

ПРОФЕССИОНАЛЬНЫЕ ОБЗОРЫ

Д. Х. Ибрагимова

Когортный анализ потребительских ожиданий населения России (1996–2010): теоретико-методологические основы исследования¹



ИБРАГИМОВА

Диляра Ханифовна —

кандидат исторических наук, доцент, заместитель заведующего кафедрой экономической социологии, старший научный сотрудник ЛЭСИ НИУ ВШЭ.

Адрес: Россия, 101000, Москва, ул. Мясницкая, д. 20.

Email: dibragimova@hse.ru

Опросы потребителей, на основе которых измеряется индекс потребительских настроений (ИПН) (Consumer Sentiment Index), проводятся более чем в 50 странах, в том числе и в России. Различных исследований, опирающихся на данные потребительских опросов относительно ожиданий, немало, однако большая их часть посвящена проверке и объяснению предсказательной силы прогнозов, основанных на данных опросов населения. В немногочисленных работах, посвящённых исследованию детерминант потребительских ожиданий, анализируется взаимосвязь компонент ИПН и различных социально-демографических характеристик, в том числе и возраста. Однако при оценке влияния возраста следует различать собственно эффект возраста, проявляющийся в определённых экономических и статусных характеристиках, и эффект когорты, то есть эффект жизненного опыта поколения, прошедшего социализацию и жившего в определённых исторических условиях. В данной статье представлен обзор теоретических подходов и результатов эмпирических исследований, которые могут быть использованы для когортного анализа потребительских ожиданий населения. В работе рассматриваются психологическая экономика Дж. Катоны, теория поколений К. Мангейма, концептуальная рамка использования когортного подхода в социальных науках, предложенная Н. Райдером. Особое внимание уделено обсуждению возможных стратегий решения так называемой проблемы идентификации, то есть дифференциации влияния эффектов (1) возраста, (2) когорты и (3) исторического периода. На базе эмпирических исследований потребительского и сберегательного поведения населения анализируются преимущества и недостатки как формально-количественных процедур решения данной проблемы, связанных с различными допущениями и ограничениями, так и разнообразных содержательных подходов, нацеленных на поиск факторов, обуславливающих изменения отмеченных трёх эффектов. В статье ставится и вопрос о том, как соотносятся когортный и поколенческий анализ, а также принципы исторической социологии в качестве методологической парадигмы подобных исследований.

Ключевые слова: потребительские ожидания; когортный анализ; анализ поколений; индекс потребительских настроений; поведение потребителей; сберегательное поведение.

¹ В данной научной работе использованы результаты, полученные в ходе выполнения проекта № 12-01-0228, осуществленного в рамках Программы «Научный фонд НИУ ВШЭ» (2013–2014).

Введение

Воздействие объективных экономических условий на поведение людей неизбежно опосредуется их субъективными воззрениями на экономику. Иными словами, покупки и (или) сбережения, к примеру, зависят не только от измеряемой экономическими переменными возможности отложить часть дохода на будущее, но и от желания это сделать. Теория психологической экономики была разработана Дж. Катоной (G. Katona) на основе эмпирических исследований и нашла многочисленных последователей во всём мире. Индекс потребительских настроений (*Consumer Sentiment Index*), рассчитываемый с конца 1940-х гг. в США на основе потребительских опросов, входит сейчас в число индикаторов, составляющих опережающий индекс (*Leading Economic Index*), используемый для краткосрочного прогнозирования экономического развития страны. По данным CIRET (Centre for International Research on Economic Tendency Surveys — Центр международных исследований экономических тенденций), к началу 2000-х гг. обследования потребительских настроений в рамках концепции психологической экономики проводятся более чем в 50 странах. В России первые такие обследования относятся к 1993 г., на регулярной основе они проводятся с мая 1996 г. [Ибрагимова, Николаенко 2005]. Необходимо подчеркнуть, что потребительские ожидания — это не ожидания относительно *всего*, а показатель, отражающий изменения в оценках и ожиданиях людей относительно собственного материального положения, перспектив экономического развития страны и ситуации на потребительском рынке².

Очевидно, что потребительские ожидания людей зависят от уровня среднедушевого дохода, от возраста, образования, места проживания, пола и от других социально-демографических характеристик. Например, анализ данных одномоментных опросов потребителей показывает, что больше, чем в среднем, оптимизм в оценках и ожиданиях относительно экономической ситуации в стране проявляют молодые люди, тогда как у лиц старшего возраста потребительские настроения ниже среднего уровня [Ибрагимова, Николаенко 2005: 46]. На первый взгляд картина вполне тривиальна: лица, имеющие такой социальный ресурс, каким является молодость, более оптимистичны и активны, в том числе и на потребительском рынке.

Однако сама по себе переменная «возраст» достаточно коварна. Исследователи уже давно обратили внимание на то, что необходимо различать эффекты возраста, времени и когорты [Shorrocks 1975]. Являясь в арифметическом выражении разностью между текущим годом и годом рождения, переменная «возраст» представляет собой смещение трёх факторов — собственно возраста, то есть биологических и отчасти психологических характеристик; когорты (в данном случае когорты по году рождения), то есть условий социализации и становления жизненного опыта в определённых условиях; и времени, отражающегося в социально-политических, экономических, информационных явлениях макросреды.

Иными словами, будут ли различаться, и если да, то каким образом, потребительские ожидания 18-летнего гражданина России в 1998 г. и россиянина такого же возраста в 2007 г.? Или каковы, к примеру, потребительские ожидания поколения россиян, вступившего в трудоспособный возраст в 2000-х гг., и когорты, чьё личностное становление пришлось на переходный период конца 1980-х —

² Индекс потребительских настроений строится на основе систематических массовых социологических опросов населения. Для построения индекса используются пять базовых вопросов, отражающих (1) оценки респондентами изменений в личном материальном положении за прошедший год; (2) ожидания относительно изменения личного материального положения в предстоящий год; (3) ожидания относительно экономических перспектив развития страны в предстоящий год; (4) ожидания относительно экономических перспектив развития страны в предстоящие пять лет; (5) оценки респондентами экономических условий для того, чтобы покупать товары длительного пользования. На основании ответов респондентов на каждый из этих пяти вопросов балансовым методом рассчитываются частные индексы, средняя арифметическая которых представляет собой совокупный индекс. Отметим, что формулировки вопросов и методика расчета ИПН в разных странах могут отличаться, соответствуя однако при этом самой концепции психологической экономики.

начала 1990-х гг.? Как менялись ожидания в зависимости от возраста? Каковы сходства и различия профиля потребительских ожиданий по возрасту в различных когортах?

Изучение данных вопросов представляет, на наш взгляд, интерес с нескольких позиций. Во-первых, если существует какая-либо закономерность в профиле потребительских ожиданий по возрасту, то в условиях изменения возрастной структуры населения она может влиять на общую динамику ожиданий. Например, если в молодости общеэкономического оптимизма больше, то с ростом старения населения совокупный оптимизм будет вследствие указанных причин снижаться. Однако если эффект когорты значим, то можно предположить, что, к примеру, люди, чьё взросление пришлось на благоприятный экономический период 2000-х гг., могут быть и в зрелом возрасте более оптимистичны, чем поколения их отцов и дедов. Или же, напротив, ощущая в последнее время усиление застойных явлений в экономике, они и в среднем возрасте будут проявлять меньший оптимизм, чем люди того же возраста в другое время. А поскольку, как было установлено, «потребительские настроения предсказывают будущие изменения в тратах домохозяйств» [Carroll, Fuhret, Wilcox 1994: 1398], эти психологические, по сути, факторы могут оказать значимое влияние на макроэкономические процессы, если большая группа людей одновременно изменит своё поведение, решив потратить или, наоборот, сберечь денежные средства.

Во-вторых, начало измерений ожиданий потребителей в послевоенной Америке было в основном стимулировано желанием бизнеса знать, собирается ли население тратить сбережения, однако со временем выяснилось, что ИПН даёт ответ и на более общий вопрос об уровне и динамике оптимизма в отношении экономического и социального развития страны в целом [Ибрагимова, Николаенко 2005: 11–12]. А эта динамика может являться, в свою очередь, индикатором стабильности и (или) нестабильности социально-экономических отношений, а уровень оптимизма различных социальных групп свидетельствовать об их адаптивном потенциале³.

В-третьих, исследование динамики потребительских настроений в разрезе когорт в изучаемый период может обогатить имеющиеся знания о процессе становления рыночного поведения населения. Концепция ИПН изначально предполагает достаточно высокий уровень развития рыночных отношений и институтов, но уже на первом этапе измерений в России стало ясно, что данный индекс имеет и дополнительные области применения, отражая общую динамику отношения населения к переменам, происходящим в стране [Ибрагимова, Николаенко 2005: 32–33]. Возникает вопрос: можно ли, и если да, то в какой мере, говорить об адаптации представителей различных когорт к новым экономическим реалиям или же об их, условно говоря, «рыночной социализации»⁴? К примеру, как было выявлено Ю. Левадой, уровень поддержки населением экономических реформ в 1994–1999 гг. изменялся незначительно, тогда как по возрастным группам, наблюдаемыми со сдвигом во времени, наоборот, весьма заметно [Левада 1999]. Это свидетельствует как раз о наличии эффекта когорты, то есть о различиях в результатах социализации, возникших в переходный период.

В данном обзоре будут (1) рассмотрены теоретические подходы, которые могут быть использованы, с одной стороны, для применения когортного анализа в социальных науках в целом, а с другой — для изучения потребительских ожиданий населения; и (2) на примере эмпирических работ продемонстри-

³ См., например: [Кесельман, Мацкевич 1998].

⁴ В широком смысле слова адаптация означает процесс приспособления человека к изменяющимся внешним условиям. Однако это приспособление к новой среде и обстоятельствам не отрицает, а, напротив, подразумевает и сохранение, хотя бы частичное, своей организованности и идентичности в этой среде. Иными словами, самая устойчивая адаптация, как указывает Ю. А. Левада, «не означает полной ассимиляции человека с системой социальных требований» [Левада 2000: 469]. В противном случае можно говорить о социализации. В кризисных условиях адаптация может приобретать «функциональную эквивалентность с процессом социализации и ресоциализации» [Головин 2004: 22].

рованы возможные способы решения возникающих методологических проблем в подобного рода исследованиях.

Психологическая экономика Дж. Катоны

Различных исследований, опирающихся на данные потребительских опросов относительно ожиданий, немало, начиная с первопроходческих работ Дж. Катоны. Именно он в конце 1940-х гг. предложил методологию учёта в моделях потребительского и сберегательного поведения населения психологических переменных, которые до этого считались неизмеряемыми. В своей теории психологической экономики Катона исходил из того, что экономика без психологии не будет успешной в объяснении важных экономических явлений, в то время как психология без экономики лишена шансов на объяснение некоторых наиболее общих, широко распространённых видов человеческого поведения [Katona 1951: 9]. Связь между психологией людей и макроэкономикой появляется, по мнению Катоны, благодаря тому, что в экономике, особенно в современной, поведение людей обусловлено не только объективными, но и субъективными факторами. Соответственно потребительские расходы (имеются в виду прежде всего расходы на товары длительного пользования) зависят не только от возможности, но и от желания покупать. Под возможностью покупать (*ability to buy*) подразумеваются уровень текущего дохода потребителей, имеющиеся финансовые активы, а также доступ к кредитам. Желание же покупать (*willingness to buy*) обусловлено личными оценками и ожиданиями людей относительно своего материального положения и общеэкономических перспектив развития страны в целом [Katona 1968: 22]. Катона предположил, что люди будут тратить сбережения и даже увеличивать расходы, если снижение дохода рассматривается как временное, но долгосрочные ожидания в целом оптимистичны, однако если ожидается дальнейшее падение дохода, то люди предпочтут сократить потребление и увеличить сбережения [Katona 1975: 242].

Катона предвидел всёвозрастающую роль потребителей в экономике, что связывалось им с двумя основными факторами. Во-первых, рост личных доходов и активов домохозяйства, а также расширение спектра финансовых инструментов даёт людям бóльшую финансовую самостоятельность. Это означает, что потребители становятся более активными в принятии решений, способными оценить и выбрать подходящий момент для покупок с целью удовлетворения своих текущих и будущих потребностей. Во-вторых, происходит рост в потребительских расходах удельного веса товаров длительного пользования (недвижимость, автомобили, крупные предметы домашнего обихода и т. д.). Покупка таких товаров не является неотложным, автоматически выполняемым действием, решения по их поводу принимаются относительно реже, покупка может осуществляться за счёт сбережений или в кредит (то есть за счёт прошлых или будущих доходов), а значит, не зависит прямолинейно от величины текущего дохода. В результате принятие решения о таких покупках становится всё более зависимым от ожиданий людей относительно личных доходов, цен на потребительском рынке, уровня безработицы, ставок процента и т. д. [Curtin 2007a: 12].

За прошедшие десятилетия появилось много эмпирических исследований, посвящённых анализу характера ожиданий (рациональные, ограниченно рациональные, адаптивные) (см.: [Noble, Windsor Fields 1982; Baghestani 1992; Grant, Thomas 1999; Howrey 2001; Carroll 2003] и др.), а также проверке и объяснению предсказательной силы прогнозов, основанных на данных потребительских ожиданий. При этом влияние ожиданий исследуется сквозь призму их взаимодействия с различными макроэкономическими индикаторами, как теми, влияние потребителей на которые проявляется опосредованно (динамика доходов, производства, занятости, цен) (см.: [Carroll, Dunn 1997; Thomas 1999; Das, Soest 2000; Curtin 2003; 2010] и др.), так и теми, что отражают результаты деятельности самих потребителей (например, потребительские расходы и сбережения (см.: [Adams 1964; Juster, Wachtel 1972; Mishkin et al. 1978; Carroll, Fuhrer, Wilcox 1994; Kwan, Cotsonitis 2004; Ludvigson 2004; Souleles 2004; Easaw, Garratt, Heravi 2005; Heim 2010] и др.)).

От чего зависят потребительские ожидания?

Отдельную группу работ представляют исследования, нацеленные на выявление детерминант потребительских ожиданий, на понимание того, как они формируются, и анализ их структуры.

Директор Мичиганского центра обследования потребителей (Survey Research Center, University of Michigan, Ann Arbor) Р. Куртин, изучая формирование ожиданий безработицы как «зеркало» ожиданий относительно личных трудовых доходов, сравнивает влияние личной и публичной информации (*private and public information*). В качестве личной информации выступают ответы респондентов на вопрос о том, слышали ли они о каких-либо экономических новостях в последнее время, и если да, то каких именно, а также оценки людьми перспектив развития экономики в ближайший год. В качестве публичной информации используются данные официальной статистики о темпах роста ВВП и безработицы [Curtin 2003: 548–549]. Автор приходит к выводу, что именно субъективные факторы (то есть отражающие личностное, частное восприятие людьми экономических процессов) доминируют в формировании ожиданий безработицы над объективной макроэкономической информацией [Curtin 2003: 552]. При этом, естественно, люди не оперируют используемыми профессиональными экономистами моделями; представления населения об экономике более фрагментарны, неоднородны, основаны на житейском опыте, а не на научных знаниях и т. д.⁵ Однако именно этот личный опыт потребителей, приобретаемый ими в процессе изменения локальных условий дохода и занятости, цен и наличия товаров на местных рынках, а также многие другие ассоциативные связи с текущими событиями в обстановке быстро меняющейся конъюнктуры и являются значимым фактором формирования ожиданий. Применительно к нашей проблематике отметим, что этот жизненный опыт и есть отражение эффекта когорты, то есть общих условий социализации группы людей, родившихся в определённый период времени.

В одном из недавних исследований авторы ставят задачу выяснить, от чего зависят потребительские настроения (совокупный ИПН и его частные составляющие), и используют многолетние первичные данные социологических опросов [Lahiri, Zhao 2013]. Регрессионный анализ показал, что наиболее значимыми детерминантами являются показатели, отражающие восприятие людьми экономических новостей и деятельности правительства в области экономики, а также ожидания самих респондентов относительно изменений процентных ставок, уровня цен, безработицы, личного дохода. Тогда как макроэкономические показатели (темпы роста инфляции, располагаемых доходов, промышленного производства и др.), а также оценки профессиональных экономистов (консенсус-прогноз) относительно роста ВВП, инфляции и безработицы, также включённые в качестве предикторов, имеют гораздо меньшую объясняющую силу [Lahiri, Zhao 2013: 22]. Роль социально-демографических характеристик в объяснении колебаний зависимой переменной невелика, большее значение по сравнению с остальными имеют пол и уровень образования респондента.

В исследовании Р. Куртина проводится анализ различий в уровне потребительского оптимизма населения России и США в зависимости от дохода и возраста респондентов [Curtin 2000]. Анализируя объединённые массивы первичных данных, автор приходит к выводу, что возрастные различия в оценках личного материального положения и ожиданиях его изменения в будущем практически идентичны у населения двух стран, чего не наблюдается по вопросу об оценке перспектив экономического развития страны и условий для того, чтобы делать крупные покупки. Казалось бы, ожидания относительно будущего национальной экономики не должны особо отличаться у разных возрастных групп, однако такое представление оказывается неоправданным. Молодые люди, имея современное по качеству образование, могут быть более квалифицированными в восприятии и анализе экономической информации,

⁵ Вопрос о том, что люди знают об экономике, представляет отдельный интерес и требует специального изучения. В качестве такового можно привести исследование: [Curtin 2007b].

тогда как лица старшего возраста, напротив, обладают бóльшим опытом, который может оказывать влияние на их интерпретацию текущих экономических событий. Корреляционный анализ показывает наличие отрицательной взаимосвязи между возрастом и оценкой экономических перспектив развития страны, однако на массиве российских данных эта связь проявляется гораздо сильнее, чем на американских. Это означает, что молодые люди в России гораздо более оптимистичны в оценках относительно будущего экономики страны, чем люди среднего и старшего возрастов. Действительно, эмпирические данные свидетельствуют о том, что разрыв в значениях соответствующего индекса между крайними возрастными группами (18–24 года, с одной стороны, и 65+, с другой) достигает в России 40 пунктов, тогда как в США эта вариация весьма незначительна — составляет не более 10 пунктов [Curtin 2000: 8]. Особенно отчётливо возрастные различия в России и США проявляются в вопросе о крупных покупках⁶. В американских данных разрыв в уровне оптимизма относительно ситуации на потребительском рынке между старшей и младшей возрастными группами минимален (в диапазоне 10 пунктов), тогда как в России он достигает 55 пунктов, то есть молодёжь оптимистичнее лиц старшего возраста в этом вопросе более чем в 1,5 раза [Curtin 2000: 9].

Осмысливая полученные результаты, автор предполагает, что, вероятно, в России зависимость между возрастом и компонентами ИПН отражает влияние других факторов, например, способность к адаптации и умение приспособиться к новым экономическим условиям [Curtin 2000: 14]. Добавим, что частично такая ситуация может быть связана с распределением доходов и всего объёма накопленных ресурсов на протяжении жизненного цикла, и российская специфика в 1990-х — начале 2000-х гг. заключалась в том, что молодые люди являлись одновременно и более материально обеспеченными, тогда как с возрастом этот уровень обеспеченности довольно резко снижался. Во многих же развитых странах личный доход, стартуя, как правило, с относительно невысокого уровня на ранних возрастных стадиях, довольно скоро затем возрастает, достигает пика к концу среднего возраста и падает (но не так стремительно, как в России) в дальнейшем [Ибрагимова, Николаенко 2005: 47].

Однако и «классическая» кривая в форме горба, отражающая изменения в доходе и (или) объёме накопленных ресурсов с возрастом, может не соответствовать действительности, если не учитывать эффект когорты, на что обратил внимание А. Шоррокс. Снижение объёма имеющихся активов с определённого возраста, наблюдаемое на данных одномоментных опросов (*cross-section data*), может быть результатом того, что рассматриваются разные поколения в разные периоды их жизни, а следовательно, вывод о соответствии кривой модели жизненного цикла будет ложным [Shorrocks 1975: 158]. Графики для людей из одной и той же возрастной когорты, построенные автором на основе комбинирования данных британской статистики налогов на наследство, демонстрировали отсутствие значительного снижения объёма накопленных ресурсов в пенсионный период. Но с учётом уровня смертности и коэффициентов дожития, различающихся от поколения к поколению, Шоррокс показал, что сберегательное поведение британцев вполне вписывается в модель жизненного цикла [Shorrocks 1975: 161]. Нам же важно отметить, что с этого времени практически стало общепринятым учитывать когортный и временной эффекты в эмпирических исследованиях потребительского и сберегательного поведения населения.

Концептуальные основы когортного анализа

Конечно же на анализ различий в рамках когорт исследователи обращали внимание и ранее. Сам термин, как и метод когортного анализа, пришёл в социологию из демографии. В демографическом понимании когорты — это группа людей, у которых в один и тот же период времени произошло определённое демографическое событие (рождение, вступление в брак и т. д.). Теоретической основой

⁶ Имеется в виду вопрос респондентам об оценке экономических условий для покупки товаров длительного пользования, на основе которого строится частный индекс целесообразности приобретения товаров длительного пользования (его часто называют просто индексом крупных покупок — *buying conditions index*).

социологического же подхода к пониманию когорт является концепция поколений Карла Мангейма. В ней можно выделить два основных постулата. Первый из них заключается в исторической локализации, что и формирует поколенческое единство: «Индивидам, принадлежащим к одному и тому же поколению, родившимся в один год, свойственно общее местоположение (*location*) в исторической протяжённости социального процесса» [Mannheim 1952: 290], при этом каждому такому местоположению свойственны «определённые способы поведения, чувствования и мышления» [Mannheim 1952: 291]. Однако историческая локализация для поколения имеет лишь потенциальную значимость, поскольку о поколении как реальности следует говорить лишь в том случае (и в этом заключается второй тезис), если между современниками существуют узы (*bond*), проявляющиеся в сфере ментальности через социальные и интеллектуальные симптомы. С социологической точки зрения факты, относящиеся к сфере ментальности, важны не только ввиду их реального содержания, но и потому, как указывает Мангейм, что им принадлежит «социализирующий эффект» [Mannheim 1952: 303–304]. Таким образом, поколения рассматриваются как общности, отражающие разные этапы человеческой жизни с точки зрения социализации и наличия определённых социокультурных характеристик. Данный подход относится и к когортам в их социологическом понимании.

Концептуальная рамка использования когортного анализа именно в социальных науках была очерчена знаменитым демографом Норманом Райдером, который прямо призывал социологов обратить пристальное внимание на изучение эффекта когорты для лучшего понимания глубинных факторов общественных изменений [Ryder 1965: 861]. В ставшей классической работе «The Cohort as a Concept in the Study of Social Change» («Когорта как концепт для изучения социальных изменений») (1965) он определял когорту как «агрегат индивидов... переживших одно и то же событие в одном и том же временном интервале», при этом каждая когорта представляет собой «не просто сумму индивидуальных историй», а «обладает отличительной структурой и характером, отражающим условия её уникальной организации и истории» [Ryder 1965: 845]. Райдер указывал на возможности интеркогортного (сравнение различных когорт между собой) и интракогортного (изучение одной когорты на протяжении её жизненного цикла) анализа, а также, основываясь на положениях возрастной психологии, подробно описывал феномен социализации, особо обращая внимание на роль семьи и отдельные этапы детства и юношества; говорил о важности жизненного опыта в поведении людей: «Когортный подход к социальному анализу получает сильную поддержку от непрерывности индивидуальной жизни, от специфического временного и потому исторически локализованного основания. Прошлое личности влияет на её настоящее, а её настоящее влияет на её будущее» [Ryder 1965: 856].

В этом взаимозависимом влиянии трёх факторов (возраст, когорта и исторический период) и заключается специфика когортного анализа. Все три признака взаимосвязаны между собой, поскольку возраст представителей когорт и исторический период измеряются по одной и той же линейной шкале времени с годичным интервалом. Априори невозможно исключение ни одного из эффектов: каждый из них описывается уравнением, включающим два других эффекта. Дифференциация влияний эффектов, известная как «проблема идентификации» (*identification problem*), и составляет основную сложность при проведении когортного анализа [Науэн 2006: 139]. Не случайно в зарубежной литературе даже есть специальный термин — APC-анализ (Age—Period—Cohort Analysis), подразумевающий когортный анализ, направленный на разделение указанных эффектов. К настоящему времени исследователями накоплен определённый опыт в решении указанной проблемы, хотя идеального и универсального варианта нет, да и вряд ли он возможен.

«Проблема идентификации»: возможные стратегии решения

Одна из возможных стратегий решения проблемы идентификации заключается в её устранении ещё в самом начале исследования путём введения различных ограничений и допущений (как теоретических,

так и математических). Наиболее «радикальное» на первый взгляд ограничение состоит в том, чтобы пренебречь одним из измерений, например, календарным временем [Baltes, Reinert 1969: 169] или возрастом [Heckman, Robb 1985]. Хотя возможны ситуации, в которых данный подход оправдан, он, по мнению ряда авторов, во многих случаях может приводить к ложным выводам, особенно если эффекты возраста, когорты и периода объясняются разными причинами (*distinct causal interpretations*) [Mason et al. 1973: 243]⁷. Безусловно, исключение одной из переменных требует убедительной аргументации и прежде всего аргументации теоретического характера, поскольку в этом исключении лежит ещё, как отмечает Н. А. Головин, «методологический водораздел между психологическим и социологическим подходами к исследованию социализации» [Головин 2004: 87–88]. Исключение эффекта времени, что часто делается в возрастной психологии при изучении проблем социализации, приближает нас к классическому психологическому подходу, а пренебрежение переменной возраста — к социологическому. При этом возрастной параметр не теряется, а сохраняется в эффекте когорты, который «есть не что иное, как дифференцированное проявление эффекта исторического периода у тех или иных возрастных групп, т. е., по сути дела, это различия в результатах социализации на массовом уровне» [Головин 2004: 86].

Другое возможное допущение может быть в установлении ограничений на коэффициенты. А. Дитон и К. Паксон, исследуя влияние эффекта когорты на потребительское и сберегательное поведение в течение жизненного цикла, предложили такую спецификацию, в которой временные эффекты в сумме приравниваются нулю и считаются ортогональными временному тренду [Deaton, Paxson 1994]. Это означает, что любые эффекты времени приписываются совместному эффекту когорты и возраста, а временные эффекты рассчитываются как отклонения от среднего значения [Deaton, Paxson 1994: 347]⁸. Основанием для такого допущения является то, что временные эффекты в сберегательном поведении обусловлены главным образом макроэкономическими шоками, тогда как на длительном периоде они усредняются. Авторы на основе анализа опросных данных населения Тайваня за 15-летний период (1976–1990) приходят к выводу, что сбережения реагируют на уровень дохода внутри когорты, который у молодых когорт выше, однако у представителей более пожилых когорт не наблюдается превышения расходов над доходами или снижения объёмов накоплений, оценка эффекта возраста показывает устойчивый рост сбережений на протяжении жизненного цикла [Deaton, Paxson 1994: 356].

Ещё один способ решения проблемы идентификации, получивший немалое распространение, был предложен К. Мэйсоном и его соавторами [Mason et al. 1973]. Идея заключается в оценке влияния эффектов с помощью регрессионного анализа. Для этого возраст, период и когорты преобразуются в множество дамми-переменных (каждая из них представляет определённый временной интервал), которые служат предикторами в модели. При этом для запуска программы с наборами фиктивных переменных одна переменная из какого-либо множества должна быть пропущена. Это исключение, необходимое для построения регрессионной модели, базируется на допущении одинакового действия эффектов на зависимую переменную, по крайней мере, в двух (или более) когортах и (или) возрастных группах, и (или) временных периодах [Mason et al. 1973: 247]. Однако в этом допущении и кроется уязвимость метода, ставшая основой для критики. Н. Гленн указывает, что субъективный выбор двух идентичных эффектов может быть ошибочным, а следовательно, существенно изменить результаты анализа [Glenn 2005]. Такой технический способ решения проблемы, по его мнению, не может быть признан удовлетворительным, поскольку главное допущение об аддитивном характере эффектов⁹ представля-

⁷ Авторы иллюстрируют данный тезис на примере динамики заработной платы мужчин в США.

⁸ Этот же подход был использован в работе О. Аттаназио, посвященной сберегательному поведению американских домохозяйств, принадлежащих к разным когортам [Attanasio 1998], применён к анализу сберегательного поведения домохозяйств Норвегии [Halvorsen 2003] и в других случаях.

⁹ Такое допущение означает, что эффект возраста является одинаковым во все исторические периоды и для всех когорт, эффект периода — идентичным для всех возрастов и когорт, а эффект когорты — одинаковым для всех возрастов и периодов.

ется некорректным [Glenn 2005: 15–16]. Тем не менее поиски сравнительно универсального способа дифференциации эффектов возраста, периода и когорты с использованием различных статистических процедур продолжаются¹⁰, хотя рядом авторов эти усилия представляются бесполезными («*a futile quest*»), если только не допустить вероятность нелинейного характера взаимосвязи между тремя переменными [Glenn 2005: 6, 20–21].

Альтернативой формально-количественным процедурам решения проблемы идентификации, которые неизбежно связаны с различными допущениями и ограничениями, является другой подход, нацеленный на понимание того, от чего зависят эффекты времени и когорты. Этот поиск «реальных факторов» влияния может осуществляться разными способами (визуальный анализ, привлечение экспертных мнений, проведение глубинных интервью, использование статистической информации и массмедиа и т. д.), но объединяет их стремление выйти за рамки мультиколлинеарности трёх указанных эффектов путём рассмотрения первоначальных факторов изменений, из которых эти эффекты складываются.

В рамках этого подхода весьма продуктивным представляется решение проблемы идентификации, реализованное известным немецким социологом-эмпириком Х.-П. Блоссфельдом в исследовании, посвящённом карьерным возможностям немецкой молодёжи [Blossfeld 1986]. Остановимся на нём подробнее. Для моделирования эффекта времени он использовал данные социально-экономической статистики. С помощью факторного анализа временных рядов (за 1950–1982 гг.) из 14 показателей экономического и социального развития ФРГ было выделено два латентных фактора (используется метод главных компонент), объясняющих 96,4% дисперсии. Первый фактор, названный автором «уровень модернизации», коррелирует с такими показателями: уровень производительности труда, дефлированный доход на душу населения и на одного работающего (экономически активного населения), объём личного потребления (дефлированный), доля расходов на услуги в потребительских расходах, доля занятых в общественном секторе экономики (*public sector*), доля 13-летних учащихся гимназий, доля работников сферы услуг в общем числе занятых, доля студентов в численности населения, доля чиновников (*civil servants*) и доля служащих (*white-collar employees*) в экономически активном населении. Второй фактор показывает высокие значения коэффициентов корреляции с уровнем безработицы (отрицательная взаимосвязь), долей инвестиций в здания и оборудование в ВВП, долей зарегистрированных вакансий в общем числе рабочих мест. Все три индикатора чётко измеряют цикличность развития рынка труда, поэтому фактор был обозначен автором соответствующим образом: «условия на рынке труда». Поскольку выделенные факторы являются ортогональными, возникает возможность включить их в одно уравнение, тем самым решив проблему разделения когортных и временных эффектов. Для оценки эффекта когорты исследователь анализирует изменение факторов «уровень модернизации» и «положение на рынке труда» в те годы, когда рассматриваемые респонденты выходят на рынок труда [Blossfeld 1986: 215].

Ценность решения Блоссфельда состоит в том, что оно даёт «...конкретный пример анализа латентного влияния исторического периода на социализацию когорт» [Головин 2004: 115]. Подход Блоссфельда

¹⁰ М. Сасаки и Т. Сузуки был предложен метод дифференциации эффектов с использованием критерия Байеса (*Bayesian criterion*), который базируется на идее о том, что изменения в следующих друг за другом «отрезках» (категориях) возраста, периода и когорт происходят постепенно; при этом отмечается, что допущение К. Мэйсона является частным случаем данного метода [Sasaki, Suzuki 1987]. Р. О'Брайеном и его соавторами была предложена смешанная модель для дифференциации эффектов: возраст и период измеряются дамми-переменными с фиксированным эффектом (*fixed-effect*), а когорты — дамми-переменными со случайным эффектом (*random-effect*) [O'Brien, Hudson, Stockard 2008]. Это позволяет, по мнению авторов модели, оценить, являются ли изменения, вызванные членством в когорте, статистически значимыми при контроле эффектов возраста и времени; такая оценка не имеет ограничений на форму функциональной зависимости между членством в когорте и зависимой переменной. Авторы тестируют предложенную ими смешанную модель дифференциации эффектов на данных статистики самоубийств. Схожие принципы использования случайных и (или) фиксированных эффектов в модели при решении проблемы идентификации используются и при анализе микроданных проекта General Social Survey (GSS) [Yang, Land 2008].

полезен ещё и тем, что помогает понять, какие статистические показатели могут быть использованы для отражения социально-экономических особенностей исторического периода. А поскольку все индустриальные общества имеют сходные параметры социально-экономического и демографического развития (хотя, конечно, необходимо учитывать специфику страны), то идея может быть перенесена и на российские реалии.

В работе А. Каптейна и его соавторов ставится вопрос о причинах дифференциации объёмов накопленных в домохозяйствах, принадлежащих к разным когортам [Kapteyn, Alessie, Lusardi 2005]. Авторы предлагают для тестирования два фактора, определяющих когортные эффекты: «рост производительности», выраженный в уровне ВВП на душу населения в те годы, когда глава домохозяйства выходит на рынок труда, и суммарные изменения в системе социального страхования (*Social Security*) в течение всего периода трудовой жизни главы домохозяйства. Используя панельные данные опроса населения Нидерландов, исследователи показывают, что фактор производительности может объяснить когортные эффекты в динамике доходов, а в совокупности с фактором изменений в пенсионном обеспечении — эффект когорты в динамике чистых активов [Kapteyn, Alessie, Lusardi 2005: 1363].

В поисках ответа на вопрос, какие показатели могут быть использованы для отражения сущностных характеристик изучаемого в нашем исследовании периода (1996–2010), следует обратить внимание на исследование Н. Головина, посвящённое процессам политической социализации [Головин 2004]. Изучая эту проблему применительно к российскому обществу 1992–2000 гг., автор рассматривает широкий спектр социально-экономических и демографических показателей с целью выявления объективных факторов, отражающих содержание данного периода¹¹. Использование статистических методов факторного анализа в данной ситуации, по мнению автора, проблематично, поскольку «...обнаруживается довольно неравномерная факторная нагрузка на переменные и слишком высокая чувствительность результатов статистических процедур к структуре и динамике переменных, обусловленной кризисными процессами» [Головин 2004: 153]. Экспертным путём Н. Головин приходит к выводу, что рассматриваемый им период характеризуется действием четырёх латентных факторов. Первый из них учитывает переменные, характеризующие ситуацию с занятостью населения и важнейшие макроэкономические показатели, то есть численность занятых в экономике, в том числе в промышленности, сельском хозяйстве, жилищно-коммунальной сфере и бытовом обслуживании, науке и её обслуживании, количество безработных, численность управленцев, число лиц старше трудоспособного возраста, а также объём ВВП, инвестиций, уровень инфляции и др. Фактор отражает ситуацию в экономике и нагрузку на население от её структурной перестройки. Вторым фактор, обозначенный автором как «противоречивость возможностей социальной мобильности молодёжи», объединяет такие показатели, как численность студенчества, выпуск специалистов с высшим образованием, количество получивших среднее образование, численность больных алкоголизмом и наркоманией. Третьим латентным фактором, действующим в рассматриваемый период, является совокупное влияние высокой естественной убыли населения, смертности и общей заболеваемости. В качестве четвёртого фактора исследователем выделяется преступность [Головин 2004: 153–154]. Эти факторы действуют дифференцированно на людей разного возраста, тем самым создавая эффект когорты. Автор указывает, что «первый фактор касается прежде всего поколений перестройки, “застоя” и поколения шестидесятых. Вторым фактор особенно сильно воздействует на молодёжь (поколение общесистемного кризиса), ставя её в отмеченную противоречивую ситуацию как раз в годы выбора жизненного пути. Третьим фактор сильнее всего действует на военное и послевоенное поколение и другие старшие возрасты, а от высокой преступности страдают все» [Головин 2004: 154].

¹¹ Помимо объективных, автор выделяет ещё субъективные факторы, под которыми подразумевается социальное настроение общества как «проявление социально-психологического климата политической социализации» [Головин 2004: 148]. Мы не рассматриваем эти факторы, поскольку изучение динамики настроений и так входит в цели нашего исследования.

Когортный, поколенческий анализ и историческая социология как методологическая парадигма

Здесь необходимо сказать, что в отечественной социологии вплоть до последнего времени речь традиционно шла о поколениях, а не о когортах. Своего рода обобщением данной традиции явилась вышедшая в 2005 г. под редакцией Ю. Левады и Т. Шанина книга «Отцы и дети: поколенческий анализ современной России» [Левада, Шанин 2005]. При всём богатстве теоретических подходов к исследованию проблемы поколений¹² единства по поводу эмпирического использования данного концепта нет. Это связано с трудностями операционализации данного понятия. К примеру, «каковы границы, разделяющие поколения? Как отличить одно поколение от другого в непрерывной череде смены поколений? На основании каких критериев можно судить о поколении?» [Семёнова 2005: 81]. Каждый исследователь отвечает на эти вопросы по-своему в зависимости от понимания теории вопроса.

Нам, если не вдаваться в подробности дифференциации поколений, видится обоснованным тезис М. Науэн о том, что «по сравнению с поколенческим подходом в социологии метод когортного анализа позволяет проводить более дифференцированный анализ общественной динамики, т.к. “когорта” представляет собой меньшую социальную общность, чем “поколение”, легче поддающуюся описанию, операционализации и эмпирическому анализу» [Науэн 2006: 142]. Иными словами, поколение может выступать в качестве совокупности различного числа когорт, выделенных, к примеру, по году рождения. Вместе с тем это ни в коем случае не означает, что когортный анализ является чисто «техническим». Суть его состоит именно в объяснении динамики каких-либо процессов различиями в социализации людей и сменой когорт, образующихся под влиянием отдельных событий или их совокупности.

Из этого следует, что при проведении когортных исследований целесообразно придерживаться историко-социологического подхода в качестве методологической парадигмы. Это означает, что временные периоды как прошлого, так и современности необходимо рассматривать как социально-исторические целостности со своими конфигурациями общественных условий и уникальными событиями, со своими альтернативами и многонаправленностью различных процессов¹³.

Заключение

Когортный подход к анализу потребительских ожиданий открывает большие возможности, во-первых, для исследования процесса адаптации людей к изменяющимся экономическим условиям и — применительно к России — механизма «рыночной социализации» населения. Во-вторых, анализ профиля потребительских ожиданий по возрасту в разрезе различных когорт полезен для понимания динамики настроений людей относительно экономического развития страны в будущем. Однако реализация данного подхода требует, с одной стороны, многолетних данных, собранных по единой методологии, а с другой — выбора стратегии решения проблемы идентификации, то есть разделения эффектов возраста, когорты и исторического периода.

Фундаментом выбора процедуры дифференциации эффектов должна быть теоретическая концепция исследователя. Применительно к анализу потребительских ожиданий отправной точкой таковой может являться психологическая экономика Дж. Катона, из которой следует, что в условиях неопределённости экономические ожидания потребителей существенно влияют на экономику в целом. Опыт измерений потребительских настроений в различных странах показывает, что ИПН — это обобщённый ма-

¹² См., например: [Дубин 1995а; 1995b; Савельева, Полетаев 1997; Глозов 2004; Левада 2005; Шанин 2005] и др.

¹³ Подробнее об исторической социологии как о подходе к изучению общества см.: [Шанин 1997]; об исторической социологии как о стратегии исследования социализации см.: [Головин 2004: 78–89].

кросэкономический показатель, действительно отражающий, а зачастую и прогнозирующий динамику экономического развития страны в целом. Соответственно можно предположить, что значение индекса аккумулирует в себе эффект периода, понимаемого в данном случае как совокупность социально-экономических характеристик в конкретную единицу времени.

Наше дальнейшее эмпирическое исследование предполагает использование данной теоретической концепции с целью выявления эффекта когорты в изменении потребительских ожиданий россиян в 1996–2010 гг.

Литература

- Глотов М. Б. 2004. Поколение как категория социологии. *Социологические исследования*. 10: 42–49.
- Головин Н. Л. 2004. *Теоретико-методологические основы исследования политической социализации*. СПб.: Издательство СПбГУ.
- Дубин Б. В. 1995а. О поколенческом механизме социальных сдвигов. В сб.: Заславская Т. И. (отв. ред.) *Куда идёт Россия? Альтернативы общественного развития*. М.: Аспект-Пресс; 237–247.
- Дубин Б. В. 1995b. Социальный статус, культурный капитал и разрыв поколений. *Мониторинг общественного мнения: экономические и социальные перемены*. 1: 12–16.
- Ибрагимова Д. Х., Николаенко С. А. 2005. *Индекс потребительских настроений*. М.: Поматур.
- Кесельман Л. Е., Мацкевич М. Г. 1998. Межгенерационный сдвиг индивидуального оптимизма/пессимизма в современном российском обществе. *Журнал социологии и социальной антропологии*. 1 (2): 113–120.
- Левада Ю. А. 1999. Пятилетние группы — пятилетние сдвиги (опыт ретроспективного анализа). *Мониторинг общественного мнения: экономические и социальные перемены*. 2: 19–24.
- Левада Ю. А. 2000. Человек приспособленный. В кн.: Левада Ю. *От мнений к пониманию: социологические очерки 1993–2000*. М.: Московская школа политических исследований; 467–488.
- Левада Ю. А. 2005. Поколения XX века: возможности исследования. В сб.: Левада Ю. А., Шанин Т. (ред.). *Отцы и дети: поколенческий анализ современной России*. М.: Новое Литературное обозрение; 39–60.
- Левада Ю. А., Шанин Т. (ред.). 2005. *Отцы и дети: поколенческий анализ современной России*. М.: Новое Литературное обозрение.
- Науэн М. С. 2006. Метод когортного анализа в социологии. *Журнал социологии и социальной антропологии*. 9 (3): 137–144.
- Савельева И. М., Полетаев А. В. 1997. Смена поколений. В кн.: Савельева И. М., Полетаев А. В. *История и время: в поисках утраченного*. М.: Языки русской культуры; 360–371.
- Семёнова В. В. 2005. Современные концепции и эмпирические подходы к понятию «поколение» в социологии. В сб.: Левада Ю. А., Шанин Т. (ред.). *Отцы и дети: поколенческий анализ современной России*. М.: Новое Литературное обозрение; 80–107.

- Шанин Т. 1997. Постскрипtum: Вопросы выбора. В кн.: Шанин Т. *Революция как момент истины: Россия 1905–1907 — 1917–1922 годы*. Пер. с англ. Е. М. Ковалёва. М.: Весь мир.
- Шанин Т. 2005. История поколений и поколенческая история. В сб.: Левада Ю. А., Шанин Т. (ред.). *Отцы и дети: поколенческий анализ современной России*. М.: Новое Литературное обозрение; 17–39.
- Adams F. 1964. Consumer Attitudes, Buying Plans, and Purchases of Durable Goods: A Principal Components, Time Series Approach. *The Review of Economics and Statistics*. 46 (4): 347–355.
- Attanasio O. P. 1998. Cohort Analysis of Saving Behavior by U.S. Households. *The Journal of Human Resources*. 33 (3). Summer: 575–609.
- Baghestani H. 1992. Survey Evidence on the Muthian Rationality of Inflation Forecasts of US consumers. *Oxford Bulletin of Economics and Statistics*. May: 173–186.
- Baltes P. B., Reinert G. 1969. Cohort Effects in Cognitive Development of Children as Revealed by Cross-sectional Sequences. *Developmental Psychology*. 1 (2): 169–177.
- Blossfeld H.-P. 1986. Career Opportunities in the Federal Republic of Germany: A Dynamic Approach to the Study of Life-Course, Cohort, and Period Effects. *European Sociological Review*. 2 (3). December: 208–225.
- Carroll C. 2003. Macroeconomic Expectations of Households and Professional Forecasters. *The Quarterly Journal of Economics*. 118 (1): 269–298.
- Carroll C., Dunn W. 1997. Unemployment Expectations, Jumping (S, s) Triggers, and Household Balance Sheets. In: Bernanke B. S., Rotemberg J. (eds). *NBER Macroeconomics Annual*. 12; 165–230. URL: <http://www.nber.org/chapters/c11039.pdf>
- Carroll C., Fuhrer J., Wilcox D. 1994. Does Consumer Sentiment Forecast Household Spending? If So, Why? *The American Economic Review*. 84 (5): 1397–1408.
- Curtin R. 2000. *The Structure of Consumer Confidence: Comparisons between the United States and Russia*. URL: <http://www.sca.isr.umich.edu/fetchdoc.php?docid=24781>
- Curtin R. 2003. Unemployment Expectations: The Impact of Private Information on Income Uncertainty. *Review of Income and Wealth*. 49 (4): 539–554.
- Curtin R. 2007a. Consumer Sentiment Surveys: Worldwide Review and Assessment. *Journal of Business Cycle Measurement and Analysis*. 3 (1): 7–42.
- Curtin R. 2007b. *What U.S. Consumers Knows about the Economic Conditions*. Paper presented at OECD World Forum on Statistics, Knowledge and Policy. June. URL: <http://www.sca.isr.umich.edu/fetchdoc.php?docid=34884>
- Curtin R. 2010. Inflation Expectations: Theoretical Models and Empirical Tests. In: Sinclair P. (ed.). *Inflation Expectations*. London: Routledge; 34–36.

- Das M., Soest A. van. 2000. *Expected Versus Realized Income Expectations: A Test of the Rational Expectations Hypothesis*. URL: <http://fmwww.bc.edu/RePEc/es2000/1750.pdf>
- Deaton A., Paxson C. 1994. Saving, Aging, and Growth in Taiwan. In: Wise D. (ed.). *Studies in the Economics of Aging*. Chicago: University of Chicago Press; 331–362.
- Easaw J., Garratt D., Heravi S. 2005. Does Consumer Sentiment Accurately Forecast UK Household Consumption? Are There Any Comparisons To Be Made With The US? *Journal of Macroeconomics*. 27: 517–532.
- Glenn N. 2005. *Cohort Analysis*. 2nd rev. ed. Thousand Oaks, CA: SAGE Publications (Quantitative Applications in the Social Sciences Series).
- Grant A. P., Thomas L. B., Jr. 1999. Inflationary Expectations and Rationality Revisited. *Economic Letters*. 62: 331–338.
- Heckman J., Robb R. 1985. Using Longitudinal Data to Estimate Age, Period and Cohort Effects in Earnings Equations. In: Mason W. M., Fienberg S. E. (eds) *Cohort Analysis in Social Research*. New York: Springer; 137–150.
- Halvorsen E. 2003. *A Cohort Analysis of Household Saving in Norway*. Discussion Papers No. 354, August 2003. Statistics Norway, Research Department. URL: <http://www.ssb.no/a/publikasjoner/pdf/DP/dp354.pdf>
- Heim J. 2010. The Impact of Consumer Confidence on Consumption and Investment Spending. *The Journal of Applied Business and Economics*. 11 (2). August: 37–54.
- Howrey P. 2001. The Predictive Power of the Index of Consumer Sentiment. *Brookings Papers on Economic Activity*. 1: 175–216.
- Juster T., Wachtel P. 1972. Anticipatory and Objective Models of Durable Goods Demand. *The American Economic Review*. 62 (4): 564–579.
- Kapteyn A., Alessie R., Lusardi A. 2005. Explaining the Wealth Holdings of Different Cohorts: Productivity Growth and Social Security. *European Economic Review*. 49 (5). July: 1361–1391.
- Katona G. 1951. *Psychological Analysis of Economic Behaviour*. New York: McGraw-Hill.
- Katona G. 1968. Consumer Behavior: Theory and Findings on Expectations and Aspirations. *The American Economic Review*. 58 (2). Papers and Proceedings of the Eightieth Annual Meeting of the American Economic Association (May, 1968); 19–30.
- Katona G. 1975. *Psychological Economics*. New York: Elsevier.
- Kwan A., Cotsomitis J. 2004. Can Consumer Attitudes Forecast Household Spending in the United States? Further Evidence from the Michigan Survey of Consumers. *Southern Economic Journal*. 71 (1). July: 136–144.

- Lahiri K., Zhao Y. 2013. *Determinants of Consumer Sentiment: Evidence from Household Survey Data*. Discussion Papers from University at Albany, SUNY, Department of Economics. URL: <http://econpapers.repec.org/paper/nyaalbaec/13-12.htm>
- Ludvigson S. 2004. Consumer Confidence and Confidence Spending. *Journal of Economic Perspectives*. 18 (2): 29–50.
- Mannheim K. 1952. *The Problem of Generations*. In: Mannheim K. (ed.). *Essays on the Sociology of Knowledge*. New York: Oxford University Press; 276–321.
- Mason K. O. et al. 1973. Some Methodological Issues in Cohort Analysis of Archival Data. *American Sociological Review*. 38 (2): 242–258.
- Mishkin F. et al. 1978. Consumer Sentiment and Spending on Durable Goods. *Brookings Papers on Economic Activity*. 1: 217–232.
- Noble N., Windsor Fields T. 1982. Testing the Rationality of Inflation Expectations Derived from Survey Data: A Structure-Based Approach. *Southern Economic Journal*. 49 (2): 361–373.
- O'Brien R. M., Hudson K., Stockard J. 2008. A Mixed Model Estimation of Age, Period, and Cohort Effects. *Sociological Methods & Research*. 36: 402–428.
- Ryder N. 1965. The Cohort as a Concept in the Study of Social Change. *American Sociological Review*. 30 (6): 843–861.
- Sasaki M., Suzuki T. 1987. Changes in Religious Commitment in the United States, Holland, and Japan. *American Journal of Sociology*. 92: 1055–1076.
- Shorrocks A. F. 1975. The Age-Wealth Relationship: A Cross Section and Cohort Analysis. *Review of Economics and Statistics*. 57 (2). May: 155–163.
- Souleles N. 2004. Expectations, Heterogeneous Forecast Errors, And Consumption: Micro Evidence Form. The Michigan Consumer Sentiment Surveys. *Journal of Money, Credit and Banking*. 36 (1). February: 39–72.
- Thomas L. B., Jr. 1999. Survey Measures of Expected U.S. Inflation. *Journal of Economic Perspectives*. 13 (4): 125–144.
- Yang Y., Land K. C. 2008. Age—Period—Cohort Analysis of Repeated Cross-Section Surveys: Fixed or Random Effects. *Sociological Methods & Research*. 36: 297–327.

PROFESSIONAL REVIEWS

Dilyara Ibragimova

Cohort Analysis of Consumer Expectations of Russian Population (1996–2010): Theoretical and Methodological Backgrounds

IBRAGIMOVA, Dilyara Khanifovna — Candidate of Sciences in History, Associate Professor, Deputy Head, Department of Economic Sociology; Senior Research Fellow, Laboratory for Studies in Economic Sociology, National Research University “Higher School of Economics”. Address: 20 Myasnitskaya str., Moscow 101000, Russian Federation.

Email: dibragimova@hse.ru

Abstract

Consumer confidence surveys are regularly conducted in more than 50 countries, including Russia. Most of them measure how optimistic or pessimistic consumers are with respect to the economy in the near future and test the predictive power of CSI components. Only a few studies analyze the determinants of consumer expectations and examine various socio-demographic determinates of CSI components, including age. However, when assessing the effects of age one should separate age and cohort effects. The term cohort effect is used to describe the effects of being born at about the same time, exposed to the same events in the process of their socialization. The paper provides an overview of theoretical approaches and empirical research which can be used for cohort analysis of consumer expectations. The paper deals with the psychological economics of G. Katona, generation theory of K. Mannheim, N. Ryder's conceptual approach to cohort analysis in social sciences. Special attention is given to the discussion of possible

strategies to address the “identification problem”, i. e. the linear dependency of cohort membership, age, and period. Based on consumer surveys data on saving and consumption, the paper analyzes the advantages and disadvantages of both “formal” and ‘substantive’ approaches aimed at clarifying the definitions and interpretations of age, period and cohort effects. The article raises the question of how to relate the generational and cohort analysis, as well as describing the principles of historical sociology as a methodological paradigm of such studies.

Key words: consumer expectations; cohort analysis; generation analysis; consumer sentiment index; consumption; saving.

References

- Adams F. (1964) Consumer Attitudes, Buying Plans, and Purchases of Durable Goods: A Principal Components, Time Series Approach. *The Review of Economics and Statistics*, vol. 46, no 4, pp. 347–355.
- Attanasio O. P. (1998) Cohort Analysis of Saving Behavior by U.S. Households. *The Journal of Human Resources*, vol. 33, no 3, Summer, pp. 575–609.
- Baghestani H. (1992) Survey Evidence on the Muthian Rationality of Inflation Forecasts of US consumers. *Oxford Bulletin of Economics and Statistics*, May, pp. 173–186.
- Baltes P. B., Reinert G. (1969) Cohort Effects in Cognitive Development of Children as Revealed by Cross-Sectional Sequences. *Developmental Psychology*, vol. 1, no 2, pp. 169–177.

- Blossfeld H.-P. (1986) Career Opportunities in the Federal Republic of Germany: A Dynamic Approach to the Study of Life-Course, Cohort, and Period Effects. *European Sociological Review*, vol. 2, no 3, December, pp. 208–225.
- Carroll C. (2003) Macroeconomic Expectations of Households and Professional Forecasters. *The Quarterly Journal of Economics*, vol. 118, no 1, pp. 269–298.
- Carroll C., Dunn W. (1997) Unemployment Expectations, Jumping (S, s) Triggers, and Household Balance Sheets. *NBER Macroeconomics Annual* (eds. B. S. Bernanke, J. Rotemberg), vol. 12, pp. 165–230. Available at: <http://www.nber.org/chapters/c11039.pdf> (accessed on 27 February 2014).
- Carroll C., Fuhrer J., Wilcox D. (1994) Does Consumer Sentiment Forecast Household Spending? If So, Why? *The American Economic Review*, vol. 84, no 5, pp. 1397–1408.
- Curtin R. (2000) *The Structure of Consumer Confidence: Comparisons between the United States and Russia*. Available at: <http://www.sca.isr.umich.edu/fetchdoc.php?docid=24781> (accessed on 27 February 2014).
- Curtin R. (2003) Unemployment Expectations: The Impact of Private Information on Income Uncertainty. *Review of Income and Wealth*, vol. 49, no 4, pp. 539–554.
- Curtin R. (2007a) Consumer Sentiment Surveys: Worldwide Review and Assessment. *Journal of Business Cycle Measurement and Analysis*, vol. 3, no 1, pp. 7–42.
- Curtin R. (2007b) *What U.S. Consumer Knows about the Economic Conditions*. Paper presented at OECD World Forum on Statistics, Knowledge and Policy, June 007. Available at: <http://www.sca.isr.umich.edu/fetchdoc.php?docid=34884> (accessed on 27 February 2014).
- Curtin R. (2010) Inflation Expectations: Theoretical Models and Empirical Tests. *Inflation Expectations* (ed. P. Sinclair), London: Routledge, pp. 34–36.
- Das M., Soest A. van. (2000) Expected Versus Realized Income Expectations: A Test of the Rational Expectations Hypothesis. Available at: <http://fmwww.bc.edu/RePEc/es2000/1750.pdf> (accessed on 27 February 2014).
- Deaton A., Paxson C. (1994) Saving, Aging, and Growth in Taiwan. *Studies in the Economics of Aging* (ed. D. Wise), Chicago: University of Chicago Press, pp. 331–362.
- Dubin B. (1995a) O pokolencheskom mekhanizme sotsial'nykh sdvigoov [On Generational Mechanism of Social Shifts]. *Kuda idet Rossiya? Al'ternativy obschestvennogo razvitiya* [Where is Russia Going? Alternatives for Social Development] (ed. T. I. Zaslavskaja), Moscow: Aspekt-Press, pp. 237–247 (in Russian).
- Dubin B. (1995b) Sotsial'ny status, kul'turny capital i razry v pokolenii [Social Status, Cultural Capital and the Generation Gap]. *The Russian Public Opinion Monitor*, vol. 1, pp. 12–16 (in Russian).
- Easaw J., Garratt D., Heravi S. (2005) Does Consumer Sentiment Accurately Forecast UK Household Consumption? Are There Any Comparisons To Be Made With The US? *Journal of Macroeconomics*, vol. 27, pp. 517–532.
- Glenn N. (2005) *Cohort Analysis*. 2nd rev. ed., Thousand Oaks, CA: SAGE Publications (Quantitative Applications in the Social Sciences Series).

- Glotov M. (2004) Pokoleniye kak kategoriya sociologii [Generation as a Sociological Category]. *Sotsiologicheskie issledovaniya*, vol. 10, pp. 42–49 (in Russian).
- Golovin N. (2004) *Teoretico-metodologicheskie osnovy issledovaniya politicheskoi sotsializatsii* [Theoretical and Methodological Foundations of Studies in Political Socialization], Saint-Petersburg: St.-Petersburg State University (in Russian).
- Grant A. P., Thomas L. B., Jr. (1999) Inflationary Expectations and Rationality Revisited. *Economic Letters*, vol. 62, pp. 331–338.
- Heckman J., Robb R. (1985) Using Longitudinal Data to Estimate Age, Period and Cohort Effects in Earnings Equations. *Cohort Analysis in Social Research* (eds. W. M. Mason, S. E. Fienberg), New York: Springer, pp. 137–150.
- Halvorsen E. (2003) *A Cohort Analysis of Household Saving in Norway*. Discussion Papers No. 354, August 2003 Statistics Norway, Research Department, Available at: <http://www.ssb.no/a/publikasjoner/pdf/DP/dp354.pdf> (accessed on 27 February 2014).
- Heim J. (2010) The Impact of Consumer Confidence on Consumption and Investment Spending. *The Journal of Applied Business and Economics*, vol. 11, no 2, August, pp. 37–54.
- Howrey P. (2001) The Predictive Power of the Index of Consumer Sentiment. *Brookings Papers on Economic Activity*, vol. 1, pp. 175–216.
- Ibragimova D., Nikolayenko S. (2005) *Index potrebitel'skikh nastroyenii* [Consumer Sentiment Index], Moscow: Pomatur (in Russian).
- Juster T., Wachtel P. (1972) Anticipatory and Objective Models of Durable Goods Demand. *The American Economic Review*, vol. 62, no 4, pp. 564–579.
- Kapteyn A., Alessie R., Lusardi A. (2005) Explaining the Wealth Holdings of Different Cohorts: Productivity Growth and Social Security. *European Economic Review*, vol. 49, no 5, July, pp. 1361–1391.
- Katona G. (1951) *Psychological Analysis of Economic Behaviour*. New York: McGraw-Hill.
- Katona G. (1968) Consumer Behavior: Theory and Findings on Expectations and Aspirations. *The American Economic Review*, vol. 58, no 2. Papers and Proceedings of the Eightieth Annual Meeting of the American Economic Association (May), pp. 19–30.
- Katona G. (1975) *Psychological Economics*. New York: Elsevier.
- Kesel'man L., Matskevich M. (1998) Mezhhgeneratsionnyy sdvig individual'nogo optimizma/pessimizma v sovremennom rossiiskom obschestve [The Intergenerational Shift of Individual Optimism/Pessimism in Contemporary Russian Society]. *Zhurnal sotsiologii i sotsial'noy antropologii*, vol. 1, no 2, pp. 113–120 (in Russian).
- Kwan A., Cotsonitis J. (2004) Can Consumer Attitudes Forecast Household Spending in the United States? Further Evidence from the Michigan Survey of Consumers. *Southern Economic Journal*, vol. 71, no 1, July, pp. 136–144.

- Lahiri K., Zhao Y. (2013) *Determinants of Consumer Sentiment: Evidence from Household Survey Data*. Discussion Papers from University at Albany, SUNY, Department of Economics. Available at: <http://econpapers.repec.org/paper/nyaalbaec/13-12.htm> (accessed on 27 February 2014).
- Levada Yu. (1999) Pyatiletnie gruppy — pyatiletnie sdvigi (opyt retrospektivnogo analiza) [Five-Year Groups — the Five-Year Changes (A Retrospective Analysis)]. *The Russian Public Opinion Monitor*, vol. 2, pp. 19–24 (in Russian).
- Levada Yu. (2000) Chelovek prisposoblenny [Adapted Human]. Levada Yu. *Ot mnenii k ponimaniyu: sociologicheskie ocherki 1993–2000* [From Opinion toward Understanding: Sociological Essays 1993–2000], Moscow: Moscow School of Political Research, pp. 467–488 (in Russian).
- Levada Yu (2005) Pokoleniya 20-go veka: vozmozhnosti issledovaniya [Generations of the 20-th Century: Possibilities for Studying]. *Otsy i deti: pokolencheskii analiz sovremennoi Rossii* [Daddies and Children: A Generational Analysis of Contemporary Russia] (eds. Yu. Levada, T. Shanin), Moscow: New Literary Review; pp. 39–60 (in Russian).
- Levada Yu., Shanin T. (eds) (2005). *Otsy i deti: pokolencheskii analiz sovremennoi Rossii* [Daddies and Children: A Generational Analysis of Contemporary Russia], Moscow: New Literary Review (in Russian).
- Ludvigson S. (2004) Consumer Confidence and Confidence Spending. *Journal of Economic Perspectives*, vol. 18, no 2, pp. 29–50.
- Mannheim K. (1952) *The Problem of Generations. Essays on the Sociology of Knowledge* (ed. K. Manheim), New York: Oxford University Press, pp. 276–321.
- Mason K. O., Mason W. M., Winsborough H. H., Poole K. W. (1973) Some Methodological Issues in Cohort Analysis of Archival Data. *American Sociological Review*, vol. 38, no 2, pp. 242–258.
- Mishkin F., Hall R., Shoven J., Juster T., Lovell M. (1978). Consumer Sentiment and Spending on Durable Goods. *Brookings Papers on Economic Activity*, no 1, pp. 217–232.
- Nauen M. (2006) Metod kogortnogo analiza v sociologii [Method of Cohort Analysis in Sociology]. *The Journal of Sociology and Social Anthropology*, vol. 9, no 3, pp. 137–144 (in Russian).
- Noble N., Windsor Fields T. (1982) Testing the Rationality of Inflation Expectations Derived from Survey Data: A Structure-Based Approach. *Southern Economic Journal*, vol. 49, no 2, pp. 361–373.
- O'Brien R. M., Hudson K., Stockard J. (2008) A Mixed Model Estimation of Age, Period, and Cohort Effects. *Sociological Methods & Research*, vol. 36, pp. 402–428.
- Ryder N. (1965) The Cohort as a Concept in the Study of Social Change. *American Sociological Review*, vol. 30, no 6, pp. 843–861.
- Sasaki M., Suzuki T. (1987) Changes in Religious Commitment in the United States, Holland, and Japan. *American Journal of Sociology*, vol. 92, pp. 1055–1076.
- Savel'eva I., Poletayev A. (1997) Smena pokoleniy [Generational Replacement]. Savel'eva I., Poletayev A. *Istoriya i vremya: v poiskakh utrachennogo* [History and Time: Searching the Past], Moscow: Yazyki russkoi kul'tury, pp. 360–371 (in Russian).

- Semenova V. (2005) Sovremennye kontseptsii i empiricheskie podkhody k ponyatiyu “pokolenie” v sociologii [Contemporary Concepts and Empirical Approaches to the Notion of Generation in Sociology]. *Otsy i deti: pokolencheskii analiz sovremennoi Rossii* [Daddies and Children: A Generational Analysis of Contemporary Russia] (eds. Yu. Levada, T. Shanin), Moscow: New Literary Review, pp. 80–107 (in Russian).
- Shanin T. (1997) Postskriptum: Voprosy vybora [Postscript: Questions of Choice]. Shanin T. *Revolution as a Moment of Truth 1905–1907 — 1917–1922* (Translated by E. Kovalev), Moscow: Ves’ mir (in Russian).
- Shanin T. (2005). Istoriya pokolenii i pokolencheskya istoriya [History of Generations and Generational History]. *Otsy i deti: pokolencheskii analiz sovremennoi Rossii* [Daddies and Children: A Generational Analysis of Contemporary Russia] (eds. Yu. Levada, T. Shanin), Moscow: New Literary Review, pp. 17–39 (in Russian).
- Shorrocks A. F. (1975) The Age-Wealth Relationship: A Cross Section and Cohort Analysis. *Review of Economics and Statistics*, vol. 57, no 2, May, pp. 155–163.
- Souleles N. (2004) Expectations, Heterogeneous Forecast Errors, And Consumption: Micro Evidence Form. The Michigan Consumer Sentiment Surveys. *Journal of Money, Credit and Banking*, vol. 36, no 1, February, pp. 39–72.
- Thomas L. B., Jr. (1999) Survey Measures of Expected U.S. Inflation. *Journal of Economic Perspectives*, vol. 13, no 4, pp. 125–144.
- Yang Ya., Land K. C. (2008) Age—Period—Cohort Analysis of Repeated Cross-Section Surveys: Fixed or Random Effects. *Sociological Methods & Research*, vol. 36, pp. 297–327.