

Методы оценки объемов неформального сектора экономики.

Целью данной работы является комплексный анализ основных тенденций, проблем и особенностей современного неформального сектора.

Задачи: рассмотреть различные взгляды на явление неформальной экономики в современном мире, изучить существующие методы ее выявления и оценки, а так же определить особенности этого феномена в России и границы применения различных методов измерения объема неформального сектора в нашей стране.

Понятие скрытой и неформальной экономической деятельности

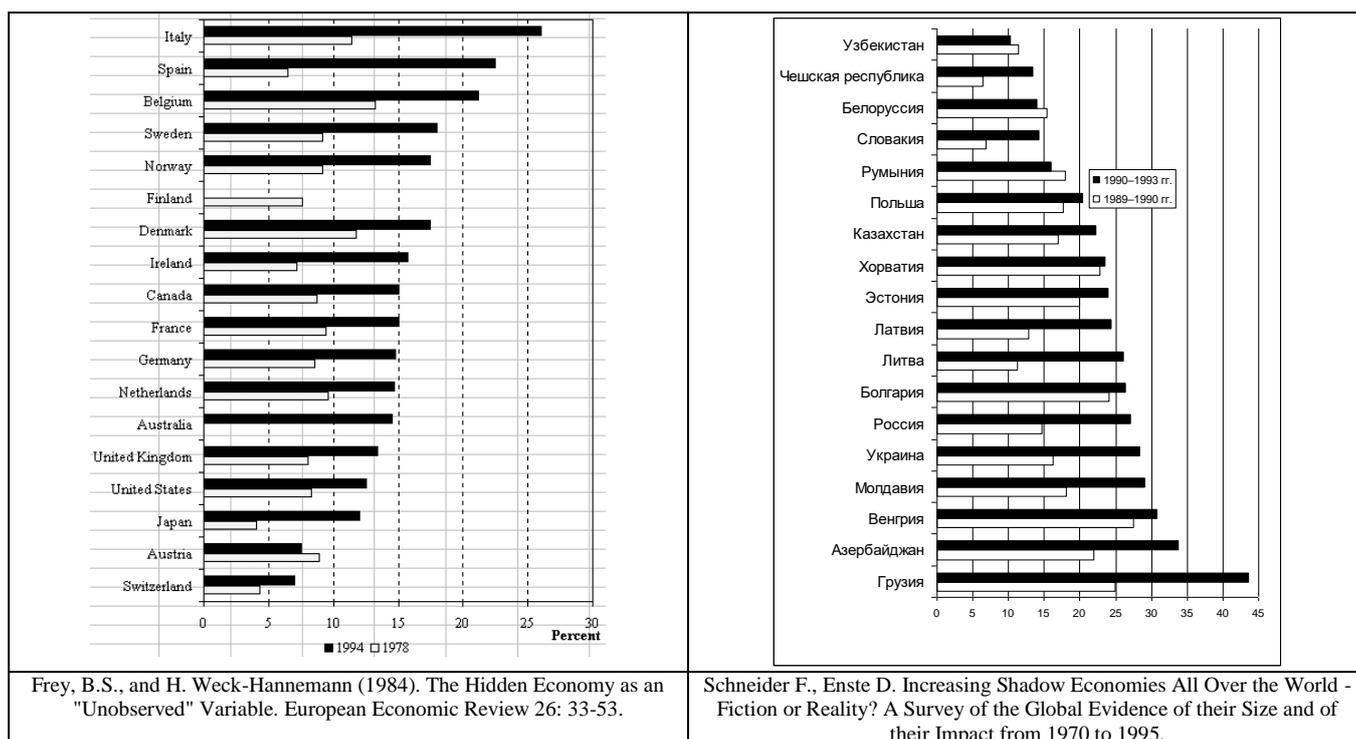
В настоящее время отсутствует единое четкое определение неформального сектора, общепризнанные критерии отнесения работающих к формально или неформально занятым. Многообразие позиций обусловлено, как правило, различиями в характере решаемых авторами теоретических и прикладных задач, а также в методологии и методике исследования.

✓ *Скрытая* экономическая деятельность включает в себя в большинстве случаев экономическую деятельность, разрешенную законом, но скрываемую или преуменьшаемую по объему с целью уклонения от уплаты налогов, социальных взносов или выполнения определенных административных обязанностей или предписаний по охране труда, выполнению санитарных и других норм.

✓ *Неформальная* экономическая деятельность осуществляется в основном на законном основании индивидуальными производителями или так называемыми "некорпорированными предприятиями".

✓ *Незаконная* экономическая деятельность является незаконной, то есть она охватывает те виды производства товаров или услуг, которые прямо запрещены существующим законодательством.

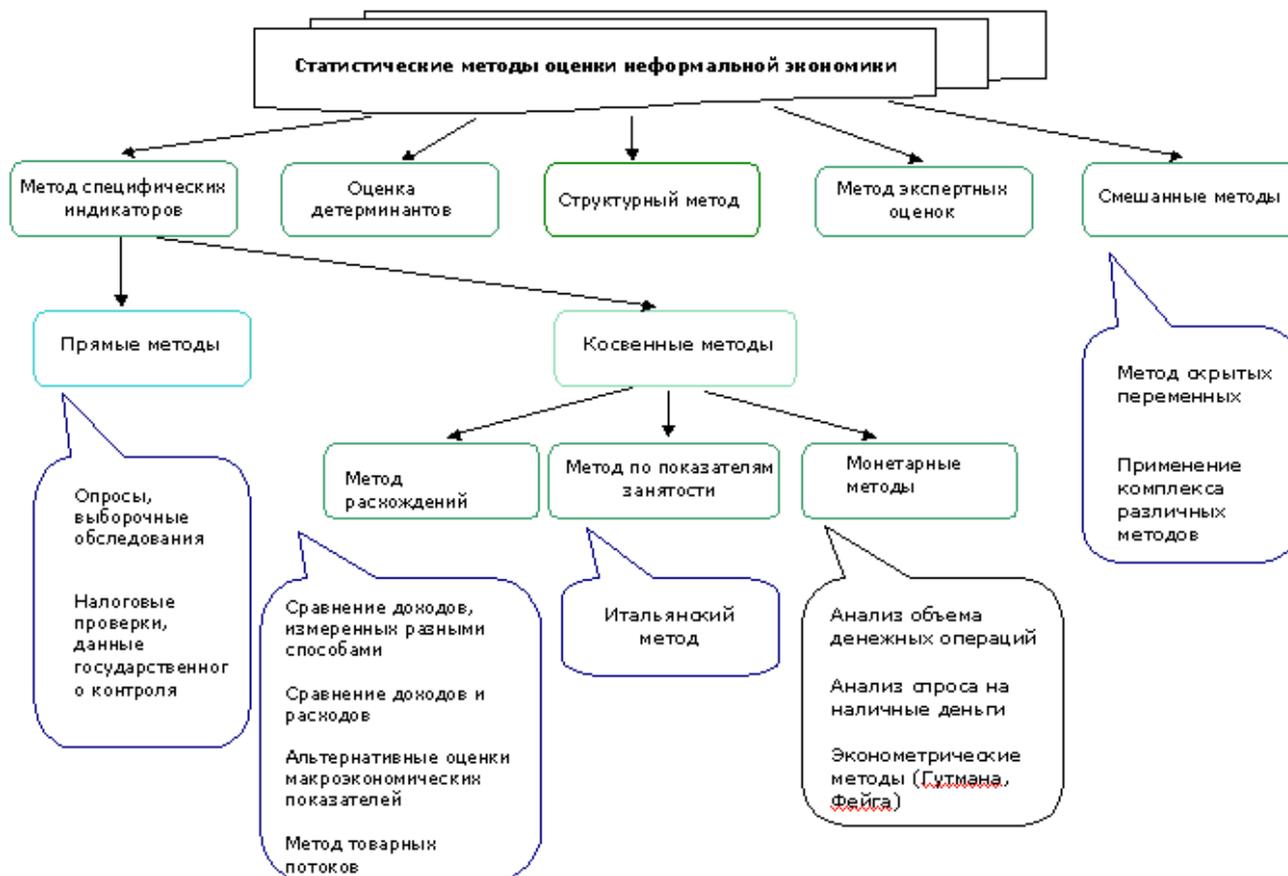
Рисунок №1.



Статистические методы оценки неформального сектора

"When you can not measure, your knowledge is meager and unsatisfactory"
Lord Kelvin (Inscription at Harper Library- University of Chicago)

Рисунок №2.

Сравнение различных методов измерения масштабов неформальной экономики

Оценки средних масштабов неформальной экономики в Канаде, Германии, Великобритании, Италии и США в 1970–1990-е годы, в % от ВВП	Методы оценок
24.4	Расхождения между фактическими и официально учтенными трудовыми ресурсами
21.9	Анализ объема операций
15.5	Анализ соотношения наличных денег и вкладов
12.7	Метод учета расхода электричества
8.9	Метод спроса на деньги
7.9	Моделирование
6.4	Расхождения между расходами и доходами
6.1	Анализ записей налоговых книг
3.1	Метод выборочных обследований

Источник: Schneider F., Enste D. Increasing Shadow Economies All Over the World - Fiction or Reality? A Survey of the Global Evidence of their Size and of their Impact from 1970 to 1995. (<http://www.economics.uni-linz.ac.at/Members/Schneider/EnstSchn98.html>)

Косвенные методы оценки неформального сектора✓ Тест Грэнжера (*Granger causality results*)

Связь между учтенным ВВП и скрытым, наличие связи между различными показателями макроэкономики и объемом неформального сектора.

✓ Методы расхождения между:

- совокупными национальными доходами и расходами
- официальным и фактическим объемом рабочей силы

фактически позволяют оценить лишь динамику неформального выпуска.

- ✓ Монетарные методы:
 - Анализ объема операций - метод Фейга (Feige)
 - Спрос на деньги – метод Танзи (Tanzi)
 - Анализ динамики соотношения наличности к депозитам или ко всей денежной массе – метод Гутманна (Gutmann)

✓ Метод мягкого моделирования (оценки детерминантов) связан с выделением совокупности факторов, определяющих неформальную экономику, и направлен на расчет ее относительных объемов

например, метод Lasko – household electricity approach:

$$\ln(ER_{ij}) = \alpha_1 \ln C_{ij} + \alpha_2 AG_{ij} + \alpha_3 G_{ij} + \alpha_4 Q_{ij} + \alpha_5 PR_{ij} + \alpha_6 H_{ij} + \alpha_7$$

$$H_{ij} = \beta_1 TL_{ij} + \beta_2 TC_{ij} + \beta_3 D_{ij} + \beta_4 I_{ij} + \beta_5 EX_{ij},$$

где i – номер страны; j – год;

ER – потребление электричества на душу населения в год; C – потребление на душу населения в год;

AG – доля сельского хозяйства в официальном ВВП; G – параметр климата;

Q – доля других источников энергии (не электричество), потребляемых домашним хозяйством, во всех источниках потребляемой энергии; PR – цена электроэнергии на внутреннем рынке;

H – выпуск неформального сектора на душу населения;

TL – налоги на трудовые доходы; TC – налоги на доход с капитала;

D – спад выпуска (в данном случае относительно 1989 года: $D_{ij} = 1 - (GDP_{ij} / GDP_{i1989})$);

I – ИПЦ; EX – совокупные расходы государства в процентах от ВВП.

- ✓ Модельный подход

Основан на теории скрытых (ненаблюдаемых) переменных.

η – ненаблюдаемая (скрытая, латентная) переменная – объем выпуска неформальной экономики;

$y' = (y_1, y_2, \dots, y_p)$ – вектор индикаторов;

$x' = (x_1, x_2, \dots, x_q)$ – вектор «причин», переменных влияющих на объем неформального сектора;

λ и γ – соответственно $(p \times 1)$ и $(q \times 1)$ -мерные векторы параметров;

ε и ζ – случайные ошибки (нормально распределенные, взаимно некоррелированные)

MIMIC model (“Multiple Indicator, Multiple Causes”)

$$y = \lambda \eta + \varepsilon \quad (1)$$

$$\eta = \gamma' x + \zeta \quad (2)$$

Отсюда получаем модель в следующем виде:

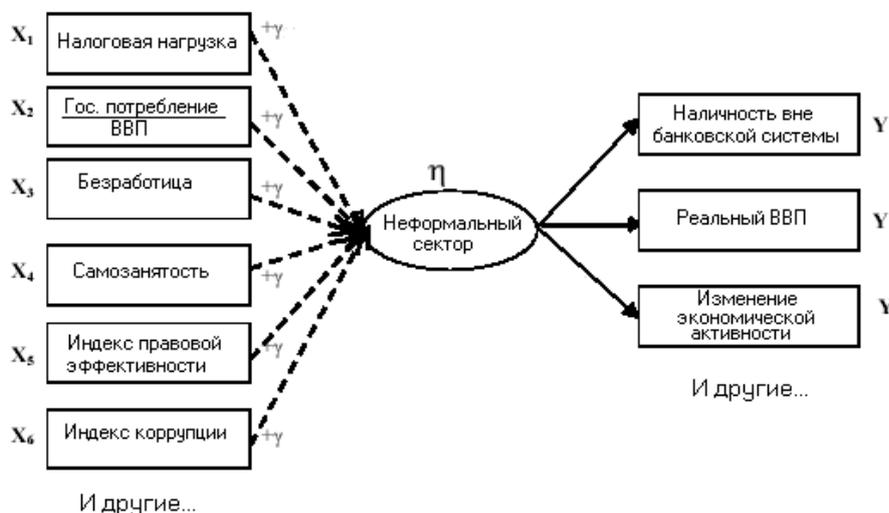
$$y = \Pi x + z$$

(3)

$$\Pi = \lambda \gamma'$$

$$z = \lambda \zeta + \varepsilon$$

$$\text{cov.}(z) = \lambda \lambda' \psi + \Theta_\varepsilon, \text{ где } \text{var}(\zeta) = \psi \text{ и } \text{cov}(\varepsilon) = \Theta_\varepsilon$$



Список литературы

1. "Measuring the Non-Observed Economy", A Handbook, OECD, 2002.
2. «Résolution concernant les statistiques de l'emploi dans le secteur informel», Organisation internationale du Travail, <http://www.ilo.org/>
3. «Безработица, структурная перестройка экономики и рынок труда в Восточной Европе и России» под редакцией Р. Емцова, С. Командера и Ф. Коричелли, Москва, ИНФРА-М, 1995
4. «Методологические положения по измерению занятости в неформальном секторе экономики». Госкомстат России, 2001.
5. «Насколько безработны безработные?» (результаты социологического анализа), Информационно-аналитический бюллетень № 2, 1998 г., Фонд «Бюро экономического анализа», <http://www.beafnd.org>
6. «О ситуации на российском рынке труда», Информационно-аналитический бюллетень № 8, 1998 г., Фонд «Бюро экономического анализа», <http://www.beafnd.org>
7. Chaudhuri Kausik, Schneider Friedrich, Chatterjee Sumana "The Size And Development Of The Indian Shadow Economy And A Comparison With Other 18 Asian Countries: An Empirical Investigation", First Draft, December 2002, www.economics.uni-linz.ac.at/Members/Schneider/default.htm
8. Dell'Anno Roberto "Estimating the Shadow Economy in Italy: a Structural Equation Approach", Department of Economics and Statistics, University of Salerno (Italy), Draft version (April 2003, www.unisa.it)
9. Djankov S., Lieberman I., Mukherjee J., Nenova T. «Going Informal: Benefits and Costs», The World Bank, April 2002
10. Feige Edgar L. "Defining and Estimating Underground and Informal Economies: the New Institutional Economics Approach" World Development, Vol 18, No 7, 1990
11. Feige Edgar L. "How Big is the Irregular Economy?" Challenge, Novembre-Décembre 1979, 5-13
12. Feige Edgar L., Urban Ivica "Estimating the Size and Growth of Unrecorded Economic Activity in Transition Countries: A Re-evaluation of Electric Consumption Method Estimates and their Implications" William Davidson Institute Work Paper 2003
13. Ghersi E. «The Informal Economy In Latin America», Cato Journal, Vol. 17, No. 1 1997, <http://www.cato.org>
14. Giles David E. A., Draeseke Robert «A Fuzzy Logic Approach to Modelling the Underground Economy», Department of Economics, University of Victoria, Canada, July 1999, www.uvic.ca
15. Giles David E. A., Tedds Lindsay M. «Modelling the Underground Economies in Canada and New Zealand: A Comparative Analysis» Econometrics Working Paper EWP0003, April, 2000, www.uvic.ca
16. Giles David E. A., Tedds Lindsay M., Werkneh Gugsu "The Canadian underground and measured economies: Granger causality results", Department of Economics, University of Victoria, Canada, June, 1999, www.uvic.ca
17. Giles David E.A. «The Underground Economy. Minimizing the Size of Government» <http://www.fraserinstitute.ca/>
18. Goldberg P.K., Pavcnik N. «The Response Of The Informal Sector To Trade Liberalization», January 2003, <http://www.nber.org/papers/w9443>
19. Grabowski M. «Informal labor market and informal economy during transition - the Polish perspective», April 2002 (Sofia), <http://www.ced.bg>
20. Hanousek J., Palda F. «Why People Evade Taxes In The Czech And Slovak Republics: A Tale Of Twins», Discussion Paper No.2002.85, April 2002, <http://www.cerge-ei.cz>
21. Koch E. «Informal Economy – Globalization for the People», August, 2002. <http://www.un.org>
22. Kolev A. «Labour supply in the informal economy in Russia during transition», Prague, 1998.
23. Lacko, M. (1999): "Hidden Economy – un unknown quantity? Comparative analysis in transition countries in 1989-1995", Working Paper, J. Kepler Universität Linz, Sozial und Wirtschaftswissenschaftliche Fakultät, Institut für Volkswirtschaftslehre, 9905.
24. Loayza, Norman V. (1996): The economics of the informal sector: a simple model and some empirical evidence from Latin America. Carnegie-Rochester Conference Series on Public Policy 45, pp. 129-162.
25. Maldonado, Carlos "The Informal Sector: Legalization or Laissez-Faire?" International Labour Review (1995) №134(№6), 705-728
26. Musiolek Bettina «Decent Work in the Informal Sector: CEE/CIS Region», Geneva, International Labour Office, 2002, <http://www.ilo.org/public/english/employment/infeco/publ.htm>
27. Najman Boris, Gignoux Jérémie "Offre de travail familiale et secteur informel en Russie, 1994-2000", INED, Paris, www.univ-paris1.fr
28. Schneider F., Enste D. "Shadow economies: Size, Causes, and Consequences" Journal of Economic Literature, Vol.38, No1 (Mar.,2000), 77-114
29. Schneider F., Enste D. «Increasing Shadow Economies All Over the World - Fiction or Reality? A Survey of the Global Evidence of their Size and of their Impact from 1970 to 1995.» <http://www.economics.uni-linz.ac.at/Members/Schneider/EnstSchn98.html>
30. Schneider Friedrich "The size and development of the shadow economies and shadow economy labor force of 22 transition and 21 OECD countries." Sofia, Bulgaria, April 2002, <http://www.ced.bg>
31. Schneider Friedrich "The Value Added of Underground Activities: Size and Measurement of the Shadow Economies of 110 Countries All Over the World", paper presented at an Workshop of Australian National Tax Centre, ANU, Canberra, Australia, July 17, 2002. www.economics.uni-linz.ac.at
32. Барсукова С. Ю. «Неформальная экономика: экономико-социологический анализ» Из-ва: Высшая школа экономики, ГУ ВШЭ, 2004 г.
33. Бекряшев А. К., Белозеров И. П. «Теневая экономика и экономическая преступность», 2003 г.,
34. Верлин Е. «Неформальная экономика Китая: взгляд изнутри», Эксперт №12, 2000 г.
35. Волконский В. А., Корягина Т. И. «Официальная и теневая экономика в реальности и статистике», Экономика и математические методы, том 36 (№ 4 , 2000г.)
36. Гимпельсон В. «Неформальная занятость в России», журнал «Демоскоп», 31 марта-13 апреля 2003г., www.demoscope.ru
37. Интернет-журнал "Экономическая теория преступлений и наказаний", <http://corruption.ruh.ru/magazine/>
- №1 // "Экономическая теория преступной и правоохранительной деятельности".
- №2 // "Неформальный сектор экономики за рубежом".
- №4 // "Теневая экономика в советском и постсоветском обществах".
- №5-2 // "Криминальная глобализация экономики. Часть II. Криминальное мировое хозяйство как система".
38. Исправников В.О. «"Теневые" параметры реформируемой экономики», Российский экономический журнал, 1996, №№ 8,9.
39. Капелюшников Р.И. «Российский рынок труда: адаптация без реструктуризации.», 1999г. <http://www.libertarium.ru/libertarium/kapelushnikov>
40. Клямкин И.М., Тимофеев Л.М. «Теневая Россия.» Экономико-социологическое исследование. М.: РГГУ, 2000.
41. Колесников С. "Теневая экономика: как ее считать", "Экономика России. XXI век" №1, январь 2001г, <http://www.ruseconomy.ru>
42. Кузнецова Т. «Некоторые аспекты исследования неформальной экономики в России», Вопросы экономики №9, 1997г.
43. Латов Ю.В. «Длинные тени общества "светлого будущего": два опыта интерпретации», Вопросы экономики. 2000. № 8.
44. Латов Ю.В. «Экономика вне закона. (Очерки по теории и истории теневой экономики)», М.: Московский общественный научный фонд, 2001.
45. Пономаренко А. «Неучтенные доходы и структура ВВП», Вопросы статистики, № 4, 1997.
46. Прауст Р.Э. «Семейные хозяйства и теневая экономика аграрного сектора России», Институт экономики переходного периода, Бюллетень № 2, 1999, http://www.iet.ru/personal/agro/newslet/2_4.htm
47. Рябушкин Б.Т., Чурилова Э.Ю. «Методы оценки теневого и неформального секторов экономики», Финансы и статистика, 2003
48. Симагин Ю. «Об оценках масштабов дополнительной занятости населения», Вопросы экономики, №1, 1998.
49. Сото Э. де «Иной путь. Невидимая революция в третьем мире.», Москва, Catallaxy, 1995.
50. Хансен М. «Дилемма неформального сектора», Человек и труд. №1,2,3. 1992.