

**БЕЛОРУССКИЙ ГОСУДАРСТВЕННЫЙ УНИВЕРСИТЕТ
ЭКОНОМИЧЕСКИЙ ФАКУЛЬТЕТ**

**МЕТОДОЛОГИЯ ЭКОНОМИЧЕСКОЙ НАУКИ,
ИЛИ КАК ПОЗНАТЬ МИР-ЭКОНОМИКУ**

Сборник статей

МИНСК, 2013

УДК ____
ББК _____

Авторы: П.С. Лемешенко (предисловие, гл. 1), В.Н. Авсянский (гл. 2),
и т. д.

Рецензенты: доктор экономических наук, профессор кафедры менеджмента БГУ В. Ф. Байнев;

доктор экономических наук, профессор кафедры экономики предприятий Академии управления при Президенте Республики Беларусь С. А. Пелих

Методология экономической науки, Или как познать современную мир-экономику / научн. рук. П. С. Лемешенко. – Минск: Четыре четверти, 2013 - ____ с.

ISBN

Издание содержит материалы обсуждения и дискуссий, проходивших на теоретических семинарах по актуальным проблемам гносеологических возможностей современной экономической науки, существующих парадигм, возникающих мифов и догм, проявляющихся в процессе исследования хозяйственной практики.

Статьи данного сборника подготовлены коллективом молодых и начинающих экономистов отделения экономической теории экономического факультета БГУ.

Издание может быть полезно широкому кругу читателей, интересующихся не просто результатами исследования, но и проявляющим интерес к самому процессу изучения устройства экономической системы, ее функционирования и развития.

Печатается в авторской редакции.

УДК ____
ББК _____

ISBN ____-____-____-____-____-____
2013

© Экономический факультет БГУ,

© Оформление. Издательский Дом

«__», 2013

ОГЛАВЛЕНИЕ

Предисловие.....	5
------------------	---

РАЗДЕЛ 1.

Новые тенденции эволюции в современной экономической науке

<i>Лемещенко П. С.</i> Мировая экономическая наука и хозяйственная практика в XXI веке.....	
<i>Авсянский В.</i> Методологические основы теории кризиса.....	
<i>Курьянович Е.</i> Методологические основы глобализации в развитии мировой экономики.....	
<i>Козловская Е.</i> Исторические предпосылки становления концепции человеческого капитала	
<i>Суцинский А.</i> Политическая экономия капитала.....	

РАЗДЕЛ 2.

Методология и инструменты исследования институциональной теории

<i>Коноплицкая Е.</i> Теория транзакционных издержек и институциональных изменений Дугласа Норта.....	
<i>Лиштван А.</i> Доверие как феномен социально-экономической реальности.....	
<i>Мартиневская К.</i> Фактор власти в экономике.....	
<i>Цеханович А.</i> Экономическая теория катастроф.....	
<i>Шипилова К.</i> Теория общественного выбора.....	
<i>Романовский А.</i> Анализ модели человеческого капитала.....	
<i>Моисеев М.</i> Поведенческая экономика: теория ограниченной рациональности Герберта Саймона.....	

РАЗДЕЛ 3.

Неоклассические традиции, макроэкономика и экономический анализ

Ременчук Е.

Разработка, развитие и практическая значимость моделей макроэкономического равновесия.....

Судник С. Модель IS-LM как одно из важнейших достижений для объяснения экономической действительности.....

Шилович Л.

Неоклассическая модель экономического роста Р. Солоу.....

Солянская И.

Общее и особенное в подходах к изучению общего экономического равновесия.....

Шабанова М.

Сравнительный анализ теорий кривых Филлипса.....

Лазаревич Н.

Теории международной интеграции.....

Бельзевская А.

Модель определения стоимости капитала предприятия.....

ПРЕДИСЛОВИЕ

...Людзям заўсёды патрабавалася шмат часу дзеля таго, каб здзейсніць што-коледы значнае. Мы бачым, што заканадаўцамі, якія далі доўгае жыццё сваім творам, былі якраз тыя, хто меў сабе на мэце дабрабыт народа і хто лепш за ўсё спасцігаў народную мудрасць і з яе дапамогай практычна кіраваў заканадаўчай дзейнасцю сваіх урадаў.

С. М. Аскерка, саветнік караля Прусакага Фрыдрыха II, ураджэнец Наваградка, які вучыўся ў Слуцку. 1760 г.

Люди, относящиеся с полным презрением к теории, тем не менее, не колеблясь, извлекают из нее постоянные выгоды.

А. Пуанкаре

Кризисные ситуации значительно усиливают востребованность экономической науки. По крайней мере, на стадии не разрушения, а на стадии действительного желания и уже объективной необходимости сформировать новую более эффективную систему хозяйствования. Это с одной стороны. С другой – с очевидностью высвечивают недостатки и противоречивость теоретических разработок, логические парадоксы, которые ранее почему-то не замечались. Это можно проиллюстрировать как на примере истории эволюции западной экономической науки, так и судьбы политической экономии социализма. Критические вехи реальной мировой экономической истории с очевидностью убеждает, что выйти из этих острых кризисных ситуаций можно только выработав новую идею. А последняя возможна лишь тогда, *когда люди понимают как происходит процесс выработки и получения приращенного, нового знания.*

Однако при мнимой или действительной востребованности теоретических разработок, упускается из вида то обстоятельство, что экономическая наука представляет собой специфическую форму сознания и имеет особенности *«производства продукта», оценки его потребительских свойств, алгоритм использования, свою траекторию и циклы развития.* Здесь важные проблемы чередуются с лжепроблемами, а перспективные идеи с мифами, выверенные законы с догмами. И отделить зерна от плевел достаточно непросто. Инвентаризация же идей и полная рефлексия теории осуществляются крайне редко. Чем глубже и обширнее перемены затрагивают пласты общественных и экономических отношений, условий хозяйствования, тем более радикальный пересмотр требуется в структуре научного экономического знания, доходящий до парадигмального основания теории. Впервые как гром среди ясного неба прозвучало откровение

высшего партийного руководства СССР в начале 80-х годов прошлого века, когда было сделано заявление о том, что «мы не знаем того общества, в котором мы живем», после чего начался поиск новой идеи необходимости обновления социализма на новой политико-экономической платформе.

Современный уровень мирового социально-экономического развития представляет собой противоречивый итог как *научно освоенных действий* хозяйствующих субъектов, так и *стихийного начала* функционирования сложной многоуровневой политико-экономической системы. Анализ теории и хозяйственной практики как *единого целого* позволяет заключить, что между ними образовалась *устойчивая дихотомия*, в результате чего экономическая наука теряет присущие ей свойства, а хозяйственные процессы приобретают неустойчивый и управляемый характер.

Острота дискуссий *после системных преобразований* вновь приобретает особую актуальность, поскольку так называемый *переходный период* затянулся на неопределенный срок, а его результаты оказались крайне скромными по сравнению с ожиданиями абсолютного большинства населения постсоциалистических государств. Рубеж нового века представляет кроме всего прочего именно такую ситуацию, когда накопленная критическая масса практических и теоретических изменений, предполагает не только активизацию исследовательской работы с ее легкой модификацией, но активное формирование новой более плодотворной теории о современной хозяйственной деятельности с ее сложной полицентричной, многополярной и динамичной направленностью, приобретшей к тому же нелинейный, дискретный, неопределенный и неустойчивый характер.

Внимание к экономической науке со стороны политиков, практиков крайне неустойчиво: в благоприятные периоды ее забывают, но востребованность ее разработок значительно усиливается во времена экономических кризисов и других тяжелых проявлений социально-экономического развития. Причем требуется, чтобы научный анализ, обобщения, выводы, оценки и рекомендации были сделаны в оперативном режиме, отвечая на запросы современности. Однако при этом забывается то весьма важное обстоятельство, что экономическая наука как специфическая форма сознания и деятельности имеет собственную траекторию развития со своими взлетами и падениями, истинными и ложными проблемами, перспективными идеями и мифами, своими циклами в эволюции категориального аппарата, адекватным инструментарием анализа. «Семена науки, — говорил Дж. Бернал, — не всходят и не растут, пока общественная почва не будет подготовлена для них экономической деятельностью»¹. Особенно это важно для гуманитарного знания, среди которого экономическое занимает весьма значимое, если не сказать определяющее место. Последнее обстоятельство связано прежде всего с теми

¹ Бернал Дж. Наука в истории общества. М., 1956, с. 662.

функциями, которые возлагаются на экономическую науку в силу ее особенных свойств.

Кроме традиционных эвристических задач экономическая наука оказывает огромное влияние на разнообразную реальную действительность, как через политико-экономические институты, так и через ту информацию, которую впитывают хозяйствующие агенты, политики, простые потребители и которой они руководствуются в своем поведении и при принятии решений. Но дело в том, что прошлое знание, которое возможно ранее и было верным, в силу естественного, иногда крайне стремительного развития событий теряет свою значимость по элементарной причине несоответствия с реальностью. Заметить же это несоответствие с точки зрения обычной информации в новой ситуации бывает крайне трудно. К сожалению, как показывает история науки и самой хозяйственной практики, этот пересмотр, как на общественном, так и на индивидуальном уровне происходит тяжело и противоречиво под весьма жестким давлением обстоятельств, называемых экономическими кризисами, потрясениями или перестройками. И тогда трагедии судеб отдельных людей, обусловленные необходимостью пересмотра ими своих мировоззренческих позиций, формируют лишь определенный этап экономического цикла с его сухими экономическими показателями. Но если материальной основой цикла является обновление стержневого элемента в условиях воспроизводства (например, основного капитала на стадии развития промышленного капитала), то смена парадигм экономической науки выступает основой преодоления цикла теоретического. Безусловно, его преодоление очень специфическое, что вполне объяснимо особенностью этой сферы деятельности. Надо отметить, что выход на новую траекторию познания социально-экономической действительности происходит более противоречиво и болезненно, чем, например, выход из реального экономического цикла. Одна из причин этого положения — отсутствие в экономической науке такой традиции, алгоритма познания, как саморефлексия процесса познания и научных выводов.

Мир науки, в данном случае экономической, будет отвечать своему названию и назначению, лишь при соответствии в той или иной мере миру реальному, экономическому. Мера их несоответствия отражает степень погрешности человеческого знания. Полной же идентичности, на наш взгляд, быть не может по простой причине динамичности, как практики, так и теории экономики. Но важно было бы для самоуверенного «экономического человека», создавшего своим неадекватным для природы и общества хозяйствованием немалое количество уже признанных и еще только намечаемых проблем, видеть и осознавать *относительность* своего знания и прогнозировать гносеологическую погрешность. Речь в данном случае можно вести о *метатеории экономической науки*, поскольку последние накопила уже достаточный критический материал для своего осмысления. Но возможность выявления общих закономерностей науки, процесса получения не фрагментарного, а *целостного системного знания* (!) возможна лишь на междисциплинарном стыке различных других наук, включая и

естественные, технические, политические и пр. И хотя шаги к этому делаются, однако проблема обобщения выводов частных направлений, царящих в экономической теории, в целостное знание далеко не проста как, может это показаться на первый взгляд.

Чтобы преодолеть «дефект знания», возникший в экономической науке где-то к середине 80-х гг. XX в., требуется не только выявление и глубокое осознание существующих в ней самой проблем, но и понимание феномена науки в целом, ее места и значения в противоречивом процессе познания. В этом смысле необходимо, как это делалось и ранее в критические для истории и науки времена, приблизить экономическую теорию к философии. К сожалению, последняя констатирует крайне слабую методологическую и гносеологическую разрешимость. Но обращение к философии экономики, к инструментарию теоретического анализа, уже зафиксировавшим себя в процессе теоретического познания, позволяют выявить тот дискурс, который может стать в основе следующего нового направления экономической мысли. И хотя его признание, отработка в непосредственном практическом использовании научных исследований является делом непростым и длительным, все же это лучше, чем находиться в плену созданных иллюзий и абстракций, лишенных сколько-нибудь значимого теоретического и практического смысла. «История экономической мысли полна подобных примеров, — пишет М. Блауг, — и ничего не добиться, коллекционируя плоские обобщения о взаимосвязи между ценностными суждениями отдельных экономистов и качеством их теоретической работы. Пропаганда и идеология присутствуют всегда, но ... экономическая наука всегда цепляется за предрассудки вчерашнего дня»¹.

Конечно, прогресс в экономической науке есть. Но, во-первых, его признание еще не носит массового характера, поскольку «mainstream» теории пронизан философией и инструментарием позитивистского утилитаризма. Во-вторых, это признание часто принимается в имплицитной форме. В-третьих, вековая история эволюции экономической науки не принесла значимых изменений в фундаментальных идеях и теориях². В-четвертых, полное проникновение новых исследовательских программ возможно тогда, когда каждая система категорий, понятий, законов, моделей и схем найдет свое место в идеально отраженном мире реальной картины сложившейся на сегодняшний день целостной и сложной системы «мир-экономики». Полицентричный и динамичный экономический мир, полагаем, нуждается в таком же многостороннем подходе, контуры которого уже имеют явные очертания с тем продуктивным приростом нового знания, в котором сегодня нуждаются все — от правящих миром и национальными государствами элит до рядовых обывателей. Сегодня гораздо лучше и выгоднее

¹ Блауг М. Экономическая мысль в ретроспективе. М., 1994, с. 5.

² Баумоль У. Чего не знал А. Маршалл: вклад XX столетия в экономическую теорию // Вопросы экономики. 2001, № 2, с. 73-107.

знать, *что надо и возможно* знать, где получить это новое знание, нежели только догадываться о его существовании. Поэтому и начинающим, и более зрелым исследователям надо не только помнить об этом, но и реально использовать, чтобы обеспечить хотя бы небольшой «прирост» знания о том сложном мире, в котором мы сегодня живем. Думается, первые шаги начинающих теоретиков, которые делают первые шаги в исследовательский мир, будут полезны не только им самим, но и другим, понимающим под наукой не некий конечный результат, а процесс активного и постоянного освоения действительности.

*Доктор экономических наук, профессор,
заведующий кафедрой теоретической и институциональной экономики
П. С. Лемещенко*

П. С. ЛЕМЕЩЕНКО

Мировая экономическая наука и хозяйственная практика в XXI веке

Сегодня нет ни одной страны, которая бы серьезно не задумывалась над своим будущим. Поиски выхода из сложившихся больших и малых проблем осуществляются в различных направлениях. При кажущемся многообразии все их можно объединить в две большие группы: первую, лежащую в плоскости национальных факторов разрешения проблем, и вторую — на международном уровне. Причем внешние условия практически для всех государств являются предопределяющими. Никто не станет отрицать регулятивных действий различных международных организаций, влияющих на внутреннюю национальную экономическую политику, валютных курсов и пр. Таким образом, правильное понимание мировых тенденций социально-экономического развития, верная оценка своего места в сложившемся «мировом экономическом порядке» дает возможность выбрать и правильный ориентир в национальной экономической политике, определив как стратегию, так и тактику решения глобальных и частных задач.

Дать объективную, полную и всеохватывающую оценку мировой экономики — дело архиважное и сверхсложное, поскольку это требует использования всевозможных количественных и качественных показателей. Но фактом остается то (!), что только те страны, которые доверившись ученым с их реальной оценкой объективных мировых политико-экономических тенденций, смогут быть впереди с реальными внутринациональными успехами.

В объективной оценке мировых очень разных и противоречивых процессов существует и гносеологическая проблема. Всегда есть опасность подходить к мировым процессам с позиций ученого-исследователя, проживающего в той либо иной стране, т.е. существует так называемый региональный, страновой ограничитель, барьер. Кроме того, в анализе мировых событий преобладает оптимистический или пессимистический подходы, когда успехи/неуспехи одних стран распространяются на все остальные страны. Это делается хотя и не правильно, если следовать главной задаче науки — эвристической, но не всегда искренне, находясь под влиянием определенных интересов и сил давления. Иначе говоря, конкуренция в умах сегодня предшествует конкуренции реальной. Право на такую конкуренцию имеют далеко не все участники, формирующие образ и институции поведения современной экономики.

Дело в том, что параметры поведения, нормы и образы морали и экономической эффективности, принципы распределения и пр. вначале задает наука в целом и экономическая в частности, имеющая во все времена мощный идеологический импульс влияния. Последняя, например, своими теориями и «теориями» определяет рамки и *содержание экономического мышления*, а, следовательно, и поведения. Она, как правило, сохраняя прежние эвристические

традиции, всегда новыми идеями и теориями находила более эффективные пути разрешения сложившихся проблем. Но она может очередной «моделью», «теорией» создать очередную финансовую пирамиду, спровоцировав «научными прогнозами» о росте рисков кризис. А в кризисе, как известно, одни проигрывают, и их большинство, а другие выигрывают. И их меньшинство. Сегодня так «работает» мировая экономика. Как отмечает Нобелевский лауреат М. Алле, теория международной торговли, которую навязывают сторонники либеральной либерализации, лжива и не выдерживает научной критики¹. Но этого не замечают не только руководители, регулирующие международные отношения, но и те, которые механически транслируют учебные пособия по мировой экономике.

Итак, аспект теоретического освоения всех старых и новых проблем, как мы уже убедились, выходит на первое место. Именно с него может получить старт новый этап в истории мировой экономики и национальных государств. Метод проб и ошибок должен уйти в историю. Но предварительно, под углом зрения мировых тенденций выясним, *что и как* влияет на изменения в экономической науке.

Во-первых, критически оценивая прошлое и заглядывая в будущее, нельзя не отметить того, что конечным итогом всего мирового исторического развития явилось обсуждение на заседании «Римского клуба» в 1968 г. всего комплекса накопившихся к этому времени острейших противоречий, которые в последующем стали обсуждаться как глобальные проблемы. Начатое здесь и стремительно продолженное в последующем их всестороннее изучение полностью подтвердило, по сути дела, крах технократического мышления и таким образом завершился триумф индустриализма. Обнаружилась тупиковая ситуация, поскольку рухнула предпосылка, на которой основывалась технологическая экспансия — представление о неисчерпаемости природных ресурсов и безграничных возможностях природы к восстановлению нарушенного общего равновесия. В свою очередь возникшее несколько ранее противоречие в так называемой «чистой экономической науке» также проявило себя в полной мере, выразившись в устранении жесткой детерминированности таких факторов производства, как «техника — человек» и смене приоритетов в сфере мотивации его общественно-трудовой деятельности.

Глобальные проблемы, с которыми столкнулось человечество, называют иногда «кризисным синдромом всемирного развития», подразумевая при этом целое множество таких беспрецедентных кризисов, как экономический, энергетический, продовольственный, демографический, сырьевой, экологический и даже социально-психологический. То есть, говоря словами О. Тоффлера, это кризис не капиталистический или социалистический, а индустриально-технократический, в котором весьма настойчиво ставится под сомнение необходимость существования традиционной основы общества с его целями, стремлением к экономическому

¹ Allais M. L'Union europeene, la mondialisation et le cho mage // Rev. des Sciences morale et polit. P., 1998, N 2. S. 65-66.

росту, культурой, моралью, устоявшимися экономическими принципами, традициями, научными критериями. Главная особенность текущего момента в том, что эти фундаментальные проблемы с поразительной остротой обнажили все сразу и одновременно. Даже З. Бжезинского, который всегда свято верил в гибель коммунизма и неизбежность западноевропейской цивилизации со всеми ее основами и атрибутами, происходящее в мире, дополненное стремительными событиями в Восточной Европе, привело в смятение и состояние большой неуверенности перед будущим¹.

Признание «всеобщего кризиса» экономической наукой в целом дает возможность не оказаться снова безоружным и беззащитно растерянным перед лицом совершенно новой цивилизации в широком смысле этого слова и требует построения, по мнению таких научных авторитетов, как Дж. Нэсбит и Ё. Масуда, абсолютно новой научной парадигмы, свободной от традиционных концепций и конструкций¹.

Для экономистов постсоциалистических стран расширение угла зрения наверняка подтолкнуло бы к отказу, как от старых, так и уже приобретенных догм, которые ни на йоту не продвигают освоение научной истины изменяющейся нашей действительности, а, скорее, уведут в сторону от нее или просто запутывают даже несложные для понимания вопросы. Ведь довольно явственно в массовом масштабе проявляется тот же общепризнанный научный стандарт с точностью до наоборот: черты хорошего социализма заимствуются еще более лучшим рынком, частная же собственность приобрела, пожалуй, совершенно неожиданные даже для ее вековых владельцев все лучшие преимущества собственности общественной, а «условия перехода к социализму, коммунизму» довольно просто, если не сказать примитивно и бессмысленно, заменяются «условиями перехода к рынку».

Предлагаемые на сегодняшний день в республике ориентиры типа «рынок» и критерии — «как в цивилизованных странах» в лучшем случае могут быть признаны как рабочие, поисковые варианты политэкономической стратегии, так же как и прозвучавшее спустя год после прихода новой власти откровение о рыночном социализме, ждущее, видимо, своего часа для обсуждения.

Во-вторых, за последние 50-60 лет произошли, можно сказать, коренные изменения в субординации национальных и международных экономических отношений. Торговля, выступив исходной формой образования мирового хозяйства, через жесткую конкурентную борьбу, но не без успеха, была дополнена соответствующими формами производительного капитала, которые закрепили интернациональные связи и превратили мировое сообщество в действительную систему. Международные экономические отношения из вторичных превратились,

¹ Бжезинский З. Вне контроля. Глобальный беспорядок накануне XXI века // США: Экон. Полит. Идеол, 1994, № 4–5.

¹ Masuda Y. The information Society as Post-Industrial Society. Warszawa, 1981, p. 72; Naisbitt I. Megatrends. N. Y., 1982.

таким образом, в первичные со всеми вытекающими отсюда последствиями. Территориальный национальный суверенитет заменяется понятием функционального суверенитета, предполагающим передачу части функций отдельных государств вновь образованным наднациональным органам. Созданные соответствующие международные политические, экономические, военные и другие институты стали в конечном итоге определять цели и многие параметры национального развития. Сейчас ни одно государство и даже, пожалуй, ни один гражданин той или иной страны не могут себе представить свои права, возможности, свое положение и доходы (настоящие и будущие) без валютных курсов, таможенных правил, мировых цен. Следовательно, и экономическая теория, традиционно базировавшаяся на соответствующих национальных стоимостных категориях, по существу, утратила во многом свою историко-логическую самостоятельность и значимость. Характерное для рынка взаимодействие спроса и предложения, а также им сопутствующие категории по нисходящей пронизаны разного рода международными регулирующими политико-экономическими и правовыми актами. Известная смитовская «невидимая рука», правда, не стала более видимой и не только из-за усложнения общественных отношений и взаимосвязей, но и благодаря влиянию довольно мощного идеолого-пропагандистского аппарата, который искажает и без того необычайно слабый для данного уровня общественного развития инструмент познания экономической науки.

По поводу трансформации самой экономической науки, когда доминирующим из множества факторов общественного развития выступил фактор НТР, писал еще в 50-е гг. Ж. Фурастье: «... нет ни одного раздела политической экономии, которые не должны были бы быть пересмотрены под углом зрения технического прогресса»¹. Несколько позже, когда за пределами экономической науки постоянно оставались уже другие необычайно важные вопросы социально-экономической системы, эту же проблему поднятия самой экономической науки на новую ступень подчеркивал и один из исследователей современного общества П. Икинз: «... Экономическая наука зашла в тупик, инструментарий ее притупился... Необходимы новый старт, разработка экономического подхода, который соответствовал бы науке, технологии, ценностям и отношениям конца XX века»².

Экономисты, обществоведы постсоциалистического пространства также, видимо, еще помнят известный тезис 80-х г. о непознанном социалистическом обществе, в котором мы живем, официально как бы открывшем многочисленные дискуссии относительно научного аппарата экономической и других гуманитарных наук, перспектив и концепций будущего. Эти малопродуктивные, по нашему мнению, дискуссии были прекращены стремительными политическими событиями

¹ *Fourastie J. Le grand espoir du siècle. Paris, 1958, s. 25.*

² *Ekens P. The Living Economy. A New Economics in the Making. N. Y., 1986, p. 1.*

и официально поставленной и безропотно неосмысленно принятой новой установкой — «альтернативы рынку нет», что не избавило, впрочем, от необходимости думать и анализировать еще более напряженно. Поэтому, реанимируя смитовские идеи с его свободной конкуренцией и «невидимой рукой», стихийно управляющих экономической ситуацией, нельзя не замечать того важного обстоятельства, что это уже «международная невидимая рука», формирующая правила поведения и корректирующая иногда очень жестко и властно чьи-то отклонения от установленного, например, «нового экономического порядка». В этой части рассуждений можно лишь напомнить в силу достаточно широкой известности о таких факторах, как монополии и государство, которые еще значительно раньше не только во многом изменили традиционную экономическую систему, но и трансформировали классическую экономическую науку. Ни одни даже самые «чистые» экономические рассуждения в нынешних условиях жесткой взаимосвязи не будут иметь абсолютно никакого смысла, если не сделать допущений типа «при прочих равных условиях», т. е. пренебречь мощным влиянием государства, крупных корпораций и многочисленных интернациональных организаций. Возникшее мировое хозяйство с его многонациональным бизнесом прежний предмет кейнсианского анализа — управление национальным спросом, — дополняет необходимостью синтеза с управлением совокупного предложения, далеко выходящего за привычные национальные рамки экономического роста.

В свою очередь снизилась эффективность традиционной денежной, фискальной и валютной политики с ослаблением доверия к экономическим процессам. Но именно в таких довольно сложных социальных и экономических взаимосвязях, значительно расширяющих объект анализа, если говорить словами В. Леонтьева, может еще только наступить «золотой век» экономической науки¹. Это интересное замечание уважаемого мэтра.

В-третьих, чтобы такое время наступило и стали реальностью не традиционные стыдливые объяснения и оправдания по поводу очередного неудавшегося исторического зигзага, а освещение будущего с построением его возможного сценария, необходимо экономистам осознать, что их представления о производственно-технологических изменениях, о социальных взаимосвязях и природе человека слишком ограничены. Действительно, нельзя же не замечать ухода с исторической арены традиционных отраслей и возникновения принципиально новых машин и технологий, произошедших изменений в структуре капитала, поистине фантастических возможностей в сфере информационного и товарного обмена, возникновения иных, более сложных мотивов поведения людей, роли последних во всем воспроизводственном процессе.

В-четвертых, обращение к классическим основам той или иной науки может

¹ Леонтьев В. Экономическое эссе. М., 1990, с. 90.

быть полезно и необходимо даже не в смысле поиска новой оригинальной идеи, подсказывающей ответ на вопросы современности, а в смысле проверки этой идеи и предлагаемого для ее обоснования набора аргументов на научную прочность, т. е. обращение к своеобразному детектору на истину.

Жизненность и прочность классической экономической доктрины объясняется, прежде всего, правильным пониманием ее авторами предмета и роли политэкономии в социокультурном развитии, удивительно гармоничным сочетанием объекта исследования со всеми его элементами (начиная от структуры и форм общественного богатства до ... его распределения), с освоенным на тот период методом и системой категорий, каждая из которых приобрела свое место и назначение. Но заслуженная оценка классической модели может быть верно понята и принята лишь при условии восприятия того, что традиционно остается за «кадром» — назначением и ролью в этой теории таких неэкономических факторов, как мораль, нравственность, традиции, сложившиеся связи и устои общества, политика, право, религия, культура и т. п. Важность вышеназванных факторов с точки зрения влияния их на смитовскую парадигму экономической науки трудно переоценить, но иногда невозможно разглядеть, особенно сейчас, за большим обилием исторических и экономических фактов, часто превращающихся в непоколебимые мифы через призму непогрешимых академических иллюзий, иногда скрывающихся за удобными математическими формулами и графиками. Иначе говоря, поиск решений по животрепещущей как для всего мира, так и для нашей республики проблеме экономического роста лежит не в плоскости традиционных экономических факторов, а за их пределами, обозначенными как институциональные факторы. Последние также имеют свою классификацию, особенности механизма проявления и управления, свой спектр влияния и движущие силы, степень результативности и надежности с точки зрения будущего системы со всеми ее элементами.

Конечно, легче всего ожидать от конкуренции положительного результата, рассуждая о разного рода «эффектах» и «предпочтениях» «саморегулирующейся системы», что стало у нас массовым явлением. Но недоумение вызывает то, что при всем обилии литературы, в которой с завидным постоянством и на протяжении веков хранится верность этому экономическому феномену, за исключением, пожалуй, работ К. Маркса и Й. Шумпетера, вряд ли где еще можно найти глубоко обоснованный механизм действия конкуренции, наглядно подтверждающий и доказывающий на языке экономических категорий, а не посредством ссылок на Ч. Дарвина, его результативность, особенно применительно к условиям «постиндустриального», «посткапиталистического», «информационного» общества, активно использующего нетрадиционные технологические уклады 5-го и 6-го уровней.

Как известно, экономический прогресс самым тесным образом связан с разделением труда и специализацией. Негативные стороны этого процесса были отмечены еще П. А. Кропоткиным. В сфере идеальных форм, к которым,

безусловно, принадлежит и экономическая наука, специализация также активно проявила себя, что обусловило расчлененность знания об экономике, природе и обществе. Специализация в экономической науке на новой теоретической основе по школам, отраслям, сферам деятельности и т. п. началась, по существу, с классической школы, которая возникла как синтез предшествующих теоретических идей. Цельность знания стала серьезной проблемой, порождающей не только неиссякаемые дискуссии, но и весьма серьезные катаклизмы и коллизии в практике. Последние, если уж не считать самых сильных экономических потрясений, довольно часто не признаются в качестве истинности или заблуждений той или иной школы. В силу этого, а также при возможности саморазвития любой идеи на формально-логической основе самым устойчивым и, может быть, самым настойчивым по привлечению к себе внимания в последние десятилетия является неоклассическое направление с его монетарной интерпретацией.

Трудно понять, почему именно монетарные идеи были приняты в качестве основы экономической политики реформируемых государств, среди которых находится и наша республика. Видимо, в силу их очевидной абсурдности и непонимания природы этих идей самими отцами-реформаторами. Но еще Дж. Хикс отмечал ограниченный характер монетаризма: «Наши проблемы носят в настоящее время не просто денежный характер и не могут быть решены с помощью монетаристских методов¹. Возможно, таким образом, предполагалось развить теорию о бесклассовом обществе, в строительстве которого большинство «реформаторов» раньше принимало самое активное участие, потому что основу неоклассической концепции, как ни парадоксально, образует именно предположение о бесклассовом обществе, что принципиальным образом отличает это направление от классической политэкономии. Обращаясь еще к таким авторитетам, как

Дж. М. Кейнс, необходимо заметить, что последний также неоднократно подчеркивал вред, а для депрессивных ситуаций и пагубность использования денежно-кредитных инструментов. Наша экономическая ситуация требует по крайней мере хотя бы задуматься о теоретическом основании проводимой экономической политики. Естественно, это привело бы к значительно меньшему количеству партий, оппозиций, пустых дискуссий.

Если оценивать с позиций социально-экономического прогресса в его современном понимании практическую значимость консервативной ветви неоклассической школы, которая, как никакая другая, претендует на исключительную значимость в экономической науке, то без преувеличения можно сказать, что человечество достигло нынешнего уровня развития не благодаря, а вопреки этим идеям, проявляющим удивительную невосприимчивость не только к открытиям других наук и иных экономических школ, но и игнорируя суть происходящих вокруг изменений. «Варясь в собственном соку», предлагаются

¹ Хикс Дж. Р. Стоимость и капитал. М., 1993, с. 90.

самые изощренные, но не наполненные реальным экономическим содержанием, инструменты анализа. Примеров здесь более чем достаточно.

Последним и самым характерным может быть пример явно неудачного использования политики либерализации и монетаризма в таких странах, как США, Англия, других развитых странах. Здесь обнаружила себя удивительная ситуация экономической стагнации с ростом на первоначальном этапе прибылей, обеспечивающихся не в результате роста производства (поскольку произошло сокращение и государственных и частных инвестиций), а в результате финансовых спекулятивных операций. Поэтому в этих странах надежды на повышение деловой активности возлагают, так же как и у нас, на внешние инвестиции, в частности на уже работающий и достаточно хорошо зарекомендовавший себя японский капитал, и традиционно без особых комментариев и аргументов на абстрактную конкуренцию. А еще – на чисто социалистическую меру: поддержку банковской системы из различного рода общественных фондов денежными ресурсами. Иначе говоря, доходы приватизируются, а расходы национализируются – чем же не новое общество?..

На наш взгляд, в обращении к конкуренции как своеобразному экономическому локомотиву присутствует или элемент лукавства, вызываемого известными слабостями человеческими, или неосознанного заблуждения, ставящего под сомнение, как возможности науки, так и способности человека на заранее согласованной основе рациональным образом координировать свои действия и, таким образом, оптимизировать весь спектр отношений и взаимопереплетающихся интересов индивидуумов. Но нельзя же не замечать того, что в экономике сложилась весьма противоречивая ситуация между финансовой сферой и остальными секторами производства явно в пользу первой, когда деньги начинают и выигрывают безо всякой конкуренции. Кроме этого, в силу ряда причин из конкурентной среды выключаются такие отрасли, как сельское хозяйство, наука и образование. Весьма специфично проявление конкурентных сил в медицине, отраслях инфраструктуры. Скажем так, ученый, учитель, врач могут конкурировать лишь между собой, а не с торговцем, работниками сферы услуг или занятыми в сельском хозяйстве. Слишком разные сферы деятельности у них, которые определяют старт конкуренции, силу и время оборота капитала.

Однако все это говорится не ради умаления заслуг одних позиций, взглядов, школ и восхваления других. Человечество с его эгоистическим «экономическим интересом» (*homo economicus*) со времен А. Смита накопило слишком много сверхактуальных проблем, чтобы будущее уже даже одной страны отдавать на волю случая, конкуренции и «рациональных ожиданий», придавая без тени сомнения всему этому respectable научный вид со ссылками на результативность. Для раздумий по поводу эффективности экономики «цивилизованных стран» можно привести несколько любопытных цифр. Например, индустриально-развитые страны, имея около 20 % населения земного шара, используют почти 70 % всех ресурсов земли и производят 80 % всех загрязняющих

веществ. При этом только США при 5 % населения используют около 40 % мирового объема добывающих ресурсов и выбрасывают в окружающую среду почти 50 % всех мировых отходов. Производство же одного стакана молока на Западе обходится в полстакана бензина.

Не подтверждается также никакими статистическими данными, ни самой жизнью известный тезис неоклассической школы о воздействии конкуренции на снижение цен. Правда, если что и снизилось за последние годы, так это реальные ставки заработной платы на рынке труда, темпы экономического роста и общий уровень жизни в странах, которые активно применяли у себя методы монетарной политики и либерализации. Поэтому эти и другие аргументы если и не убедят, то позволят хотя бы усомниться в универсальной значимости ортодоксального направления в экономической мысли, потому что неоклассический экономический романтизм конца нынешнего столетия, вскормленный ортодоксальным европейским прагматизмом и наполненный американским долларовым содержанием, имеет лишь определенный ограниченный сектор экономики с его соответствующим уровнем и сферой. Справедливости ради надо отметить, что анализ на уровне фирмы не только возможен, но и крайне необходим. Но его разрешающая способность, т. е. всесторонняя научная обоснованность без искажения действительности, и практическая значимость увеличиваются только после «выяснения позиций» на международном и национальном макроэкономическом срезе. В противном случае это будет оригинальная, не лишенная логико-математической замысловатости гимнастика ума, на которой, пожалуй, и закончится ее научная значимость и практическая применимость.

Однако из этого вовсе не следует хотя и распространенный, но весьма упрощенный вывод типа: «...если свободная конкуренция уже не может, то государство должно и обязано...». Дело в том, что прежде чем наделять некое государство распорядительно-регулирующими полномочиями, необходимо помнить об ограниченных возможностях института государства. Традиционно в силу своего естественного положения государство возлагает на себя значительно больше полномочий, чем способно «переварить», присваивая себе права и победы, отдавая «этому» народу обязанности и ответственность за свое руководство. Как политический элемент общественной системы государство всегда имело и имеет завидную и устойчивую тенденцию к обособлению с явно выраженными эгоистическими интересами и мотивами поведения, маскируя и часто выдавая их за «государственные, национальные интересы». С юридической точки зрения четкого критерия между ними практически не существует, хотя в каждом государстве существуют законы о государственной измене, коррупции и т. п.

Истории известны также многочисленные факты, когда силой государственной машины создается крайне малоэффективная экономика со всеми вытекающими отсюда последствиями для абсолютного большинства населения. Тем не менее она обеспечивает расточительный образ жизни государственных чиновников и еще совсем незначительной, очень пестрой по составу части

населения страны из среды ученых, независимых журналистов и политиков, деятелей культуры и искусства, работников профсоюзов, персональных пенсионеров, которых устраивает такое положение вещей по вполне понятным причинам. Декабристы появятся, возможно, потом, после того как на поддержание «стабильности экономического кризиса» уже не хватит никаких политико-правовых мер, ресурсов, времени и сил для репрессий. Страны, упустившие момент необходимых обновлений еще в 50-е гг., сегодня обеспечили для себя невыигрышную ситуацию на мировой арене по многим параметрам.

Поэтому в новой формирующейся концептуальной основе экономической науки конца XX в. должны быть не вопросы чистой экономической теории, *а фундаментальные проблемы природы, общества, экономики с соответствующей методологией и системой категориального аппарата.* Ряд «традиционных» и новых для этой науки вопросов вольно или невольно, но уже получил некоторое свое освещение. В иных же престижных вузах, призванных готовить нестандартно мыслящую правящую элиту, немалое число актуальных и современных, но характерных именно для политэкономии проблем, прочно вошло уже в учебные курсы, хотя и под абсолютно разными названиями. Тем более что в мировой практике сложилась, может быть, еще не совсем окончательно, но именно такая ситуация, когда между группами стран распределяются роли и функции. Например, *первая известная группа стран* занимается формированием политики на глобальном уровне, выступает законодателем и распорядителем финансов, производством и аккумуляцией знания, информации, выработкой технологии, производит некоторые весьма значимые материальные элементы основного капитала. Бесспорно, что широко распространенные учебные курсы типа «экономика» с разной степенью их освоения могут выступать лишь как арифметика экономики, что, конечно, явно недостаточно. *Вторая группа стран* обеспечивает производство вспомогательных элементов основного капитала и товаров массового потребления. *Третьей же группе стран* история оставляет лишь роль поставщика сырья, дешевой рабочей силы и региона сбыта морально устаревших и не совсем качественных товаров. Естественно, как вторая, так и третья группы стран могут выступать пользователями, где-то даже создателями соответствующих сфер экономической информации и знания, необходимых для безупречного выполнения своих функций.

Понимание последнего положения представляется особенно важным для освоения западной экономической науки на постсоциалистическом теоретическом пространстве, чтобы, отличив действительно научное достижение от массового поп-знания, наладить у себя в стране соответствующую подготовку квалифицированных специалистов, а не пропагандистов-черносотенцев, «приобщающихся к мировым достижениям» теории за две-три недели с адекватным поведением на товарном рынке или на ниве государственного управления.

Осознание своей роли каждым государством, каждым народом позволило бы

сконцентрировать интеллектуальные и природно-экономические возможности для выхода на более значимую и приемлемую позицию, а не возмущаться «происками» Запада. Народы Западной Европы, если и не любят, то уважают достойных и понимающих партнеров, создающих не только материальный продукт, но и полезную информацию.

Следующим направлением приведения экономической науки в соответствие с современной изменившейся реальностью, требующей адекватного восприятия настоящего и верного прогноза сценария будущего, выступает *проблема получения синтезированного целостного знания*. Оно добывается как средой традиционно сложившихся в экономической науке специализаций, школ и направлений, так и широко выходящими за ее пределы науками. Обычно экономисты ведут диалоги, эмоциональность которых, как правило, обратно пропорциональна весомости выдвигаемых аргументов, в достаточно привычных понятиях неоклассиков и неокейнсианцев, теории марксизма и институционализма, некоторых интерпретаций их крайних позиций. Однако при этом игнорируются достижения в области естественных и технических наук, чем обедняется широко применяемая категория «производительных сил», упускаются из вида по разным причинам результаты исследований уже получивших самостоятельный статус таких наук, как экономическая психология, социология, управление, макроэкономическое планирование и моделирование и т. п. Агрегированный же цельный взгляд необходим прежде всего для того, чтобы исключить в условиях глубокой специализации наук односторонность познания сложнейшего объекта, каким является экономическая система. Лауреат Нобелевской премии М. Алле подчеркивал: «Как физика нуждается сегодня в единой теории всеобщего тяготения, электромагнетизма и квантовой механики, так и гуманитарные науки нуждаются в единой теории поведения людей»¹.

Еще в конце прошлого века психологами было установлено, что объект в целом не может быть правильно объяснен с позиций отдельно воспринимаемых его составных элементов, как, например, аккорд в музыке. Это явление чем-то подобно дефекту массы в физике, проявляющемуся в разнице суммы энергии связи структурных частей и целого тела. И чем больше дефект массы, тем выше энергия связи и тем устойчивее ядро. В контексте наших рассуждений можно сделать вывод, что сложный мир сложившихся устойчивых взаимосвязей как на национальном, так и на международном уровне невозможно правильно отразить ни одним направлением современной экономической науки, ни даже их суммой, не получив так называемого «дефекта знания». Следовательно, и в прогнозе будущего, а тем более в принятии решения и выборе мер по предотвращению непереносимых сценариев во избежание фатального исхода всегда существует немалая доля

¹ Алле М. Единственный критерий истины — согласие с данными опыта // МЭ и МО, 1989, № 11, с. 27.

погрешности, если не грубой ошибки. Она может быть значительно снижена в рамках науки, если исключить в целом самонадеянность человека и ученых, а особенно присущее экономистам свойство иметь весьма высокое мнение о том, что они делают сами и пренебрегать результатами не только смежных наук, но и деятельностью даже своих коллег по профессии. В противном случае природа не потерпит пустоты, заполняя ее, что уже весьма активно и происходит на самом деле, разного рода далеко не безобидными астрологическими прогнозами и предсказаниями гадалок, которые будут кому-то выгодны. Ведь мы не согласны с прошлым, нам не нравится настоящее, но еще более ужасает неизвестность нашего будущего. Сделать будущее более предсказуемым и лучшим экономическая наука не только должна, но и может, если, не рядясь в тогу надменного пророка, но и не посылая себе голову пеплом, она осознает свое истинное предназначение и обнаружит свои внутренние проблемы и противоречия, заключив тесный союз с практикой. Ведь влияние на судьбу народа верных или ложных идей, которые царят в обществе и так же трудно различимы, как шедевр от подделки, значительно большее, чем принято считать. Нам же в поисках гармонии жизни никогда не следует забывать мудрого совета древних, что в драме бытия мы являемся одновременно и актерами, и зрителями.

На специфику славянского мышления указывал в свое время еще Н. А. Бердяев: «Русские обладают исключительной способностью к усвоению западных идей и учений и к их своеобразной переработке. Но усвоение западных идей и учений русской интеллигенцией было в большинстве случаев догматическим. То, что на Западе было научной теорией, подлежащей критике, гипотезой или, во всяком случае, истиной относительной, частичной, не претендующей на всеобщность, у русских интеллигентов превращалось в догматику, во что-то религиозного откровения. Русские все склонны воспринимать тоталитарно, им чужд скептический критицизм западных людей... Она (русская душа. - П. Л.) совершает смешение, принимает относительное за абсолютное, частное за универсальное, и тогда ... впадает в идолопоклонство»¹. И действительно, как в России, так и в Беларуси, по сути, на протяжении всей своей истории первые влиятельные «образцы» мышления появлялись с Европы. Здесь все было бы ничего, поскольку технико-экономическая основа создавал такую необходимость и возможность отражать это в категориях, представленных в иных странах. Но нельзя впадать в идолопоклонство, потому что надо соблюдать единство общего, единичного и специфического.

Еще приведем длинную, но, как нам представляется, необходимую цитату Дж. Кейнса, которая рельефно отражает специфику экономического мышления и роль математики в этом процессе: «Цель нашего анализа отнюдь не в том, чтобы

¹ Бердяев Н. А. Истоки и смысл русского коммунизма. Париж, 1955.

создать такую механику или шаблонную схему операций, которая автоматически выдавала бы безошибочный ответ, а в том, чтобы обеспечить себя *методом для систематического и планомерного изучения ряда проблем*. Поэтому после установления предварительных выводов путем последовательной изоляции одного за другим усложняющихся факторов мы теперь должны вернуться к нашей исходной позиции и учесть, насколько это возможно, вероятные взаимодействия всех этих факторов. *Именно такова природа экономического мышления*. Любой другой способ применения формальных принципов познания (без которых, однако, мы заблудились бы как в лесу) привел бы нас к ошибкам. *Крупный дефект формализации экономического анализа с помощью псевдоматематической символики* (курсив наш – П.Л.) в том именно и состоит, что все эти построения явным образом исходят из допущения о строгой независимости введенных в анализ факторов, и они теряют всю свою доказательность и значение с отпадением этой гипотезы. ...Слишком большая доля современной «математической экономики» представляет собой по существу простую мешанину, столь же неточную, как и первоначальные допущения, на которых она основывается, причем авторы получают возможность забывать о сложных отношениях и взаимосвязях действительного мира, замыкаясь в лабиринтах претенциозных и бесполезных символов¹» Это означает, что старт научному мышлению дает, прежде всего, методология или осознанный способ к изучаемому явлению. Второе, как говорил Г. Ф. Гегель, чтобы понять – надо это выразить в понятиях или категориях. Третья (но последняя) составляющая теории – это конструкция или отражение изучаемого объекта с помощью уже ставших известными категорий. И, конечно, необходимость количественных измерений создает условия для использования инструментария математики.

Методологические основы теории кризиса

Авсянский В.

Теория кризиса

Особенности экономического кризиса 2008-2013 гг., имеющего место в мировом хозяйстве, остро ставят вопрос об исследовании причин кризисов и их последствий. Само по себе явление кризиса, уже предполагает некоторые изменения в обществе, в экономических отношениях людей, т.е. трансформацию (под трансформацией понимаются принципиальные изменения) форм

¹ Кейнс Дж. Общая теория занятости, процента и денег. – М., 1978, с. 372-373.

жизнедеятельности общественных систем на разных фазах жизненного цикла. Традиционно кризис рассматривается с негативной стороны, и считается провалом рынка как господствующей идеологии. Ниже будут рассмотрены фундаментальные факторы кризиса, которые представляют современные экономические течения в мире.

Предпосылкой для изучения теории кризиса в странах постсоветского пространства, является распад СССР и становление нового социально-рыночного хозяйства, следствием чего становятся циклические колебания, принципиально отличные от циклических колебаний, происходивших в плановой экономике. Более того, условия становления и эволюции рыночных отношений оказались деформированными, поэтому общество столкнулось с более глубокой трансформацией.

Итоги полутора вековых теоретических поисков причин и последствий кризиса широко известны. Однако, если в трактовке длительности и последствий кризисов научное сообщество пришло к единому мнению, то в трактовке причин, вызывающих кризисы, и инструментов экономической политики по преодолению негативных последствий цикла на разных стадиях существуют серьезные разногласия.

Фаза кризиса - наиболее сложный и противоречивый период в динамике любой системы. Эта фаза завершается либо переходом системы в качественно новое состояние (кризис роста), либо ее гибелью и заменой другой системой (кризис распада). Это сложный период, когда нарушается устоявшееся равновесие, возникает большой выбор возможных альтернатив будущего развития. Поэтому важно, оценив структуру и глубину кризиса, его место в мейнстриме, выбрать наиболее надежные, с наименьшими потерями пути выхода из кризиса, перехода системы в новое состояние [10]. Данное положение позволяет выделить два основных тезиса в структуре современной теории кризиса.

Первое из них было тщательно разработано политэкономией XIX века в рамках развития трудовой теории стоимости и состоит в том, что продукт труда распределяется между двумя факторами производства – трудом и капиталом, неравномерно. Капитал, в соответствии с базовыми принципами капитализма, рассматривает продукт труда как свою частную собственность, и, как следствие, владельцы труда не получают за него необходимое вознаграждение. Таким образом, неотделимой проблемой капитализма является постоянное ускоренное приращение капитала [1].

Недостаток, на который следует обратить внимание, состоит, в частности, в том, что капитал существует не столько в денежной форме, сколько в форме активов. А стоимость актива определяется желанием рынка его приобрести, что, если идти по цепочке покупок, рано или поздно упирается в конечный спрос, то есть спрос государства и/или отдельных субъектов хозяйствования. Но последние непосредственно выступают в рамках производственных отношений со стороны труда, а спрос государства также существенно зависит от возможностей

потребителей. Таким образом, рост спроса при капитализме неминуемо отстает от роста капитала, что, если не принять специальных мер, обесценивает последний, как непосредственно, в виде товаров, так и опосредованно, из-за снижения его эффективности. Последнее вызвано тем, что уменьшение объема прироста спроса по отношению к приросту капитала ведет к уменьшению объема прибыли на каждую единицу нового капитала.

Решение этой проблемы для капитала оказывается принципиально важным и осуществлялось за всю историю экономической мысли двумя основными способами. **Первый** возник в период классического капитализма, в котором регулярно проходили кризисы перепроизводства, обеспечивающие перераспределение активов и «сжигание» избыточного капитала. Этот способ работал эффективно, но по мере развития мировой экономики, кризисы становились все сильнее и сильнее, так что нужно было искать что-то новое [2].

Вторым способом стал вывоз капитала на еще неосвоенные территории – соответствующая политика получила в конце XIX века название империализма. Этот способ неминуемо вызвал острую конкуренцию не только за рынки сбыта товаров, но и за рынки вывоза капитала и завершился сначала I, а потом и II Мировыми войнами. Поскольку после появления СССР, а потом и мировой системы социализм, появилась системная угроза самому существованию капиталистической системы, ей потребовалось значительно более согласованная политика [11]. В результате, в 1944 году вывоз капитала был институализирован в рамках Бреттон-Вудских соглашений, которые создал как институты, регулирующий этот процесс (ГАТТ, ныне ВТО, МВФ, Мировой Банк), так и систему регулирования мировых финансов на базе американского доллара, привязанного к золоту и, контролируемой, соответственно, Федеральной резервной системой США.

Вторым базовым элементом теории стала роль мирового разделения труда, которое играет принципиальную роль в рамках той модели (парадигмы) научно-технического прогресса (НТП), которая сформировалась в конце XVIII – начале XIX веков и сегодня распространилась на весь мир. Принципиальной особенностью этой модели является то, что очередной виток НТП неминуемо сопровождается углублением процессов разделения труда, а они, в свою очередь, требуют увеличения объемов рынков сбыта, что неминуемо приводило к дисбалансам в сфере потребления. Ведь движение любой страны на пути научно-технического развития за последние 250 лет требовало расширения рынков сбыта своей продукции, то есть рынков, которые бы она контролировала. Соответственно, количество технологически независимых государств в мире за последние два века все время сокращалось.

Безусловно, понимание того, что каждый кризис имеет свои закономерности, и по сути все кризисы взаимосвязаны и взаимозависимы, позволяет дать ответы на многие вопросы касающиеся кризиса 2008-2013 гг. Но необходимо также четкое понимание того, что каждая фаза кризиса индивидуальна, т.е. каждый кризис

специфичен, дает новый толчок к приросту знания [11]. Необходимо отметить, что кризисы всеобщие: нет системы в обществе и природе, которая не развивалась бы в ритме циклической динамики, переживая фазы зарождения, появления, распространения, зрелости, кризиса и перехода в новое состояние (или гибели) [7]. Следовательно, думается, что закономерности кризиса можно переименовать в закономерности обновления общества. Данный вывод подтверждает тезис о несовершенности экономической науки, в частности, рыночной доктрины, основным постулатом которой является «невидимая рука» рынка, которая возвращает систему в исходное равновесное состояние. В такой системе кризисы не могут существовать как элемент развития.

Для преодоления кризиса (дисбалансов) недостаточно одного понимания его структуры и последствий. Необходимо понимание причин вызвавших его. Прежде чем перейти к рассмотрению факторов, следует кратко пояснить некоторые положения теории кризисов. Из всех работ посвященных теории кризиса, выделяется одна, - «Тектология» А. А. Богданова, в которой впервые и наиболее полно сформулированы следующие положения (приведены лишь некоторые) [3]:

1. Кризис (от греч. –«решение») – это завершение или перелом в ходе некоторого процесса, имеющего характер борьбы, т.е. резкий переход, нарушение дискретности;

2. Существуют два типа кризисов в динамике систем: «кризисы С» - конъюгационные, соединительные: образование новых связей; «кризисы Д» - разделительные: разрыв связей. Однако границы между ними условны: каждый кризис представляет в действительности цепь элементарных кризисов того и другого типа;

3. Кризис есть нарушение равновесия и переход к новому равновесию – такой переход помогает диагностировать его и разработать методологию предвидения, что критически важно для понимания на сегодняшний день;

4. Равновесие есть частный случай кризиса;

5. В динамике трансформаций просматриваются действия генетических закономерностей – наследственности, изменчивости и отбора.

Факторы кризиса. Сравнительный анализ

Понимание положений русского ученого А. А. Богданова, позволяет более глубоко оценить причины резких циклических колебаний. Поиски причин кризиса привели к появлению множества экзогенных теорий цикла, которые объясняли цикличность развития наличием внешних факторов: от природных катаклизмов, демографических, политических, до циклов солнечной активности, непонятного оттока золота из страны (Де Лавель, «Laveleye E. De Le Marche

monetaire et ses crises depuis cinquante ans», 1865 г.). Следовательно, можно выделить *внешние и внутренние* факторы.

Исследование внутренних факторов началось немного позже, и породило множество научных теоретических обоснований. К основным внутренним причинам циклического развития ученые-экономисты относили: колебания цен на товары; внутреннюю неустойчивость самой рыночной системы, связанную с особенностями обновления основного капитала; недопотребление и т.д.

Несмотря на многообразие мнений по поводу внутренних факторов кризиса, теоретические обоснования причинно-следственных связей при объяснении циклического развития экономики, можно классифицировать по признаку принадлежности к системе воспроизводства:

Первая группа – причины в сфере обращения (распределения)

Сторонники теорий обращения связывают кризисы с нарушением равновесия между спросом на деньги и их предложением на микро уровне. К данной группе можно отнести основоположника монетарной теории Милтона Фридмана. Согласно его подходу, причиной циклических колебаний являются колебания денежной массы, и для того, чтобы экономика развивалась стабильно, нужен стабильный рост денежной массы. А такой теории причиной кризисов являются действия Центробанков. На примере Великой депрессии 1930-х гг. Фридман показывает, что причиной экономического кризиса стали действия Федеральной резервной системы, которая не смогла предотвратить сокращение денежной массы [8]. В таком подходе есть доля здравого смысла, но только отчасти. Монетаристы игнорируют системные проблемы капитализма, такие, как противоречие между потреблением и производством. В условиях капитализма потребляют одни люди, а руководят производством совсем другие. В таких условиях не удивительно, что будут возникать периоды перепроизводства и следующие за ними экономические кризисы. Денежные власти с тех пор научились «сбрасывать деньги с вертолета», однако, угроза кризиса никуда не делась. С помощью эмиссии денежной массы кризис можно отсрочить, но никак не полностью устранить его вероятность. Более того, на сегодняшний день стало очевидно, что когда правительство латает дыры в бюджете путем эмиссии денег, будущий кризис рискует принять катастрофический характер.

К данной группе следует отнести также сторонников Австрийской школы, которые также показали, что кризис в рыночной экономике происходит в результате конъюнктуры на денежном рынке, создаваемой центральными банками и системой не со 100 % нормой резервирования, что приводит к заниженным процентным ставкам, росту денежной массы. Это создает экономический бум. Фирмам кажется, что проекты нужны экономике, будут прибыльны, и они начинают инвестировать в потенциально убыточные проекты – «плохие инвестиции». Домохозяйства из-за роста цен перестают сберегать и начинают тратить больше своих доходов – берут ссуды. Бум вечно продолжаться не может и всегда наступает второй этап – крах, кризис. Кредитование падает, денежная масса сокращается, в результате цены снижаются, предпринимателям приходится продавать «плохие инвестиции». И потребители, и предприниматели в долгах. Начинаются оптимизации производства – происходят увольнения.

Вторая группа – причины в сфере производства.

Основной вклад в выявлении причин в сфере производства внес Карл Маркс. Он отмечал, что до промышленной революции конца XVIII века не существовало никаких регулярно повторяющихся бумов и депрессий. Поскольку эти циклы возникают на исторической сцене примерно в то же самое время, что и современная промышленность, Маркс заключил, что кризисы являются неотъемлемой чертой капиталистической экономики. Причину кризисов Маркс видел в производстве товаров сверх платежеспособного спроса. И дело не в ошибках оценки емкости рынка и даже не в желании владельцев капитала получить максимальную прибыль, а в самой природе и законах развития экономики, нацеленной на получение прибыли [4].

Владелец капитала (бизнесмен, капиталист, корпорация) стремится к получению прибыли, которая является формой *прибавочной стоимости*. Прибыль отдельный владелец капитала получит, только распродав (обменяв) произведенные товары. И каждый из владельцев не видит принципиальных препятствий для этого. Значит, чтобы прибыль получили все владельцы нужно распродать все произведенные товары. Но при этом работники в форме заработной платы получают стоимость своей рабочей силы, которая суммарно всегда меньше, чем стоимость произведенных товаров. Работники тратят зарплату преимущественно на потребительские товары. Вторую часть совокупного спроса составит замещение

выбывших средств производства. Но часть из произведенного в эквиваленте прибавочной стоимости так и останется не раскупленной. Она должна будет распределиться на личное потребление самих капиталистов и на расширение их бизнеса. При этом прибыль в денежной форме появляется в руках капиталиста лишь для того, чтобы воплотиться в новом товаре.

Таким образом, с точки зрения движения стоимости, баланс может быть сведен, то есть все произведенные товары распределены и оплачены. Это отличает теорию Маркса от теорий «недопотребления рабочим классом».

Однако конкуренция для снижения затрат на единицу продукции вынуждает капиталиста наращивать объем производства, что создает спрос на дополнительные средства производства. Расширение производства неизбежно сталкивается с ограниченным размером спроса.

Из-за общего хаотичного характера экономики (несогласованности действий производителей) какой-то товар окажется в избытке, какой-то в дефиците. При этом каждый капиталист стремится максимизировать прибыль. Для этого предпринимаются специальные меры, чтобы искусственно расширить рамки ограниченного спроса: предлагаются всевозможные формы кредита, скидок, бонусов и т.п. Все это создает дисбаланс между суммой зарплат (которая тратится преимущественно на потребление) и суммарной стоимостью потребительских товаров. Следствием этого является нарушение равновесия между спросом и предложением на товары и последующий резкий спад товарного производства, цепные банкротства и массовая безработица – то есть экономический кризис.

В представлении капиталистов дело принимает форму нехватки денежных средств (ликвидности). Предпринимаются попытки увеличить денежную массу, которая лишь материализует прибыль, но не увеличивает совокупный спрос. Кризис растягивается в фазу депрессии, которая продолжается до тех пор, пока не будет распродан «избыток» товаров. Ситуация усугубляется тем, что предприятия производят дополнительные товары, хотя и в меньшем объеме, чем в период экономического роста.

Общую сумму долгов формирует разрыв между общей стоимостью товаров и общей суммой зарплат, затрат на восстановление/ расширение производства и личного потребления капиталистов. Но стремление капиталистов к прибыли диктует необходимость снижения затрат (прежде всего затрат) и ограничение их личного потребления. Создается разрыв платежного баланса, спрос начинает снижаться. Для стимулирования совокупного спроса активно применяется

кредитование (в том числе – потребительское кредитование). Владельцы капитала вынуждены отпускать товар в долг или в кредит. Через несколько циклов производства долги накапливаются. Неизбежно наступает фаза, когда товары перестают отпускать в долг, поскольку размер долговых обязательств превышает разумные возможности их погашения. Кредитование прекращается, и спрос начинает уменьшаться очень быстрыми темпами.

Однако не следует кредит считать причиной кризиса. Кредитная пирамида является вынужденной мерой для смягчения платежного и производственного кризиса, то есть последующий кредитный (финансовый) кризис сам является следствием общего кризиса.

К этой группе можно отнести труды ученых М. И. Туган-Барановского (Российская научная школа), Н. Кондратьева, Й. Шумпетера, С. Кузнеця. Они указывают на то, что промышленные кризисы являются неизбежной фазой экономических циклов.

Третья группа – причины в сфере потребления.

К данной группе относятся теории авторов, исследующих рыночные связи динамики совокупного эффективного спроса и совокупного предложения на макроуровне с учетом психологической склонности к сбережениям и потреблению. Лидером данной группы, несомненно, является Дж. М. Кейнс. С выходом его работы «Общая теория занятости, процента и денег» началось развитие кейнсианской теории цикла, которая не только соединила в себе ряд предшествующих концепций, но и оказалась в центре новой макроэкономической теории, которая попыталась объяснить механизм капиталистического производства, причины его отклонений от равновесного состояния, а так же разработать антициклическую политику с прямым участием государства.

Основой экономических процессов Кейнс назвал психологическую природу человека, а причиной экономических кризисов – смену настроения капиталистов, иначе говоря, движение от оптимизма к пессимизму [9]. Таким образом, Кейнс сформировал «основной психологический закон», суть которого состоит в том, что обычно человек увеличивает потребление с ростом дохода, но не пропорционально последнему. Недостаточный потребительский спрос может быть компенсирован увеличением затрат на повышение инвестиций, т.е. ростом спроса на средства производства. Общий объем инвестиций зависит в свою очередь от

склонности к инвестированию. Кейнс показывает, что предприниматель расширяет свои инвестиции до тех пор, пока норма прибыли не падает до нормы процента. В такой ситуации у предпринимателя сужаются границы выбора проектов для вложения денег, что вызывает рост безработицы. Снижение нормы прибыли Кейнс объяснил увеличением массы капитала и пессимистичными ожиданиями предпринимателей относительно будущих доходов. Данные положения способны вызвать кризис.

Таким образом, в преодолении кризиса главная роль принадлежит государству, которое должно способствовать увеличению инвестиций в производство. Рост инвестиций способен вызвать резонансный эффект и усилить рост экономики: увеличение занятости, национального дохода и потребления.

Четвертая группа – институциональные факторы кризиса

К данной группе можно отнести теории, доказывающие взаимное влияние и обусловленность экономических, исторических, политических, социальных факторов кризиса, его течения и последствия. Причины кризиса институционалисты видят, прежде всего, в неправильной организации институтов.

В методологии институционалистов (Т. Веблен, Дж. Коммонс, Г. Адамс, К. Эйрс, У. Клэр, Дж. Кеннет) не встретишь увлечения сложными формулами, графиками. Их аргументы обычно основаны на опыте, логике, статистике. В центре внимания не анализ цен, спроса и предложения, а проблемы более широкого плана. Их волнуют не чисто экономические проблемы, но экономические проблемы во взаимосвязи с социальными, политическими, этическими и правовыми проблемами. Сосредоточив внимание на решении отдельных, как правило, значимых и актуальных задач, институционалисты не выработали общей методологии, не создали единой научной школы. В этом проявилась слабость институционального направления, его неготовность разработать общую, логически стройную теорию, и взять смелость за разработку антициклической политики.

На лицо факт – точки зрения на причины экономических кризисов весьма противоречивы. И для этого есть немало объективных предпосылок. Дело в том, что воздействие на цикличность воспроизводства одних и тех же факторов в разные периоды весьма различно и к тому же проявление их в отдельных государствах имеет свои особенности. Актуальной на сегодняшний день является

теория, связывающая продолжительность цикла с научно-техническим прогрессом (НТП) и с проблемами распределения результатов в сфере обращения. Активная часть основного капитала сегодня морально устаревает в течении 7-9 лет. Это требует ее обновления, что служит стимулом экономического оживления. Естественно, роль денег весьма велика, но без принципиальных изменений в структуре и технической базе реального сектора переход к оживлению невозможен. Так как исходным толчком служит замена оборудования и технологии, то обновление основного капитала называют материальной основой экономического цикла.

Пятая группа – теории неоклассической и либеральной школ.

Представители неоклассической и либеральной школ выдвигают различные причины экономических кризисов, не связывая их с природой капитализма. Многие из них считают причиной кризисов недопотребление населением, что вызывает перепроизводство. П. Самуэльсон, например, в качестве наиболее известных теорий циклов и кризисов в своей книге «Экономика» отмечает следующие: денежную теорию, которая объясняет цикл экспансией (сжатием) банковского кредита; теорию нововведений, объясняющую цикл использованием в производстве важных нововведений (Шумпетер, Хансен); теорию недопотребления, усматривающую причину цикла в слишком большой доле дохода, идущей богатым и бережливым людям, по сравнению с тем, что может быть инвестировано (Гобсон, Фостер, Кэтчингс и др.); теорию чрезмерного инвестирования, сторонники которой полагают, что причиной рецессии является, скорее, чрезмерное, чем недостаточное, инвестирование (Хайек, Мизес и др.) [6].

Если согласиться с тем, что кризис может возникнуть вследствие действия всего многообразия внешних и внутренних факторов, можно сделать вывод, что опасность кризиса существует постоянно, его необходимо предвидеть и прогнозировать.

ЛИТЕРАТУРА

1. Shumpeter Josef. Business Cycles. Vol. 1, 2. N.Y. 1939.
2. Анчишкин А. Н. Наука – техника – экономика // А. Н. Анчишкин. – 2-е изд. М.: Экономика, 1999.
3. Богданов А. А. Тектология. Всеобщая организационная наука // А. А. Богданов. Кн. 1, 2. М.: Экономика, 1989.

4. К. Маркс, Капитал: критика политической экономии. Т. 1: [пер. с нем., фр., англ.] // Маркс Карл; [введ. О. И. Ананьина; предисл. Л. Л. Васина, В. С. Афанасьева]. – М.: Эксмо, 2011. – 1200 с. – (Капитал. Карл Маркс).
5. Кейнс Дж. М. Общая теория занятости, процента и денег // Пер. с английского профессора Н. Н. Любимова. – М.: Гелиос АРВ, 2012. – 352 с.
6. Самуэльсон П., Нордхаус В. Экономика // П. Самуэльсон, В. Нордхаус. – М.: Вильямс. – 2012. -1360 с.
7. Сорокин П. А. Главные тенденции нашего времени // П. А. Сорокин. – Москва: Наука, 1997.
8. Фридман М. Основы монетаризма // М. Фридман. – М.: ТЕИС, 2002.
9. Хансен Э. Классики Кейнсианства. Т. 2. Экономические циклы и национальных доход // Э. Хансен. - М.: Экономика, 1997. – с. 87.
10. Яковец Ю. В. Глобальные экономические трансформации 21 века // Ю. В. Яковец. – Москва: Экономика, 2011. – с. 382.
11. Яковец Ю. В. Эпохальные инновации 21 века // Ю. В. Яковец. – Москва: Экономика, 2004.

Модель определения стоимости капитала предприятия

Бельзевская А.

Теоретические основы финансовых активов предприятия

Материальное благосостояние любого общества определяется эффективностью работы хозяйственных связей, иначе говоря экономики, выражаемой количеством товаров и услуг, которое может быть создано и потреблено его членами. С этой целью используются реальные активы (факторы экономического роста и развития), такие как земля, здания, оборудование и знания, применяемые для производства товаров.

Реальные активы – это активы, которые используются для производства товаров и услуг [3].

Наряду с реальными активами существуют и финансовые активы, например, акции и облигации. Подобный вид активов – это не более чем листы бумаги или данные в компьютере, и они напрямую не входят в производственные мощности. Вместо этого в экономически развитых странах финансовые активы являются средством, используемым человеком для того, чтобы засвидетельствовать свои права на реальные активы.

Финансовые активы – это требования (права) на материальные активы или доход от них [3].

Различие между реальными и финансовыми активами значительно:

- реальные активы требуют больших инвестиционных затрат (капиталовложений);
- рыночная ликвидность реальных активов меньше;

- доходность реальных активов во многих случаях выше, что связано с приоритетными возможностями создания конкурентных преимуществ на товарных и инновационных рынках, в отличие от финансовых рынков.

В то время как реальные активы – источник национального дохода в экономике, финансовые активы характеризуют его распределение среди экономических агентов.

Финансовый актив как первичный элемент и материальный носитель финансовой информации обладает рядом таких свойств, как цена, стоимость, доходность, риск, ликвидность. Любой экономический агент, принимая решение о целесообразности приобретения финансового актива, старается вести себя рационально, оценивая эффективность планируемой операции. Он вынужден ориентироваться либо на абсолютные показатели (цена, стоимость), либо на относительные (доходность, риск). Поэтому оценка финансовых активов является фундаментальной задачей экономической теории и одной из ключевых задач управленцев организаций.

Характеристики финансовых активов

Цена и стоимость финансового актива - два взаимосвязанных, но несовпадающих понятия. Стоимость – это свойство финансового актива иметь денежное выражение. Стоимость является объективным свойством, присущим любому финансовому активу. Цена – это показатель, с помощью которого измеряется стоимость. В отличие от стоимости на цену влияют субъективные факторы, которые обусловлены представлениями о стоимости финансового актива, методами, средствами и способами ее оценки или измерения. По сравнению со стоимостью цена реально существует, в том смысле, что она объявлена и финансовый актив по ней равнодоступен любому участнику рынка.

Основные различия между ценой и стоимостью финансового актива состоят в следующем:

- стоимость – это объективное свойство финансового актива, тогда как цена – это показатель стоимости, декларированный, объявленный, который можно видеть в прейскурантах, ценниках, рыночных котировках;

- в любой конкретный момент времени стоимость однозначна, а цена многозначна, при этом число оценок стоимости зависит от числа участников рынка, которые продают или покупают финансовый актив;

- можно утверждать, что стоимость первична, поскольку является объективным свойством, а цена вторична, так как является субъективным измерителем этого свойства.

Поскольку финансовые активы являются товаром на финансовом рынке и обладают теми же свойствами, что и любой другой товар, то для оценки стоимости финансовых активов можно воспользоваться теми же подходами, что и для оценки стоимости товара. Цена есть денежное выражение стоимости товара, при этом деньги выступают мерой стоимости товара. С позиций рыночной экономики в

основе цен товаров лежит закон стоимости. При равенстве на рынке спроса и предложения на товар цена обычно соответствует стоимости товара [9]. При несоответствии спроса и предложения цена товара отклоняется от его стоимости, что свидетельствует о недостатке или избытке финансовых активов.

Можно привести другие подходы оценки стоимости товаров [1]. Например, в трудовой теории стоимости Карл Маркс считал источником стоимости товара лишь труд наемных работников, игнорируя при этом труд предпринимателей и другие факторы [8]. Основные представители теории предельной полезности – Уильям Стэнли Джевонс (1835-1882), австрийцы Карл Менгер (1840-1921), Фридрих фон Визер (1851-1926) и Ойген Бем-Баверк (1851-1914) [4], американский экономист Джон Бейтс Кларк (1847-1938) [5] считали, что стоимость определяется степенью полезного эффекта с точки зрения потребителей. Сопоставляя оба подхода, можно заметить, что в рамках теории стоимости Маркса решающая роль принадлежала фактору предложения, когда принимались во внимание затраты труда, затраченного на производство товаров. В рамках теории предельной полезности, наоборот, основное внимание было уделено потребительским оценкам. Соответственно, двум подходам была присуща ограниченность, то есть ни один из них не мог претендовать на абсолютную истинность в объяснении реальной хозяйственной практики.

С другой стороны, финансовые активы обладают специфическими свойствами, благодаря которым они выделяются в отдельный от других товаров класс. Среди специфических свойств можно выделить следующие:

- финансовые активы являются объектами финансового рынка и находятся в собственности экономических субъектов;
- в будущем финансовые активы могут приносить их владельцам экономическую выгоду (доход);
- значение будущей экономической выгоды (дохода) финансовых активов является неоднозначным, неопределенным, причем эта неопределенность ложится на их владельцев.

Экономический эффект и эффективность финансового актива характеризуется соответственно такими показателями, как доход и доходность [2].

Доход представляет собой приращение капитала за период владения финансовым активом:

$$\Delta S = S - P, \quad (1.1)$$

где ΔS – доход финансового актива;

S , P – сумма инвестиции соответственно в конце и в начале периода владения финансовым активом.

Поскольку доход является абсолютной величиной, то он не позволяет проводить сопоставительный анализ при вложении разных сумм в различные финансовые активы. Более универсальным является другой показатель – доходность, которая является отношением дохода к первоначальной сумме вложения капитала:

$$r = \frac{S - P}{P}, \quad (1.2)$$

где r – доходность или процентная ставка за период владения финансовым активом.

Неопределенность будущего значения доходности порождает два показателя доходности: ожидаемая и реальная доходность. Ожидаемая доходность – это доходность, которую экономический агент предполагает получить от владения финансовым активом [3, 10]. Она определяется на основе анализа исторических данных для данного финансового актива. Реальная доходность – это доходность, которую экономический агент получает в результате владения финансовым активом [3, 10]. Отклонение реальной доходности от ожидаемой доходности является случайной величиной, поскольку под воздействием различных факторов может принимать различные значения. Неопределенность будущей доходности финансового актива связана с понятием риска финансового актива.

В общем случае риск относится к возможности наступления какого-либо неблагоприятного события в будущем, в нашем случае это отклонение реальной доходности от ожидаемой доходности финансового актива. Поэтому основой для измерения риска финансового актива является распределение вероятностей возможных значений его доходности.

Разброс вероятных результатов доходности показывает в процентах шанс того, что наступит каждый из возможных результатов. Ожидаемая доходность финансового актива ($\bar{r}$) представляет собой средневзвешенную величину возможных значений доходности, вычисленную с учетом частоты наступления вероятности исходов, и рассчитывается по формуле [10]:

$$\bar{r} = \sum_{i=1}^n r_i p_i, \quad (1.3)$$

где n – число возможных значений доходностей;

r_i – доходность финансового актива за предыдущий период;

p_i – вероятность наступления i -й доходности.

Мерой разброса возможных результатов доходности финансового актива относительно его ожидаемой доходности может служить такой статистический показатель, как дисперсия [3, 10]:

$$\sigma^2 = \sum_{i=1}^n (r_i - \bar{r})^2 \cdot p_i, \quad (1.4)$$

где σ^2 – дисперсия доходности финансового актива.

Другим измерителем риска финансового актива часто выступает показатель среднеквадратичного отклонения, представляющий собой квадратный корень из дисперсии [3, 10]:

$$\sigma = \sqrt{\sigma^2} = \sqrt{\sum_{i=1}^n (r_i - \bar{r})^2 \cdot p_i}, \quad (1.5)$$

где σ – среднеквадратичное отклонение доходности финансового актива.

Преимущество среднеквадратичного отклонения перед дисперсией в том, что его размерность совпадает с размерностью доходности финансового актива. Среднеквадратичное отклонение доходности показывает, насколько в среднем каждый вариант доходности финансового актива отличается от его ожидаемого значения. Чем выше среднеквадратичное отклонение, тем более рискованным считается финансовый актив.

Другая формула расчета среднеквадратичного отклонения имеет вид [3, 10]:

$$\sigma = \sqrt{\frac{\sum_{i=1}^n (r_i - \bar{r})^2}{n - 1}}, \quad (1.6)$$

где $\bar{r}$ – среднегодовая доходность ценной бумаги за n периодов, вычисляемая по формуле [3, 10]:

$$\bar{r} = \frac{1}{n} \cdot \sum_{i=1}^n r_i. \quad (1.7)$$

В последних двух формулах принято равномерное распределение вероятностей p_i :

$$p_i = 1 / n. \quad (1.8)$$

Таким образом, фактические доходности, связанные с владением финансовым активом, по тем или иным причинам могут отличаться от их ожидаемых значений, и именно это различие между ожидаемыми и фактическими доходностями является характеристикой риска. В качестве показателей риска финансовых активов могут использоваться такие статистические показатели, как дисперсия и среднеквадратичное отклонение.

Портфель финансовых активов предприятия

Одним из наиболее сложных вопросов, с которыми сталкиваются финансовые менеджеры, является связь между структурой капитала, представляющей собой сочетание заемных и собственных источников средств, и курсом акций. Руководство каждой компании принимает свое собственное решение по этому вопросу.

Ни отдельный человек, действующий от лица акционеров фирмы, ни менеджер, не должны принимать решения об инвестировании финансовых средств, руководствуясь лишь соображениями ожидаемой доходности. Тот, кто принимает

решение, должен сначала оценить рисковость инвестиций, а затем определить является ли уровень доходности достаточным для компенсации ожидаемого риска.

Понятие риска можно определить двояко [7]:

как общий риск (total risk), относящийся к конкретному финансовому активу, рассматриваемому изолированно, и измеряемый дисперсией возможных исходов относительно ожидаемой доходности этого актива;

как рыночный риск (market risk), относящийся к конкретному финансовому активу как части инвестиционного портфеля и оцениваемый с учетом вклада этого актива в совокупный риск портфеля в целом.

Рыночный риск измеряется β - коэффициентом фирмы, а общий риск состоит из рыночного риска и элемента риска, который можно исключить с помощью диверсификации.

Различают также два вида риска:

производственный риск, характеризующий неотъемлемую рисковость операций фирмы, если она не использует заемный капитал;

финансовый риск, т.е. дополнительный риск, налагаемый на держателей акций в результате решения фирмы воспользоваться займом.

Производственный риск (business risk) с позиции общего риска измеряется неопределенностью, неизбежной при прогнозировании рентабельности активов (Return on Assets - ROA) [7]:

$$ROA = \text{доход инвесторов} / \text{активы} = (\text{чистая прибыль держателей обыкновенных акций} + \text{проценты к уплате}) / \text{активы}.$$

Так как активы должны быть численно равны капиталу, представленному в форме заемного и собственного капитала, эту формулу можно переписать в виде формулы расчета рентабельности инвестиционного капитала (Return on Invested Capital - ROI):

$$ROI = (\text{чистая прибыль держателей обыкновенных акций} + \text{проценты к уплате}) / \text{инвестированный капитал}.$$

Если фирма не пользуется заемным капиталом и поэтому не платит процентов, ее активы численно равны собственному капиталу:

$$ROE = \text{чистая прибыль держателей обыкновенных акций} / \text{обыкновенный акционерный капитал},$$

где ROE (Return on Equity) – рентабельность обыкновенного (собственного) капитала).

Производственный риск финансово независимой (leverage - free) фирмы может измеряться среднеквадратическим отклонением ее ожидаемой ROE, -

$$\sigma_{ROE}.$$

Производственный риск зависит от ряда факторов, среди которых особое внимание надо обратить на степень постоянства затрат. Если в составе затрат фирмы высок удельный вес постоянных затрат, которые не снижаются при падении спроса, то для фирмы характерен относительно высокий уровень

производственного риска. Этот фактор называется операционным левериджем (operating leverage). В деловой терминологии высокий уровень операционного левериджа при прочих неизменных факторах означает, что сравнительно небольшое изменение объема реализации приводит к большому изменению ROE.

Среднеквадратическое отклонение ROE, $\sigma_{ROE(U)}$, в том случае, если фирма не использует заемное финансирование, служит мерой производственного риска, который несут акционеры фирмы (общего риска) $\sigma_{ROE} = \sigma_{ROE(U)}$, если фирма не привлекает заемного капитала. Однако если фирма использует заемный капитал, то $\sigma_{ROE} > \sigma_{ROE(U)}$, так как производственный риск ложится на держателей акций. Таким образом, с позиции общего риска мерой финансового риска служит $\sigma_{ROE} - \sigma_{ROE(U)}$ [7].

Для достижения поставленных целей экономические агенты обычно прибегают к дифференциации своих вложений, то есть формируют портфель финансовых активов. Распределяя вложения по различным финансовым активам, можно достичь более высокого уровня доходности вложений либо снизить уровень их риска. Характерной особенностью портфеля финансовых активов является то, что риск портфеля может быть значительно меньше, чем риск отдельных финансовых активов, входящих его состав.

Теория структуры капитала предприятия

Во второй половине 50-х гг. XX века проводились интенсивные исследования по теории структуры капитала и цены источников финансирования. Является общепризнанным, что основной вклад был сделан Ф. Модильяни и М. Миллером. Поскольку их теории базировались на целом ряде предпосылок, носящих ограничительный характер, дальнейшие исследования в данной области были посвящены изучению возможностей ослабления этих ограничений.

Ф. Модильяни и М. Миллер – лауреаты Нобелевской премии по экономике. Модильяни был удостоен этой награды в 1985 году «за анализ поведения людей в отношении сбережений», как за работу, имеющую исключительно важное прикладное значение в создании национальных пенсионных программ, а также «за работу по вопросу о связи финансовой структуры компании с оценкой ее акций инвесторами», а Миллер – в 1990 году «за вклад в теорию формирования цены финансовых активов».

Теория портфеля и теория структуры капитала представляют собой сердцевину науки и техники управления финансами крупной компании, поскольку позволяют ответить на два принципиально важных вопроса: откуда взять и куда вложить финансовые ресурсы. Поэтому 1958 год, когда была опубликована работа Модильяни и Миллера «Стоимость капитала, финансирование корпораций и теория

инвестиций» («The Cost of Capital, Corporation Finance, and the Theory of Investment»), рассматривается как рубежный, начиная с которого от мировой экономики отпочковалось самостоятельное направление, известное как современная теория финансов.

Миллер и Модильяни внесли большой вклад в исследование финансовых рынков ценных бумаг, разработав теорию финансирования корпораций и стоимостной оценки компаний на рынке. Эта теория объясняет связь или причины ее отсутствия между структурой финансовых активов предприятия и политикой дивидендов, с одной стороны, и рыночной оценочной стоимостью предприятия - с другой.

Модель Модильяни – Миллера стоимости капитала предприятия без учета налогов

В начале своего исследования Модильяни и Миллер сделали следующие допущения [12]:

- Производственный риск может быть измерен показателем σ_{EBIT} , и фирмы с одинаковой степенью производственного риска составляют группу однородного риска.

- Все наличествующие и потенциальные инвесторы имеют одинаковые оценки будущих значений EBIT каждой фирмы; другими словами, инвесторы имеют одинаковые ожидания в условиях неопределенности относительно предполагаемой будущей доходности и рисковости доходов.

- Акции и облигации продаются на идеальных рынках капитала. Это допущение подразумевает среди прочего, что:

- брокерские комиссионные отсутствуют;
- инвесторы (как частные лица, так и организации) могут получить займы под такой же процент, что и корпорации.

Задолженность фирм и частных лиц лишена риска, и поэтому процентная ставка по займам является безрисковой. Данная ситуация выдерживается вне зависимости от размеров заемного капитала, используемого фирмами или частичными лицами.

Все потоки денежных средств имеют бессрочный характер; иными словами, у фирмы нулевые темпы прироста и «ожидаемо постоянные» значения EBIT, а их облигации являются бессрочными с фиксированным процентом. «Ожидаемо постоянные» означает, что фактический уровень доходов может отличаться от ожидаемого.

Акции одного класса фирм гомогенны, являются совершенными субститутами друг друга, различаются только масштабами выпуска.

В условиях частичного микроэкономического равновесия на идеальном рынке цена гомогенных акций одного класса фирм пропорциональна их ожидаемой доходности.

Модильяни и Миллер начали свой анализ, допустив отсутствие каких-либо налогов на доходы корпораций или частных лиц. Исходя из этого и предшествующих утверждений, они выдвинули и алгебраически доказали два утверждения.

Утверждение 1. Рыночная стоимость любой фирмы определяется путем капитализации ее чистой операционной прибыли (EBIT, при $T = 0$, где T – ставка налога) с постоянной ставкой, соответствующей классу риска фирмы:

$$V_U = \frac{EBIT}{WACC} = \frac{EBIT}{k_{su}},$$

где V_L – стоимость фирмы финансово зависимой формы, т.е. использующую заемный капитал;

V_U – стоимость финансово независимой фирмы;

k_{su} – требуемая доходность для фирмы, не использующей заемный капитал;

$WACC$ – средневзвешенная цена капитала.

Предполагается, что обе фирмы находятся в одном классе риска [12].

Поскольку V , как определено формулой, величина постоянная, то по модели Модильяни-Миллера при отсутствии налогов стоимость фирмы не зависит от способа ее финансирования. Это означает так же, что:

- $WACC$ для любой фирмы, с использованием заемного капитала или без него, совершенно не зависит от структуры ее капитала;

- $WACC$ для всех фирм одной группы риска равна цене акционерного капитала финансово независимой фирмы из этой же группы риска.

Утверждение 2. Цена акционерного капитала финансово зависимой фирмы

k_{sL} равна сумме цены акционерного капитала финансово независимой фирмы той же группы риска и премии за риск, величина которой зависит как от разницы между ценами акционерного и заемного капитала для финансово независимой фирмы, так и от уровня финансового левериджа, т.е. от соотношения заемного и собственного капитала:

$$k_{sL} = k_{su} + \text{премия за риск} = k_{su} + (k_{su} - k_d) \cdot \frac{D}{S},$$

где D – рыночная оценка заемного капитала фирмы;

S – рыночная оценка акционерного капитала фирмы;

k_d - постоянная цена заемного капитала [12].

Утверждение 2 констатирует, что по мере увеличения доли заемного капитала фирмы цена ее акционерного капитала также увеличивается, причем математически точным образом.

Рассмотренные вместе два утверждения Модильяни и Миллера означают, что увеличение доли заемного капитала в структуре источников не увеличивает стоимость фирмы, так как выгоды от более дешевого заемного капитала будут в точности уравновешены увеличением степени риска и, следовательно, цены ее акционерного капитала.

Таким образом, теорема Модильяни - Миллера утверждает, что в отсутствии налогов, как рыночная стоимость фирмы, так и общая цена ее капитала не зависят от структуры ее финансовых источников.

Популярно объясняя полученный результат модели, в работе приведен следующий пример: нельзя заработать больше на продаже по отдельности обезжиренного молока и масла, извлеченного из него, чем от продажи исходного молока высокой жирности.

Формальное доказательство строится на рассмотрении арбитражных процессов (одновременной покупке и продажи, идентичных по риску акций с различной ценой), которые осуществляют склонные к риску инвесторы. Независимость цены фирмы от структуры капитала объясняется невозможностью равновесной ситуации существования фирм, идентичных по степени риска и размеру операционной прибыли, но с неравной рыночной ценой. Наличие на рынке переоцененных акций (акции фирм с более высокой ценой) побудит инвесторов, знающих условие равновесия (что переоцененные не будут расти в цене), продавать их и вкладывать средства в акции недооцененных фирм (с низкой ценой фирмы) и получать, таким образом, арбитражный доход. Эти арбитражные операции будут проходить, и давать выигрыш инвестору до тех пор, пока цена на переоцененные акции не упадет, а цена на недооцененные соответственно не возрастет. Таким образом, с помощью оптимизации финансового портфеля инвестора можно максимизировать общую доходность портфеля. В равновесии (при отсутствии возможности арбитражных операций) рыночная стоимость фирм и их *WACC* становятся равными вне зависимости от их структуры капитала [12].

Каждое из допущений, перечисленных выше, необходимо для того, чтобы работало арбитражное доказательство. Например, если производственный риск фирмы неодинаков, арбитражным процессом пользоваться нельзя.

В работе можно найти пример, где авторы проводят корреляционно-регрессионный анализ статистических данных из исследования Ф. Б. Аллена (1947-1948) 43 крупных компаний электроэнергетики в США и Р. Смита (1953) для 42 нефтяных компаний США. Исследование показало отсутствие корреляции между стоимостью капитала компаний и количеством взятых кредитов (долгов) на протяжении рассматриваемого отрезка времени в обоих случаях. Так же они

выявили положительную корреляцию между количеством взятых кредитов и доходностью акций компаний. Это подтверждает основной вывод авторов: ожидаемая норма доходности акций отражает, что умеренное количество долгов (кредитов) компании с репутацией в действительности не прибавляет ее акциям риска неплатежа, то есть владельцам компании не придется выплачивать более высокие дивиденды, чтобы удержать своих акционеров.

Модель Модильяни – Миллера стоимости капитала предприятия с учетом корпоративных налогов

В 1963 году Модильяни и Миллер опубликовали свою вторую работу, в которой было учтено влияние налогов [13]. Приняв во внимание налоги на прибыль корпораций, Модильяни и Миллер сделали вывод о том, что цена акций непосредственно связана с использованием предприятием заёмного финансирования: чем выше доля заёмного капитала, тем выше и цена акций. Ниже приводятся утверждения Модильяни и Миллера, относящиеся к корпорациям, выплачивающим налог на прибыль.

Утверждение 1 описывает нижеприведенная формула. Стоимость финансово зависимой фирмы равна сумме стоимости финансово независимой фирмы из той же группы риска и эффекта финансового левириджа, который представляет собой экономию по уменьшению налоговых платежей, равную ставке налога на корпорации, умноженный на величину заемного капитала [13]:

$$V_U + TD$$

Важным является то, что, когда вводятся корпорационные налоги, стоимость финансово зависимой фирмы превышает стоимость финансово независимой фирмы на величину TD. Эта разница возрастает с увеличением доли заемного капитала, так что стоимость фирмы максимизируется при стопроцентном заемном финансировании.

При отсутствии заемного капитала, $D = 0$ долл., стоимость фирмы равна рыночной оценке ее акционерного капитала (S):

$$V_U = \frac{EBIT * (1 - T_c)}{k_{sU}},$$

где k_{sU} - цена собственного капитала финансово независимой фирмы [13].

Утверждение 2. Цена акционерного капитала финансово зависимой фирмы равна сумме цены акционерного капитала финансово независимой фирмы из той же группы риска и премии за риск, величина которой зависит от разницы между ценой акционерного и заемного капитала финансово независимой фирмы, соотношения заемного и собственного капитала и ставки корпорационного налога [13]:

$$= k_{sU} + (k_{sU} - k_d) * (1 - T) * \frac{D}{S}$$

Формула 1.5 идентична формуле 1.3, за исключением множителя (1-T). Так как (1-T) < 1, обложение корпорации налогами вызывает увеличение цены акционерного капитала с меньшей скоростью, чем это происходит при отсутствии налогов. Именно эта особенность в сочетании со снижением эффективной ставки цены заемного капитала вызывает тот результат, который изложен в утверждении 1, а именно – возрастание стоимости фирмы с увеличением уровня финансового левериджа.

Модель Миллера с учетом влияния налогов на личные доходы

В своем президентском обращении 1976 году к Американской финансовой ассоциации Мертон Миллер представил модель, разработанную для того, чтобы показать, как влияет заемное финансирование на оценку стоимости фирмы с учетом налогов на физических и юридических лиц.

Начиная описание модели, вводятся обозначения:

Tc – ставка налога на корпорации,

Ts – ставка налога на личный доход от владения акциями,

Td – ставка налога на личный доход от предоставления займов.

Необходимо отметить, что доход на акции поступает отчасти в форме дивидендов и отчасти как прирост капитала, так что Ts есть средневзвешенная величина эффективных годовых ставок налога на дивиденды и на доход от прироста капитала, тогда как весь доход инвесторов в виде полученных процентов облагается, в конечном счете, налогом по высшей ставке.

Стоимость финансово независимой фирмы определяется следующим образом [11]:

$$= \frac{EBIT (1 - T_c) (1 - T_s)}{k_{sU}}$$

Член (1 - Td) вносит поправку на налоги на личные доходы. Поскольку введение налогов на личные доходы снижает доход, оставшийся в распоряжении инвесторов, то при прочих равных условиях стоимость фирмы в данном случае уменьшается.

Выводы Миллера могут быть подтверждены путем арбитражного доказательства, по приводимому здесь альтернативному доказательству следовать легче.

Разделив денежный поток фирмы, использующей заемный капитал (CFL) на поток идущий акционерам, и поток, направляемый держателям облигаций получим [11]:

CFL = CF акционерам + CF держателям облигаций,

CFL = (EBIT - I)*(1 - Tc)*(1 - Ts) + I*(1 - Td),

где I – сумма процентов по долгу за год.

$$CFL = EBIT \cdot (1 - T_c) \cdot (1 - T_s) - I \cdot (1 - T_c) \cdot (1 - T_s) + I \cdot (1 - T_d).$$

Поскольку все денежные потоки являются бессрочными, к ним применима основная модель оценки бессрочной ренты ($V = CF / k$):

$$V_L = \frac{EBIT \cdot (1 - T_c) \cdot (1 - T_s)}{k_{sU}} - \frac{I \cdot (1 - T_c) \cdot (1 - T_s)}{k_d} + \frac{I \cdot (1 - T_d)}{k_d}$$

Принимая во внимание формулу 1.8, получаем [11]:

$$V_L = V_U + \frac{I \cdot (1 - T_d)}{k_d} \left[1 - \frac{(1 - T_c) \cdot (1 - T_s)}{1 - T_d} \right]$$

или

$$= V_U + D \left[1 - \frac{(1 - T_c) \cdot (1 - T_s)}{1 - T_d} \right].$$

Следствия:

Член, взятый в квадратные скобки, умноженный на D, представляет собой выигрыш от использования заемного капитала.

Если игнорировать все налоги, т.е. $T_c = T_s = T_d = 0$, то член, заключенный в квадратные скобки превратится в ноль, и в этом случае формула 1.9 становится такой же, как в первоначальной модели Модильяни-Миллера.

Если $T_s = T_d = 0$, то член в квадратных скобках уменьшается до T_c , так что уравнение становится как в модели Модильяни-Миллера с учетом налогов на корпорации.

Если $T_s = T_d$, то заключенный в квадратные скобки член равен T_c .

Если $(1 - T_c) \cdot (1 - T_s) = 1 - T_d$, то член в квадратных скобках равен нулю и эффект финансового левериджа становится нулевым. В этом случае преимущество заемного капитала с точки зрения налогообложения фирмы точно уравновешивается преимуществом акционерного капитала с точки зрения налогообложения личных доходов. При этом условии структура капитала не оказывает влияния на стоимость фирмы или цену ее капитала, т.е. происходит возврат к первоначальной теории нулевых налогов Модильяни-Миллера [11].

Следует отметить, что, как правило, когда эффективная ставка налога на доход от акций меньше эффективной ставки налога на доход от облигаций, модель Миллера дает меньшее значение выгоды от использования заемного капитала, чем можно рассчитывать по модели Модильяни-Миллера с учетом налогов.

Ограничения модели Модильяни-Миллера

Оппоненты теорий Модильяни-Миллера и Миллера обычно критикуют их на том основании, что сделанные допущения неверны. Основные возражения следующие:

Критики говорят о неравноценности для инвестора личного и корпоративного финансового риска. Арбитражные операции означают для инвестора варьирование личного и корпоративного финансового рычагов, при этом в подходах Модильяни-Миллера и Миллера не учитывается, что по личному долгу ставки процента будут больше из-за большего риска и для инвестора корпоративный финансовый риск предпочтительнее из-за отсутствия угрозы личного банкротства.

Модели Модильяни-Миллера и Миллера пренебрегают брокерскими затратами, что делает переход от фирмы L к фирме U «бесплатным». Однако в реальном мире наличествуют и брокерские, и другие транзакционные затраты, что затрудняет арбитражный процесс.

3. Модильяни и Миллер первоначально допустили, что корпорации и инвесторы могут привлекать заемный капитал по безрисковой ставке. Для того чтобы прийти к тем выводам, которые вытекают из моделей Модильяни-Миллера и Миллера, необходимо все же накладывать ограничение: процентная ставка при привлечении заемного капитала должна быть одинаковой для корпораций и инвесторов. Хотя крупнейшие институциональные инвесторы, вероятно, и могут получать займы с той же ставкой процента, что и корпорации, многим таким инвесторам вообще не позволено привлекать заемный капитал для покупки ценных бумаг. Кроме того, большинству индивидуальных инвесторов, по всей вероятности, приходится брать займы под более высокий процент по сравнению с крупными корпорациями.

4. Миллер в своей статье сделал вывод, что равновесие может быть достигнуто, но для этого налоговая выгода от заемного финансирования корпораций должна быть:

- одинакова для всех фирм;
- постоянной для отдельной фирмы независимо от объема заемного капитала.

Однако налоговая выгода различна для разных фирм: высокодоходные компании получают от заемного капитала максимальную налоговую выгоду, когда как для фирм, борющихся за существование, она гораздо меньше. Кроме того, некоторые фирмы имеют другие формы защиты от налогов, например высокие амортизационные отчисления, взносы в пенсионный фонд, скидки на операционные убытки прошлых периодов, и эти формы защиты уменьшают сумму экономии за счет уплаты процентов. Было бы также упрощением предполагать, что ожидаемая налоговая экономия не зависит от объема заемного капитала. Более высокая доля заемного капитала увеличивает вероятность того, что фирма не сможет в будущем эффективно использовать возможность налоговой экономии, так как при увеличении этой доли повышается вероятность убыточности фирмы в будущем и, как следствие этого, более низких налоговых ставок. С учетом всех факторов

кажется вероятным, что защита от налога посредством использования заемного капитала для одних фирм имеет большую значимость, чем для других.

5. Модели Модильяни-Миллера и Миллера не предусматривают затраты, связанные с финансовыми затруднениями. Кроме того, они игнорируют агентские затраты.

Поскольку теория Модильяни-Миллера базировались на целом ряде предпосылок, носящих ограничительный характер, дальнейшие исследования в данной области были посвящены изучению возможностей ослабления этих ограничений.

ЛИТЕРАТУРА

12. Бельзевская А. Марксизм и радикальная экономическая теория. Курсовая работа. Минск: БГУ, 2009. 20 с.
13. Бельзевская А. Теория формирования цены финансовых активов. Курсовая работа. Минск: БГУ, 2010. 43 с.
14. Боди З., Кейн А., Маркус А. Принципы инвестиций. М.: Вильямс, 2002. 984 с.
15. Бём-Баверк О. Критика теории Маркса. Челябинск: Социум, 2002. 283 с.
16. Глава III. Марксизм // Жид Ш., Рист Ш. История экономических учений - М.: Экономика, 1995. [Электронный ресурс]. Режим доступа: <http://gallery.economicus.ru/cgi-bin/alln.pl?type=school#school09>. Дата доступа : 30.10.2012.
17. Кузнецова Л. Методология оценивания стоимости и хеджирования финансовых активов: автореф. дис. ... докт. экон. наук: 08.00.10 / ТГЭУ - Владивосток, 2007. 43 с.
18. Лялин В., Воробьев П. Рынок ценных бумаг. М.: ТК Велби, Проспект, 2007. 384 с.
19. Маркс К. Капитал. М.: Партиздат ЦК ВКП(б), 1936. Т. 1. 665 с.
20. Маршалл А. Принципы экономической науки. [Электронный ресурс]. – <http://ek-lit.narod.ru/marsod.htm>. – Дата доступа : 08.11.2012.
21. Шарп У., Александер Г., Бэйли Дж. Инвестиции. М.: ИНФРА-М, 1997. 1024 с.
22. Merton H. Miller: Leverage. Nobel lecture, December 7, 1990 by Graduate School of Business, University of Chicago, Chicago, Illinois, USA, pp. 10.
23. Modigliani F., Miller M. H. The Cost of Capital, Corporation Finance and the Theory of Investment // Amer. Econ. Rev. 1958. June. P. 261-297.
24. Modigliani F., Miller M. H. Taxes and the Cost of Capital : A Correction // Ibid. 1963. June. P. 433-443.

Теория транзакционных издержек и институциональных изменений Дугласа Норта

Коноплицкая Е.

Дуглас Норт является одной из ключевых фигур неоинституционализма в экономической теории. В 1993 году Норт стал лауреатом Нобелевской премии в области экономики «за возрождение исследований в области экономической истории, благодаря приложению к ним экономической теории и количественных

методов, позволяющих объяснять экономические и институциональные изменения» [1].

К пониманию роли транзакционных затрат Дуглас Норт пришёл под воздействием работ Р. Коуза «Природа фирмы» (1937 г.) и «Проблема социальных издержек» (1961 г.). Теорию транзакционных издержек Дуглас Норт рассматривал в качестве одной из двух составляющих теории институтов. По его мнению, объединение теории транзакционных издержек и теории человеческого поведения даёт возможность понять, почему и с какой целью существуют институты, а так же какую роль они играют в жизни общества. «Затратность информации является ключом к пониманию издержек транзакций, которые состоят из издержек оценки полезных свойств объекта обмена и издержек обеспечения прав и принуждения к их соблюдению» [3, с.45]. Эти издержки служат источником экономических, социальных и политических институтов и их изменений.

В работе «Институты, институциональные изменения и функционирование экономики» (1990 г.) понятие «институт» определяется как -:«правила игры» в обществе, или, выражаясь более формально, созданные человеком ограничительные рамки, которые организуют взаимоотношения между людьми. Институциональные изменения определяют то, как общества развиваются во времени, и таким образом являются ключом к пониманию исторических перемен» [3, с.17]. Идентификация институтов уменьшает неопределённость, что способствует установлению устойчивой структуры взаимодействия между людьми. Другими словами, «институты определяют и ограничивают набор альтернатив, которые имеются у каждого человека» [3, с.18]. Однако, устойчивость институтов не противоречит тому факту, что они претерпевают изменения. Норт утверждал, что изменяются все институты, будь то формальные правила или неформальные отношения. «Институциональные изменения – это сложный процесс, потому что предельные изменения могут быть следствием изменений в правилах, неформальных ограничениях, в способах и эффективности принуждения к исполнению правил и ограничений» [3,с.21]. Вместе с тем отмечено, что неформальные правила, к которым можно отнести традиции, культурное наследие общества (вектор поведения), изменяются гораздо медленнее, чем формальные правила. Это ключевое положение отвечает на вопрос, почему одни страны экономически растут быстрее остальных?

Издержки оценки

Полезность, которую человек получает от кого-либо изделия или услуги, возникает из различных их свойств. Норт приводит пример с покупкой автомобиля: «Покупая автомобиль, я получаю взамен определённые цвет, скорость, оформление, отделку салона, пространство для ног, потребление бензина на одну милю - всё это ценимые мною свойства, хотя то, что я купил - это только автомобиль» [3, с.47]. Данный пример наглядно демонстрирует, что «ценность акта обмена для его участников состоит в ценности различных свойств, соединяемых

воедино предметом или услугой» [3, с.48]. Обе стороны обмена пытаются установить свойства объекта обмена, которые представляют для них ценность, что влечёт за собой издержки оценки данного объекта обмена и издержки установления прав, передающихся при обмене.

Товары и услуги имеют большое количество свойств и степень их проявления. Для полной, качественной и точной оценки степени проявления различных свойств требуется большое количество затрат [3, с.49]. Однако также следует учитывать наличие такого понятия, как асимметрия информации. В примере с автомобилем продавец данного вида товара намного лучше разбирается в автомобилях и в его полезных свойствах, чем его покупатель. Помимо того, что один участник обмена лучше знаком с полезными свойствами предмета обмена, чем другой участник, он ещё может получить дополнительную выгоду от скрытия информации об этих свойствах [3, с.49]. Однако скрывать информацию не всегда выгодно, и участники обмена стремятся раскрыть полную информацию.

Далее Норт приходит к некоторым обобщениям по поводу аспектов оценки модели обмена с транзакционными издержками. Сперва он рассматривает стандартную неоклассическую модель Вальраса. Исходя из этой модели общего равновесия, товары являются идентичными, обмен происходит мгновенно и рынок находится в единой точке пространства. Модель также предусматривает, что для индивидов доступна полная информация о товаре, и условия сделки также известны обеим сторонам [3, с.49]. Как отмечалось ранее, эти издержки состоят из издержек по оценке полезных свойств товаров, услуг и различных характеристик агентских функций. Из-за наличия данных издержек логично предположить, что затрачиваются немалые ресурсы для контроля, оценки и принуждения к выполнению соглашения [3, с.50]. Ввиду того, что полная оценка полезных свойств требует определённых затрат, всегда существует возможность получения дополнительной выгоды при условии направления ресурсов на получение более детальной информации. Норт приводит пример, в котором продавец фруктов может посчитать для себя невыгодным тщательно сортировать свой товар. В свою очередь покупатель может посчитать для себя выгодным потратить своё время, чтобы выбрать лучшие фрукты из предложенных ему продавцом. В этом случае продавец предоставляет покупателю возможность бесплатно получить дополнительные полезные свойства, если покупатель потратит свои усилия и время для сортировки товара. Из-за большого разнообразия характеристик и издержек оценки свойств товаров, услуг и агентских функций идеальные права собственности на права и ресурсы могут принимать различные формы. Существуют случаи, в которых оптимальной формой было бы разделение прав между участниками обмена. В целом Норт утверждает, что «чем проще посторонним лицам влиять на полезность принадлежащего кому-либо блага, не неся при этом полных издержек, связанных с этим влиянием, тем ниже ценность блага. В результате этого максимизация ценности блага требует такой структуры собственности, при которой стороны, способные влиять на множество конкретных свойств блага, могут предъявить

остаточные права на пользование этими свойствами» [3, с.50]. В этом случае стороны обмена реально принимают на себя ответственность за свои действия, что заставляет их максимизировать потенциальные выгоды обмена.

Издержки обеспечения условий транзакций и прав собственности

Именно из-за того, что покупателям неизвестны свойства товара или услуги, или характеристики деятельности агентов, им приходится затрачивать ресурсы на осуществление оценки и контроля этих свойств и характеристик. Следовательно, возникают вопросы, которые связаны с соблюдением условий транзакций. Одним из таких вопросов, по мнению Норта, является вопрос «Кто обеспечивает соблюдение условий транзакций?». Ответ на этот вопрос он демонстрирует на примере отношения между хозяином и рабом. Норт отмечает, что между ними существует неявно выраженный контракт, а именно, «чтобы получить максимум отдачи от раба, хозяин должен тратить ресурсы для контролирования и измерения производимой им работы и продуманно применять награды и наказания в зависимости от результатов труда раба. Ввиду возрастающих предельных издержек осуществления оценки и контроля хозяину невыгодно устанавливать всеобъемлющий контроль за трудом раба, и он будет осуществлять контроль только до тех пор, пока предельные издержки не сравняются с дополнительным предельным доходом от контроля за рабом» [3, с.51]. В результате этого раб приобретает по отношению к своему труду определённые права собственности. Таким образом, Норт в изложенном выше примере ввёл понятие прав собственности. «Во всех исследованиях по проблеме «принципал - агент» и проблемам осуществления контроля, мы исходим из допущения, что принципал имеет власть, достаточную для подчинения себе агента и тем самым соблюдения условий соглашения. Аналогичным образом агент имеет возможность наблюдать за соблюдением принципалом своих обязательств и обеспечивать свои (агента) права и интересы, вытекающие из соглашения» [3, с.52]. Соблюдение условий транзакций может не представлять проблем, если в этом соблюдении заинтересованы все участники обмена. А также соблюдение условий сделки могут вытекать и из опасения того, что другой участник сделки примет ответные действия. Однако если одна из сторон преследует исключительно свои интересы и выгоды, возникает проблема проведения сложных форм обмена из-за сомнений по поводу того, что другая сторона сочтёт для себя выгодным соблюдать условия и соглашения.

Дуглас Норт определяет права собственности в качестве прав, которые индивиды относят к своему труду, к товарам и услугам, находящимся в их владении. Так как при любой структуре прав собственности издержки транзакций больше нуля, следовательно, определение прав собственности и контроль за соблюдением этих прав никогда не бывает полными. Некоторые блага находятся в общественной собственности, и индивиды должны были бы понести расходы, если бы они захотели взять эти блага в свою собственность. Так как, по мнению Норта, на протяжении истории транзакционные издержки коренным образом изменялись,

существуют большие «различия в пропорциях сочетания между юридической защитой прав, индивидуальными попытками присвоить себе некоторые права и индивидуальными усилиями по защите собственных прав» [3, с.53]. Причиной таких различий по Норту является разная институциональная структура.

Институты образуют структуру для обмена, которая определяет издержки осуществления транзакций и издержки трансформации. Тем самым, институты структурируют экономический обмен в огромном разнообразии форм, которые, однако, имеют несколько общих типов в рамках модели обмена с транзакционными издержками [3, с.53]. Согласно Нарту выделяются три формы обмена:

1) Персонифицированная форма обмена - это форма обмена, господствующая на протяжении большей части экономической истории. Характеризуется повторяемостью, наличием общего набора ценностей, то есть культурной гомогенностью, и отсутствием контроля и принуждения со стороны третьих лиц. В условиях персонифицированного обмена транзакционные издержки были низкими, однако трансформационные издержки были высокими, так как разделение труда и специализация были неразвиты. Такой обмен проходил в условиях небольших торговых или экономических общностях;

2) Неперсонифицированная форма обмена стала развиваться ввиду того, что по мере роста масштабов обмена сторонами обмена была предпринята попытка установить наиболее устойчивые связи с клиентами или персонифицировать обмен, однако, «чем разнообразнее становился обмен, тем более сложные соглашения требовались между сторонами, и тем труднее было заключать такие соглашения» [3, с.54];

3) Неперсонифицированный обмен с контролем, осуществляемым третьей стороной - это форма обмена, которая поспособствовала достижению успеха современных экономических систем, отличающихся сложными контрактными отношениями. Третья сторона в данной форме обмена выполняет функцию принуждения. Необходимость в данной функции возникла из-за того, что для общества становятся выгодными такие формы поведения, как мошенничество и обман. Поэтому так важна третья регулирующая сторона обмена.

Исходя из представленных выше форм обмена, Норт заключает, что для разработки институциональной модели необходимо изучить формальные правила и неформальные ограничения.

Неформальные ограничения и формальные правила

Во всех обществах люди накладывают на себя ограничения, которые помогают структурировать отношения с окружающими. В условиях неполноты информации и недостаточной способности производить расчёты эти ограничения снижают издержки взаимоотношений между людьми по сравнению с тем, что было бы в отсутствии институтов [3, с.56]. Несмотря на то, что формальные правила гораздо легче поддаются описанию, чем неформальные ограничения, всё же данные ограничения имеют большое значение. Неформальные правила пронизывают всю

нашу жизнь. На вопрос «откуда берутся неформальные ограничения?» Норт отвечает, что они возникают из информации, передаваемой посредством социальных механизмов, и являются частью того наследия, которое называем культурой. Одним из элементов культуры являются обычаи. Важная характеристика обычая состоит в том, что учитывая издержки обмена, обе стороны весьма заинтересованы в минимизации издержек оценки [3, с.62]. Следовательно, обмен способствует закреплению принятых обычаев. С точки зрения общих ресурсов, затрачиваемых на транзакции в рамках всей экономики, на обычаи, решающие проблему координации, приходится, вероятно, большая часть транзакционных издержек по сравнению с другими неформальными ограничениями [3, с.63].

Неформальные ограничения имеют такие свойства, которые способствуют процессам обмена, сокращая при этом издержки оценки и издержки соблюдения условий обмена. По мнению Норта, если бы не было неформальных ограничений, то асимметричность информации потребовала бы привлечение больших дополнительных ресурсов для оценки, и возможно помешала бы процессу обмена из-за того, что соблюдение его условия было бы невозможно проконтролировать.

Формальные правила отличаются от неформальных ограничений только по степени проявления. Переход от неформальных ограничений к формальным правилам осуществляется за счёт перехода от менее сложных обществ к более сложным. Такое возрастание сложности обществ выражается в увеличении степени разделения труда и специализации.

Норт считает, что формальные правила могут дополнять неформальные ограничения, повышая при этом их эффективность. Они способствуют снижению издержек получения информации, контроля и принуждения и, следовательно, позволяют неформальным ограничениям регулировать более сложные операции обмена.

Формальные правила состоят из политических, юридических и экономических правил и контрактов. Политические правила определяют фундаментальную и иерархическую структуру общества. Экономические правила определяют и устанавливают права собственности. Права собственности - это пучок прав по использованию и получению дохода от собственности и ограничению доступа других лиц к имуществу или ресурсу [3, с.68]. Функция формальных правил - облегчение политического и экономического обмена.

При создании правил также учитываются и возможные «издержки защиты правила». То есть предусматриваются такие механизмы, которые позволяют выявить нарушение правил, установить степень нарушения и наказать нарушителя. В «издержки защиты правил» включается оценка поведения экономических агентов и оценка характеристик товаров и услуг обмена.

При рассмотрении формальных правил, можно сделать заключение, что политические правила формируют экономические, однако прослеживается и обратная зависимость. Другими словами, политические решения определяют и

устанавливают права собственности и, следовательно, контракты. Хотя следует заметить, что структура экономических интересов также имеет влияние на политическую структуру. «В состоянии равновесия данная структура прав собственности (и механизма их обеспечения) будет соответствовать конкретному набору политических правил и механизмов их обеспечения. Изменения на одной стороне приведут к изменению на другой стороне» [3, с.70].

Общество является источником всех правил; «далее они опускаются на уровень прав собственности и затем на уровень индивидуальных контрактов. Контракты отражают структуру стимулов и анти-стимулов, коренящуюся в структуре прав собственности (и механизмов их обеспечения); таким образом, набор альтернатив, открывающихся перед игроками, и те формы организаций, которые они создают при заключении конкретных контрактов, проистекают из структуры прав собственности» [3, с.74]. Экономическая теория рассматривает контракт, обладающий такими характеристиками, как простоты, определённости и полнота. Более того, такой контракт предполагает обмен определённым товаром в краткий период времени. В реальной экономике предметом заключения контракта становится товар с множеством различных свойств и измерений, а обмен может занимать продолжительный период времени. Исходя из такой характеристики контракта стороны, заключающие контракт, должны договариваться о множестве условий. Норт подчёркивает, что контракты не только создают чётко определённые границы, которые позволяют получить эмпирические свидетельства о формах организации, но и являются ключом к тому, каким именно образом участники обмена будут структурировать более сложные формы организации. Говоря иначе, контракты отражают различные способы облегчения обмена.

Изменения в неформальных ограничениях осуществляются постепенно и часто могут являться подсознательными, формируя альтернативные модели поведения. Формальные правила устанавливаются и поддерживаются сознательно, чаще всего государством. Изменения формальных институтов могут происходить одномоментно и быть результатом принятия каких-либо юридических или политических решений. Институты формальных правил чаще всего представляют собой своего рода иерархию. Такая иерархия включает правила высшего порядка (например, конституция) и правила низшего порядка (например, административный акт). Правила высшего порядка изменяются гораздо дольше и значительно труднее, чем правила низшего порядка [2, с.124]. Таким образом, институциональные изменения – это сложный процесс, который носит непрерывный характер.

Институциональные изменения

Согласно Дугласу Норту институты (как формальные, так и неформальные) претерпевают изменения, а «самым важным источником этих изменений являются фундаментальные изменения в соотношении цен. Дело в том, что оно изменяет стимулы, испытываемые индивидом в процессе человеческих отношений, и единственным другим источником институциональных изменений выступают

изменения вкусов» [3 ,с.109]. Технический прогресс, появление новых видов продукции, открытие новых рынков, рост населения и так далее ведут к изменению цен конечной продукции по отношению к ценам факторов производства или к изменению цен одних факторов по отношению к изменениям цен других. В этих случаях участники транзакции начинают осознавать необходимость пересмотра условий этой сделки. В результате будет предпринята попытка изменения условий соглашения с учётом изменившихся цен. Но ввиду того, что ранее заключённые соглашения встроены в иерархическую систему правил, то такой пересмотр контрактов может потребовать пересмотра какого-либо правила более высокого порядка. Неформальные ограничения под влиянием ценовых сдвигов тоже могут измениться, однако этот процесс будет постепенным и происходить по мере формирования альтернативных моделей поведения [2 ,с.124].

С течением времени происходящие фундаментальные изменения в соотношении цен приводят к сильным изменениям стереотипов человеческого поведения и рационализации тех категорий, которые образуют стандарты поведения. Одним из примеров таких фундаментальных институциональных изменений Норт приводит распространённое движение за отмену рабства. «Ещё во время Гражданской войны в США институт рабства был экономически выгоден. Например, вопрос о рабстве использовался для того, чтобы изменить соотношение сил сторон в региональных конфликтах между Севером и Югом по поводу отношений с американским Западом в контексте проблем политического контроля Конгресса США в первой половине XIX века. Но именно интеллектуальная сила движения за отмену рабства позволила политикам эксплуатировать эту тему» [3, с.110]. Норт подчёркивает в этой ситуации то, что за счёт институциональной структуры избирательного процесса, индивиды имели возможность выражать своё крайне негативное отношение к рабству с наименьшими для них издержками, то есть, не причиняя ущерб себе, и в это же время «назначать очень высокую «цену» рабовладельцам [3 ,с.111]. По мнению Норта, основное здесь то, что такая институциональная структура не давала рабовладельцам Юга никаких возможностей, чтобы откупиться от избирателей и помешать им выразить свои убеждения в ходе голосования. Исходя из этого исследования, Дуглас Норт делает вывод, что снижая цену, которую индивиды платят за свои убеждения, институты делают идеи, догмы, экстравагантные убеждения и идеологии важным источником институциональных изменений.

В работе Норта «Институты, институциональные изменения и функционирование экономики» процесс институциональных изменений описывается следующим образом. Происходит изменение в соотношении цен, что приводит политическую и/или экономическую сторону акта обмена к выводу, что для одной из сторон (или обеих) было бы выгодно изменить условия соглашения. Следовательно, ими предпринимаются попытки пересмотреть условия этого соглашения. Но ввиду того, что существует иерархическая система правил, куда, в том числе, включаются и соглашения, пересмотр условий невозможен без

изменения правил высшего порядка в этой иерархии. В этом случае та сторона, которая стремится усилить свои переговорные позиции, возможно, захочет затратить ресурсы на изменение правил высшего порядка. Изменение в соотношении цен или изменение вкусов ведёт к постепенному разрушению норм поведения и их замене другими нормами [3, с.112].

ЛИТЕРАТУРА

1. Douglass C. North [Электронный ресурс]. - Режим доступа: http://www.nobelprize.org/nobel_prizes/economics/laureates/1993/north.html
2. Гульбина Н.И. Теория институциональных изменений Д. Норта [Электронный ресурс]. – Режим доступа: <http://sun.tsu.ru/mminfo/000063105/283/image/283-123.pdf>
3. Норт Д. Институты, институциональные изменения и функционирование экономики / Пер. с англ. А.Н. Нестеренко; предисл. и науч. Ред. Б.З. Мильнера. - М.: Фонд экономической книги «Начала», 1997. - 180 с. - (Современная институционально-эволюционная теория)

Методологические основы глобализации в развитии мировой экономики

Курьянович Е.

На современном этапе внешнеэкономические факторы воздействуют почти на любой вид хозяйственной деятельности. Игнорирование, как хозяйствующим субъектом, так и отдельной страной в целом интеграционных процессов, происходящих в мировой экономике, ведет к значительным издержкам. Речь идет о своеобразном вызове, который глобальная экономическая система бросает экономике отдельных стран, вследствие чего происходит нивелировка национальных различий, в которых скрыты корни конкурентных преимуществ, позволяющих предприятиям, базирующимся в данной стране, успешно конкурировать с иностранными фирмами в тех или иных отраслях и секторах экономики

Глобализация является историческим процессом, развивающимся на протяжении столетий и остается еще незавершенным.

Исходя из специфики моего исследования, стоит определить соотношения между понятиями «глобализация», «интернационализация хозяйственной жизни», «международное экономическое сотрудничество», «международная экономическая интеграция», чему и будет посвящена первая часть статьи.

В результате международной кооперации производства, формирования международного разделения труда, внешней торговли и международных экономических отношений в целом происходит усиление взаимосвязи и взаимозависимости национальных экономик, нормальное развитие которых невозможно без учета внешнего фактора. Данное явление носит название «интернационализация хозяйственной жизни». Интернационализация хозяйственной деятельности — это усиление взаимосвязи и взаимозависимости

экономик отдельных стран, влияние международных экономических отношений на национальные экономики, участие стран в мировом хозяйстве.

В своем развитии интернационализация экономики прошла ряд этапов. Вначале она представляла собой международное экономическое сотрудничество: затрагивала сферу обращения и была связана с возникновением международной торговли в конце XVIII- начале XX века. В конце XIX века набирает силу международное движение капитала. Международное экономическое сотрудничество означало развитие устойчивых хозяйственных связей между странами и народами, выход воспроизводственного процесса за рамки национальных границ. Следующим этапом стала международная экономическая интеграция, обусловленная углублением международного разделения труда, интернационализацией капитала, повышением степени открытости национальных экономик и свободы торговли. В общем виде международную экономическую интеграцию можно охарактеризовать как процесс хозяйственного объединения стран на основе разделения труда между отдельными национальными хозяйствами, взаимодействия их экономик путем развития глубоких устойчивых взаимосвязей. Также стоит отметить, что международная экономическая интеграция — это достаточно высокая и перспективная ступень развития мировой экономики, качественно новый и более сложный этап интернационализации хозяйственных связей. На этой ступени происходит не только сближение национальных экономик, но и обеспечивается совместное решение экономических задач. Поэтому экономическую интеграцию можно представить как процесс экономического взаимодействия стран, приводящий к сближению хозяйственных механизмов, принимающий форму межгосударственных соглашений и согласованно регулируемый межгосударственными органами.

В качестве характерной особенности интеграционных объединений в настоящее время можно назвать их развитие как на двусторонней, так и на региональной или на глобальной основе. Такое сотрудничество нескольких государств приводит к созданию отдельных блоков. Например, созданы Евросоюз (ЕС), Ассоциация государств Юго-Восточной Азии (АСЕАН), Содружество Независимых Государств (СНГ), Североамериканское соглашение о свободной торговле (НАФТА). В рамках данных организаций государства принимают решения, касающиеся экономических взаимоотношений, условий экспорта и импорта, а также внутренней экономической политики, которая в силу нового характера мирового хозяйства практически неотделима от международных процессов.

Каждый из созданных блоков имеет свой уровень экономической интеграции. При этом в зависимости от такого уровня обычно выделяют:

- зоны свободной торговли;
- таможенные союзы;
- страны общего рынка;
- экономические союзы.

Наиболее высокий уровень экономической интеграции на региональных рынках присущ экономическим союзам и самый низкий уровень такой интеграции имеют зоны свободной торговли. На современном этапе происходят глубокие изменения во всей системе международных отношений. Существенной их чертой становится глобализация. По праву глобализацию можно назвать высшей стадией интернационализации мировой экономики. Экономическая интеграция вполне вписывается в процесс глобализации, составляя его ядро, а сама глобализация представляет собой более высокую стадию интернационализации, ее дальнейшее развитие.

Следует отметить то, что на данный момент о дате начала глобализации ведется много споров. Но есть основания утверждать, что процесс глобализации начался с началом самой истории. В научной литературе, однако, начало глобализации обычно связывают с теми или иными событиями западной истории. Историки отмечают значение первого кругосветного путешествия в 1519-1521 гг. Сторонники теории мировой экономики увязывают начало глобализации с экспансией западного капитализма в период после XVI века. Некоторые специалисты в области экономической истории указывают, что именно рубеж девятнадцатого и двадцатого веков был точкой наивысшего подъема международной торговли и инвестиций, пока Первая мировая война и Великая депрессия не запустили цепную реакцию протекционизма. Социолог Р.Робертсон считает, что глобализация началась в период между 1875 и 1925 гг., когда мир был поделен на временные пояса, введена международная линия смены дат, почти повсеместно принят грегорианский календарь, создана международная система телеграфной связи. Еще одна группа ученых связывает начало глобализации с окончанием Второй мировой войны, наступлением ядерного века, освобождением колоний, возобновлением международной торговли и инвестиций и экономическим ростом северо-восточной Азии. Некоторые связывают появление глобализации с возникновением *Rex Americana* в начале 1970-х (В начале 1970-х годов Бреттон-Вудская система была отменена, и единственной мерой стоимости стал доллар - сам по себе, обеспеченный только экономической и политической мощью США) или триумфом неолиберальной идеологии в начале 1980-х. В середине 80-х гг. XX в. американские авторы обозначили им появление нового типа социальности и миропорядка, который по всем формам и параметрам – социальной организации, власти, идеологии, экономики, образа жизни и т. д. – отличается от ныне существующего.

Наконец, следует отметить, что появление этого термина связывают с именем Т. Левита, который в статье, опубликованной в «*Harvard Business Review*» в 1983 г., обозначил им факт слияния рынков отдельных продуктов, производимых крупными многонациональными корпорациями. Распространение же он получил благодаря американскому социологу Роланду Робертсону, который в 1985 году дал наиболее употребляемое определение понятию «глобализация» - «Глобализация - это серия эмпирически фиксируемых измерений, разнородных, но объединяемых

логикой превращения мира в единое целое», а в 1992 г. изложил основы своей концепции в книге «Социальная теория и глобальная культура», и японцу Кеничи Омае, опубликовавшему в 1990 г. бестселлер «Мир без границ».

Исходя же из цели исследования, представленной в статье, рассмотрим понятие глобализации применительно к мировой экономике.

Дискуссии о том, что такое глобализация, начавшиеся в тот период, когда исследователи начали осмысливать новый феномен, не только не прекратились, но и приобрели глубину и масштаб. Глобализация подразумевает международный характер рынков сбыта, что способствует увеличению производства, снижению затрат и, в свою очередь, расширению, усилению международного производства. В современных западных исследованиях экономистов и политологов глобализация рассматривается через призму либерализации торговли, участие страны в глобальных процессах определяется уровнем индекса открытости, составной частью которого является торговый оборот. Глобализация как объективный процесс является реализацией на межнациональном уровне общих закономерностей, возникших и проявившихся в начале в экономических системах низших уровней: общего экономического закона общественного разделения труда и повышения его производительности, концентрации производства и централизации капитала. Они лежат в основе экономического развития отрасли, сектора экономики, национальной экономической системы. Все это - единый процесс образования экономических систем разного уровня, в основе которого лежит закон роста производительности.

Современная глобализация мировой экономики выражается в следующих процессах:

- углублении, прежде всего, интернационализации производства, а не обмена, как это было раньше. Интернационализация производства проявляется в том, что в создании конечного продукта в разных формах и на разных стадиях участвуют производители многих стран мира. Промежуточные товары и полуфабрикаты занимают все большую долю в мировой торговле и в межкорпоративных трансфертах. Институциональной формой интернационализации производства выступают транснациональные корпорации;

- углублении интернационализации капитала. Под интернализацией капитала обычно подразумевают рост международного движения капитала между странами, прежде всего, в виде прямых инвестиций (причем объемы прямых иностранных инвестиций растут быстрее, чем внешняя торговля и производство), интернационализации фондового рынка;

- глобализации производительных сил через обмен средствами производства и научно-техническими, технологическими знаниями, а также в форме международной специализации и кооперации, связывающих хозяйственные единицы в целостные производственно-потребительские системы;

- формировании глобальной материальной, информационной, организационной инфраструктуры, которая обеспечивает осуществление международного сотрудничества;

- увеличении масштабов международной миграции рабочей силы.

Все более важным направлением международного сотрудничества становится сфера услуг, которая развивается быстрее сферы материального производства.

Учитывая, что для транснациональных корпораций внешнеэкономическая деятельность в большинстве случаев имеет более важное значение, чем внутренние операции, они выступают основным субъектом глобализационных процессов. Транснациональные корпорации - это основа глобализации, ее главная движущая сила. Они уже продолжительное время организуют разработку своих изделий в одной стране, изготовление – в другой, продажу – в третьей. Это позволяет минимизировать издержки и максимизировать прибыли.

Обычно выделяют 3 уровня глобализации:

На макроэкономическом уровне (затрагивает региональную, национальную экономику) глобализация проявляется в стремлении государств и интеграционных объединений к экономической активности вне своих границ за счет либерализации торговли, снятия торговых и инвестиционных барьеров, создания зон свободной торговли и т.п.

На микроэкономическом уровне (касается отдельных компаний) глобализация проявляется в стремлении к расширению деятельности компаний за пределы внутреннего рынка. Большинству крупнейших транснациональных корпораций приходится действовать в глобальных масштабах: их рынком становится любой район с высоким уровнем потребления, они должны быть способны удовлетворять спрос потребителей везде, независимо от границ и национальной принадлежности. Компании мыслят в глобальных категориях покупателей, издержек, поставок и конкурентов. Различные звенья и стадии проектирования, производства и сбыта продукции размещаются в разных странах, унифицируясь в международном масштабе. За счет использования трансфертных поставок, цен, благоприятных условий воспроизводства, лучшего учета рыночной ситуации создание и развитие транснациональных фирм позволяет обойти множество барьеров.

На мезо-уровне процесс глобализации охватывает товарные, финансовые и валютные, рынки труда.

Скептики процесса глобализации утверждают, что глобализационному тренду последних двадцати лет уделяется слишком много внимания. Такова позиция и Пола Херста, оксфордского политолога и сторонника лейбористов, который придерживается такой точки зрения: «во-первых, глобализационный тренд вовсе не является беспрецедентным в мировой истории, а во-вторых, международные инвестиции и торговля в основном сосредоточены в треугольнике Северная Америка-Япония-Западная Европа». Политолог Роберт Уэйд указывает,

что объем торговли все еще мал по сравнению с национальными экономиками; инвестиции компаний в своих странах намного превышают инвестиции за рубежом и т.д.; к тому же, огромная часть земного шара (Африка, Южная и Средняя Азия) очень мало затронута глобальными процессами. Подобные возражения важны тем, что позволяют нам более осторожно воспринимать мифы о неизбежности и необратимости глобализации. Следует, впрочем, сделать две оговорки. Во-первых, никто и не утверждает, что глобализация для того, чтобы называться таковой, должна быть действительно всеобъемлющей и вездесущей; на самом деле, как в развитых, так и в развивающихся странах она затрагивает лишь определенные отрасли экономики.

Как уже отмечалось выше, существует различие между понятиями «интернационализация» и «глобализация» мировой экономики. В первом случае речь идёт об усилении взаимозависимости отдельных национальных экономик под влиянием экономической интеграции, но при сохранении ключевой роли национального государства и относительной автономности национальных экономик. Глобализация же приводит к тому, что национальные экономики становятся частью единой мировой экономической системы, т.е. глобализированной экономики.

В основе предпосылок и движущих сил глобализации мировой экономики лежат факторы, относящиеся к ведущим сферам современной жизни:

- информационная революция (создание глобальных сетей);
- интернационализация капитала и ужесточение конкуренции на мировых рынках;
- дефицит природных ресурсов и обострение борьбы за контроль над ними;
- демографический взрыв;
- усиление техногенной нагрузки на природу.

Также в научных трудах современных исследователей в качестве предпосылок глобализации выделяется открытость и либерализация мировой экономики. Так, по мнению М. Портера именно торговля лежит в основе «объективного процесса» глобализации. «Открытое общество» Д. Сороса - это идеальное производство для глобальной экономики. Открытость и либерализация рынков обеспечивают идеальные условия для конкуренции, движения и эффективного использования факторов производства[12]. М. Портер выделил пять сил конкуренции, которые определяют уровень прибыли в отрасли:

- проникновение на рынок новых конкурентов;
- угроза появления на рынке товаров-субститутов, произведенных по другой технологии;
- потенциальные возможности покупателей;
- потенциальные возможности поставщиков;
- конкуренция между компаниями, уже укрепившимися на рынке.

Конкурентные стратегии основываются на понимании правил конкуренции, действующих в отрасли и определяющих ее привлекательность для инвестиций.

Целью конкурентной стратегии является изменение этих правил в пользу своей компании. По мнению М. Портера, компания может сама определить свои сильные и слабые стороны, анализируя силы, которые влияют на конкуренцию в данной отрасли, и причины, лежащие в их основе.

Необходимо отметить такие черты процесса глобализации мировой экономики, как: всеохватность, многообъектность, прозрачность, многоэтапность, взаимопроницаемость, виртуализация, конвергенция, экологическая детерминированность.

Важный вопрос представляет собой генезис глобализации. Профессор экономики и политологии Калифорнийского университета Майкл Д. Интрилигейтор под глобализацией понимает значительное увеличение масштабов мировой торговли и других процессов международного обмена в условиях все более открытой, интегрированной, не признающей границ мировой экономики. Следовательно, по его мнению, следует говорить не только о традиционной внешней торговле товарами и услугами, но и о валютных потоках, движении капитала, обмене технологиями, информацией и идеями, перемещении людей.

М. Интрилигейтор выделяет следующие источники глобализации[6]:

- Технологический прогресс.
- Либерализация торговли и другие формы экономической либерализации.
- Значительное расширение сферы деятельности организаций, ставшее возможным в результате как технологического прогресса, так и более широких горизонтов управления на основе новых средств коммуникации.
- Достижение глобального единomyслия в оценке рыночной экономики и системы свободной торговли.
- Особенности культурного развития.

М. Интрилигейтор выделяет следующие преимущества глобализации:

- обострение международной конкуренции;
- экономия на масштабах производства;
- выигрыш от торговли на взаимовыгодной основе;
- повышение производительности труда.

Исходя из вышесказанного, у меня есть свое видение данной проблемы. К позитивным последствиям процесса глобализации, по моему мнению, можно назвать:

1. Достигается экономия на масштабах производства;
2. Происходит углубление специализации и международного разделения труда, вследствие этого оптимизируется размещение ресурсов в мировом масштабе;
3. За счет роста конкуренции развиваются технологии, внедряются инновации, расширяется ассортимент и повышается качество товаров на национальных рынках;
4. Становятся широко доступными достижения науки, техники и культуры в мировом масштабе.

5. Формирование основы для решения глобальных проблем человечества, в первую очередь экологических, что обусловлено объединением усилий мирового сообщества, консолидацией ресурсов, координацией действий в различных сферах.

Существует также большой разброс мнений и по такому вопросу: каковы ее ближайшие и отдаленные перспективы, что она несет странам и народам. Согласно первой, глобализация представляет собой «игру с нулевой суммой»: она дает выигрыш относительно более развитым странам, проигрывают же менее развитые (развивающиеся) государства. Развитые страны используют как экономические ресурсы развивающихся стран (природное сырье, дешевую рабочую силу), так и их рынки (для сбыта своей продукции), что приводит к консервации относительно отсталой экономической структуры последних, а также к снижению темпов их экономического роста. В этом случае глобализация становится фактором усиления неравенства между странами мира. Как отмечает И.Г.Владимирова, «современные глобализационные процессы разворачиваются, прежде всего, между промышленно развитыми странами и охватывают развивающиеся страны лишь в части, касающейся их исполнительской функции.[2] Глобализация укрепляет позиции первой группы стран, дает им дополнительные преимущества. В то же время разворачивание процессов глобализации в рамках современного международного разделения труда грозит заморозить нынешнее положение менее развитых стран мировой периферии, которые становятся скорее объектами, нежели субъектами глобализации. Таким образом, степень положительного влияния глобализационных процессов на экономику отдельных стран зависит от места, которое они занимают в мировой экономике, фактически основную часть преимуществ получают богатые страны или ТНК.»

Сторонники второй точки зрения считают, что увеличение международного обмена в большей степени выгодно для развивающихся стран, поскольку это способствует более быстрому догоняющему развитию. В процессе глобализации развивающиеся страны получают доступ к капиталу и технологиям развитых стран. В результате экономическое неравенство между странами мира сокращается, развитие мировой экономики приобретает более сбалансированный характер.

Одной из самых больших угроз глобализационных процессов многие эксперты называют рост безработицы. В качестве образца можно привести следующий прогноз: для функционирования мировой экономики в этом столетии будет достаточно 20 % населения. Больше рабочей силы не потребуется. Пятой части всех ищущих работу хватит для производства товаров первой необходимости и предоставления всех дорогостоящих услуг, какие мировое сообщество сможет себе позволить. Эти 20 %, в какой бы то ни было стране, будут активно участвовать в жизни общества, зарабатывать и потреблять, и к ним, пожалуй, можно добавить еще примерно один процент тех, кто, например, унаследует большие деньги. У тех же 80 %, которые останутся не у дел, будут колоссальные проблемы.

М. Интрилигейтор, рассматривая недостатки глобализации именует их потенциальными проблемами. Первая проблема связана с вопросом, кто оказывается в выигрыше от глобализации. Несправедливое распределение благ от глобализации порождает угрозу конфликтов на региональном, национальном и интернациональном уровнях. В результате происходит не конвергенция или выравнивание доходов, а скорее их поляризация, в процессе которой быстроразвивающиеся страны входят в круг богатых государств, а бедные страны все больше отстают от них. Растущий разрыв в доходах вызывает недовольство с их стороны, что может обернуться в международные конфликты, поскольку государства стремятся присоединиться к клубу богатых стран и готовы бороться с ними за свою долю в мировом производстве. Вторая проблема порождается потенциальной региональной или глобальной нестабильностью из-за взаимозависимости национальных экономик на мировом уровне, которая может привести к экономическому конфликту. Третья проблема вызвана опасением, что контроль над экономикой отдельных стран может перейти от суверенных правительств в другие руки, в том числе к наиболее сильным государствам, многонациональным или глобальным корпорациям и международным организациям. Суверенитет государства все больше ограничивается, что особенно заметно в экономике. Это связано с появлением, как уже отмечалось выше, на национальном и интернациональном уровнях новых актеров - мощных ТНК, международных торговых и финансовых организаций. Они располагают не меньшими финансовыми ресурсами, чем многие правительства, способны создавать и содержать частные армии, действовать на территории разных стран. Годовые доходы отдельных ТНК превосходят бюджеты и ВВП некоторых развитых государств. ТНК умело используют пустоты между международным правом и законодательством национальных государств в своих интересах, не стесняясь порой подгонять последнее под свои нужды. Не нужно забывать, что основной принцип существования ТНК - это принцип ликвидности, то есть извлечения максимальной прибыли, не считаясь с национальными интересами, не говоря уже о социальных гарантиях. Выходит, что национальные государства вынуждены сегодня приспосабливаться к реалиям глобальной экономики. Страны вынуждены играть по правилам ТНК, а не наоборот. Это хорошо видно на примере привлечения зарубежных инвестиций в Беларусь. Сколько бы ни старались власти навязать свои условия зарубежным предпринимателям, ничего из этого не выйдет.

Наряду с этим, М. Интрилигейтор верно указывает, что в сфере безопасности глобализационные процессы также могут привести к возникновению конфликтов; политические кризисы, способные перерасти из локальных в крупномасштабные события. Развивающиеся страны часто теряют или испытывают угрозу потери не только важнейших своих ресурсов, но и способность к их воспроизводству, что исключает, для них, какую бы то ни было историческую перспективу. Кроме того, необратимость отставания развивающихся стран обуславливается еще и обесценением традиционных, «старых» ресурсов и технологий. Везде, где

сохраняются старые продукты и методы производства, начинает полностью ощущаться давление конкуренции низких цен и низких производственных издержек, оказываемое развитыми странами.

Обобщая изложенное, можно сформулировать потенциальные негативные последствия процесса глобализации:

1. Одной из проблем глобализации является потенциальная глобальная нестабильность из-за взаимозависимости национальных экономик на мировом уровне. В результате локальные экономические колебания или кризисы в одной стране могут иметь региональные или даже глобальные последствия. Такая возможность носит не только теоретический характер, а является вполне реальной, что подтверждает финансовый кризис в Азии, начавшийся летом 1997 года в Таиланде, а затем перекинувшийся на другие страны Юго-Восточной Азии, дойдя и до Южной Кореи.

2. Специалист в области политэкономии и политологии Роберт Рейх заявил, что «национальные экономики» исчезают, и компании больше не имеют гражданства. Многие авторы считают, что глобализация означает закат национального государства. Историк Пол Кеннеди считает, что правительства теряют контроль, и глобализация разъедает позиции развивающихся стран и трудящихся: «Сегодня глобальное общество стоит перед необходимостью примирить технологические изменения и экономическую интеграцию с традиционными политическими структурами, национальным самосознанием, социальными потребностями, институтами и обычаями». Специалисты в области международных отношений сходятся в том, что глобализация порождает необходимость международного управления и подрывает власть национальных государств. Закат национального государства пророчат и социологи; Эванс полагает, что глобализация вступает в противоречие с государством, потому что в противоречии с государством находится неолиберальная идеология, лежащая в основе глобализации, а не из-за характеристик глобализации самих по себе. Пожалуй, наиболее проработанную теорию упадка национальных государств выдвигает британский экономист Сара Стрендж, согласно которой, глобализация подрывает власть национальных государств и порождает необходимость международного управления. Не все, однако, согласны с таким подходом. Противоположную точку зрения отстаивают Р. Гилпин, Л. Панич, которые считают, что глобализация повышает значение внутренней политики: «сегодня авторами глобализации являются сами государства, и речь идет в первую очередь об их реорганизации, а не вытеснении на обочину». В основном, большинство экономистов считает, что национальное государство не собирается отмирать и уступать свои позиции глобальному мега-государству.

3. Многие ученые говорят о конце европейского государства всеобщего благосостояния. Те не менее, американский экономист Милтон Гаррет с цифрами в руках доказывает жизнеспособность социал-демократической модели в условиях глобализации и в экономическом, и в электоральном смысле; о том, что

государство не исчезает говорит и тот факт, что расходы этих же государств не снижаются по мере их вовлечения в глобальную экономику.

4. Дестабилизация финансовой сферы, потенциальная региональная или глобальная нестабильность из-за взаимозависимости национальных экономик на мировом уровне. Локальные экономические колебания или кризисы в одной стране могут иметь региональные или даже глобальные последствия.

5. Ограничение со стороны транснациональных корпораций государств проводить национально ориентированную экономическую политику.

Что же в конечном счете глобализация несет странам — угрозу или новые возможности? На мой взгляд, однозначно ответить на этот вопрос практически невозможно, ведь баланс позитивных и негативных последствий постоянно изменяется. Однако реальность состоит в том, что глобализация представляет объективное и совершенно неизбежное явление современности, которое можно притормозить средствами экономической политики (что и происходит в ряде случаев), но нельзя остановить или «отменить», ибо таково требование современного общества и научно-технического прогресса.

М.А.Суржиков в своей статье, посвященной методологическим основам глобализации мировой экономики, предлагает глобализацию мировой экономики квалифицировать как экономический закон: «развитие производительных сил и производственных отношений, начавшись в рамках национальной экономики, достигнув определенного, наперед заданного уровня зрелости, неизбежно перерастает государственные рамки и стремится к формированию единого мирового экономического пространства»[13]. Закон глобализации, будучи законом экономическим, законом-тенденцией, не выражает строгой количественной зависимости между явлениями и не фиксируется в строгой экономической модели. Исходя из этого закона, нельзя предсказать, время вступления определенного национального государства в те или иные международные экономические организации. Однако он выражает устойчивые тенденции и однозначно предопределяет общие пути мирового развития. Закон глобализации, как и другие экономические законы (закон денежного обращения, закон спроса и предложения), действует вне зависимости от органов власти и юридических законов отдельного государства и от межгосударственных соглашений, получая при этом в них то или иное отражение.

Таким образом, в завершение моей статьи можно сделать вывод о том, что глобализационный процесс будет играть определяющую роль в мировой экономике XXI в. Как бы ни относились к глобализации ее противники и сторонники, нужно признать, что она уже явно изменила мировую систему, порождая новые проблемы, но и открывая новые возможности. В мировом хозяйстве изменения, происходящие под воздействием глобализации, характеризуются рядом особенностей. Возникают новые формы хозяйственных связей, число пользователей Интернета превысило 2 млрд. чел. Масштаб информационных потоков через «всемирную паутину» способствует созданию новых продуктов, путей и рынков сбыта, обуславливает

интернационализацию коммуникаций и формирует глобальную конкуренцию. Активизируется инновационная деятельность, изменяются ее направления. Развитые страны Европы до 80 % финансовых ресурсов направляют в высокотехнологичные отрасли, банковский или страховой бизнес, в то время как ранее примерно 20 % их направлялись в промышленное производство, 40 % в торговлю и 30 % в сферу недвижимости и финансов. Глобализация придает новое измерение мировому хозяйству, обуславливая его новые количественные и качественные характеристики.

ЛИТЕРАТУРА

1. Богомолов О.Т. Мировая экономика в век глобализации : учебник / О.Т. Богомолов. — М. : Экономика, 2007. — 361 с.
2. Владимирова И.Г. Глобализация мировой экономики: проблемы и последствия / И.Г. Владимирова // Менеджмент в России и за рубежом. – 2001. — № 3.
3. Гостева С.Р. Проблемы изучения феномена глобализации / С.Р. Гордеева // Актуальные проблемы современной науки. — 2008. — № 3. — С. 107-122.
4. Егоров В.С. Глобализация: мировоззренческий аспект проблемы // Глобализация: синергетический подход / Под общ. ред. В.К.Егорова - М.: РАГС, 2002, с.190.
5. Иванов Н.П. Парадоксы глобализации – вызовы и поиски ответа // Глобальный мир. Материалы постоянно действующего междисциплинарного семинара. – М., 2005.
6. Интриллигейтор М. Глобализация мировой экономики: выгоды и издержки // Мир перемен. – 2004. – №1. – С. 44–52.
7. Луценко К. Кто победит? Национальное государство в эпоху глобализации/К. Луценко // Свободная мысль. – 2006. - №3. – С.192-199.
8. Нечай А.А. Глобализация мировой экономики и роль государства.// Международное право и международные отношения. - 2010. — № 4.
9. Панышин Б.Н. Беларусь и глобализация; поиск и определение пути устойчивого социального-экономического развития. // Беларусь и глобализация: поиск пути развития, с .182-195.
10. Паныков В.С. Глобализация экономики: некоторые дискуссионные вопросы //Безопасность Евразии. №1-2008, январь-март.
11. Онгоров Т.Н. Международная экономическая интеграция : эволюция и границы понятия / Т.Н. Онгоров // Проблемы современной экономики. - 2008. — № 3.
12. Портер М. Конкуренция: учебное пособие: пер. с англ. — М.: Издательский дом «Вильямс» 2000. — С. 495.
13. Суржиков М.А. Методологические основы глобализации мировой экономики//Мировая экономика и международные экономические отношения. – 2012. - №2(87). - С.343-347.
14. Тойганбаева А.Е., Кенжебаева З.С. Методологические основы глобализации в развитии мировой экономики.//Фундаментальные исследования. – 2012. - №3. - с. 193-198.

Доверие как феномен социально-экономической реальности

Лиштван А.

Тема доверия в последнее время заслуженно становится, если не самой, то одной из самых популярных. В её обсуждении принимают участие экономисты, социологи, политики, психологи. Исследование доверия стало в настоящее время одним из самых востребованных направлений в общественных науках.

Актуальность этой темы объясняется ее воздействием на все сферы деятельности жизни человека. Одной из важнейших идей работы А. Смита “Теория нравственных чувств”, была идея доверия к человеку. Адам Смит отмечал, что человек доверяет тем, в ком он уверен, с кем можно сосредоточиться на общих положениях дел [21]. Для человека на первом месте, как считает А. Смит, должны быть доверие, уважение, любовь окружающих нас людей. «Любовь к людям побуждает нас искать их расположения, а не стремиться к господству над ними; человек справедливый и правдивый желает вовсе не богатства, он дорожит более всего доверием, которое он внушает к себе» [22].

А. Маршалл в своей книге «Принципы политической науки» пишет, что в современных условиях с развитием технологий, производства, совершенствованием знаний у людей появилось больше возможностей для обмана, подделок. Но это не значит, что люди стали пользоваться этими возможностями, наоборот, «современные методы торговли включают в себя вошедшие в привычку принципы доверия, с одной стороны, а с другой – способность противостоять искушению обманывать, способность, не свойственную отсталым народам». [14] Тем самым А. Маршалл подчеркивает, что доверие – это выработанная у людей привычка.

С развитием кризисных ситуаций все чаще обращаются к данному термину. Еще Дж. Ст. Милль отмечал, что причиной кризиса является сокращение кредита, а средством преодоления — не уменьшение предложения, а восстановление доверия. Такая трактовка отличается от мнения его предшественников, считавших, что кризис является результатом общего перепроизводства.

Без доверия невозможно функционирование хозяйственной системы, в частности рыночного хозяйства. Доверие и недоверие дают более полное объяснение поведения в условиях рыночной экономики, чем принципы рациональности. Так Дж. Стиглиц писал, что «рыночная система работает во многом благодаря именно доверию. Инвесторы просто вынуждены вручать свои трудовые сбережения другим людям, и, решаясь на это, они ожидают, что не будут, как минимум, обмануты». [23].

Итак, многие ученые обращались и обращаются, так или иначе, к исследованию категории доверия. В современных работах, посвященных теме доверия, оно рассматривается в двух направлениях: теоретическом и практическом. В теоретических работах описываются проблемы, рассматриваются факторы, но практически не используются статистические данные. Практически же направленные авторы пытаются строить индексы доверия, но на данный момент возникают вопросы с репрезентативностью выборки. Поэтому для получения более полного, комплексного и достоверного анализа влияния такого явления как доверие на экономику необходимо обращаться к анализу одновременно двух аспектов:

необходимы комплексные количественные оценки, базирующиеся на глубоких теоретических проработках.

Общая характеристика доверия как экономической категории и его истоки

Определение доверия в экономике носит наиболее конкретный и прикладной характер. По словам профессора Школы углубленных международных исследований при Университете Джонса Хопкинса Френсиса Фукуямы доверие является ключевой характеристикой развитого человеческого общества. Нобелевский лауреат по экономике К. Эрроу отмечает, что «в сущности любая коммерческая сделка содержит в себе элемент доверия, особенно длящаяся определенный период времени» [1, с. 357].

Представителей разных экономических школ и направлений исследовали истоки, причины и мотивы возникновения доверия в человеческих взаимоотношениях. Изучая вопрос возникновения доверия, они рассматривали данное понятие в основном через призму экономических отношений взаимовыгодного обмена экономических агентов, при этом учитывался один из главных параметров – удовлетворение собственных потребностей экономических агентов.

Представители меркантилизма и утилитаризма, выступая за государственное регулирование, утверждают, что доверие к государству и между экономическими агентами формируется под влиянием государства.

Классики и неоклассики, выступающие за идею «невидимой руки», наоборот, считали, что государство не должно вмешиваться в деятельность экономических агентов, т.е. доверие должно формироваться без участия государства. Классики отрицают существование социального капитала, но это не значит, с их точки зрения, что невозможно доверие между экономическими и рыночными субъектами. Марксисты исследуют общество в целом, а не индивидов, тем самым они ставят главной целью удовлетворение общественных, т.е. и государственных, потребностей. Тем самым они выступают за формирование доверительных отношений между экономическими агентами.

Школа маржинализма предлагает гипотезу, согласно которой государство регулирует деятельность экономических агентов, но блага при этом должны распределяться на основе обоюдной договоренности и согласованности. Когда государство выступает гарантом защиты собственности и соблюдается справедливость и рациональность при распределении материальных ценностей, между агентами возникает доверие.

«Старые институционалисты» считают, что доверие возможно только при миролюбивом типе поведения, т.к. при хищническом типе поведения формируется институт частной собственности, обостряется социальная напряженность, что исключает возможность возникновения доверия между различными классами.

«Новые институционалисты» доказали, что при взаимодействии разных экономических агентов в условиях конкуренции и ограниченности ресурсов

возникают формальные и неформальные правила поведения. В ситуации неопределенной и асимметричной информации при совершении экономических сделок происходит утрата доверия. В данной ситуации возникает необходимость неких институциональных ограничений. Появление доверия возможно лишь тогда, когда государство контролирует выполнение обязательств и выступает гарантом исполнений всех условий договора между агентами. Доверие неинституционалисты рассматривают на межличностном уровне.

Итак, согласно исследованиям ученых-экономистов разных экономических школ и направлений доверие возникает в результате общения между собой экономических агентов, домашних хозяйств и различных экономических субъектов. Большинство исследователей определяют доверие «как уверенно позитивные или оптимистические ожидания хозяйствующего субъекта относительно поведения контрагента» [15, с. 71]. Доверие формируется на основе добросовестности, честности и порядочности. Неискренность в хозяйственных взаимоотношениях способна поколебать доверие.

Особое внимание и исследование института доверия связано с изучением социального капитала. Это объясняется тем, что доверие является нравственной основой социального капитала. П. Бурдье трактовал социальный капитал как «ресурсы, основанные на родственных отношениях и отношениях в группе членства» [3, с. 19]. Но наиболее распространенной и приемлемой является трактовка социального капитала, данная Дж. Коулменом. Дж. Коулмен утверждал, что социальный капитал – это потенциал взаимного доверия и взаимопомощи, целерационально формируемый в межличностных отношениях: обязательства ожидания, информационные каналы и социальные нормы [4]. Дж. Коулмен делит капитал на три вида, отмечая, что социальный капитал – это наименее осязаемая форма капитала, т.к. существует только во взаимоотношениях индивидов.

В теории социального капитала считается, что нормы взаимности, связи, социальные сети, доверие и другие элементы, являются благоприятными факторами внешней среды, в то время, как институционалисты воспринимают их как ограничения. Еще одним новшеством Дж. Коулмана было, что социальный капитал создается обществом в целом, а не отдельными индивидами. В будущем этой же идеи придерживался и Ф. Фукуяма.

Таким образом, социальный капитал и доверие являются взаимосвязанными понятиями, но ни в коем случае не отождествляются.

Некоторые современные ученые, например, Р. Коуз, К. Эрроу, Ф. Фукуяма, преподносят доверие как сугубо экономическое благо. Кеннет Эрроу, нобелевский лауреат в области экономики, утверждает: «Вообще-то доверие имеет как минимум очень важную ценность с прагматической точки зрения. Доверие – это своеобразная смазка общественного механизма. Оно крайне эффективно: имея возможность положиться на слово другого человека, ты сэкономишь себе массу усилий. К сожалению, это не тот товар, который можно легко купить. Если же вам приходится его покупать – значит, у вас уже есть сомнение по поводу того, что вы

покупаете. Доверие <...> это товар, у него есть реальная экономическая и практическая ценность; он повышает эффективность системы в целом, позволяет вам производить больше благ или чего-то другого, что вы считаете ценностью. Но он относится к тем товарам, торгоя которыми на рынке технически осуществима или вообще осмыслена» [2, с. 23].

Ф. Фукуяма в книге «Доверие. Социальные добродетели и путь к процветанию» подчеркивает: доверие и честность всегда присутствуют в обычной экономической жизни и принципиально влияют на её нормальное развитие. Однако люди часто воспринимают порядочность и минимальный уровень доверия как нечто само собой разумеющееся. В качестве доказательства автор приводит такой пример: не так часто люди выходят, например, из ресторанов или такси, не расплатившись. Такое поведение довольно легко объяснить: человека удерживает мысль о возможном наказании. Экономисты утверждают, что если бы люди думали только исключительно о том, как максимизировать свой доход, и не сдерживались бы неэкономическими факторами, например, правилами приличия или моральными соображениями, тогда, каждый раз входя в ресторан или сядя в такси, они должны были заранее просчитать, смогут ли убежать, не заплатив за услугу. Также человек должен просчитать, будет ли цена такого действия выше, чем ожидаемая выгода (бесплатный ужин и бесплатный проезд). В зависимости от этого он примет решение, оставаться ему честным или сбежать, не заплатив. И если в обществе в большинстве случаев так не происходит, то это говорит о том, что существует некий базовый уровень честности, который поддерживается в силу скорее привычки, чем разумного расчета [26, с. 254-255].

Ф.Фукуяма определяет экономическую ценность доверия. Заключая договор, мы рассчитываем на честность и порядочность партнера. Другими словами, строим свои договорные обязательства на основе доверия. Если предположить, что в мире не существует доверия, то мы должны сделать документ (контракт) «неуязвимым» – прописать в нем все возможные ситуации, при которых партнер при желании мог бы нас обмануть. Такие документы были бы бесконечно длинными. Но и тогда мы до конца не были бы уверены в том, что контрагенты не найдут другие способы нас обмануть и уйти от выполнения своих обязательств. В случае возникновения спорной ситуации, мы не могли бы прибегнуть и к арбитражному суду, так как не вполне доверяли бы и третьей стороне. Любой спорный вопрос приходилось бы решать, обращаясь в суд [26, с. 256]. Как следствие мы несли бы существенные затраты на поиск надежного партнера, обсуждение и согласование контракта, изучение государственного законодательства и т.д.

Основными критериями доверия являются надежность, компетентность, порядочность, предсказуемость, единство. Предсказуемость показывает, насколько хорошо субъект знает человека, по отношению к которому определяется уровень доверия. Предсказуемость также характеризует способность субъекта предсказать, как поведет себя этот человек в ситуации неопределенности. Под надежностью подразумевается представление субъекта о том, способен ли тот или иной человек

прийти на помощь в критической ситуации. Единство характеризует наличие у субъекта общих целей, взглядов, принципов с другим человеком.

Следует отметить, что отсутствие доверия, также как и его избыточное количество, неблагоприятно сказывается на экономике. В первом случае происходит снижение деловой активности и падение экономического роста. Во втором случае создаются условия для недобросовестных отношений в деловых операциях, в том числе и обмана партнера, что ведет к серьезным экономическим потерям. Эффективное функционирование рыночной экономики требует не высокого, а оптимального уровня доверия. Доказано, что «оптимальный уровень доверия, которое рациональный экономический агент должен показать в сделках, равен кредитоспособности другой стороны. Такой уровень доверия приводит к эффективному рынку. Доверие меньше приводит к потере экономических возможностей, доверие больше приводит к ненужной уязвимости и потенциальной эксплуатации. Доверие меньше приводит к потере экономических возможностей, доверия – больше приводит к ненужной уязвимости и потенциальной эксплуатации» [12, с. 6].

Уровень доверия на микроуровне является важнейшим фактором, влияющим на величину транзакционных издержек в экономике. Под транзакционными издержками понимаются затраты взаимодействия субъектов экономики. Они включают в себя издержки оценки полезных свойств объектов обмена и издержек обеспечения прав и принуждения к их соблюдению. Эти издержки оценки и принуждения служат источником социальных и, политических и экономических институтов [18, с.45]. К транзакционным издержкам относятся, к примеру, и издержки, которые ложатся на предприятие при заключении им сделок. Снижение издержек при заключении сделок ведет к росту числа сделок в экономике, стимулированию деловой активности. Важнейшими факторами, определяющими размер транзакционных издержек, являются уровень несовпадения экономических интересов агентов и неопределенность правил их поведения. Наличие доверия в хозяйственных отношениях полностью исключает или значительно сокращает транзакционные издержки. Это происходит благодаря:

- уменьшению издержек поиска информации, т.е. снижению затрат времени и ресурсов, необходимых для ведения поиска потенциальных покупателей или продавцов потребительских благ, а также уменьшению потерь, связанных с асимметрией получаемой информации;
- снижению затрат времени и финансовых затрат на подготовку, оформление и заключение контрактов, а также сокращением или полным исключением сопутствующих формальных и ненужных процедур;
- сокращению издержек, связанных с всевозможными измерительными процедурами;
- уменьшению величины издержек оппортунистического поведения партнера, обусловленные затратами на наказание нарушителей прописанных в контракте соглашений;

- экономией затрат, связанных с защитой прав собственности (расходы, связанные с судебными процедурами).

Таким образом, доверие обеспечивает снижение всех видов транзакционных издержек. Однако не все ученые-экономисты придерживаются данной точки зрения. Так, например, А. Ляско считает, что во многих случаях доверие оказывается либо нейтральным по отношению к транзакционным издержкам, либо увеличивает их уровень. Как доказательство правильности своей позиции он приводит следующие аргументы: [13, с. 42-47]

1. экономические агенты нередко инвестируют ресурсы в создание и поддержание механизмов доверия. Ожидаемая выгода не всегда покрывает связанные с этим затраты;

2. доверие нельзя рассматривать как статистическое явление – процесс достижение доверия между контактными сторонами непосредственно связан с транзакционными издержками;

3. избыточное доверие между партнерами может привести к росту транзакционных издержек, связанных с распределением и защитой прав собственности;

4. доверие не способствует снижению транзакционных затрат, являющихся следствием взаимного непонимания, различий в компетенции или разных уровней знания отдельных фирм.

По мнению А. Ляско, снижение транзакционных издержек объясняется не воздействием отношений доверия, а позитивным влиянием сопутствующих институциональных механизмов, поддерживающих и гарантирующих взаимное доверие. К ним он относит репутацию, контрактные гарантии, неявные источники формальных и неформальных санкций, не позволяющих нарушать взаимные обязательства.

Доверие на макроуровне определяется исследователями как нормативная категория, подчеркивающая особый статус доверия по отношению к институтам.

Еще одним способ разделения доверия – это выделение двух типов доверия: межличностное доверие и институциональное. Межличностное доверие – доверие между людьми, оно начинается с уважительного отношения, например, к соседями. Институциональное же доверие представляет собой доверие людей к социальным институтам и его представителям. Примером институционального доверия в повседневной жизни может быть ввод пароля от кредитной карточки в интернете, когда люди доверяют банковской системе и их системе безопасности. В связи с приведенной выше трактовке типов доверия, можно утверждать, что межличностное доверие существует в любом обществе, а институциональное доверие – там где, есть организации, координирующие деятельность общества. Институциональное доверие способствует установлению социально- политической стабильности в обществе. Институциональное доверие растет, когда люди положительно оценивают деятельность политиков, социальных организаций.

Два типа доверия тесно взаимосвязаны между собой, т.к. люди начинают больше доверять друг другу, зная, что они всегда могут обратиться в социальную организацию, которая в случае необходимости защитит их права, т.е. для взаимодействия необходимо доверие к государственным институтам и их надлежащее функционирование. Элинор Остром, нобелевский лауреат в области экономики 2009 года, отмечает, что для поддержания доверия граждан к государству суды и полиция должны обеспечивать выполнение правил коллективной деятельности. Процесс создания и накопления доверия к государству является долгим процессом и нужно постоянно поддерживать данное доверие. [6].

Адам Смит, отец политэкономии, как часто его называют, утверждал, что благосостояние основывается на разделении труда. В своей работе «Исследование о природе и о причинах богатства народов» он приводит пример разделения труда при производстве булавок. А. Смит отмечает улучшение результата производства благодаря данному разделению. Но производство булавок не достигло бы такого результата, если бы рабочие не доверяли друг другу. Также и современная всемирная экономика основывается на разделении труда и доверии, сопутствующем этому процессу.

Как отмечает Г.Ф. Ромашкина в работе «Сети межличностного и институционального доверия как ресурс неформальной экономики» соотношение уровней межличностного и институционального доверия является важным индикатором состояния общества. Выделяется четыре ситуации соотнесения двух типов доверия.

Оба типа доверия, и межличностное, и институциональное, находятся на уровне выше среднего. В данном случае общество обладает значительным социальным капиталом, а власть, в свою очередь, способствует его сохранению и воспроизводству.

Высокий уровень межличностного доверия и низкий уровень институционального доверия. В этой ситуации общество существует автономно от власти. В этом случае происходит «амортизация» социального капитала и возникает тенденция перехода к ситуации IV.

Низкий уровень межличностного доверия и высокий уровень институционального доверия. В этом случае результат противоположен ситуации II: социум не может функционировать самостоятельно, он практически полностью зависит от властных инициатив.

Институциональное и межличностное доверие на низком уровне. В данном случае взаимодействия в обществе оказываются практически парализованными, так как власть не в состоянии контролировать ситуацию, а координированные действия людей сильно затруднены из-за взаимного недоверия [20].

Говоря о доверии на макроуровне, экономисты выделяют три категории экономических субъектов: население, бизнес и власть (государство). Каждая из этих категорий основывается на определенных критериях, которые им кажутся наиболее важными. Особое место занимает власть. Уровень доверия власти к

населению и доверия власти к бизнесу имеет первостепенное значение и проявляется в усилении или наоборот ослаблении роли государственных органов. Но власть экономические вопросы не всегда решает исходя из экономической целесообразности. Часто власть принимает решения, направленные на снижения социальной напряженности или поддержания политической стабильности в стране. Такие шаги могут негативно сказаться на уровне доверия бизнеса к власти и населения к власти. Снижение уровня доверия населения и бизнеса к власти в свою очередь понизят общий уровень в обществе.

Таким образом, можно утверждать, что, как правило, причиной снижения доверия между бизнесом и властью являются действия власти. И, как подчеркивают авторы статьи «Конструирование доверия в инновационном развитии экономики», в развитых странах мира, в первую очередь, перед властью стоит проблема сохранения и построения доверия в экономике. Это определило интерес к возможности конструирования доверия.

Для повышения уровня доверия, а также для обеспечения воспроизводства доверия, необходимо конструирование доверия. Это означает, что должно быть объединение усилий власти, т.е. государства, бизнеса, населения, а также различных институтов общества. Цель конструирования – не просто разовое повышение уровня доверия, а, главным образом, обеспечение воспроизводства доверия большим числом общественных институтов.

ЛИТЕРАТУРА

1. Arrow, K.J. Gifts and Exchanges/ K.J. Arrow // Philosophy and Public Affairs [Electronic resource]. -1974. - Mode of access:
2. http://scholar.google.com/citations?hl=en&user=Dn8X_gIAAAAJ&citation_for_view=Dn8X_gIAAAAJ:ufrVoPGSRksC&view_op=view_citation . - Date of access: 15.10.2012.
3. Arrow, K.J. The Limits of Organization / K.J. Arrow// Management [Electronic resource]. -1974. - Mode of access:
4. http://scholar.google.com/citations?hl=en&user=Dn8X_gIAAAAJ&citation_for_view=Dn8X_gIAAAAJ:2osOgNQ5qMEC&view_op=view_citation . - Date of access: 15.10.2012.
5. Bourdieu, P. The forms of capital/ P. Bourdieu; Ed. by J. Richardson // Handbook of theory and research for sociology of Education [Electronic resource]. -1986. - Mode of access: <http://econ.tau.ac.il/papers/publicf/Zeltzer1.pdf> . - Date of access: 08.11.2012.
6. Coleman, J. S. Social capital in the creation of human capital / J.S. Coleman // American Journal of Sociology [Electronic resource]. -1988. - Mode of access: http://onemvweb.com/sources/sources/social_capital.pdf . - Date of access: 15.11.2012.
7. Nooteboom, B. Trust: forms, foundations, functions, fallures and figures / B. Nooteboom// The Journal of Socio-Economics [Электронный ресурс]. – 2005. Mode of access: <http://ideas.repec.org/a/eee/soceco/v34y2005i3p421-424.html> . - Date of access: 25.10.2012.
8. Ostrom, E. Social capital: a fad or a fundamental concept?/ E. Ostrom// Center for the Study of Institutions, Population, and Environmental Change Workshop in Political Theory and Policy Analysis Indiana University [Electronic resource]. -1999. - Mode of access: http://www.exclusion.net/images/pdf/778_latuk_ostrom.pdf . - Date of access: 01.11.2012.
9. Simmel, G. The Philosophy of Money/ G.Simmel; transl.by T. Bottomore and D. Frisby – 3-d edition - London: Routledge, 2004. – 543 p.

10. Sztompka, P. Trust: a sociological theory/ P. Sztompka// Cambridge university press [Электронный ресурс]. – 1999. Mode of access: http://books.google.by/books?printsec=frontcover&vid=LCCN00266562&redir_esc=y#v=onepage&q&f=false . - Date of access: 25.10.2012.
11. Гусейнов, А.А. Словарь по этике / под ред. А.А. Гусейнова и И.С. Кона. – 6-е изд. – М.: Политиздат, 1989. – 447 с.
12. Зинченко, В.П. Психология доверия/ В.П. Зинченко // Вопросы философии. – 1998. – № 7. – С. 76-93.
13. Купрейченко, А.Б. Психология доверия и недоверия/А.Б. Купрейченко.—М.: Институт психологии РАН, 2008. - 571 с.
14. Лазаричева, С.Н. О феномене «доверие» или «trust» между фирмами в кластере
15. Предприятий/ С.Н. Лазаричева// Отраслевые рынки. -2011. - №6 (28). – С. 4 – 20.
16. Ляско, А.К. Доверие и транзакционные издержки / А.К. Ляско // Вопросы экономики. – 2003. - №1. – С.42-47.
17. Маршалл, А. Предварительный обзор / А. Маршалл// Принципы политической науки // [Электронный ресурс] Режим доступа: <http://ek-lit.narod.ru/mar101.htm> – Дата доступа 20.10.2012 .
18. Мельник, В.П. Факторы доверия и недоверия в хозяйствовании / В.П. Мельник// Научные труды ДонНТУ. Сер. эконом. – Донецк, 2009. - Т. 1. – С.71-79.
19. Мильнер, Б. З Теория организации: учебник/ Б.З. Мильнер. – 2-е изд., перераб. и доп. - М:ИНФРА-М, 2000. – 480с.
20. Мышляева, Т.В. Доверие в современном обществе: подходы к анализу/ Т.В. Мышляева // Вестник Нижегородского университета им. Н.И. Лобачевского. Сер. соц. науки. - 2006. - № 1. - С. 301-307.
21. Норт, Д. Институты, институциональные изменения и функционирование экономики/ Д. Норт; пер. с англ. А.Н. Нестеренко, предисл. и науч. ред. Б.З. Мильнера. – М.: Фонд экономической книги «НАЧАЛА», 1997. – 180 с.
22. Ожегов, С.И. Толковый словарь русского языка: 80000 слов и в фразеологических выражений / С.И. Ожегов, Н.Ю. Шведова. – М.: Азбуковник, 1999. – 944 с.
23. Ромашкина, Г. Ф. Сети межличностного и институционального доверия как ресурс неформальной экономики/Г.Ф. Ромашкина, Ю.П. Абдалова Ю.// информационно библиотечный центр [Электронный ресурс]. - 2005. – Режим доступа: www.tmnlib.ru/DbFileHandler.axd?213 . –Дата доступа: 10.11.2012.
24. Смит, А. О чувстве этого приличия / А. Смит// Теория нравственных чувств или опыт исследования законов, управляющих суждениями, естественно составляемыми нами сначала о поступках прочих людей, а затем и о своих собственных. – Ч.1, Гл.4 / А. Смит // [Электронный ресурс] Режим доступа: http://gallery.economicus.ru/cgi-bin/frame_rightn_newlife.pl?type=in&links=../in/smith/works/smith_w2_1_1_4.txt&img=works_small.gif&name=smith&list_file= – Дата доступа 31.10.2012
25. Смит, А. Об основании наших суждений о собственных поступках и чувствах, а также о чувстве долга / А. Смит//Теория нравственных чувств или опыт исследования законов, управляющих суждениями, естественно составляемыми нами сначала о поступках прочих людей, а затем и о своих собственных. – Ч. 3. Гл.5 / А. Смит // [Электронный ресурс] Режим доступа: <http://gallery.economicus.ru/cgi->

bin/frame_rightn_newlife.pl?type=in&links=../in/smith/works/smith_w2_3_1_5.txt&img=works_s_mall.gif&name=smith&list_file= – Дата доступа 31.10.2012

26. Стиглиц, Дж. Ю. Ревущие девяностые. Семёна развала/ Дж. Ю. Стиглиц; пер. с англ. и примеч. Г.Г. Пирогова; вступит. статьи Г.Ю. Семигина и Д.С. Львова. - М.: Современная экономика и право, 2005. - 424 с.

27. Сухих, В.В. Конструирование доверия в инновационном развитии экономики / В.В. Сухих, С.Г. Важенин, И.С. Важенина // Шумпетеровские чтения: материалы 1-й Междунар. научно-практ. конф., Пермь, 2011 / ГОУВПО «Пермский государственный технический университет». - Пермь, 2011. - С. 147-449.

28. Уколова, Ю.С. Категории «вера» и «доверие» – семантика различий / Ю.С. Уколова// Наука. Релігія. Суспільство. -2008. - № 2. – С. 192-200.

29. Фукуяма, Ф. Доверие: социальные добродетели и путь к процветанию: Пер. с англ. /Ф. Фукуяма. - М.: ООО «Издательство АСТ»: ЗАО НПП «Ермак», 2004. – 730с.

30. Хоскинг, Дж. Экономика доверия/ Дж. Хоскинг// Неприкосновенный запас [Электронный ресурс] .- 2010.- Режим доступа: <http://magazines.russ.ru/nz/2010/5/ho7-pr.html>.– Дата доступа 23.11.2012.

Фактор власти в экономике

Мартиневская К.

Проблема власти в экономической концепции К. Маркса

Впервые в политической экономии власть как характеристика экономических отношений капитализма появляется в работах К. Маркса. Он не рассматривал власть как отдельную категорию экономической теории, но утверждал, что ею владеет тот, кто контролирует и поставяет капитал. Цены и заработная плата устанавливаются в соответствии интересами владельцев капитала. Помимо всего прочего, они контролируют и государство, которое превращается в исполнительный комитет, подчиненный воле и интересам господствующего класса. Основные постулаты власти по Марксу заключаются в следующем:

- Источником власти в капиталистических отношениях является собственность как обладание меновыми стоимостями, деньгами. Поэтому характер власти в отношениях между людьми есть важнейшая характеристика капитализма, его специфическая черта, отличающая данный тип производственных отношений от экономических систем, организованных на личной зависимости, в основе которой лежит применение насилия;

- Власть является существенной характеристикой капитала, а капитал – это командная власть над трудом и его продуктами. Капиталист обладает ею лишь как собственник капитала. Он покупает рабочую силу и тем самым приобретает власть над работником;

- Власть капитала над трудом является условием создания новой общественной производительной силы труда, основанной на кооперации производства, разделении труда, применении машин и т.д.

- В условиях господства власти, основанной на меновой стоимости, общественная целесообразность устанавливается как результат стихийной власти принудительных законов рынка над экономическим поведением.

Рабочий подвластен не тому или иному капиталисту, а классу капиталистов в целом, так как, покидая по какой-либо причине одного капиталиста, он не избавляется от необходимости зарабатывать на жизнь и, соответственно, переходит к другому капиталисту. По мимо экономической власти, господствующий класс капиталистов имеет также власть идеологическую, так как «мысли господствующего класса являются в каждую эпоху господствующими мыслями».

Проблема власти в теории хозяйственного порядка В.Ойкена.

Вальтер Ойкен, ярчайший немецкий экономист XX века, разработал теорию хозяйственного порядка, центральным звеном которой является концепция экономической власти.

Автор утверждает, что власть - это одна из важнейших характеристик хозяйственного процесса. Проблема экономической власти существовала всегда, но с начала промышленной революции она предстала в новой форме. Вместе с промышленной революцией наступила эпоха бурного роста экономической власти: власть отдельных фирм, власть концернов, картелей, центральных плановых органов или же союзов предпринимателей и профсоюзов. Важнейшими особенностями хозяйственной жизни в современном рыночном хозяйстве являются наличие различных властных группировок и экономическая борьба между ними. С точки зрения В.Ойкена, властные позиции отдельного хозяйства и его место в экономической власти проявляются в том, как формируются его хозяйственные планы, и в его влиянии на хозяйственные планы других хозяйств.

Соотношение между властью и свободой для отдельных хозяйств является для В.Ойкена отличительной характеристикой различных хозяйственных порядков, по Ойкену их три. Первый из них – это полная конкуренция, для которой характерно отсутствие экономической власти со стороны отдельных хозяйств. Иными словами, одинаковая свобода для всех потребителей и производителей. Единственным аппаратом контроля над хозяйствами, обладающим силой принуждения, является механизм цен. По мнению Ойкена, это идеальный хозяйственный порядок. Абсолютной противоположностью полной конкуренции является централизованное плановое хозяйство, где происходит наибольшее сосредоточение власти. Третьей формой хозяйственного порядка является олигополистическая, располагающаяся между полной конкуренцией и централизованным хозяйством. Носителями экономической власти здесь выступают частные властные группировки. Властная позиция частных групп определяется их рыночным положением и эластичностью спроса и предложения.

По мнению автора, концентрация экономической власти является главной причиной нерешенности глобальных проблем, состоящих в отсутствии учета

интересов потребителей при планировании хозяйственного процесса, искажении соотношения издержек и выгод из-за отсутствия принудительного ценового механизма, несправедливости в распределении доходов, нарушении индивидуальной свободы и принципов правового государства. Экономическая власть является оправданной лишь в том случае, когда она служит целям создания и сохранения конкурентного порядка. В частности, допускается власть внутри предприятий и власть центрального банка.

Ойкен критикует современную ему экономическую науку за пренебрежение проблемами власти. По его мнению, у многих ученых, занимающихся национальной экономией, отсутствуют видение и понимание того обстоятельства, что хозяйственный процесс пронизан жестокой борьбой за власть. При этом он отвергает тезис о том, что проблема власти выходит за рамки экономического анализа.

Теория хозяйственного порядка нашла отражение в формировании институциональной структуры экономики Германии после окончания Второй мировой войны и явилась одним из теоретических источников «немецкого экономического чуда». Вместе с тем ряд радикальных предложений Ойкена, направленных на минимизацию экономической власти, не нашли поддержки и так и не были реализованы.

Проблема власти в экономической концепции Дж. К. Гэлбрэйта.

Проблема власти вызвала особый интерес и в традиционной институциональной теории, для которой она являлась центральной категорией анализа. Приверженцы институционализма утверждали, что экономика сама по себе является системой власти, власти, которая выходит далеко за рамки спроса и предложения на рынке.

Прежде всего, речь идет о работах Дж.К.Гэлбрэйта: «Американский капитализм: концепция уравнивающей власти», «Новое индустриальное общество», «Экономические теории и цели общества», «Анатомия власти». Этот ученый выдвинул концепцию «уравнивающей» власти, которая представляет отражение понимания Гэлбрэйтом роли организованных групп и государства в современном капитализме.

Идея Гэлбрэйта состоит в том, что олигополии внутренне присуща тенденция к «уравниванию» сил (власти) : сильным продавцам теперь противостоят сильные покупатели. Автор особенно подчеркивает роль профсоюзов и крупных компаний в сфере розничной торговли. В одном из таких случаев фирма, контролировавшая сеть супермаркетов, заставила производителей снизить цену на кукурузные хлопья, просто пригрозив им, что она сама займется их производством. Хорошо известно, что некоторые крупные торговые компании оказывают сильнейшее давление на тех, у кого они покупают товары. Государство, также выступает одной из «уравнивающих» сил, в частности против монополии. А

вот олигополии автор расценивал как благо, с точки зрения роста «уравновешивающей силы» и технического прогресса.

Помимо всего прочего, Гэлбрэйт развивал концепцию экономической власти следующим образом:

- Он ставил вопрос об источниках экономической власти и характере ее связи с определенными факторами производства. По его мнению, если рассматривать вопрос в долгосрочном плане, то имело место радикальное перераспределение власти над производственным предприятием между факторами производства. Господствующие позиции капитал приобрел не так давно: еще пару столетий назад ни один здравомыслящий человек не усомнился бы в том, что власть решающим образом связана с землей.

- Гэлбрэйт утверждал, что власть переходит к тому фактору производства, который наименее доступен и труднее всего заменить.

- Что касается современного капитализма, то, по мнению Гэлбрэйта, он характеризуется избытком предложения капитала, что проявляется в тенденции к превышению сбережений над капиталовложениями. В то же время резко возросла потребность в специализированных знаниях. Поэтому в современной экономике источник власти переместился от капитала к организованным знаниям, что, в свою очередь, находит отражение в перераспределении власти в обществе.

- По мнению автора, рыночная экономика все более вытесняется «планирующей системой» – миром, где власть принадлежит техноструктуре, в частности крупным корпорациям, и растет она пропорционально размерам и зрелости фирм.

В результате роста корпораций власть потребителя становится минимальной или исчезает вообще. По мере развития экономики распределение экономических ресурсов – капитала, рабочей силы, материалов зависит от власти производителя во все возрастающей степени.

Проблема власти в теории доминирования Ф. Перру.

Существенный вклад в развитие теории экономической власти внес выдающийся французский экономист Ф. Перру.

Общая экономическая теория Ф. Перру представляет собой систематический анализ проблемы власти в экономике, в основу которого положена теория экономического доминирования. Автор стремился доказать, что в центре экономического анализа должны быть такие экономические факторы, как сила, давление, принуждение и власть, которые были отброшены теоретиками либеральной и маргинальной школ.

Ф. Перру характеризует власть, во-первых, как проявления асимметричного влияния, оказываемого конкурирующими фирмами и отраслями для достижения желаемых экономических целей; во-вторых, как влияние организованных и структурированных групп – таких, как ассоциации менеджеров и профсоюзов; в-

третьих, влияние, применяемое государством в экономической сфере в национальном или международном масштабах. Возникновение власти связано с различиями в размерах производства и капитала, с различной степенью информированности партнеров, с принадлежностью к различным сферам хозяйства. Таким образом, одни экономические единицы являются доминируемыми, а другие – доминирующими, то есть одни хозяйства доминируют над другими.

В соответствии с данной логикой совершенная конкуренция может быть рассмотрена как экономическая ситуация, где любой элемент доминирования отсутствует.

Доминант определяется в результате превосходства по трем пунктам: относительной величины, переговорной власти, места в целостной структуре общественного разделения труда.

Согласно данной теории, современную экономику невозможно рассматривать как сеть обмена, независимую от сети власти. Чистый обмен возникает лишь в отдельных случаях.

Осуществление доминирующего эффекта базируется на принуждении, которое пронизывает всю экономическую жизнь. Оно может быть публичным (применяется со стороны государства) и частным (проявляется в отношениях экономической единицы с потребителями, конкурирующими производителями, прессой и т.п.) Такие способы влияния включают в себя и использование нерыночных операций – предотвращения расширения кредита для конкурентов, промышленного шпионажа, угрозы насилия.

Доминирующие предприятия – это те, которым удастся навязать свою экономическую политику (условия производства, уровень цен и т.п.) в ущерб интересам других фирм, исключая их всяческое сопротивление. При этом нельзя смешивать понятие доминирования с монополией: сфера деятельности господствующей фирмы шире, чем сфера деятельности монополии.

Ф. Перру также описывал деформацию экономического пространства, которая создается в связи с неравенством хозяйственных единиц. Наиболее интересный вид такой деформации - поляризация пространства вокруг ведущей отрасли. Предприятия, входящие в поляризованное пространство, оказываются в неравноправном положении по отношению к его полюсу, испытывая на себе его увлекающее или тормозящее воздействие.

Проблема власти в экономических концепциях М.И. Туган-Барановского и Я. Такаты

Выдающийся российский экономист М.И.Туган-Барановский предположил, что пропорции обмена и, следовательно, цены на товары определяются в соответствии с отношениями полезностей (аналогично с теорией предельной полезности). Что касается власти, то она включается в сферу распределения.

Чистый продукт распределяется как доход множества экономических агентов или с другой стороны как цена факторов производства. Сама величина чистого продукта определяется в соответствии с отношениями полезностей. Но Туган-Барановский полагал, что величина, распределяемая рабочим как заработная плата или капиталистам – как процент, определяется в соответствии с отношениями власти. Цена товаров определяется предельной полезностью. Но какая часть этой цены распределена рабочим, а какая – капиталисту, решает власть.

Однако распределение и, следовательно, доход являются ценой определенного фактора производства. Цены на факторы производства и цены на товары взаимосвязаны между собой. Исходя из этого Я.Таката, известный японский экономист и социолог, расценивал точку зрения Туган-Барановского о том, что в целом цены формируются под воздействием власти, как ошибку. Однако, симпатизируя автору, Таката полагал, что причина этой ошибки коренится в отсутствии во время написания им своей книги общей теории равновесия, поскольку теория власти Туган-Барановского предшествовала общей теории равновесия.

Я.Таката различает две модели власти в экономической теории. Согласно первой, рыночная экономика является самоуправляемым объектом, а власть – предпосылкой для существования экономики. Поэтому экономическая теория не учитывает действия власти, поскольку она просто формулирует законы движения экономики в соответствии с ее собственной логикой. Согласно второму подходу, автор утверждает, что власть играет активную роль в экономике. Экономика не является независимой от власти и не имеет собственной логики, полностью изолированной от нее.

Я.Таката полагал, что люди не просто стремятся к максимизации полезности, но и обладают волей к власти, ведь мир заселен активным человеческим бытием, а не просто «машинами, калькулирующими полезность». При этом он пытался не заменить теорией власти экономическую теорию предельной полезности, а скорее – соединить их вместе

По Такате, власть имеет два широких типа: «внутренняя власть» (власть подлинная), которую лидеры группы имеют над ее членами, и «внешняя власть» (власть принудительная), которую группы могут иметь «против внешнего мира».

Я. Таката отрицает утверждение, что цена фактора производства определяется исключительно предельной производительностью этого фактора. Ведь без цены на факторы производства невозможно оценить величину предельной производительности, и это логически противоречит определению цены на средства производства через предельную производительность. Предельная производительность – это величина, на которую доход увеличивается или уменьшается, когда определенный фактор производства изымается или добавляется к наиболее благоприятной комбинации факторов производства. Чтобы ее определить, надо знать цены на факторы производства. Если мы не в состоянии установить цену на все средства производства, то мы не сможем определить

наиболее эффективную комбинацию и, следовательно, предельную производительность.

Что касается заработной платы, то она определяется, прежде всего, социальным статусом работника и его внеэкономической властью, а предельная производительность оказывает корректирующее воздействие на оплату труда. Поэтому влияние власти является не просто данным внешним условием, на основе которого развиваются чисто экономические процессы, а их частью, влияющей на определение экономических переменных.

Безработица же может быть объяснена тем фактом, что «рабочие требуют уважения к себе и используют власть таким образом, что они не будут работать за менее чем соответствующую зарплату».

Таким образом, суть экономической теории, основанной на власти, состоит в том, что цены факторов производства (величина доходов) первоначально определяются отношениями власти. По мнению Такаты, это относится к величине не только заработной платы, но также процента и ренты.

Отрицание власти в неоклассической теории и австрийской школе

В неоклассической экономической теории власть как общая характеристика экономической системы отсутствует, а, соответственно – отсутствует и концепция экономической власти. Она рассматривается как отклонение от нормального (естественного) состояния экономической системы, вызванное внешними для экономики факторами.

Государство признается единственным агентом, способным применять санкции, и, следовательно, является единственным источником власти.

Возьмем, к примеру, модель Вальраса, в которой отсутствие власти базируется на предположении о том, что экономические агенты, вступающие в обмен, равны между собой, а также о том, что предложение и спрос находятся в равновесии. В таких условиях рынок носит свободный характер, и каждая транзакция агента равна лучшей из альтернатив. Поэтому агент ничего не теряет, отказываясь от текущей или наиболее предпочтительной транзакции в пользу другой лучшей альтернативы. Следовательно, вопросов о распределении власти и присутствии принуждения в отношениях обмена не возникает: никто не является субъектом каких бы то ни было форм принуждения или какого-либо типа ограничения.

Присутствие властных структур признается неоклассиками только в несовершенном рынке, где существует контроль над ценами со стороны монополий или правительства.

Положение проблемы власти в австрийской экономической теории несколько иное. Вместо того, чтобы отрицать проблему власти, австрийские экономисты отрицают ее важность для объяснения функционирования конкурентной рыночной экономики. По словам Е.Бём-Баверка власть в экономике

следует рассматривать как «насильственное вторжение социальных сил, которые, в конце концов, разрушаются естественными экономическими законами». Этим он хотел подчеркнуть превосходство экономических законов над институциональными факторами власти.

Как пример он рассматривал повышение заработной платы сверх предельной производительности, которое было навязано действиями профсоюзов. Подобное отклонение представлялось лишь как временное явление, поскольку, во-первых, оно побуждает нанимателей заменить методы производства на более капиталоемкие, а во-вторых, конкуренция между уволенными рабочими снова урежет заработную плату до уровня, соответствующего предельной производительности.

Близкую точку зрения на экономическую власть имел Й.Шумпетер. Автора всегда интересовало общество в целом, поэтому в его теории категорическое отрицание действия власти отсутствует. Однако он не рассматривал ее действие в рамках экономической теории, а вместо этого искал результаты экономического поведения или эффективного обмена в рамках того, что может быть названо «чистым обменом».

Но самую радикальную позицию в отношении проблемы экономической власти заняли представители так называемой «неоавстрийской школы»: Ф.Хайек, Л.Мизес, М.Ротбард. Как писал последний, в условиях свободы частное принуждение, «зловеще звучащий» термин «экономическая власть», отсутствует. При этом признаками отсутствия власти являются добровольность обмена и его взаимовыгодный характер. Вместо фактора власти используется фактор права, обуславливавший возможность отказаться совершать предлагаемый обмен. Каждый человек обладает такой властью и таким правом. Поэтому борьба против экономической власти в данном смысле слова, согласно М.Ротбарду, становится бессмысленной.

Аналогичную позицию в отношении проблемы власти занимает Л.Мизес. по его словам, если кто-то желает применить понятие власть к явлениям рынка, то ему следует сказать: в рыночной экономике вся власть принадлежит потребителям. А владение факторами производства не дарует в рыночной экономике власть в смысле принуждения, это скорее служба истинным законодателям рынка – потребителям.

Общее положение австрийской школы состоит также в ограничении власти государства в экономической жизни обеспечением правового порядка. Конкурентного рынка вполне достаточно для регулирования капиталистической экономики.

Таким образом, рассмотренные экономические концепции можно классифицировать по следующим направлениям: полное отрицание влияния власти на экономическое поведение (австрийская школа), признание власти как внешнего фактора, влияющего на экономику и искажающего ее естественное состояние (неоклассическая школа), рассмотрение власти как общей характеристики

экономических взаимодействий (марксизм, институционализм, историческая школа), признание экономической власти самостоятельной экономической категорией (Ф.Перру, Я.Таката, В.Ойкен).

В связи с наличием кардинально противоположных взглядов на фактор власти в экономике, экономическая наука так и не выработала собственного концепта власти, тем более в экономической литературе крайне мало работ, специально посвященные систематическому исследованию понятия «власть». Но, не смотря на это, обобщая существующие экономические концепции, в которых затронута рассматриваемая проблема, можно судить о природе экономической власти, выявить ее признаки и структуру.

ПРИРОДА, ПРИЗНАКИ И СТРУКТУРА КАТЕГОРИИ «ЭКОНОМИЧЕСКАЯ ВЛАСТЬ»

Поскольку власть представляет собой отношения, в процессе которых удовлетворения потребностей одних людей могут сознательно определяться, устанавливаться и формироваться другими людьми, максимизирующими таким путем свою выгоду, то рассмотрим теперь особенности проявления природы власти для каждой из сторон данных отношений – объекта и субъекта власти.

Природа власти для ее объекта состоит в том, что он вынужден в процессе властных отношений нести издержки в пользу субъекта, и при этом не важно, что он непосредственно делает и какой результат производит собственными издержками. Важно то, что они носят вынужденный характер, так как человек предпочел бы обойтись без них при достижении цели. Но несет он издержки лишь потому, что это условие получения выгоды (т.е., другими словами, возможность избежать еще больших издержек). Уже сам факт, что человек «согласен» нести какие-либо затраты ресурсов, предполагает наличие какой-либо внешней или внутренней силы, воздействующей на него. Принудить объект власти нести издержки в пользу ее субъекта означает для субъекта власти создать ее объекту альтернативные издержки в случае его неподчинения, т.е. издержки отказа, превышающие издержки подчинения.

Что касается субъекта власти, то для него природа власти заключается в способности к созданию для контрагента издержек отказа. Властью обладает тот, кто может создавать контрагенту издержки отказа, и тем самым служить силой, которая принуждает объект власти нести издержки подчинения в свою пользу.

Следует подчеркнуть, что не все случаи влияния одного индивида на поведение другого можно охарактеризовать как влияние власти. Для того, чтобы отличать властные отношения от взаимодействий другого рода необходима выявить признаки власти:

- влияние субъекта власти на другой объект власти есть результат стремления первого из них к максимизации полезности через подчинение с этой целью ресурсов второго;

- субъект власти влияет на ее объект тем, что служит для него источником издержек, возникающих в случае неподчинения;
- издержки отказа возникают как результат сознательных и преднамеренных решений субъекта власти в отношении ее объекта;
- объект власти в состоянии предвидеть возможные издержки своего отказа и учитывает их при разработке плана своего поведения;
- подчинение, есть результат воздействия на интересы и мотивы поведения объекта власти;
- суть подчинения состоит в том, что объект несет издержки в пользу субъекта власти.

Исходя из выявленных признаков власти можно сделать выводы о ее структуре. Властные отношения включают четыре основных элемента: субъект, объект (все множество объектов для данного субъекта составляет властное пространство), инструмент и ресурс (источник) власти (все множество ресурсов для данного субъекта составляет властный капитал).

Властное пространство субъекта распадается на несколько зон, каждая из которых обладает характерными только для нее чертами. К таким зонам относятся:

Организация. В данной зоне власть субъекта осуществляется непосредственно и играет роль единственного координирующего механизма.

Мета-корпорация, или множество экономических агентов, связанных с субъектом власти имущественными отношениями (холдинговые системы), долгосрочными контрактами и договорами о передаче властных функций. Данную зону экономической власти можно считать пограничной между организацией и рынком.

Рынок. В этой зоне власть субъекта основана на способности влиять на цены на рынке и повышать экономическую прибыль, ограничивая объем производства и сбыта. Максимальна власть монополиста, затем по убывающей степени - олигополистов, компаний на рынках монополистической конкуренции и компаний на рынках совершенной конкуренции.

Власть во внеэкономической сфере, способная воздействовать на решения государственных органов и других субъектов прочих сфер общественной жизни. Примером может служить лоббирование.

К основным субъектам экономической власти в современном мире относятся: финансовые и нефинансовые корпорации; метакорпорации, или группы, включающие множество компаний, банков и т.п.; международные правительственные и неправительственные экономические и финансовые организации (МВФ, Мировой банк, ВТО и т.д.); некоммерческие структуры, воздействующие на экономические процессы (профсоюзы, объединения потребителей, гражданские союзы и др.); государственные органы (принимая решения, воздействующие на экономическую сферу); отдельные предприниматели и руководители корпораций, а также государственные чиновники; формальные и неформальные объединения предпринимателей.

Эти же группы могут быть и объектами власти, поскольку в организации всегда взаимодействует множество центров влияния. Поэтому организация может рассматриваться и как субъект власти и как зона власти для ее руководителей, менеджеров и др.

Господство субъектов власти основано на ее ресурсах, т.е. свойстве, отличающем субъект власти от объекта и дающем первому доступ к соответствующему инструменту. Власть каждого конкретного субъекта определяется теми ресурсами, которыми он располагает. Но ни для кого не секрет, что рациональный индивид стремится к увеличению собственной выгоды, к ее максимизации. Поэтому в условиях экономической асимметрии власть становится неизбежной. По этой причине ее можно рассматривать как фактор, влияющий на эффективность экономической системы.

ПРОБЛЕМА ЭФФЕКТИВНОСТИ ЭКОНОМИЧЕСКОЙ ВЛАСТИ

Поскольку мы приняли власть как должное, возникает два вопроса: всегда ли она является эффективной и какое влияние она оказывает на экономическое развитие.

В целом экономика является эффективной, если она способствует увеличению общественного богатства. Для этого у экономических агентов должны быть стимулы к продуктивной экономической деятельности в общественных интересах. Созданием таких стимулов обусловлено существование институтов власти, которые призваны ограничить неэффективное производство. Ведь способность экономической организации к эффективному функционированию в известной степени будет зависеть от того, кто, над кем, в какой мере, в каких границах и каким способом осуществляет власть, какие виды экономической деятельности власть ограничивает, на что власть направляет, какие возможности она создает. Сложившаяся система экономической власти может явиться источником результативности и порядка в экономической системе или стать причиной неэффективности и хаоса. Отсюда возникает проблема эффективности системы экономической власти или эффективного равновесия власти в экономической системе.

Экономическая власть может способствовать снижению эффективности экономических процессов по ряду причин. Во-первых, в связи с тем, что субъект затрачивает значительные усилия и ресурсы на поддержание власти, возникают «издержки контроля». Во-вторых, в экономике возможны издержки эгоистического использования власти, особенно в случае с монополиями. В-третьих, возникают издержки недостаточной информированности и рациональности поведения субъекта власти, который также может допустить ошибку, как и любой экономический агент. Последствия таких ошибок отражаются не только на нем одном, но и на всех объектах власти, подчиненных ему. Кроме того, существует определенный лаг между принятием субъектом решения и его исполнением.

Современная экономика во многом является "экономикой власти". В мире сложилось множество крупных корпоративных структур, оказывающих влияние на процессы, происходящие в обществе. Именно в условиях господства корпораций ускорился НТП. Таким образом, отношения власти могут быть и эффективными. Во-первых, экономическая власть приводит к исчезновению транзакционных и информационных издержек. Во-вторых, существуют многочисленные "провалы" рынка, когда он не обеспечивает устранение негативных явлений при производстве общественных благ. И здесь необходима помощь экономической власти (преимущественно государства). В-третьих, действия властвующего субъекта позволяют повысить эффективность производства. Наконец, в-четвертых, именно борьба за власть стимулирует развитие экономических субъектов, приводя к конкуренции.

Но крупные корпорации могут оказаться эффективными лишь тогда, когда они конкурируют друг с другом или с рынком как системой координации. Между тем в этой конкуренции участвует и третья сторона - государство, выступающее в роли арбитра, задачей которого является уравновесить рынок и власть в экономике.

В то же время далеко не всегда конкуренция приводит к выживанию наиболее эффективных форм, например так называемой "новой экономики". В условиях существования "сетевых внешних эффектов" появились новые монополии, власть которых основана на контроле за стандартами сетей. Стандарт может и не быть наиболее эффективным и совершенным, но поскольку его использует большинство, он будет применяться при подключении новых элементов к сети. Таким образом, "власть стандартов" способна снизить эффективность экономики.

Различия в степени эффективности той или иной формы организации системы экономической власти связаны с тем, что формы, в которых могут выступать элементы структуры власти, варианты организации институтов власти и системы власти имеют разные относительные преимущества.

Инструментальные преимущества. Они связаны с инструментальными способностями (в виде ресурсов власти, форм контроля, характера санкций и т.п.) разных форм и институтов власти достигать различных общественных целей. В одних случаях, когда речь идет, например, о необходимости принуждения к выполнению ясных и фиксированных целей, определенные преимущества имеет иерархическая власть. Что же касается инновационной деятельности, то здесь прямая иерархическая власть нередко бессильна и, более того, препятствует творчеству, связанному с созданием, внедрением и восприятием инноваций в силу создаваемых ею высоких транзакционных издержек. В данной ситуации преимущества имеет власть рынка. Государство обладает сравнительными преимуществами в применении насилия, но порождает опасность бюрократизации общества и ограничения экономических прав и свобод. Монопольная власть позволяет своему обладателю мобилизовать финансовые ресурсы, необходимые для осуществления крупных инвестиционных проектов, но вместе с тем

ограничивает воздействие конкурентной среды и потребности общества в инновациях.

Затратные преимущества. Это сравнительные преимущества разных элементов, форм и институтов власти, связанные с величиной издержек по осуществлению экономической власти. В разных экономических ситуациях, достаточно описанных в литературе по неинституциональной экономике, такими преимуществами могут обладать либо рынок, либо фирма, либо государство.

Мотивационные преимущества. Эти преимущества связаны с тем, насколько те или иные субъекты власти обладают мотивацией к достижению желаемых общественных целей. В частности, мотивационные преимущества проявляются в том, насколько носители власти гарантированы от «злоупотребления» ею, от использования своего властного потенциала в частных целях. В данном случае абсолютным преимуществом обладает рынок как форма обезличенной власти.

Поиск эффективной формы организации экономической власти связан с анализом указанных сравнительных преимуществ с точки зрения их соответствия целям экономического развития или, точнее, целям, которых люди хотят достичь в отношении данной экономической системы при данном уровне технического развития и данной социальной среде.

ЛИТЕРАТУРА

1. Блауг М. Экономическая мысль в ретроспективе. – М.: Дело, 1994. – 687 с.
2. Вебер М. Избранные произведения. – М.: Прогресс, 1990. – 808 с.
3. Дементьев В.В. Экономика как система власти. Донецк: «Каштан», 2003. – 245с.
4. Либман А.М. Власть и организационное развитие / Менеджмент в России и за рубежом, №5, 2003 [Электронный ресурс]. – Режим доступа: http://orekhovasv.ru/ls_PDF/B/B7.pdf - Дата доступа: 28.11.2012

Анализ модели человеческого капитала

Романовский А.

Понятие человеческого капитала

Результатом стремительных изменений в производительных силах общества после 2-ой Мировой Войны стала теория человеческого капитала, возникновение которой произошло в середине XX века. Теория приобрела большую популярность на Западе, а ее разработчики Шульц и Беккер стали лауреатами Нобелевской премии по экономике. С помощью установок, которые были предложены учеными, нашлись ответы на многие «спорные» вопросы о роли человека в производстве. Термин «человеческий капитал» впервые появился в работах Теодора Шульца (Theodore Schultz), экономиста, интересовавшегося трудным положением слаборазвитых стран. Шульц заявлял, что улучшение благосостояния бедных

людей зависело не от земли, техники или их усилий, а скорее от знаний, которыми они обладали. Он назвал этот качественный аспект экономики «человеческим капиталом». Шульц, получивший Нобелевскую премию в 1979 году, предложил следующее определение: «Все человеческие способности являются или врожденными, или приобретенными. Каждый человек рождается с индивидуальным комплексом генов, определяющим его врожденные способности. Приобретенные человеком ценные качества, которые могут быть усилены соответствующими вложениями, мы называем человеческим капиталом» [1, с.46].

Часто специалистами в области изучения человеческого капитала принимается за основу подход А. Добрынина, который определил человеческий капитал как «сформированный в результате инвестиций и накопленный человеком определенный запас здоровья, знаний, навыков, способностей, мотиваций, которые целесообразно используются в той или иной сфере общественного воспроизводства, содействуют росту производительности труда и производства, и тем самым, влияют на рост доходов (заработка данного человека)» [2, с.66].

Теорией человеческого капитала стали заниматься еще в XIX в. Тогда это стало одним из перспективных направлений развития экономической науки. Уже со второй половины XX в. она стала основным достижением экономики образования и труда.

Уже в 1950-1960-е годы странами США, Англии и Франции была осознана экономическая важность такого фактора, как образование, которое является одним из главных факторов человеческого капитала. Повышение уровня образования приводило к росту качества человеческого капитала, качества жизни. А к середине XX века были сформулированы методологические основы и главные направления теории “человеческого капитала” такими экономистами как Г. Беккер, У. Боуэн, Э. Дженисон и др. В эпоху научно-технической революции и преобразований в структуре производительных сил, фактором экономического роста становится непосредственно сам работник. Эффективность использования основных ресурсов все больше зависит от того, насколько работники морально и материально заинтересованы в достижении высоких конечных результатов.

Понятие человеческого капитала рассматривают в широком и узком смысле. В узком смысле «одной из форм капитала является образование. Человеческим его назвали потому, что эта форма становится частью человека, а капиталом является вследствие того, что представляет собой источник будущих удовлетворений или будущих заработков, либо того и другого вместе» [3, с.42]. В широком смысле человеческий капитал формируется путем долгосрочных капиталовложений (инвестиций) в человека в виде издержек на образование, подготовку рабочей силы на производстве, а также на здравоохранение, миграцию, улучшение жилищных условий, миграцию и поиск информации о ценах и доходах.

Понятие “человеческого капитала” в “Экономической энциклопедии” определяется как «особый вид капиталовложений, совокупность затрат на развитие воспроизводственного потенциала человека, повышение качества и улучшение

функционирования рабочей силы» [4, с.56]. Обычно в состав человеческого капитала включают знания общеобразовательного и специального характера, навыки, накопленный опыт.

Более полную и развернутую характеристику человеческого капитала можно получить при использовании функционального подхода. Принцип функциональности определения характеризует явление не только с точки зрения его внутренней структуры, но с точки зрения его функционального предназначения, т.е. конечного целевого использования. Следовательно, человеческий капитал - это не просто совокупность навыков, знаний, способностей, которыми обладает человек. Но и:

Во-первых, это накопленный запас навыков, знаний, способностей.

Во-вторых, это такой запас навыков, знаний, способностей, который целесообразно используется человеком в той или иной сфере общественного воспроизводства и способствует росту производительности труда и производства.

В-третьих, целесообразное использование данного запаса в виде высокопроизводительной деятельности закономерно приводит к росту заработков (доходов) работника.

В-четвертых, увеличение доходов стимулирует, заинтересовывает человека путем вложений, которые могут касаться здоровья, образования и др., увеличить, накопить новый запас навыков, знаний и мотиваций, чтобы в дальнейшем его вновь эффективно применить.

Человеческий капитал развивается в контексте, включающем:

- 1) обучение в семье в период раннего детства;
- 2) формальное образование и профессиональную подготовку, включая раннее детство, школьное обязательное образование, профессиональное или общее образование сверх обязательного уровня, высшее образование, профессиональное образование на рынке труда, обучение взрослых и т.д.;
- 3) профессиональную подготовку на рабочем месте, а также информационное обучение на работе посредством специфической деятельности, такой, как исследования и инновации или участие в различных профессиональных объединениях;
- 4) неформальное информационное обучение на рабочем месте и в повседневной жизни и гражданской деятельности.

Человеческий капитал очень разнообразен по своей природе. Навыки могут быть:

- 1) общими (к примеру, способность читать, писать, считать и говорить). Относится к общему человеческому капиталу.
- 2) глубоко специфическими, а также более или менее пригодными для разных обстоятельств и ситуаций. Специфические навыки и знания, которые необходимы фирмам, корпорациям, приобретаются на рабочем месте или путем обучения, организованного самой фирмой (корпорацией). Относится к специфическому человеческому капиталу.

3) интеллектуальными. Сюда входит хорошее образование, квалификация, профессиональные знания и опыт. Относится к человеческому интеллектуальному капиталу

Наиболее интересный факт человеческого капитала состоит в том, что большинство навыков и знаний являются скрытыми, т.е. они не зафиксированы и документально не подтверждены. Это происходит из-за сложности и отсутствия документальных стандартных форм подтверждения, либо само подтверждение не было произведено. Чем более скрытыми и неявными являются знания, тем ими труднее обмениваться, также затрудняется распространение этих скрытых навыков. Некоторые ключевые знания и личные качества, относящиеся к человеческому капиталу, могут быть структурированы следующим образом:

1) Коммуникации (включая владение иностранными языками по каждому из последующих пунктов). Сюда входит понимание речи, умение говорить, чтение, письмо, ораторство.

2) Счет.

3) Внутриличностные навыки. К ним относятся мотивация, настойчивость, «обучение учению», самодисциплина (включая саморегулируемые стратегии обучения); а также способность делать выводы на основе соответствующего набора этических ценностей и целей жизни.

4) Межличностные навыки (работа в команде, лидерство)

5) Прочие навыки и свойства (относящиеся ко многим вышеперечисленным областям). Это способность к применению информационных и компьютерных технологий, скрытые знания, умение решать проблемы (отчасти воплощается в других типах навыков), физические качества и сноровка [5, с.44].

Человеческий капитал обладает следующими особенностями:

1) в современных условиях человеческий капитал является главной ценностью общества и главным фактором экономического роста;

2) формирование человеческого капитала требует от самого человека и всего общества значительных затрат;

3) человеческий капитал в виде навыков и способностей является определенным запасом, т.е. может быть накапливаемым;

4) человеческий капитал может физически изнашиваться, экономически изменять свою стоимость и амортизироваться;

5) человеческий капитал отличается от физического капитала по степени ликвидности;

6) человеческий капитал неотделим от его носителя – живой человеческой личности;

7) независимо от источников формирования, которые могут быть государственными, семейными, частными и др., использование человеческого капитала и получение прямых доходов контролируется самим человеком.

В экономической литературе можно встретить несколько подходов по классификации видов человеческого капитала. Виды человеческого капитала

можно классифицировать по элементам затрат, инвестиций в человеческий капитал. Например, выделяют следующие его составляющие: капитал образования, капитал здоровья и капитал культуры.

С точки зрения характера содействия экономическому благосостоянию общества различают потребительский и производительный человеческий капитал.

Потребительский капитал создает поток услуг, потребляемых непосредственно, и, таким образом, содействует общественной полезности. Это может быть творческая и образовательная деятельность. Результат такой деятельности выражается в предоставлении потребителю таких потребительских услуг, которые приводят к появлению новых способов удовлетворения потребностей или повышению эффективности существующих способов их удовлетворения.

Производительный капитал создает поток услуг, потребление которых содействует общественной полезности. В этом случае имеется в виду научная и образовательная деятельность, имеющая непосредственное практическое применение именно в производстве (создание средств производства, технологий, производственных услуг и продуктов).

Следующим критерием классификации видов человеческого капитала является различие между формами, в которых он воплощается:

- 1) Живой капитал включает в себя знания, воплощенные в человеке.
- 2) Неживой капитал создается, когда знания воплощаются в физических, материальных формах.
- 3) Институциональный капитал состоит из живого и неживого капитала, связанного с производством услуг, удовлетворяющих коллективные нужды общества. Он включает в себя все правительственные и неправительственные институты, которые содействуют эффективному использованию двух типов капитала (образовательные и финансовые учреждения) [6, с.28].

Основные компоненты человеческого капитала

Человеческий капитал в современной, интеллектуализированной, экономике неоднороден. Сейчас мы рассмотрим, что представляют собой компоненты человеческого капитала, дополнительные к интеллектуальным ресурсам личности.

Биофизический капитал — это жизненные ресурсы личности, ее физический и психологический потенциал, рассматриваемые в контексте способности к созданию стоимости. Можно привести немало примеров, когда именно этот вид ресурсов является не только доминирующим, но и весьма дорогостоящим. Так, для профессиональных баскетболистов одним из ключевых компонентов их человеческого капитала является, как правило, рост. Существуют люди, например актеры-карлики, извлекающие доход из аномалии своего физического развития. Велико значение опосредованного влияния биофизических ресурсов как естественного, природного ограничения профессиональных возможностей личности (возраст, пол, состояние здоровья) [8, с.82]. Поэтому закономерно, что

сегодня практически все исследователи рассматривают затраты на здравоохранение как инвестиции в человеческий капитал.

Другим важным компонентом человеческого капитала являются социальные ресурсы личности, то есть заложенный в человеке потенциал социального взаимодействия, его включенность в определенную социальную среду. В течение долгого времени социальные ресурсы личности определялись преимущественно происхождением человека, его принадлежностью к той или иной социальной группе. Любой гражданин Древнего Рима имел право на хлеб и зрелища, которые стали неотъемлемой частью экономики того времени: хлеб нужно было растить, для зрелищ нужны были Колизей, гладиаторы и львы. Иными словами, социальный капитал, являясь принадлежностью человека, не был обусловлен его индивидуальными заслугами, а был связан с экономикой скорее в потребительском, чем в созидательном плане [11, с. 96].

Различные виды человеческого капитала и средства их формирования взаимодействуют. Долгое время базой социального капитала было богатство в натуральной или денежной форме. Наряду с этим фактором большую роль в формировании социального капитала играло и играет образование, обеспечивающее социализацию личности. Образование дает не только знания и умения, составляющие основу интеллектуального капитала, но и определенный престиж в обществе, причем тем больший, чем большим социальным капиталом обладает соответствующее образовательное учреждение. Сегодня все более отчетливо прослеживается обратное воздействие, например участие в добровольческой деятельности (волонтерство), спонсорство, благотворительность оказывают влияние на экономические результаты, интеллектуальную или политическую карьеру.

Интеллектуальные ресурсы личности – это сформированные в процессе формального и неформального обучения знания, информация и креативные способности человека. Интеллектуально богатыми являются люди, которые демонстрируют успешные черты личности, обладают хорошей общей и профессиональной подготовкой, хорошими тактическими способностями, умеют принимать правильные решения стоящих перед ними проблем и обеспечивать их выполнение.

Характеризуя свойства интеллектуальных ресурсов личности, можно выделить сначала те, которые свойственны человеческому капиталу вообще:

- 1) Человеческий капитал неотчуждаем и, соответственно, неликвиден. Если человек располагает неиспользуемыми материальными ресурсами, он может сдать их в аренду, взять ссуду под залог этих материальных ценностей, в конце концов – законсервировать до лучших времен, что невозможно по отношению к интеллектуальным способностям и знаниям.

- 2) Интеллектуальные ресурсы являются ресурсами двойного назначения. Они используются не только в производственной (экономической) деятельности, но и в повседневном обиходе, в жизни, идущей за границами рабочего времени.

Поэтому инвестиции в формирование интеллектуальных ресурсов, как и человеческого капитала вообще, не отделимы от расходов на потребление.

3) Человеческий капитал не храним. Он существует только в текущее время, и время, в течение которого он не использовался, упущено навсегда. Для человека, не работающего по специальности, стоимость образования относится соответствующей долей на неявные издержки его нынешней деятельности.

4) Так же как и другие виды человеческого капитала, интеллектуальные ресурсы личности двойственны с точки зрения их рыночной стоимости. Лейф Эдвинссон вводит, в частности, понятия «базовая стоимость человеческого капитала» и «потенциальная стоимость человеческого капитала». Базовая стоимость человеческого капитала рассматривается как дисконтированная рыночная стоимость будущего дохода, на которую ориентируется индивид, определяя целесообразность инвестиций в образование. Потенциальная стоимость человеческого капитала – это та стоимость, на которую ориентируется предприниматель, нанимающий индивида, то есть арендующий его человеческий, в частности интеллектуальный, капитал. При формировании цены рабочей силы на рынке труда она зависит от доходности ресурса труда и издержек предпринимателя на его оплату.

5) Профессиональные знания человека также формирует человеческий капитал. Однако, если знания довольно специфические, то они могут быть использованы работником только в какой-то конкретной сфере деятельности или в определенной организации, в отличие от каких-то общих знаний.

6) В процессе формирования интеллектуальных ресурсов задействованы врожденные и сформированные в процессе воспитания способности личности. Очевидно, что в известной мере наследуется и биофизический капитал. Определенные врожденные психологические предпосылки имеет и интеллектуальный капитал. Наряду с этими общими свойствами, характерными для человеческого капитала, интеллектуальный капитал обладает рядом специфических особенностей. Такими специфическими для интеллектуального капитала чертами являются старение знаний, соотношение явного и неявного знания в структуре интеллектуальных ресурсов личности.

Под процессом старения знаний понимается не утрата знания, связанная с биофизическим старением работника, а явление, аналогичное моральному износу оборудования, в основе которого лежит старение объективированного в этом оборудовании знания.

Альберт Шапиро выдвинул гипотезу о полураспаде знаний (дословно – о «половине жизни знания»), получившую широкий отклик среди специалистов по управлению человеческими ресурсами. Это определение заимствовано из физики, где существует понятие периода полураспада радиоактивности. Имеется в виду, что интенсивность излучения радиоактивного вещества постепенно сокращается, но никогда не исчезает окончательно. Поэтому определяется период, за который излучение сокращается наполовину [9, с.216].

Применительно к знанию данная аналогия справедлива. Человек никогда ничего не забывает окончательно, и при определенном стечении обстоятельств из его памяти выплывает нечто, казалось бы, давно, забытое. Период полураспада знаний определяется как время после завершения обучения, в течение которого профессионалы теряют половину первоначальной компетентности. Сегодня считается, что период полураспада знаний в сфере науки и проектирования составляет около 5 лет. Знания с коротким периодом полураспада соответствуют условиям деятельности частного сектора и, в частности, в области финансов. Знания с длинным периодом полураспада фундаментальны и более устойчивы к действию факторов морального старения, являются базой для приобретения многих видов знания с коротким периодом полураспада. Более длительным периодом жизни обладают знания, адаптированные к условиям общественного сектора экономики и государственного управления.

Долговременные знания даются человеку академическим базовым образованием, которое требует достаточно долгого периода и финансируется семьей и государством. Знания с коротким периодом полураспада требуют гораздо более короткого периода обучения, которое финансируется самим работником и (или) работодателем. Оба эти типа знания характеризуются различной экономической отдачей.

Особенности процесса приобретения и использования знания определяют связь индивидуума с организацией, интеллектуальный капитал которой он формирует. С одной стороны, работник нуждается в организации, особенно в силу продолжающейся специализации знания, которое может быть применено только в организации и через организацию. С другой стороны, работник квалифицированного труда, знания и умения которого образуют его уникальный капитал, значительно отличается от обычного промышленного рабочего. Его капитал (знания) и средства производства (интеллектуальные инструменты анализа, синтеза, моделирования и т. п.) ставят его в положение внутреннего предпринимателя.

После изучения основных компонентов человеческого капитала можно прийти к заключению, что человеческий капитал в современной экономике довольно неоднороден и правильный анализ всех его компонентов поможет лучше изучить его. После изучения человеческого капитала, его особенностей, теории развития человеческого капитала, современных и классических подходов изучения к нему, его структуры, можно прийти к следующим выводам:

- 1) Человеческий капитал, – как определяют его большинство экономистов классической школы, – состоит из приобретенных знаний, навыков, мотиваций и энергии, которыми наделены человеческие существа и которые могут использоваться в течение определенного периода времени в целях производства товаров и услуг.

- 2) Важнейшими формами вложений в человека западные экономисты считают образование, подготовку на производстве, медицинское обслуживание,

миграцию, поиск информации о ценах и доходах, рождение детей и уход за ними. Современные экономисты классифицируют человеческий капитал следующим образом: капитал здоровья, капитал образования и капитал культуры, акцентируя внимание на первом из них. Также капитал подразделяют на социальный, витальный (генный) и духовный.

3) Человеческий капитал, как разнородное понятие, имеет множество особенностей и классификаций.

Классический подход. Методологический индивидуализм

Экономисты всех школ, начиная с экономических учений древней Азии и древней Греции, стремились выявить причину возникновения добавочного продукта и пояснить каким образом можно этот добавочный продукт увеличить. Так, в Кодексе законов вавилонского царя Хаммурапи (1792 – 1750 гг. до н.э.) большое внимание уделялось регулированию отношений найма и размеров оплаты за наемный труд, правовой защите личностей производителей. При этом производитель, а в Древней Греции, например, это, прежде всего, был раб, рассматривался как «говорящее орудие, имеющее низкую производительность труда». Тем не менее, признавалось, что и раба нужно материально поощрять за его труд [9, с.52].

Далее, Томас Манн (1571 – 1641 гг.) являлся классическим представителем зрелого меркантилизма. Не заботясь об общем благосостоянии нации и являясь представителем купеческого капитала, он признал первым и главным способом снижения издержек ограничение заработной платы наемных рабочих и понижение жизненного уровня народа в целом [10, с.118].

Пионером исследования человеческого капитала является лауреат Нобелевской премии Т. Шульц. В эпоху научно-технической революции объективно требовался пересмотр роли знания и образования в создании национального дохода и экономическом росте. Доказывая, что в экономике США доход от человеческого капитала больше, чем от капитала физического. Шульц призывал страны делать крупные инвестиции в образование, здравоохранение и науку. Развитие этих сфер, по его мнению, важнее для экономического роста, чем строительство новых фабрик и заводов. [11, с.60].

Оформление теории человеческого капитала приходится на конец 50-х и начало 60-х годов в США. На правах особого раздела она вошла во все западные учебники по экономике. У истоков ее стояли известные американские экономисты, представители так называемой «чикагской школы», – лауреаты Нобелевской премии Теодор Шульц и Гэри Беккер, Бартон Вейсброт, Джордж Минцер, Ли Хансен. Позднее большой вклад в ее разработку внесли Марк Блауг, С. Боулс, Йорам Бен-Порэт, Ричард Лэйард, Дж. Псахаропулос, Ф. Уэлч, Б.Чизвик и другие. В том виде, в котором она была первоначально сформулирована, исследовательская программа по изучению человеческого капитала характеризовалась

методологическим индивидуализмом. Методологический индивидуализм – представление о том, что любые социальные явления могут быть сведены к их основаниям в области индивидуального поведения. Это было связано с тем, что родоначальники теории человеческого капитала были хорошо ознакомлены с частной медициной и частным образованием, что, по сути, является инвестициями в человеческий капитал, в то время, 1960е годы американские общественные программы по образованию и оказанию медицинских услуг практически отсутствовали. [15, с. 321]

Классическим сочинением, во многом определившим дальнейшее направление исследований в этой области, считается книга Гэри Беккера «Человеческий капитал» (первое издание – 1964 г., второе – 1975 г.).

В целом эта концепция лежит в русле неоклассического направления, но набор аналитических инструментов неоклассической школы используется ею для изучения тех социальных институтов (образование, здравоохранение и т.д.), которые оставались прежде за пределами экономического анализа.

Центральная методологическая установка «чикагской школы» человеческого капитала – объяснять экономические процессы на основе принципа максимизирующего поведения индивидуумов – перенесена на самые различные сферы вне рыночной деятельности человека. При этом упор делается на количественном анализе. Концепция «чикагской школы» предполагает, что вложения средств в образование, здравоохранение, миграцию и другие виды деятельности производятся на рациональной основе – ради получения больших доходов в будущем.

Эти затраты, или инвестиции, на производство человеческого капитала являются исключительно важными для семьи и для всего общества.

К ожидаемой отдаче от инвестиций в человеческий капитал относятся более высокий уровень заработков, большее удовлетворение от избранной работы в течение жизни, а также более высокая оценка нерыночных видов деятельности.

В целом неоклассическая теория рынка труда содержит:

1) Теорию спроса на труд, которая включает в себя теорию предельной производительности и связанный с нею аппарат производственных функций.

2) Теорию предложения труда, которая, в общем, состоит из моделей выбора между работой и досугом и моделей инвестирования в человеческий капитал [13, с.86].

Производительные качества и характеристики работника были признаны особой формой капитала на том основании, что их развитие требует значительных затрат времени и материальных ресурсов и что они, подобно физическому капиталу, обеспечивают своему владельцу более высокий доход. В последние десятилетия идея, что капитал состоит из одних физических активов, была подорвана. На ее месте постепенно утвердился более всеобъемлющий взгляд, согласно которому капиталом является любой актив – физический или человеческий, обладающий способностью генерировать поток будущих доходов.

Важнейшими формами вложений в человека западные экономисты считают образование, подготовку на производстве (on – the job training), медицинское обслуживание, миграцию, поиск информации о ценах и доходах, рождение детей и уход за ними. Образование и подготовка на производстве повышают уровень знаний человека, т.е. увеличивают объем человеческого капитала. Охрана здоровья, сокращая заболеваемость и смертность, продлевает срок службы человека, а также увеличивает интенсивность его использования. Миграция и поиск информации способствуют перемещению рабочей силы в районы и отрасли, где труд лучше оплачивается, т.е. туда, где цена за услуги человеческого капитала выше.

Рождение детей и уход за ними представляют собой форму воспроизводства человеческого капитала в следующем поколении.

В этой классификации уравниваются факторы разного срока действия и влияющие на разные стороны воспроизводства рабочей силы.

Образование и здравоохранение – это факторы долговременного действия. Продуктом процесса образования является качественно новая рабочая сила с высоким уровнем квалификации, способная к труду большей сложности. Охрана здоровья делает человека способным к более интенсивному и продолжительному труду. В отличие от них миграция и поиск информации выступают как факторы кратковременного действия. Если образование и охрана здоровья связаны с действительным ростом стоимости рабочей силы, то миграция и поиск информации отражают колебания цены рабочей силы вокруг стоимости. Миграция и поиск информации – это процессы распределительного порядка, тогда как образование и здравоохранение представляют собой отдельные моменты в производстве рабочей силы.

Как показывают расчеты, в 1969 г. в США средний пожизненный доход (lifetime income) мужчин с высшим образованием превосходил пожизненный доход мужчин со средним образованием примерно на 210 тыс. долларов. В том же 1969 г. стоимость четырех лет пребывания в колледже равнялась в среднем 5,2 тыс. долларов [14, с.50].

Следовательно, разница в пожизненных доходах примерно в 40 раз или почти на 205 тыс. долларов превышала прямые издержки обучения в высшем учебном заведении.

Если же рост образовательной подготовки связан с получением подготовки, а это именно так, то можно, конечно, охарактеризовать затраты на приобретение образования как возрастающую стоимость. Но сказать, что это капитал, то есть самовозрастающая стоимость, было бы нелепо. Ценность квалификации возрастает не сама: неперенным условием является здесь труд ее носителя.

Западные экономисты признают, что создание человеческого капитала (например, процесс обучения) требует активных трудовых усилий от «инвестора». Человеческий капитал (т.е. запас знаний и способностей, накопленных работником) может реализоваться только в труде своего обладателя. Напротив, возрастание

стоимости капитала не требует от собственника каких-либо затрат труда с его стороны.

Что же тогда означает выдвижение понятия «человеческий капитал»? Не более чем осознание того факта, что навыки и способности людей могут быть запасом, то есть могут быть накапливаемы. Таким образом, западная политэкономия вновь открыла для себя то, что было известно еще Адаму Смиту и Давиду Риккардо. Помимо А Смита и В. Петти, другие экономисты – Э. Денисон, Дж.Р. Маккуллох, Н. Сениор, Генри Д. Маклеод, Ирвин Фишер, рассматривающие человеческий капитал на микро- и макроуровнях, утверждали, что люди должны быть включены в категорию капитала. Они аргументировали свою точку зрения следующим: продукт труда работников увеличивает национальное богатство; расходы на человека, которые увеличивают этот продукт, будут увеличивать национальное богатство; затраты на воспитание и образование людей являются реальными затратами.

Т.Шульц также призывал других ученых отказаться оттого, что он считал «интеллектуальными ошибками» традиционных экономистов, предлагая делать упор на качество человека как участника производства. В статье «Создание капитала образованием» [11, с.258]. Т.Шульц представил оценки стоимости рабочей силы, включающие расходы на образование и стоимость труда, потерянной человеком за время его учебы. По сути дела, Т.Шульц приобрел славу отца революции вложений в человеческий капитал. Для него эти вложения имели широкое содержание: к ним он относил вложения в образование в стенах учебных заведений, дома, на работе, а также капиталовложения в сферу здравоохранения, образования и науки.

ЛИТЕРАТУРА

1. Добрынин А.И. Человеческий капитал в транзитивной экономике: формирование, оценка, эффективность использования/ А. И. Добрынин, С.А. Дятлов, Е.Д. Цыренова. – СПб.: Наука, 1999. – с. 46-49
2. Щетинин В. Человеческий капитал и неоднозначность его трактовки// МЭ и МО. – 2006. – № 12. – С. 66-74
3. Борисов Г.В. Инвестирование в человеческий капитал в условиях трансформирующейся экономики России// Вестник С.-Петербур. ун-та. – 2004. – № 2. – С. 42-56
4. Борисов Г.В. Человеческий капитал фирмы// Вестник С.-Петербур. ун-та. – 2004. – № 1. – С. 56-62
5. Матюхин В.А. Взаимосвязь высшего образования и трудоустройства выпускников вузов в развитых европейских странах// Вестник С.-Петербур. ун-та. – 2006. – № 4. – С. 44-48
6. Борисов Г.В. Инвестирование в человеческий капитал в условиях трансформирующейся экономики России// Вестник С.-Петербур. ун-та. – 2004. – № 2. – С. 28-44
7. Ильинский И.В. Инвестиции в будущее: образование в инновационном воспроизводстве. СПб.: Изд. СПбУЭФ, 1996. – С. 94-1122

8. 8. Лысков А.Ф. Человеческий капитал: понятие и взаимосвязь с другими категориями// Менеджмент в России и за рубежом. – 2004. – № 6. – С. 58-68
9. 9. Теория человеческого капитала: Учебное пособие/ Под ред. С.А. Дятлова. – СПбУЭФ, 1996. – С. 52-63
10. 10. Концепция человеческого капитала: Учебное пособие/ Под ред. Р.И. Капелюшникова. – М., 1977. – С. 118-134
11. 11. Шульц Т. Ценность детей// THESIS. – 1994. – № 6. – С. 60-76
12. 12. Саградов А. А. Человеческий капитал: источник развития// Экономика и жизнь. – 2006. – № 2. – С. 18-26
13. 13. Беккер Г.С. Человеческое поведение: экономический подход. Избранные труды по экономической теории/ пер. с англ. – М.: Высшая школа, 2003. – С. 86-90
14. 14. Зиятдинова Ф.Г. Образование и наука в трансформирующемся обществе// СОЦИС. – 2000. – № 11. – С. 50-58
15. 15. Блауг М. Методология экономической науки. – Журнал «Вопросы экономики», 2004. – С. 321

Общее и особенное в подходах к изучению общего экономического равновесия

Солянская И.

Помимо присутствия многочисленных последователей марксистской политической экономии, вторая половина XIX века характеризуется появлением неоклассического направления экономической мысли, связанного с изучением механизма функционирования рыночного хозяйства. Формирование неоклассического направления происходило под влиянием классической политической экономии в ходе маржиналистской научной революции.

Неоклассики. Лозаннская школа

Лозаннская школа, будучи ветвью маржиналистского направления экономической мысли, впервые осуществила анализ хозяйства с точки зрения общего равновесия. Именно представители лозаннской школы, наряду с английскими маржиналистами У. С. Джевонсом и Ф. И. Эджуортом, оказались инициаторами внедрения в экономическую науку математических методов, особенно методов дифференциального исчисления.

Будучи представителем Лозаннской школы, Леон Вальрас в 1874 г. первым высказал мысль, что максимизирующее поведение потребителей и производителей может привести и при некоторых условиях приведет к равновесию между величиной спроса и величиной предложения на рынке каждого товара и фактора производства в экономике. [2, стр. 256] Современники Вальраса, изучающие принципы равновесия рынка, могли допустить, что на них может существовать равновесие. Однако они исследовали этот вопрос с позиций отдельных рынков, т.е.

анализировали частичное равновесие, как, например, А. Маршалл. В то время экономисты не учитывали, что равновесные состояния на отдельных рынках не образуют общее равновесие, и рассматривали только равновесие на микроуровне. Вопрос существования равновесия на макроуровне очень подробно исследовал Леон Вальрас, основоположник теории общего равновесия. [3].

Его теория объединяет в себе «революционную» креативность и классический синтез. Эта теория – своего рода базис на пути экономистов к точной науке и, несмотря на свою устарелость в наши дни, все еще составляет основу большей части современных теоретических исследований. Мари Эспри Леон Вальрас (1834-1910) был французом. Французскими были и все корни его достижений. Сам он подчеркивал влияние своего отца Огюста Вальраса и Курно. Но, как отмечалось выше, следует учитывать и влияние Сэя, его подлинного предшественника. А за спиной Сэя вырисовывается вся французская традиция: Кондильяк, Тюрго, Кенэ, Буагильбер, независимо от того, как много или мало Вальрас сознательно почерпнул из нее. Он оказывал традиционное уважение А. Смиту. [13]

Модель Л. Вальраса

Основные условия модели Л. Вальраса:

1) совершенная конкуренция (а именно множество продавцов и покупателей, свободный вход и выход из отрасли, полная информированность и т.д.)

2) Каждый экономический субъект стремится максимизировать свою прибыль. Существует m видов потребительских благ (которые производятся конкурентными фирмами).

3) В хозяйстве имеется n видов ресурсов. Они находятся в собственности потребителей и предоставляются последними фирмам по некоторым ценам, причем каждый потребитель может иметь любое количество видов ресурсов, и не обязательно поставляет на рынок ресурсов все свои ресурсы. Потребители максимизируют свои функции полезности.

4) для производства единицы каждого блага необходимо фиксированное количество каждого ресурса. [1]

Таким образом, теория Вальраса основана на системе k уравнений, в которой эти уравнения отражают равновесные состояния на отдельных рынках, а, соответственно, эта система будет отражать общее равновесие. Поэтому Л. Вальрас попытался доказать, что эту систему можно решить – в таком случае он и доказал бы, что существует общее равновесие. Для начала он принял некоторые допущения, а именно то, что количество рабочих, оборудования, месторасположение фирмы и коэффициенты затрат заданы, в то время как предложение труда и капитала переменны. [3] А это значит, что неизвестные в этой системе - цены всех благ и факторов производства и их количества. Сами же уравнения можно разделить на 4 группы: уравнения для спроса на потребительские блага, уравнения для

предложения ресурсов, уравнения для равновесия в отрасли, уравнения для спроса на ресурсы [1]. Эти уравнения отражают поведение потребителей и производителей, направленное на максимизацию выгод, т.к. это необходимый фактор для существования равновесия – максимизация полезности. Для максимизации полезности требуется, чтобы предельные полезности покупаемых товаров и производительных услуг были пропорциональны их ценам. С помощью математических подсчетов Л. Вальрас пришел к системе, которая имеет k решений и k неизвестных. А это означает, что система имеет решения, то есть существует общее равновесие.

Недочеты в теории Л. Вальраса:

1) Графическое отображение решения системы уравнений может показать, что прямые могут и вовсе не пересечься, либо наоборот, пересечься несколько раз, что будет означать, что существуют несколько точек равновесия.

2) Вполне возможно, что решения будут содержать «отрицательные или бесконечные цены», чего не может быть.

3) Равенство количества независимых уравнений числу неизвестных - это лишь необходимое, но не достаточное условие решения системы уравнений общего равновесия. [3]

4) Согласно закону Вальраса, равновесие на денежном рынке должно устанавливаться автоматически, а повышение общего уровня цен не должно вызывать никаких изменений на денежном рынке. На самом же деле увеличение уровня цен всегда приводит к дополнительному росту спроса на деньги. [5, стр. 356]

5) Данная модель не подразумевает развития во времени: внедрения новых технологий, развития НТР, присутствия риска и неопределенности и т.д.[1]

Безусловно, модель Леона Вальраса – сильно упрощена и крайне нереалистична с точки зрения экономических реалий, однако не стоит недооценивать его вклад в развитие экономической науки. Полный смысл того, что «все зависит от всего» не был осознан до Вальраса, а современные теории денег, международной торговли, занятости и экономического роста – это упрощенные варианты теории общего равновесия. [3]. Иными словами, его модель можно назвать универсальной экономической моделью.

Ф. Эджуорт

Ф. Эджуорт – яркий представитель маржиналистского направления экономической мысли. Теория общего равновесия Эджуорта базируется на теории равновесия Вальраса. Однако его программа ставила своей целью сопоставить и определить связь между равновесием Вальраса в условиях конкуренции и решениями, которые были получены путем альтернативного анализа обменных процессов (из теории игр). Гипотеза Эджуорта заключалась в том, что если конкуренция будет увеличиваться до бесконечности (т.е. число продавцов), то

множество решений системы Вальраса будет уменьшаться до единицы, т.е. это будет являться доказательством того, что существует единственная точка равновесия. (Эту гипотезу доказывали такие ученые, как Жерар Дебре, Герберт Скарф, Роберт Ауманн и Труман Бевли). [7]

Также Эджуорт известен своей графической конструкцией, названной «ящиком Эджуорта», или «ящиком обмена благ». Этот ящик анализирует распределение двух благ между двумя субъектами рынка. Он состоит из двух систем координат, каждая из которых соответствует экономическому субъекту. Кривые, изображенные на графике - это кривые безразличия обоих субъектов. Чем дальше кривая безразличия от координатных осей, тем больше полезности получает субъект от потребления товара. В том случае, если эти кривые касаются друг друга, то каждый из субъектов максимизирует полезность при помощи обмена. Любой другой случай месторасположения кривых не приведет к более выгодной позиции одновременно как первого, так и второго потребителя. [9].

Эджуорту удалось проникнуть глубоко в суть проблемы и его работы сделали возможным иной, альтернативный подход к вопросу о существовании конкурентного равновесия [4].

В. Парето

Описывая достижения ученых в сфере равновесия, нельзя не отметить заслуги В. Парето. В. Парето усовершенствовал модель, разработанную Эджуортом. Он изменил ящик Эджуорта и исследовал эту модель в трехмерном пространстве. Если Эджуорт указывал на то, что при помощи его модели можно определить рыночную цену, то Парето определял с помощью этой модели оптимум потребления.

К тому же к заслугам В. Парето, современника Л. Вальраса и представителя Лозаннской школы, можно отнести и то, что он усовершенствовал теорию общего равновесия, а именно вывел пять необходимых и достаточных условий существования общего равновесия (в рыночной экономике):

- 1) Взвешенные по ценам предпочтения равны для всех товаров;
- 2) Доходы и расходы каждого домохозяйства равны;
- 3) Переход от неравновесного состояния в экономике к равновесному не требует изменений в объемах предложения благ;
- 4) Цены продукта равны издержкам на производство этого продукта (т.е. условие конкурентного рынка);
- 5) Производственные блага полностью используются в процессе производства, т.е. отсутствует избыточная производственная мощность.

В. Парето разработал теорию оптимального размещения ресурсов, которая гласила, что об улучшении благосостояния можно говорить лишь тогда, когда повышение уровня жизни отдельных членов общества не связано с ухудшением

жизни у других, т. е. автор выступает со своим пониманием социального благосостояния. [8]

Дж. Б. Кларк

В XIX веке Дж. Б. Кларк был единственным американцем, внесшим значительный вклад в маржиналистскую парадигму. Согласно мнению Дж. Б. Кларка, экономический анализ статки должен объяснять основные закономерности экономики, т.е. условия экономического равновесия. Динамическую ситуацию по Дж. Б. Кларку можно охарактеризовать как нарушение равновесия и переход от одного равновесия к другому. В динамике появляется новая экономическая переменная - предпринимательская прибыль. В статике она всегда равна нулю, а доход предпринимателя сводится к заработной плате высококвалифицированного труда. Предпринимательская прибыль в динамике является вознаграждением за технические и организационные нововведения. Эта концепция, как уже отмечалось, является основным элементом вклада Дж. Б. Кларка в маржиналистское учение, да и в экономическую науку в целом.

Основной недостаток подхода лозаннцев к анализу экономики было ее уподобление механическим системам. В этом они резко отличались от австрийцев и были близки к экономистам-классикам; более того, можно сказать, что по механистичности своего анализа они пошли гораздо дальше последних. Для классиков, как уже упоминалось, уподобление экономики механическим объектам имело значение с точки зрения выдвижения идеи о том, что ей внутренне присущи универсальные и объективные законы. Что же касается представителей лозаннской школы, то для них такое уподобление было важно потому, что позволяло представлять экономику как равновесную систему.

Неовальрасова модель общего равновесия

После Вальраса многие ученые также занимались этой проблемой, особенно в послевоенный период. Это были его последователи или же последователи Вильфредо Парето. Таким образом, эти ученые сформировали неовальрасову школу. Наиболее знаменитые последователи Вальраса - Тьяллинг Купманс, Джон Хикс, Кеннет Эрроу, Жерар Дебре, Лайонел Мак-Кинзи, Давид Гейл, Герберт Скарф. Из японских ученых выделились Хукукане Никайдо и Такаши Негуши.[3] Первое строгое доказательство (то есть соблюдение и необходимого и достаточного условий) существования общего равновесия осуществил в 1930-х гг. немецкий математик и статистик А. Вальд. Впоследствии это доказательство усовершенствовали в 1950-х гг. К. Эрроу и Ж. Дебре.[1].

К. Эрроу и Ж. Дебре

Эти ученые базировались на доказательстве теории общего равновесия Вальраса, однако ввели в нее некоторые изменения и уточнения. Например, у Вальраса технологии были фиксированным коэффициентом, в модели Эрроу – Дебре была произведена их замена на изменяющиеся производственные возможности. Одним из недочетов в работе Вальраса было то, что цены в решении его системы могли бы получиться отрицательными. К. Эрроу и Ж. Дебре занялись изучением вопроса, может ли существовать такой набор цен (положительных), при которых каждый субъект рынка максимизировал бы полезность, и не было бы избыточного спроса или предложения. [4]. Основные условия действия этой модели:

- 1) Домохозяйства предлагают труд и потребляют положительное число товаров.
- 2) Домохозяйства претендуют на некоторую долю прибыли, их кривые безразличия выпуклы. [10]
- 3) Происходит постоянная отдача от масштаба (что можно охарактеризовать как недочет в этой модели)
- 4) Для любого товара существуют один или несколько других товаров, которые находятся с ним в отношении замещения. [1].

С помощью метода математического анализа они смогли доказать возможность существования равновесия. А именно доказали существование конкурентного равновесия, при котором продавец получает максимум прибыли при заданной цене, причем если существует избыток товара, то его цена равна нулю, а отрицательных цен нету. [10]. Также в своей работе Дебре указывал на то, что при существовании общего равновесия обязательно должно присутствовать оптимальное распределение товаров и услуг, т.к. иное распределение привело бы к ухудшению позиций хотя бы одного участника рынка. [4]. В общем, модель Эрроу - Дебре включает себя исправленную и дополненную модель общего равновесия Вальраса, однако также имеет свои недостатки и недочеты. Так, например, она несовместима с появлением на рынке новых товаров (т.к. модель зависит от предположения о том, что у каждого субъекта рынка есть набор всех продуктов, выставяющихся на рынок, которые удовлетворяют его потребности). Ну и опять же, математический метод не может полностью отражать хаотичность рыночных отношений в мире. Из этого примера мы можем сделать вывод, что модель Эрроу - Дебре также не полностью учитывает динамику рынков. [12].

Количество представителей неовальрасовского направления было достаточно весомым. Каждый внес свой вклад и свои новые идеи в совершенствование теории общего равновесия. Так, например, Герберт Скарф выступил родоначальником прикладного использования теории общего равновесия. Он разработал расчетный алгоритм для поиска решения систем общего равновесия и получил количественные оценки последствий изменений в экономической политике, таких как изменения в налогообложении. Однако дают ли эти расчеты

более точные ответы, чем гораздо более простые модели частичного равновесия? Далеко не обязательно [2].

Стабильность равновесия изучали такие ученые, как Леонид Хурвикс, Френк Ханн, Лайонел Мак – Кинзи, Кеннет Эрроу. Дункан Фолей применил теорию общего равновесия к теории ценообразования общественных благ. [7]

Российский ученый Д. Патинкин улучшил модель Вальраса тем, что учитывал в своем анализе изменение спроса на деньги после увеличения общего уровня цен. Он ввел в модель денежного рынка дополнительный компонент, а именно стоимость денежных запасов, остающихся на руках у продавцов и потребителей. [5, стр. 356].

Невальрасова теория общего равновесия

В начале 50-х гг. XX в. в связи с быстрыми темпами целенаправленной математизации экономической науки в макроэкономической теории господствующие позиции принадлежали кейнсианской концепции. Особенность подхода кейнсианцев заключалась в том, что они акцентировали внимание на несовершенстве рынка труда, а также изучали зависимость величины спроса на труд от спроса на товары. Ну и конечно, рассматривали вопросы равновесия с позиции макроэкономики. Устойчивость кейнсианского общего равновесия характеризуется существованием равновесия на трех из четырех рынков, причем на четвертом существует безработица на рынке труда. Такие экономисты, как Жак Друе и Жан-Паскаль Бенасси (кейнсианцы) применили общую теорию равновесия с рационированием. Иными словами, эти экономисты пытались рассмотреть проблему общего равновесия, опираясь на то, что каждый потребитель руководствуется своими собственными интересами и вкусами, а также ведет себя рационально. Данные подходы кейнсианцев, описанные выше, были названы невальрасовой теорией общего равновесия. [5, с. 357]

Последующее совершенствование теорий. Их эмпирическая значимость

Как видим, многие научные деятели, занимаясь вопросами общего равновесия, использовали метод математического анализа. Они использовали ряд допущений, и, основываясь на абстрактных условиях, пытались доказать возможность существования общего равновесия на рынках всех благ. Однако тут стоит отметить, что точную математическую модель общего равновесия создать невозможно, т.к. существует огромное количество переменных и взаимосвязей между ними. Математика имеет однозначное решение, в то время как рынки динамичны и хаотичны. Значит, однозначное математическое решение будет присуще для рынков только в определенный момент, т.к. там все время происходит изменения. Поэтому экономистами вводятся разные допущения и неизменяемые коэффициенты, что, конечно, существенно снижает точность сделанных выводов.

М. Блауг отмечает, что превосходство прикладных моделей общего равновесия является практическим вопросом, поскольку их построение связано с серьезными затратами. Конечно, принять в расчет все взаимосвязи лучше, чем просто игнорировать их, говорит М. Блауг, но эта работа гораздо труднее, а отдача от нее может не оправдать затраченных усилий. Всеохватывающее равновесие на множественных рынках является чертой определенных моделей экономики и не обязательно отражает ее фактическое устройство. [2]

Все это позволяет нам утверждать, что в теоретической модели общего равновесия представителей Лозаннской школы и их последователей существуют идеализированные и абстрактные компоненты. [12]. К тому же при попытке математического описания состояния общего равновесия в экономике многие экономисты не учитывали важность динамического анализа рынка, его изменения во времени. В общем, допущений было крайне много. Подобные недочеты показал и П. Самуэльсон, указав, что экономическая наука никогда не ставила перед собой задачу сформулировать какие-либо динамические теории, которых и не хватало в анализе модели общего равновесия. [4]. Безусловно, представители неоклассического направления прекрасно понимали, что рынок постоянно меняется. Однако они считали, что причины, вызывающие нарушение рыночного равновесия носят внешний по отношению к системе характер, как то: внезапное изменение численности населения, война, неурожай, эпидемия и прочие стихийные бедствия. Сам же рынок не содержит в себе каких-либо сил, могущих стать источником нарушения равновесия.

Такие великие экономисты, как П. Самуэльсон и Дж. Хикс изучали проблемы теории динамических процессов и теорию устойчивости.

Дж. Хикс

Хикс внес большой вклад в развитие теории общего равновесия, т.к. в его теории присутствуют некоторые особенности, отличающие его теорию от теории его предшественников и последователей. Так, например, Дж. Хикс выделил недочеты в теории равновесия Маршалла, указывая в его работе на то, что необходимо обязательно анализировать экономические взаимосвязи между отдельными экономическими процессами. Также он не в полной мере соглашался с трудами Л. Вальраса, указывая, что характер рассуждений Вальраса слишком абстрактный и статичный и не предусмотрен для анализа рынка, который является динамичным. [11, стр. 37] Дж. Хикс же в своих работах провел анализ оптимального поведения потребителей и фирм, функций рыночного спроса и предложения, что помогло ему усовершенствовать модель общего равновесия. [4]. В своих работах Дж. Хикс очень подробно анализировал проблемы устойчивого состояния равновесия и стабильности на рынке (причем автор «Стоимости и капитала» старался обойти статичность показателей и коэффициентов, т.к. рынок динамичен), а также показывал, что несогласованность участников рынка между

собой может привести к несбалансированному развитию экономики. В конце концов экономист пришел к выводу, что устойчивость присуща только статическим моделям общего экономического равновесия, в реальности же устойчивого состояния общего равновесия не существует. [11] Однако английский ученый указал на то, что общее равновесие вполне способно образоваться «само собой», т.е. показал парадокс «невидимой руки» (т.е. децентрализованные механизмы распределения ресурсов могут обеспечивать "упорядоченные" состояния рынка.) [4] Одно из ключевых понятий динамической концепции Дж. Хикса - "временное равновесие" - широко используется в настоящее время в теоретической макроэкономике. Место Дж. Хикса в современной экономической теории в значительной степени связано с разработанными им методами анализа, например, с использованием сравнительной статистики и применением динамического анализа к изучению экономического роста и торгового цикла.

Он подвергся критике со стороны П. Сэмюэльсона и других экономистов за чисто формальный характер своих расчетов, не учитывающих проблем распределения, исторического и культурного развития общества, а также разного рода иррациональных факторов, влияющих на выбор покупателя.

Самый существенный вклад П. Самуэльсона в развитие теории общего равновесия заключается в том, что он доказал, что экономическая наука никогда не ставила целью сформулировать в явном виде динамические теории. Без описания динамического механизма, характеризующего реакцию системы на изменения внешних условий, не может считаться обоснованным ни один вывод, который опирается на анализ сравнительной статистики. Неустойчивая система, параметры которой подверглись изменениям, не обязательно должна снова вернуться в положение такого «нового» равновесия. П. Самуэльсон использовал распространенное в математической литературе определение устойчивости для анализа динамической системы.

М. Алле

В 1980-е гг. лауреат Нобелевской премии Морис Алле одним из первых дал наиболее общее и строгое доказательство эквивалентности состояний максимальной эффективности и равновесия в рыночной экономике. Он выдвинул, исходя из теоретических положений, систему правил, соблюдение которых способно привести экономику к состоянию максимальной эффективности. Основными методами Мориса Алле являются общенаучные принципы и методы: принципы относительности и целостности, структурный подход, поиск инвариантов, математические методы. М. Алле вводит понятие излишка, а также вместо понятия «рыночная экономика» понятие «экономика рынков», предполагающее множественность рынков и множественность систем цен как наиболее адекватное отражение реальной экономической динамики. Понятие потенциального излишка принципиально важно для понимания функционирования

экономики рынков и для определения состояний максимальной эффективности. Он говорил о том, что в любом состоянии, кроме состояния максимальной эффективности, существуют такие точки, при которых существуют излишки. Это означает, что в таком состоянии можно улучшить положение каждой единицы потребления без привлечения каких-либо дополнительных ресурсов и без дополнительных усилий с чьей-либо стороны. В этой точке имеет место потеря эффективности для всей экономики в целом. Разумеется, данная модель, модель экономики рынков, работает на основе некоторых принципов:

1) принцип предпочтения – каждая единица потребления осуществляет обмен лишь тогда, когда в результате действительного проведения обмена она переходит в то состояние, которое для нее является предпочтительным, то есть индекс предпочтения возрастает;

2) принцип технической эффективности – каждая производящая единица стремится применить самую эффективную технологию производства

3) принцип излишка – производственная или посредническая единица осуществляет операции обмена и подразумевающие их производственные операции лишь в том случае, если они предоставляют ей возможность получить излишек в результате действительного обмена;

4) принцип распределения - производственные или посреднические единицы действительно распределяют полученные излишки в соответствии с некоторым правилом;

5) принцип рынка – на каждом частичном рынке, где осуществляется обмен двух благ друг на друга при участии более чем двух операторов, имеют место «твердые» предложения обмена одного из благ на другое по определенной цене, что накладывает на операторов жесткие обязательства.

6) принцип автономии – все операторы свободны в поиске и реализации излишков по приемлемым для них ценам;

7) принцип достаточной информации – имеется достаточная информация относительно действительных возможностей реализации излишков;

8) принцип достаточного стимулирования – знание о потенциальном излишке действительно стимулирует операторов реализовать его;

9) принцип участия – обменные операции продолжаются до тех пор, пока они обеспечивают возможность реализации излишков.

10) принцип компенсации внешнего ущерба – при данной системе операций любые потери, понесенные в связи с этими операциями экономическим агентом, не являющимся участником данной системы операций, компенсируются.

Таким образом, модель экономики рынков Морриса Алле более реалистична и дает более простые доказательства, и сами эти доказательства не связаны никакими ограничительными гипотезами непрерывности, дифференцируемости или выпуклости. Простота этих доказательств позволяет без особого труда уяснить основные причины существования стабильного равновесия. Теория экономики рынков показывает, как благодаря децентрализованному поиску всех

потенциальных излишков и стимулам, порождаемым их частичным или полным присвоением соответствующими операторами, достигается состояние максимальной эффективности. Модель реализации излишков экономики рынков по своей сути является динамической, тогда как модель рыночной экономики с акцентом на равновесие системы цен совершенно статична. Если модель рыночной экономики соответствует в основном конкурентной экономике и образу экономик западного типа, то общая модель экономики рынков включает все возможные случаи независимо от того, есть конкуренция или нет, и может представлять как экономики стран «Востока», или «третьего мира», так и Запада. Принципиально новым в модели М. Алле является и то, что он включил в анализ институциональные рамки, и сместил фокус с понятия общего равновесия на понятие максимальной эффективности. [6]

В последних работах, посвященных теории общего равновесия, особое внимание уделялось следующему вопросу: можно ли согласовать между собой оптимизационные модели децентрализованной экономики, в которых деньги не выступали в роли актива, а служили лишь масштабом цен, с моделями, в которых на процессы принятия решений и структуру хозяйственных операций влияет неопределенность перспектив, характеризующих будущую систему сделок.

В этой связи можно сослаться на два основных направления исследований:

1) быстро увеличивается число работ, посвященных детальному анализу проблем, связанных с фактором неопределенности, издержками осуществления хозяйственных операций, денежным рынком и др.

2) обширная литература, посвященная неравновесным механизмам реакции системы на изменение внешних условий.

Зная эти механизмы, экономисты могут исследовать проблемы, порождаемые неопределенностью перспектив относительно будущего поведения участников хозяйственного процесса.

Рой Раднер предложил более общий вариант модели Эрроу - Дебре - вариант, который учитывает влияние, оказываемое неопределенностью перспектив. Он показал, что функционирование системы в будущем можно описать с помощью "стандартной" модели, если только хозяйственная система располагает самой разветвленной системой таких рынков срочных сделок, на которых заключаются условные контракты. Такой подход позволил Раднеру в следующей работе развить предложенную Хиксом идею относительно временного равновесия для последовательности состояний экономики. Вместе с тем оказалось возможным ввести более общее (по сравнению с формулировкой Эрроу и Дебре) определение равновесия. Под равновесием понимается теперь "такая совокупность цен на рынках текущих продаж, совокупность общих ожиданий и согласованных индивидуальных планов (каждый участник хозяйственного процесса при этом руководствуется одним планом), что при заданных ценах и ценовых ожиданиях каждый индивидуальный план оказывается оптимальным с точки зрения Данного участника при соответствующей последовательности бюджетных ограничений".

Хан, Курц и Старретт использовали понятие временной последовательности состояний экономики, описываемых моделью Эрроу - Дебре, при исследовании различных хозяйственных форм, обеспечивающих функционирование.

Последние работы Грамона, Юне, Сондермана и некоторых других авторов посвящены аналогичной проблеме - в них рассматриваются институциональные характеристики денежной экономики и возможности введения этих характеристик в модели общего равновесия.

Возрождение интереса к роли денег в значительной степени расширило сферу исследований, посвященных проблеме общего равновесия, и обогатило их методологию. Прошедшее десятилетие характеризовалось не только дальнейшим развитием теории общего равновесия, но и некоторой ее "переориентацией". [4]

В общем, после проведенного анализа теорий общего равновесия возникает вопрос о прикладном значении общего равновесия. Этот вопрос подробно рассмотрен М. Блаугом, который отмечает, что, с одной стороны, все теории общего равновесия обладают некоторой упрощенностью, к тому же математические модели никогда не смогут полностью отражать иррациональные реалии этого мира; с другой стороны, возникает вопрос: Способствуют ли эти теории росту понимания нами экономического мира? [2] Если да, то значение этих теорий, может быть, и не будет настолько весомым с позиции прогнозов и отображения действительности, однако позволит нам более глубоко осознать механизмы функционирования экономических систем.

ЛИТЕРАТУРА

1. Беляев, М. И. Общее равновесие // Милология [Электронный ресурс]. – Режим доступа: <http://www.milogiya2007.ru/micro26.htm> . Дата доступа: 20.11.2012.
2. Блауг М. Методология экономической науки, или Как экономисты объясняют: пер. с англ. Ю. В. Автономова. — М.: Журнал «Вопросы экономики», 2004. — 416 с.
3. Блауг, М. Общее равновесие по Вальрасу // Экономика [Электронный ресурс]. – Режим доступа: <http://gallery.economicus.ru/cgi-bin/> Дата доступа: 20.11.2012.
4. Вайнтрауб, Э. Р. Теория общего равновесия. // Экономика [Электронный ресурс]. – Режим доступа: http://gallery.economicus.ru/cgi-bin/frame_rightn.pl Дата доступа: 20.11.2012.
5. Журавлева, Г. П. Экономика: Учебник. — М.: Юристъ, 2001. — 574 с
6. Некрасов В. И. Взгляды Морриса Алле на эффективность в экономике рынков: идеи и условия // Мерзлякова Г. В. // Вестник Удмуртского университета.-2010.-№2.- С. 18-22.
7. Неовальрасова школа общего равновесия // Экономика [Электронный ресурс]. – Режим доступа: http://gallery.economicus.ru/cgi-bin/frame_rightn.pl?type=school Дата доступа: 20.11.2012
8. Оптимум по Парето // Дело и Сервис [Электронный ресурс]. – Режим доступа: <http://www.dis.ru/slovar/economic/802.html> Дата доступа: 20.11.2012.
9. Равновесие в экономике чистого обмена. Диаграмма Эджворта // Экономическая теория [Электронный ресурс]. – Режим доступа: http://economicstheory.ru/index.php?option=com_content&view=article&id=85 Дата доступа: 20.11.2012.

10. Фирмы с модели Эрроу – Дебре // Историко-экономический клуб [Электронный ресурс]. – Режим доступа: http://club-kollizei.ru/Firmy_s_mod/index.html Дата доступа: 20.11.2012.
11. Хикс, Дж. Р. Стоимость и капитал. – М.: Прогресс, 1988. – 191 с.
12. Чусов, А. В. Математическая модель и экономическая реальность. Анализ модели равновесия в конкурентной экономике Эрроу – Дебре // Виртуальный философский центр [Электронный ресурс]. – Режим доступа: http://vfc.org.ru/rus/events/seminars/sem_phil_mat/08-10-17chusov.php Дата доступа: 20.11.2012.

Модель IS-LM как одно из важнейших достижений для объяснения экономической действительности

1361122075417.jpg 1360924917602.jpg

*«Если я видел дальше других, то потому,
что стоял на плечах гигантов»*

И. Ньютон

Для любой науки огромную важность представляют методы и инструменты, которые используются для анализа того, что данная наука изучает. Используемые методы зависят от науки, от специфики ее предмета и объекта исследования. Специфика экономики как науки в том, что ее методология изменчива: методы, которые используются для объяснения экономических процессов, изменяются с течением времени; модели, отражавшие экономическую картину 19 века, не всегда могут быть применимы для объяснения современной ситуации.

Сегодня модель IS-LM широко используется для толкования макроэкономических процессов. Однако она представляет большой интерес и в методологическом плане. Важно рассмотреть то, как пришли к ней экономисты. Именно знание предпосылок и допущений, из которых исходят авторы, позволяет экономическому сообществу принять определенную модель или предпринять попытку выстроить новую, изменив исходные постулаты, которые кажутся заведомо ложными.

Представляет интерес сама логика построения новых моделей в экономической науке, которая хорошо проиллюстрирована в статье Дж.Хикса «Господин Кейнс и классики: попытка интерпретации» (1937) [1]. Чтобы сопоставить модели, нужно привести их к «общему знаменателю». Дж. Хикс берет за основу модель Кейнса, представленную системой из трех уравнений, которые отражают зависимость спроса на деньги от нормы процента и дохода, зависимость инвестиций от нормы процента и зависимость инвестиций от сбережений (сбережения, в свою очередь - это функция от дохода):

$$M=L(I,i); \quad I_x=C(i); \quad I_x=S(I) \quad [1]$$

Такие же уравнения выстраиваются, исходя из основных идей классической теории. Классики полагают, что спрос на деньги находится в прямой зависимости от дохода, инвестиции представляют собой функцию от нормы процента, в то же время инвестиции – функция от сбережений, причем сами сбережения зависят от дохода и нормы процента:

$$M=kI; \quad I_x=C(i); \quad I_x=S(i, I) \quad [1]$$

Главным недостатком классической теории, по сравнению с теорией Кейнса, является то, что она не применима для анализа экономических колебаний. В ходе цикла происходят колебания совокупного денежного дохода. Согласно классической теории, это можно объяснить лишь колебаниями M или k , а также изменениями в распределении.

Как пишет Дж.Хикс, для того чтобы изменилась M , должна появиться предпосылка в виде расширения кредита. А в этом случае необходимо рассмотреть взаимосвязь между предложением банковских денег и нормой процента. То есть спрос на деньги так или иначе связан со ставкой процента. Этот недостаток классической теории Кейнс исправляет, предполагая, что спрос на деньги зависит не от дохода, а от нормы процента. В связи с этим вводится понятие «предпочтение ликвидности». Однако Кейнс, несмотря на то, что придает норме процента определяющее значение в изменении денежной массы, все-таки приходит к выводу, что денежная масса также зависит от дохода.

С другой стороны, возможность влияния нормы процента на норму сбережений в теории Кейнса игнорируется. Однако Дж.Хикс говорит, что это «не более, чем упрощение», которое не так существенно.

«Следуя математической стройности» Дж. Хикс переписал базовые уравнения в следующем виде:

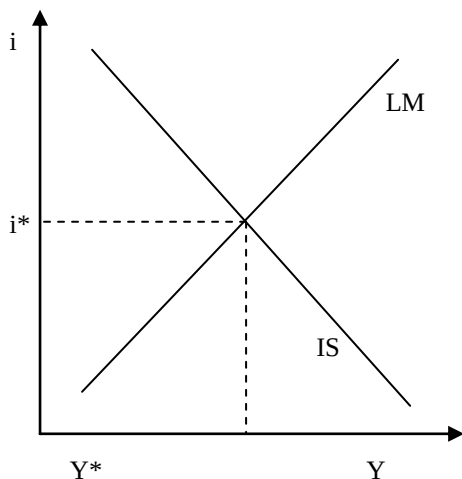
$$M=L(I,i); \quad I_x=C(I,i); \quad I_x=S(I,i) \quad [1]$$

Следуя логике Хикса, построим графики данных функций. Если количество денег задано, первое уравнение $M=L(I,i)$ дает соотношение между доходом (I) и нормой процента (i). Данное соотношение можно представить в виде восходящей кривой LM (кривая спроса на ликвидность), так как рост дохода увеличивает спрос на деньги, а повышение нормы процента уменьшает. Данная кривая иллюстрирует рынок денег. С другой стороны, из двух других уравнений получаем иное соотношение между доходом и нормой процента. Это позволяет построить график IS (инвестиции – сбережения) – восходящую кривую, показывающую равенство инвестиций и сбережений.

Заслуга Дж.Хикса в том, что, проанализировав базовые уравнения теории Кейнса и классической теории, он построил наглядную модель, отражающую равновесие денежного и реального рынка.

Абстрактная модель Дж.Хикса получила подробное обоснование в работе Э.Хансена «Денежная теория и финансовая политика». Данная работа задумывалась автором как учебник для тех, кто изучает экономику. Логика рассуждения Э.Хансена заключается в следующем: определяются факторы,

детерминирующие доход и ставку процента. Помимо количества денег к ним относятся кривая инвестиционного спроса, потребительская функция, функция предпочтения ликвидности. Или, как пишет Э.Хансен, согласно старой терминологии, факторами, определяющими доход и ставку процента, являются производительность, бережливость, желание иметь деньги, количество денег.



Положение кривой IS , отражающей равновесие в реальном секторе (равенство сбережений и инвестиций) определяется следующими факторами: кривой предельной эффективности инвестиций, потребительской функцией. Другими словами, основой для построения кривой IS является кейнсианский крест. Крест Кейнса в макроэкономике рассматривается как базовая модель определения дохода. Фискальная политика и инвестиции принимаются экзогенными, причем фискальная политика оказывает мультипликационное влияние на доход [2].

Кривая LM в модели $IS-LM$ выводится из теории предпочтения ликвидности, когда спрос на деньги положительно связан с доходом. Пересечение кривых IS и LM показывает единственную точку равновесия как на рынке товаров, так и на рынке денег.

В макроэкономике модель Хикса-Хансена используется для объяснения того, как экономическая политика и шоки влияют на доход и процентную ставку в коротком периоде, когда цены фиксированы. Модель демонстрирует, как может повлиять на макроэкономические показатели фискальная и монетарная политика. Фискальная политика, направленная на увеличение государственных расходов или уменьшение налогов, вызывает сдвиг кривой IS вправо. Соответственно, модель предсказывает установление равновесия в новой точке: доход увеличится при одновременном повышении процентной ставки. Влияние монетарной политики заключается в следующем: увеличение денежной массы Центральным банком

вызовет сдвиг кривой LM вправо, в результате чего, согласно модели, доход увеличится, в то время как процентная ставка будет снижаться.

Модель IS-LM (модель Хикса-Хансена) хорошо прижилась в экономической теории и до сих пор является одной из наиболее значимых моделей в макроэкономике. Сильные ее стороны не подвергаются сомнению. Однако, как для любой из «универсальных» моделей, область применения для данной модели несколько ограничена. В частности, эта проблема возникает, когда речь заходит о национальной экономике конкретных стран. То есть, по словам Т.Агаповой, макроэкономические модели «представляют собой общий инструментарий современного макроэкономического прогнозирования и не имеют какой-либо национальной специфики» [3]. Национальная специфика находит отражение в конкретных условиях использования инструментов модели, в их комбинации, в межвременном выборе.

Работу экономиста в методологическом плане можно сравнить с одной стороны, с работой ученого, с другой стороны, с работой инженера. Американский экономист Г.Мэнкью обратил внимание на то, что после «Общей теории...» экономисты начали излагать свои взгляды в рамках конкретных моделей. В частности, это относится к модели Хикса-Хансена, в основе которой лежит кейнсианская теория. Это было работой экономиста-ученого. Однако изучение экономической действительности одновременно происходило экономистом-инженером. Эконометристы, в частности, Клейн, разрабатывали прикладные модели, которые исходили из имеющихся данных и могли бы в будущем использоваться для экономической политики. По сути, экономисты-ученые шли от теории к практике, экономисты инженеры – от реальности к построению модели [4].

Главным аспектом при разработке экономических моделей остается приемственность. Авторы каждой из используемых ныне моделей, созданных для объяснения экономической действительности, опираются на то, что уже было сделано до них. Именно такой подход позволяет совершенствовать существующие теории, предлагая новые модели и методы. Иными словами, дальше других видят те, кто стоит «на плечах гигантов».

ЛИТЕРАТУРА

13. Хикс Дж.Р. Господин Кейнс и классики: попытка интерпретации // Перевод Е.И. Николаенко. М.: Директмедиа Паблишинг, 2008. - 16 с.
14. 2. Хансен, Э. Денежная теория и финансовая политика / Э. Хансен, пер. с англ. — М: Дело, 2006. — 311с.
15. 3. Агапова Т. Современная экономическая теория: методологическая база и модели // Российский Экономический Журнал. – 1995. - №10.
16. 4. Мэнкью Н.Г. Макроэкономист как ученый и инженер / Н. Г. Мэнкью // Вопросы экономики. - 2009. - № 5. - С.86-103.

Политическая экономия капитала

Капитал (от лат. *capitalis* — главный) — одна из важнейших категорий экономической науки, обязательный элемент рыночной экономики, необходимый фактор и ресурс производства, главный объект рынка капитала.

Капитал имеет много значений и может трактоваться как некий запас материальных благ («физический капитал»), как сумма денег, или «финансовый капитал», как нечто, что включает в себя не только материальные предметы (средства производства), но и нематериальные элементы, такие, как знание, образование, квалификация, человеческие способности, используемые в производстве товаров и услуг («человеческий капитал»), как элемент богатства, приносящий его владельцу регулярный доход на протяжении длительного времени («дисконтированный поток дохода»), как сумма прав распоряжаться некоторыми ценностями, дающая их обладателям доход без вложения соответствующего труда («юридический капитал»).

Все эти взгляды едины в одном: капитал — это любой ресурс экономики, создаваемый с целью производства большего количества экономических благ и способный приносить доход.

Наиболее полное и логически законченное исследование категории капитала было проведено К. Марксом в его труде «Капитал». Наряду с рассмотрением конкретных форм функционирования капитала он раскрыл и содержание данной категории, анализируя ее не только как вещь, пребывающую в покое, но и как движение.

Политэкономия капитала

Первое направление политэкономии (политэкономия капитала или буржуазная политэкономия) отошло от представления о труде как единственном источнике стоимости и богатства. Наряду с ним выделялась роль капитала и земли. Буржуазным это направление было названо потому, что оно отражало интересы буржуазии как собственника капитала и земли. В конце XIX века развитие данного направления привело к возникновению новой экономической дисциплины, получившей название «Экономикс».

Важной особенностью «Экономикс» является то, что она сконцентрировалась на изучении явлений и процессов, происходящих в рыночной экономике, которая рассматривается как «естественная», отвечающая законам природы форма хозяйства. Все остальные формы предстают как отклонение от «естественного» состояния вещей.

Понимание сущности капитала Карлом Марксом в его работе “Капитал. Критика политической экономии”

По Карлу Марксу, изначально капитал — это любое благо, стоимость. Но это лишь необходимое условие зарождения (существования) капитала. Далее следует отметить, что капитал — это не просто стоимость, а авансированная стоимость, что

подчеркивает и объясняет интерес предпринимателя в авансировании средств на реализацию определенного товара, который может быть связан с риском и потерей авансированной стоимости. Это отказ от удовлетворения ежеминутных желаний, определенное воздержание во имя дела.

Но авансированная стоимость у К. Маркса еще не есть капитал. Таковым он может стать, если создает прибавочную стоимость, которая после реализации принесет прибыль. Капитал — это самовозрастающая стоимость. Но и этого недостаточно. Капитал — это движущаяся стоимость, стоимость, которая находится в постоянном движении, и, чем быстрее оборот авансированной стоимости, тем меньше требуется средств для достижения поставленной цели — получения прибыли.

Капитал существует в различных формах.

Изначально он выступает в денежной форме. Это денежный капитал, роль (функция) его сводится к созданию необходимых условий для процесса производства материальных благ. Имея деньги, предприниматель приобретает на рынке необходимые факторы производства: рабочую силу, средства производства и земельный участок (возможно, в аренду).

Другой формой капитала является производительный капитал, функция которого — рациональное потребление приобретенных факторов в процессе производства; создание товаров, обладающих общественной потребительной стоимостью и стоимостью, содержащей прибавочную стоимость и прибыль.

Третьей формой капитала выступает товарный капитал, его роль и функция — в реализации произведенных товаров и содержащейся в них стоимости и прибавочной стоимости, т.е. превращение товарного капитала в денежный.

Две схемы обращения средств

Маркс предложил две схемы обращения средств: Т-Д-Т (товар – деньги – товар или продажа ради купли) и Д-Т-Д (купля ради продажи). Именно эти две схемы по Марксу иллюстрируют различие между деньгами как средством обращения и как капиталом соответственно. К. Маркс различает деньги, затрачиваемые на товар в каждой из этих схем, в случае Т-Д-Т речь идёт о потреблении и в конечном итоге о потребительской стоимости. А в схеме Д-Т-Д затраты составляют не потребительскую, а меновую стоимость. Однако Маркс подчёркивал, что схема Д-Т-Д верна и имеет смысл только в таком виде: Д-Т-Д', где Д' = Д + ДД. То есть только в случае приращения первоначально авансированной суммы. Сам К. Маркс сказал так: “Это приращение... я называю прибавочной стоимостью”. И благодаря данной стоимости “первоначально авансированная стоимость не только сохраняется в обращении, но и изменяет свою величину. И как раз это движение стоимости превращает её в капитал”. Маркс, исходя из этого, утверждал, что данное движение имеет форму кругооборота, т.к. получаемая в результате меновой сделки прибавочная стоимость сразу же становится частью первоначально авансированной стоимостью уже в новом цикле. И так будет до тех

пор, пока эта стоимость будет находиться в сфере обращения. Извлечённый из оборота капитал прибавочной стоимости не даёт. Самодвижущуюся, самовозрастающую стоимость Маркс и называл капиталом. Движение капитала с целью возрастания его стоимости К. Маркс назвал самоцелью этого капитала и счёл, что это движение ничем не ограничено. А формулу $D-T-D'$ – всеобщей формулой капитала. Марксом дано и такое яркое определение капитала: "Превращая деньги в товары, которые служат вещественными элементами нового продукта, или факторами процесса труда, присоединяя к их мёртвой предметности живую рабочую силу, капиталист превращает стоимость – прошлый, овеществлённый, мёртвый труд – в капитал, в самовозрастающую стоимость...". Маркс дал такое определение капитала: "Обращающиеся деньги, употреблённые с производительной целью". Деньги, счёл Маркс, это одна из форм капитала. Именно они определяют его величину в численном выражении и потому они являются исходным и конечным пунктом процесса возрастания стоимости.

Однако само обращение денег и товаров ещё не создаёт приращения капитала, т.е. прибавочной стоимости. Оно только перераспределяет уже созданный капитал. А потому торговый и ростовщический капитал не являются самовозрастающими. Изменение стоимости денег, которые должны обратиться в капитал, не может совершиться в самих деньгах, т.к. это всего лишь средство реализации цены товаров, покупаемых или продаваемых. Не возникает это изменение и в части формулы $T - D'$, потому, что в данном случае происходит лишь перевод товара из натуральной в денежную форму. Следовательно, изменение стоимости денег должно произойти в части $D - T$, т.е. возникнуть только из потребительской стоимости товара. Но для этого товар должен обладать тем свойством, что его потребление было бы овеществлением труда, а, следовательно, созданием стоимости. По Марксу, такой товар – это способность к труду или рабочая сила. Именно она создаёт приращение капитала при потреблении самой рабочей силы. Таким образом, владелец денег может превратить их в самовозрастающий капитал только в том случае, если найдёт на рынке свободных рабочих. Поэтому капитализм сложился гораздо позже возникновения товарного и денежного обращения. Только когда рабочая сила рабочего приняла форму товара, принадлежащего ему, а труд рабочего стал наёмным, началась капиталистическая эпоха.

Приращение капитала произойдёт только при производстве потребительской стоимости, обладающей меновой стоимостью, и производстве стоимости и прибавочной стоимости одновременно.

Формула капитала

Кроме того, К. Маркс первым вывел формулу $K = c + v$, где K – капитал, c – денежная сумма, израсходованная на средства производства, v – сумма, потраченная на рабочую силу, т.е. заработная плата. C представляет собой часть стоимости, превращённую в постоянный капитал, v – часть стоимости,

превращённой в переменный капитал. Следовательно, первоначально $K = c + v$. В процессе производства получается товар, стоимость которого равна $c + v + m$, где m – прибавочная стоимость, а сам капитал возрастёт на m и составит $K' = K + m$. К. Маркс считал, что прибавочная стоимость – следствие изменения стоимости v , т.е. части капитала, превращённой в рабочую силу. Поэтому $v + m = v + Dv$ (прирост v).

Маркс дал следующее определение сущности капитала: “В процессе производства капитал развился в командование над трудом, т.е. над действующей рабочей силой, или самим рабочим. Персонифицированный капитал, капиталист, наблюдает за тем, чтобы рабочий выполнял своё дело как следует и с надлежащей степенью интенсивности... капитал развился в принудительное отношение, заставляющее рабочий класс выполнять больше труда, чем того требует узкий круг его собственных потребностей”, иначе говоря, капитал есть средство господства над производством.

Классическая политическая экономия до Маркса сложилась в Англии – самой развитой капиталистической стране. Адам Смит и Давид Рикардо, исследуя экономический строй, положили начало трудовой теории стоимости. Маркс продолжал их дело. Он строго обосновал и последовательно развил эту теорию. Он показал, что стоимость всякого товара определяется количеством общественно необходимого рабочего времени, идущего на производство товара.

Там, где буржуазные экономисты видели отношение вещей (обмен товара на товар), там Маркс раскрыл отношение между людьми. Обмен товаров выражает связь между отдельными производителями при посредстве рынка. Деньги означают, что эта связь становится всё теснее, неразрывно соединяя всю хозяйственную жизнь отдельных производителей в одно целое. Капитал означает дальнейшее развитие этой связи: товаром становится рабочая сила человека. Наёмный рабочий продает свою рабочую силу владельцу земли, фабрик, орудий труда. Одну часть рабочего дня рабочий употребляет на то, чтобы покрыть расходы на содержание своё и своей семьи (заработная плата), а другую часть дня рабочий трудится даром, создавая прибавочную стоимость для капиталиста, источник прибыли, источник богатства класса капиталистов.

Капитал, созданный трудом рабочего, давит рабочего, разоряя мелких хозяев и создавая армию безработных. В промышленности победа крупного производства видна сразу, но и в земледелии мы видим то же явление: превосходство крупного капиталистического земледелия увеличивается, растёт применение машин, крестьянское хозяйство попадает в петлю денежного капитала, падает и разоряется под гнётом отсталой техники. В земледелии – иные формы падения мелкого производства, но самое падение его есть бесспорный факт.

Побивая мелкое производство, капитал ведёт к увеличению производительности труда и к созданию монопольного положения союзов крупнейших капиталистов. Самое производство становится всё более общественным, – сотни тысяч и миллионы рабочих связываются в планомерный хозяйственный организм, – а продукт общего труда присваивается горстью

капиталистов. Растёт анархия производства, кризисы, бешеная погоня за рынком, необеспеченность существования для массы населения.

Увеличивая зависимость рабочих от капитала, капиталистический строй создаёт великую мощь объединённого труда.

От первых зачатков товарного хозяйства, от простого обмена, Маркс проследил развитие капитализма до его высших форм, до крупного производства.

“Принципы политической экономии”

В экономической науке термин доминировал до конца 19 в. - время выхода (1890) работы известного английского экономиста Альфреда Маршалла “Принципы политической экономии”. Политэкономия капитала - это неоклассическое направление в экономической науке, которая ставит целью синтезировать классическую политическую экономию капитала. А. Маршалл рассматривал капитал не как совокупность вещей, а как некую невещественную, незримую, тесно связанную с вещами форму. К капиталу относятся и нематериальные блага: деловые способности и профессиональное мастерство, деловые связи предпринимателя и доверие к нему как к личности. А. Маршалл считает возможным говорить о человеческом капитале. «Способности человека так же важны в качестве средства производства, как и любой другой вид капитала».

С точки зрения А. Маршалла, капитал подразделяется на потребительский капитал и вспомогательный, или опосредствующий, капитал, свободный или подвижный капитал.

Относительно предпринимателя свободный капитал — это имеющиеся в распоряжении блага, выражающие определенную денежную стоимость, которую можно использовать для любых целей. Относительно частных лиц Маршалл делит капитал на потребительский и вспомогательный.

Потребительский капитал состоит из товаров такой формы, которая способна удовлетворять потребности непосредственно, т.е. из товаров, обеспечивающих существование рабочих, таких, как пища, одежда, жилье и т.д.

Вспомогательный, или опосредствующий, капитал, по Маршаллу, назван так потому, что он содействует приложению труда в производстве. Сюда входят инструменты, машины, фабрики, железные дороги и т.д., а также и всякого рода сырье.

Мерой потребления основного капитала выступает износ, денежным выражением которого являются амортизационные отчисления, представляющие собой часть стоимости основного капитала, переносимую на готовый продукт в каждом производственном цикле.

Большое значение А. Маршалл уделяет предпринимательству. Предприниматели делятся на две категории: те, кто открывает новые и улучшенные методы хозяйствования, и те, кто следует проторенными путями. Вторые получают нормальную прибыль, первые могут получить больше. Пока новатор, улучшивший производство, может продавать свой товар по старой цене, его доходы будут

превышать средний уровень. Затем конкуренция приведет к увеличению предложения товара и снижению его цены, а прибыль упадет примерно до прежнего уровня. Прибыль новатора А. Маршалл рассматривает как квазиренту (не земельную ренту). (В длительном периоде все факторы, участвующие в производстве, являются переменными, тогда как в краткосрочном периоде объемы использования некоторых из них постоянны. Выплаты владельцу фактора, предложение которого в краткосрочном периоде фиксировано, называют квазирентой, т. е. будто бы рентой, поскольку в длительном периоде, когда все факторы становятся переменными, эти платежи исчезают, тогда, как собственно экономическая рента сохраняется и в длительном периоде. А. Маршалл, который и ввел понятие квазиренты, называл этим термином доход, приносимый всяким производительным капитальным благом, в частности машинами и другими средствами производства).

Рассмотрение знаний капитала позволило А. Маршаллу отказаться от рикардианской динамики капитала, основанной на неуклонном падении предельной производительности капитала. Конечный результат зависит от способа применения знаний. Когда высокоодаренный человек оказывается во главе предприятия, он быстро умножает его капитал, а тот, кто менее способен распоряжается крупным капиталом и вскоре теряет его. Падение предельной производительности капитала А. Маршалл связывает с его вещественными формами, формулируя закон убывающей отдачи: «Каждое приращение капитала и труда, вкладываемых в обработку земли, порождает в общем пропорционально меньшее увеличение количества получаемого продукта, если только указанное приращение не совпало по времени с усовершенствованием агротехники».

Капиталу принадлежит одно из ведущих мест среди факторов производства, поскольку именно он придает современным экономикам многие из их основных черт:

- индустриальный (технологический) характер;
- специализацию и кооперирование общественного производства;
- наличие крупного производства и, соответственно, крупных предприятий

в экономике.

Все названные особенности отражают принятые на определенной ступени развития хозяйства способы решения вопросов «что производить?» и «как производить?» Капитал же, воплощенный в конструкционных материалах, станках, оборудовании, сооружениях и т.п., в большей степени, чем любой другой фактор производства, определяет техническую сторону современной экономики, т.е. диктует характер ответов на эти вопросы. Можно сказать, что производственный потенциал любого современного государства материализован в накопленных ресурсах фактора капитал.

ЛИТЕРАТУРА

1. Ленин В. И. Три источника и три составных части марксизма // Просвещение: английская (буржуазная) политическая экономия. 1913. № 3

2. 2) Маршалл А. Принципы политической экономии.-М.: Прогресс, 1983 – 416. Т. 1. С. 135-136.
3. 3) Маркс К. Г. Капитал. Критика политической экономии.-М.: Эксмо, 1867 – 900. Т. 1.
4. 4) Маркс К. Г. Капитал. Критика политической экономии.-М.: Эксмо, 1885 – 643. Т. 2.
5. 4) Электронная онлайн библиотека: История экономической мысли и экономическая история // banauka.ru [Электронный ресурс]. – Режим доступа: <http://banauka.ru/>. Дата доступа: 30.11.2012
6. 5) Экономика. Знания здесь!: Экономика // topknowledge.ru [Электронный ресурс]. – Режим доступа: <http://www.topknowledge.ru/>. Дата доступа: 30.11.2012
7. 6) Борисов Е.Ф. Хрестоматия по экономической теории.-М.: Юристъ, 2000 – 536.

Экономическая теория катастроф

Цеханович А.

Что такое теория катастроф? Теория катастроф изучает изменения, которым подвержена определенная система во времени. Она анализирует определенные закономерности и механизмы, которые обуславливают переход от одного состояния системы к другому, а также исследует причины, влияющие на скачкообразные переходы, разрывы и качественные изменения. Термин «теория катастроф» был введен Рене Томом и Кристофером Зиманом в конце 1960-х — начале 1970-х годов. В то время утверждалось, что новая наука – теория катастроф для человечества гораздо важнее и ценнее, чем математический анализ, т.к. она изучает универсальный метод всех скачкообразных переходов, в то время как математический анализ способен исследовать лишь плавные и непрерывные процессы. Необходимо отметить, что "катастрофами" в математике называются скачкообразные изменения, возникающие в виде внезапного ответа системы на плавное изменение внешних условий. [2]

Вскоре после появления нового термина, были сделаны многочисленные попытки применить теорию катастроф в различных областях: физике, экспериментальной психологии, лингвистике, прикладной математике, геологии, гидродинамике, экономике. С помощью теории катастроф моделировали деятельность мозга, исследовали устойчивость кораблей, восстания заключенных в тюрьмах, поведение биржевых игроков, влияние алкоголя на водителей и так далее. Теория катастроф очень быстро стала популярной и модной. Однако вскоре страсти улеглись, и все стало на свои законные места.

«Математическая теория катастроф сама по себе не предотвращает катастрофы, подобно тому, как таблица умножения, при всей ее полезности для бухгалтерского учета, не спасает ни от хищений отдельных лиц, ни от неразумной организации экономики в целом», - писал в книге «Теория катастроф» российский математик Владимир Игоревич Арнольд. Таким образом, математические модели

катастроф указывают некоторые общие черты самых разных явлений скачкообразного изменения режима системы в ответ на плавное изменение внешних условий, например, устойчивый установившийся режим (экономический или экологический) обычно погибает, либо столкнувшись с неустойчивым (причем в момент столкновения скорость конвергенции бесконечно велика), либо вследствие нарастания (опять бесконечно быстрого) самоподдерживающихся колебаний. Это объясняет, почему так трудно бороться с катастрофой, когда ее признаки сделались уже заметными: скорость ее приближения неограниченно возрастает по мере приближения к катастрофе. [2]

Для того чтобы понять, как теорию катастроф можно применять в социально-экономической сфере, необходимо изучить ее теоретические аспекты. Как было сказано ранее, объект теории катастроф – скачкообразные переходы систем из одного состояния в другое, разрывы в плавных процессах, а также качественные изменения поведения систем. Источниками теории катастроф являются: теория гладких отображений Уитни и теория бифуркаций динамических систем Пуанкаре и Андронова, с которыми мы познакомимся чуть позже.

Попробуем рассмотреть теорию катастроф в рамках экономической системы. Итак, экономическая система - совокупность взаимосвязанных между собой экономических элементов, образующих устойчивую целостность. Экономическая система – ступенчатая, многоуровневая система, и любая неопределенность, случайность во входных параметрах в нижних уровнях приводит к неопределенностям и случайностям в выходных параметрах подсистем более высокого порядка и системы в целом. Можно предположить, что такая система содержит катастрофу. Ю.К. Алексеев и А.П. Сухоруков рассматривают существенные признаки катастроф в экономической системе: [1]

- модальность – свойство объекта системы, которое заключается в том, что при некотором значении управляющих параметров возможны несколько положений равновесия системы (несколько мод);

- недостижимость – в системе одно из положений равновесия не достигается и не наблюдается;

- катастрофические скачки – скачкообразный переход системы из одного положения равновесия в другое;

- гистерезис – переход системы из одного состояния в другое и обратно при разных значениях управляющих параметров;

расходимость – малое изменение пути в пространстве параметров приводит к качественно отличному конечному состоянию системы.

Основной задачей экономической системы является оптимизация, т.е. максимизация функции прибыли или минимизация функции издержек. В данном случае, для решения задачи оптимизации, наиболее применимой может оказаться теория особенностей Уитни. Что представляет собой данная теория и как она может применяться в исследовании экономических явлений? Итак, теория особенностей

Уитни – это обобщение исследования функций на максимум и минимум. В 1955 г. американский математик Хасслер Уитни опубликовал работу «Об отображениях плоскости на плоскость», которая заложила основу новой математической теории – теории особенностей гладких отображений, а вместе с ней и теории катастроф. Отображение поверхности на плоскость – это сопоставление каждой точке поверхности точки плоскости. Уитни заметил, что в случаях «общего положения», то есть во всех случаях, кроме некоторых исключительных, встречаются особенности лишь двух видов – все другие разрушаются при малом «шевелении» тел или направлений проектирования, тогда как эти два вида особенностей устойчивы и сохраняются при малых деформациях отображения. Одна из таких особенностей – складка, вторую особенность Уитни назвал сборкой. [2]

Для того, чтобы лучше понять эти простейшие типы катастроф, рассмотрим простые и очень популярные примеры с лыжником. Представьте лыжника, спускающегося с горы. Гора пологая, лыжник едет спокойно. Он не видит, что у него впереди опасность – навис снежный козырек. Доехав до козырька, лыжник, понятно, сваливается с высоты, барахтается в снегу и начинает как-то выкарабкиваться из снежной массы, насколько хватает сил. Вот это называется простейшей катастрофой типа «складки». Если рассмотреть того же лыжника, тот же снежный козырек, но другой характер снежного склона, то мы получим представление катастрофы «сборка». Снежный козырек образовался в данном месте, а вот здесь, сбоку, этот козырек постепенно и плавно сходит на нет. Таким образом, если знать заранее про опасный козырек, лыжник мог бы повернуть, объехать опасность, спокойно перейти в то же самое конечное состояние, но уже без всякого падения, так, как это и полагается настоящему, опытному горнолыжнику. [7]

Рене Том пытался объяснить, что гладкость поверхности не гарантирует, что при плавном изменении одной переменной, все другие тоже меняются плавно. Лыжник, подъезжающий к обрыву, движется по достаточно гладкой поверхности, и одна из его пространственных координат изменяется достаточно гладко. Тем не менее, за обрывом одна из оставшихся координат должна измениться скачком – иначе лыжник оторвется от поверхности. [9]

Очень популярным было исследование нарушений тюремного режима с помощью теории катастроф. Постон и Стюарт с ее помощью исследовали динамику нарушений режима в тюрьме Гартри в течение 1972 г.

Авторы выделили два основных фактора, влияющих на беспорядки: напряженность, а именно чувство разочарования и безысходности; разобщенность (отсутствие общения и взаимное отчуждение). Анализ показал, что с ростом напряженности повышается вероятность волнений, а увеличение разобщенности связано с характером волнений – они становятся более внезапными и яростными. Авторы полагают, что динамика данной системы соответствует модели катастрофы "сборка". Из рис. 4 видно, что при низких значениях разобщенности система стремится к устойчивому положению умеренного волнения, но при высоком уровне

разобщенности она меняет свое положение скачком с нижнего листа на верхний и обратно.[6]

Теперь рассмотрим, как можно использовать модель катастрофы «сборка» для принятия решения фирмы о внедрении конкретного новшества. Предположим, что инновация принимается фирмой, если оценка прибыли, полученной от внедрения новшества, высокая, и отвергается при низкой оценке прибыли. Новинка может быть как отвергнута, так и принята в том случае, если оценка прибыли принимает промежуточное значение. В этом случае фирме необходимо владеть дополнительной информацией о новинке с той целью, чтобы точнее оценить будущую прибыль. Для решения этой задачи Т. Олива предлагает использовать модель катастрофы "сборка"

Как утверждалось ранее, в любой системе, на которую действуют различные внутренние и внешние факторы, происходят не только плавные, но и резкие, скачкообразные изменения. Экономическая система долгое время не может находиться в равновесии, т.к. она подвержена влиянию различных факторов, вследствие чего могут возникнуть неравновесные состояния (колебания), это значит, что система может стать неустойчивой. Эволюционный процесс любой системы математически описывается векторным полем в фазовом пространстве. Точка фазового пространства задает состояние системы. Приложенный в этой точке вектор указывает скорость изменения состояния системы. В некоторых точках вектор может равняться нулю. Такие точки называются положениями равновесия, в них состояние системы во времени не изменяется.

Можно ли предвидеть, спрогнозировать, уберечься от различного рода катастроф с помощью данной теории? Возьмем, к примеру, такую катастрофу, которая часто случается в экономической системе, как финансовый кризис. Рассмотрим экономический кризис 1998 г. в России, когда случился обвал российского рубля. На тот момент газеты и журналы не сообщали истинных причин девальвации рубля, даже специалисты ничего не могли объяснить широкой публике. В данном случае теория катастроф может классифицировать и разобрать этот случай. До августа 1998 года рубль был явно завышен по отношению к доллару, т.е. он обязан был упасть. До кризиса доллар стоил 4 рубля с чем-то, вскоре он стал стоить 6 и 7 рублей, что на тот момент уже означало начало кризиса. Правительство принимало все меры, чтобы затормозить доллар, чтобы удержать его на уровне порядка 6 рублей. Однако, как показывал экономический анализ, в то время доллар как раз и должен был стоить 7-8 рублей. Вскоре наступил критический момент, и доллар подскочил до 20, потом до 30 рублей, потом снова упал до 15 рублей и, в конце концов, установился на уровне 20 рублей, но затем постепенно начал расти. Это была рублевая лихорадка. [7]

Ученые утверждают, что надо было построить математическую модель катастроф, с помощью которой можно было заменить один вариант катастрофы на другой, более мягкий. За полгода до кризиса необходимо было поднимать доллар,

тогда не надо было идти на дефолт, следовательно, можно было избежать «лихорадки» рубля, хаоса. Эту ситуацию математики и экономисты попытались объяснить с помощью катастрофы типа «сборки». Если рассматривать популярный пример с лыжником, то при катастрофе «сборка», «лыжник с трудом выбирается из сугроба», в то время как при мягком варианте развития событий, он вообще не падает. Естественно, данная модель не позволяет ответить на все вопросы и спрогнозировать с точностью катастрофу. Рубль упал бы в любом случае, однако это падение могло быть мягче и ни таким катастрофичным. [7]

Что происходит с любой системой, когда изменяются ее определенные параметры или происходит смена установившегося режима, если считать, что положение равновесия – это установившийся режим в реальной системе? Наблюдаются следующие явления, в том числе и в экономической системе:

➤ После потери устойчивого равновесия установившимся режимом начинается колебательный периодический режим. Данный вид потери устойчивости называется мягкой потерей устойчивости;

➤ Перед тем как установившийся режим теряет устойчивость, область притяжения этого режима становится очень малой, и всегда присутствующие случайные возмущения выбрасывают систему из этой области еще до того, как область притяжения полностью исчезает. Этот вид потери устойчивости называется жесткой потерей устойчивости. В этом случае система уходит из стационарного режима скачком и перескакивает на иной режим движения;

Установившийся режим может быть другим устойчивым стационарным режимом, или устойчивыми колебаниями, или более сложным движением. Такие режимы движения получили название аттракторов, так как они "притягивают" соседние режимы (переходные процессы).

Многие страны СССР столкнулись с трудностями перехода от административной экономики к рыночной экономике. Что происходит во время перестройки существующей системы на новый уровень и как в данном случае можно использовать теорию катастроф?

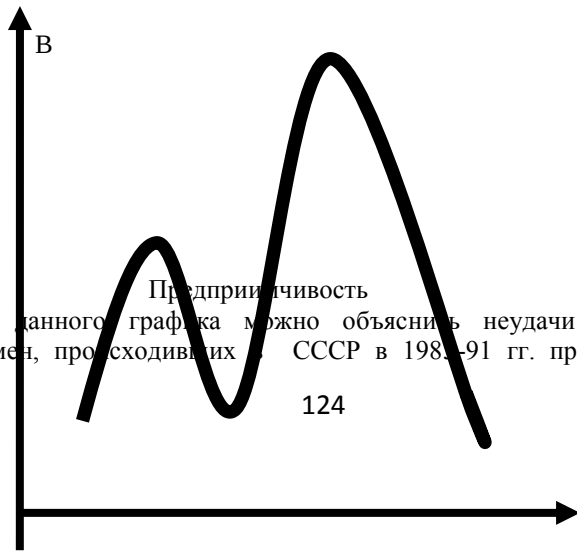
Благосостояние

A

B

Предприимчивость

С помощью данного графика можно объяснить неудачи экономико-политических перемен, происходивших в СССР в 1981-91 гг. при Горбачеве.



Арнольд предложил построить график, на котором изображена «двугорбая прямая», где низкий горб (точка А) условно назван «административной экономикой», а тот, который повыше (точка В) – «рыночной экономикой». В то время были предприняты меры по переходу, быстрому переходу страны из социализма с его малой предприимчивостью и низким средним благосостоянием населения страны в капитализм, в рыночную экономику, с более высоким благосостоянием и предприимчивостью. Однако, как утверждали математики, основываясь на теорию катастроф и теорию перестроек, данный путь перехода не мог обойтись без жертв и потерь. Трудность этого процесса состоит в том, что для того, чтобы попасть в точку «рыночная экономика», необходимо провалиться в глубокий ров, который соединяет «административную экономику» с «рыночной». Это означает, что постепенное движение к лучшему приводит к ухудшению, при этом скорость ухудшения при равномерном движении к лучшему увеличивается. Растет и сопротивление системы ее изменению. Причем, максимум сопротивления достигается раньше, чем достигается самое плохое состояние на кривой. Когда общество достигает «дна», скатываться вниз уже невозможно. Следовательно, сопротивление процессу перестройки начинает постепенно падать, и теперь система начинает, как бы, притягиваться к лучшему состоянию. Здесь очень важно отметить, что слабо развитая система может перейти в лучшее состояние почти без предварительного ухудшения, в то время как развитая система на такое постепенное улучшение неспособна, в связи с тем, что такая система является устойчивой. Если систему удастся перестроить из плохого состояния в хорошее достаточно быстро, скачком, то далее она сама будет эволюционировать в сторону хорошего состояния. [2]

Математики утверждают, что это и есть объективные законы функционирования сложных нелинейных систем. Эти законы надо знать, и соблюдать во время разного рода перестроек, переходов, качественных изменений и нельзя игнорировать, подобно тому, как нельзя игнорировать законы природы и общества (будь то закон тяготения или закон стоимости).

В теории катастроф существует ещё один важный подход к исследованию скачкообразных переходов, изменений параметров любой системы, в том числе и экономической. Этот метод заключается в изучении наличия у гладкой вещественной функции критических точек, в которых производная обращается в нуль. Критическими являются точки, в которых график функции имеет горизонтальную касательную. Необходимо отметить, что классификация критических точек в математической теории катастроф является одним из главных ее источников. [5]

Обратимся к экономической системе. Под влиянием различных факторов экономическая система находится в устойчивом равновесии, если функция потенциала имеет строгий локальный минимум. При превышении определенных значений этих факторов система будет плавно изменять свое состояние, если критическая точка невырождена (невырожденная критическая точка является

изолированной; критическая точка называется изолированной, если найдется такая ее окрестность, в которой нет других критических точек). При некотором увеличении нагрузки критическая точка вырождается, вырожденная критическая точка как структурно-неустойчивая распадается на невырожденные или исчезает. При этом система скачкообразно переходит в новое состояние, характеризующееся потерей устойчивости, разрушениями. [2]

Многочисленные особенности, бифуркации (раздвоение, разветвление) и катастрофы (скачки) возникают во всех задачах о нахождении экстремумов, задачах оптимизации, управления и принятия решений. Из этого следует, что математическую теорию катастроф можно применять в исследовании экономической системы, т.к. ее основной задачей является оптимизация - максимизация функции прибыли или минимизация функции издержек. Однако при всей ее полезности и ценности, необходимо помнить, что она не всемогуща, она не способна предотвратить катастрофы. Тем более современная экономика представляет собой сложную систему, внезапные изменения которой не поддаются никакому анализу и предсказанию.

ЛИТЕРАТУРА

1. Алексеев, Ю.К., Сухоруков, А.П. Введение в теорию катастроф / Ю.К. Алексеев, А.П. Сухоруков – М.: «Издательство МГУ», 2000 г. – 173 с.
2. Арнольд, В.И. Теория катастроф / В.И. Арнольд – М.: «Наука. Гл. ред. физ.-мат. лит.», 1990 г. – 128 с.
3. Басовский, Л.Е. Прогнозирование и планирование в условиях рынка. Учебное пособие. – М.: ИНФРА-М, 2001г.
4. Баяк, Д. Глобальный кризис и его модель / Д. Баяк // “Вокруг света” . – 2009 г.
5. Острейковский, В.А. Анализ устойчивости и управляемости динамических систем методами теории катастроф / В.А. Острейковский – М.: «Высшая школа», 2005 г. – 326 с.
6. Постон, Т., Стюарт, Я. Теория катастроф и её приложения / Т. Постон, Я. Стюарт - М.: «Мир», 1980г. – 608 с.
7. Чирков, Ю. Математика: теория катастроф / Ю. Чирков // Журнал “Национальная безопасность” . – 2011 г.
8. Теория катастроф // Свободная энциклопедия Википедия [Электронный ресурс]. – Режим доступа: http://ru.wikipedia.org/wiki/Теория_катастроф . – Дата доступа: 22. 11. 2012.
9. Том Рене // Свободная энциклопедия Википедия [Электронный ресурс]. – Режим доступа: http://ru.wikipedia.org/wiki/Том,_Рене . – Дата доступа: 01. 12. 2012.

Сравнительный анализ теорий кривых Филлипса

Шабанова М.

Среди множества макроэкономических показателей в центре внимания финансовых аналитиков, политиков и всех остальных людей всегда находятся два

основных показателя состояния экономики - темп инфляции и уровень безработицы. Как известно, эти две кривые носят не только макроэкономический, но и социальный характер. Поэтому трактовка кривой Филлипса является центральным аспектом любой макроэкономической теории [5, с.48].

Данная работа посвящена сравнительному анализу конкурирующих подходов к кривой Филлипса.

Структура работы выглядит следующим образом. Сначала будет представлена традиционная кейнсианская интерпретация кривой Филлипса. Затем – монетаристский и ново-классический подходы, известные своим отсутствием компромиссного выбора между инфляцией и безработицей в долгосрочном периоде. Следующий подраздел будет посвящен трактовке новых кейнсианцев и, наконец, в конце будет представлена попытка построения кривой Филлипса для Российской экономики.

Традиционная кривая Филлипса: история появления, сущность, и логическое обоснование

В конце 50-х годов XX в. в арсенал кейнсианства вошла кривая Филлипса - модель, использованная в последующем в экономической политике для выбора между инфляцией и безработицей. Сам Филлипс, в прошлом - электрик, сменивший профессию, благодаря этой кривой стал одним из самых известных экономистов. В 60-ые годы его кривая стала центральным элементом макроэкономической науки.

Важно упомянуть, что первоначально учёный не рассматривал темп инфляции как таковой, а исследовал корреляцию безработицы с уровнем номинальной заработной платы [15 с.7-9]. На рис.1 представлена оригинальная модель Филлипса (по оси абсцисс отложен уровень безработицы, по оси ординат – уровень номинальной заработной платы).

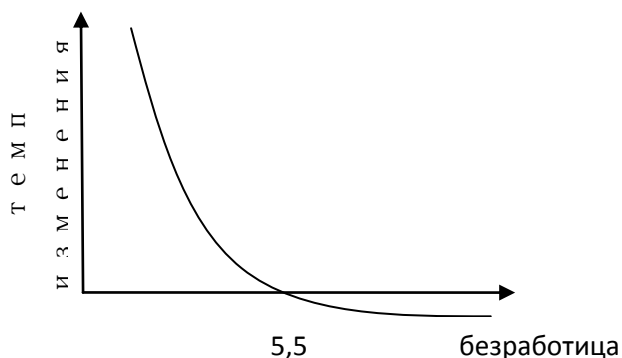


Рис. 1 – Первоначальный вид кривой Филлипса
Примечание - Источник: составлено по [15, с.3].

Несмотря на то, что объяснение обратной зависимости между инфляцией и безработицей было предложено И. Фишером еще в 1926 году, эта теория получила признание только после публикации статьи Филлипса «Зависимость между безработицей и темпом изменения номинальной заработной платы в Великобритании в период с 1861 по 1957 г.» в 1958 году в английском журнале «Económica». Идея кривой возникла у Филлипса, когда он читал книгу шведского экономиста Бента Хансена «Теория инфляции» (1951). В своей статье на основе анализа эмпирических данных по Великобритании почти за 100 лет Филлипс доказал существование обратной зависимости между темпами изменения заработной платы и уровнем безработицы. Согласно кривой Филлипса, зарплата в Соединенном Королевстве обнаруживала тенденцию к росту задолго до достижения полной занятости; она начинала расти при уровне безработицы около 5,5% - в точке, в которой кривая Филлипса пересекает горизонтальную линию, соответствующую нулевому уровню роста денежной заработной платы [1, с.429].

Исходная идея Филлипса связывала уровень безработицы с давлением спроса в экономике. Чем ниже уровень безработицы, тем больше избыточный спрос на труд и тем жестче наемные работники будут требовать повышения своих доходов. То есть, темп роста заработной платы будет расти по мере роста спроса на труд. Этот рост прекратится только тогда, когда избыточный спрос на труд станет равным нулю [15, с.283].

Через два года после выхода указанной работы, П. Самуэльсон и Р. Солоу подтвердили наличие подобной зависимости в США, и назвали её «кривой Филлипса». Именно с их именами также связана первая модификация модели: в статье «Анализ антиинфляционной политики» (1960) экономисты построили кривую, показывающую обратную зависимость между уровнем безработицы и темпом инфляции для экономики США. Такая замена не имела принципиального значения, так как увеличение заработной платы и рост цен тесно связаны друг с другом: в периоды быстрого подъема заработной платы быстро растут и цены [2, с.456].

На рис. 2 изображена переработанная модель, где уровень заработной платы сменился годовыми темпами инфляции. Это, по сути, ее единственное существенное отличие.

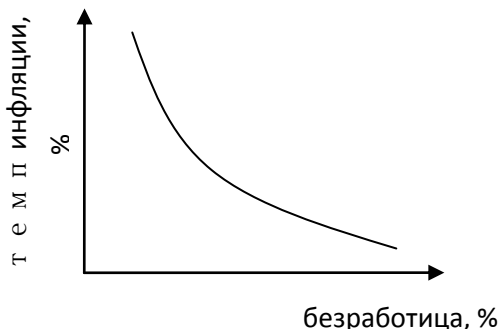


Рис.2 – Кривая Филлипса для краткосрочного периода

Примечание - Источник: составлено по [8, с.699]

Кривую Филлипса, показанную на рисунке 1 и 2, можно записать как:

U)

и

Л)

Таким образом, основное утверждение кривой Филлипса состоит в следующем: при прочих равных, чем выше уровень безработицы, тем ниже темп инфляции (изменение уровня цен по сравнению с предыдущим периодом).

Кривая Филлипса, по сути, явилась очень удобным инструментом для лиц из правительства, отвечающих за макроэкономическую политику в стране: в краткосрочном периоде существует альтернатива между инфляцией и безработицей, одновременно решать эти обе проблемы нельзя. В 60-ые годы (период сосуществования невысокой инфляции и маленькой безработицы) данный инструмент не заставлял усомниться в установленной зависимости [1, с.430]. Однако ситуация изменилась в начале 70-х, когда впервые в истории Запада возник феномен одновременного сосуществования инфляции и безработицы – так называемой стагфляции. Попытки уменьшить безработицу традиционными методами приводили лишь к большей инфляции. Кривая больше не отражала реальную действительность, и требовался новый подход, который предложили приверженцы неоклассической традиции [5, с.50].

Кривая Филлипса с точки зрения монетаристов и новых классиков

В конце 60-х годов М. Фридман и Э. Фелпс практически одновременно адаптировали кривую Филлипса к новым условиям. И именно по теории Филлипса о том, что избыточный спрос на труд (связанный с безработицей) ведет к росту номинальной заработной платы до равновесного уровня, Фридман и Фелпс нанесли удар [8, с.699]. В начале 70-х похожую трактовку предложили и новые классики во

главе с Лукасом. Ученые сделали несколько предположений, подтвердившихся впоследствии.

Во-первых, они предположили, что экономические агенты ориентируются на реальную, а не номинальную заработную плату. Вот что писал об этом Фридмен: «Phillips' analysis ... is deservedly celebrated as an important and original contribution. But, unfortunately, it contains a basic defect - the failure to distinguish between nominal wages and real wages» [11, с.8]. Они делают предположение о том, что переговоры по вопросам заработной платы обычно направлены на установление такой ставки номинальной заработной платы W , которая, в конечном счете, призвана обеспечить определенный уровень реальной заработной платы при заданном уровне цен. Однако поскольку переговоры осуществляются через определенные промежутки времени (например, раз в год), то во внимание принимается такой уровень цен, который, как ожидается, будет существовать в течение всего времени действия контракта, определяющего ставки заработной платы. Так, в момент t номинальная ставка W устанавливается с целью получить определенную ставку реальной заработной платы W/π_e , где π_e - это ожидаемый уровень цен [8, с.700-701]. Поэтому уравнение кривой 1.1 можно записать следующим образом:

$$h - h(U)$$

$$e - f(U)$$

а в ценовой форме:

Эти уравнения показывают, что значения W и π для какого-либо определенного уровня безработицы зависят от ожидаемых темпов инфляции.

Во-вторых, экономисты утверждают, что обратная зависимость между темпом роста цен и уровнем безработицы существует лишь в краткосрочном периоде и отсутствует в долгосрочном периоде (то есть учёные жёстко разграничивают анализ на краткосрочный и долгосрочный периоды) [1, с.430]. Такое разграничение связано с учетом гипотезы естественного уровня безработицы [11, с.9]. Согласно этой гипотезе, экономика имеет внутреннюю тенденцию (заложенную самим рыночным механизмом) к естественному уровню безработицы (U_n). Если фактическая норма безработицы (U) равна естественной, то рынок рабочей силы в модели Фридмена-Фелпса находится в состоянии равновесия. Если U больше U_n , то имеется избыточное предложение рабочей силы, а если U меньше U_n - избыточный спрос на рабочую силу [8, с.701].

Общими чертами этих двух трактовок можно считать следующие характеристики:

1) Краткосрочный период - это период неравновесия, порожденного денежной политикой правительства. Такая политика связана с тем, что правительство, путем стимулирования, пытается снизить безработицу ниже естественного уровня. Однако снижение является временным и в скором времени

безработица возвращается к естественному уровню, а экономика оказывается в длительном периоде.

2) Долгосрочный период - это период, в течение которого сбываются ожидания и/или экономика полностью расходует все свои ресурсы. Другими словами, это и есть период, в течение которого система находится в состоянии естественного уровня безработицы. Вся безработица в этот период носит добровольный характер [5, с.50].

А вот механизм движения экономики из длительного периода в короткий объяснялся приверженцами неоклассической традиции по-разному.

М. Фриден выдвинул так называемую «гипотезу адаптивных ожиданий», в соответствии с которой ожидания основываются на прошлом опыте, но при этом постоянно проверяются и корректируются в ходе экономической деятельности. Действительно, при вступлении в договорные отношения с администрацией рабочие, не зная точно реального размера будущей инфляции, ориентируются на ее ожидаемые масштабы. Ожидания формируются по принципу «завтра будет примерно то же самое, что сегодня и вчера» [9, с.168]. Стимулирующая денежная политика правительства, приводящая к росту цен и снижению ставки реальной заработной платы, позволяет фирмам поднять номинальную ставку. Для работников временно создается обманчивое впечатление повышения реальной заработной платы, ведущее к падению размера безработицы ниже естественного уровня (экономика переместится вверх по краткосрочной кривой Филлипса). Но, несмотря на медленное изменение ожиданий, они все же корректируются, и рано или поздно увеличение инфляционных ожиданий приведет к сдвигу краткосрочной кривой Филлипса вверх (чем выше ожидаемый темп инфляции, тем правее сдвинется кривая) (см. рис.3). Дальнейшее следование политике стимулирования спроса на графике отражается в своеобразной траектории кривой, напоминающей «ёлочку»: она показывает переход ко все более высоким кривым Филлипса и обратное движение вдоль этих кривых к естественному уровню безработицы. Со временем все экономические агенты адаптируются к новым условиям и скорректируют свои инфляционные ожидания: они установятся на новом уровне, а экономика возвратится к естественному уровню безработицы. Любые попытки правительства снизить уровень безработицы ниже естественного приведут к ускорению инфляции. Если же фактический уровень безработицы окажется выше естественного уровня, то инфляционные ожидания уменьшатся и процесс пойдет в противоположном направлении [1, с.434].

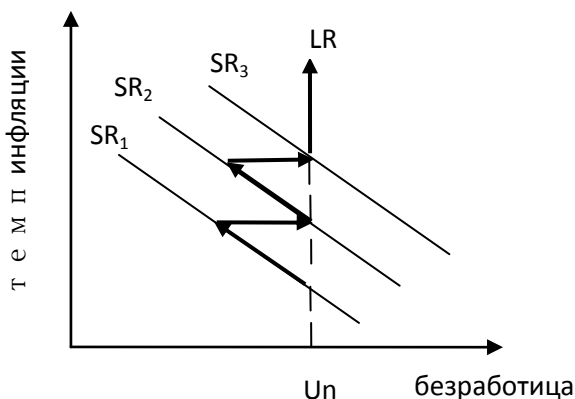


Рис. 3 Долгосрочная и краткосрочная кривая Филлипса
Примечание - Источник: составлено по [1, с.434]

Вскоре в дебаты включилась школа рациональных ожиданий. Новые классики, во главе с Лукасом, критиковали только что описанный подход, указывая на несовместимость гипотезы адаптивных ожиданий с полностью рациональным поведением хозяйствующих субъектов [5, с.51]. Первое, что сделали новые классики, это была критика используемых кейнсианцами и монетаристами схем формирования ожиданий. Обе они, утверждает школа рациональных ожиданий, противоречат постулату оптимальности и недооценивают действительно присущую человеку способность вести себя разумно. В наибольшей степени данная претензия относится к концепции «денежной иллюзии» (люди не настолько глупы, чтобы каждый раз делать одни и те же ошибки, принимая номинальные величины за реальные), однако она касается и самой гипотезы адаптивных ожиданий. Строить прогнозы по модели Фридмана допустимо лишь в условиях ценовой стабильности. Тогда действительно «завтра будет примерно то же самое, что сегодня и вчера», но как только инфляция вырывается из-под контроля, адаптивные ожидания превращаются в форму нерационального поведения. Привыкнув жить в условиях резких ценовых скачков, люди формируют ожидания уже не только на базе прошлого опыта, но и на основе своих экономических познаний и представлений о будущей политике государства.

В отличие от адаптивных ожиданий, которые иногда называют «ожиданиями, повернутыми назад», рациональные ожидания являются «ожиданиями, устремлёнными вперед» [9, с.170].

Сторонники теории рациональных ожиданий полагают, что поскольку инфляционные ожидания экономических агентов рациональны и формируются на основе всей имеющейся в их распоряжении информации, то отклонений от долгосрочной кривой Филлипса быть не может, и экономика перемещается вдоль

этой вертикальной кривой. Экономические агенты предвидят все возможные изменения, все действия правительства предсказуемы, поэтому фактический темп инфляции равен ожидаемому. Если правительство начинает борьбу с безработицей, экономические агенты заранее предвидят ее последствия и меняют свои инфляционные ожидания в сторону увеличения. Экономика движется вверх вдоль долгосрочной кривой Филлипса, поэтому выпуск всегда находится на потенциальном уровне, а безработица - на естественном уровне [1, с.434].

Применение гипотезы рациональных ожиданий к анализу соотношения безработицы и инфляции естественным образом ведет новых классиков к выводу о несостоятельности как кейнсианской, так и монетаристской интерпретаций кривой Филлипса.

Обе эти трактовки привели к новому виду уравнения кривой:

$$\pi = h(U - U_n)$$

Эта кривая представляет собой вертикальную кривую LR (см. рис. 4), проведенную вверх от точки естественной безработицы (U_n) и указывающую, что в состоянии долговременного равновесия норма безработицы может равняться только U_n , а соответствующий ему темп инфляции может быть любым [8, с.702-703]. Из этой формулы видно, что возможной причиной одновременного роста темпа инфляции и уровня безработицы является изменение инфляционных ожиданий [1, с.431].

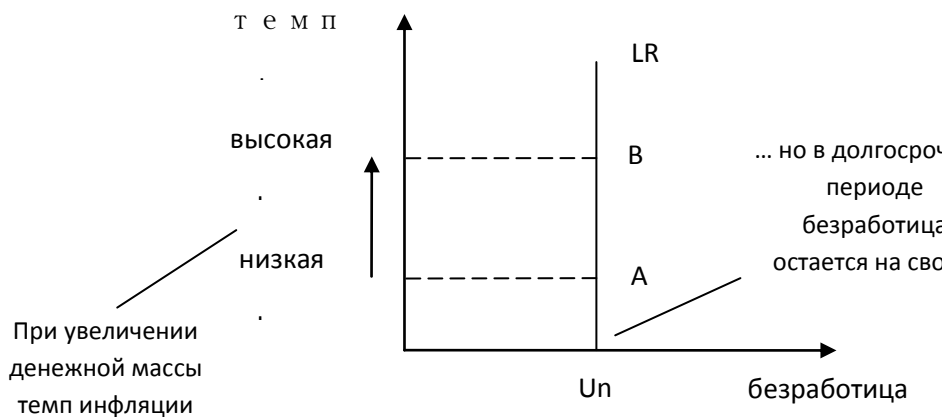


Рис. 4 – Долгосрочная кривая Филлипса

Примечание - Источник: составлено по [1, с.434]

Долгосрочная кривая Филлипса в виде вертикальной линии отражает фундаментальный вывод приверженцев неоклассической традиции (как монетаристов, так и новых классиков): компромиссного выбора между инфляцией и безработицей в длительном периоде не существует [5, с.52]. Попытки политиков снизить безработицу ниже естественного уровня не достигают поставленной цели, но при этом оборачиваются большей инфляцией. Поэтому вывод, вытекающий из модели Фридмана-Фелпса состоит в том, что денежно-кредитная политика в состоянии долговременного равновесия не может воздействовать на уровень безработицы [8, с. 703-704].

«Вклад» в stagflationary нефтяного шока середины 70-х г. прошлого века потребовал включения в уравнение показателя шоковых изменений предложения ϵ , которые повышают темпы инфляции независимо от колебаний спроса и инфляционных ожиданий:

$$\dot{p} = h(U - U_n) + \epsilon$$

Графически негативные шоки предложения также отображаются сдвигом кривой Филлипса вправо [1, с. 432].

К началу 1980-х рассмотренная трактовка кривой Филлипса стала подвергаться сомнениям, в первую очередь экономистами различных кейнсианских школ. Первое сомнение касалось гипотезы адаптивных и рациональных ожиданий. Считалось, что это настолько сложный процесс, что неправильно его описывать какой-либо четкой формулой. Более того, гипотеза адаптивных ожиданий указывает на то, что люди используют только прошлый опыт, что, в общем-то, неверно; гипотеза рациональных ожиданий предполагала, что люди функционируют подобно счетным машинам, что также противоречит реальности.

Была подвергнута критике и гипотеза естественного уровня безработицы. Эконометрическое подтверждение монетаристских и неоклассических выводов относительно формы кривой Филлипса также не было установлено. Поэтому в 1980-х годах кривой Филлипса «занялись» кейнсианские школы – новое кейнсианство и посткейнсианство [5, с. 53].

Новокейнсианская трактовка кривой Филлипса

Основным пунктом разногласий между новыми классиками и новыми кейнсианцами является вопрос о том, как быстро происходит корректировка зарплаты и цен. Новые классики выстраивают свои макроэкономические теории на допущении о гибкости зарплаты и цен. Теории новых кейнсианцев основаны на жесткости зарплаты и цен, что необходимо для объяснения того, почему существует вынужденная безработица и почему денежная политика оказывает такое сильное воздействие на экономическую активность [3].

Эта жесткость является следствием несовершенства рыночных структур, которые, по мнению новых кейнсианцев, порождаются двумя основными факторами:

- разнородностью конечных продуктов и факторов производства, особенно труда;
- асимметричностью информации.

Для отражения связей между асимметричностью информации и разнородностью продуктов и ресурсов, с одной стороны, и безработицей, с другой, в рамках нового кейнсианства было разработано множество разнообразных (порой несвязанных) концепций.

Первыми новокейнсианскими моделями кривой Филлипса считаются модели Фишера и Тейлора. Жесткость заработной платы ими объясняется существованием долгосрочных контрактов, которые надолго фиксируют заработок (от одного года до нескольких лет). Тогда в случае изменения спроса на труд меняется уровень занятости, а не зарплата.

Концепция «инсайдеров-аутсайдеров», разработанная А. Линдбеком и Д. Сноуэром, предполагает деление всех работников фирмы на две группы - инсайдеров (тех, кто уже работает на фирме) и аутсайдеров (претендентов на рабочие места). При этом предполагается, что монопольная власть, которой обладают инсайдеры (за счет уже произведенных трат на профессиональную (пере)подготовку, необходимость осуществления дополнительных издержек найма и увольнения работников и т.д.), позволяет им получать завышенную заработную плату. В результате в экономике появляются безработные, формирующиеся за счет аутсайдеров [6, с. 111-113].

Однако наиболее популярным вариантом модели оказалась концепция эффективной заработной платы, согласно которой эффективность труда работников фирм повышается, если оплата их труда превышает равновесный уровень. В рамках данной модели существует несколько теорий о влиянии заработной платы на производительность труда.

Одна из них, относящаяся к слаборазвитым странам, утверждает, что зарплата влияет на питание. Высокооплачиваемые рабочие могут позволить себе лучше питаться, а более здоровые рабочие работают более продуктивно. В таких странах фирма может намеренно платить зарплату выше равновесного уровня для поддержания здоровья рабочих. Однако эта точка зрения не имеет значения для работодателей в развитых странах, где равновесный уровень зарплаты намного выше уровня, необходимого для здорового образа жизни.

Вторая теория эффективной оплаты труда, более подходящая для развитых стран, утверждает, что высокие заработки сокращают текучесть рабочей силы. Чем больше фирма платит рабочим, тем больше у них стимулов остаться на фирме. Но выходит, что рабочему, которому платится равновесная заработная плата, без разницы, продолжать работать или уволиться, что в действительности не так [2, с. 217-218].

Третья теория, разработанная Э. Вайсом, утверждает, что среднее качество персонала на фирме зависит от получаемой ими зарплаты. Если фирма сокращает заработную плату, лучшие работники могут перейти на другую работу, так что на фирме останутся только худшие, не имеющие альтернатив. Экономисты называют такой отбор «отрицательной селекцией» (неблагоприятным отбором). Завышая зарплату, фирма может избежать отрицательной селекции, улучшить качественный состав работающих и тем самым повысить производительность труда [6, с.114].

И, наконец, четвертая теория, авторами которой являются Ф. Шапиро и Дж. Стиглиц, утверждает, что высокая заработная плата повышает старательность работников. Теория исходит из того, что фирмы не могут полностью контролировать наемных работников, поэтому при определенных условиях ими вполне может осуществляться уклонение от своих обязанностей. Экономисты называют такую возможность нечестного поведения «моральным риском». Фирма может сгладить проблему морального риска, установив более высокую зарплату. Выплачивая высокую зарплату, она побуждает рабочих не уклоняться от работы, тем самым повышая производительность труда.

Все эти теории эффективной оплаты труда едины в том, что фирма работает более эффективно, если она платит своим рабочим более высокую зарплату, (на уровне ставки, превышающей равновесное значение заработной платы), в результате чего возникает безработица [2, с. 218-219].

Большую популярность получает также модель малоподвижной цены (1983 года), предложенная Г. Кальво. Она стала очень популярной моделью в различных эконометрических исследованиях и вопросах об эффективной денежной политике. Кальво для начала делает пару допущений. Каждый период определенная доля фирм λ может корректировать цены. При этом каждая фирма имеет одну и ту же вероятность попасть в группу корректирующих цены фирм [10, с.3].

Также в модели определяются 3 основополагающих отношения:

1. «желаемая» цена (цена, максимизирующая прибыль): $p_t^* = p_t + \alpha u_t$, где p_t - общий уровень цен, u_t - реальный объем выпуска.

Но фирмы редко назначают желаемую цену, так как корректировка цен происходит не так часто, поэтому, когда у фирмы возникает возможность изменить цену, она устанавливает цену, равную средней желаемой цене. Вследствие этого, «корректировочная» цена определяется следующим уравнением:

$$2. x_t = \lambda \sum_{j=0}^{\infty} (1 - \lambda)^j E_t p_{t+j}^* .$$

Она равняется средневзвешенному значению текущей желаемой цены и всех будущих желаемых цен. Данная формула показывает, что желаемые цены более отдаленных периодов времени имеют меньшее значение для фирмы, так как она может осуществить еще одну корректировку цен до какой-то даты в будущем.

Третье уравнение модели определяет общий уровень цен:

$$3. p_t = \lambda \sum_{j=0}^{\infty} (1-\lambda)^j x_{t-j}.$$

Согласно ему, общий уровень цен определяется как среднее значение всех цен в экономике или средневзвешенное значение всех цен, установленных фирмами в прошлом. Чем больше λ , тем меньшую роль играют прошлые ценовые решения фирм.

Таким образом, новокейнсианская кривая Филлипса выглядит следующим образом:

$$\pi_t + E_t \pi_{t+1}, \text{ где } \beta = \alpha \lambda / (1-\lambda)$$

Согласно новокейнсианской кривой, текущий темп инфляции является функцией выпуска и ожидаемой в будущем инфляции [14, с.4-6].

Новый пересмотр кривой Филлипса произошел уже в новом тысячелетии. Г. Мэнкью и Р. Райс предложили новую модель - модель малоподвижной информации.

Основная идея заключается в том, что информация в макроэкономических условиях распространяется между фирмами довольно медленно. Причиной этому является либо издержки получения информации либо издержки реоптимизации. В любом случае, несмотря на то, что цены постоянно изменяются, сами ценовые решения не всегда основаны на текущей информации [14, с.2]. Считается, что некоторая доля фирм (λ) вычисляет оптимальную цену, основываясь на текущей информации, в то время как остальные фирмы устанавливают цены по старой информации. Каждая фирма при этом имеет одинаковую вероятность быть именно той фирмой, которая будет корректировать цены.

Также, как и в модели Кальво, желаемая цена фирмы определяется следующим образом: $p_t^* = p_t + \alpha y_t$.

«Корректировочная» цена фирмы, которая последний раз установила свои цены j периодов назад это: $x_{jt} = E_{t-j} p_t^*$.

Общий уровень цен – это среднее значение цен всех фирм в экономике:

$$p_t = \lambda \sum_{j=0}^{\infty} (1-\lambda)^j x_t^j$$

Обобщенное уравнение для общего уровня цен (при объединении уравнений, приведенных выше) будет выглядеть следующим образом:

$$p_t = \lambda \sum_{j=0}^{\infty} (1-\lambda)^j E_{t-j} (p_t + \alpha y_t)$$

Проведя определенные преобразования данного уравнения, Мэнкью и Райс приводят следующую формулу темпа инфляции:

$$\dot{y}_t + \lambda \sum_{j=0}^{\infty} (1-\lambda)^j E_{t-1-j} (\pi_t + \alpha \Delta y_t) = \beta \Delta y_t, \text{ где } \beta = \alpha \lambda / (1-\lambda), \Delta y_t = y_t - y_{t-1}$$

Следовательно, темп инфляции зависит от выпуска, прошлых инфляционных ожиданий и ожиданий темпа выпуска.

Главными отличиями между двумя моделями заключаются в следующем:

1) модель малоподвижной цены зависит от текущих ожиданий будущей экономической обстановки;

2) модель малоподвижной информации зависит от прошлых ожиданий текущей экономической обстановки [14, с.5-7].

Основной минус модели состоит в сомнительной предпосылке о том, что к одним фирмам информация поступает медленно, а к другим - быстро. Авторы и сами это понимают, уделяя данной проблеме внимание в своей работе. Но самое большее, что они могут сделать - это сослаться на аспекты, касающиеся издержек получения информации и издержек принятия решений. Однако в целом, в этой модели гипотеза издержек принятия решений выглядит ничуть не убедительнее, чем гипотеза несовершенной информации в модели новых классиков (модели Лукаса) [5, с.55-56].

Кривая Филлипса в Российской экономике (1994-2012)

Попытки протестировать само выполнение зависимости Филлипса предпринимались многими экономистами для США и стран Евросоюза, т.е. для стабильных, развитых экономик. Для развивающихся экономик, зачастую имеющих более высокий уровень инфляции, кривая Филлипса редко имеет такой вид (см. рис.2). Но все же попробуем построить изначальный вариант кривой Филлипса для российской экономики.

Для России (как и для Республики Беларусь) проблема построения осложняется тем, что Россия на протяжении рассматриваемого периода находилась в состоянии трансформационного перехода от плановой экономики к рыночной, вследствие чего экономическая ситуация и само поведение всех макроэкономических временных рядов весьма нестабильны [4, с.2]. Для Республики Беларусь возникает еще и проблема искажения в самих измерениях темпа инфляции и безработицы (нельзя отрицать явное наличие «скрытой» безработицы в нашей стране). Поэтому сложно априорно судить о степени правильности полученных выводов для России. Кроме того, поскольку ряды макроэкономических данных по России ведутся только с начала 1990-х годов,

возникает проблема оценки модели при малом количестве точек. Чтобы исключить данную проблему, данные по инфляции и безработице брались по кварталам.

Кривая Филлипса на основе квартальных данных представлена на рисунке 5.

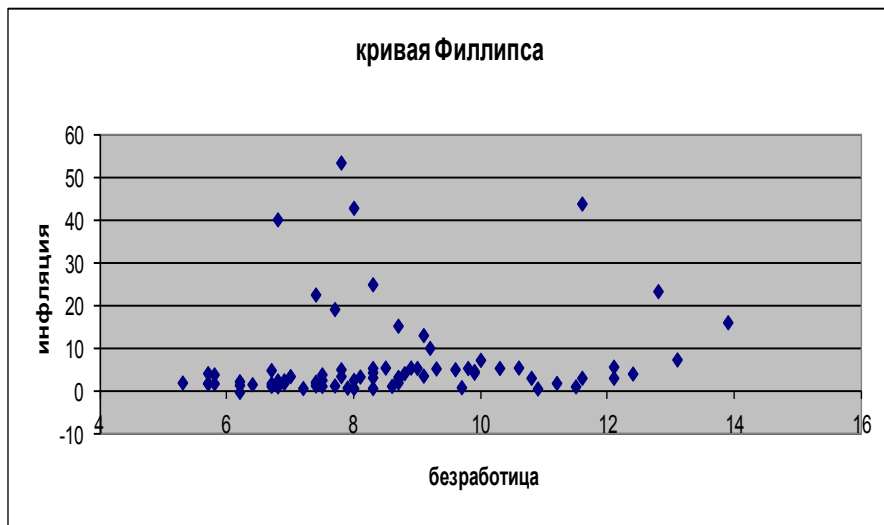


Рис. 5 – Кривая Филлипса для России (квартальные данные с 1 квартала 1994 года по 1 квартал 2012 года)

Примечание - Источник: собственная разработка

Опираясь на этот график, можно говорить о том, что отрицательная зависимость между уровнем безработицы и инфляцией в России наблюдалась лишь на отдельных временных интервалах. Причем такие зависимости наблюдались при заметном разных уровнях безработицы.

Таким образом, в своей изначальной форме кривая Филлипса - это так называемая малая макроэкономическая модель, показывающая обратную зависимость между скоростью изменения заработной платы (зависимая переменная) и уровнем безработицы (объясняющая переменная); данное явление было истолковано как изменение цен на товар (труд) в результате избыточного спроса (низкая безработица). Первую модификацию модели произвели Солоу и Самуэльсон, построив кривую, показывающую обратную зависимость между уровнем безработицы и темпом инфляции. Затем в модель были привнесены ожидания. Согласно гипотезе адаптивных ожиданий (Фридмен), ожидания основываются на прошлом опыте. Согласно гипотезе рациональных ожиданий (Лукас), экономические агенты формируют ожидания, используя всю доступную

экономическую информацию. Их еще называют «ожиданиями, устремленными вперед».

Как уже известно, кривая Филлипса в ходе исследований изменила свою форму и представлялась экономистами как вертикальная прямая, берущая свое начало из точки естественного уровня безработицы. «Вклад» в стагфляцию нефтяного шока середины 70-х г. прошлого века потребовал включения в уравнение показателя шоковых изменений предложения ε .

Впоследствии, были проведены еще многие модификации кривой Филлипса (модели малоподвижных цен и малоподвижной информации новых кейнсианцев и др.), но в общепринятом подходе кривая Филлипса в линеаризованном виде выглядит следующим образом:

$$\pi = \pi_e - b(U - U_n) + \varepsilon$$

Кривая Филлипса утверждает, что уровень инфляции - изменение уровня цен по сравнению с предшествующим периодом - зависит от трех факторов:

- ожидаемой инфляции;
- отклонения безработицы от естественного уровня, т.е. циклической безработицы;
- шоковых изменений предложения.

ЛИТЕРАТУРА

1. Макроэкономика: учебник / А. В. Аносова [и др.] - М.: Юрайт, 2011. — 526 с.
2. Мэнкью, Н. Г. Макроэкономика. Перевод с английского / Н. Г. Мэнкью – М.: Издательство МГУ, 1994. – 736 с.
3. Мэнкью Н. Г. Новая кейнсианская экономическая теория [Электронный ресурс] – Режим доступа: http://gallery.economicus.ru/cgi-bin/frame_rightn.pl?type=school&links=/school/newkeynesianism/lectures/newkeynesianism_11.txt&img=brief.gif&name=newkeynesianism. – Дата доступа: 22.11.2012.
4. Палий А. А. Оценка NAIRU для российской экономики в период с 1994 по 2005 год [Электронный ресурс] – Режим доступа: <http://www.iep.ru/files/text/other/referat/005.pdf>. – Дата доступа: 29.11.2012.
5. Розмаинский И. В. Сравнительный анализ теорий кривых Филлипса: методологические аспекты с точки зрения посткейнсианского подхода / И. В. Розмаинский // Экономический вестник Ростовского государственного университета. – 2006. – №1. – С. 48-60.
6. Розмаинский В. И. История экономического анализа на Западе / В. И. Розмаинский, Холодилин К. А. – СПб.: СПбГУ, 2000. – 138с.
7. Федеральная служба государственной статистики [Электронный ресурс] – Режим доступа: <http://www.gks.ru/wps/wcm/connect/rosstat/rosstatsite/main/>. – Дата доступа: 29.11.2012.
8. Харрис Л. Денежная теория: Пер. с англ. / Л. Харрис. Общ. ред. и вступ. ст. В.М. Усоскина. - М.: Прогресс, 1990.-750 с.
9. Худокормов А.Г. История экономических учений / А.Г. Худокормов. – М: Инфра-М, 2002. – 733с.

10. Calvo G. A. Staggered prices in a utility-maximizing framework [Электронный ресурс] – Режим доступа: <http://isites.harvard.edu/fs/docs/icb.topic500592.files/calvo.pdf>. – Дата доступа: 26.11.2012.
11. Friedman M. The American economic review [Электронный ресурс] – Режим доступа: <http://www.aeaweb.org/aer/top20/58.1.1-17.pdf>. – Дата доступа: 26.11.2012.
12. Hall T. E., Hart W.R. The Samuelson-Solow «Phillips curve» and the great inflation [Электронный ресурс] – Режим доступа: <http://www.fsb.muohio.edu/fsb/ecopapers/docs/hallte-2010-08-paper.pdf>. – Дата доступа: 24.11.2012.
13. Laidler D. Phillips in retrospect [Электронный ресурс] – Режим доступа: <http://economics.uwo.ca/faculty/laidler/workingpapers/phillips.pdf>. – Дата доступа: 24.11.2012.
14. Mankew G., Reis R. Sticky information versus sticky prices: a proposal to replace the new Keynesian Phillips curve [Электронный ресурс] – Режим доступа: <http://www.columbia.edu/~r2572/papers/02-stickyQJE.pdf>. – Дата доступа: 22.11.2012.
15. Phillips A. W. The Relation Between Unemployment and the rate of change of money wage rates in the United Kingdom, 1861-1957 [Электронный ресурс] – Режим доступа: <http://onlinelibrary.wiley.com/doi/10.1111/j.1468-0335.1958.tb00003.x/pdf>. – Дата доступа: 15.11.2012.

Неоклассическая модель экономического роста Р. Солоу

Шилович Л.

Неоклассическая модель роста была разработана Робертом Солоу и впервые представлена в его статье «Вклад в теорию экономического роста» в 1956 году. Данная модель заменила кейнсианскую модель экономического роста Харрода-Домара. Необходимость в пересмотре данной модели обуславливалась тем, что она слишком сильно переоценивала неустойчивость капиталистической экономики. [1] Нужно также учитывать, что Харрод и Домар опубликовали свои работы по данной теме в 1939 и 1946 году соответственно. Их теория роста, как и многое в макроэкономике, была разработана под влиянием последствий Великой Депрессии и Второй мировой войны и поэтому имела довольно пессимистичный характер. Во время послевоенного восстановления и периода устойчивого развития появилась необходимость в иных подходах к оценке роста экономики. Появившаяся в этих условиях модель Солоу отвечала данным требованиям, а также описывала рост не механическим образом, с помощью описания потоков и запасов товаров, а через устойчивое и естественным образом поддерживаемое движение к равновесию. Данная модель получила большую известность, она включена во все современные учебники по макроэкономике, а ее автор получил в 1987 году Нобелевскую премию по экономике «за фундаментальные исследования в области теории экономического роста». [5]

Предпосылки модели

Среди предпосылок можно условно выделить существенные предположения, которые влияют на результаты модели и неизбежные упрощения, которые на

данный результат не влияют. Для создания успешной модели важно, чтобы существенные предпосылки данной модели были максимально приближены к реальности, особенно в тех случаях, когда результат прогнозирования модели напрямую зависит от таких предположений.

Теоретической основой для модели являлись производственная функция Кобба-Дугласа и модель Харрода-Домара. Функция Кобба-Дугласа служила прототипом формы производственной функции модели Солоу, так как она отвечала требованиям о существенности каждого из факторов производства, убывающей положительной отдаче от их использования и стремящемуся в бесконечность выпуску при условии стремления в бесконечность одного из факторов производства. [2] Модель Харрода-Домара была базой, на критике которой строилась модель Солоу. По его мнению [3] модель Харрода-Домара имела специфическую особенность, заключающуюся в применении инструментария описания краткосрочного периода для анализа долгосрочного экономического роста. Так как долгосрочный период обычно относится к неоклассическим сферам исследования, то Солоу использует все предпосылки модели Харрода-Домара за исключением фиксированных пропорций капитала и труда, иными словами невозможно замещение одного из факторов производства другим, что неверно для долгосрочного периода. Солоу также подверг [3] критике вывод модели Харрода-Домара о том, что даже в долгосрочном периоде экономика сбалансирована лишь на «лезвии ножа» в точке, где естественный рост оказывается равным гарантированному и фактическому, в единственной точке, где полностью задействованы и труд, и капитал. Отклонения ключевых параметров – нормы сбережений, отношения «капитал-выпуск» и уровня роста рабочей силы – от своих равновесных значений приводят либо к растущей безработице, либо к длительной инфляции. Данная модель допускала возможность изменения этих параметров, но предполагалось, что такие изменения случайны и не связаны друг с другом. В реальности это означало бы маловероятность существования периодов стабильного экономического роста. Но если принимать во внимание взаимозаменяемость труда и капитала, то в условиях существования эффективных рынков этих факторов, норма сбережения в экономике прямо связана с инвестициями фирм. Чем выше норма сбережения, тем меньше стоимость капитала в сравнении с заработной платой и тем больше капитала используется вместо труда, и наоборот. [8] В случае отказа от фиксирования данных параметров нестабильность долгосрочного равновесия также исчезает. Для своей модели Солоу значительно скорректировал жесткость этих предпосылок.

Допущения модели Солоу и ее основы

В модели Солоу предполагается [3], что применяется односекторная производственная технология, общий объем выпуска $Y(t)$, часть произведенного товара потребляется, а остаток сберегается и инвестируется в производство. Сберегаемая доля выпуска постоянна и равна s . Технологические возможности

представлены производственной функцией с двумя факторами производства, труд L и капитал K , при этом капитал образуется за счет аккумуляирования произведенных товаров, таким образом

$$\dot{K} = sY. \quad (1.1) [3]$$

При этом под выпуском понимается чистый выпуск после вычета амортизации. В этом есть некоторое отличие первоначальной модели от ее современного варианта, представленного в учебниках по макроэкономике. В настоящее время степень выбытия капитала рассчитывается отдельно, как норма амортизации δ . [2] Существует постоянная отдача от масштаба, из чего следует, что наличие невосполняемых ресурсов не учитывается. Солоу отмечает [3], что допущение о постоянном эффекте от масштаба является естественным для теорий долгосрочного роста. Итоговое уравнение выглядит как

$$Y = F(K, L). \quad (1.2) [3]$$

Добавление в систему уравнения спроса на труд позволило бы ее логически завершить, но Солоу решил воспользоваться положениями модели Харрода-Домара. Было сделано допущение [3], что население и трудовые ресурсы, занятые в производстве N растут с постоянным экзогенным темпом n . При отсутствии изменений в технологии n будет также являться темпом естественного роста в модели Харрода-Домара. Так как данная модель основана на традициях неоклассической школы, то уровень безработицы в долгосрочном периоде равен естественному.

$$L(t) = L e^{nt} \quad (1.3) [3]$$

представляет собой кривую предложения труда, которая при заданных условиях является совершенно неэластичной

$$\dot{K} = sF(K, L e^{nt}) \quad (1.4) [3]$$

- это базовое уравнение аккумуляции капитала, которое соответствует действительности при естественном уровне безработицы.

Дальнейшая оценка, отмечает Солоу[3], затруднительна без знаний о форме производственной функции для каждого отдельно взятого случая, однако некоторые более широкие выводы возможны на основе этой модели.

Для того, чтобы проследить взаимосвязь накопления капитала и экономического роста Солоу водит новую переменную $r = \frac{\dot{K}}{L}$. В результате математических преобразований получается

$$y = F(r, 1) \quad (1.5) [3]$$

и

$$\dot{r} = sF(r, 1) - nr \quad (1.6) [3]$$

Данная функция показывает общий произведенный объем товаров при одной единице труда, занятой в экономике или иными словами, выпуск на работника как функцию капитала на работника. В случае если $\dot{r} = 0$, мы имеем дело с частным случаем, когда темп экономического роста равен темпу прироста рабочей силы, что

совпадает с гарантированным ростом в модели Харрода-Домара. [2] Такая ситуация одновременно является и стационарным состоянием для рассматриваемой экономики, при котором удельный выпуск, капитал на человека и потребление постоянны, а агрегированные потребление, выпуск и запасы капитала растут с постоянным темпом, равным темпу роста населения.

Следующим шагом было добавление нейтрального технологического прогресса. [4] Нейтральным он считается в том случае, если при росте предельного продукта каждого из факторов предельные нормы замещения остаются неизменными. Такой технологический прогресс должен был компенсировать сдвиги в производственной функции. В таком случае производственная функция принимала вид:

$$Y = AF(K, L). \quad (1.7) [4]$$

В случае если технологический прогресс изменяет относительные производительности факторов производства, то уровень развития технологии вносится в модель как дополнительный к фактору труда и производственная функция принимает вид:

$$Y = F(K, LA), \quad (1.8) [2]$$

где LA – новый фактор производства – эффективный труд.

Этим вариантом и воспользовался Солоу для своей модели. В итоге при введении новой переменной $\tilde{r} = \frac{K}{AL}$ и принятии темпов роста за g получились итоговые уравнения:

$$y = F(\tilde{r}, 1) \quad (1.9) [2]$$

и

$$\dot{\tilde{r}} = sF(\tilde{r}, 1) - n\tilde{r} - g\tilde{r}. \quad (1.10) [2]$$

Данная система достигает стационарного состояния при $\dot{\tilde{r}} = 0$.

В базовой модели Солоу, при заданных параметрах n и g , каждому значению нормы сбережения s соответствует единственное стационарное значение $\tilde{r}$ и соответствующий объем потребления c . Стационарный режим, в котором потребление максимально, называют “золотым правилом”, т.е. правило деления выпуска на потребление и накопление, обеспечивающее максимальное стационарное потребление, называется “золотым”. Сам термин «золотое правило», а также метод расчета оптимальной нормы сбережения были впервые предложены Э. Фелпсом в 1961 году, но данный шаг независимо друг от друга сделали еще несколько экономистов (Т. Суон, Дж. Мид, М. Алле, Дж. Робинсон, К. фон Вайцзеккер и др.) [1] Идеальной по «золотому правилу» считается точка, в которой кривые $sF(\tilde{r}, 1)$ и $n\tilde{r}$ имеют одинаковый наклон. [2]

Результаты модели

Таким образом, добавление разумной доли технологической гибкости в модель Харрода-Домара позволила достигнуть значительных результатов. Во-

первых [5], модель Солоу показала, что существует множество возможных путей достижения устойчивого долгосрочного экономического роста и равновесия. Кроме того, существует также множество равновесий, которые при изменении экзогенных параметров модели могут значительно отличаться друг от друга.

Другим важным выводом является то, что равновесный уровень долгосрочного экономического роста не только не пропорционален сбережениям (которые одновременно являются и инвестициями), но и является почти полностью не зависящим от них. Так при первоначальном увеличении сбережений выпуск увеличится, и, как следствие, в течение некоторого времени будет наблюдаться более быстрый экономический рост, но достичь таким способом постоянного увеличения выпуска невозможно. [5] Таким образом, увеличение дохода, направляемого на сбережение, повлияет на темпы роста лишь в краткосрочном периоде. Вывод из этих рассуждений очевиден: в долгосрочном периоде основным фактором экономического роста является развитие техники и технологии.

Еще одним выводом из данной модели является тезис о сходимости стран при условии, что они имеют одинаковые экзогенные параметры развития. [2] С учетом того, что данные параметры возможно регулировать, это привело бы к достижению всеми экономиками мира одного и того же устойчивого состояния. На практике можно заметить, что это не так. Причина этого в том, что данная модель предполагает не абсолютную, а относительную сходимость. Абсолютная сходимость была бы в случае, если бы технологии, капитал и труд обладали бы абсолютной мобильностью, и не было бы никаких границ для их распространения по всему миру.

Развитие модели и ее применение на практике

Модель Солоу быстро приобрела научную популярность. Многие экономисты посвятили свои работы ее исследованиям.

Профессор Эдвард Вольф из Университета Нью-Йорка провел исследования долгосрочной перспективы экономического роста. [5] Он собрал данные за 1880-1979 для семи больших стран (выбор производился по доступности данных и выборка, вполне вероятно, не является репрезентативной). После анализа данных Вольф сделал вывод о наличии сильной позитивной корреляции между уровнем технологического прогресса и скоростью инвестирования. На основе этого заключения можно сделать вывод о том, что если бы у всех стран был одинаковый доступ к технологии, то те страны, которые инвестировали бы с большей скоростью, получали бы большую выгоду от новых знаний. Тем не менее, нужно отметить, что это не единственно возможное толкование обнаруженной связи.

Необходимо также отметить вклад Берта Хикмана и Роберта Козна [5], которые создали вполне завершенную эконометрическую модель на основе модели Солоу, «модель ежегодного роста экономики США». В данной модели пути достижения равновесия соответствуют представленным в неоклассической модели роста, хотя и используются в более упрощенном виде для перемещения акцентов на

определяющие факторы сбережений и эволюционные преобразования в рабочей силе. Также нужно отметить, что их исследования также позволяют рассматривать отклонения от равновесного уровня роста, что, как подчеркивал Солоу, является приоритетным направлением дальнейшего развития модели.

Важное дополнение в модель экономического роста внес Эдвард Денисон [5] в его статье «Анализ экономического роста США с 1929 по 1969». Используя статистические данные по США, он определил базовые детерминанты экономического роста и сделал вывод, что хотя наиболее «мощным двигателем» экономического роста действительно является технологический прогресс, на втором месте стоят инвестиции в человеческий капитал.

После этого Г. Мэнкью, Д. Ромер и Д. Вэйл [6] провели эмпирическое исследование, действительно ли, как предполагается в классической модели, реальный доход принимает тем большие значения, чем выше уровень сбережений и тем меньшие значения, чем выше темп роста населения. Также была рассмотрена зависимость реального дохода от технического прогресса и коэффициентом выбытия капитала. Были использованы данные о реальном доходе, государственном и частном потреблении, инвестициях по 195 странам за период с 1960 по 1985 годы. Результаты исследования, в целом, подтвердили предположения и выводы классической модели Солоу. Однако было установлено, что сбережения и темпы роста трудоспособного населения оказывают значительно большее влияние на реальный доход, чем предполагалось моделью. Поэтому авторы пошли по пути расширения модели путем включения в нее человеческого капитала. Г. Мэнкью, Д. Ромер и Д. Вэйл разделяют в модели Солоу капитал на физический и человеческий. Производственная функция одинакова для физического капитала и потребления. Поэтому единица потребления может быть превращена или в единицу физического капитала, или в единицу человеческого капитала. Они полагают, что уровень выбытия у человеческого капитала такой же, как и у физического капитала. Эмпирическая проверка Г. Мэнкью, Д. Ромера и Д. Вэйла показала, что значение человеческого капитала статистически значимо для всех протестированных выборок. С учетом человеческого капитала сходимость в модели Солоу остается относительной, но является более выраженной, чем в классической модели.

Практическое применение модели

Модель Солоу имеет не только общетеоретическое, но и важное прикладное значение. Практическое ее применение представлено во многих работах зарубежных авторов, посвященных изучению целого ряда актуальных проблем современной экономической политики. К числу этих проблем относятся [6]:

количественный анализ влияния изменения размера государственного сектора на экономический рост в экономике США за период с 1950 по 1998 годы;

оценка состояния и прогнозирование дальнейшего развития экономической системы Турции с 1998 года по настоящее время;

изучение влияния европейской интеграции на долгосрочный экономический рост на примере 15 европейских стран в период с 1960 по 1998 годы;

изучение влияния уровня образования на экономический рост в Гватемале на основе количественного анализа долгосрочных временных рядов показателей экономического развития этой страны и другие.

Модель Солоу используется как действенный инструмент прикладного анализа и проектирования государственной экономической политики во многих странах мира.

Критика модели

Нужно отметить, что Солоу рассматривает экономический рост с исключительно неоклассической точки зрения. Иногда положения неоклассической теории не совпадают с явлениями реальной хозяйственной практики.

Наиболее ярким примером является рассмотрение экономики полной занятости. Все сложности, связанные с достижением такого состояния просто не берутся во внимание. Также модель не учитывает такие «кейнсианские» аспекты функционирования экономики как жесткость цен и заработной платы, предпочтение ликвидности, влияние государственной политики и неопределенность. [3]

Важным является и то, что модель фокусируется в основном на технологическом прогрессе как источнике роста и не рассматривает вопросы эффективности спроса. [6]

Модель Солоу на данный момент является основным инструментом неоклассической школы для изучения экономического роста в долгосрочном периоде. Теоретическими предпосылками модели послужили производственная функция Кобба-Дугласа и модель экономического роста Харрода-Домара. Данная модель иллюстрирует способы достижения равновесного пути развития в долгосрочном периоде. В результате можно сделать вывод, что главным источником долгосрочного роста является технологический прогресс. Неоклассическая модель роста получила развитие в работах многих известных экономистов и, несмотря на некоторые методологические недостатки, является основой для перспективных исследований данной проблематики.

ЛИТЕРАТУРА

1. Автономов В.С. Теории экономического роста / В.С. Автономов // История экономических учений : учеб. пособие / В.С. Автономов [и др.] ; под ред. В.С. Автономова, О. Ананьина, Н. Макашевой. –М.: ИНФРА-М, 2009. – Гл. 31. – С. 537–554.
2. Бернанке Б, Абель Э. Экономический рост в долгосрочном периоде
3. // Макроэкономика: учеб. пособие /– М., 2004. – Гл. 6. – С. 279–323.
4. A Contribution to the Theory of Economic Growth / Robert M. Solow // The Quarterly Journal of Economics, Vol. 70, No. 1. (Feb., 1956), pp. 65-94.

5. Technical Change and the Aggregate Production Function / Robert M. Solow // The Review of Economics and Statistics, Vol. 39, No. 3 (Aug., 1957), pp. 312-320

6. Robert M. Solow / Prize Lecture: Growth Theory and After".// Nobelprize.org. [Электронный ресурс] – 2012 – Режим доступа: http://www.nobelprize.org/nobel_prizes/economics/laureates/1987/solow-lecture.html– Дата доступа : 10.11.2012.

7. Волкова А.В. О применении модели Солоу к анализу практических проблем экономической политики в исследованиях зарубежных и российских авторов // Анализ, моделирование и прогнозирование экономических процессов: материалы II Международной научно-практической Интернет-конференции, 15 декабря 2010 г. – 15 февраля 2011 г. / под ред. Л.Ю. Богачковой, В.В. Давниса; Волгоград. гос. ун-т, Воронеж. гос. ун-т. – Воронеж : Изд-во ЦНТИ, 2010.

8. Роберт Солоу // Галерея экономистов Economicus.ru [Электронный ресурс]. – 2012. – Режим доступа : http://gallery.economicus.ru/cgi-bin/frame_rightn_newlife.pl?type=in&links=../in/solow/biogr/solow_b1.txt&img=brief.gif&name=solow – Дата доступа : 10.11.2012.

Теория общественного выбора

Шипилова К.

Идейный фундамент теории общественного выбора

Теория общественного выбора представляет собой одно из наиболее ярких направлений экономического империализма, связанное с применением методологии неоклассической экономической теории для изучения политических процессов и феноменов. Зародившись в 1960-х годах как отрасль экономической науки, изучающая вопросы налогообложения и государственных расходов, теория общественного выбора в последующие десятилетия значительно расширила сферу своего анализа и в настоящее время может рассматриваться в качестве дисциплины, по праву претендующей на статус экономической теории политики.

В 1940-50-х годах представления о рациональном характере поведения индивидов в политической сфере стали активно проникать в научные дискуссии, благодаря опубликованным в этот период работам Й. Шумпетера, К. Эрроу, Д. Блэка, Э. Даунса. Объединение двух указанных направлений стало основой разработки комплекса идей, известных ныне как теория общественного выбора. Ключевую роль в этом сыграли представители так называемой Вирджинской школы (Дж. Бреннан, У. Нисканен, М. Олсон, Г. Таллок, Р. Толлисон) в экономической теории. Признанным лидером этой школы является Дж. Бьюкенен, награжденный в 1986 г. Нобелевской премией по экономике за исследование договорных и конституционных основ теории принятия экономических и политических решений.

Иногда теорию общественного выбора называют «новой политической экономией», так как она изучает политический механизм формирования

макроэкономических решений. Критикуя кейнсианцев, представители этой теории поставили под сомнение эффективность государственного вмешательства в экономику. Последовательно используя принципы классического либерализма и методы микроэкономического анализа, они сделали объектом анализа не влияние кредитно-денежных и финансовых мер на экономику, а сам процесс принятия правительственных решений.

Позиция вирджинской школы заключается в том, что она негативно относится к государственному вмешательству в экономическую жизнь. Вместе с тем она не считает, что рынок способен выполнять роль эффективного регулятора. Рынок работает плохо, но это не значит, что государство будет работать лучше.

Предмет исследования – анализ особенностей нерыночных процессов выявления и согласования предпочтений с помощью политического механизма. Цель исследования – объяснить экономические аспекты политических процессов, сравнить эффективность рыночного и государственного механизма принятия решений.

Теория общественного выбора – это теория, изучающая различные способы и методы, посредством которых люди используют правительственные учреждения в своих собственных интересах.

Основные методологические предпосылки: методологический индивидуализм, концепция «экономического человека», анализ политики как процесса обмена.

В условиях ограниченности ресурсов каждый из нас стоит перед выбором одной из имеющихся альтернатив. Методы анализа рыночного поведения универсальны. Они с успехом могут быть применены к любой из сфер, где человек должен сделать выбор.

методологический индивидуализм: люди действуют в политической сфере, преследуя свои личные интересы и нет грани между бизнесом и политикой. Теория общественного выбора – это теория, изучающая различные способы и методы, посредством которых люди используют правительственные учреждения в своих интересах.

концепция "экономического человека". Человек в рыночной экономике отождествляет свои представления с товаром. Он стремится принять такие решения, которые максимизируют значение функции полезности. Его поведение рационально. Рациональность индивида имеет в данной теории универсальное значение. Это означает, что все – от избирателей до президента, руководствуются в своей деятельности в первую очередь экономическим принципом, т.е. сравнивают предельные выгоды и предельные издержки: $MB > MC$,

где MB – предельные выгоды (marginal benefit);

MC – предельные издержки (marginal cost).

анализ политики как процесса обмена. Если на рынке люди меняют яблоки на апельсины, то в политике платят налоги в обмен на общественные блага. Этот

обмен не очень рационален. Обычно налогоплательщики одни, а блага за счёт налогов получают другие.

Трактовка политики как процесса обмена восходит к диссертации шведского экономиста Кнута Викселя "Исследования по теории финансов" (1896). Основное различие между экономическими и политическими рынками он видел в условиях проявления интересов людей. Эта идея легла в основу работ американского экономиста Дж. Бьюкенена.

Сторонники этой теории рассматривают политический рынок по аналогии с товарным. Государство - это арена конкуренции людей за влияние на принятие решений, за доступ к распределению ресурсов, за места на иерархической лестнице. Но государство - это рынок особого рода. Его участники имеют необычные права собственности: избиратели могут выбирать представителей в высшие органы государства, депутаты - принимать законы, чиновники - следить за их исполнением. Избиратели и политики трактуются как индивиды, обменивающиеся голосами и предвыборными обещаниями. Вместе с тем они доказывают, что рынок не способен выполнить роль эффективного регулятора. Рынок "работает" плохо, но это не означает, что государство будет "работать" лучше.

В теории общественного выбора показывается: как конкуренция политиков за голоса избирателей приводит к усилению вмешательства государства в экономику; как через государственные программы происходит перераспределение дохода от разных слоев населения в пользу средних классов; как небольшие, но тесно сплоченные политические группы могут брать верх над широким, но рассеянным политическим большинством.

В силу этого Дж. Бьюкенен и его сторонники считают, что следует найти инструменты, которые бы увязали практическую и правовую деятельность с экономической теорией неоклассиков. Чтобы поддержать эффективность регулирования, нужно не вести речь о том, какие средства и подходы (денежно-кредитные или бюджетные) выглядят лучше, а кардинально совершенствовать сам механизм принятия решений на политическом уровне. Задача заключается в том, чтобы сформировать новую систему выработки политических решений, подобную тому, как осуществляется выбор решений на товарно-денежном рынке.

По мнению Дж. Бьюкенена, применяя модель экономического поведения к анализу политики, необходимо учитывать разницу в мотивах поведения, а главное - "неодинаковую структуру" рыночной и политической систем. В основе теории общественного выбора лежит применение экономического подхода к анализу политических процессов. Политические решения - это выбор альтернативных вариантов. Именно в этом сходство политики с обычным рынком, хотя есть и некоторые особенности. Если на рынке люди меняют яблоки на апельсины, то в политике они платят налоги в обмен на общественные блага. Такой обмен не рационален, ведь чаще всего налоги платят одни, а блага за счет налогов получают другие.

На политическом рынке вместо принципа "один доллар - один голос" действует принцип "один человек - один голос". Именно с этим теоретики общественного выбора связывают высокую вероятность появления в сфере политики результатов, не оптимальных с точки зрения общества. В политическом процессе граждане не могут руководствоваться обычными правилами торговли, поскольку потребителем общественных благ является не отдельный человек, а общество в целом. Тем не менее, убеждает Дж. Бьюкенен, в политике существует аналог свободной торговли. Это договоренность между людьми, свойственная любому виду обмена. Единодушие, достигнутое участниками коллективного выбора в политике, аналогично добровольному обмену индивидуальными товарами на рынке.

Теоретики общественного выбора предлагают новую концепцию организации "политического рынка": так реформировать политические процедуры и правила, чтобы они способствовали достижению всеобщего согласия. В рамках "политического обмена" выделяются два уровня общественного выбора.

Первый уровень - разработка правил и процедур политической игры. Например, правил, регламентирующих способы финансирования бюджета и одобрения государственных законов, а также системы налогообложения. Среди них могут быть разные правила - единодушие, квалифицированного большинства, простого большинства и др. Это позволит находить согласованные решения. Совокупность предлагаемых правил, норм поведения и процедур Дж. Бьюкенен называет "конституцией экономического поведения". Такой конституционный договор 1 должен сделать некоторые вещи не достижимыми для политиков, борющихся на выборах: они не должны иметь возможность контролировать денежную массу. Конституция должна сделать обязательным поддержание сбалансированного бюджета, а ее форма - быть единогласно одобрена теми, кто обязан ей подчиняться, поскольку в противном случае они не свободны.

Второй уровень - практическая деятельность государства и его органов на основе принятых правил и процедур. В силу всего этого критерием справедливости и эффективности политической системы должно стать распространение правил экономической игры на политический процесс. Сторонники теории общественного выбора полагают, что государство должно выполнять защитные функции и не брать на себя функций участия в производственной деятельности. Они предлагают в качестве главного в деятельности государства принцип защиты порядка без вмешательства в экономику. По их мнению, блага общественного пользования целесообразно превратить в товары и услуги, продающиеся на рынке. Людям и фирмам следует заключать соглашения и реализовать контракты на взаимовыгодных условиях, без регламентации со стороны государства. В свою очередь, выбор политических правил, предупреждает Дж. Бьюкенен, не должен выходить за рамки реальности.

Ученый указывает на довольно распространенную среди экономистов ошибку, которая искажает правильное понимание функции государства. Они

полагают, что государство устанавливает "правила игры". Дж. Бьюкенен убеждает: государство не изменяет и не устанавливает правил, а лишь констатирует их соблюдение или несоблюдение, накладывая только те санкции, которые заблаговременно утверждены в рамках конституционного договора. Иначе говоря, само государство санкций не создает, а только выносит решения об их применении. И в этом смысле "модель рефери" достаточно уместна.

Таким образом, теорию общественного выбора можно определить как экономический анализ процессов принятия нерыночных решений или как применение экономической теории в политологии. Следовательно, эта теория имеет тот же предмет, что и политология, а именно - теория государства, поведение избирателя, правила голосования, партийная политика, бюрократия. При этом исследование проводится на базе методологии экономической теории. Основной поведенческой предпосылкой теории общественного выбора, как и экономической теории в целом, является идея, согласно которой человек - независимо от того, в какой роли он выступает (как избиратель, политик или бюрократ), - действует как рациональный эгоист, максимизирующий полезность.

Поведение избирателя

В теории общественного выбора широко используется микроэкономический анализ для объяснения процесса принятия политических решений. Так, современный американский представитель этого направления Э. Даунс в своей работе "Экономическая теория демократии" исследует поведение рационального избирателя и предлагает следующую формулу:

$$E(U_A t+1) - E(U_B t+1),$$

где $t+1$ – период времени между прошедшими и настоящими выборами

A – партия у власти

B – оппозиция

U – полезность от действия правительства за период $t+1$

E – ожидаемая ценность.

При этом если в результате получается положительное число, избиратель голосует за партию A , если отрицательное – за оппозицию, если ноль – избиратель воздерживается от голосования, но, будучи рациональным субъектом, оценивает деятельность того правительства, которое находится у власти за истекший период t еще и по формуле:

$$U_{it} / U_{at}$$

где U_{it} – максимально возможная полезность, идеальная (i -ideal), которую можно было бы получить за истекший период t

U_{at} – полезность, реально полученная (a -actual) за истекший период t .

При хорошем рейтинге избиратель все-таки проголосует за партию находящуюся у власти, при плохом – против.

Говоря о выборах или каких-либо иных политических действиях индивидов, необходимо отметить возможность рационального игнорирования этих действий индивидами.

Рассмотрим случай голосования по какому-либо вопросу, имеющему для конкретного человека меньшее значение, чем, к примеру, назначенная на это время деловая встреча. Предположим, что человек видит, что его голос на выборах не буде иметь большого веса, т.к. в обществе подавляющее большинство придерживается другой точки зрения (это может быть обусловлено данными опросов общественного мнения в СМИ, или же явно выраженных настроениях в обществе, или же опытом предыдущих голосований по данному вопросу). Кроме того, сама сущность и содержание вынесенного на голосование вопроса не является для данного человека жизненно важной (вопрос имеет крайне малое отношение к повседневной жизни индивида или же не имеет таковой вообще). С другой стороны этот человек видит, что отмена деловой встречи может повлечь за собой какие-либо издержки (например, он не сможет заключить договор и, следовательно, не получит возможной прибыли от этого договора). Обдумав сложившуюся ситуацию с рациональной точки зрения, наш "экономический человек" не пойдет на выборы, т.к. его насущные проблемы ему ближе, и ему выгоднее пойти на деловую встречу. В случае же когда обсуждаемый вопрос не имеет никакого отношения к жизни голосующего, то ему будет выгоднее даже просто отдыхать дома, чем пойти на голосование.

Рассмотрим еще один пример. Предположим, что в момент голосования лицо находится в другом городе и не имеет возможности взять открепительный талон. В этой ситуации ему надо ехать на свой избирательный участок, платить собственные деньги за билет, брать свободные дни на работе, если дорога очень далекая и т.д. В этом случае, при обдумывании вопроса "голосовать, или не голосовать?", т.е. при сравнении своих затрат и выгод от данного процесса, индивид скорее всего откажется от голосования.

Во всех приведенных примерах, индивиды взвешивают свои выгоды и издержки от посещения избирательного участка, и если издержки выше, то человек на голосование не пойдет. Мы сталкиваемся со случаем рационального игнорирования. Причем игнорироваться может не только голосование, но и такое политическое действие, как снятие должностного лица с должности вследствие нарушения этим лицом его прав или невыполнения обязанностей, если эта процедура сильно затруднена. Быть рационально проигнорированными могут быть и многие другие действия.

Обобщая все выше указанное, можно сказать, что существует некий эффект порога – это минимальное значение пользы, которое необходимо превысить, что бы избиратель участвовал в политическом процессе. Если оно ниже определенной величины, то избиратель старается избежать исполнения своего гражданского долга, становясь человеком, для которого рациональнее проигнорировать политический процесс.

Поведение политика

Помимо голосования существуют другие каналы выражения политической воли. Люди, заинтересованные в конкретном политическом решении, могут заняться лоббированием. То есть, посредством каких-либо факторов, влиять на решения избранного во власть лица, заниматься пропагандой каких-либо политических решений.

Теория общественного выбора рассматривает процесс принятия решений как разновидность рыночной сделки, или торга: "Вы мне обеспечиваете голоса на выборах – я вам обеспечиваю проведение в жизнь конкретных правительственных программ, удовлетворяющих ваши интересы". Лоббисты ищут не что иное, как политическую ренту (осуществляют "погоню за политической рентой"). Политическая рента – это получение экономической ренты через политические институты, или, иначе выражаясь, путем политического прогресса.

Как и любая деятельность, лоббизм имеет свою альтернативную стоимость. Во-первых, избиратели должны иметь некую информацию о предстоящих выборах и определить круг насущных проблем, по которым требуется решение правительства. Здесь стоит отметить, что информация имеет альтернативную стоимость, выраженную деньгами, временем, или их объединением. Во-вторых, избиратели должны поддерживать связь со своими избранниками. Письма, телеграммы, объявления в газетах, использование профессиональных "лобби" в столице так же стоят денег и времени. Мало кто из избирателей чувствует столь великую заинтересованность в определенном решении какого-либо вопроса, что считает ее адекватной усилиям, затраченным на хотя бы одно письмо тому, за кого он голосовал.

Однако определенные группы людей с взаимными и значительными интересами находятся в несколько иной ситуации. Они могут разделить грядущие затраты на обмен информацией, изложение своих взглядов выборным представителям; они могут нанимать профессиональных "лобби" на полный рабочий день. В результате, их влияние на правительственные органы может быть в несколько раз сильнее по сравнению с тем, кто действует в одиночку.

Непропорциональная их размерам сила небольших хорошо организованных групп иногда работает на руку другим объединениям, которые преследуют свои цели, считая их непременно полезными для всех граждан. Это вполне применимо к кругу лиц, одержимых поисками ренты, которые имеют своей главной целью лишь получение узких интересов получения личной выгоды. Порой интересы определенного круга лиц настолько важны для них же, что простым собранием они готовы принять решение о выдвижение своего кандидата в депутата и дальнейшего его продвижения. Возможности узкого круга лиц в продвижении "своего человека" сильны, поскольку подкреплены как личными интересами, так и интересами предприятия в целом.

Как отмечалось раньше, в большинстве своем избиратели голосуют не часто, и политические проблемы в перерывах между кампаниями занимают не много места. Наоборот, члены думы, правительства и т.д. ежедневно встречаются и обмениваются мнениями, а так же голосуют по сотням вопросов. Это дает им возможность заниматься "обменом и торговлей" голосами или логроллингом.

Смысл торговли голосами весьма прост. Каждый участник власти выбирает несколько вопросов, которые, по его мнению, важны для его избирателей. В обмен на голосование "ЗА" по этим пунктам повестки дня этот политик обязуется оказать поддержку тем, кто согласиться на это предложение.

Практика логроллинга, в конечном счете, ведет к принятию определенных программ. Такие программы создают возможности поиска ренты для очень ограниченного круга лиц, перекладывая затраты по осуществлению программ на широкие массы налогоплательщиков или потребителей. Это означает, что практика логроллинга выдвигает на первый план местные интересы за счет общенациональных, поскольку локальные вопросы воздействуют на избирателей больше всего. Таким образом, складывается ситуация, в которой избранному представителю законодательной власти имеет смысл "продать" свой голос по важным, общенациональным вопросам – бюджетному дефициту, назначению Верховного Суда, заключении внешнеполитических союзов и соглашений – чтобы заручиться поддержкой других представителей по таким узким локальным вопросам, как конкретный военный заказ или протекционистский тариф, которые выгодны его избирателям.

Один из вариантов продажи голосов – это бочонок с салом, - своеобразное "общественное корыто". Так называются законы, состоящие из серии небольших локальных проектов, которые выгодны населению какого-либо региона, но осуществляются за счет бюджета всех налогоплательщиков. Политические предприниматели в процессе длительной работы добавляют "сала" в этот "бочонок", до тех пор, пока не наступает уверенность, что необходимое большинство голосов набрано. Тогда на рассмотрение выдвигается целый пакет предложений, как единый закон. Этот законопроект принимается, хотя ни одна из его частей в отдельности не получила бы большинства голосов и не прошла бы тестирование, исходя из анализа затрат и результатов.

Функция логроллинга заключается в выражении интересов сильно заинтересованного меньшинства, при безразличии или легкой оппозиции большинства. Ведь в практике логроллинга, наряду с "бочонком сала" или поиском налоговых лазеек и льгот, решаются такие вопросы, как гражданские права национальных и расовых меньшинств, свобода совести и религиозных отправления, и т.д.

Избранные в законодательные органы представители имеют свои собственные интересы, которые не обязательно и не всегда совпадают с интересами поддерживающих их избирателей. Для политического деятеля его переизбрание на новый срок – событие высочайшего приоритета, - хочет ли конкретный народный

избранник отстаивать интересы своих избирателей, бороться за воплощение тех или иных проектов, получить власть и престиж или просто не беспокоиться о поиске новой работы.

Но для того, чтобы быть переизбранным на новый срок, надо потратить много денег. Поэтому политический деятель должен стать и политическим предпринимателем: ему необходимо искать источники финансирования предвыборной кампании. Лоббисты, ищущие ренты для определенных узких кругов, - это один из богатейших источников финансовой поддержки кандидатов на выборные должности. Хотя мало кто из членов конгресса в открытую продает свои голоса, у них всегда находится время на изложение своей позиции и на сбор пожертвований в узком графике работы. Часто сторона, располагающая достаточным количеством времени для декларации своей позиции наиболее полным образом, оказываются в выигрыше.

Поведение бюрократии

До настоящего момента наше внимание к теории общественного выбора было сконцентрировано на выборе, который делали избиратели и избранные ими представители. Однако реальная практическая деятельность правительства на всех уровнях выполняется множеством правительственных органов: департаментов, агентств, учреждений, которые в совокупности хорошо известны нам как бюрократия.

Государственные учреждения имеют очевидные сходства и различия с частными фирмами. Но, несмотря на ряд определенных сходств они далеко не полностью эквивалентны частным фирмам. Во многих аспектах своей деятельности они способны воспользоваться преимуществами иерархической формы организации предприятия в еще меньшей степени, чем частные фирмы, и в то же самое время более подвержены недостаткам, присущим этой форме организации предприятия. Причины этого явления кроются в трех основных пунктах: контроль, конкуренция и личные интересы бюрократии.

Но кто проверяет проверяющих? В любой иерархической структуре деятельность подчиненных контролируется на всех уровнях, дабы убедиться в добросовестном исполнении их служебных обязанностей. Но как обстоит дело на примере государственных учреждений? В государственном учреждении наиболее близким аналогом совета директоров являются его выборные законодательные органы. Ведь одно из основных занятий законодателей - наблюдать за деятельностью государственных учреждений и совместно с представителями исполнительных властей назначать их высшее руководство. Однако, не отрицая несовершенства инструментов контроля над деятельностью корпорации, отмечу, что контроль за функционированием государственных учреждений со стороны избирателей поставлен еще хуже.

В дополнение к различиям между способами связи частных и государственных предприятий со своими владельцами и избирателями, имеют место дополнительные отличия в способах их связи со своими потребителями. В качестве наглядного примера рассмотрим разницу в процедурах при оформлении водительских прав и вкладов в банк. Обе эти операции требуют двух-трех минут у обслуживающего вас клерка, однако оформление или перерегистрация водительского удостоверения иногда затягивается. Если вы обращаетесь по этому вопросу лично, то быстро убеждаетесь, что офицеров, ведающих оформлением дел, значительно меньше, чем того хотелось бы; что очередь здесь в несколько раз длиннее, чем в банке; что служащие меньше заняты своими служебными обязанностями, чем надо и т.д. Ничего подобного круглосуточному банковскому автомату в этом деле просто не существует.

Одно из наиболее частых упоминаний личных выгод руководителей частных государственных учреждений – это расширение подведомственных им организаций. Заработная плата, размеры кабинетов и контор, поездки, командировки и путешествия, престиж, возможности продвижения вверх по служебной лестнице – все это возрастает для руководства учреждения по мере его расширения. Естественно, директора государственных учреждений активно взаимодействуют с конгрессом и его администрацией, любыми путями добиваясь увеличения бюджетов и прав своей организации. Трудновато встретить государственное учреждение, руководство которого согласилось бы с мыслью, что кто-то другой в структуре государства может выполнять их функции лучше. В практике неизвестны случаи, когда государственные учреждения возвращали бы в казну неиспользованные фонды – ведь всегда можно найти, на что потратить деньги: новая мебель, поездка на конференцию и подобные милые вещи.

Другой аспект личных интересов бюрократов проистекает из-за несложного эффекта вращающихся дверей. Этот эффект подразумевает циклическую ротацию руководителей частных фирм в родственные им государственные организации и обратно. Скорость вращения дверей очень быстро растет, так как руководители в промышленных сферах зачастую получаю в 5-10 раз больше, чем равные им по рангу администраторы в государственном секторе. Таким образом, служба в государственном секторе может рассматриваться лишь как вложение в человеческий капитал, которое может быть возвращено только тогда, когда его обладатель поменяет государственную службу на работу в частной фирме. Эффект вращающихся дверей создает явные симпатии у многих государственных служащих к тем отраслям промышленности, которые они курируют.

Некоторые экономисты утверждают, что общественный сектор по своей природе менее эффективен, чем частный. И дело не в том, что в государственный сектор попадают ленивые и некомпетентные работники, тогда как целеустремленные и способные тяготеют к частному. Дело скорее в том, что рыночная система создает стимулы к повышению эффективности, чего нет в государственном секторе. Точнее говоря, у менеджеров частных предприятий есть

личный сильный стимул, чтобы эффективно работать, - увеличение дохода. Независимо от того, работает ли частная фирма в условиях конкуренции или монополии, уменьшение издержек благодаря эффективному управлению способствует увеличению прибыли. Глава же государственного ведомства или его управляющий, который добивается эффективности в своей епархии, не получает ощутимой личной выгоды, то есть части прибыли. В рыночной системе заложен четкий критерий эффективности функционирования частной фирмы – прибыли и убытки. Эффективная фирма рентабельна, поэтому она преуспевает и развивается. Неэффективное предприятие нерентабельно и не преуспевает, оно деградирует, терпит банкротство и перестает существовать. Но как можно определить эффективно ли работает энергетическое управление, пожарная команда, Министерство сельского хозяйства? В частном секторе неэффективность и материальные потери ведут к прекращению производства определенных видов товаров и услуг. Но государство не склонно отказываться от той деятельности, в которой оно потерпело неудачу. Обычно реакцией правительства на неудачу является удвоение ассигнований и штатов. Это означает, что неэффективность государственного сектора может воспроизводиться в большем масштабе. Критики указывают на тенденцию государственных ведомств продолжать поддерживать свою занятость тем, что отыскивают новые проблемы, которые требуют решения. Неудивительно поэтому, что социальные проблемы в том виде, как их описывает правительство, имеют тенденцию не только существовать, но и явно разрастаться.

В каждом из рассмотренных случаев достижение бюрократами личной выгоды ведет к тому, что их действия приходят в противоречие с общественными интересами. Конечно, это не означает, что все как на подбор официальные лица никогда не принимают решений в интересах всех граждан. Многие из них, руководствуясь чувствами своего профессионализма и гордости, делают то, что, как они полагают, необходимо для общества; хотя иногда с точки зрения их выгоды нужно было действовать противоположно. Но теоретики общественного выбора предупреждают, что профессионализм и гордость возобладают у бюрократов далеко не всегда. Мотивы извлечения личной выгоды – это ветер, дующий в постоянном направлении, под действием которого всегда дрейфует принятие тех или иных бюрократических решений.

ЛИТЕРАТУРА

1. История экономических учений/Под ред. В. Автономова, О. Ананьина, Н. Макашевой: Учеб. пособие. – М.: ИНФРА-М, 2003. – 784с. – (Серия “Высшее образование”).
2. Долан Э. Дж., Линдсей Д. Микроэкономика/Пер. с англ. В. Лукашевича и др.; Под общ. ред. Б. Лисовика и В. Лукашевича. С.-Пб., 2005 448 стр
3. Макконнелл К.Р., Брю С.Л. Экономикс: Принципы, проблемы и политика. В 2 т.: Пер. с англ. 11-го изд. Т.1 – М.: Республика, 2006 – 400 с.
4. Нобелевские лауреаты по экономике. Джеймс Бьюкенен. М.: Таурус Альфа, 2005
5. Нуреев Р.М. Курс микроэкономики: Учебник для вузов. – 2-е изд., изм. – М.: Издательство НОРМА (Издательская группа НОРМА-ИНФРА М), 2004. – 527 с.

6. Олсон М. Логика коллективных действий. М.: Фонд экономической инициативы, 2006.

7. Отмахов П.А. Вирджинская школа в американской политической экономии//Проблемы американистики. Вып. 8: Консерватизм в США: прошлое и настоящее. М.: Издательство МГУ, 2003. С. 325-340.

8. Политическая рента в рыночной и переходной экономике. М.: ИМЭМО, 2005.

Разработка, развитие и практическая значимость моделей макроэкономического равновесия

Ременчук Е.

Модели макроэкономического равновесия классиков и Дж. М. Кейнса

В классической и неоклассической модели экономического равновесия рассматривается, прежде всего, взаимосвязь сбережений и инвестиций на макроуровне. Прирост доходов стимулирует увеличение сбережений; превращение сбережений в инвестиции увеличивает объемы производства и занятости. В итоге вновь увеличиваются доходы, сбережения и инвестиции. Соответствие между совокупным спросом (AD) и совокупным предложением (AS) обеспечивается через гибкие цены и механизм свободного ценообразования.

Согласно классической теории, на каждом рынке имеется одна ключевая переменная (цена, процент, заработная плата), обеспечивающая равновесие рынка. Через спрос и предложение инвестиций определяется норма процента. На денежном рынке в качестве определяющей переменной выступает уровень цен. Соответствие между спросом и предложением на рынке труда регулирует величина реальной заработной платы.

Классики не видели особой проблемы в превращении сбережений домохозяйств в инвестиционные расходы фирмы. Если часть доходов откладывается в виде сбережений, значит, она потребляется. Но, чтобы потребление росло, сбережения не должны лежать без движения, они должны трансформироваться в инвестиции. Без этого замедляется рост валового продукта, а, значит, снижаются доходы и спрос.

Кейнс же, в отличие от классиков, обосновал положение, согласно которому сбережения являются функцией не процента, а дохода. Цены, включая заработную плату, не гибкие, а фиксированные; точку равновесия AD и AS характеризует эффективный спрос. Рынок товаров становится ключевым. Уравновешивание спроса и предложения происходит не в результате повышения или понижения цен, а вследствие изменения запасов.

Кривая спроса AD – количество товаров и услуг, которые способны приобрести потребители при сложившемся уровне цен. Совокупный спрос изменяется под влиянием динамики цен. Чем выше уровень цен, тем меньший запас денег у потребителей и меньшее количество товаров и услуг, на которое

предъявляется платежеспособный спрос. Между размерами совокупного спроса и уровнем цен есть и обратная зависимость: рост спроса на деньги влечет за собой повышение процентной ставки.

Кривая совокупного предложения AS демонстрирует, какое количество товаров и услуг может быть произведено и представлено на рынке производителями при разных уровнях средних цен.

Пересечение кривых совокупного спроса и совокупного предложения в определенной точке отражает соответствие равновесной цены и равновесного объема производства. При нарушении равновесия рыночный механизм будет выравнивать совокупный спрос и совокупное предложение и сработает, прежде всего, ценовой механизм.

Модель Дж. Р. Хикса

Идея экономического равновесия всегда привлекала экономистов, для которых удобство и четкость изложения были основными достоинствами теоретических построений. Одним из наиболее ярких представителей этой группы экономистов является профессор Оксфордского университета Дж.Р. Хикс. Помимо работ по экономической теории, его перу принадлежат труды по международной торговле и английской налоговой системе.

Экономические взгляды Хикса представляют собой весьма утонченный вариант современных концепций полезности и экономического равновесия. Хикс успешно владел математическими приемами анализа, в то же время он нередко исследовал вопросы экономической политики. Ему не свойственен «рикардианский грех», так как его теория никак не похожа на свод экономических предписаний. Хикс довольно серьезно относился к своей теории и ждал того же от своих читателей. Но его работы изложены на весьма сложном языке и так строго подчинены логической последовательности, что их понимание нередко затруднено. Хикс как бы говорит читателям: вы должны взять мою теорию такой, какова она есть, или оставить ее.

Модель IS-LM впервые была предложена Хиксом в 1937 г. в качестве интерпретации сути макроэкономической концепции Дж. М. Кейнса и поэтому является, своего рода, конкретизацией модели AD-AS. Модели классиков и Кейнса (рассмотренные ранее) анализируют ситуацию на товарных рынках без учета денежного рынка, на котором ставка процента является эндогенной величиной и устанавливается независимо от равновесия на товарном рынке.

Товарный и денежный рынки связаны между собой. Совокупный спрос формируется под влиянием потребления, инвестиций, государственного расхода и чистого экспорта. Эти факторы формируют рынок благ. Но совокупный спрос находится и под влиянием денежных факторов. Хикс определил, что без денежной составляющей невозможно понять закономерности функционирования рынка благ.

Таким образом, основной целью анализа экономики с помощью модели IS-LM является объединение товарного и денежного рынка в единую систему, другими словами, необходимо найти такое сочетание рыночной ставки процента и дохода, при котором одновременно достигается равновесие и на товарном рынке, и на денежном.

Представлена данная модель была в журнале «Эконометрика» в статье «Господин Кейнс и «классики» попытка интерпретации». От классической модели она отличается тем, что, во-первых, вводится в рассмотрение предпочтение ликвидности и, во-вторых, масштабы сбережений определяются лишь размерами дохода. Модель Хикса в некоторых случаях достигала те логические связи, которые не были развиты у Кейнса в явной форме. В письме Хиксу Кейнс сообщил, что нашел его статью интересной и что у него «по существу нет каких-либо критических замечаний».

Предпосылки модели

Модель IS-LM представляет собой модель совместного равновесия товарного и денежного рынков.

Она является моделью кейнсианского типа, описывает экономику в краткосрочном периоде и служит основой современной теории совокупного спроса. В модели IS-LM товарный и денежный рынок представлены как сектора единой макроэкономической системы.

Под товарным рынком подразумеваются не только рынки потребительских товаров и услуг, но и рынок инвестиционных товаров. Если спрос на потребительские товары связан в первую очередь с доходом, то на инвестиционные товары – с процентной ставкой.

Спрос на инвестиции (предприниматели) и предложение инвестиций (население) являются двумя составляющими макроэкономического равновесия товарного рынка. В общем случае они не совпадают, поэтому макроэкономическое равновесие товарного рынка очень неустойчиво. Факторами, влияющими на равновесия могут быть: доход домохозяйств, уровень цен, инфляционные ожидания и ожидания роста доходов, величина задолженности, налоговые ставки, величина процентной ставки.

Денежный рынок – это механизм купли-продажи краткосрочных кредитных инструментов, например, векселей и коммерческих бумаг.

Модель IS-LM содержит несколько уравнений:

1. Основное макроэкономическое тождество

$$Y = C + I + G + X_n$$

2. Функция потребления

$$C = a + b(Y - T), \text{ где } T = T_a + tY.$$

3. Функция инвестиций

$$I = e - di$$

4. Функция чистого экспорта

$$X_n = g - m' \cdot Y - n \cdot i$$

5. Функция спроса на деньги

$$\frac{M}{P} = k \cdot Y - h \cdot i$$

Модель IS-LM сохраняет все предпосылки простой кейнсианской модели: о неизменности уровня цен, совершенной эластичности совокупного предложения, равенстве совокупного выпуска совокупному доходу.

Экзогенными переменными модели, задаваемыми в нее извне, являются государственные закупки товаров и услуг (G), предложение денег (M), налоговая ставка (t).

Эндогенными переменными, определяемыми внутри модели, выступают доход (Y), потребление (C), инвестиции (I), чистый экспорт (Xn).

Исключение составляет предпосылка о постоянстве ставки процента. Если в кейнсианской модели ставка процента фиксирована и выступает экзогенной переменной, то в модели IS-LM она эндогенна и формируется внутри модели; ее уровень меняется и определяется изменением ситуации равновесия на денежном рынке.

Таким образом, можно сделать следующий вывод. Денежный и товарный рынки находятся в процессе постоянного взаимодействия. Изменения на одном рынке отражаются на другом. И это происходит постоянно, за исключением случая ликвидной ловушки. Процесс взаимодействия этих рынков и показывает модель IS-LM.

Кривая IS (равновесие на товарном рынке)

Кривая IS выводится из простой кейнсианской модели (модели совокупных расходов, рассмотренной ранее), но отличается тем, что часть совокупных расходов и, прежде всего, инвестиционные расходы теперь зависят от ставки процента. Во всех точках кривой соблюдается равенство инвестиций и сбережений.

Так как инвестиции – это отрицательная функция процентной ставки, а потребление – положительная функция реального дохода, можно записать уравнение совокупного спроса следующим образом:

$$AD = C(Y) + I(i)$$

А предложение в соответствии с кейнсианской трактовкой имеет вид:

$$AS = C(Y) + S(Y)$$

Отсюда следует, что равновесное состояние на товарном рынке может иметь место только при соблюдении следующего равенства:

$$I(i) = S(Y)$$

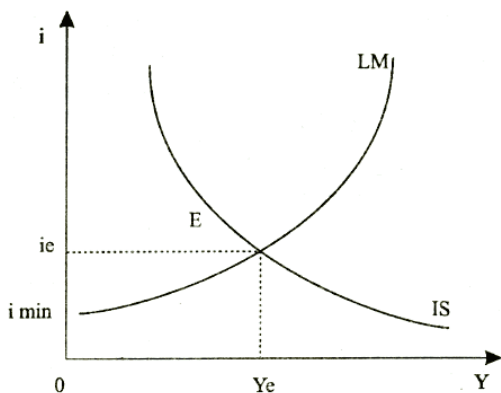
Все точки кривой IS – суть точки равенства сбережений и инвестиций при разных значениях процентной ставки и национального дохода. Таким образом, кривая IS отражает не функциональную зависимость между процентной ставкой и доходом, а множество равновесных ситуаций на товарном рынке, которые получаются в результате действия функции сбережения и функции инвестиций.

Кривая LM (равновесие на денежном рынке)

Рассмотрев модель равновесия на товарном рынке, можно теперь перейти к рынку денег. Так как спрос на деньги зависит от ставки процента, то существует кривая равновесия рынка – кривая LM, каждая точка которой представляет собой комбинацию величин дохода и ставки процента, представляющие собой равновесие на денежном рынке.

Кривая LM имеет специфическое строение: горизонтальную и вертикальную части. Горизонтальный участок отражает тот факт, что процентная ставка не может опуститься ниже минимального значения, а вертикальная часть кривой показывает, что за пределами максимального значения процентной ставки никто не будет держать сбережения в денежной форме, а обратит их в ценные бумаги. Сдвиг кривой LM будет иметь место при изменении предложения денег или изменении уровня цен.

Пересечение кривых IS и LM дает единственное значение величины ставки процента и уровня дохода, обеспечивающие одновременное равновесие на рынке товаров и денег.



Равновесие в модели IS — LM

Широкое применение модель IS-LM получила после выхода книги А.Хансена «Монетарная теория и фискальная политика» в 1949 г., тогда она получила второе свое название – модель Хикса - Хансена.

В дальнейшем американский экономист Роберт А. Манделл (лауреат Нобелевской премии за 1999 г.) и английский экономист Д. Флеминг откорректировали модель IS-LM и разработали открытую модель IS-LM-BP. Где BP – график платежного баланса. Данная модель учитывала существенные изменения, произошедшие в экономике развитых стран в послевоенный период, в частности, усиление значения внешнеэкономических отношений и международной торговли, уменьшение безработицы и нарастание инфляционных процессов. Основными объектами модели IS-LM-BP является уже не только норма процента и внутреннее предложение денег, но и обменный курс национальной валюты. Таким образом, видоизмененная модель чутко реагирует на любые изменения внешнеэкономической конъюнктуры. Также она описывает зависимость бюджетной и денежно-кредитной политики от режима валютных курсов.

Воздействие кредитно-денежной и бюджетно-налоговой политики на уровень национального дохода

В качестве примера применения модели IS-LM можно рассмотреть влияние государственной политики на национальный доход.

Модель IS-LM широко используется экономистами для анализа влияния на национальный доход краткосрочных колебаний макроэкономической политики. Таким образом, рассмотрим основные направления ее использования в аналитических целях.

Начать следует с анализа макроэкономических последствий для экономики страны в краткосрочном периоде бюджетно-налоговой и денежно-кредитной политики.

Предположим, что правительство, проводя расширительную политику, увеличило государственные доходы на некоторую величину A . При этом кривая IS сдвинется вправо на величину, равную произведению A на простой мультипликатор расходов Дж. М. Кейнса ($1/(1-MPC)$). В этом случае равновесие экономической системы перемещается в новую точку – выше и правее первоначальной. Из этого следует, что имеет место рост как уровня дохода, так и ставки процента.

Немаловажным фактом является то, что рост дохода в ответ на стимулирующую бюджетную политику в модели IS-LM меньше, чем в модели «доходы-расходы», предложенной Кейнсом. Так получается потому, что, в отличие от модели Кейнса, в модели IS-LM инвестиционные расходы предполагаются непостоянными. В модели IS-LM рост дохода в результате увеличения государственных расходов предполагает увеличение спроса на деньги и соответствующий рост ставки процента, чтобы обеспечить равенство спроса и фиксированного предложения на деньги. Повышение ставки процента приведет к снижению инвестиционных расходов. Следует отметить, что это влияние роста ставок процента на инвестиции в связи с повышением государственных расходов

получило название «вытеснения»: увеличение государственных расходов вытесняет частные расходы, в том числе инвестиции. Таким образом, денежный рынок, в каком-то смысле, уменьшает мультипликационный эффект увеличения государственных расходов.

Теперь предположим, что правительство проводит расширительную денежно-кредитную политику «дешевых» цен, увеличивая предложение денег. В этом случае рост денежной массы в условиях неизменного уровня цен вызовет рост реального запаса денежных средств. Это, в свою очередь, при заданном уровне цен приведет к снижению ставки процента и сдвигу кривой вправо - вниз. В итоге, равновесие экономической системы перемещается в другую точку, находящуюся ниже и правее первоначальной. Это говорит о том, что рост предложения денег снижает равновесную ставку процента и увеличивает уровень дохода. Это происходит за счет стимулирования инвестиций и соответствующего расширения спроса на товары и услуги.

Стабилизационная политика в Республике Беларусь

В современных условиях растущей интернационализации хозяйственной жизни и ее глобализации система макроэкономических взаимосвязей значительно усложняется. Процессы, происходящие внутри национальной экономики, испытывают на себе мощное воздействие результатов внешнеэкономической деятельности. В то же время экономические показатели, характеризующие состояние внешнего сектора, находятся под влиянием внутренних макроэкономических процессов. Все это делает более сложным формирование и проведение макроэкономической политики, различные направления которой должны быть скоординированы с учетом возрастающего числа факторов.

Проводя макроэкономическую политику, государство, прежде всего, стремится к достижению такого внутреннего равновесного состояния экономики, при котором обеспечивается полная занятость, темпы инфляции минимальны и поддерживаются стабильные темпы экономического роста. Вместе с этим, в современной открытой экономике проблема внешнего равновесия, то есть равновесного состояния платежного баланса, становится в один ряд с важнейшими внутренними макроэкономическими проблемами. Это обусловлено, с одной стороны, тем, что состояние платежного баланса в целом и отдельных его составных частей, а также динамика валютного курса имеют важное макроэкономическое значение. Они во многом определяют темпы внутренней инфляции, уровень процентных ставок, динамику инвестиций, состояние государственного бюджета, изменение конкурентоспособности страны на мировых рынках, размеры совокупного спроса и многие другие важнейшие характеристики национальной экономики. С другой стороны, в современных условиях от режима и динамики валютного курса, а также от степени международной мобильности

капитала в значительной мере зависят и выбор инструментов экономической политики, и ее эффективность.

В открытой экономике должно одновременно достигаться как внутреннее, так и внешнее равновесие. Внутреннее равновесие – баланс потребностей и ресурсов в форме соответствия совокупного спроса совокупному предложению, причем в условиях полной занятости и отсутствие инфляции. Внешнее равновесие связано со сбалансированным торговым и платежным балансом и заданным режимом валютного курса, что предполагает поддержание определенного уровня валютных резервов. Иначе говоря, к рынкам товаров и услуг, труда и капитала и ценных бумаг добавляется еще и валютный рынок.

Макроэкономический анализ функционирования рыночной экономики служит основанием для включения в число экономических функций государства проведение стабилизационной экономической политики, целями которой являются: поддержание общего экономического развития государства при полной занятости населения; устойчивый рост экономики; стабильный уровень цен; сбалансированный платежный баланс страны.

Под стабилизационной политикой государства понимается система экономических мероприятий правительства, направленных на сдерживание роста безработицы и инфляции, стимулирование экономического роста, обеспечение платежного баланса страны.

По набору используемых инструментов, как известно, данная политика делится на бюджетно-налоговую, денежно-кредитную и комбинированную. Бюджетно-налоговая политика сводится к воздействию на экономическую конъюнктуру с помощью манипулирования государственным бюджетом. Как правило, она сопровождается эффектом вытеснения (про него говорилось раньше), ведущим к перераспределению прав использования факторов производства от частного сектора к государству. Денежно-кредитной политикой называют регулирование экономической активности с помощью изменения количества находящихся в обращении денег.

Кроме бюджетно-налоговой и денежно-кредитной политики, для воздействия на экономическую конъюнктуру в открытой экономике правительство может использовать валютную политику. С ее помощью регулируется курс национальной валюты и условия перелива мирового капитала. В то же время в условиях фиксированного валютного курса центральный банк не может проводить самостоятельную денежно-кредитную политику. При плавающем же валютном курсе результативность бюджетно-налоговой политики тем ниже, чем мобильнее перелив капиталов между странами.

Необходимый для достижения двойного равновесия конкретный набор мероприятий стабилизационной политики предопределяется текущим состоянием экономической конъюнктуры. При этом используется столько разновидностей экономических политик, сколько целей предусматривается достичь.

Таким образом, в экономическом развитии государства важную роль играет стабилизационная политика, предполагающая мероприятия правительства, направленные на стимулирование или сдерживание роста национальной экономики с помощью налогов, государственных расходов, объема предложения денег и административного регулирования.

Беларусь располагает высокотехнологическими отраслями промышленности, имеет высококвалифицированные профессиональные кадры. Также она обладает хорошей сетью дорог, воздушных и железнодорожных сообщений с Восточной и Западной Европой. Расширяется другая инфраструктура, в том числе телекоммуникации.

Однако, несмотря на перечисленные выше благоприятные факторы по привлечению иностранных инвестиций, у инвесторов все еще нет полной уверенности в стабилизации макроэкономической ситуации. Существенный бюджетный дисбаланс, высокая инфляция и скрытая безработица, частично регулируемые цены, крайняя степень зависимости от внешних рынков (в первую очередь других стран СНГ) сырья и энергоносителей потенциальных инвесторов – все это является неблагоприятными факторами.

В нашей стране практически отсутствует банковское финансирование среднесрочных и долгосрочных проектов, недостаточно развиты финансовые институты и рынки.

Даже, несмотря на хорошую подготовку, белорусские рабочие и служащие имеют малый опыт непосредственного знакомства с западным предпринимательством, методами управления и практикой бухгалтерского учета.

Отсюда вытекает высокая необходимость разработки всесторонней и перспективной программы мер, нацеленной на привлечение столь необходимых иностранных прямых инвестиций.

Развитие включает в себя в качестве основного элемента достигнутый прогресс по ряду ключевых параметров уровня жизни людей. Центральное место при этом занимают образование, здравоохранение и распоряжение ресурсами. В Беларуси усиленно развиваются все эти элементы.

Стабилизация касается основных макроэкономических проблем, включая инфляцию, платежный баланс, задолженность, безработицу и колебания производства. Макроэкономическая политика имеет весьма важное значение, как при формировании рыночной экономики, так и при ее функционировании.

В тех же целях используется денежно-кредитная политика – понижая или повышая учетную ставку процента можно повышать интерес к дополнительным вложениям капитала или же сводить их на нет.

Таким образом, государство должно проводить в целях сглаживания циклических колебаний в период спада политику активизации всех хозяйственных процессов, а в период так называемого «перегрева» экономики стремится сдерживать деловую активность при помощи как бюджетно-налоговой, так и денежно-кредитной политики.

Соответственно и основными направлениями политики в условиях переходного периода Республики Беларусь являются налогово-бюджетная и денежно-кредитная политика, контроль над заработной платой и ценами, индексация.

При этом в условиях спада налогово-бюджетная политика направляется на повышение совокупного спроса путем наращивания государственных капитальных вложений, понижения налогов. Недостатком стимулирования совокупного спроса является опасность возникновения инфляционного спроса и ограниченная возможность маневрирования налогами и расходами вследствие большого бюджетного дефицита.

Основным же направлением денежно-кредитной политики остается удержание обменного курса белорусского рубля и его покупательской способности.

ЛИТЕРАТУРА

1. J.R. Hicks «Mr. Keynes and the «Classics»; Suggested Interpretation» / *Econometrica*, Volume 5, Issue 2 (Apr., 1937), 147-159
2. Агапова Т.А., Серегина С.Ф. Макроэкономика: Учебник М.: МГУ им. М.В. Ломоносова, Издательство «Дело и Сервис», 2004. – 448 с.
3. Долан Э., Линдсей Д. Макроэкономика. Спб.: Питер, 1999
4. История экономических учений. Учеб. пособие / под ред. В. Автономова и др.) – М.: Инфра-М, 2000.
5. Селигмен Б. Основные течения современной экономической мысли. – М.: Прогресс, 1968.
6. Шимов В.Н, Александрович Я.М, Богданович А.В. Национальная экономика Беларуси, Минск, БГЭУ, 2009; с. 256, 302.

Поведенческая экономика: теория ограниченной рациональности

Герберта Саймона

Моисеев М.

Общая характеристика процессов принятия решений

Начиная с самого начала своей деятельности Саймон обратил внимание на проблему процессов принятия решений, которые, как он считал, определяют суть менеджмента. Базируясь на сделанных опытах, Саймон выделял 3 главных этапа процесса принятия решений:

Поиск оснований, которые бы объясняли, почему принятие решения необходимо. На этом этапе руководитель, который решает какую бы то ни было проблему, производит, разведывательную деятельность, иными словами, полноценно взвешивает появившуюся задачу, определяет признаки данной проблематики, а также причины её возникновения.

Придумывание, вырабатывание и разбор потенциального направления деятельности. На этой ступени руководитель производит «проектную» деятельность, или подготавливается к принятию решения; такая процедура состоит

из: поиска альтернативных вариантов и анализа результатов, учитывая различные факторы, которые влияют на итог.

Избрание установленного направления деятельности. Здесь происходит прямой выбор альтернативы или принятие управленческого решения.

Безусловно, что все отмеченные фазы структурированы. «Разведывательная» деятельность проходит перед подготовкой решения, а подготовка решения, в свой черед, идет перед выбором альтернативы. В действительности, порядок этих этапов может оказаться более сложным. Причина в том, что у каждой из стадий есть возможность рассматриваться более детально и тогда процесс принятия решения будет включать несколько более мелких шажков. К примеру, на первом этапе руководитель обязан принять решения о выборе существенной информации, которая имеет связь с постановочной проблемой и о настоящих основаниях появления такой проблемы. На второй фазе определяются решения касательно допустимости: выбор различных вариаций действий, о важнейших факторах внутренней и внешней среды организации, которые влияют на результаты решений. Третья стадия, характеризуется, необходимостью принимать решения о процессе принятия самого решения и лишь, потом переключаться на сравнение и выбор альтернатив. Мало того, процесс принятия решений предусматривает и возврат к более ранним этапам, то есть повтор, принимая во внимание уже полученные результаты. И, конечно же, нужно осознавать человеческую натуру и принимать тот факт, что она редко принимает решения обдуманно и поэтапно. Такая нерациональность влечет перескок от одной стадии к другой. Следовательно, принятие решений — это циклический, колебательный и нелинейный процесс, который трудно представить в виде строгой последовательности циклов, которые бы четко разделялись друг с другом.

Однако, выбор альтернативного варианта, не является конечным этапом в процессе принятия решения. Я думаю мало, кто не согласится с предположением о том, что всякое решение стоит чего-нибудь, только в случае успешности его реализации. Вследствие этого процесс принятия решения должен быть дополнен фазой реализации. Объяснить это, можно тем, что любые решения в пределах организации взаимозависимы. Каждое решение выдвигается в качестве средства исполнения прочего. Подчиненные, неминуемо столкнутся с новоиспеченными заданиями. Одним словом, каждое решение управленца создает новые решения, которые должны принять исполнители. Следовательно, принятию решений постоянно сопутствует деятельность всех сотрудников в организации. Поэтому всю деятельность фирмы можно представить в виде непрерывного процесса принятия решений, что послужило основанием для того, чтобы эта организация появилась. [7].

Согласно взглядам Герберта Саймона, люди, сталкиваясь с проблемой выбора в действительности, пытаются упростить реальность и использовать облегченную ее модель. Подобным упрощением, которое нередко производится, является расчленение последствий решений на 3 части:

- Такие последствия, которые преследуются или наоборот избегаются.
- Такие последствия, к каким индивиды, которые принимают решения, сравнительно безразличны; им всё равно: воплотится ли всё в жизнь.
- Те альтернативные результаты или вмененные издержки (внутренние издержки, затраты самого предпринимателя, которые связаны с реализацией им предпринимательской деятельности).

Необходимо подчеркнуть, что предоставленные последствия носят психологический характер.

В соответствии с положениями Саймона, также нужно употребить критерий эффективности управления — это ориентировочная формулировка критерия рациональности при принятии решений. Представление о том, какой выбор является эффективным, как и мнение о рациональности выбора, все время производится сравнительно с проводимыми в жизни ценностями. Поэтому при оценке эффективности, нужно быть в курсе, какие ценности будут максимизироваться. Перед тем как сравнивать итоги, необходимо установить совокупность ценностей, на основе которых будет произведена оценка. Обнаружение задач — самая тяжелая стадия в оценивании эффективности управления. Однако если организация решает две или более задач, встает вопрос о приоритетности. К сожалению, система оценивания при таком варианте сможет только отобразить результаты этих действий, но она не в состоянии дать ответ, по поводу предпочтительности какого-либо конкретного варианта.

Вторая и третья стадии оценки — установление того, какое количество результатов достигнуто и каким образом разные версии управленческих действий подействуют на это количество (величину). К завершающей стадии оценки эффективности или сравнению результатов по издержкам, можно начинать после выполнения предшествующих стадий. Оценка эффективности не может оказаться более аргументированной, чем процесс, определяющий задачи. Она не может быть правильнее, чем оценка итогов или оценка того, как управленческие действия отразились на итогах. Как считал Саймон, в целом мы имеем незначительные сведения об измерении уровня эффективности управления.

Также, Саймон полагает, что в ситуациях, где мы разбиваем средства и цели, можно определять эффективность как максимизацию достижений наших задач с помощью применения ограниченных нейтральных средств.

Необходимо обозначить, что всяким конкретным поведением является равнодействующая значительного числа предпосылок. Помимо этих ролевых предпосылок есть ещё другие предпосылки, которые относятся к положению в социуме (исходным положением здесь является личное восприятие). Они представлены личными мнениями, убеждениями, а также предпосылки, которые охарактеризовывают личность [4, с. 66].

Разумеется, встает вопрос о предпочтительности техники. Обсуждая эту проблему, Саймон отмечал, что любые управленческие решения «программируются» в разных степенях и находятся как бы на бесконечном,

непрерывном отрезке (континуум), который сформирован с помощью двух противоположных типов решения: незапрограммированных и запрограммированных.

Решение принято считать незапрограммированным, если для него нет готовых правил или процедур. Такие решения можно встретить в редких ситуациях, когда нет опыта в исправлении такой проблемы. В качестве примера можно выделить внедрение новых технологий, стратегическое планирование, реорганизация фирмы. Здесь существенную роль играет опыт, интуиция, а также способности управляющих. Саймон полагает, что «стоимость» принятия незапрограммированного решения весьма высока, вследствие этого организация должна пытаться запрограммировать как можно большее количество решений.

Запрограммированные решения – это такие решения, для которых есть готовые процедуры и правила. Традиционно «программируются» решения, которые встречаются в ситуациях-повторах. Это ведет к тому, что при повторном появлении аналогичной ситуации применяется заблаговременно спланированная методика, которая экономит время и обеспечит хорошее качество решения. Пример: ценообразование, отбор персонала.

К традиционным методам выбора запрограммированных решений относят применение умений и навыков действий в шаблонных ситуациях, а также правил и норм поведения, определенных как структурой, так и культурной стороной фирмы. Данные методы развивались на протяжении столетий. Тем не менее, по мнению Саймона, вторая половина XX века сделала невероятную революцию в принятии решений. Эта революция обязана созданию компьютерных технологий, которые открывали, все более трудные решения с помощью построения математических моделей проблематичных ситуаций и оценивание на данных моделях различные результаты альтернативных действий. Касательно этого, Саймон дает позитивный прогноз: «автоматизированные фабрики будущего будут работать на основании программируемых решений, которые будут произведены в автоматизированных офисах» [3, с. 31][4, с. 63-64].

Итак, процесс принятия решений показан следующими фазами: поиск причин для принятия решений, анализ потенциальных вариантов деятельности, принятие управленческого решения и его воплощение в жизнь (реализация). При всем этом, встретившись с проблемой выбора, человек использует упрощенную модель действительности, беря в основу свои ценности и устремления. С последним связан критерий эффективности управления как выражение рациональности при принятии решений. Для того, чтобы уменьшить риск, фирма должна применять «запрограммированные» решения, потому что «незапрограммированные» чрезмерно «дорогостоящие».

Устремления в основе деятельности

Саймон полагает, что рациональный процесс не входит в принятие решений по управлению, а вместо этого люди упрощают реальную ситуацию. Данное упрощение может быть объяснено:

Масса альтернатив, рассматриваемых менеджерами даже при применении современных методов, намного меньше, чем их объективно имеющийся набор

Информация, содержащаяся в организации, не позволяет установить и оценить точно последствия выбранных вариантов.

Цели в процессе принятия решений отличаются сложностью, и объединить их в однозначный измеримый показатель почти невозможно [3, с. 26].

Менеджер обыкновенно не старается принять оптимальное решение, а предпочитает вариант, который обеспечит результат, или же вариант, достаточно хороший, по мнению самого менеджера. Многие случаи принятия решений, как личных, так и коллективных, индивидом, связаны с розыском и выбором удовлетворительных альтернатив. Лишь редкие случаи связаны с поиском и выбором наилучших альтернатив.

Необходимо отметить, что поиск удовлетворительных решений совершается путем определения уровней устремлений, или притязаний (*aspiration levels*). Такой поиск осуществляется по разнообразным показателям, описывающим свойства альтернативных вариантов. К примеру, выражая цель принятия решения, менеджер устанавливает «свой» уровень прибыли, «свой» объем продаж, позволительный уровень риска, позволительные расходы ресурсов и времени. Но лишь альтернатива, которая удовлетворяет всем уровням устремлений, найдена, последующие поиски прекращаются, и полученная альтернатива воспринимается как финальная. Если же у менеджера есть больше одной версии, приводящей к удовлетворительному результату, тогда он выберет лучший из них. Но есть случаи, когда ни одна альтернатива не ведёт к соответствующему уровню устремлений. Тогда появляется 3 абсолютно разные версии поведения:

- Во-первых, индивид, который принимает решения, может продолжать поиск альтернатив, соответствующих его устремлениям

- Во-вторых, если у человека не получается достичь приемлемого положения, то уровни устремлений могут видоизменяться к понижению, то есть стать более осуществимыми

- В-третьих, в случае, если первые 2 механизма не работают (решение всё равно не находится), тогда «рациональное адаптивное поведение» индивида меняется на «эмоциональное» поведение (как, апатия или агрессия), блокируя возможность принятия удовлетворительного решения.

Однако, в случае, если ни одна из версий не работает, то теория прогнозирует 2 принципиально разных типов поведения: в краткосрочном периоде - поиск новых направлений, ориентиров, а в долгосрочном - «эмоциональным» поведением, или то, что психологи называют неврозом [3, с. 55-56].

В соответствии с концепцией ограниченной рациональности, «удовлетворительно работающие» менеджеры в процессе принятия решений обходятся без поиска и анализа всех потенциальных альтернатив и используют сравнительно простые правила рассудка, что существенно облегчает им жизнь [6, с. 2].

Итак, потребители пытаются прийти к удовлетворительному положению, а фирмы стараются прийти к удовлетворительному объёму прибыли и продаж. При всём при этом они понемногу увеличивают или снижают уровень устремлений, а это зависит от факта: превосходят ли результаты обозначенную цель или наоборот. Именно удовлетворение личных интересов является стимулом действия для потребителей и управляющих.

Конфликт интересов и формирование ожиданий

Необходимо отметить, что несогласованность интересов расположена в самой центре экономической теории. Главная трудность заключается в том, что свойство рациональности требует, чтобы некто владел более высокой способностью просчета, чем все прочие, и абсолютно понятно, что для всех, данное указание не может быть выполнено [4, 58-60].

В сложных ситуациях, велик шанс, что будет видна огромная пропасть между действительными условиями принятия решений и каким образом данные условия воспримут непосредственные участники событий. Сам анализ может быть либо нормативным (включение целого спектра результатов) либо дескриптивным, исследование вопросов касающихся того, какие особенности ситуации сначала нужно решить и какие представления о данной ситуации уже сложились.

Насчет организаций можно сказать что: количество факторов, которые имеют отношение к эффективности какой-нибудь организации, настолько велико, что можно брать в учет только небольшую часть (самую очевидную). Комплекс этих принятых факторов неизменно меняется, пока под влиянием внешних и внутренних условий появляются новые ситуации; «обучение» в виде реакции на воспринимаемые следствия является основным способом проявить рациональность.

Таким образом, возникает тезис о важности исследования не только объективных условий окружающей среды, но и поведения рациональных индивидов в ситуации неопределенности и сложности мыслительного процесса. Значение имеется не только в рациональности выбора в плане адекватности выбранных решений, а рациональности процедур, иными словами «эффективность (в рамках людских познавательных возможностей) процедур, которые используются для решений выбора».[3, с. 26-27].

Очевидно, что будущие события не могут предопределить настоящие, тем не менее, то, что готовит будущее, должно быть в некоторой степени спланировано в настоящем.

Долгое время заинтересованность экономистов в рациональности процедур в качестве специальной категории, несхожей с рациональностью выбора, определялась, большей частью, вопросами о неопределенности и ожиданиях. Элементарный принцип максимизации полезности и прибыли не мог применяться к ситуациям, в которых оптимальные решения имели связь с неопределенными экстерналиями или от поступков иных рациональных экономических лиц.

Труд по анализу механизма создания ожиданий представляет собой существенное увеличение границ традиционной теории. Поскольку, вместо того чтобы разбирать внешнюю сферу как данную, которая известна принимающему человеку решение, она вводит в теорию процесс получения знаний о внешней среде. Поэтому она вынуждает нас вводить в модель «экономического человека» его свойства как человека, который обрабатывает всю информацию. [4, с. 60-62].

В реальности при принятии решений нужно учитывать цели и оценки, состояние среды и приобретенные на основе этих оценок выводы. Устремления могут быть тривиальными и нетривиальными, противоречивыми и непротиворечивыми; факты могут быть истинными или предположительными (основаны на наблюдениях); выводы могут быть правильными или ошибочными. В переносном смысле, весь процесс можно назвать процесс "рассуждения", где факты являются предпосылками, а полученное решение, вытекает из данных предпосылок.

Основным доводом создания экономической теории неопределенности и обоюдных ожиданий было желание отыскать критерии рациональности выбора, с целью выведения концепции рациональности за пределы статичной оптимизации в ситуациях определенности. Как и в случае с классической теорией принятия решений, внимание ученых сосредоточено не на том, каким образом будут приниматься решения, а каковы эти решения непосредственно. [3, с. 28-29].

Познавательные способности

С раскручиванием рынка информационных услуг и продуктов совершается видоизменение структуры экономики и создание информационного сектора как отдельной отрасли. Информация начинает указываться в составе производительных сил и нематериальных ресурсов производства. По этому поводу можно процитировать Стиглера: «Едва ли нужно напоминать ученым, что информация является ценным ресурсом» [2, с. 305].

О.Уильямсон дает такое определение: «Ограниченная рациональность обозначает экономическое поведение, являющееся сознательно рациональным, но только в ограниченной степени; показывает ограниченность когнитивных способностей человека в приобретении, сохранении, и анализе информации». При этом подчеркивается, что лицо, принимающее решение, добросовестное.[5, с. 689].

Нужно понимать, что информация не является начальным ресурсом, т.е. человек должен понести издержки по поводу её получения. В зависимости от того,

каким образом показан поиск информации, модель «экономического человека» может отображаться различными типами: может ставиться вопрос об оптимальном количестве информации и масштабах поиска; иногда случается «информационный парадокс»: издержки по получению информации ясны, а вот ценность самой информации, нет. Также существует понятие субъективной ценности. [12, с. 14-15].

Проблемы поиска берутся в случаях, когда не все альтернативные версии действий появляются перед рациональным экономическим субъектом с самого начала и должны быть определены при помощи дорогостоящих мер. Обычно, вариант поведения избирается перед тем, как в ходе поиска обнаруживаются все возможные альтернативы. В качестве примера можно рассмотреть покупку дома или прочего имущества, когда предложения приходят последовательно и действуют в течение узкого срока времени. В этом примере вопрос заключается не в том, каким образом происходит поиск, а в том, как принимается решение прекратить его. Другими словами, речь идет о числе рассмотренных вариантов. Идея проста: при увеличении объемов поиска растут издержки.

В оптимизационной модели момент прекращения поиска обуславливается уравниванием предельных издержек поиска с предельным приращением числа альтернатив для выбора решений.

Модель, дающая удовлетворительные варианты, прекращает поиск, когда наилучший из предложенных вариантов превышает уровень притязаний, который сам понемногу выправляется соответственно ценности предлагаемых вариантов. В обоих случаях поиск оказывается попросту еще одним фактором производства, и инвестиции в процесс поиска устанавливаются с помощью такой же схемы уравнивания предельных значений величин, как и инвестиции в произвольный иной фактор [3, с. 30-31].

Нетрудно увидеть, что выбор удовлетворительной версии требует от экономического лица намного меньшей осведомленности, нежели неоклассическая модель. Ему уже не требуется располагать точной информацией об итоге данного варианта и сопоставлять его с итогами альтернативных вариантов в пределах совокупной функции полезности. Хватает расплывчатого подсознательного представления о том, что данная версия ниже или выше приемлемого уровня. При этом сопоставлять варианты между собой совсем не нужно. Ситуация становится более сложной, когда у субъекта довольно много времени для принятия решения. Тогда он может отобрать не только первый, но и оставшиеся удовлетворительные варианты, и потом, в случае если их большое количество, повысить планку уровня притязаний и повторить весь процесс. [1, с. 643].

Большинство из наших теперешних проблем связаны вопросом о том, как мы применяем ограниченную информацию и ограниченные математические возможности для того, чтобы решать существенные проблем, масштабы которых едва можно представить.

В соответствии с теорией Герберта Саймона, человек обычно никак не отвечает на поступающую к нему новую информацию, хотя в случае её

задействования и успешного применения, он, возможно, получил бы добавочную полезность. Предпочтение субъекта в заключении оказывается сравнительно автономным от конкретной ситуации и в большей мере обусловливается заблаговременно заданными правилами поведения.

В этом месте хочется привести еще одно предположение Саймона: «В мире, где информации сравнительно мало и проблемы, которые нужно решать, немногочисленны и просты, информация почти всегда - очевидное благо. В мире, где основным ограниченным ресурсом есть внимание, информация может быть дорогостоящим объектом роскоши, поскольку она может переключить наше внимание с важных моментов на несущественные» [2, с. 34]. Здесь, можно было бы сказать, что нужна рационализация отношения к процессу поиска информации и оцениванию приобретенной информации, ведь зачастую необходимо переводить внимание с привычных вещей на непривычные, новые и более важные. Тем не менее, Саймон полагал, что «мы не можем посвящать внимание информации лишь потому, что она есть», основываясь на примерах «систем информационного снабжения менеджмента», которые называются по-современному информационными автоматизированными «системами поддержки принятия решений», и находя внимание, а не информацию, ограниченным ресурсом, которое достойно регулярных исследований [3, 34-35]. При этом для поставленных в реальности задач в динамических условиях, нередки случаи, когда нужная информация отсутствует при избытке прочей информации. Как пример, можно рассмотреть следующую ситуацию: в то время как новые администраторы не научились пропускать потоки простых данных, они отвлекали старых администраторов от более весомых вещей. Таким образом, касательно современных организаций можно резюмировать, что автоматизированная информационная система, которая не потребляет, не усваивает объём информации больший, чем она вырабатывает и распространяет, отрицательно воздействует на работу той организации, к которой она присоединена.

Менеджмент внимания и учета косвенных последствий действий – являются двумя целевыми проблемами рациональности процедуры, которые стоят перед современным обществом. [3, 34-36].

Необходимо также заметить, что менеджеры в своей деятельности используют интуицию, которая по-настоящему помогает определять управленческим сотрудникам правильные решения. Что же представляет собой интуитивное принятие решений? Это подсознательные процессы принятия решений, основываясь на личном опыте менеджера и агрегированного мнения окружающих. Интуиция делает рациональный анализ более полноценным. Менеджер, который уже имел дело с проблемой схожего типа, действует весьма быстро, имея в своем распоряжении ограниченный запас информации. В этом случае он доверяет своему опыту.

Социологический опрос показал, что практически треть решений, принимаемых менеджерами в организациях, принято в первую очередь, полагаясь на свой "внутренний голос", а не на научные результаты. [7].

Что ж, «разумные люди» приходят к «разумным» выводам в ситуациях, когда нет возможности использовать классические модели рационального выбора. Анализ рациональности процедур в условиях, ограниченности внимания, проблема редчайше сложная и, так как необходимая информация отсутствует, то перед каждым, кто заинтересован в рациональном размещении ограниченных ресурсов, стоят многочисленные нерешенные и принципиально важные исследовательские проблемы.

ЛИТЕРАТУРА

1. Костюк, В.Н. История экономических учений / В. Н. Костюк. - М.: Центр, 1997. 224с.
2. Пиндайк, Р., Микроэкономика / Р. Пиндайк, Д. Рубинфелд.: пер. с англ. – 2-е изд. – М.: Дело, 2001. – 808 с.
3. Саймон Г.А. Рациональность как процесс и продукт мышления / Г. А. Саймон // THESIS, 1993, вып.3, с.16-38
4. Саймон, Г.А. Теория принятия решений в экономической теории и в науке о поведении // Вехи экономической мысли. / Под ред. В. М. Гальперина, С.М. Игнатьева, В.И. Моргунова. - СПб.: Экономическая школа, 2000.- 2т
5. Уильямсон, О.И. Экономические институты капитализма: Фирмы, рынки, «отношенческая» контрактация / О. И. Уильямсон. - СПб.: Лениздат, CEV Press, 1996.- 702 с.
6. Галерея экономистов/ Электронный ресурс: http://gallery.economicus.ru/cgi-bin/g_framen_newlife.pl Дата доступа: 30.11.2012
7. Behavioral economics Handbook of the Philosophy of Science, Vol. 5 (электронная версия)

Теории международной интеграции

Лазаревич Н.

Теории политической интеграции

В период с конца 1950-х до начала 1970-х гг. основными подходами были федерализм (А.Спинелли), функционализм (Д.Митрани), неофункционализм (Э.Хаас, Ф.Шмиттер, А.Этциони) и транзакционализм (К.Дойч). [5]

Теоретической основой исследований интеграции считается федерализм межвоенного времени. Федерализм видел конечной целью интеграции создание из некогда суверенных государств нового единого федеративного государства или надгосударственных структур, и представлял собой скорее политическую программу, чем теорию; хотя он и стремится к объяснению существенных связей и закономерностей процесса, лежащего в основе объединения отдельных политических единиц в единое целое. [5]

Согласно федералистам, для создания нового политического сообщества необходимо было заменить национальные правительства наднациональными институтами. Верили, что форма (федеративное супергосударство) — важнее содержания, политика — важнее экономики.

По убеждению А. Спинелли — известного итальянского федералиста, лидера европейского федералистского движения, - лишь резкий поворот в сторону федеративной модели мог бы привести к успеху в объединении всей Европы. Применительно к европейскому интеграционному процессу представители «федерализма» выдвинули тезис о появлении особого (федерального) институционального устройства, определяющего как характер взаимоотношений между самими интегрирующимися единицами, так и распределение полномочий между ними, с одной стороны, и возникающим «единым центром», с другой. Характеризуя специфику такого распределения полномочий, А. Спинелли утверждал, что ни одна из властей соответствующего уровня не должна располагать какими-либо преимуществами, а полномочия местных, региональных, национальных органов и органов европейского масштаба должны сочетаться и дополнять друг друга. Иными словами, межгосударственные органы будущей «новой» Европы не должны наделяться полномочиями исключительно широкими, отличающимися от полномочий отдельных государств в сторону увеличения. По мнению Э. Уистрича, «сущность федерализма заключается в децентрализации власти везде, где это необходимо...». При этом стоит обратить внимание на то, что децентрализация там, «где это необходимо», по сути, представляет собой содержание одного из основополагающих принципов Маастрихтского договора о Европейском союзе — принципа субсидиарности.

Федерализм имеет весьма глубокие философские корни, берущие свое начало еще в древнегреческой Античности и средневековой европейской политической мысли. И все же в качестве основополагающих источников федералистского мышления чаще называют: обилие планов по укреплению мира в Европе XVII—XVIII столетий и американскую Конституцию. Что касается последней, то ее появление послужило мощным импульсом к развитию и широкому распространению федералистских взглядов и теорий. Тем не менее, трудно дать однозначный ответ на вопрос о том, может ли американская (или, например, швейцарская) модель федерации быть взята за основу, если речь идет об углублении интеграции существующих не одно столетие суверенных и независимых государств, и, в частности, может ли такая модель объединить на федеративных началах многочисленные государства современной Европы?

В качестве теории международной интеграции, федерализм отстаивает точку зрения о том, что в основе взаимоотношений между интегрирующимися странами должна лежать модель союзного государства, учреждение которого одновременно рассматривается и в качестве конечного продукта, результата интеграции. В контексте европейского интеграционного процесса идеи «федерализма» ассоциируются с созданием единой федеральной Европы. Более того, приверженцы

данной теории считают, что именно создание федерации поставит точку в использовании насилия при разрешении спорных вопросов между государствами, ибо ее (федерации) высшими ценностями как раз и являются мир и безопасность. Именно федерация, как они полагают, может служить образцом «целесообразной, демократической и эффективной организации». Европейская интеграция, по мнению федералистов, не может быть революционным процессом. Это должно быть эволюционное, поступательное развитие. Как отмечал в свое время известный западноевропейский деятель, активный поборник межгосударственной интеграции в рамках ЕС Ж. Монне, «...политический союз Европы должен строиться шаг за шагом, так же как и осуществление экономической интеграции. В один прекрасный день этот процесс приведет нас к Европейской федерации...». Вместе с тем, он не может ограничиваться лишь сферой политических отношений между государствами, хотя без политической интеграции, по мнению федералистов, не может быть реальной интеграции вообще. [6]

В 1943 году появляется работа Дэвида Митрани, в которой были заложены основы конкурирующей теории — функционализма. Данная теория в значительной степени отличается от федералистского подхода к исследованию и анализу межгосударственной интеграции. В своем классическом виде она представлена в работах Д. Митрани, выступающего за трансформацию и обновление сложившихся за многие десятилетия представлений о системе международных отношений и предлагавшего так называемую «функциональную альтернативу», имеющую своей конечной целью всеобъемлющее мировое единство. Появление этой теории не только в значительной степени повлияло на все последующее развитие интеграционной теоретической мысли (в особенности это касается неофункционализма), но и существенно активизировало практические действия, направленные на реальное сближение европейских государств.

Одна из основополагающих идей функционализма состоит в том, что международная интеграция должна быть в максимальной степени деполитизирована, а эффективное сотрудничество государств и избежание конфликтов могут и должны быть достигнуты путем концентрации усилий в первую очередь на общих для всех вопросах благосостояния (как во всемирном масштабе, так и на национальном уровне). Интеграционная динамика приводит к появлению функциональных организаций, располагающих определенными полномочиями, предоставленными непосредственно самими государствами. Конечным продуктом интеграции становится образование функциональной системы, элементы которой могут начать работать и без общей политической надстройки. Представители данного направления рассматривают международную интеграцию как процесс постепенного перехода от традиционной межгосударственной системы отношений к некоему функциональному сообществу, процесс перераспределения властных полномочий отдельных государств в пользу создаваемой надгосударственной структуры, обладающей функциональной эффективностью.

Некоторые специалисты-критики данной теории отмечают, что в целом последующее развитие европейского интеграционного процесса серьезно разочаровало представителей направления. К глубокому сожалению приверженцев функционализма, те функциональные организации, на которые ими возлагались особые надежды, так и не смогли избавиться от чрезмерной политизированности и сконцентрировать свои усилия на решении исключительно функциональных задач. Вместе с тем, некоторые из фундаментальных идей Д. Митрани были впоследствии существенно переработаны и легли в основу создания одной из наиболее влиятельных теорий международной интеграции — неофункционализма.

Стоит также отметить, что, по мнению функционалистов, международные организации должны быть созданы для удовлетворения базовых функциональных потребностей — развития торговли, транспортных сетей, производства и т.п. Экономика же считалась важнее политики, а институциональная форма должна была определяться функциональным содержанием.

Появление неофункционализма было связано с периодом так называемого «евроэнтузиазма» в 60—70 гг. XX столетия, когда неизбежность дальнейшей интеграции государств — участников Европейских сообществ представлялась все более очевидной. Наибольший вклад в становление и развитие этой теории внесли такие известные личности, как Э. Хаас, Л. Линдберг, А. Этzioni.

По мнению сторонников неофункционализма, последовательность и структура интеграционного процесса предполагают создание системы мощных центральных институтов и постепенную передачу государствами-участниками принадлежащего им суверенитета на уровень Сообщества в целом. При этом и государства-участники, и их правительства рассматриваются как играющие в этом процессе весьма пассивную роль и не выделяющиеся из общей массы действующих лиц. Комиссия ЕС, напротив, выступает в качестве активного организатора и вдохновителя интеграционного процесса, а организованные группы, партии, политические элиты выполняют роль своеобразного «катализатора» интеграции.

Неофункционализм, в отличие от других теорий политической интеграции, абсолютно не стремится предсказать, каков будет ее конечный результат, уделяя гораздо большее внимание исследованию самого процесса, механизма интеграции. Вместе с тем, представители данной теории отстаивают точку зрения о неизбежности появления некоего наднационального образования — «нового политического сообщества», находящегося, с точки зрения иерархии, как бы над государствами. Стоит отметить, что именно с данным направлением связывают появление идеи «наднациональности» в международном праве. [6]

Некоторые авторы отмечают, что по сравнению с «функционализмом» Д. Митрани «неофункционализм» в гораздо большей степени представляет собой теорию региональной политической интеграции, ибо предметом его исследования являются интеграционные взаимоотношения государств, относящихся к отдельному региону планеты. Более того, обращает на себя внимание непосредственная и существенная взаимосвязь между взглядами

неофункционалистов и практикой Европейских сообществ: весьма часто неофункционализм характеризуют как «метод интеграции в рамках ЕС».

Еще одним подходом к исследованию и анализу европейской интеграции, имевшим достаточно широкое распространение и значительное влияние в рамках политической науки, является теория «сообщества безопасности», в основе которой лежит изучение последовательности исторических событий в контексте достижения и обеспечения мирного сосуществования и дружественных отношений между государствами. В основе транзакционализма лежит концепция сообществ безопасности». Считается, что концепция «сообществ безопасности» была выдвинута в 1957 году Карлом Дойчем и его коллегами в книге под его редакцией «Политическое сообщество и Североатлантическая зона». Они выдвинули тезис о необходимости создания так называемого «сообщества безопасности», представляющего собой «группу государств, достигших значительного уровня интеграции друг с другом и осознавших необходимость определенной общности (единства)». Однако, на самом деле эту концепцию еще в начале 1950-х годов предложил Ричард Ван Вагенен. К. Дойч и его коллеги определяли сообщество безопасности как группу, члены которой достигли такой степени интеграции, что у них возникала обоснованная уверенность, что члены сообщества не будут воевать между собой. Дойч выделял два типа сообществ безопасности — плюралистические и объединенные. В рамках первых сообществ государства сохраняют суверенитет, сообщество безопасности второго вида предполагает отказ от суверенности и формальное объединение в единое государство (по сути, речь идет о том же федерализме), при этом в обоих случаях конфликты внутри сообщества разрешаются только мирными способами. В случае плюралистических сообществ безопасности необходимо наличие разделяемых членами сообщества ключевых ценностей — общей идентичности, стремления оказывать взаимную помощь, общих институтов. Чувство принадлежности к одному сообществу, согласно Дойчу, возникает благодаря коммуникациям и взаимодействию между его составными частями. Именно поэтому в качестве доказательной базы своей концепции Дойч и его коллеги приводят данные об объемах трансакций (торговля, туризм) между отдельными государствами — членами того или иного сообщества. [5] Межгосударственная интеграция, по мнению представителей данного направления, — это многовекторный, многоаспектный процесс, и для того, чтобы получить о нем максимально полное представление, необходим достаточно большой набор методов и средств познания. В этой связи К. Дойч предлагает использовать определенную систему критериев для выяснения того, как далеко продвинулись государства в реализации их интеграционных инициатив, насколько быстро может осуществляться их взаимодействие в той или иной сфере, что мешает активизации их усилий в этом направлении и т. д.

В целом стоит отметить, что данное направление, хотя и относится к числу многочисленных теорий политической интеграции, тем не менее, имеет много общего с социологическим подходом к изучению европейского интеграционного

процесса и, по мнению некоторых специалистов, «тесно переплетается с общесоциологическим анализом». [6]

Стоит отметить, что если федерализм и функционализм представляли собой скорее соответствующие политические программы и подходы к построению мира, чем полноценные теории, то неофункционализм и трансакционализм уже имели вполне обоснованные теоретические амбиции. Неофункционалисты попытались преодолеть излишне техницистский подход функционалистов и их желание отделить политику от процессов интеграции.

Социологический подход к изучению процесса интеграции

По мнению А. Этзони, «для социолога представляет, вероятно, наибольший интерес образование новых союзов, участниками которых выступают нации и государства».

Согласно социологическому подходу, в первую очередь широкие народные массы должны были бы стать основной движущей силой интеграции. Однако они так и не оказались в достаточной степени вовлеченными в этот процесс. В результате отдельные личности, различные социальные элиты, политические и экономические группировки становятся главными действующими лицами на интеграционной сцене. Именно от характера их взаимоотношений, от их принципиальных позиций и существа принимаемых ими решений непосредственно зависит интеграционная динамика.

Среди наиболее важных идей, лежащих в основе социологического подхода к изучению европейского интеграционного процесса, следует выделить идею «политического объединения», в наибольшей степени разработанную в трудах А. Этзони. Данная идея акцентирует свое внимание на таких вопросах, как степень вовлечения главных действующих лиц в процесс объединения, отработка механизма и определение пространственных пределов объединения и т. п. Другой фундаментальной основой социологического подхода к исследованию и анализу европейской интеграции является коммуникативная теория, выдвигающая на первый план различные формы социального общения, а также необходимость развития коммуникативных навыков и способностей у субъектов, участвующих в таком общении. Наконец, значительную роль в становлении и развитии социологического подхода к изучению европейской интеграции сыграл и такой весьма важный и существенный элемент, как общая политическая культура.

Экономико-теоретический подход к изучению европейской интеграции

Вплоть до конца 70-х гг. XX столетия в среде представителей экономической науки наблюдался определенный скептицизм относительно явных экономических преимуществ более тесного сотрудничества между государствами. Тем не менее, последующее прогрессивное развитие экономической политики Европейских

сообществ, в особенности создание единого рынка, а затем экономического и валютного союза в рамках ЕС, послужило мощным импульсом к дальнейшему развитию экономико-теоретического подхода к изучению европейской интеграции.

Представители данного подхода утверждали, что одна из главных причин появления Европейских сообществ лежит именно в экономической плоскости. По их мнению, желание создать таможенный союз во многом явилось первоначальным импульсом к осуществлению вообще политики интеграции, а установление единого таможенного тарифа и необходимость его постоянного изменения привели к возникновению общей торговой политики. Более того, конкурировать с США и Японией, оставаясь в рамках полузамкнутых национальных экономик, европейские страны были уже не в состоянии. Гораздо больший потенциал и жизнеспособность демонстрировали как раз региональные, а не национальные экономики.

Идея экономической интеграции достаточно быстро охватила различные секторы экономики западноевропейских государств: сельское хозяйство, промышленность, энергетику, сферу услуг, транспортную отрасль. Непосредственно сама интеграционная динамика стала ассоциироваться с последовательным достижением определенных стадий экономической интеграции, а именно с созданием зоны свободной торговли, таможенного союза, единого внутреннего рынка, экономического и валютного союза и т. д. В рамках экономико-теоретического подхода особую актуальность приобрели вопросы влияния различных экономических соглашений на динамику и условия традиционного межгосударственного сотрудничества, вопросы дальнейшего совершенствования интеграционных механизмов. В центре внимания оказалась проблема разумного и справедливого распределения между всеми участниками интеграционного процесса не только выгод, получаемых в результате интеграции, но и определенных издержек, которые государства вынуждены нести, интегрируясь друг с другом. Острота данной проблемы была во многом обусловлена появлением точки зрения о том, что, хотя интеграция государств рассматривается в целом как весьма положительное, прогрессивное явление, тем не менее, более развитые страны неизбежно теряют, интегрируясь с менее развитыми, в то время как последние только приобретают от такого сближения.

Стоит отметить, что среди представителей данного подхода так и не сложилось единство взглядов на природу и цели межгосударственной интеграции. Некоторые из них отождествляли региональную интеграцию прежде всего с возвращением к идеалам свободной торговли, а сама интеграция, по их мнению, непосредственно должна сводиться лишь к отмене различного рода ограничений, препятствующих свободному перемещению товаров и услуг. Другие же являлись активными сторонниками интенсификации интеграционного процесса, причем в самых различных областях, и рассматривали создание европейского рынка как единственный путь к достижению всеобщего благосостояния в рамках всей Европы.[6]

Правовой подход к изучению интеграционных процессов

В традиционном восприятии межгосударственная интеграция, как правило, ассоциируется с определенными политическими или экономическими процессами либо с их совокупностью. Вместе с тем, нельзя забывать и о той важной роли, которую играет право в области регулирования интеграционных взаимоотношений государств. По мнению М. Каппеллетти, М. Секкомбе и Дж. Уэйлера, именно право определяет статус и сферу деятельности главных действующих лиц в условиях интеграции, контролирует, а при необходимости и ограничивает их действия, выполняет роль своеобразного нормативного регулятора во взаимоотношениях между участниками интеграционного процесса. Именно право осуществляет функцию «упорядочения и стимулирования интеграционного процесса, консолидации его содержательных и организационных структур». Наглядным примером тому является деятельность Европейских сообществ, чьи основополагающие цели и задачи (создание основ для все более тесного союза европейских народов, экономический и социальный прогресс, непрерывное улучшение условий жизни и труда, устойчивое развитие, процветание и стабильность и т. д.) не могут быть достигнуты и реализованы вне рамок правового поля, без реального и эффективного регулирующего воздействия со стороны правовых норм. Как справедливо отмечают некоторые специалисты, интеграция в Западной Европе, начавшись с права, и на всех последующих своих этапах характеризовалась достаточно высоким уровнем правового регулирования.

Одной из наиболее характерных особенностей Европейских сообществ, по мнению представителей правового подхода, является уникальность их юридического статуса, которая заключается в том, что, с одной стороны, Сообщества созданы государствами и функционируют на основе международно-правовых норм, а с другой, в рамках ЕС сформировался собственный специфический автономный правопорядок, существенно отличающийся от национального правопорядка какого-либо из государств-участников.

Важным аспектом, который на протяжении нескольких десятилетий обсуждается в среде представителей правового подхода к исследованию и анализу европейской интеграции, является проблема соотношения права Европейских сообществ и национальных правовых систем государств-участников.

ЛИТЕРАТУРА

1. А.С. Булатов. Главные интеграционные группировки мира [Режим доступа]: http://business.polbu.ru/bulatov_economy/ch164_x.html
2. [Дата доступа]: 26.11.12
3. Европейский Союз Википедия [Режим доступа]: http://ru.wikipedia.org/wiki/Европейский_союз [Дата доступа]: 12.11.12
4. Жуков Международные экономические отношения [Режим доступа]: http://alexskaj.ru/meo/mezhdunarodnie_integracionnie_processi.html
5. [Дата доступа]: 28.11.12

6. Интеграционные процессы во всемирном хозяйстве. Мировая экономика. Часть 1. (конспект лекций). Авторы: Шкуропат А.В., Терский М.В., редактор: Александрова Л.И. [Режим доступа]: http://abc.vvsu.ru/Books/l_mirekon1/page0008.asp [Дата доступа]: 12.11.12

7. Ю.А.Никитина От интеграции к регионализму: эволюция теорий регионального межгосударственного сотрудничества - Научная школа МГИМО

8. Ю.Лепешков Межгосударственная интеграция в рамках Европейского Союза: некоторые вопросы теории Белорусский. - Журнал международного права и международных отношений, №1, 2001.

Исторические предпосылки становления концепции человеческого капитала

Козловская Е.П.

Сегодняшнее состояние мировой экономики показывает огромную значимость не только уровня развития техники и технологий для качественного экономического роста, но и умений управлять экономическими процессами. То есть, растет значимость человеческого капитала.

21 век характеризуется увеличением скорости обмена информации и увеличением темпов жизни. В мировой экономике появляется новый термин – «экономика знаний», где главную роль играет человек, с его накопленными знаниями и умениями, т.е. с человеческим капиталом. Составной частью «экономики знаний» является ее инновационный характер. Опять же, фундаментом инноваций является человеческий капитал.

Происходящие в обществе радикальные социально-экономические преобразования, связанные с переходом к информационному обществу, ставят перед исследователями ряд актуальных проблем. В их числе проблема выявления особенностей изменяющихся социально-экономических отношений, которые в экономической литературе относятся к категории «человеческий капитал». Формирование информационной экономики, где главенствующую роль играет специфический ресурс – информация и знания, связано с необходимостью рассмотрения и анализа человеческого капитала. Формирование и развитие человеческого капитала, использование его потенциала становится, наравне с развитием технологий, ключевым фактором развития производительных сил общества. Анализ экономической литературы показывает, что развитие информационной экономики неразрывно связано с концепцией человеческого капитала, развитием сфер, где происходит его формирование и накопление. Несмотря на большое внимание, уделяемое теории человеческого капитала в экономической литературе, в силу многогранности и разноплановости данной категории определенные аспекты остаются недостаточно изученными.

Недостаточная разработанность относится к таким вопросам, как проблема износа человеческого капитала; измерения уровня и отдачи от вложений в

человеческий капитал; участия человеческого капитала в развитии общества. Остаются неясными и многие вопросы механизма воспроизводства человеческого капитала на разных уровнях, проблемы механизма управления этим капиталом. Это отражается в том, что довольно длительный процесс перехода к информационному обществу развитых стран сопровождается дефицитом специалистов, способных реализовывать разрабатываемые информационные технологии.

Важной проблемой предстает необходимость рассмотрения вопросов изменения социально-экономического положения человека в условиях информационной экономики, особенности мотивационного механизма формирования и накопления человеческого капитала, мотивации в структуре

воспроизводства человеческого капитала. Кроме того, экономический анализ мотивационного механизма деятельности человека дает возможность решения многих проблем в создании целостной концепции трансформации экономических отношений в условиях перехода к информационной экономике. Анализ мотивационных процессов позволяет изучать и решать такие проблемы как экономический рост, распределение доходов, содержание процессов труда и др.

Концепция человеческого капитала позволяет с единых позиций изучать многие явления и процессы рыночной экономики, осмысливать возникающие при развитии информационной экономики новые формы взаимодействия между производством и потреблением.

Методологические основы концепции человеческого капитала

Первый ученый-экономист, который обратился к вопросу о роли человеческого фактора в экономическом развитии, был Адам Смит, классик английской политической экономии. В своей работе «Исследования о богатстве народов» (сокр.) он показал, что рабочая сила является главным движущим фактором процесса производства, а общественное воспроизводство в широком, народнохозяйственном, аспекте есть возобновление производства товаров и воспроизводства самой рабочей силы. Эти моменты неизменно привлекали внимание экономистов-теоретиков, его последователей. Необходимо отметить, что его работа базировалась на наблюдаемых фактах, т.е. А. Смит обращался к действительному знанию, делая индуктивные умозаключения.

Значимым открытием Смита в концепции человеческого капитала, является его наблюдение того, что увеличение производительности полезного труда зависит, прежде всего, от повышения ловкости и умения рабочего, а затем от улучшения машин и инструментов, с помощью которых он работал. Идея Смита о том, что обновление и развитие экономики не возможно лишь за счет замены средств труда и производства (основного капитала), крайне актуальна на сегодняшний день.

Основной капитал по Смигу состоит из машин и иных орудий труда, из построек, из земли и из приобретенных и полезных способностей всех жителей и

членов общества. Отметил он также и то, что приобретение таких способностей, считая также содержание их обладателя в течение его воспитания, обучения или ученичества, всегда требует действительных издержек, которые представляют собой основной капитал, как бы реализующийся в его личности. Эти способности, являясь частью состояния определенного лица, вместе с тем становятся частью богатства общества, к которому это лицо принадлежит. Большую ловкость или умение рабочего можно рассматривать с той же точки зрения, как и машины и орудия производства, которые сокращают или облегчают труд и которые, хотя и требуют известных расходов, но возвращают эти расходы вместе с прибылью. Важный тезис состоит в том, что человеческий капитал менее подвержен износу по сравнению со средствами производства.

С другой стороны рассмотрел и расширил роль человеческого фактора Карл Маркс. Он рассматривал производство человека - потребительное производство - как второй вид общественного производства. В этом процессе потребительного производства рабочая сила не только воспроизводится, но и совершенствуется, развивается. Происходит своего рода «накопление» производительной силы труда, созидательных способностей человека, причем в большей степени именно умственных способностей.

Анализируя взгляды пролетарского критика буржуазной политической экономии Томаса Годскина, Маркс утверждает, что «накопление» производительной силы труда действительно имеет место быть, но не как мертвая масса, а как нечто живое — искусство рабочего, степень развития труда. Результатом производства физических и умственных способностей к труду является развитая рабочая сила, способная к квалифицированному труду. Сложность, качество труда, если отвлечься от вещественных условий производства, являются характеристикой самой рабочей силы. Развитая рабочая сила проявляется в сложном труде, хотя может реализовываться и в простом труде. Но простая рабочая сила, ни при каких обстоятельствах не может проявиться в сложном труде. Можно сказать, что величина вновь созданной стоимости определяется произведением сложности труда (количество рабочей силы) на величину рабочего времени, в течение которого осуществляется труд, при прочих равных условиях. Таким образом, развитая рабочая сила способна создавать большую стоимость в течение рабочего времени, чем простая, но так как на ее производство расходуется большее количество общественного труда, то она имеет и большую стоимость воспроизводства. Труд, который имеет значение более высокого, более сложного труда по сравнению со средним общественным трудом, есть проявление такой рабочей силы, образование которой требует больших вложений, и которое имеет, поэтому более высокую стоимость, чем простая рабочая сила. Если стоимость этой силы выше, то и проявляется она в более высоком труде и овеществляется, поэтому за равные промежутки времени в сравнительно более высоких стоимостях.

Маркс так же показывает, что экономический рост (расширенное общественное воспроизводство) не происходит сам по себе, и может

осуществляться только при наличии прибавочного продукта. Это общее положение для всех формаций. Избыток продукта труда над издержками поддержания труда и образования и накопление из этого избытка общественного, производственного и резервного фонда - все это было и остается основой всякого общественного, политического и умственного прогресса. Прибавочный продукт создается рабочей силой, а затем служит источником ее воспроизводства. Последнее происходит как за счет роста населения, так и за счет развития способностей к труду отдельных людей, накопления ими знаний, опыта и умений. Накопление способностей к труду членов общества, развитие индивидуальных рабочих сил требуют значительных затрат живого и овеществленного труда. Этот специфический вид накопления, овеществленного в человеке труда, остается еще сравнительно мало исследованным. Технология формирования и развития главной производительной силы общества мало изучена экономической наукой (Гойло).

Весьма тривиально, что физическое и интеллектуальное развитие человека, состояние здоровья, профессиональная подготовка зависят от объема и структуры питания, рациональности одежды, от объема и структуры потребления бытовых услуг, услуг здравоохранения, просвещения, культуры, профессионального образования. Процессы развития личности человека и его способностей к труду изучаются представителями различных наук - медиками, психологами, социологами, экономистами, но до сих пор эти исследования не интегрированы в достаточно целостную теорию человеческого капитала. До недавнего времени значительная часть экономистов недооценивала влияние потребления населением материальных благ и услуг на развитие способностей человека к труду.

Во многом по этой причине, во время научно-технического прогресса образовался дефицит высококвалифицированных кадров, и в 1950-е годы центр тяжести исследований сместился с процессов использования имеющейся рабочей силы на процессы создания качественно новой рабочей силы. Структурные изменения в совокупной рабочей силе, интерес к факторам экономического роста и экономической динамике явились причинами возникновения и развития теории человеческого капитала. Истоки ее, помимо А. Смита и К. Маркса, просматриваются в работах У. Петти, Д.С. Милля, Ж.Б. Сэя, Н. Сениора, Ф. Листа, И.Г. фон Тюнена, У. Багехота, Е. Энгеля, Г. Сиджвика, Л. Вальраса, И. Фишера и других экономистов прошлых столетий. В 1950-90-х годах XX в. эта теория сформировалась и развивалась в трудах Т. Шульца (впервые использовал термин «человеческий капитал»), Г.Беккера (развил идею Шульца, обосновав эффективность вложений в человеческий капитал и сформулировав экономический подход к человеческому поведению), Б. Вейсброда, Дж. Минцера, Л. Хансена, М. Блауга, С. Боулса, Й. Бен-Порэта, Р. Лейарда, Дж. Псахаропулоса, Ф. Уэлча, Б. Чизвика.

Сегодня эта теория развивается в рамках неоклассического направления западной политэкономии и используется в исследовании таких сфер, как образование, здравоохранение, семья и другие сферы вне рыночной деятельности.

«Человеческий капитал» - как определяют его большинство западных экономистов - совокупность знаний, умений, навыков, используемых для удовлетворения многообразных потребностей человека и общества в целом. Первоначально под человеческим капиталом понималась лишь совокупность инвестиций в человека, повышающая его способность к труду — образование и профессиональные навыки. В дальнейшем понятие человеческого капитала существенно расширилось. Последние расчеты, сделанные экспертами Всемирного банка, включают в него потребительские расходы — затраты семей на питание, одежду, жилища, образование, здравоохранение, культуру, а также расходы государства на эти цели. Человеческий капитал является формой капитала, потому что является источником будущих заработков, или будущих удовлетворений, или того и другого вместе. Он человеческий, потому что является составной частью человека.

Сторонники теории человеческого капитала разработали количественные методы анализа эффективности вложений в образование, медицинское обслуживание, подготовку на производстве, миграцию, рождение и уход за детьми и их денежной отдачи для общества и семьи. Главное внимание в этом анализе уделяется производимым способностям человека и дифференциации доходов, вызываемой различными уровнями инвестиций в их производство.

Оппонентами этого направления выступают консервативные психологи и экономисты, приписывающие ведущую роль в дифференциации способностей наследственному, биологическому, фактору, полагая, что объяснение всей разницы в доходах у лиц с неодинаковым уровнем подготовки, получаемым образованием приводит к завышению эффекта обучения.

Оба указанных объяснения причин дифференциации способностей к труду и, соответственно, доходов населения подверглись критике радикальных экономистов. По их мнению, образование выступает как посредник, преобразующий неравенство в социальном происхождении в неравенство доходов.

Передача от поколения к поколению экономического неравенства в капиталистическом обществе, по их мнению, происходит как посредством наследственной передачи связей в деловом мире, так и через усвоение и изменение ценностных установок, мотиваций и стереотипов поведения. Поэтому если на разных уровнях производственной иерархии требуются работники с разными поведенческими характеристиками и если развитие этих характеристик осуществляется в основном в семье, то социальное происхождение может быть важнейшей причиной воспроизводства экономического неравенства.

Наконец, К. Дженкс на обширном выборочном материале показал, что корреляция между образованием и заработками обнаруживается лишь для агрегатных, групповых величин, тогда как при анализе индивидуальных данных связь эта практически исчезает. Отсюда делается вывод: дифференциация доходов имеет вероятностный характер, вызывается преимущественно случайными причинами.

Таким образом, западные экономисты, несмотря на значительные усилия, потраченные на разработку теории рабочей силы и изощренную технику статистического анализа дифференциации доходов и факторов их вызывающих, не смогли завершить создание стройной и подтверждаемой фактами теории.

Теоретический подход к анализу человеческого капитала

Исходя из того, что одним из первых Дж. Р. Маккуллох ясно определил человеческие существа как капитал, более того, как формируемую часть национального богатства, появился вопрос о том, как его оценить, какие методы оценки применять и как его совершенствовать. Кроме того, отмечается существование тесной аналогии между общепринятым и человеческим капиталом, считая, что инвестиции в человеческие существа должны иметь темп оборота, согласующийся с темпом оборота других инвестиций, плюс нормальный темп оборота, определенный рыночной процентной ставкой в течение возможной жизни индивидуума.

Теоретические идеи Маккуллоха продолжил английский экономист Нассау У. Сениор. Он так же предполагал, что человеческие существа могут успешно трактоваться как капитал. В большинстве своих рассуждений на эту тему он брал в этом качестве мастерство и приобретенные способности, но не самого человека. При случае, тем не менее, он трактовал сами человеческие существа как капитал с затратами на содержание, вкладываемыми в человека с ожиданием получения выгоды в будущем. Он утверждал, что существует очень маленькая разница между рассуждениями о ценности раба и ценности свободного человека. Принципиальная разница заключается в том, что свободный человек продает самого себя на определенный период времени и только в определенном отношении, в то время как раб продается на всю его жизнь.

Схожий подход в определении человеческого капитала применил и Генри Д. Маклеод, английский экономист и юрист, противник классической политической экономии, особенно рикардианства. Рассматривал производящего человека как фиксированный капитал. С его точки зрения, если этот человек не является продуктивным, то не подвержен экономическому анализу. Это мнение резко противоречит мнению Леона Вальраса, который включал все человеческие существа в капитал. А ценность, или цена, этих человеческих существ, по Вальрасу, определяется подобно другим капитальным товарам. Кроме того, Вальрас был лишен внутреннего нежелания, подобно некоторым экономистам, рассматривать человеческие существа как капитал. Он доказывал, что чистой теории "присуще полное абстрагирование от рассмотрения справедливости и практической целесообразности", и призывал "рассматривать человеческие существа исключительно с точки зрения меновой стоимости".

Среди сторонников нежелания оценивать человеческие существа в деньгах есть и представитель немецкой географической школы в экономической науке

Иоганн Г. фон Тюнен. Но из этого нежелания, проистекает недостаток ясности и путаность понятий в одной из наиболее важных областей политической экономии. Более того, может оказаться, что свобода и достоинство людей могли бы быть успешно обеспечены, если бы они были субъектами законов о капитале. Фон Тюнен предполагал, что многие социальные институты могли быть отменены, если бы затраты, которые увеличивают производительность труда, рассматривались в аналитической схеме человеческого капитала. Капитализированная ценность этих расходов, кроме того, должна быть включена как часть в агрегированный запас капитала.

Хотя Альфред Маршалл допускал, что оценки капитализированной стоимости человека могут быть полезными, и рассматривал их в явном виде по методу капитализации чистого заработка (потребление вычиталось из заработка до капитализации), он отбросил это понятие как "нереалистическое", поскольку человеческие существа не продаются на рынке.

Проблема включения человеческого существа в капитал рассматривалась Ирвином Фишером. Капитал, как он утверждал, является полезным предназначенным материальным объектом, и, следовательно, поскольку человеческие существа обладают этой характеристикой, последовательность в рассуждениях требует их включения в понятие капитала. Более того, мастерство индивидуума не является капиталом, а лишь является добавкой к самому индивидууму. Существует, говорил И. Фишер, обученный индивидуум, который должен быть включен в понятие капитала.

Вышеизложенные теоретические настроения помогают выдвинуть актуальный вопрос: будет ли равна стоимость мастерства в совокупности с полезными способностями и стоимость самого индивидуума?

Эдвард Денисон предполагает, что говорить о технологическом прогрессе, воплощенном в физическом капитале, значит просто ссылаться на изменения в качестве основных фондов (капитальных товаров). Такая аналогия может быть применена и к человеческим существам. Мастерство и приобретенные способности воплощены в человеческих существах и, предположительно, увеличивают их качество, как производительных единиц. Следовательно, их мастерство и способности являются неотъемлемыми от индивидуумов. И сомнительно, можно ли говорить о них отдельно от человека как о капитале.

Однако, ответ на поставленный вопрос может трактоваться по-разному, в зависимости от определения понятия экономической ценности. Так, если ценность определяется как «чистая прибыль» для общества, где превышение валового выпуска над валовым потреблением даёт чистую прибыль, сумма мастерства или полезных способностей будет увеличивать прибыль, в то время как добавление к ним индивидуума увеличивает не только выпуск, но и потребление. Ценность мастерства и полезных способностей и ценность индивидуума, если и то и другое измерено величиной чистой добавленной прибыли, в этом случае может быть различной.

Тем не менее, берутся ли только мастерство и приобретенные способности или их владелец, для определения человеческого капитала это является относительно маловажным. Но все же, в некоторых случаях различие между мастерством и приобретенными способностями, с одной стороны, и человеком, с другой, важно, например, для целей налогообложения, что отмечает Б. Ф. Кикер.

Что касается доминирующей в мировой экономике теории общего равновесия с постулированными краткосрочными договорами, то согласно ей предприниматели не заинтересованы в инвестициях в рабочую силу. Но в последнее время факторы долгосрочного роста широко признаются в качестве доминирующих в регулировании деловой активности. Как отмечают некоторые западные экономисты, предприниматели все лучше осведомлены о важности инвестиций, которые становятся «интегрированной частью человека», и это осознание приводит к освобождению роста инвестиций в человека. Следовательно, симметричное рассмотрение приобретенных способностей человека и обычного капитала привычно для многих экономистов.

В конечном итоге, ученые-экономисты делают вывод, что денежная стоимость населения является наибольшим активом страны и что «общественно-заинтересованные в национальном благосостоянии граждане и студенты активно поддерживают прогресс, способствующий сохранению человеческой жизни и наслаждению имеющимся здоровьем, с тем, чтобы жизнь производительных индивидов была продлена и, следовательно, прибавлена к благосостоянию общества».

Этому заключению противоречат мнения некоторых экономистов мейнстрима, которые утверждают, что дальнейшее возрастание затрат на здравоохранение в развитых странах, будет в дальнейшем производить лишь здоровье, но не благосостояние. А это является не эффективным с экономической точки зрения.

Многие ученые использовали различные оценки капитальной стоимости человека. Некоторые авторы использовали оценки капитальной стоимости человека при оценке потерь в первой мировой войне. Однако наиболее актуальным является подход Боага. Он отмечал, что метод капитализации заработков в оценивании человеческого капитала является более предпочтительным, поскольку с его помощью оценивается стоимость материальных вещей, в то время как метод стоимости производства может включать затраты на индивидуума в отрыве от их влияния на увеличение его способности зарабатывать. «Валовой» метод, с его точки зрения, является более предпочтительным в случае оценивания денежных потерь в результате войны: "в расчетах материальных потерь потери дохода обычно сравниваются с общим национальным доходом, а не с национальными сбережениями, и, следовательно, часто лучше рассматривать капитализированную стоимость уменьшения валового дохода, а не прибавочного".

Хотя Нассау У. Сениор ранее отмечал это, Гарольд Боаг был первым, кто четко определил одну из трудностей, связанных с методом оценки человеческого

капитала по стоимости производства: явно невозможно определить, как много затрат на образование, содержание и т.п. точно необходимо для производства получателя дохода, рассматриваемого отдельно от его способностей "любить, наслаждаться, восхищаться, которые могут не сопутствовать производству материального богатства".

Аналитическая схема человеческого капитала используется западными экономистами для тех же самых целей, что и обычный капитал, а именно для показа экономической выгоды миграции, инвестиций в здоровье, предотвращение преждевременных смертей, в образование и т.д.

Примечателен пример произошедший в Соединенных Штатах Америки в конце 19 века, связанный с денежной ценностью иммигрантов для Соединенных Штатов. Существовало всеобщее мнение, что иммиграция экономически выгодна для США, и это находилось в соответствии со свойствами концептуальной схемы человеческого капитала. Существовали, тем не менее, некоторые вопросы, касающиеся степени выгоды и методов исчисления денежной ценности иммигрантов. Среди экономистов, а также экономистов-социологов, исследовавших эту проблему выделяются следующие:

Фридрих Кнапп, немецкий политэконом, использовал метод стоимости производства Энгеля без учета обесценения и затрат на содержание человека для оценки капитальной стоимости иммигрантов, прибывающих в США. Он заключил, что если уровень иммиграции останется прежним, то страна будет получать примерно миллион долларов в день в стоимости человеческого капитала.

Мейо-Смит применял процедуру капитализации чистых заработков и считал, что иммигрант, имеющий способности и ищущий возможность их применить, обладает денежной ценностью, не меньшей затрат на его производство, для страны, в которую он приезжает. Вместе с тем он отмечал, что этот метод дает ошибки, так как капитализированная стоимость будущих заработков иммигрантов зависит от существующих возможностей получить работу, не лишая её других рабочих. Иначе, считал он, запас человеческого капитала в стране, принимающей иммигрантов, не будет возрастать.

В первой четверти двадцатого века появилось несколько работ, авторы которых использовали аналитическую схему человеческого капитала в попытках определить денежные потери из-за могущих быть предотвращенными болезней и смертей. Их мысль сводится к тому, что болезни и преждевременные смерти приводят к потерям человеческого капитала и что эффект от его накопления может быть увеличен путем предупреждения и отсрочки болезней и смертей в той степени, в какой это возможно.

Рассматривая проблемы образования, Дж.Р. Уолш отметил, что со времен У. Петти, многие экономисты включали человека в категорию фиксированного капитала, поскольку подобно капиталу человек требует затрат на создание и служит для возвращения этих затрат с прибылью. Важное заключение которое следует из его работ состоит в том, что ценность образования, полученного в

колледже, нередко превосходит затраты на его приобретение. Увеличение дохода мотивирует индивидуумов на развитие их интеллектуального потенциала путем образования и повышения квалификации. Авторы, ссылаясь на труды Ф. Нойманна выделяют образование как наиболее существенный элемент человеческого капитала (наряду с такими его элементами, как запасы здоровья и практические навыки). Вопросу значения высшего образования в последние десятилетия много внимания уделяют Т.В. Шульц, Г. Беккер и другие западные экономисты.

Уолш эмпирически пытался дать ответ на вопрос, являются ли затраты на образование человека для его профессиональной карьеры инвестициями в капитал, производимыми с целью получения прибыли, с установлением рыночного равновесия и являются ли они откликом на те же мотивы, которые приводят к инвестициям в обычный капитал. Он утверждал, что они являются таковыми. Для проверки своей гипотезы он взял данные о заработках людей с разными уровнями образования. Их капитальная оценка была получена с помощью метода капитализации заработков для каждого уровня возрастов, при которых заканчивается образование.

Стоимость различных уровней образования Уолш вычислил методом стоимости производства и затем сравнивал эту стоимость и капитальную ценность, предполагая, что они стремятся друг к другу. Он вычислил также капитальную ценность и стоимость профессионального обучения и нашел, что стоимость превосходит ценность для людей, имеющих научные степени магистра, доктора и т.д.

Причину Уолш видел в том, что рассматривается только денежный оборот, а ученые с этими степенями получают особое удовлетворение и потребительские ценности, например, возможность путешествовать, длительные отпуска и каникулы, разного рода услуги. Учет этих факторов будет увеличивать капитальную ценность и приближать оценку ценности к стоимости. Ценность превосходит стоимость для инженеров, людей со степенью бакалавра и юристов, так как имеет место краткосрочное превышение спроса на эти профессии над их предложением и со временем, по мере подготовки специалистов по данным профессиям будет обучено больше людей и ценность станет равной стоимости.

Заключение

Развитие, накопление и использование способностей человека к труду уже два с лишним века интересуют экономистов-теоретиков. Уже В. Петти, А. Смит, Дж. С. Милль и К. Маркс включали развитые полезные способности человека в понятие основного капитала. В 19 веке не прерывалась дискуссия о необходимости и целесообразности трактовки человека и его способностей как своеобразного основного капитала. Такие известные экономисты, как Жан-Батист Сэй, Джордж Маккуллох, Нассау Сениор, Вальтер Рошер, Генри Маклеод, Леон Вальрас, Иоганн

фон Тюнен, Ирвин Фишер считали возможной и полезной трактовку человека как основного капитала. Для оценки величины человеческого капитала использовались методы "стоимости производства" и "капитализации заработков" (или их комбинации). Аналитическая схема человеческого капитала применялась для показа экономической выгоды миграции, инвестиций в здоровье, в образование, экономических потерь от болезней, войн и т.п.

Из трактовки человека как основного капитала непосредственно вытекала необходимость разработки количественной оценки человеческого капитала. Метод "стоимости производства", восходящий к А. Смиту, заключается в оценивании реальных затрат на "производство человека" (чистого расхода средств существования). Второй метод - "капитализация заработков" восходит к У.Петти и заключается в оценивании настоящей (приведенной к настоящему моменту времени) ценности будущего потока доходов индивидуума (чистого или валового дохода). У. Фарр, Э. Энгель, Т. Витстейн разработали методы экономической оценки человека, практически применимые в сфере страхования жизни. Американские экономисты Л.Дублин и А.Лотка усовершенствовали методику Т. Витстейна и Э. Энгеля и сделали её пригодной для оценки как величины человеческого капитала, так и его компонентов.

Экономические оценки человеческого капитала стали широко использоваться как на микроэкономическом, так и макроэкономическом уровнях для определения величины национального богатства, потерь общества от войн, болезней и стихийных бедствий, в сфере страхования жизни, выгоды инвестиций в образование, здравоохранение, миграцию и для многих других целей.

ЛИТЕРАТУРА

МЕТОДОЛОГИЯ ЭКОНОМИЧЕСКОЙ НАУКИ, КАК ЭКОНОМИСТЫ ПОЗНАЮТ МИР

Составитель *Авсянский Валентин Николаевич*

Печатается в авторской редакции

Подписано в печать: _____. Формат _____. Бумага (офсетная).

Тираж ____ экз. Заказ ____