Ольга Золотарева

Золотарева Ольга Анатольевна — кандидат экономических наук, директор Центра демографии и статистики Института экономических стратегий, доцент факультета государственного управления МГУ имени М.В. Ломоносова

zolotareva@spa.msu.ru

Olga A. Zolotareva — Institute for Economic Strategies, Lomonosov Moscow State University

Некоторые аспекты построения рейтингов и оценки их качества

Рейтинги являются независимыми, беспристрастными, методологически обоснованными и позволяют на базе широкого спектра метрик дать оценку конкурентоспособности стран, регионов, отраслей, компаний.

Обзорная статья
УДК 338.001.36
DOI: 10.33917/es-5.191.2023.126-131
Для цитирования: Золотарева О.А. Некоторые аспекты построения рейтингов и оценки их качества // Экономические стратегии. 2023. № 5(191). С. 126–131. DOI: https://doi.org/10.33917/es-5.191.2023.126-131

В современном мире инструментальной компонентой, обеспечивающей анализ, прогноз и поддержку принятия управленческих решений как на макро-, так и на микро- и мезоуровне стали рейтинги. Возрастающая интенсивность потоков и объемов информации, ее многомерный характер, разнообразие форматов ее представления и коммуникаций для передачи в условиях возрастания сложности экономических и социальных явлений и процессов создали мощный спрос на рейтинги в бизнесе, финансово-инвестиционной сфере и в стратегическом управлении, и на государственном уровне. Это объясняется тем, что рейтинги являются независимыми, беспристрастными, методологически обоснованными и позволяют на базе широкого спектра метрик дать оценку конкурентоспособности стран, регионов, отраслей, компаний. С учетом рейтингов формируются последующие инвестиционные решения ключевых экономических игроков.

Ключевые слова
Рейтинги, качество рейтингов, интегральные индексы, параметры качества данных

Введение

Рейтинги, являясь сравнительно новым феноменом, имеющим всего лишь столетнюю историю, в современном мире становятся важным элементом информационно-аналитической деятельности и могут дать оценку значимости каждой темы. Отметим, что до появления рейтингов в том или ином виде имелся сравнительный анализ стран друг с другом и для выявления перспектив сотрудничества, и при соперничестве/конкуренции, и при планировании войн/сражений, и для мира. Основной тенденцией развития теории построения рейтингов стало расширение возможностей характеристики объектов рейтингования с учетом открытости данных. Масштабное распространение получили рейтинги, построенные на базе интегральных индексов, включающих множество отдельных метрик, характеризующих объект рейтингования.

Различные рейтинги в различных форматах предоставляют международные организации:

- Организация Объединенных Наций (ООН) ранжирует страны по индексу человеческого развития (*Human Development Index*), индексу гендерного неравенства (*Gender Inequality Index*), индексу многомерной бедности (*Multidimensional Poverty Index*);
- Всемирный экономический форум — ВЭФ (*World Economic Forum*) предоставляет информацию о рейтинге стран по индексу инклюзивного развития (*Inclusive Development Index*), индексу глобальной конкурентоспособности (*Global Competitiveness Index*), глобальному индексу гендерного разрыва (*Global Gender Gap Index*);
- Институт *Legatum* распределяет страны по индексу процветания *Legatum*™ (*The Legatum Prosperity Index*™);

>> Основной тенденцией развития теории построения рейтингов стало расширение возможностей характеристики объектов рейтингования с учетом открытости данных.

- Всемирная организация интеллектуальной собственности (*World Intellectual Property Organization*) ранжирует страны по глобальному инновационному индексу (*Global Innovation Index*);
- Фонд «Наследие» предоставляет информацию о рейтинге стран по индексу экономической свободы (*Index of Economic Freedom*);
- Институт Фрейзера публикует рейтинг стран по индексу экономической свободы мира (*Economic Freedom of the World Index*);
- SDSN и *Bertelsmann Stiftung* разработали индекс прогресса по Целям устойчивого развитиям — индекс ЦУР (*Sustainable Development Goals Index*) и на его основе ранжируют страны;
- Международный союз электросвязи определяет порядок стран по глобальному индексу кибербезопасности (*Global Cybersecurity Index*) и др.

Рейтинги: сущность, основные классификации и особенности построения

Термин «рейтинг» (англ. *rating*) переводится как «оценка, определение стоимости» или как «отнесение к классу, разряду, категории». По сути, рейтинг — числовой или порядковый показатель, характеризующий важность или значимость определенного объекта или явления. Другими словами, рейтинг представляет собой список объектов,

Review article
For citation: Zolotareva O.A. Nekotorye aspekty postroeniya reitingov i otsenki ikh kachestva [Some Aspects of Compiling Ratings and Assessing their Quality]. *Ekonomicheskie strategii*, 2023, no 5(191), pp. 126–131.
DOI: https://doi.org/10.33917/es-5.191.2023.126-131

Some Aspects of Compiling Ratings and Assessing their Quality

In the modern world, ratings have become an instrumental component that provides analysis, forecast and support for management decisions at both the macro, micro and meso-levels. The increasing intensity of flows and volumes of information, its multidimensional nature, the variety of formats for its presentation and communication for transmission in the context of increasing complexity of economic and social phenomena and processes, have created a powerful demand for ratings in business, in the financial and investment sphere and in strategic management, as well as at the state level. This is explained by the fact that ratings are independent, impartial, methodologically sound and allow, based on a wide range of metrics, to assess the competitiveness of countries, regions, industries and companies. Taking into account the ratings, subsequent investment decisions of the key economic players are formed.

Keywords
Ratings, ratings quality, integral indices, data quality parameters

Ольга Золотарева

расположенных в определенной последовательности в зависимости от оценок, полученных по различным показателям их деятельности, как правило, по принципу «от лучших к худшим». Список объектов или явлений, имеющих наибольший рейтинг, обычно называют «Топ N» или «ТОР N», где N — количество объектов в списке, обычно кратное 10.

В Советском энциклопедическом словаре [1] термин «рейтинг» понимается узко — как индивидуальный числовой показатель оценки спортивных достижений шахматиста (шашиста) в классификационном списке (рейтинг-листе). Современный словарь иностранных слов определяет рейтинг как «индивидуальный числовой показатель оценки популярности, авторитета, лица, организации, группы их деятельности, программ, планов в определенное время» [2].

В широком смысле рейтинг (оценка, положение, ранг) — экспертная оценка качества определенного объекта. Объектом рейтингования могут выступать финансовые инструменты, кредитоспособность компаний, университеты, компании, города, регионы, страны и т.д.

Отметим, что рейтинг — это не всегда ранжирование. Рейтинг сводится к комплексной оценке состояния субъекта. Он может представлять характеристику этого состояния по совокупности ряда параметров, отраженную в комбинации символов.

Существует множество разновидностей рейтингов. Их можно классифицировать на основании разных параметров. В частности, по количеству характеристик, на основании которых оценивают ранжируемые объекты, рейтинги можно разделить на однофакторные и многофакторные (рэнкинги и, собственно, рейтинги).

По источникам информации, на основании которой составляют рейтинги, их также можно отнести к нескольким категориям:
- составленные по результатам опроса целевой аудитории;
- построенные на вторичной информации;
- основанные на данных, полученных непосредственно от ранжируемых объектов.

В зависимости от того, сколько раз был выпущен рейтинговый продукт, выделяют периодические и непериодические рейтинги.

Как бы велико ни было разнообразие рейтингов, а также круг целей, ради достижения которых их используют, спрос на рейтинги создают несколько классов потребителей: инвесторы, коммерческие и некоммерческие организации различного направления, граждане и т.д.

Главное назначение рейтинга — содействие расстановке субъектов в сфере деятельности по ключевым факторам успешности. Однако идеальный вариант уязвим, поскольку требует полной информации по множеству аспектов деятельности, чего в реальной жизни не бывает. Основная сложность работы с рейтингом состоит в том, что нужно обеспечить информационную прозрачность в условиях, когда часть необходимой информации недоступна. Как следствие возникает вопрос оценки качества рейтинга.

Значимость оценки качества отдельных рейтингов также обосновывается тем, что несмотря на существующие общие методологические принципы построения рейтингов на основе интегральных индексов, определенные в Руководстве *"Handbook on Constructing Composite Indicator:*

>> Рейтинг — числовой или порядковый показатель, характеризующий важность или значимость определенного объекта или явления.

Таблица 1. Сравнительная характеристика методологических аспектов индексов экономической свободы

Сравнительный параметр	Индекс экономической свободы (*Index of Economic Freedom*), Фонд «Наследие»	Индекс экономической свободы мира (*Economic Freedom of the World Index*), Институт Фрейзера
Количество компонентов в индексе	12 количественных и качественных факторов/свобод объединены в четыре основных компонента: [1] верховенство права; [2] размер правительства; [3] эффективность регулирования; [4] открытые рынки	Пять основных компонентов: [1] размер правительства; [2] правовая система и обеспечение прав собственности; [3] надежные деньги; [4] свобода международной торговли; [5] регламент
Общее число переменных	Точное число переменных не указано	44
Значимость компонентов и переменных (веса)	Равнозначны	Равнозначны
Шкала	От 0 до 100 (100 — лучший результат)	От 0 до 10 (10 — лучший результат)
Природа данных	Экспертные данные	Данные сторонних организаций

methodology and user guide" [3] (Руководство по построению композитных индикаторов: методология и руководство пользователя; далее — Руководство), единых требований к количеству и перечню показателей, включаемых в интегральные индексы (в том числе по направлениям), единой методологии взвешивания и агрегирования и даже единых единиц измерения интегральных индексов (шкалы различаются — есть от 0 до 1, есть от 1 до 100) не выработано. В Руководстве не рассматриваются никакие конкретные теоретические основы для построения интегральных индексов, предлагается только набор статистических подходов и общепринятых практик, которые могут обеспечить на должном уровне техническое качество разрабатываемого индекса.

В качестве примера разного подхода к оценке одного объекта рейтингования можно привести Индекс экономической свободы (*Index of Economic Freedom* [4]), разработанный Фондом «Наследие», и Индекс экономической свободы мира (*Economic Freedom of the World Index* [5]), представляемый Институтом Фрейзера (*табл. 1*).

Оба рейтинга, несмотря на отличие в методологии их построения (разные учитываемые показатели в построении интегрального индекса, разное их число и т.д.), имеют право на существование, и данные по ним публикуются.

Подобных примеров можно привести множество, что обусловливается многоструктурностью, многосложностью, самыми разнообразными предпосылками и факторами развития, когда количество и поименный состав индикаторов, используемых для построения сводных индексов, лежащих в основе рейтингов, не может быть идентифицирован однозначно и нет возможности прийти к полному пониманию и признанию со стороны всех теоретиков и практиков. Также можно назвать два отличающихся рейтинга в области искусственного

>> Главное назначение рейтинга — содействие расстановке субъектов в сфере деятельности по ключевым факторам успешности.

интеллекта: на базе *Global AI Index* [6] — Глобального индекса искусственного интеллекта (организация, публикующая рейтинг, — *Tortoise Media*) и на базе *AI Index* [7] — Индекса ИИ (Стэнфордский университет) [8]. В аспекте оценки гендерной проблематики на поверхности различия в рейтингах по *Gender Inequality Index* [9] — Индексу гендерного неравенства (Программа развития ООН (ПРООН)) и по *Global Gender Gap Index* [10] — Глобальному индексу гендерного разрыва (Всемирный экономический форум — ВЭФ (*World Economic Forum*)) и т.п.

Принципы аудита качества рейтингов

Наличие множественности рейтингов, увеличение их числа и разнообразия вынуждают выявлять те из них, которым может быть выражено высокое доверие.

В Руководстве, в разделе 2.1 «Профиль качества для сводных показателей», указывается, что фактически общее качество сводного показателя зависит от нескольких аспектов, связанных как с качеством исходных данных, использованных для построения индикатора, полученных национальной статистикой, так и с надежностью процедур, использованных при его построении (внутренних процессов сбора, обработки, анализа и распространения данных и метаданных).

В международной практике в целях оценки качества исходных данных, используемых для построения индикаторов, на базе которых осуществ-

ляется рейтингование, также применяют параметры, рекомендованные международными организациями (ОЭСР [11], МВФ [12], ЕСС [13] и иными, включая национальные статистические службы) в «рамочных системах измерения качества». Параметры качества данных в рамочных системах унифицированы, при этом в ряде случаев они более обобщены, а в ряде, наоборот, — более детально раскрыты.

Анализ опыта оценки качества рейтингов позволил сформулировать требования/основные характеристики, которым должны удовлетворять/отвечать рейтинги:
- практической полезности и востребованности (под конкретные задачи для пользователей);
- информационной прозрачности и легкой интерпретируемости (наличие метаданных — информации о параметрах, на основе которых разработан рейтинг; наличие комментариев);
- качества и полноты рейтинговой оценки (научная обоснованность методологии, лежащей в основе разработки рейтинга, включая процессы сбора и обработки данных);
- максимальной простоты и доступности, легкой интерпретируемости (удобный информационный ресурс рейтинга с возможностью формирования таблиц и графиков по запросам пользователей);
- соответствия реальной ситуации (ожидаемых и фактических результатов).

Перечень требований/основных характеристик, которым должны отвечать рейтинги, дает основание определить основные параметры качества интегральных индексов и рейтингов (*табл. 2*).

Единым критерием при установлении параметров качества данных определена их функция, направленная на характеристику «пригодности для использования»[1] с точки зрения потребностей пользователей.

Таблица 2. Параметры качества рейтинга

Параметр качества	Описание
Релевантность	Степень полезности и востребованности данных рейтинга, определяемая соответствием информации потребностям пользователей, пригодностью для решения конкретных задач
Информационная прозрачность	Степень доступности информации, на основе которой составлен рейтинг (наличие справочных метаданных о параметрах рейтинга, о метрологии экспертных оценок, включающей в том числе описание уровня квалификации и компетентности специалистов, участвующих в оценке)
Интерпретируемость	Наличие дополнительной информации и комментариев для эффективной интерпретации и использования рейтинга
Точность	Степень, в которой рейтинг правильно описывает состояние субъекта (страны, региона, организации), для измерения которого он разрабатывался. Мера соответствия данных рейтинга реальным статистическим и иным данным
Согласованность/связность	Степень логической связки параметров рейтинга, а также степень успешного совмещения/сведения данных рейтинга с другой информацией статистического или иного характера в широком аналитическом контексте
Полнота	Степень достаточности параметров, включенных в рейтинг, для получения качественной оценки состояния субъекта
Достоверность	Степень объективности данных рейтинга, что позволяет рассматривать рейтинг как качественно разработанный на основе научной методологии и на высоком профессиональном уровне. Мера доверия рейтингу, которая определяется с учетом репутации организации, осуществляющей разработку рейтинга, у пользователей
Доступность	Легкость, с которой пользователи могут иметь доступ к данным рейтинга и понимать его и сопутствующую информацию вне зависимости от географических, экономических, социальных, организационных или иных барьеров
Своевременность	Степень актуальности данных рейтинга, их регулярная публикация

Заключение

Популярность рейтингов на современном этапе объясняется двумя основными причинами. Во-первых, их простотой: они дают сводную оценку множества аспектов — измерений сложных многомерных явлений таким образом, чтобы облег-

References

1. *Sovetskii entsiklopedicheskii slovar'* [Soviet Encyclopedic Dictionary]. Pod red. A.M. Prokhorova, 4-e izd. Moscow, Sovetskaya entsiklopediya, 1989, 1632 p.
2. *Tekhnologii reitingov* [Rating Technologies]. Konsaltingovaya gruppa MD, available at: http://md-consulting.ru/articles/html/article19.html
3. *Handbook on Constructing Composite Indicators: Methodology and User Guide*, available at: https://www.oecd.org/sdd/42495745.pdf
4. *2023 Index of Economic Freedom*, available at: https://www.heritage.org/index/
5. *Economic Freedom*. Fraser Institute, available at: https://www.fraserinstitute.org/studies/economic-freedom
6. *The Global AI Index*. Tortoise, available at: https://www.tortoisemedia.com/intelligence/global-ai/
7. *AI Index*. Stanford University, available at: https://aiindex.stanford.edu/report/
8. Ageev A.I., Zolotareva O.A., Zolotarev V.A. Rossiya v global'nom mire iskusstvennogo intellekta: otsenka po mirovym reitingam [Russia in the Global World of Artificial Intelligence: Assessment by World Rankings]. *Ekonomicheskie strategii,* 2022, no 2(182), pp. 20–31, available at: DOI: https://doi.org/10.33917/es-2.182.2022.20-31

С учетом рейтингов формируются последующие инвестиционные решения ключевых экономических игроков.

чить их измерение и сравнение. Во-вторых, рейтинги заставляют компании, учреждения и правительства ставить под сомнение свои стандарты, что приводит к их пересмотру. Поэтому неудивительно, что за последние два десятилетия наблюдается бурный рост числа рейтингов, что закономерно определяет возникновение проблемы, связанной с оценкой качества рейтингов.

Основная сложность работы с рейтингом состоит в том, что нужно обеспечить информационную прозрачность того или иного объекта рейтингования в условиях, когда часть необходимой информации недоступна. Как следствие, это отражается на качестве рейтинга, данные которого могут не соответствовать ожиданиям. От места, занимаемого в рейтинге, зависит отношение потенциальных инвесторов, партнеров или потребителей. Иметь высокий рейтинг не просто престижно, но и экономически выгодно.

Достижение высокого качества рейтинга определяется прозрачностью, понятностью, сходимостью ожидаемых и фактических результатов. Для практиков качество рейтинга определяется публичностью (то есть информация, на основе которой построен рейтинг, имеется в открытом доступе), стабильностью (рейтинг существует более трех лет), массовостью (рейтинг охватывает не менее 100 объектов), периодичностью (публикуется ежегодно). ЭС

ПЭС 23096
Статья поступила в редакцию 11.10.2023;
принята к публикации 19.10.2023

Примечание

1. В соответствии с ГОСТ Р ИСО 9241-210-2012 под «пригодностью использования» понимают «свойство системы, продукции или услуги, при наличии которого установленный пользователь может применить продукцию в определенных условиях использования для достижения установленных целей с необходимой результативностью, эффективностью и удовлетворенностью».

Источники

1. Советский энциклопедический словарь / Под ред. А.М. Прохорова. 4-е изд. М: Советская энциклопедия, 1989. 1632 с.

2. Технологии рейтингов [Электронный ресурс]. Консалтинговая группа MD. URL: http://md-consulting.ru/articles/html/article19.html

3. Handbook on Constructing Composite Indicators: methodology and user guide [Электронный ресурс]. URL: https://www.oecd.org/sdd/42495745.pdf

4. 2023 Index of Economic Freedom [Электронный ресурс]. URL: https://www.heritage.org/index/

5. Economic Freedom [Электронный ресурс]. Fraser Institute. URL: https://www.fraserinstitute.org/studies/economic-freedom

6. The Global AI Index [Электронный ресурс]. Tortoise. URL: https://www.tortoisemedia.com/intelligence/global-ai/

7. AI Index [Электронный ресурс]. Stanford University. URL: https://aiindex.stanford.edu/report/

8. Агеев А.И., Золотарева О.А., Золотарев В.А. Россия в глобальном мире искусственного интеллекта: оценка по мировым рейтингам [Электронный ресурс] // Экономические стратегии. 2022. № 2 (182). С. 20–31. DOI: https://doi.org/10.33917/es-2.182.2022.20-31

9. Доклады о развитии человеческого потенциала [Электронный ресурс]. UNDP. URL: http://hdr.undp.org/en

10. Доклады о глобальном гендерном разрыве [Электронный ресурс]. World Economic Forum. URL: https://www.weforum.org/reports/ab6795a1-960c-42b2-b3d5-587eccda6023

11. Рамки качества статистической деятельности ОЭСР [Электронный ресурс]. OECD. URL: https://www.oecd.org/sdd/qualityframeworkforoecdstatisticalactivities.htm

12. Data Quality Assessment Framework-Generic Framework [Электронный ресурс]. IMF. URL: https://www.imf.org/external/np/sta/dsbb/2003/eng/dqaf.htm#P50_2523

13. Европейская комиссия. Евростат. Качество. Европейские стандарты качества. Кодекс практики европейской статистики [Электронный ресурс]. Eurostat. URL: https://ec.europa.eu/eurostat/web/quality/european-quality-standards/european-statistics-code-of-practice

9. *Doklady o razvitii chelovecheskogo potentsiala* [Human Development Reports]. UNDP, available at: http://hdr.undp.org/en

10. *Doklady o global'nom gendernom razryve* [Reports on the Global Gender Gap]. World Economic Forum, available at: https://www.weforum.org/reports/ab6795a1-960c-42b2-b3d5-587eccda6023

11. *Ramki kachestva statisticheskoi deyatel'nosti OESR* [OECD Statistical Quality Framework]. OECD, available at: https://www.oecd.org/sdd/qualityframeworkforoecdstatisticalactivities.htm

12. *Data Quality Assessment Framework-Generic Framework*. IMF, available at: https://www.imf.org/external/np/sta/dsbb/2003/eng/dqaf.htm#P50_2523

13. *Evropeiskaya komissiya. Evrostat. Kachestvo. Evropeiskie standarty kachestva. Kodeks praktiki evropeiskoi statistiki* [European Commission. Eurostat. Quality. European quality standards. European Statistics Code of Practice]. Eurostat, available at: https://ec.europa.eu/eurostat/web/quality/european-quality-standards/european-statistics-code-of-practice