

ЭКОНОМИЧЕСКИЕ ЗАКОНОМЕРНОСТИ, МОДЕЛИ и РЕАЛЬНОСТЬ¹

3. Модели и политические действия в экономике

П. Кругман был одним из активных экономистов, который энергично объявил о кризисе финансовой математики, условно возложив ответственность не на всю экономическую науку за мировой кризис 2007—2009 гг., а на используемые математические модели, «красота» которых была привлекательной, но содержание оказалось неубедительным.

Действительно, математическая логика и методы анализа совершенно отличаются от тех приемов, которые используют экономисты. Неслучайно Л. В. Канторович даже в своей Нобелевской лекции говорил о необходимости создания аналитических групп, включающих математиков, экономистов и отраслевых специалистов (в современном звучании — это специалисты-управленцы в конкретных областях, а также инженеры и специалисты, понимающие технику дела).

Математическая запись неких параметров, величин, формулировка отношений между ними, сразу обеспечивает внедрение математической логики в экономическую логику, потому что математика закрепляет своеобразное правило в виде формулы, тождества, создавая иллюзорное впечатление, так что это правило не может измениться. Но в жизни указанное соотношение может оказаться вовсе неверным, либо, в самом выгодном варианте, просто измениться в результате содержательной замены каких-то институтов. Это внедрение [математики] происходит незаметно, но способно повлиять на выводы и рекомендации экономистов. Формулировка выводов привязывается к математическим выражениям. К тому же экономическая наука с большим трудом «видит» и принимает фактор «управление», который в сугубо теоретических доктринах почти отсутствует, но и управление обычно слабо ориентируется на выводы, которые предлагает экономическая теория. К тому же, «управление» довольно трудно поддается математической формализации. Этот междисциплинарный разрыв в значительной степени обуславливает несовершенство экономического

анализа и порождает ограничения в части реализации тех или иных рекомендаций и выступает, на мой взгляд, объективным ограничителем создания универсальной социальной теории.

Построение эконометрической модели предполагает определенную логику, если угодно, математический алгоритм, когда и согласно которому такая модель может быть построена. Интересна позиция Я. Тинбергена на этот счет: общая тенденция состоит в том, чтобы ограничить в дальнейшем использование сложных понятий, модель необязательно должна быть сложной. Данная точка зрения очень хорошо согласуется с видением физика Л. Больцмана, который утверждал, что если модель сложнее жизни, которую описывает, то она ничего не описывает. Вместе с тем, алгоритм построения эконометрической модели обычно предполагает следующее.

1. Список переменных, которые необходимо включить в модель.
2. Уравнения и зависимости, которым должны подчиняться переменные.
3. Решение и проверка составленных уравнений.

Эмпирическая проверка и верификация любой модели является самым главным инструментом, подтверждающим ее достоверность.

Трюгве Хаавельмо проводит такую мысль: конкретные результаты наших усилий по получению количественных оценок, как оказалось, часто были тем хуже, чем более утонченные инструменты мы использовали [5].

В качестве ограничений эконометрического моделирования обычно выступают следующие позиции:

- ложная корреляция;
 - проблема идентификации: если экономическая теория хорошая, может не найтись способа квантифицировать экономические связи, исследуя информацию о состоянии экономики;
 - методы изменения экономических связей.
- «В учебных заведениях экономисты читают лекции и заняты исследованиями сложных ма-

¹ Продолжение, начало в № 5 за 2016 г.

тематических моделей конкурентной экономики, не существующей в развивающихся странах, в то время как проблемы бедности, безработицы, комплексного развития деревни, образования не вызывают у них интереса. Критерием успеха во всех видах подобной деятельности становится не вклад в развитие страны, а высокая оценка маститыми учеными в развитых странах. Часто публикации работ исследователей из развивающейся страны в международном журнале или приглашение участвовать во встрече считаются более важным делом, чем решение местной технологической, аграрной, медицинской или экологической проблемы» [4].

В качестве некой перспективы совершенствования эконометрических подходов вполне уместен будет список Дж. Форрестера — отца основателя моделей динамики мировой экономической системы:

- 1) отказ от концепции равновесия;
- 2) опора на реальные процессы хозяйственного управления;
- 3) отказ от простоты, если она противоречит реальности;
- 4) замена оптимизационного подхода принятием решений на основе неполной информации;
- 5) перенос цели математического моделирования с выбора альтернатив на улучшение экономического поведения;
- 6) моделирование микроструктуры, генерирующей макроповедение;
- 7) определение структуры модели и ее параметров непосредственно из реального экономического поведения субъектов;
- 8) верификация модели как итеративный процесс большой размерности со многими вариантами и возможностями, позволяющий легко включать новые нелинейные зависимости.

Разумеется, реализация принципов Дж. Форрестера на практике вряд ли будет способствовать «победе» универсализма, но подвинет усилия экономистов в части создания правдоподобных теорий и инструментов анализа и управления, приблизив и подчинив математические описания к тому, что наблюдается исследователем в хозяйственной жизни. Эмпирический анализ и его влияние должны быть расширены для увеличения правдоподобия экономических теорий.

При этом должна сохраняться возможность применения физически, а также биологических аналогий. Однако применение любых аналогий требует соблюдения принципа, который я осмелюсь назвать «справедливости перенесения», после чего любая модель должна подвергнуться оценке точности и верификации правдоподобия полученных результатов и применимости рекомендаций. Хотелось бы отметить, что затраты на моделирование и получение результатов не долж-

ны значительно превосходить издержек неприменения данных рекомендаций, если бы модель не была создана, а рекомендации на ее основе не были получены. Более того, если рекомендации существовали в континууме потенциальных управленческих решений и без модели, и могли быть отобраны иными способами оценки альтернатив, а модель не обеспечивает безусловного выбора именно этих вариантов, тогда ее полезность резко снижается, а затраты на разработку, которые несет исследователь, оправдываются только потенциальной возможностью совершенствования аппарата теории.

Вне всяких сомнений, государственные решения влияют на экономику. Но подавляющее большинство экономических теорий не видят этого. Например, теории циклической динамики и волновых колебаний не чувствительны к решениям. Какие бы решения и меры не принимались государством, цикл, волна все равно обнаруживается и дает возможность как будто бы прогнозировать экономические изменения. Может сложиться ощущение, что в соответствии с логикой колебаний экономических параметров будущее состояние предопределено. Вместе с тем, решения возникают в ответ на необходимость противодействия каким-то проблемам, при этом возникают и новые институты, которые также влияют на экономическую динамику. В связи с этим нельзя признать экономику предопределенной, а циклическую закономерность точно подтверждаемой. Об этом смело высказывался Н. Д. Кондратьев при подготовке своего знаменитого доклада по длинным волнам, причем профессор Е. Слуцкий и еще ряд видных российских экономистов того времени отговаривали его делать этот доклад по указанной причине. Таким образом, любые модели в экономической науке имеют ограничения и нужны исследователю только как инструмент для принятия необходимых решений, понимания закономерностей изменений в экономике, с тем, чтобы эти решения были как можно более адекватными. Нужно сказать, что принцип «2-А» — адекватности и адаптивности должен применяться относительно используемых моделей при выработке экономической политики.

4. Как «включить» поведение — новая макроэкономика?

Согласно Дж. Акерлофу и Р. Шиллеру [1], современная макроэкономическая теория хорошо описывает ситуацию в случае рациональных реакций агентов при действии экономических мотивов поведения. Однако, что касается случаев с нерациональными реакциями агентов при экономических мотивах поведения и неэкономических мотивах (при рациональных и иррациональных реакциях), а, в соответствии с имеющимися фак-

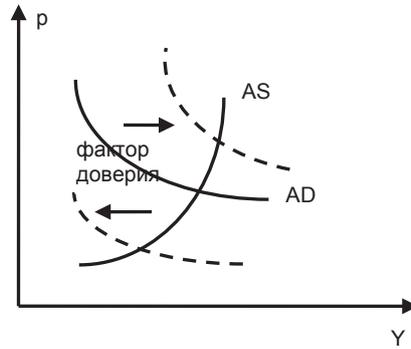


Рис. 2. Макроэкономическая «поведенческая» модель

тами жизни, именно такие модели преобладают, то классическая макроэкономика не дает убедительных ответов.

Иррациональное начало агентов, фактор доверия определяет сдвиг кривой спроса (рис. 2²).

Вместе с тем, при значимости фактора «доверие», необходимо отметить, что на сдвиг кривой спроса может влиять множество иных значимых факторов — технологические, структурные, изменения предпочтений и конкурентного замещения и др. Поэтому, когда вводится понятие «мультипликатор доверия», который показывает, как изменяется доход (увеличивается или сокращается), когда уровень доверия растет (изменяется) на один пункт, то в таком случае, можно говорить и о мультипликаторе, например, функции здоровья [3], от которой зависят реакции агентов и их вклад в ВВП, либо технологический мультипликатор и мультипликаторе объема знаний. Все эти параметры в той или иной степени могут влиять на развитие экономики, и в настоящем историческом периоде довольно существенны, пренебречь ими невозможно.

Хотелось бы отметить, что неоклассическая макроэкономика во главу угла ставила так называемую теорию естественного уровня. Макроэкономисты, которые включают в анализ проблему доверия и информационной асимметрии при принятии решений, все-таки, пусть и с некоторыми оговорками, но привязывают свои рассуждения именно к этой теории, в связи с чем, их критику неоклассики и собственные предложения по изменению макроэкономики нужно считать весьма условными и усеченными.

Так, утверждается, что теория естественного уровня стала основой макроэкономической политики, причем именно эта теория предполагает отсутствие «денежной иллюзии», что составляет центральную мысль всей макроэкономической науки. Но от этой идеи не отходят и критики неоклассической макроэкономики, в частности, Дж. Акерлоф и Р. Шиллер. Конечно, подчинение макроэкономического инструментария достижению полной занятости, когда связь рынков труда и регулирующих на этих рынках институтов и данного

инструментария слаба, выглядит неадекватно, даже если включить доверие и мультипликатор доверия в этот анализ. Меры в виде расширения дисконтного окна, прямых инвестиций в банки для насыщения экономики ликвидностью, а также смягчение ограничений в финансировании предприятий государством направлены на оживление спроса и, безусловно, не являются безупречными. Более того, существуют вопросы относительно того, насколько они в принципе необходимы и, тем более, достаточны. Мне представляется, что развертывание кризиса происходит не по неким объективным причинам, а в силу организации работы финансовых и шире — экономических институтов, которые, не изменяясь по существу, с течением некоторого времени так взаимодействуют друг с другом, что провоцируют кризис. Действенность макроэкономических мероприятий правительства будет определяться тем, на какой стадии кризиса эти меры будут применены и не являются ли меры правительства ускорителями и (или) причиной кризиса.

Интересно отметить, что ликвидация причин кризиса 2007—2009 гг. рассматривалась как борьба с кредитным дефицитом, чтобы достичь ситуации полной занятости на уровне макроэкономики. Данная логика представляется мне «линейной» и самоочевидной. А такая мера является крайне недостаточной, чтобы обеспечить управляемый выход из кризиса и предотвратить повторное его возникновение. Разумеется, необходимо ограничить спекуляцию на деривативах и других ценных бумагах, а также регулировать процесс секьюритизации. Для этого понадобится инструментализация управления финансовой системой в целом и ее корректировка. Общий завышенный и неоправданный оптимизм, который порождает спекуляция, а также разница между выдачей краткосрочных и долгосрочных кредитов (когда деньги берутся на короткий срок, а выдаются агентам на более продолжительный) обеспечили низкую эффективность базовых финансовых, банковских институтов. В итоге случилось схлопывание ликвидности для

² Рис. 1 приведен в первой части статьи в № 5 за 2016 г.

всей экономической системы. Простым сокращением налогов, ростом бюджетных расходов (эти две меры противоположны в реализации — трудно снизить налоги и одновременно увеличить расходы), а также снижением процента, хотя указанные меры не будут бесполезны, трудно быстро решить проблему изменения психологии агентов, сформировавшуюся под влиянием действующих институтов. Нужно отстранить их от возможностей, которые по существу и разрушили макроэкономическую стабильность, породив кризис. В этом видится главный стержень реформирования мировой финансовой системы, а также преобразования по образцу спекулянтов в России.

Обратим внимание, что кризис 2007—2009 гг. был связан не с тем, что агенты вывели свои капиталы («бегство» капитала), как, например, в Таиланде в 1997 г., что вызвало обвальную девальвацию. Сильной девальвации нигде и не наблюдалось. Полагаю, что налицо был обновленный кризис глобального капитализма, кризис его финансовых институтов, «съедающих» денежные ресурсы и обедняющих производственные секторы кредитом как на периферии, так и в национальных экономических системах (в меньшем объеме). Хотелось бы особо отметить, что планирование макроэкономической политики на основе гипотезы естественного уровня с привязкой кредита к необходимости обеспечения полной занятости представляется мне не вполне корректной мерой и устаревшим методом макроэкономической политики. Введение же мультипликатора доверия не дает новой теории макроэкономики, как озвучивают Дж. Акерлоф и Р. Шиллер в приведенной выше работе. Причины здесь следующие.

Во-первых, инфляция не может быть детерминирована одним фактором и только с ним так жестко связана в краткосрочном или долгосрочном периоде. Имеется в виду фактор безработицы — чем выше безработица, тем ниже инфляция, а при низкой безработице инфляция становится довольно высокой. К тому же, взаимную детерминацию, исходя из кривой Филипса, довольно трудно подтвердить, потому что явление безработицы зависит от состояния рынков труда, структурных изменений в экономике (межсекторная динамика). Иными словами, подобное соотношение есть модель, причем отклонение от этой модели наглядно продемонстрировали годы стагнации, когда инфляция и безработица были высокими. Следовательно, никакой облик кривой Филипса не подтверждается ни на коротком, ни на длинном интервале по многим экономическим системам в разные периоды их развития.

Во-вторых, помимо безработных, которые имеют своеобразную мотивацию и очень жесткие ограничения по личному доходу и уровню потребления, в экономике действуют агенты, имеющие работу, с совершенно иной моделью поведения,

проявляющие разную активность, то есть новаторы и консерваторы (разновидность консерваторы — имитаторы). Именно они, взаимодействуя, испытывая различные переходные состояния, более всего определяют процесс динамики цен, то есть инфляцию. Если это не так, то получается, что наименьшая группа агентов в совокупной своей реакции сильнее связана с инфляцией. Однако безработный никак не влияет на процесс ценообразования и даже спрос со стороны этой группы агентов весьма незначителен, чтобы обеспечивать инфляцию спроса. Тогда почему же макроэкономисты, отталкивающиеся от гипотезы естественного уровня, придают очень большое значение взаимосвязи безработицы и инфляции. Дело в том, что гипотеза естественного уровня устанавливает ту величину занятости в экономике, которая принимается в качестве приемлемой и даже необходимой величины. Эта гипотеза рождена исследователями тогда, когда рынки труда были гибкими, а индустрия более однородна и имела больший вес в создаваемом продукте. Сейчас же при технологической разнородности, негибких рынках труда, различных институциональных формах занятости, гипотеза естественного уровня явно поколеблена новыми обстоятельствами экономической жизни.

Гипотеза естественного уровня исходит из положения, что агентам не свойственна «денежная иллюзия», так что они рационально принимают решения относительно цен и инфляции, а также прочих событий. Более того, фактически устанавливается одна точка и необходимость стремления к ней как магистральное направление макроэкономической политики. Структурные характеристики экономики, необходимость приложить инструменты макроэкономической политики к достижению необходимых структурных соотношений, при такой философии макроэкономической политики, не принимаются во внимание. Равновесие экономики и наибольшая ее эффективность якобы будут достигнуты в точке полной занятости, где сохраняется некоторый уровень безработицы, но он не вносит своего вклада ни в инфляцию, ни в дефляцию, то есть, нейтрален к динамике цен, инфляционно нейтральный уровень. Считается, что в экономике рынков всегда присутствует безработица как некоторый показатель гибкости системы, развития ее не на кривой производственных возможностей, а несколько ниже, что дает возможность маневра и наращивания результата по всем направлениям, а не за счет переброски ресурсов с одного направления развития на другое. Величина же естественного уровня для каждой страны своя и с течением времени может также изменяться, например, увеличиваться. Это означает согласие или признание относительного роста числа безработных в экономике нормой. Однако интерспецификация труда,

как ресурса производства, фактически переносит экономическую систему на кривую производственных возможностей, когда замещение возможно за счет перелива этого фактора из одной сферы использования в другую.

Долгое время экономическая политика становится привязанной к этому естественному уровню, стремится привести систему к точке естественного уровня как положению наибольшей эффективности, как принято считать согласно классической теории.

Обратим внимание, что исходя из данной гипотезы естественного уровня, ничего не говорится о других факторах безработицы и инфляции, о продолжительности состояния в точке естественного уровня, о гибкости самих инструментов макроэкономической политики и их способности привести ситуацию к данному равновесию. Оценка масштаба такого явления как безработица сильно зависит от определения этого явления и метода учета, точнее, правил, по которым регистрируется безработица. Агенты, действующие согласно этим правилам и находящие способы отклонения от них или используя эти правила для получения дополнительных выгод, могут быть мотивированы в своих действиях уровнем социальной защиты и объемом правительственных социальных программ, которые влияют на решения относительно смены работы и приобретения статуса безработного. Гипотеза естественного уровня вообще не видит институциональных эффектов функционирования экономической системы.

Когда низок уровень доверия агентов, довольно трудно ожидать массированного распространения в экономике инноваций. Один и тот же агент может быть и новатором, и консерватором, и имитатором в зависимости от институциональных условий, денежно-кредитного обеспечения своей деятельности, правительственных мероприятий. Наблюдается перманентное переключение стратегии в зависимости от тех или иных условий. Доверие формируется в ходе кропотливых усилий и связано с последовательными, подтверждаемыми фактически действиями, которые приносят удовлетворение и связаны с ожидаемым результатом. В случае если ожидается одно, а делается другое, доверие быстро утрачивается, как оно исчезает при массированном оппортунизме. Оно способно демпфировать риск потери дохода в результате конкуренции, поэтому фактор доверия довольно важен в формировании экономической мотивации агентов.

Наличие в экономике новаторов, консерваторов, имитаторов, их активность в те или иные периоды, может сильно влиять на динамику цен. Это влияние может быть таким, что, в частности, рост числа новаторов и новаций будет сопровождаться увеличением цен и безработицы, а предприни-

маемые меры правительством, исходя из логики «гипотезы естественного уровня», в таком случае приведут к свертыванию указанной тенденции. Доминирование консерваторов и имитаторов может поддержать темп роста цен на каком-то стабильном уровне, однако сокращение в группе «новаторов» обернется увеличением безработицы. Как видим, соотношение между вкладом различных групп агентов в инфляцию и экономическое развитие фактически определяет и объясняет отклонение от модели кривой Филипса, когда может существовать и высокая инфляция, и высокая безработица, и относительно не увеличивающаяся инфляция при повышающейся безработице. Анализ должен быть явно многофакторным и учитывать многие аспекты названных макроэкономических явлений. Только в этом случае он и будет правдоподобным [2].

В-третьих, работодатели, представляющие собой особый тип экономических агентов, проводящих на микроуровне политику заработной платы и занятости, научились калькулировать затраты на труд таким образом, чтобы уметь снижать фактическую заработную плату, сохраняя норму прибыли, что важно им самим и собственникам. Для этого, наемному работнику назначается фиксированное жалование, оклад, и вводится целая система надбавок и премий, которая как будто привязана к результатам труда, часто и к прибыли. При развертывании кризиса в экономике, либо возникновении кризисного периода для конкретной фирмы, работодатель просто снимает эти надбавки, которые, как правило, не регулируются трудовым законодательством и на каждой фирме или в организации могут быть свои собственные. Вследствие этого фактически выплачиваемая заработная плата работника сокращается, а опротестовать подобные действия практически невозможно или очень трудно (высоки транзакционные издержки в суде). Тем самым, вроде бы эффект храповика существует, то есть цены на различные факторы производства ригидны к понижению, то есть неподатливы к снижению и при этом по фактору «труд» имеются явные возможности сокращения заработной платы (цены труда). Это является одним из факторов сокращения сбережений в периоды кризиса, причем сбережения сокращаются еще и вследствие финансовой дестабилизации, девальвации, сокращения ликвидности банковской системы и т. д.

Следовательно, наемный работник, подписывая подобный трудовой контракт, предполагающий фиксированный оклад и систему надбавок, не только не включает ожидаемую инфляцию, но де-факто и де-юре подписывает согласие на возможность дефляции стоимости своего труда.

Подводя итог, необходимо отметить, что новая поведенческая макроэкономическая теория может возникнуть не за счет включения в старые и уже неадекватные аналитические конструкции

неких психологических эффектов и обновленных параметров (типа мультипликатора доверия), а за счет фундаментальной проработки микроэкономических оснований макроэкономики с получением четкой картины изменения моделей поведения групп агентов, институтов, инструментов экономической политики, направленных на достижение устойчивых неравновесных состояний и ожидаемых изменений поведения микроэкономических агентов (иррациональное начало).

По существу, Дж. Акерлоф и Р. Шиллер делают попытку, кардинально не отклоняясь все-таки от классической макроэкономики добавить в нее поведенческий аспект, разворачивая свой прием на базе гипотезы «естественного уровня» (правда, они называют ее теорией).

Интересно отметить, что модель Манделла-Флемминга, привязывающая действенность (по влиянию на рост ВВП) фискальной и денежной политики к режиму валютного курса (при плавающем — эффективна денежная политика, при фиксированном валютном курсе — фискальная), абсолютно не учитывает эффект «вязкости» расходов, вытекающий из их структуры, влияющий на «накопительный» режим функционирования экономики, с возникающими проблемами для макрофинансов и развития. Рост денежной массы и реальных денег при плавающем валютном курсе может вообще не приводить к росту производства с постепенным возвращением понизившейся процентной ставкой, вызвавшей отток капитала и девальвацию, на прежний уровень, как в модели Манделла-Флемминга по следующим причинам.

Во-первых, отток капитала и девальвация могут оказаться значительными, так что при структуре расходов агентов, в которых преобладает доля импорта, подорожание последнего вызовет рост цен со снижением величины реальных денег в экономике.

Во-вторых, часть реальных денег может быть потрачена на фондовом рынке в зависимости от того, какой режим накопления существовал в стране на начальный момент денежной экспансии. Отток капитала может уменьшить объем сбережений, а неэффективность финансовой и банковской системы не позволит использовать имеющиеся сбережения на нужды роста производства. В таком случае налицо будет «провал» модели — она ничего не объясняет, и денежная политика при плавающем валютном курсе не будет иметь силу.

Требуется отметить, что модель действует еще и в предположении о наличии корреляционной связи между деньгами и процентом. Если денег стало больше в экономике, процент должен снижаться, однако институциональные ограничения этого процесса явно не учитываются. В России подобная взаимосвязь вообще не была очевидной продолжительное время. Фискальная же политика,

сводимая к росту государственных расходов при плавающем валютном курсе, должна быть согласно модели Манделла-Флемминга непродуктивной, не приводить к росту продукта. Логика такова: рост государственных расходов увеличит ставку процента (опять реализуется предположение ни на чем не основанное о взаимосвязи между денежной массой в экономике и процентом), что привлечет в страну капитал, обеспечив ревальвацию валюты, расширение дешевого импорта, сокращение экспорта. Ухудшение счета текущих операций обеспечит своеобразную компенсацию роста государственных расходов, потребуются меры по покрытию дефицита внешнеторгового баланса. Однако прямые вливания в экспортно ориентированные производства могут поддержать экспорт и даже не допустить его сокращения, а повышение экспортных цен и возникновение напряженности на внешних рынках будут стимулировать производителей экспортной продукции повышать качество и технико-экономические параметры продукции, улучшать обслуживание за рубежом. Цель состоит в сохранении объема продаж. Кроме того, процент может возрасти незначительно для существенного притока капитала в страну, а при отсутствии точек приложения этого капитала, он вызовет перемещение собственности на активы. Структура расходов верхних доходных квантилей может измениться, и данное изменение поглотит имеющийся прирост. При фиксированном валютном курсе, согласно Манделлу-Флеммингу, возникает обратная ситуация, когда денежная политика бессильна, а фискальная наиболее действенна. Но для данного случая возможны аналогичные аргументы, которые явным образом не учитываются в данной модели. Иными словами, невозможно для реальной экономической системы применять абстрактно полученные модели общего, можно сказать обучающего назначения.

Необходимы модели конкретно-факторного действия, увязывающие цели и задачи развития экономики с существующими ограничениями, условиями, установленными взаимосвязями выбранных параметров. Только такие модели обеспечат необходимую дифференциацию по инструментам различных видов экономической политики. Например, структура расходов в экономике, скорее всего, будет определять и темп инфляции, и темп и качество экономического развития.

Влияя на предельную и среднюю склонность к потреблению (потребительские расходы), значит и на эластичность спроса по указанным группам продуктов и услуг, возможно с помощью инструментов финансовой политики (налоговых, бюджетных, институциональных), а также денежно-кредитной политики, поддерживать не только совокупный спрос на блага национального производства (продукты и услуги), но и, находя компромисс, с

режимом сбережений, обеспечивать долгосрочные перспективы устойчивого в финансовом смысле функционирования экономики.

5. Модернизация экономики — способ управления изменениями?

Может ли экономика развиваться в режиме постоянных изменений, да еще с меняющейся скоростью? Ответ утвердительный, даже если такие изменения приводят к снижению системной эффективности, но при быстрых изменениях скорости определенные структуры и система в целом могут быть разрушены. Следовательно, модернизация может рассматриваться как способ развития, но при этом необходимо оговорить, что имеется в виду под модернизацией, и какие параметры подлежат изменению, в каком направлении и при помощи каких инструментов или воздействий.

Модернизация экономики и общества — это вне всяких сомнений системная задача. Ставя задачу именно так, безусловно, признается, де-факто, низкая системная эффективность российской общественной системы (если изменений требуют практически все общественные подсистемы одновременно, то в наличии системный кризис общества), низкая эффективность и низкий уровень жизни населения, дисфункция системы управления. Однако внесистемная постановка и отсутствие уточнения содержания такой модернизации, как и отсутствие ее плана, подрывают возможность достижения необходимых результатов, да и собственно подрывают правильность понимания содержания модернизации. Например, должна ли модернизация вернуть базовые макроэкономические параметры, приведенные к уровню 1990 г. и к какому сроку? Какой период должна охватывать модернизация, и какую структуру экономики и общества обеспечить, создать? В зависимости от ответа на эти вопросы, подлежат определению периоды или этапы модернизации, основные пропорции социально-экономической системы, которые желательны с точки зрения эффективности и долгосрочных перспектив развития государства. Все иные инструменты и мероприятия должны иметь подчиненное таким установкам и пропорциям значение.

Допустим, удельный вес инноваций в общем объеме производимого дохода невысок, скажем 0,5% или 3%, а в другой социально-экономической системе — 10%, но эти 0,5% или 3% инноваций высоко эффективны, а те 10% значительно уступают по показателю эффективности. Иными словами, на 10% требуется многократно больший ресурс, нежели на 3%, скажем в 10 раз больший, тогда речь идет о том, что в первом случае имеются интенсивные инновации, причем их объем в экономике не так велик, а во втором, экстенсивные инновации, при большем объеме в экономике. Нуж-

но ли осуществлять структурную модернизацию, чтобы, в частности, обеспечить количественно долю инноваций в 10%? А если прибыль от этих 10%, которые еще и экстенсивные, вывозится, условно говоря, в «куршавель»? В чем смысл и социальное назначение таких инноваций? Вне всяких сомнений, общественные институты, технологии, уровень развития науки, техники, инженерных школ, условия создания отечественных продуктов, исходный уровень социального неравенства и даже распределение собственности влияют на инновации. В частности, высокие налоги могут в одной системе быть своеобразным стимулятором инновационного развития, в другой — тормозить инновации. Кривая, отражающая связь налогов и инноваций, ее вид, будет определяться в целом общественным устройством, включая традиции. Ибо, если общество привыкло к тому, что государство посредством высоких налогов аккумулирует финансовые ресурсы с тем, чтобы направить их по мультиплицирующим цепочкам, стимулируя возникновение инновационных производств, как в скандинавской модели, то кривая в масштабе «уровень инноваций — налоги», где по ординате отложен уровень инноваций, а по абсциссе — налоги, будет иметь положительный наклон (напоминать кривую предложения). В обратном случае, наклон такой кривой будет отрицательным (напоминать кривую спроса). Вид этой кривой и чувствительность влияния налоговой системы на инновации и производство потребуют уточняющих исследований и учета многих факторов состояния общественной системы.

Эффективность инструментов макроэкономической политики при оценке требует учета реализации принципа Тинбергена-Тейла «цели — инструменты». Если число инструментов явно ниже числа целей, что подчеркивает нарушение принципа Тинбергена-Тейла, либо возможно достичь большего числа целей меньшим набором инструментов, например, если рост государственных расходов оказывает одновременно эффект монетизации экономики, что учитывается на уровне соответствующих макроэкономических моделей, используемых при планировании макроэкономической политики, то не факт, что цели могут быть не достигнуты, как и при выполнении принципа, можно целей не достигнуть, если содержательно инструменты не предназначены для достижения данных целей. Иными словами, речь необходимо вести о качественном наполнении мероприятий правительственной политики, причем главным условием эффективности общественного развития выступает структурная макроэкономическая политика и ее планирование, причем измерять эффективность общественного развития, видимо, стоит по каждому векторному направлению, составляющему это развитие, отдельно, поскольку

агрегирование здесь приведет либо к имманентным ошибкам интегрирования в силу потери синергизма, либо не учтет все необходимые аспекты, факторы, описывающие развитие.

В связи со сказанным, нужно также отметить, что в России существует яркая проблема постановки задачи модернизации. Актуальными становятся следующие вопросы.

1. Возможна ли модернизация за счет сырьевого комплекса страны, если учесть, что эффективность нефтегазовой отрасли постоянно снижается, а инфляция издержек становится все более регламентирующей функционирование этой отрасли, в том числе по причине технологической отсталости и отсутствия необходимого капитала? Вполне актуален вопрос: будет ли Россия сырьевой экономикой, сохранит ли контроль своих ресурсов, обеспечит ли использование ресурсной ренты на благо каждого члена общества, которые в совокупности слагают страну, или будет присваиваться отдельными агентами, применяя лексику Т. Веблена, — «праздным классом» с отдельными подачками для «подставной праздности»?

2. Насколько возможно модернизировать экономику, сохраняя задачу удвоения ВВП и какой должна быть глубина модернизации? Кроме того, насколько адекватно провозглашение задач модернизации в условиях недостатка ликвидности и финансово-экономического кризиса, является ли модернизация этапным планированием сначала преодоления кризиса и инерционных посткризисных явлений, а затем уже изменением хозяйственных пропорций и каков ее алгоритм?

3. Как возможно модернизировать экономику при неправильной постановке целей модернизации и отсутствии понимания ее содержания? Например, если структура национального богатства стран Запада такова, что 65% приходится на человеческий, 15% — на природно-ресурсный и 20% — на физический капитал, а для России все с точностью наоборот, то есть 65% — на природно-ресурсный, 20 — на физический и 15% — на человеческий капитал, то под модернизацией следует ли понимать изменение данного соотношения? Либо необходимо понимать получение такого соотношения секторов экономики в валовом продукте как $x_1 x_2 \dots x_n$, где n — число секторов, а x — желаемая доля каждого сектора в создании общественного продукта, которое отличается от существующего исходного $y_1 y_2 \dots y_n$? Либо под модернизацией следует понимать планомерную ликвидацию (выправление) структурной вилки, когда высокодоходные виды деятельности в экономике низкорискованные, а низкодоходные (все производственные секторы) высокорискованные? Тогда необходимо выстроить инструментарий экономической политики так, чтобы он позволял выправить отмеченную структурную деформацию

по секторам экономики. К тому же придется точно определить, какие производственные системы и за счет каких ресурсов (в государственном или частном секторе) подлежат восстановлению (возрождению). Усилиями частного сектора это вряд ли возможно, поэтому придется укреплять и развивать производства, а отдельные создавать именно силами государства с возможным привлечением ресурсов частного сектора.

4. Нужно ли проблеме модернизации российской экономики рассматривать как структурную задачу формирования соответствующих хозяйственных пропорций, что требует рассмотрения проектировочной задачи, использования методов планирования и подбора необходимо инструментария, воздействующего на компоненты этой и предполагаемой (желательной) структуры?

Только продвинувшись в части ответов на поставленные вопросы и поняв причины кризиса внутри самой экономической науки, можно подойти к созданию новой модели современного общественного развития, модифицируя неэффективную и изжившую себя капиталистическую форму общественного воспроизводства и социокультурного развития. Мне представляется важным отметить, что подлинное существо модернизации состоит в решении структурной задачи по компонентам национального богатства, структуре секторов и «структурной вилке» национальной экономики. Именно так должна быть поставлена задача, а ее решение предлагаться на основе методов планирования, проектирования пропорций, национализации части производств и ресурсной базы и развития эффективного и масштабного для России государственного сектора.

Иными словами, нужна не просто принципиально иная макроэкономическая политика, нужна иная макроэкономика, то есть макроэкономический анализ, который бы исходил из необходимости выправления структурных деформаций, видел бы наличие промышленности и организационных структур, связанных с ними рынков, конкретный продукт, причем не только текущего потребления, но и средства производства, которые этот продукт создают. Потребуется обуздать финансовую систему, подчинив ее задачам развития производственно-технических систем экономики, ее инфраструктуры, медицины, образования и иных социальных благ (услуг). Только так удастся получить адекватный происходящему макроэкономический анализ, преодолеть кризис мышления, рецептов и действий.

6. «Экономика классной доски»

В 1970-м году В. Леонтьев, цитируя президента эконометрического общества Ф. Х. Хана в выступлении перед Американской экономической ассоциацией, отмечал: «Достижения экономической

теории за последние два десятилетия впечатляющи и во многих отношениях великолепны. Однако нельзя отрицать, что есть что-то скандальное в спектакле, в котором множество людей занято усовершенствованием анализа экономических состояний, в отношении которых нет оснований предполагать, что они когда-либо имели или будут иметь место. Это неудовлетворительное и в какой-то степени позорное положение вещей». Мало что изменилось с тех времен. Хорошим ученым считался тот, кто решал крупные проблемы, не совершая попыток усомниться в самой системе, поскольку реализация таких попыток потребовала бы выдвинуть некие альтернативы, что не уберегло бы исследователя от нападков и обвинений относительно неудовлетворительности методологии и обоснованности. Иными словами, не ошибается тот, кто ничего не делает. Эту мысль прослеживает еще Дж. К. Гэлбрейт в работе «Экономические теории и цели общества». Но поскольку исследователю как будто не пристало ошибаться, то выбирается, как правило, режим функционирования, обеспечивающий относительное спокойствие и получение научных наград. Итогом становится то, что анализу подвержены состояния, которых никто никогда не видел, а практическая польза решения абстрактных задач в рамках «экономической теории классной доски» становится небольшой.

Финансово-экономический кризис 2007—2009 гг. снова обнажил проблему адекватности теории и шире — экономической науки. Хотя, накануне кризиса известные экономисты, такие как О. Бланшар, Б. Бернанке, говорили о «золотом веке», «эпохе умиротворенности» в экономической науке, а еще в 2003 г. Роберт Лукас заявил, что основные проблемы рецессии и депрессии, делового цикла являются решенными, и наука должна обратиться к решению задач долгосрочного экономического роста.

Экономическая наука должна объяснять реальность, предполагать последствия тех или иных действий и решений, предлагать наиболее рациональные варианты развития. Конечно, масштабные кризисы необходимо исключить, чтобы исключить и ущерб, который они доставляют человечеству, даже если для этого понадобится исправить, либо изменить базовые институты, к которым все привыкли (издержки такого исправления должны быть не выше издержек самого кризиса).

В основном речь идет о кризисе, имеющем структурную основу, то есть порождаемом соотношением, пропорцией элементов экономической системы, их взаимодействием. Он выражается в том, что сокращается качественное состояние отдельных подсистем, секторов экономики, а некоторые из них теряют прежний уровень конкурентоспособности. Конечно, другие сектора и сферы деятельности могут приобретать какие-либо вы-

годы, получать преимущественное положение, однако подобные изменения совсем не означают, что будет создана эффективная экономическая структура, обеспечивающая развитие в соответствии с необходимыми целями.

С теоретической точки зрения, наличие кризисных явлений в экономике следует воспринимать со следующих позиций.

Во-первых, какое-то число кризисов в экономике является отражением (издержками) экономического развития, по аналогии с трением скольжения в механике, обеспечивающим перемещение тел в пространстве. Эти кризисы являются выражением экономической дисфункции — непреднамеренного, либо преднамеренного снижения качества экономического развития (состояния отдельных структур и институтов). Дисфункциональность может быть и закономерной, когда она связана с тем, что подходит к завершению жизненный цикл системы менее эффективной по сравнению со вновь появляющимися. Следовательно, кризисное явление может иметь помимо отрицательного и положительное значение. Экономическая система многоэлементна, поэтому точно предсказать результат постоянного взаимодействия этих элементов практически невозможно. В этой связи можно констатировать, что кризис возникает случайно, причем случайность выступает частным случаем закономерности, характеризующей экономическую эволюцию.

Во-вторых, в экономике происходят кризисы-катастрофы. Это в основном кризисные явления, поражающие целиком экономическую систему и приводящие к значительным социальным потерям (высокой безработице, гиперинфляции, сокращению сбережений, разрушению инновационного потенциала страны, спаду производства, нарушению режима воспроизводства основного капитала, обесценению интеллектуальной и других видов собственности, сокращению потенциала финансовой, банковской сферы и т. д.).

Кризисные явления в экономике могут охватывать отдельные, но взаимосвязанные сферы — конвергентные кризисы. В этом случае изменению подвергнуты параметры, характеризующие развитие конкретной сферы, отрасли экономики. В результате эти кризисы способны усиливать друг друга, превращаться в так называемый системный кризис, охватывающий экономику в целом, что выражается в соответствующем изменении макроэкономических агрегатов. Конвергентные кризисы могут существовать, не привлекая внимания, то есть их присутствие в экономике выражается в снижении качества отдельных подсистем без существенного влияния на макроэкономические показатели.

Интересен тот факт, что кризисы, природа которых заключается в принятых решениях, в от-

личие от «генетических кризисов» (порожденных логикой функционирования экономики), являются полной неожиданностью для экономических властей. В частности, дефолт 1998 г., обвал на валютном рынке 2014 г. представляют примеры таких кризисов. К такому роду кризисов относится кризис системы в ходе реализации мероприятий по ее реформированию. Это происходит в том случае, если не продумана целесообразность, глубина реформирования и отсутствуют ресурсы на осуществление необходимых мер и доведения управленческих воздействий до их логического завершения. В России 2007—2009 гг. наблюдалась как раз ситуация, связанная с тем, что значительное число конвергентных кризисов совпали с мировым финансовым кризисом.

Деформация экономических пропорций является важным условием кризиса. Например, структура национального богатства, доходов (неравенство), собственности, государственного и частного секторов экономики и др. На заработную плату в структуре доходов в странах Запада приходится примерно 70%, в России — 5—15% (по разным оценкам). При этом основная часть налогов берется из расчета по заработной плате. Производительность труда в расчете на 1 долл. заработной платы в России в 3 раза выше, чем в США. Однако повышение заработной платы вне связи с производительностью будет ожидаемым и воспримется закономерным без серьезного эффекта в области стимулирования труда и трудовой отдачи. Различные «структурные маневры» правительства, осуществляемые без воздействия на макропропорции, будут иметь лишь перераспределительный характер. Так, социальная реформа, предполагающая монетизацию льгот, привела к ликвидации ряда фундаментальных льгот для одних граждан (льготы были ими заработаны), а экономию от этого государство направит на выплату надбавок участникам войны, студентам, то есть компенсации другим гражданам, причем эти группы при локализованном рассмотрении могут и совпадать. Такая политика имеет заведомо транзакционное назначение и не затрагивает структурных пропорций экономики.

Любой кризис является социальным явлением, выражается в конкретных реакциях различных агентов, правительственных мероприятиях, которые призваны этот кризис преодолеть, сделать как можно менее продолжительным. А почему экономическая наука не дает рецептов, которые бы способствовали тому, чтобы эти кризисы исключить? В частности в СССР не было никаких кризисов, что, например, с восхищением отмечали экономисты Сидней и Беатрис Вебб после посещения СССР в 1930-е годы.

Имеется ли польза от кризиса и зачем человеческому обществу нужны кризисы? В частности, Йозеф Шумпетер говорил о пользе экономической

депрессии, так как экономика приспосабливается тем самым к изменениям. Но к каким изменениям? Продуктивны ли они, насколько полезны для экономических агентов и насколько экономика все-таки приспосабливается? Если нечем измерять приспособление, а Шумпетер точно ничем ничего не измерял, тогда, как можно говорить о его наличии? А как быть с сотнями тысяч пострадавших в ходе кризисов, с войнами, которые были следствием этих кризисов и уносили жизни уже миллионов людей. Да и современные мировые финансовые кризисы и в 1997—1998 гг., и в 2007—2009 гг. показали, что пострадать могут сбережения сотен миллионов людей на планете. Как же возможно говорить о пользе кризиса, когда миллионы людей не доедают, живут за чертой бедности, страдают от болезней и не имеют шансов получить образование и медицинскую помощь?

Однако всю ответственность за кризисы не следует возлагать на экономическую науку, упрекать ее в том, что она оказалась бессильной в предсказании кризиса или навешивать ярлыки какой-то одной экономической школе, которая имела сильные позиции долгие годы в правительственных кругах.

Следует обратиться к институтам, включая и институты организации самой науки, которые позволили пренебречь иными точками зрения и иными предложениями и предостережениями, а также учесть результаты структурной динамики экономической системы. Удивительно, но остается фактом, что современные критики, обладая нобелевской премией по экономике, полагают, что они правы, но остаются в стереотипных представлениях о развитии экономической науки, поскольку замена доминирования одной экономической школы другой ничего не способна изменить по существу (речь идет о критике П. Кругмана). И фискальное стимулирование в рамках кейнсианских программ — это старый рецепт экономической политики. Главный же вопрос, с моей точки зрения, должен состоять в том, почему растущая сложность экономической системы, ввергающая ее в кризисы, оставляет неизменной сложность правительственных мероприятий и инструментов, не предполагая более дифференцированные методы воздействия и управления экономикой. Дело не в том, что интегральные эффекты правительственных мероприятий трудно учитывать и оценивать, а действия различных ведомств накладываются друг на друга с неясным усилением или ослаблением. Проблема состоит в том, что скорость развития экономики приобрела такую величину, что наука не успевает оценивать как саму эту скорость, так и изменение закономерностей с ней связанных. Как известно, Р. Лукас назвал антикризисный план американского президента Б. Обамы «халтурной экономикой». Причина в том, что вывод из кризиса, согласно этому плану, осуществляется

за счет кейнсианских рецептов, которые сейчас реанимируются после эпохи главенства неоллиберализма и монетаризма, но которые не способны ликвидировать долговую природу современной экономики. Выход из кризиса уже плавно происходит за счет дальнейшего возрастания долговой экономики. Таким образом, имеем парадоксальную ситуацию, когда долговая экономика обеспечила эффект «схлопывания ликвидности», по существу породив кризис, а преодоление кризиса сопряжено с дальнейшим развитием долговой экономики за счет применения методов финансового стимулирования и поддержки совокупного спроса.

Неравномерное развитие техники и технологий создает структурную основу для кризисов, но сначала возникает диспропорция в развитии финансового сектора, который приобрел начиная с конца 1980-х годов самодовлеющее влияние на мировую систему. Таким образом, кризис может быть порожден сугубо дестабилизацией сферы финансов и банков, которая предоставлена самой себе, либо быть сгенерирован в области структурных диспропорций и изменений в технике и технологиях. Нужно отметить, что создание современной техники предполагает иную логику, чем линейное заимствование ресурса у старых комбинаций. Скорее всего, это логика высокой моды, интерспецифического ресурса, секретных разработок. Изобретательство, научная работа, осуществляемые также в условиях «старых» средств производства, тем не менее, могут давать новые комбинации. Вопрос относительно того, насколько вообще возможно, используя «старые» ресурсы создавать новые комбинации и не понадобятся ли для этого «новые» ресурсы, имеет ответ в рамках логики совершенствования и развития техники. Ответ определяется постановкой задачи, уровнем проектной ситуации. Если речь ведется об освоении космоса, то здесь понадобились и новые комбинации средств производства, и новые комбинации интеллекта и даже управленческих решений. В начальной точке этого проекта наука дала точный ответ, что ресурсов для решения такой задачи — достаточно, но нужны принципиально новые виды ресурсов и они были созданы.

В условиях современного кризиса экономики наблюдается эффект «исчезновения» финансов, в итоге происходит свертывание заказов в промышленности и других секторах. В результате, фирмы, свертывая одни технические направления работы, могут «пробовать» освоение других технических направлений. При этом никакой переброски ресурсов не происходит, просто останавливаются одни работы и заказы, сокращается персонал, но возникают какие-то новые заказы, на новых рынках, при сокращении занятых и объемах выпуска. Эти случаи нарушают принцип «созидательного разрушения». Институциональные ограничения

начинают играть все более важную роль при рассмотрении структурных проблем экономики, детерминируют межсекторный перелив ресурсов. Именно институты дают примеры отклонений от принципа «созидательного разрушения» или, по крайней мере, приводят к необходимости его модификации и добавления принципа «комбинаторного наращения», который в большей степени адекватен при рассмотрении проблемы развития современной техники и технологий. Нужно отметить, что появление новых заказов в условиях нижней точки цикла по большому счету не может переломить инерцию спада, так что выход из кризиса обусловлен, скорее, действиями консерваторов — имитаторов, нежели сугубо новаторов (критической массы новаторов, обеспечивающей подъем экономики благодаря своей активности, как правило, не наблюдается).

Однако хотелось бы отметить, что проблема не так проста и отнюдь не касается исключительно фискального некейнсианского рецепта стимулирования экономики в период депрессии, что предлагает Пол Кругман [6]. Подлинное содержание проблемы не просто в учете эффектов иррационального поведения агентов на рынке, их стадного поведения, паники и доверия, а также оптимистических ожиданий, провоцирующих эффект расточительства, что затем сопровождается истощением ликвидности, то есть не только и не столько в имманентной нестабильности финансовых рынков и необходимости включить финансовый сектор в макроэкономические модели, а в том, чтобы понять эффективность развития различных секторов экономики, соотношений скоростей этого развития и их взаимовлияния. Существо проблемы в отрыве и отсутствии убедительных теоретических объяснений и вытекающих практических рекомендаций по ликвидации «разрывов» межсекторного экономического развития. Иными словами, необходим ответ на вопрос, какой размер финансового и обрабатывающего секторов, а также сектора услуг наиболее целесообразен и возможен для данной экономической системы?

Справедливости ради отметим, что французские регуляционисты использовали метод структурного анализа для изучения проблемы кризиса капиталистической системы и задевают межсекторную постановку проблемы, хотя и не отвечают на указанный вопрос. Еще Х. Ф. Мински выделил пять фаз финансово-экономического кризиса (рентабельная инновация, бум, эйфория, рост рисков и паника — кризис), делая при этом особый акцент на выборе между производственными и финансовыми инвестициями. Нужно отметить, что это типичный жизненный цикл инвестиций, по которому сначала растут инвестиции в силу «желания инноваций» (в нижней точке признается их позитивная роль, с чем трудно согласиться),

этот рост приводит к росту потребности в деньгах и повышает ставку процента, с которым дожимается рынок по прибыли с ростом рисков, которые достигая пика создают панику (кризис). Однако в такой схеме-модели развития финансового-экономического кризиса допущением становится нижняя точка и роль инноваций в ней, а также рост инвестиций с последующим ростом процента, без учета обратного блокирующего эффекта, который может возникнуть в той или иной экономической системе. Эта схема, к сожалению, также вписывается в общие рамки неоклассических объяснений.

Ключевая же идея Дж. М. Кейнса о том, что полное развитие финансовых систем делает еще менее вероятным саморегулирование рыночных экономик, с одной стороны, позволяет справедливо усомниться в неоклассических рецептах преодоления кризиса, с другой стороны, все-таки

не позволяет получить точного ответа о причинах, прогнозах и масштабе возникающих финансово-экономических потрясений. Можно задаться вопросом: а должна ли в принципе экономическая наука давать ответ на подобные вопросы?

Полагаю, что ответ требуется дать утвердительный, поскольку иначе трудно оправдать существование большого числа исследователей, создающих некий совокупный интеллектуальный продукт, который не способен снизить, либо устранить дестабилизаторы экономики, социальные последствия кризиса. Экономическая наука должна не только помогать выявлять какие-то закономерности в поведении различных агентов и подсистем экономики, но и помогать обосновывать и принимать необходимые решения, во всяком случае, способствовать возникновению более ясной картины в области управления.

(продолжение следует)

Олег СУХАРЕВ,

доктор экономических наук, профессор,
заведующий сектором ИЭ РАН

ЛИТЕРАТУРА

1. Акерлоф Дж., Шиллер Р. Spiritus Animalis или как человеческая психология управляет экономикой и почему это важно для мирового капитализма. — М.: ООО «Юнайтед Пресс», 2010.
2. Сухарев О. С. Институциональная теория и экономическая политика. В 2-х т. — М.: Экономика, 2007.
3. Сухарев О. С. Теория эффективности экономики. — М.: Финансы и статистика, 2009.
4. Тодаро М. Экономическое развитие. — М: МГУ, ЮНИТИ, 1997. — С 353.
5. Haavelmo T. The Role of Econometrician in the Advancement of the Economic Theory / *Econometrica*. 1958. № 3.
6. Krugman P. How Did Economists Get It So Wrong? // *The New York Times*. 2009. Sept. 2. P. 3—8.