

Контрсанкции и динамика сельского хозяйства в регионах России: произошло ли ускорение?

Котырло Елена Станиславовна, д.э.н., доцент департамента прикладной экономики факультета экономических наук НИУ ВШЭ.

Зайцев Александр Андреевич, к.э.н., научный сотрудник Центра комплексных европейских и международных исследований (ЦКЕМИ) факультета мировой экономики НИУ ВШЭ

Работа посвящена оценке влияния контрсанкций – российского агропродовольственного эмбарго 2014-го года и программ поддержки сельского хозяйства – на динамику сельского хозяйства в регионах России в 2014-2017 гг. С 2014 года для отечественного сельского хозяйства и пищевой промышленности сложились благоприятные условия развития. Помимо введения эмбарго и двукратной девальвации, укрепивших положение российских сельхозтоваропроизводителей, объемы финансирования по программам развития АПК в России и поддержки экспорта за 2013-2018 гг. были увеличены в 1,5 раза¹. Одновременно появились и новые сдерживающие факторы развития сельского хозяйства. Во-первых, это падающий потребительский спрос и общая стагнация экономики на фоне двукратного падения нефтяных цен, финансовых санкций и исчерпания прежней, основанной на экспорте сырьевых ресурсов, модели развития. Во-вторых, это сильная зависимость сельского хозяйства и пищевой промышленности от импортных машин и оборудования и ряда продуктов промежуточного потребления, доходящая до 80-90% (Цухло, 2016), (Митин, 2018)².

В результате отечественные производители оказались в неоднозначной ситуации: с одной стороны, появилась возможность роста производства за счет снижения конкуренции и увеличения господдержки. С другой стороны, растущие

¹ Со 170 до 250 млрд. руб. План на 2019 г. - 308 млрд. рублей. По данным МинСельхоза, цит. По (Ведомости, 2019)).

² Экономика и Жизнь <https://www.eg-online.ru/article/380214/>

издержки производства, связанные с импортом продуктов промежуточного потребления, и, как следствие, рост розничных цен осложнили данный процесс на фоне падающего спроса. Стоит отметить, что при достаточно широком интересе к теме влияния внешних санкций на российскую экономику (Синяков, Ройтман, & Селезнев, 2015), (Гурвич & Прилепский, 2016), (Прилепский, 2019), (Kholodilin & Netsunajev, 2016), количественной оценке влияния именно контрсанкций посвящено небольшое число работ (Волчкова & Турдыева, 2016), (Бородин, 2016, 2018), (Светлов, Янбых, & Логинова, 2019), (Скрыпник, Зайцев, & Рязанов, 2019). В последних оценки выполнены либо только для 2014/2015 гг., либо для отдельных рынков (рынки мяса) или регионов России, либо же проводятся сценарные расчеты (см. (Волчкова & Турдыева, 2016)). Результаты свидетельствуют о позитивном вкладе эмбарго и господдержки в динамику сельского хозяйства, однако на их основе нельзя получить представление о вкладе различных влияющих факторов. В свою очередь отраслевые эксперты (Гатаулина, Шагайда, Узун, & Шишкина, 2019; Серова, 2019; Сизов, 2017) не берутся утверждать, что роли господдержки в динамике сельского хозяйства доминировала в наблюдавшемся тренде. Важную роль сыграл общий рост внутренних цен, который был достигнут, в том числе, за счет девальвации рубля.

Таким образом, апостериорный анализ всего санкционного периода (2014-2017(8)) на настоящий момент отсутствует. Более того, данный вопрос не рассматривался на основе региональных данных. Настоящая работа отчасти пытается заполнить данный пробел. Для этого на основе региональных данных и подхода difference-in-difference оцениваются эффекты контрсанкций для динамики реальной валовой добавленной стоимости сельского хозяйства в 2014-2017 гг.

Методика и данные

Источником данных служит ежегодная региональная статистика динамики валовой добавленной стоимости (ВДС) по основным разделам ОКВЭД³. Оценка динамики отраслей строится на анализе изменений индексов физического объема добавленной стоимости. Санкционный период включает в себя 2014-2017 гг. Он сравнивается с периодом 2008-2013 с исключением 2009-2011 гг. Исключение объясняется кризисом 2009 г. и засухой 2010 г., делающими предположение параллельного тренда необоснованным.

³ Сборники Росстата «Регионы России. Основные социально-экономические показатели», база данных Росстата ЕМИСС.

В исследовании применяется метод difference-in-difference, предложенный Ashenfelter and Card (1985) и Card (1990). Во-первых, мы используем метод формирования синтетической контрольной группы Abadie и Gardeazabal (2003), которые предлагают конструировать веса так, чтобы в дореформенный период наблюдения контрольной группы в наибольшей степени походили на наблюдения группы воздействия. В качестве группы воздействия мы рассматриваем сельское хозяйство (раздел А+В ОКВЭД-1). Электроэнергетика, строительство и гостиничные услуги выступают как отрасли контрольной группы. Благодаря включению контрольной группы, мы исключаем влияние макрошоков, общих для всех отраслей, и получаем состоятельные оценки эффекта.

Поскольку в анализе используется несколько периодов, появляется проблема автокорреляции ошибок, и обычный в данном случае метод оценки панельных данных с фиксированными эффектами или в первых разницах не дает состоятельных оценок. Вопрос коррекции метода оценки обсуждается в ряде работ, в частности, Bertrand et al. (2004), Hansen (2007) и др. Мы используем метод фиксированных эффектов с коррекцией на автокорреляцию (Stata: xtregar). Модель представлена уравнением:

$$y_{it} = \beta_0 + \beta_1 Agro_{it} + \beta_2 Year_t + \beta_3 Agro_{it} Reform_t + Region_i \cdot Industry_i + \varepsilon_{it},$$

здесь y_{it} результативная переменная, $Agro$ – дамми для различия групп воздействия (значение 1) и контроля (значение 0), β_3 – различие между группами после санкций, интересующий нас показатель. Во-вторых, помимо весов, соответствующих синтетической контрольной группе (строительство – 22%, гостиничный бизнес – 31%, электроэнергия – 47%), мы дополняем взвешивание вкладом отраслей на региональном уровне в российскую экономику в целом, используя показатели валовой добавленной стоимости (млрд.руб.) в 2017 г..

Результаты

Найден положительный эффект контрсанкций и государственной поддержки на темпы роста сельского хозяйства. Он различается в зависимости от применяемого подхода. До взвешивания на долю отрасли в структуре национального производства составляет 6-7%, во втором подходе, с дополнительным взвешиванием – 3-4%, значимость 99%. Результаты можно интерпретировать как демонстрацию большей положительной динамики в сельском хозяйстве в тех регионах, которые не являются

ключевыми в отрасли. В то же время, коррекция на региональную структуру сельского хозяйства в российской экономике снижает размер эффекта санкционного периода на развитие сельского хозяйства. То есть, регионы – крупные производители сельскохозяйственной продукции, испытали меньший положительный эффект контрсанкций. Основной прирост пришелся в 2014 г. без каких-либо значимых изменений в пользу сельского хозяйства по сравнению с контрольной группой, в 2015-2016 гг. и небольшим в 2017 г. Причины такой динамики видятся в том, что позитивный эффект возросшей доли продовольственного рынка столкнулся с отрицательным эффектом исчерпания инвестиционного потенциала, накопленного к началу контрсанкций, и ограничения производства сократившимся потребительским рынком из-за снижения доходов населения.