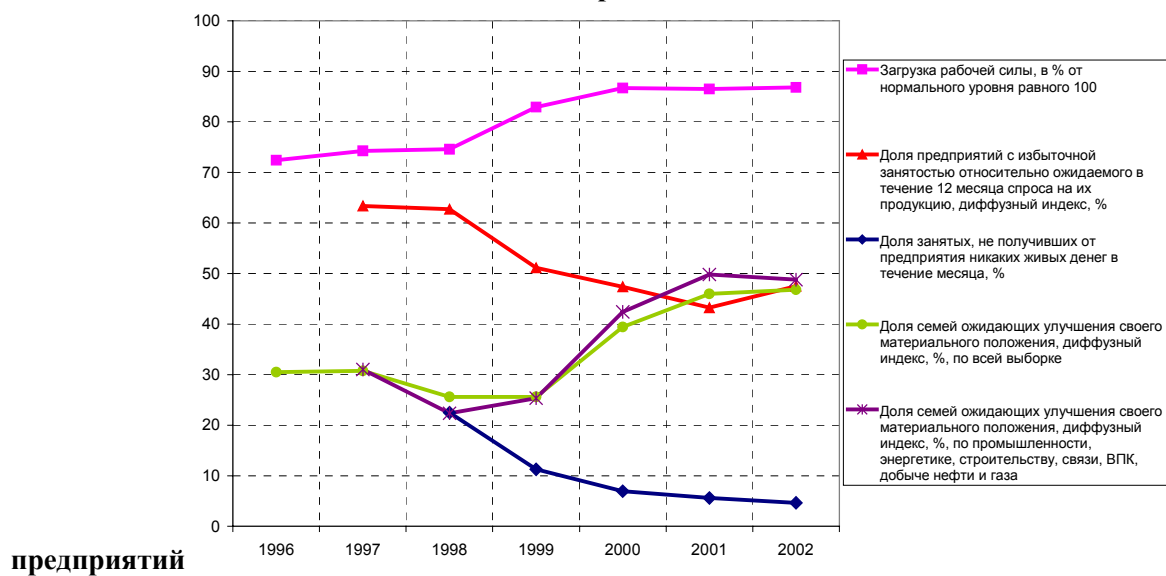
- загрузка рабочей силы;
- укомплектованность рабочей силой относительно ожидаемого в течение 12 месяцев спроса;
- доля работников, не получивших никаких живых денег от предприятий.

Каждый из указанных параметров влияет на ожидания населения с лагом примерно 2-3 квартала. Причем использование опросных данных по населению, занятому в промышленности, улучшает эконометрические оценки. (рис 7.)

<sup>3</sup> Мы использовали сравнение именно этих показателей по двум причинам: 1) во-первых, ожидания населения относительно изменения личного материального положения находятся в сильной обратной связи с их ожиданиями безработицы в стране в целом (коэффициент корреляции равен  $-0,7$ ); 2) во-вторых, показатель материального благосостояния для семьи примерно то же самое, что объем выпуска для предприятия. С одной стороны, семья является в некотором роде производящей единицей, за что и получает, как правило, главную часть своего дохода, а значит, и материального благосостояния. С другой, - объем выпуска для предприятия является основой его благосостояния как хозяйственной единицы. Никакого более близкого к этому показателя не существует.



**Рис.7. Ожидания населения и индикаторы востребованности рабочей силы со стороны предприятий**



Итак, основные задачи, поставленные для решения главной цели проекта, решены. Исходя из результатов исследования, можно сказать, что развитие мер государственной политики, нацеленных на снижение опасений безработицы, могут быть не менее эффективными по сравнению с мерами, направленными на сокращение безработицы. Они могут быть не прямыми (например, создание системы негосударственного страхования от потери работы), менее финансово затратными, и, кроме того, способствовать возникновению мультипликативного эффекта.