

**НАРОДНОХОЗЯЙСТВЕННЫЕ
ПРОБЛЕМЫ**

**ВЛИЯНИЕ ОРГАНИЗОВАННОЙ ПРЕСТУПНОСТИ
НА РЕГИОНАЛЬНУЮ ДИФФЕРЕНЦИАЦИЮ ЦЕН***

© 2007 г. К. П. Глущенко

(Новосибирск)

Оценивается влияние организованной преступности на межрегиональный разброс цен для каждого года с 1992 по 2000 г. и за период 1993–2000 гг. по выборкам, включающим 70 регионов России и 50 регионов ее европейской части. В большинстве случаев связь между ценами и преступностью оказывается статистически значимой и положительной. Организованная преступность вносит весомый вклад в средний межрегиональный разброс цен. Вместе с тем роль организованной преступности со временем снижается.

1. ВВЕДЕНИЕ

Широкие масштабы организованной преступности в России вызвали интенсивный поток исследований, посвященных экономической стороне этой проблемы. Достаточно сказать, что издается даже специализированный реферативный журнал “Экономическая теория преступлений и наказаний”. Однако работы, в которых количественно оцениваются результаты воздействия организованной преступности на различные аспекты экономической деятельности, весьма немногочисленны. Задача дать такие количественные оценки является предметом данной статьи. В ней приводятся результаты статистических расчетов по эмпирическим данным (включающим как сведения официальной статистики, так и информацию из других источников), которые показывают, какую роль играет организованная преступность в межрегиональных различиях цен потребительских товаров.

Литература по экономическим аспектам организованной преступности в России достаточно обширна, поэтому ограничимся упоминанием только нескольких работ. Так, В. Волков (1999) трактует организованную преступность как вид бизнеса, названный им “силовым предпринимательством”. А.В. Кива (1999) качественно оценивает масштабы криминальной деятельности, пытаясь ответить на вопрос, действительно ли в стране произошла “криминальная революция”. В. Радаев (1998) приводит ряд данных об издержках предпринимателей, обусловленных организованной преступностью, основываясь на результатах социологических обследований. Дж. Ляйцель (Leitzel, 2002) рассматривает российскую организованную преступность и коррупцию в терминах затрат и выгод. Работа (Lotspeich, 1997) посвящена вымогательству; автор обнаруживает, что большая доля новых частных предприятий в России платит “дань” преступным группировкам. Д. Браун и Дж. Эрл (Brown, Earle, 2000) провели эконометрический анализ связи между эффективностью предприятий и – наряду с другими факторами – уровнем организованной преступности (результаты этой работы обсуждаются далее в разд. 5).

Вклад настоящей статьи состоит в том, что она дает (в количественном выражении) представление о роли, которую организованная преступность играет в сегментации российского рынка.

2. МЕТОДИКА АНАЛИЗА

Статистический анализ основан на следующих теоретических соображениях¹. Национальный рынок потребительских товаров рассматривается как совокупность региональных рынков (для упрощения регионы представлены их административными центрами). Интеграция (связанность) такого пространственно рассредоточенного рынка определяется свободой перемещения товаров между регионами.

*Работа выполнена при финансовой поддержке Консорциума экономических исследований и образования (EERC) (проект 99-313).

¹Подробное обсуждение и обоснование принятого в работе подхода содержится в (Глущенко, 2002; Gluschenko, 2003, 2004), поэтому здесь он излагается в общих чертах, а математическая формализация сведена к минимуму.

Один из полюсов – совершенно интегрированный рынок, характеризующийся абсолютно свободным межрегиональным товарообменом. Иными словами, совершение сделки купли-продажи данного товара между агентами рынка как из одного региона, так и из любых двух разных, требует одних и тех же затрат. Тогда пространственное рассредоточение теряет свое значение, рынок функционирует как единое целое, по сути являясь полным аналогом “точечного” совершенного конкурентного рынка. При этом на всем рынке устанавливается единая цена товара, зависящая от совокупного по стране спроса, спрос же в каждом отдельном регионе влияния на цену в нем не оказывает.

Механизмом поддержания пространственного равновесия является межрегиональный товарный арбитраж – покупка товара в регионах, где он дешевле, для перепродажи там, где цена выше (поскольку рассматривается статическая модель, принято, что арбитраж происходит мгновенно). Допустим, в некотором регионе выросли доходы, что повлекло за собой рост спроса на товар и, соответственно, повышение его цены. Возможность получения прибыли за счет разницы в ценах порождает арбитражные сделки. Вызванный ими приток товара в данный регион из остальных увеличивает предложение, обуславлив снижение цены, а отток товара из других – повышение цены в этих регионах. В результате такого процесса цена товара во всех регионах вновь выровняется (эти нехитрые рассуждения и лежат в основе известного закона единой цены). Причем в случае, когда изменение спроса в регионе пренебрежимо мало по сравнению с объемом спроса во всей стране (что и имеет место на практике), выравнивание цен происходит без изменения их общего уровня. Иными словами, на совершенном интегрированном рынке кривая предложения для каждого отдельного региона представляется абсолютно эластичной, откуда очевидно отсутствие зависимости цены в регионе от локального спроса.

Транзакционными издержками арбитража естественно считать разницу между затратами на совершение сделки между агентами рынка из двух разных регионов и внутри одного и того же региона. При таком определении транзакционные издержки арбитража на совершенном интегрированном рынке отсутствуют. Другой полюс – совершенно неинтегрированный рынок, на котором возможности межрегиональной торговли полностью отсутствуют. Он представляет собой просто совокупность изолированных друг от друга, автаркических региональных рынков. Цена товара в каждом регионе определяется исключительно соотношением локального предложения и локального спроса. В терминах транзакционных издержек арбитража это означает, что для каждой пары регионов они превышают любое возможное различие между ценами товара в регионах данной пары (формально издержки арбитража на таком рынке бесконечны, в отличие от нулевых в случае совершенной интеграции).

В реальности такая ситуация будет соответствовать промежуточному случаю: ограниченной в той или иной мере свободе межрегиональной торговли – само пространственное рассредоточение рынка является препятствием для абсолютной свободы товарообмена, обуславливая необходимость организации транспортировки товаров на большие расстояния. В этом случае имеют место конечные транзакционные издержки арбитража, величина которых зависит от того, между какими конкретными регионами осуществляется арбитраж, т.е. для каждой пары регионов она будет своя. На таком рынке арбитраж не в состоянии полностью выровнять цену товара: он может уменьшить межрегиональные различия цены лишь до размеров издержек арбитража. Отсюда следует, что хотя цена товара в регионе и не определяется полностью локальным спросом, но в некоторой мере может зависеть от него. Степень этой зависимости можно использовать для оценки интеграции рынка: чем слабее зависимость, тем более интегрирован рынок.

Трудность состоит в том, что достаточно представительные данные о спросе отсутствуют. Поэтому для эмпирического анализа нужен более доступный показатель. Обозначим через P_r цену некоторого товара в регионе r , а через I_r – душевой доход в этом регионе. Условие рыночного равновесия

$$D(P_r, I_r) - S(P_r) = 0 \quad (1)$$

(где $D(\cdot)$ – функция спроса, а $S(\cdot)$ – функция предложения), которое позволяет выразить цену как функцию от душевого дохода, избавившись от величины спроса. Примем в качестве измерителя различия цен между регионами r и s логарифм отношения розничной цены товара в этих регионах, $P_{rs} = \ln(P_r/P_s)$, а в качестве измерителя различия спроса – величину $I_{rs} = \ln(I_r/I_s)$. Тогда при некоторых дополнительных предположениях указанную выше зависимость можно представить в

виде следующей эконометрической модели (для удобства индексы регионов считаются упорядоченными так, что все величины P_{rs} неотрицательны):

$$P_{rs} = \beta I_{rs} + \varepsilon_{rs}. \quad (2)$$

Здесь β – неизвестный (подлежащий оценке) коэффициент, представляющий собой эластичность межрегионального разброса цен по разбросу доходов, а ε_{rs} – остаточный член (ошибка) регрессии. Величина β является характеристикой степени интеграции рынка, она измеряет отклонение от состояния совершенной интеграции, в котором $\beta = 0$.

Одновременно различие цен P_{rs} равно трансакционным издержкам арбитража, точнее, величине $C_{rs} = \ln(1 + c_{rs})$, где c_{rs} – издержки арбитража в расчете на единицу товара по отношению к его цене. Не зная этих издержек, мы и наблюдаем зависимость разброса цен от разброса спроса. Но если можно квантифицировать какие-то составляющие издержек арбитража, то при включении их в правую часть уравнения (2) эта зависимость будет ослабевать, а если бы удалось охватить все составляющие, то она исчезла бы вообще. Отсюда приходим к расширенному варианту модели (2), позволяющему оценить вклад различных факторов в межрегиональный разброс цен:

$$P_{rs} = \beta^* I_{rs} + \sum_k \delta_k X_{krs} + \varepsilon_{rs}, \quad (3)$$

где k – индекс фактора, предположительно влияющего на разброс цен; X_{krs} – переменная, количественно описывающая фактор k для пары регионов (r, s) ; δ_k – оцениваемые коэффициенты, отражающие степень влияния соответствующего фактора на разброс цен.

Величина β^* характеризует совокупное влияние неидентифицированных факторов. Очевидно, что $\beta^* < \beta$, но вряд ли можно ожидать, что при $\beta > 0$ мы получим $\beta^* = 0$, поскольку набор переменных X_{krs} на практике заведомо не охватит всех препятствий межрегиональному товарообмену (например, автору, несмотря на значительные усилия, так и не удалось собрать более или менее полную информацию об административных барьерах, направленных на ограничение вывоза отдельных видов продукции из региона или их ввоза в регион, которые время от времени имели место в различных субъектах Федерации).

Торговля потребительскими товарами, имеющая дело с “живыми” деньгами, – весьма привлекательный объект для криминальных группировок. Поэтому можно ожидать, что их деятельность в этой сфере оказывает заметное влияние на конечные розничные цены. В таком случае различие цен между регионами будет зависеть от того, насколько разнятся масштабы этой деятельности в данных регионах. Как велико указанное влияние (и имеется ли вообще), можно установить, включив соответствующие показатели в состав переменных X_{krs} . Чтобы иметь концептуальную основу для интерпретации статистических оценок, рассмотрим в общих чертах, каким образом криминальная деятельность может влиять на цены товаров в регионах.

3. МЕХАНИЗМ ВОЗДЕЙСТВИЯ ОРГАНИЗОВАННОЙ ПРЕСТУПНОСТИ НА ЦЕНЫ

Публикации в российской прессе времен рыночных преобразований дают бесчисленное множество конкретных примеров преступной деятельности, затрагивающей сферу розничной и оптовой торговли. Обобщая эти примеры, можно выделить ряд основных направлений такой деятельности, в конечном счете отражающихся на розничных ценах. Классифицировав по экономическим последствиям виды преступной деятельности, их можно объединить в следующие совокупности (для краткости описанные схематично).

К первому виду преступной деятельности можно отнести racket предприятий оптовой и розничной торговли или, как изящно выразились зарубежные исследователи (Berkowitz, DeJong, Husted, 1998), извлечение “вымогательской ренты”. Сюда же следует включить грабежи на дорогах и “дань” за провоз груза по тому или иному участку автомагистрали и (или) за ввоз его в город². Экономическим последствием является увеличение издержек меж- и внутрирыночной торговли (включаемое в конечные цены). Согласно В. Радаеву (1998), плата преступной группе за “защиту” от других групп и отдельных вымогателей за “крышу” обходится предпринимателю в 10–15% доходов, но может быть и больше – до 1/3. С другой стороны, предотвращение racket также связано с ростом затрат на охрану и безопасность бизнеса.

² Правда, взимать такую “дань” может и милиция (Кактурская, Крашков, 2002).

Заинтересованные в поддержании величины “вымогательской ренты” преступные группы препятствуют притоку товаров из местностей с более низкими ценами (например, широко известен факт, что московская мафия не пропускала в город автомашины с овощами и фруктами из южных районов страны (Efferon, 1994)). Эта совокупность включает также принуждение привезших товар продать его криминальной группировке (или ее “подопечным”) по бросовой цене; он затем перепродается на местном рынке по гораздо более высоким ценам. Экономическое последствие – ограничение арбитража.

Для поддержания величины “вымогательской ренты” преступные группировки также вынуждают продавцов не опускать цены ниже “установленной” границы. В некоторых случаях “заказчиками” таких акций выступают и сами торговцы, препятствуя конкурентам снижать цены. Экономическое последствие здесь состоит в ограничении внутривыночной ценовой конкуренции.

И, наконец, четвертая совокупность связана с товарами, поставляемыми особо крупными партиями. Имеются сведения, что в некоторых городах оптовая торговля бензином (и, возможно, сахаром) контролируется организованной преступностью. “Скрытая” монополия (если фактический контроль принадлежит одной криминальной группе) или картельный сговор (если групп несколько) позволяют синхронно поднять в городе цены на товар, одновременно блокируя его поступление по иным каналам. Еще одна сфера махинаций здесь – закупка продовольствия местными администрациями, осуществляемая коррумпированными чиновниками в “кооперации” с преступными группами по завышенным ценам (чаще всего дело касается зерна, большие объемы закупок которого сулят огромные барыши; естественно, что впоследствии использование такого сырья приводит к высоким ценам производимой из него продукции, в частности хлеба). Экономическая суть этой совокупности – изъятие, обычно с избытком, межрегиональной разницы в ценах, а последствие – локальный рост цен (не элиминируемый арбитражем).

Таким образом, организованная преступность объективно противодействует интеграции российского потребительского рынка, создавая как непосредственные барьеры для товарного арбитража, так и увеличивая трансакционные издержки арбитража и тем самым препятствуя межрегиональному выравниванию цен. Поэтому следует ожидать, что чем выше в регионе уровень организованной преступности, тем выше в нем будут цены.

Следует отметить еще одно крупное направление криминальной деятельности, потенциальные экономические последствия которой качественно иные – усиление конкуренции и снижение цен. Речь идет о подпольном производстве суррогатной водки и контрабандном ввозе товаров. В какой мере это обстоятельство может скорректировать предшествующий вывод?

При широкомасштабном производстве фальсифицированной водки ее реализация производится через легальные каналы³. Попав в торговую сеть, она распространяется дальше как обычный товар, в том числе и в другие регионы (так, известно, что в течение нескольких лет водка “Абсолют” в Россию не поставлялась, тем не менее она продавалась по всей стране)⁴. Прежде поддельная водка продавалась в розничной торговле заметно дешевле подлинной, однако впоследствии – после ужесточения контроля за оборотом алкогольной продукции, лицензирования торговли ею, запрета продажи в киосках – она продается по тем же ценам, что и подлинная (чтобы не привлекать внимания контролирующих и правоохранительных органов), а ценовая конкуренция с легальными производителями происходит почти исключительно в сфере оптовой торговли. В случае, когда поддельная водка поставляется производителем (или его посредником) непосредственно в магазины, он заинтересован не в увеличении объема продаж в каждом из них за счет более низких розничных цен, а в проникновении в другие, поскольку это дает гораздо больший прирост дохода.

Мало оказалось стимулов участвовать в ценовой конкуренции и у самих магазинов, так как выигрыш от увеличения оборота несопоставимо (на порядки) меньше выгоды от подмены подлинной водки фальсифицированной. Не исключено, что поддельную водку в магазин поставляет одна криминальная группа, а “крышу” ему предоставляет другая. Но даже если такие магазины имеют какие-то “льготы” от организованной преступности, другие, торгующие подлинной водкой (или даже поддельной, но поступившей по легальным каналам, так что о ее происхождении

³ Подпольная торговля суррогатной водкой (по весьма низким ценам) относится скорее в основном к сфере теневой экономики, чем к организованной преступности. Обычно она имеет место в случаях кустарного производства в небольших масштабах, организованного отдельными лицами или небольшими группами “подпольных бизнесменов”.

⁴ Поэтому введенная в некоторых регионах дополнительная сертификация алкогольных напитков имеет не только протекционистские цели, но призвана также воспрепятствовать проникновению на рынок фальсифицированной водки (как ввозимой из других регионов, так и местного производства).

магазин может и не знать), испытывают описанное выше давление преступных групп. Таким образом, воздействие организованной преступности на цены здесь может быть канализировано по разным направлениям. И хотя априорно нельзя сказать, какой будет в конечном счете равнодействующая, можно полагать, что скорее всего рост издержек торговли окажется более значимым⁵.

Хотя контрабандный ввоз товаров и должен способствовать снижению цен, но, как представляется, этот эффект вряд ли локализуется на уровне отдельного региона. Так, излюбленные объекты контрабанды – сигареты (до 1999 г.), алкогольные напитки, бытовая электроника. Однако их нелегальный ввоз осуществляется большими партиями и затем эти товары распространяются по всей стране. Даже если партии относительно малы, их объем обычно все же велик для отдельного города (региона) и они распределяются по нескольким окружающим регионам. Например, в Новосибирске контрабанда ширпотреба из Китая монополизирована одной из преступных группировок, но Новосибирск служит лишь крупной оптовой перевалочной базой этих товаров, которые затем направляются в другие регионы страны (Томилина, 2000). По-видимому, контрабанда скорее способствует снижению цен на уровне всей страны, чем отдельных регионов.

Итак, следует ожидать, что знак коэффициента δ_k при переменных, представляющих организованную преступность, окажется положительным.

4. ИСХОДНЫЕ ДАННЫЕ

Поскольку необходимая информация имела не по всем субъектам Федерации, статистический анализ охватывает 70 регионов страны. В выборку не включены: все 10 автономных округов, республики Адыгея, Дагестан и Ингушетия, Чеченская Республика, Волгоградская и Мурманская области, Еврейская автономная область, а также Московская и Ленинградская области (но города Москва и Санкт-Петербург в выборке присутствуют). Кроме расчетов по этой выборке (“Россия в целом”), дающей 2415 пар регионов, они проводились также по европейской части РФ. Данная выборка охватывает 50 регионов, что дает 1225 наблюдений по парам регионов. Рассматриваемый период – 1992–2000 гг.

В статье в качестве представителя цен используется стоимость набора из 25 основных продуктов питания⁶. Помесячные данные о стоимости набора с февраля 1992 г. по декабрь 2000 г. по административным центрам регионов были получены в Госкомстате России (стоимости набора за 1992–1996 гг. были рассчитаны ретроспективно; хотя с июня 2000 г. для статистических публикаций был принят новый набор, стоимость прежнего продолжала определяться до конца 2000 г.). Из них рассчитывались относительные стоимости 25-продуктового набора P_i/P_s для каждой пары регионов, а затем вычислялось их среднее геометрическое за соответствующий год (для 1992 г. – за 11 месяцев). Поскольку усредняются не абсолютные значения цен, а их отношения, такое усреднение вполне корректно даже для лет с высокой инфляцией.

Переменная I_{rs} рассчитывалась таким же образом по месячным доходам на душу населения; источником данных послужили ежемесячники “Социальное и экономическое положение России”. Известно, что данные официальной статистики об абсолютных величинах доходов населения не отличаются высокой достоверностью. Однако межрегиональные соотношения доходов, как выяснилось в ходе исследования, довольно близки к реальности. Это показало сопоставление с межрегиональными соотношениями целого ряда показателей, в той или иной мере связанными с денежными доходами (расходы населения, выплаченная заработная плата, розничный товарооборот и др.). По-видимому, процентные ошибки статистического измерения доходов в разных регионах не очень разнятся между собой.

В качестве дополнительных переменных, которые характеризуют различные факторы, влияющие на интеграцию рынка товаров, были использованы: расстояния между административным центром регионов (как индикатор транспортных затрат), труднодоступность региона (1 – для Магаданской, Камчатской, Сахалинской областей и Республики Якутии, 0 – для остальных регионов), издержки обращения в розничной торговле, качество транспортной инфраструкту-

⁵ Отметим, что “позитивная” роль организованной преступности может ускользать от статистики цен. Для статистического наблюдения за ценами на водку используются 6 марок-представителей: отечественная водка обычного качества (типа “Русская”, “Московская”), повышенного качества (типа “Посольская”, “Пшеничная”) и импортная (типа “Финляндия”, “Абсолют”). Если поддельная водка имеет иную марку, регистрация цен минует ее (не говоря уже о продаваемой подпольно).

⁶ Результаты более обширного анализа, охватывающего как агрегированные ценовые показатели, так и цены ряда отдельных продовольственных и промышленных товаров, содержатся в работе (Глущенко, 2002).

Таблица 1. Корреляция между уровнем и экономической властью преступности

Год	Россия в целом	Европейская часть
1992	0.114	0.061
1993	0.136	0.053
1994	0.168	0.025
1995	0.116	-0.069
1996	0.190	0.148
1997	0.097	-0.037
1998	0.090	-0.070
1999	0.077	-0.047
2000	0.034	-0.088

ры, индекс регионального транспортного тарифа, степень регулирования цен в регионах, уровень дотирования местных производителей. За более подробным описанием этих переменных со ссылками на источники данных отсылаем читателя к работам (Глущенко, 2002; Gluschenko, 2004).

Для квантификации масштабов деятельности организованной преступности использованы два индикатора⁷. Первый – общий уровень преступности, т.е. количество зарегистрированных в регионе преступлений на 100000 человек населения в данном году согласно данным официальной статистики (Регионы России, 2001, т. 2, с. 270–271). Значение переменной для пары регионов рассчитано как логарифм отношения величин этого показателя в регионах, входящих в пару, она далее обозначается $X_{УПР}$.

Второй индикатор характеризует экономическую власть организованной преступности, измеряя ее долей региональной экономики, контролировавшейся криминальными группами в 1995–1996 гг. Оценки были сделаны аналитиками еженедельника “Аргументы и факты” на основе данных, полученных на научной конференции по теневой экономике, а также предоставленных Вольным экономическим обществом и МВД РФ (Какоткин, 1996). Так как значения данного индикатора имеются только на один момент времени, принято, что они одинаковы для всех годов рассматриваемого периода. Такое предположение, вероятно, близко к действительности в 1995–1996 гг., для которых делались оценки, но, конечно, при большом удалении от этих лет такая экстраполяция может оказаться довольно грубой. Следуя (Brown, Earle, 2000), степень экономической власти преступности принята равной 1 (очень высокая), если криминальные группы контролируют более 50% экономики региона, 0.75 (высокая) – если 35–50%, 0.5 (средняя) – если 20–25%, и 0.25 (низкая) – если они контролируют менее 20%. Значение переменной для пары регионов рассчитано как разность этих величин в регионах данной пары, она далее обозначается $X_{ЭВР}$.

Корреляция между двумя измерителями организованной преступности довольно слаба. Коэффициенты корреляции по годам представлены в табл. 1.

В разные годы корреляция имеет различные знаки, ее максимум приходится на 1996 г., на который и была сделана оценка экономической власти организованной преступности. Данные табл. 1 показывают, что эти два индикатора организованной преступности далеко не являются разными версиями друг друга, а характеризуют ее с разных сторон. Исходя из этого, в регрессию (3) включены обе переменные. Можно предположить, что общий уровень преступности косвенно отражает активность преступных сообществ, тогда как экономическая власть преступности – возможности таких сообществ сочетать преступные формы деятельности с легальными, тем самым значительно увеличивая “эффективность” первых. Деятельность криминальных структур в легальном бизнесе качественно отлична от обычной уголовщины: преступность как таковая, когда имеет здесь место, гораздо более латентна, поскольку имеет в основном экономический характер. Поэтому вряд ли большая экономическая власть преступности в регионе обязательно вызовет рост числа преступлений.

Следует отметить, что указанные показатели не только являются всего лишь косвенными и очень грубыми характеристиками организованной преступности, но и имеют невысокое каче-

⁷ Под индикатором понимается показатель, косвенно характеризующий изучаемый объект и используемый взамен не доступных наблюдению и измерению характеристик (Социология, 2003, с. 363; Цели и ресурсы, 1985, с. 86).

ство. Число зарегистрированных преступлений гораздо ниже их фактического числа. Однако все же можно полагать, что эти две величины пропорциональны друг другу. И использование в качестве переменной отношения данного показателя в паре регионов улучшает ситуацию (как в случае с душевыми доходами). Конечно, не исключено, что в отдельных регионах доля незарегистрированных преступлений резко отличается от “типичной”, ухудшая качество оценок, но можно надеяться, что в большинстве регионов она достаточно близка к “типичной”. Сведения, по которым можно было бы судить о качестве показателя экономической власти организованной преступности, вообще отсутствуют. Публикация (Какоткин, 1996) не описывает ни метод его оценки, ни использованные данные, а первоисточников, на которых она основывается, обнаружить не удалось. Таким образом, приведенные в следующем разделе количественные результаты, которые получены на основе такой информации, условны. Информативными являются не величины оценок сами по себе, а их значимость, направление изменений и степень влияния на объясняемую переменную.

Конечно, и сам выбор переменных далек от желаемого. Чтобы не апеллировать к интуитивному определению организованной преступности, будем отталкиваться, например, от ее описания и классификации в (Дзалиев, 1999, с. 234–247). На основании этих данных видно, что организованную преступность нельзя квантифицировать каким-то одним показателем, нужна многомерная характеристика – комплекс показателей. Но из-за специфики описываемого объекта такого комплекса показателей, “адекватно” отражающего организованную преступность, мы не будем иметь никогда (тем более, когда речь идет о ее деятельности в какой-то определенной сфере экономики). И при количественном анализе всегда придется довольствоваться той информацией, которая доступна – косвенными и весьма неточными характеристиками.

Поскольку один из индикаторов представляет собой общий уровень преступности, возникает вопрос: в какой мере межрегиональные различия цен могут быть обусловлены “неорганизованной” преступностью? Для одиночных преступников или их небольших групп, не входящих в криминальные сообщества, доступны всего несколько видов преступлений, которые могут оказать влияние на цены: кражи в магазинах самообслуживания, другие хищения товаров, ограбления торговых точек. Их результатом является почти исключительно рост издержек розничной торговли вследствие компенсации потерь от преступлений или затрат на их предотвращение (в отличие от организованной преступности, обладающей возможностями действовать, как показывает обсуждение в разд. 3, практически во всех звеньях цепи распределения товаров). Но межрегиональные различия издержек обращения в розничной торговле являются в используемой для анализа модели контролируемым фактором – они представлены отдельной объясняющей переменной, что элиминирует эффект “неорганизованной” преступности.

5. РЕЗУЛЬТАТЫ СТАТИСТИЧЕСКОГО АНАЛИЗА

Регрессия (3) оценивалась для каждого отдельного года рассматриваемого периода и с тем же набором переменных по панели 1993–2000 гг. (содержащей 19320 наблюдений по России в целом и 9800 наблюдений по европейской части страны). По России в целом среднее значение переменной, характеризующей экономическую власть организованной преступности, $\bar{X}_{ЭВ} = 0.084$, а ее стандартное отклонение $\sigma(X_{ЭВ}) = 0.360$; по европейской части России $\bar{X}_{ЭВ} = 0.046$, $\sigma(X_{ЭВ}) = 0.380$ (напомним, что значения данной переменной не меняются во времени). В табл. 2 приведены средние значения и стандартные отклонения объясняемой переменной и второй из интересующих нас объясняющих переменных – уровня преступности.

Наряду с $X_{УПрс}$ имеются еще несколько переменных, постоянных во времени либо по своему существу (расстояние, труднодоступность региона, качество транспортной инфраструктуры), либо из-за отсутствия данных в динамике (степень регулирования цен и уровень дотирования). Из-за этого применение панельной модели с фиксированными эффектами невозможно, и используется модель со случайными эффектами, основанная на методе наименьших квадратов с панельной корректировкой стандартных ошибок – модель PCSE (Beck, Katz, 1995). Поскольку данных об издержках обращения за 1992 г. найти не удалось, этот год в панель не включен.

Результаты оценки регрессии (3) по годам и по панели 1993–2000 гг. представлены в табл. 3 (панельные оценки содержит последняя строка таблицы). Так как полный набор оценок довольно громоздок, приводятся только оценки коэффициентов δ_k при переменных, характеризующих

Таблица 2. Описательные статистики

Год	Россия в целом				Европейская часть			
	различие цен P_{rs}		уровень преступности $X_{уПrs}$		различие цен P_{rs}		уровень преступности $X_{уПrs}$	
	\bar{P}	$\sigma(P)$	$\bar{X}_{уП}$	$\sigma(X_{уП})$	\bar{P}	$\sigma(P)$	$\bar{X}_{уП}$	$\sigma(X_{уП})$
1992	0.207	0.164	0.208	0.357	0.180	0.142	0.183	0.312
1993	0.255	0.226	0.225	0.375	0.184	0.167	0.181	0.341
1994	0.273	0.260	0.218	0.363	0.166	0.132	0.149	0.339
1995	0.241	0.212	0.230	0.378	0.147	0.118	0.168	0.368
1996	0.228	0.224	0.183	0.455	0.121	0.104	0.137	0.482
1997	0.206	0.212	0.154	0.390	0.098	0.081	0.042	0.382
1998	0.192	0.195	0.128	0.395	0.112	0.090	0.047	0.397
1999	0.150	0.149	0.092	0.406	0.100	0.085	0.040	0.424
2000	0.157	0.160	0.125	0.361	0.093	0.079	0.084	0.377
1993–2000	0.195	0.228	0.196	0.382	0.106	0.135	0.158	0.377

Таблица 3. Оценки влияния организованной преступности на разброс цен

Год	Россия в целом				Европейская часть			
	уровень преступности		экономическая власть преступности		уровень преступности		экономическая власть преступности	
1992	0.155	(0.008)***	0.014	(0.008)*	0.120	(0.012)***	-0.002	(0.011)
1993	0.157	(0.010)***	0.072	(0.011)***	0.104	(0.014)***	0.057	(0.014)***
1994	0.168	(0.008)***	0.070	(0.008)***	0.097	(0.010)***	0.051	(0.008)***
1995	0.110	(0.006)***	0.097	(0.006)***	0.068	(0.006)***	0.087	(0.007)***
1996	0.035	(0.005)***	0.056	(0.007)***	0.040	(0.004)***	0.073	(0.007)***
1997	0.012	(0.006)**	0.043	(0.006)***	-0.020	(0.005)***	0.029	(0.005)***
1998	0.013	(0.005)**	0.044	(0.006)***	-0.001	(0.006)	0.033	(0.006)***
1999	-0.006	(0.004)	0.024	(0.005)***	-0.020	(0.005)***	0.011	(0.006)*
2000	0.047	(0.005)***	0.045	(0.006)***	0.016	(0.005)***	0.016	(0.005)***
1993–2000	0.071	(0.003)***	0.050	(0.003)***	0.038	(0.003)***	0.040	(0.003)***

организованную преступность⁸. В табл. 3 в скобках даны стандартные ошибки (для оценок по отдельным годам – скорректированные на гетероскедастичность по Уайту); обозначения ***, ** и * показывают, что оценка значима на уровне 1, 5 и 10%, соответственно, отсутствие звездочек говорит о статистической незначимости оценки. Оценки для 1992 г. получены без учета издержек обращения, что несколько уменьшает их сопоставимость с оценками для остальных лет (правда, эксперименты с регрессиями для этих лет показали, что включение или исключение данной переменной слабо влияет на значения оценок коэффициентов при переменных организованной преступности).

За исключением двух случаев значимые оценки имеют ожидаемый положительный знак, говоря о том, что действия организованной преступности действительно обуславливает увеличение межрегионального разброса цен. Незначимыми оказались лишь три оценки: в двух случаях для уровня преступности и в одном – для экономической власти преступности. В основном одновременно значимы обе переменные организованной преступности, и нет ни одного случая, когда обе были бы незначимы. Это подтверждает высказанное выше предположение, что данные индикаторы являются двумя разными характеристиками организованной преступности.

⁸ Оценки для всех переменных приведены в (Глуценко, 2002; Gluschenko, 2004).

Таблица 4. Тренды влияния организованной преступности на разброс цен

Переменные	Россия в целом	Европейская часть
Уровень преступности	0.193–0.036 <i>t</i> (0.004) (0.001)	0.149–0.030 <i>t</i> (0.005) (0.001)
Экономическая власть преступности	0.116–0.018 <i>t</i> (0.004) (0.001)	0.077–0.012 <i>t</i> (0.005) (0.001)

Коэффициент при переменной, характеризующей уровень преступности, является эластичностью цены по уровню преступности. Таким образом, в целом за 1993–2000 гг. рост уровня преступности в регионе на 10% приводил к увеличению цен в регионе (если брать Россию в целом) примерно на 0.7%. Максимум приходится на 1994 г., составляя около 1.7%. По европейской части страны эта величина равна 0.4%, а ее максимальное значение – 1.2% в 1992 г. Все это справедливо и для пар регионов, только относится к росту различия цен между двумя регионами при увеличении различия в уровнях преступности.

Вообще говоря, коэффициент при переменной, описывающей экономическую власть организованной преступности, также представляет собой эластичность. Но сама переменная принимает дискретные значения, что приводит к следующей трактовке: увеличение степени экономической власти преступности в регионе на одну градацию (например, со слабой до средней) приводило к росту цен приблизительно на 1.3% для страны в целом и на 1% для европейской части, если рассматривать весь период 1993–2000 гг. По отдельным годам (исключая 1992 г.) эта величина менялась от 0.6 до 2.5% в первой выборке и от 0.3 до 2.2% – во второй; в обеих максимальные значения достигались в 1995 г. Интерпретация для пар регионов аналогична указанной в предыдущем абзаце.

Как видно, полученные оценки говорят, что в европейской части России влияние организованной преступности на увеличение разброса цен между регионами несколько слабее, чем по стране в целом.

Что касается динамики, то данные табл. 3 показывают наличие определенной тенденции: воздействие преступности на межрегиональный разброс цены в первые годы рыночных преобразований усиливается, достигая максимума в 1994–1995 гг., а затем начинает убывать. Чтобы оценить общее направление и скорость этих изменений, коэффициенты при переменных, описывающих организованную преступность, были представлены в динамическом виде как $\delta_k = \delta_{k0} + \delta_{k1}t$ (где t – год относительно 1993 г.) и оценены по панели 1993–2000 гг. Результаты приведены в табл. 4 (в скобках под оценками даны их стандартные ошибки); все оценки значимы на уровне 1%.

Во всех случаях коэффициент тренда оказывается отрицательным, показывая, что преобладающей тенденцией в рассматриваемом периоде является ослабление влияния организованной преступности. Скорость данного процесса довольно высока: исходные значения δ_k уменьшаются приблизительно на 20% в год (причем в процентном выражении скорости для России в целом и европейской части страны практически одинаковы).

Этот результат, на первый взгляд, представляется несколько неожиданным – действительность не дает свидетельств тому, что масштабы деятельности организованной преступности в России сокращаются. Но он говорит не об этом, а только об уменьшении ее экономического воздействия на потребительский рынок – в частности, о сужении сферы извлечения “вымогательской ренты”. И действительно, имеется ряд подтверждений такой динамики криминальной активности. Например, аналогичную тенденцию обнаружил В. Радаев (1998) на основе анализа данных социологических обследований: сокращение “зоны применения силовых методов” в российском бизнесе (в том числе, естественно, и в связанном с торговлей потребительскими товарами). Он предлагает следующие объяснения: конец эпохи “быстрых денег”, раздел зон влияния, повышение заботы (как преступности, так и пользующегося ее услугами бизнеса) о собственной безопасности, уход криминала в “белые” и “серые” сегменты рынков⁹. Это не означает, что ор-

⁹ “Период, когда делались рискованные деньги (большие, быстрые), закончился. “Сейчас это рутинная, сложная и тяжелая работа, здесь нет сверхприбыли, а где нет сверхприбыли, туда не лезут вымогатели”, – цитирует В. Радаев (1998, с. 90) своего респондента.

Таблица 5. Вклад организованной преступности в средний разброс цен, %

Год	В общий разброс цен		В разброс цен за вычетом географически обусловленного	
	Россия в целом	Европейская часть	Россия в целом	Европейская часть
1992	16.1	12.4	56.5	55.1
1993	16.2	11.5	55.9	41.8
1994	15.7	11.5	43.2	28.6
1995	14.3	12.3	31.1	22.9
1996	5.1	9.7	17.4	19.0
1997	2.9	2.3	11.2	7.1
1998	3.3	2.8	14.5	10.3
1999	1.0	-0.3	5.9	-1.1
2000	6.2	2.1	32.6	6.3
1993–2000	9.3	7.8	27.1	16.1

организованная преступность отстает, она трансформируется – противостояние преступности и бизнеса сменяется их взаимным проникновением.

Оценки, приведенные в табл. 3, говорят о том, что чувствительность цен к изменению уровня и экономической власти преступности относительно невелика, поэтому сами по себе они не дают представления о том, насколько значительную роль играет организованная преступность в формировании межрегионального разброса цен. Следуя (Engel, Rogers, 1996), экономическую значимость объясняющей переменной можно измерить вкладом ее среднего в среднее объясняемой переменной. Поскольку из (3) вытекает, что $\bar{P} = \hat{\beta} * \bar{I} + \sum_k \hat{\delta}_k \bar{X}_k$ (“^” означает оценку параметра), совместный вклад обеих переменных, описывающих организованную преступность, в средний разброс цен рассчитывается как $(\hat{\delta}_{уп} \bar{X}_{уп} + \hat{\delta}_{эв} \bar{X}_{эв}) / \bar{P}$. С другой стороны, в общем среднем разбросе цен можно выделить часть, обязанную естественным, неустранимым факторам. Такими являются расстояния, разделяющие регионы, и труднодоступность ряда регионов. Различия транспортных издержек между парами регионов обуславливают значительную часть разброса цен: в разные годы от 54 до 83% по России в целом и от 46 до 77% по европейской части (в целом за период 1993–2000 гг. соответственно 66 и 51%). Поэтому рассчитан также вклад организованной преступности в разброс цен за вычетом “естественной” части последнего, т.е. при среднем разбросе цен, уменьшенном на ту его часть, которая обязана соответствующим переменным – расстоянию и труднодоступности: $(\hat{\delta}_{уп} \bar{X}_{уп} + \hat{\delta}_{эв} \bar{X}_{эв}) / (\bar{P} - \hat{\delta}_{фп} \bar{X}_{фп} + \hat{\delta}_{тд} \bar{X}_{тд})$; индекс ФР означает физическое расстояние, а ТД – труднодоступность. Результаты приведены в табл. 5.

Как видно по данным табл. 5, организованная преступность вносит весомый вклад в возникновение межрегиональных различий цен. Если взять период 1993–2000 гг. в целом, то ей обязана почти десятая часть общего разброса цен по стране. А в разбросе цен сверх вызванного географическими факторами – более четверти по всей стране и почти шестая часть по европейской части страны. Особенно сильно проявлялось воздействие преступности на потребительские цены в начальные годы рыночных преобразований. Следует отметить, что из всех идентифицированных факторов, за исключением географических, почти во все годы наибольший вклад в разброс цен дает организованная преступность. Вместе с тем в подтверждение изложенных выше выводов он снижается со временем, хотя и с некоторыми отклонениями от этой тенденции. Весьма вероятно, что они связаны с кризисом 1998 г. и его последствиями. После периода почти неуклонного снижения в 1998 г. вклад преступности в разброс цен вновь увеличился, резко упав в следующем году (а в европейской части России – вообще исчезнув), но в 2000 г. он опять возрастает, причем различие между Россией в целом и европейской частью становится очень значительным. Однако приходится воздержаться от объяснения причин такой динамики, поскольку по мере удаления от 1995–1996 гг. индикатор экономической власти организованной преступности становится все менее надежным. Не исключено, что ее распределение по стране к 2000 г. (а может, и раньше) уже заметно отличалось от той, на которой основаны расчеты. Соответственно, уменьшается и надежность статистических оценок.

Приведенные результаты статистического анализа (как и предварявшие их содержательные соображения) показывают, что организованная преступность является существенным препятствием интеграции российского рынка. Но есть и другой результат, который, казалось бы, не согласуется с этим. Д. Браун и Дж. Эрл проанализировали влияние конкуренции на эффективность российских предприятий (Brown, Earle, 2000). Используя в качестве одной из переменных экономическую власть организованной преступности, они обнаружили довольно удивительный феномен: организованная преступность усиливает положительный эффект конкуренции, в том числе межрегиональной. Отсюда можно было бы заключить, что организованная преступность, напротив, способствует интеграции российского рынка. Так ли это? И противоречит ли данный результат зарубежных коллег изложенному в настоящей работе или же их можно совместить?

В качестве объясняемой переменной Д. Браун и Дж. Эрл используют физический объем выпуска продукции предприятием, а уровень конкуренции (“конкурентного давления”) характеризуют степенью деконцентрации меж- и внутрирегионального рынков. Выявленная положительная связь между этими переменными свидетельствует, что чем менее концентрирован рынок, тем выше эффективность работающих на нем предприятий, измеряемая выпуском продукции. При учете комбинированного воздействия конкуренции и организованной преступности (представленного произведением данных переменных) связь значительно усиливается.

Наш анализ относится к потребительским товарам (хотя в данной статье представлена только часть результатов, охватывающая продовольственные товары первой необходимости, они *качественно* не отличаются от результатов, полученных для других товаров). До кризиса 1998 г. производство большинства из них было низкоприбыльным, если не вообще убыточным. Поэтому криминальные группы не проявляли интереса к захвату контроля над производством этих товаров, предпочитая паразитировать на торговле ими. Привлекательными для преступных групп были конкурентоспособные, успешно работающие предприятия, контроль над которыми мог бы обеспечить высокие доходы. Таковыми (опять же до кризиса 1998 г.) были главным образом предприятия, работающие – прямо или опосредованно – на экспорт. Они в первую очередь и были объектом экспансии организованной преступности¹⁰ (дополнительный свет на вопрос о направленности этой экспансии могли бы пролить результаты расчетов Брауна и Эрла, будь они представлены в разрезе отраслей, но, к сожалению, в их работе приведены только агрегированные по всем отраслям данные).

Таким образом, даже если организованная преступность действительно способствует усилению конкуренции, нет оснований ожидать ее положительного влияния на интеграцию *потребительского* рынка, что и подтверждает использование индикатора $X_{ЭВРС}$, совпадающего с примененным Брауном и Эрлом, в настоящем исследовании. Более того, вряд ли можно полагать, что обнаруженный ими эффект связан с усилением ценовой конкуренции на внутреннем рынке вообще. О чем же тогда говорят их результаты? Авторы находят объяснение обнаруженному феномену в конкуренции преступных групп между собой, а также в том, что они облегчают поставку товаров за счет как обхода бюрократических рогаток, так и защиты поставок от грабителей. Возможно, это в определенной мере и имеет место, но главное, как представляется, в другом.

Во-первых, причинно-следственная связь может быть обратной: неорганизованная преступность способствует росту эффективности предприятия, и наоборот, чем успешней оно работает, тем более привлекательно для преступных групп и тем больше у него шансов попасть под контроль криминала. Во-вторых, преступная группа действительно может способствовать успешности предприятия своими специфическими средствами: контрабандным вывозом продукции, уходом от налогов, получением за счет подкупа чиновников различных преференций и (или) заказов на поставку своей продукции по завышенным ценам и т.п. И в-третьих, деятельность организованной преступности может вызывать искусственное увеличение самого показателя конкуренции (степени деконцентрации рынка): например, когда “вокруг” контролируемого предприятия создается множество посреднических фирм (зарегистрированных как производственные), задача которых состоит в уводе доходов предприятия от налогообложения, “отмывании” капиталов (часть которых может использоваться как легальные инвестиции в предприятие), внешнеторговых операциях с нарушением закона и т.п.

Из сказанного можно сделать вывод, что противодействие интеграции рынка, установленное в настоящем исследовании, и (кажущееся или действительное) усиление положительного эффекта конкуренции, обусловленные деятельностью криминалитета, которые обнаружили Д. Браун и

¹⁰Возможно, после 1998 г. ситуация изменилась. Однако сведений, дающих представление об эволюции “отраслевых интересов” организованной преступности за последние годы, обнаружить не удалось.

Дж. Эрл, не противоборствуют, а мирно сосуществуют друг с другом, происходя в разных “нишах”. Таким образом, полученные нами и зарубежными коллегами результаты не противоречат друг другу, а наоборот, взаимно дополняют.

6. ЗАКЛЮЧЕНИЕ

Итак, даже при использовании очень грубых индикаторов, характеризующих масштабы организованной преступности в регионах, обнаруживается значимая зависимость разброса потребительских цен по стране от деятельности криминальных групп. Вклад преступности в межрегиональные различия цен довольно весом и превосходит вклад любых других помех межрегиональному товарообмену за исключением обусловленных географическим положением регионов. Наличие положительной связи между организованной преступностью и потребительскими ценами в регионе означает, что имеется обратная зависимость между уровнем жизни в регионе и масштабами организованной преступности. Таким образом, организованная преступность в конечном счете вызывает снижение жизненного уровня в стране.

Автор признателен Ю. Андриенко, Э. Берилёфу, Д. Берковицу, М. Шафферу и Дж. Эрлу за полезные обсуждения и замечания. Он также благодарен Д. Брауну, любезно предоставившему некоторые данные.

СПИСОК ЛИТЕРАТУРЫ

- Волков В.** (1999): Силовое предпринимательство в современной России // *Социологические исследования*. № 1.
- Глуценко К. П.** (2002): Насколько едино российское экономическое пространство? // *Научные доклады Консорциума экономических исследований и образования*. № 01 / 11.
- Дзлиев М.И.** (1999): Рынок и насилие. М.: Мир безопасности.
- Какоткин А.** (1996): Триумфальное шествие криминала // *Аргументы и факты*. № 30.
- Кактурская М., Крашков А.** (2002): Почему арбузы дорогие, или “Бизнес па русски” // *Аргументы и факты*. № 36.
- Кива А.В.** (1999): Криминальная революция: вымысел или реальность // *Общественные науки и современность*. № 3.
- Радаев В.** (1998): О роли насилия в российских деловых отношениях // *Вопр. экономики*. № 10.
- Регионы России (2001): Регионы России. М.: Госкомстат России.
- Социология (2003): Социология: Энциклопедия. Минск: Книжный дом.
- Цели и ресурсы (1985): Цели и ресурсы в перспективном планировании. М.: Наука.
- Томилини И.** (2000): Китайский ручей в таможенный карман // *Аргументы и факты Сибири (региональное приложение к еженедельнику “Аргументы и факты”)*. № 37.
- Beck N., Katz J.N.** (1995): What to Do (and Not to Do) with Time-series Cross-section Data // *American Polit. Science Rev.* Vol. 89. № 3.
- Berkowitz D., DeJong D. N., Husted S.** (1998): Quantifying Russia’s Price Liberalization // *J. of Comparative Econ.* Vol. 26. № 4.
- Brown D., Earle J.** (2000): Competition, Geography, and Firm Performance: Lessons From Russia // *CEPR and WDI Annual International Conference on Transition Economics, Moscow, 2–5 July*.
- Effron S.** (1994): Russia’s Breadbasket Hit by Mafia // *Moscow Times*. 23 June.
- Engel C., Rogers J.H.** (1996): How Wide Is the Border? // *American Econ. Rev.* Vol. 86. № 5.
- Gluschenko K.** (2003): Market Integration in Russia During the Transformation Years // *Econ. of Transition*. Vol. 11. № 3.
- Gluschenko K.** (2004): Analyzing Changes in Market Integration through a Cross-Sectional Test for the Law of One Price // *International J. of Finance and Econ.* Vol. 9. № 2.
- Leitzel J.** (2002): Corruption and Organized Crime in the Russian Transition. In: “*Institutional Change in Transition Economies*” / Cuddy M., Gekker R.(eds.). Aldershot, England; Burlington, VT: Ashgate.
- Lotspeich R.** (1997). An Economic Analysis of Extortion in Russia // *МОСТ-MOST*. № 4.

Поступила в редакцию
28.02.2005 г.

Impact of Organized Crime on Inter-Regional Variability of Prices**K. P. Gluschenko**

The impact of organized crime on inter-regional price dispersion is estimated for every year from 1992 to 2000, and over the panel of 1993–2000, using a sample of 70 Russian regions, and that of 50 regions from the European part of Russia. The relationship between prices and crime is, for the most part, statistically significant and positive. Organized crime considerably contributes to the average cross-region price dispersion. However, the effect of organized crime is weakening over time.