

НОВАЯ РЕАЛЬНОСТЬ

Славянская школа в экономике и прогнозировании

Среди множества школ в экономике и прогнозировании преобладали школы западного образца. В чем причина такого положения дел? Можно ли говорить о существовании славянской школы? Факты успешных прогнозов смены трендов в мировой экономике позволяют говорить о формировании славянской школы в экономике и прогнозировании. Например, Наталья Чистякова-Ярославова спрогнозировала резкое падение цен на нефть в июле 2008 г., а независимо от нее Александр Бандура также спрогнозировал сначала резкий скачок цены нефти (в 2007-2008 гг.) с последующим ее резким падением (2008 г.) в совокупности с точным прогнозом начала текущей рецессии в США. Каковы же отличительные признаки этой школы?



Александр БАНДУРА

к. т. н., доцент экономического факультета НАУКМА
banduraon@ukroil.com.ua

Любая экономическая модель (теория) или их группа, объединенная общей методологией построения в экономическую школу, имеет смысл и создается для адекватного описания, анализа и, самое главное, прогнозирования реальности. Поэтому экономические решения, принимаемые по результатам анализа и прогнозирования, являются фактическим отражением состояния экономических теорий и школ.

Среди множества экономических школ можно выделить такие наиболее известные: гарвардская, чикагская, австрийская, кейнсианская (английская), монетаристская (неоклассическая), «мейнстрим» и так далее. Теории в рамках каждой из школ в свое время и при определенных рыночных условиях (конъюнктуре) адекватно описывали реальность, что и обеспечило их временный успех. Однако при смене конъюнктуры, практически с наступлением очередной рецессии, теории становились неадекватными, а прогнозы, соответственно, ошибочными.

Так было и с текущей рецессией. Ни одна теория в рамках известных школ не предсказала однозначно точное время начала рецессии и резких колебаний цен на товарных и фондовых рынках. Подтверждением тому служат многочисленные банкротства ведущих финансовых (Lehman Brothers, AIG...) и промышленных (General Motors, Chrysler...) корпораций. Точнее, некоторые экономисты допускали возможность рецессии, однако считали такой сценарий

маловероятным, оценивая его вероятность до 30%. При этом они не указывали возможного времени ее начала, что делало их прогноз практически бесполезным.

Все модели анализа и прогнозирования, которые созданы в рамках известных экономических школ, можно разделить на два типа: *структурные (теоретические)* и *неструктурные (статистические)*.

Одной из главных проблем экономических школ, исповедующих структурные модели, – невозможность анализа и прогнозирования в реальном времени, поскольку все законы экономики, сформулированные в рамках любой из школ, являются локальными. Не существует ни одного общего закона, справедливого для всех возможных комбинаций рыночной конъюнктуры. На этот факт обращает внимание, например, российский экономист, академик РАН В. М. Полтерович. Он считает, что структурные модели пребывают в глубоком кризисе, выход из которого возможен при наличии хотя бы одного общего, фундаментального закона, справедливого для любого состояния конъюнктуры.

На эту же проблему, но лет на двадцать ранее указывал П. Самуэльсон, Нобелевский лауреат, анализируя локальный характер моделей бизнес-цикла, предложенных в рамках известных школ экономики. Он отмечал, что невозможно однозначно определить первопричину бизнес-цикла (рецессии), поскольку все факторы, которые претендуют на роль первопричины в той или иной модели,

являются функционально взаимозависимыми. Иными словами, между ними не существует причинно-следственной связи. Любой из известных факторов (законов) может быть «назначен» первопричиной, а все остальные факторы можно объяснить, опираясь на этот фактор. Однако при смене конъюнктуры мы вынуждены «переназначить» другой фактор первопричиной, и на его основе объяснить остальные. Тем самым невозможно создать общую модель, которая бы описывала бизнес-цикл при любой конъюнктуре рынка, то есть все модели бизнес-цикла в рамках известных школ носят частный характер, являются локальными.

Как спрос, так и предложение зависят от большого количества разнородных, часто не связанных между собой факторов, между которыми если и существуют причинно-следственные связи, то их еще никому не удалось описать в общем виде. К числу таких факторов относятся, например, психологические и технологические. Подчеркивая эту разницу, российский экономист Н. Кондратьев классифицировал в 20-е годы XX века все динамические процессы на трендовые (количественные) и колебательные (качественные). Эти факторы (процессы) настолько разные, что школы экономики тоже можно классифицировать по способу описания взаимодействия между психологическими и технологическими факторами, между колебательными и трендовыми процессами.

Главной проблемой для всех школ была задача каким-то об-



Где начало того конца, которым оканчивается начало?
(Козьма Прутков)

ЧИСЛО

30%

Экономисты в своих прогнозах допускали возможность рецессии, однако считали такой сценарий маловероятным, оценивая его вероятность не более 30%.

разом объединить эти принципиально разные динамические процессы в одно целое, объяснив природу (механизм) этого взаимодействия. Эта задача оказалась такой сложной, что экономические школы на заре своего развития пытались просто игнорировать один из видов этих процессов, предполагив, что один доминирует над другим при определенных экономических условиях.

Так, например, один из основателей австрийской школы Ф. Визер придавал настолько большое значение именно психологическим факторам, колебательным процессам, что вообще считал экономику прикладным разделом психологии. При этом представители ранней австрийской школы пытались объяснить технологические (трендовые) процессы на базе психологических (колебательных). А представители марксистской школы, наоборот, игнорировали психологические процессы (рынок), придавая исключительное значение трендовым (количественным). Очевидно, что игнорируя тот или иной аспект реальности, невозможно адекватно ее описать.

Своеобразный выход из этого тупика предложил А. Маршалл, представитель американской школы, который отказался от попыток объяснить природу связи между трендовыми и колебательными процессами, сосредоточившись на изучении их баланса в обезличенном монетарном измерении (спроса и предложения). Однако такой подход в конечном итоге и привел к возникновению другого рода проблем, которые мож-

но назвать фундаментальными, поскольку в рамках известных школ их невозможно корректно устранить. Эти проблемы можно свести к так называемой проблеме «заколдованного круга» в экономических оценках: цены определяются затратами производства, которые, в свою очередь, зависят от цен. Именно так можно объяснить локальность законов экономики (В.М. Полтерович), функциональный характер связи между факторами, лежащими в основе макроэкономической динамики (П. Самуэльсон) и наличие фундаментальных («неустрашимых») проблем моделей известных экономических школ.

К числу таких фундаментальных проблем относится, например, вынужденное искажение представления о динамике в рамках всех структурных моделей. Например, динамика вынужденно понималась как движение во времени искусственного стационарного (стабильного) состояния, в рамках которого параметры всегда остаются статичными. Интересно, что этот факт привлекает внимание экономистов уже почти последние сто лет (Струве, Н. Кондратьев, Кларк, Дж. Сорос), однако ситуация не меняется. Любопытно отметить, что Струве и Дж. Сорос объясняли искажение динамики статичностью математических методов, пришедших в экономику из технических наук. Тем не менее, в самих технических науках никакого искажения динамики не наблюдается. Забегая немного вперед, скажем, что с позиций *славянской школы* искажение динамики в экономике – это внешнее проявление проблемы «заколдованного круга» в экономических оценках. Экономисты просто вынуждены вводить такие искусственные категории как «стабильное», «стационарное» состояние, чтобы иметь хоть какую-то точку отсчета в мире постоянных колебаний конъюнктуры.

Еще одной проблемой моделей является многообразие факторов, определяющих баланс спрос-предложение. Это

приводит к тому, что один-два фактора анализируются, а действие остальных неизбежно устраняется допущениями, по образцу «при прочих равных условиях». Только эти примеры могут объяснить непригодность структурных моделей для прогнозирования реальной экономики. Вместе с тем, преимуществом структурных моделей является возможность объяснить природу того или иного экономического процесса, пояснить причину смены тенденций в экономике.

Невозможность анализа макроэкономической динамики (бизнес-циклов) в реальном времени с помощью структурных моделей привела к созданию неструктурных. К примеру, представители гарвардской школы (У. Митчелл) пытались, анализируя обширные статистические данные, получить какие-либо устойчивые причинно-следственные связи между данными, что позволило бы прогнозировать бизнес-цикл в реальном времени (метод лидирующих индикаторов). Однако все неструктурные методы имеют общие недостатки: невозможность отличить реальный сигнал о смене тенденции от фальшивого и отсутствие каких-либо пояснений, почему вообще возник фальшивый сигнал.

Таким образом, ни структурные, ни неструктурные модели в рамках известных экономических школ не могут оградить нас от неожиданности ре-

■ Методологический подход славянской школы прогнозирования открывает возможности для формулировки общих, а не локальных законов экономики. Предлагаем нашим Читателям обсудить проблему прогнозирования цен нефтяного рынка и как следствие, уровня доходов в новом блоге нефтяного обозрения «Терминал» – <http://oilblog.com.ua>

ФРАЗА НОМЕРА

АЛЕКСАНДР БАНДУРА,
к. т. н., доцент экономического факультета НАУКМА

Ни структурные, ни неструктурные модели в рамках известных западных экономических школ не могут оградить нас от неожиданности рецессий, финансовых кризисов и скачков цен на нефть. Между тем, такие экономисты, как М. Туган-Барановский и Н. Кондратьев, заложили основы принципиально нового подхода к анализу экономической динамики (реальности), а философская база под эти основы была заложена в работах академика В. Вернадского.

цессий, финансовых кризисов и скачков цен на нефть.

Такие экономисты, как М. Туган-Барановский и Н. Кондратьев, заложили основы принципиально нового подхода к анализу экономической динамики (реальности), а философская база под эти основы была заложена в работах ака-

ставителя американских школ А. Маршалла, поскольку графически, внешне, они выглядят схожими. Но между ними есть принципиальная разница. У А. Маршалла баланс процессов в сферах обмена и производства выражается только в монетарных единицах измерения, что в случае несовершен-

зволяет устранить отмеченные выше недостатки как структурных, так и неструктурных моделей (корректно решив проблему «заколдованного круга») и разработать синтезирующую модель, которая объединяет лучшие черты обоих классов моделей. Это дает возможность анализировать и прогнозировать в общем случае экономическую динамику в реальном времени при любой конъюнктуре рынков.

Таким образом, методологический подход *славянской школы* открывает возможности для формулировки общих (а не локальных) законов экономики. Например, ресурсная модель в *общем виде* определяет *первопричину экономической динамики* как суммарное несовершенство рынков, приводящее к использованию неэффективных технологий. А технологическая неэффективность измеряется величиной *скрытого дефицита ресурсов*, вовлеченного в производство ВВП. При этом любой из локальных факторов, что определяет причину цикла в известных школах, может рассматриваться как видимое проявление скрытого дефицита при текущей рыночной конъюнктуре. Между локальными факторами известных школ и скрытым дефицитом в ресурсной модели существует причинно-следственная (а не функциональная) связь, что позволяет в общем виде объяснить и прогнозировать бизнесциклы. Подтверждением преимущества методологического подхода *славянской школы* служит успешное описание на базе ресурсной модели экономики США за 40 лет и Испании за 18 лет, чего не удавалось достичь в рамках ни одной из известных школ.

Говорят, что первым экономистом был Колумб. Когда он отправился открывать Америку, он не знал, куда направляется. Когда он ее достиг, он не знал, где находится. И все это он сделал на государственные средства.

