

Дэни Родрик

Экономика решает:
сила и слабость
«мрачной науки»

 **ВТБ24**
Банк развития

ИЗДАТЕЛЬСТВО
ИНСТИТУТА
ГАЙДАРА

Dani Rodrik

Economics Rules

The Rights and Wrongs of
the Dismal Science

330.1

330.101.

P-615

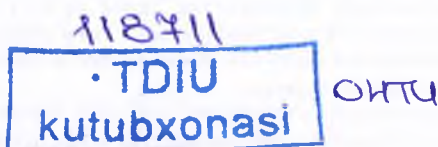
Дэни Родрик

Экономика решает

Сила и слабость
«мрачной науки»

Перевод с английского

Екатерины Головляницыной



ИЗДАТЕЛЬСТВО
ИНСТИТУТА
ГАЙДАРА

МОСКВА • 2016

330.1

330.101

УДК 330.1

ББК 65.01

Р60

Р-615

Издание осуществлено при финансовой поддержке
банка ВТБ 24 (ПАО)

Родрик, Д.

Р60 Экономика решает: сила и слабость «мрачной науки» [Текст] / пер. с англ. Е. Головляницыной. М.: Изд-во Института Гайдара, 2016. — 256 с.

ISBN 978-5-93255-444-9

После глобального финансового кризиса профессия экономиста не в почете. И хотя многие сейчас осуждают и высмеивают экономистов, спрос на их услуги велик как никогда. Чтобы разобраться с этим парадоксом, нам необходимо понять как сильные, так и слабые стороны экономической науки.

Дэни Родрик утверждает, что сила экономики состоит в сосуществовании множества теоретических подходов — того, что экономисты называют «моделями». Экономисты способны держать в уме множество различных, подчас противоречивых моделей мира. При правильном подходе это позволяет им понимать мир, выдвигать предложения по его улучшению и накапливать знания. Именно это делает экономику «наукой», хотя и не похожей на физику или другие точные и естественные науки, но все же наукой.

ECONOMICS RULES

Copyright © 2015, Dani Rodrik

All rights reserved

© Издательство Института Гайдара, 2016

ISBN 978-5-93255-444-9

Содержание

- Предисловие и благодарности · 9
- Введение. Правильное и неправильное использование экономических понятий · 14
- Глава 1. Что делают модели · 22
Многообразие моделей · 25; Модели как басни · 32; Модели как эксперименты · 36; Нереалистичные предположения · 40; О моделях и математике · 45; Простота против сложности · 54; Простота, реализм и реальность · 61
- Глава 2. Наука экономического моделирования · 63
Проясняя гипотезы · 65; Когда обычная интуиция нас подводит · 75; Научный прогресс и последовательная смена моделей · 84; Модели и эмпирические методы исследований · 94; Модели, авторитет и иерархия · 98; Ошибочное vs. то, что не дотягивает до ошибки · 103
- Глава 3. Навигация между моделями · 105
Диагностика для стратегии роста · 108; Общие принципы выбора модели · 117; Верификация критически важных предпосылок · 117; Верификация механизмов · 122; Верификация прямых следствий · 124; Верификация побочных следствий · 135; Снова о внешней валидности · 138
- Глава 4. Модели и теории · 139
Теория стоимости и ее распределения · 143; Теория циклов деловой активности и безработицы · 152; Теории как объяснения конкретных событий · 165; На самом деле теории — просто модели · 173
- Глава 5. Когда экономисты ошибаются · 175
Ошибки бездействия: финансовый кризис · 181; Ошибки действия: Вашингтонский консенсус · 189; Психология

и социология экономики · 199; Власть и ответственность · 206

Глава 6. Экономическая наука и ее критики · 209

Пересматривая привычные критические аргументы · 211; Проблема ценностей · 218; Недостаток плюрализма · 231; Амбиции и умеренность · 244

Эпилог. Двадцать заповедей · 249

Десять заповедей для экономистов · 249; Десять заповедей для неэкономистов · 250

*Посвящается моей матери
Кармеле Родрик
и памяти моего отца
Виталия Родрика.
Они дали мне любовь к знанию
и возможность получать его.*

Предисловие и благодарности

В ОСНОВУ этой книги лег курс лекций по политэкономии, который я и Роберто Мангабейра Унгер несколько лет читали в Гарвардском университете. Роберто в своей неподражаемой манере заставил меня основательно поразмыслить о сильных и слабых сторонах экономической науки и четко сформулировать, в чем я вижу пользу экономического метода. Роберто утверждал, что наша дисциплина стала бесплодной и утратила новизну потому, что экономисты перестали заниматься «большими» социальными теориями в духе Адама Смита и Карла Маркса. Я, в свою очередь, замечал, что сила экономической науки состоит именно в теориях малого масштаба — особого рода контекстуально обусловленных рассуждениях, которые четко разделяют причины и следствия и тем самым проливают свет — хотя бы отчасти — на социальную реальность. Наука с умеренными претензиями, практикуемая со смирением, говорил я, скорее принесет пользу, чем поиск универсальных теорий устройства капиталистической системы или причин богатства и бедности во всем мире. Не думаю, что сумел его убедить, но надеюсь, что он увидит: его доводы возымели эффект.

Идея озвучить эти соображения в виде книги окончательно оформилась в Институте перспективных исследований, куда я перебрался летом

2013 и где провел два восхитительных года. Большая часть моей научной карьеры прошла в междисциплинарной среде, и я считал себя весьма сведущим — если не искушенным — в различных направлениях социальных наук. Но работа в институте стала упражнением для ума совершенно иного масштаба. Мое новое пристанище, Школа социальных наук в составе института, опиралась на гуманистический и интерпретативный подходы, что резко контрастировало с эмпирическим позитивизмом экономической науки. Общаясь с многочисленными гостями Школы — представителями антропологии, социологии, истории, философии и политической науки, наряду с экономикой, я был потрясен силой подспудного недоверия к экономистам. Мои собеседники считали, что экономисты либо констатируют очевидное, либо применяют простые схемы к сложным общественным явлениям. Порой я чувствовал, что с немногочисленными экономистами в моем окружении обращаются как с «учеными идиотами» общественных наук: они-де хорошо разбираются в математике и статистике, но в остальном от них мало прока.

Парадокс состоял в том, что я встречал подобное отношение раньше — но противоположно направленное. Найдите компанию экономистов и послушайте, что они скажут о социологии или антропологии! С точки зрения экономистов, представители всех остальных социальных наук слишком невняты, недисциплинированы, чересчур полагаются на слова и недостаточно — на эмпирические данные или (альтернативный вариант) несведущи в тонкостях эмпирического анализа. Экономисты умеют мыслить и получать результат, тогда как остальные просто ходят кругами. Так что мне, пожалуй, следовало быть более готовым к встрече

с подозрениями, направленными в обратную сторону.

Одним из неожиданных следствий погружения в водоворот общественных наук Института стало то, что я начал больше уважать себя как экономиста. Долгое время я критиковал моих коллег-экономистов за узость мысли, склонность воспринимать модели буквально и уделять недостаточное внимание социальным процессам. Но я понял, что аргументы многих критиков, не принадлежащих к дисциплине, упускают самое главное. Очень многие неверно представляют себе суть работы экономистов. И я не мог не думать, что ряд практик других социальных наук только выиграли бы, перенея привычное для экономистов внимание к аналитической аргументации и эмпирическим данным.

Вместе с тем я понимал, что в таком положении дел экономистам некого винить, кроме самих себя. Проблема ведь не только в их самодовольстве и нередко доктринерской заикленности на одном способе видения мира. Дело еще и в том, что экономисты очень плохо справляются с задачей представления своей науки всем остальным людям. Немалая часть этой книги посвящена демонстрации того, что экономическая наука включает огромное и постоянно растущее разнообразие понятийных схем, предлагающих разные объяснения устройства мира и различные выводы в отношении государственной политики. И все же то, что неэкономисты обычно слышат от экономистов, звучит как безусловное восхваление рынков, рациональности и эгоистического поведения. Экономисты преуспевают в вероятностных объяснениях социальной жизни — таких, которые ясно показывают, как рынки (и вмешательство в них государства) приводят к разным последствиям в отношении эффективно-

сти, справедливости и экономического роста в зависимости от конкретных обстоятельств. Однако на публике экономисты чаще говорят об универсальных экономических законах, одинаково действующих везде, независимо от контекста.

Я решил, что нужна книга, которая наведет мосты через это разделение — книга, адресованная одновременно и экономистам, и неэкономистам. Экономистам я хочу сообщить, что им следует пересмотреть образ практикуемой ими науки. Я предложу альтернативное видение, которое делает акцент на полезных исследовательских направлениях в экономической науке, но не скрывает заблуждений, к которым склонны ее представители. Неэкономистам я хочу сообщить, что в рамках такого видения значительная часть стандартной критики в отношении экономической науки лишается смысла. Экономическая наука дает много оснований не только для критики, но и для одобрения (и поощрения).

Институт перспективных исследований стал превосходной средой для написания этой книги еще по одной причине. Тихие рощи вокруг, превосходная кухня и изумительные возможности для развития делают его настоящим раем для ученого. Коллеги по Школе — Даниэль Аллен, Дидье Фассен, Джоан Скотт и Майкл Уолцер поощряли мои размышления об экономике и вдохновляли сильно отличающимся от моего, но столь же взыскательным отношением к науке. Мой ассистент Нэнси Коттерман дала полезные комментарии к рукописи в дополнение к поразительно эффективной административной поддержке. Я благодарен руководству Института, и особенно его директору Робберту Дейкграафу, за предоставленную мне возможность быть частью этого выдающегося сообщества интеллектуалов.

Помощь и советы Эндрю Уайли помогли книге попасть в правильные руки, а именно в издательство *W. W. Norton*. Там Брендан Карри превосходно отредактировал, а Стефани Хейберт тщательно вычитала рукопись; их правки значительно улучшили книгу. Особая благодарность Авинашу Дикситу — ученому, являющему пример достоинств экономистов, о которых рассказывает книга, за подробные комментарии и предложения. Мои друзья и соавторы Шарун Муканд и Арвинд Субраманиан щедро уделяли мне свое время, а их идеи и советы задали форму всего проекта. Последнее, но не менее важное: я, как всегда, в глубочайшем долгу перед моей женой Пинар Доган, которая дарила мне любовь и поддержку, а также помогла прояснить мои доводы и рассуждения по поводу экономических концепций.

ВВЕДЕНИЕ

Правильное и неправильное использование экономических понятий

В ИЮЛЕ 1944 ГОДА в курортном городке Бреттон-Вудс в штате Нью-Хэмпшир собрались делегаты от сорока четырех стран, чтобы создать послевоенный международный экономический порядок. Они разъедутся через три недели, разработав глобальную систему, которая просуществует более трех десятков лет. Эта система — плод трудов двух экономистов: титана экономической профессии из Англии Джона Мейнарда Кейнса и чиновника из Министерства финансов США Гарри Декстера Уайта¹. Кейнс и Уайт расходились во мнениях по многим вопросам, особенно по тем, в которых затрагивались государственные интересы, но их объединяло общее мировоззрение, сформированное опытом периода между мировыми войнами. Они стремились предотвратить в будущем такие резкие колебания, каки-

1. До сих пор идут споры о том, был ли Уайт на самом деле советским шпионом. Страстные обвинения против Уайта выдвинуты в книге: Benn Steil, *The Battle of Bretton Woods: John Maynard Keynes, Harry Dexter White, and the Making of a New World Order* (Princeton, NJ: Princeton University Press, 2013). Доводы в защиту позиции Уайта см.: James M. Boughton, "Dirtying White: Why Does Benn Steil's History of Bretton Woods Distort the Ideas of Harry Dexter White?" *Nation*, June 24 (2013).

ми стали последние годы действия золотого стандарта и Великая депрессия. Они оба считали, что для достижения этой цели необходимы фиксированные, но допускающие коррекцию валютные курсы; либерализация международной торговли, но не потоков капитала; расширение сфер применения государственной кредитно-денежной и налоговой политики; более плотное сотрудничество двух новых международных агентств — Международного валютного фонда и Международного банка реконструкции и развития (который получил известность как Всемирный банк).

Систему Кейнса и Уайта ждал необычайный успех. Она привела развитые рыночные экономики к периоду невиданного ранее экономического роста и стабильности; также улучшились показатели развития стран, недавно получивших независимость. Причиной крушения этой системы в 1970-х годах стало то самое усиление движения спекулятивного капитала, против которых предостерегал Кейнс. Но она остается образцовым примером конструирования глобальных институтов. Каждое успешное преобразование в мировой экономике сопровождалось громкими заявлениями реформаторов о «новом Бреттон-Вудсе».

В 1952 году экономист из Колумбийского университета по имени Уильям Викри разработал новую систему ценообразования для нью-йоркского метрополитена. Он рекомендовал повысить стоимость проезда в пиковые часы на загруженных линиях и снизить цены на проезд в другое время на прочих линиях. Система ценообразования в зависимости от плотности транспортного потока стала результатом применения экономических идей спроса и предложения к сфере общественного транспорта. Дифференцированные тарифы по-

ощряют пассажиров с гибким расписанием дня избегать поездок в пиковые часы. Они обеспечивают более равномерное по времени распределение пассажиропотока, снижая нагрузку на транспортную систему и одновременно увеличивая общее количество перевезенных пассажиров. Позднее Викри создал похожую систему для автомобильных дорог и автотранспорта. Но многие считали его идеи безумными и неосуществимыми на практике.

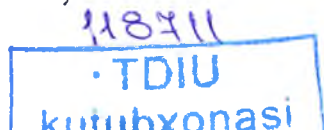
Первой страной, испытавшей в деле ценообразование в зависимости от плотности транспортного потока, стал Сингапур. В 1975 году сингапурские водители начали платить пошлину за въезд в деловой центр города. В 1998 году эту систему сменил электронный сбор платежей, что дало возможность устанавливать размер пошлины на основании средней скорости транспортного потока. По всеобщему признанию, эта система обеспечила сокращение пробок, повышение пользования общественным транспортом, снижение выбросов углекислого газа и существенную прибавку к доходным статьям сингапурских властей. Видя такие успехи, различные варианты этой системы применили и в других крупных городах — Лондоне, Милане и Стокгольме.

В 1997 году профессор экономики Бостонского университета Сантьяго Леви, служивший в своем родном Мехико заместителем министра финансов, решил кардинально изменить подход правительства к борьбе с бедностью. Существующие программы предполагали помощь бедным преимущественно в форме субсидирования расходов на питание. Леви утверждал, что такие программы дороги и не достигают намеченной цели. Из ключевых постулатов экономической науки следует, что в вопросе помощи бедным прямые денежные субсидии

эффективнее субсидирования цен на определенные потребительские товары. Леви также полагал, что прямые субсидии станут рычагом, который позволит в конечном счете улучшить здоровье и повысить уровень образования населения. Матери будут получать помощь наличными деньгами; со своей стороны они постараются обеспечить своим детям возможность учиться в школе и получать медицинскую помощь. Говоря языком экономистов, данная программа создает для матерей стимулы инвестировать в детей.

Программа *Progresa* (впоследствии переименованная в *Oportunidades*, а затем в *Prospera*) стала первой крупной программой обусловленных денежных трансфертов (ОДТ), примененной в развивающейся стране. Поскольку программу предполагалось вводить поэтапно, Леви разработал хитроумную процедуру реализации, которая позволяла достоверно оценить результативность программы. Весь проект опирался на базовые правила экономической науки, но в корне изменил представления разработчиков социальной политики о программах по борьбе с бедностью. Когда появились положительные результаты, программа стала образцом для других стран. Похожие программы появились в более дюжины государств Латинской Америки, включая Бразилию и Чили. Пилотная программа ОДТ осуществлялась даже в Нью-Йорке под руководством мэра Майкла Блумберга.

Три группы экономических идей сработали в трех разных сферах — мировая экономика, городской транспорт и борьба с бедностью. В каждом случае экономисты перестраивали часть нашего мира, приложив несложные экономические концепции к общественно значимым проблемам. Эти примеры лучше всего отражают суть экономиче-



ской науки, но есть и много других: теория игр использовалась для определения правил аукционов при распределении частот в телекоммуникационной отрасли; модели рыночного дизайна помогли медикам организовать прикрепление местных жителей к медицинским учреждениям; модели отраслевых рынков организации легли в основу антимонопольной политики; а недавние открытия макроэкономической теории привели к тому, что центральные банки многих стран начали широко применять политику таргетирования инфляции². Когда экономисты все делают правильно, мир становится лучше.

Но экономисты часто ошибаются, как показывает множество примеров в этой книге. Я написал ее, чтобы объяснить, почему экономисты иногда оказываются правы, а иногда — нет. В центре книги — «модели», абстрактные, обычно выраженные математическим языком концепции, с помощью которых экономисты постигают мир. Модели — это и сила экономики, и ее ахиллесова пята; именно они делают экономику наукой — не такой, как квантовая физика или молекулярная биология, но тем не менее наукой.

Экономика использует не одну универсальную модель, а набор различных моделей. Развиваясь,

2. R. Preston McAfee and John McMillan, «Analyzing the Airwaves Auction», *Journal of Economic Perspectives* 10, no. 1 (Winter 1996): 159–175; Alvin E. Roth and Elliott Peranson, «The Redesign of the Matching Market for American Physicians: Some Engineering Aspects of Economic Design», *American Economic Review* 89, no. 4 (1999): 748–780; Louis Kaplow and Carl Shapiro, *Antitrust*, NBER Working Paper 12867 (Cambridge, MA: National Bureau of Economic Research, 2007); Ben Bernanke et al., *Inflation Targeting: Lessons from International Experience* (Princeton, NJ: Princeton University Press, 1999).

эта научная дисциплина расширяет свою библиотеку моделей и добивается все большего соответствия моделей и реальности. Разнообразие моделей в экономике необходимо в условиях изменчивого социального мира. В разных обстоятельствах нужны разные модели. Экономисты едва ли когда-либо создадут универсальные модели, пригодные для любых обстоятельств.

Неэкономисты склонны неправильно использовать свои модели — отчасти потому, что берут за образец естественные науки. Они нередко ошибочно рассматривают модель (одну из многих) как универсальную, уместную и применимую в любых обстоятельствах. Экономистам следует побороть этот соблазн. Они должны тщательно отбирать модели в соответствии с изменением обстановки или при переходе от одной ситуации к другой. Они должны научиться более гибко переключаться между моделями.

Эта книга и чувствует, и критикует экономистов. Я защищаю ядро экономической науки — роль экономических моделей в создании знания, но критикую определенный способ экономических изысканий и использования (в том числе неправильного) экономических моделей. Доводы, которые я привожу, не являются «официальной линией партии». Подозреваю, что многие экономисты не согласятся с моим видением экономической науки, особенно с моими взглядами на то, какого именно типа наукой является экономика.

Общаясь со многими неэкономистами и представителями других наук об обществе, я часто поражался их представлениям об экономике. Многие основания для недовольства общеизвестны: экономическая наука все чрезмерно упрощает и рассматривает вне контекста; претендует на универ-

сальность, игнорируя роль культуры, истории и прочих обстоятельств; превозносит рынок; опирается на множество скрытых ценностных суждений и к тому же не умеет объяснять и предсказывать происходящее в экономике. Каждое из этих критических замечаний во многом происходит из непонимания того, что экономическая наука является собранием разнородных моделей, у которых нет определенного идеологического уклона и которые не приводят к одному и тому же выводу. Конечно, в той степени, в которой сами экономисты забывают об этой разнородности экономических моделей, часть вины лежит и на них.

И еще одно уточнение, прежде чем начать. Термин «экономическая наука» (*economics*) стал использоваться в двух разных смыслах. Одно определение делает акцент на содержательном аспекте исследований; в такой интерпретации экономическая наука — это одна из наук об обществе, цель которой — понять, как устроена экономика. Второе определение делает акцент на методах: экономическая наука — это один из способов изучения общества с применением определенных инструментов. В такой интерпретации дисциплина ассоциируется с аппаратом математического моделирования и статистическим анализом, а не с определенными гипотезами или теориями относительно экономики. Отсюда следует, что экономические методы можно применить, помимо экономики, ко многим другим сферам — начиная от принятия решений в семье и заканчивая вопросами о политических институтах.

Я использую термин «экономическая наука» во втором смысле. Все, что я скажу о преимуществах моделей и об их неправильном использовании, в равной степени применимо к исследованиям

в политологии, социологии или праве, основанных на близких подходах. Публика обычно связывает эти методы только с работами наподобие тех, о которых рассказывается в «Фрикономике». Данный подход, основанный на тщательном эмпирическом анализе и логике «стимул-реакция», который популяризировал экономист Стив Левитт, использовался для исследования самых разных социальных явлений, начиная от стратегий борцов сумо и заканчивая мошенничеством со стороны учителей государственных школ³. Некоторые критики считают, что такого рода работы опощляют экономическую науку. Они отказываются от рассмотрения серьезных вопросов — в каком случае рынки работают успешно, а в каком — нет; что обеспечивает экономический рост; как достичь компромисса в стремлении к полной занятости и к стабильности цен, и других — в пользу изучения обыденных, повседневных сюжетов.

В этой книге я основное внимание уделяю как раз таким серьезным вопросам и тому, как экономические модели помогают их решать. Мы не должны искать в экономической науке универсальные объяснение или рекомендации на любой случай, независимо от обстоятельств. Разнообразие социальной жизни слишком велико, чтобы втиснуть его в одну универсальную схему. Но каждая экономическая модель подобна карте одного участка местности. Вместе взятые, экономические модели — это лучший способ исследования бесконечных холмов и долин, составляющих наш социальный опыт.

3. Steven D. Levitt and Stephen J. Dubner, *Freakonomics: A Rogue Economist Explores the Hidden Side of Everything* (New York: Harper & Collins, 2005); Стивен Левитт и Стивен Дабнер, *Фрикономика* (Москва: Манн, Иванов и Фебрер, 2010).

Что делают модели

В 1973 ГОДУ экономист шведского происхождения Аксель Лейонхувуд опубликовал небольшую статью под названием «Жизнь экононов». Это было очаровательное псевдоэтнографическое описание всех подробностей типичных практик, статусных отношений и табу среди экономистов. Как разъяснял Лейонхувуд, «племя экононов» определяется приверженностью его членов к тому, что он назвал «модли» — отсылка к упрощенным математическим моделям, которые являются основным рабочим инструментом экономиста. Хотя модли не имеют никакого очевидного практического применения, но чем более искусно и с более сложными ритуалами выделан модль, тем выше статус его владельца. Пристрастие экононов к модлям, пишет Лейонхувуд, объясняет их презрение к членам других племен, таких как «социоги» и «политоги», — ведь эти племена не делают модли¹.

Слова Лейонхувуда остаются актуальны и сорок лет спустя. Обучение экономике в значитель-

1. Axel Leijonhufvud, «Life among the Econ», *Western Economic Journal* 11, no. 3 (September 1973): 327. Со времени выхода статьи использование моделей получило широкое распространение и в других общественных науках, особенно в политологии.

ной степени сводится к изучению сменяющих друг друга моделей. Пожалуй, самый важный фактор, определяющий шансы на успех в этой профессии, — это способность создавать новые модели или применять уже существующие на новом эмпирическом материале, чтобы объяснить какой-либо аспект социальной реальности. Релевантность и применимость той или иной модели — вот вокруг чего идут самые ожесточенные споры среди экономистов. Хотите тяжко ранить экономиста — скажите ему: «У вас нет модели».

Модели — основание для гордости. Начните общаться с экономистами, и в скором времени вам на глаза попадется кружка или футболка с надписью «Экономисты делают это с моделями». Вы также поймете, что большинству из них больше нравится забавляться с математическими построениями, чем тратить время на попытки уловить суть явлений реального мира. (Тут нет никакого сексизма: моя жена, тоже экономист, как-то получила такую кружку в подарок от своих студентов в конце семестра).

С точки зрения критиков, именно приверженность экономистов моделям является причиной почти всех недостатков нашей профессии: сведение сложной социальной жизни к нескольким упрощенным взаимосвязям, готовность полагаться на очевидно не соответствующие действительности предпосылки, одержимость выверенностью математических построений в ущерб реалистичности, склонность одним махом переходить от упрощенной абстракции к рекомендациям по государственной политике. Они находят непостижимой легкостью, с которой экономисты перескакивают от страницы уравнений к выводам в защиту, скажем, свободы торговли или определенной нало-

говой политики. Другие обвиняют экономистов в том, что они лишь усложняют и без того очевидное. Экономические модели облачают здравый смысл в математические формулы. И среди самых непримиримых критиков такого рода — те экономисты, которые решили отклониться от ортодоксальной экономической науки. Считается, что выдающийся экономист Кеннет Боулдинг сказал: «Математика придает экономической науке строгости; к несчастью, она также делает ее безжизненной»². Как заметил Ха-Джун Чанг, экономист из Кембриджского университета, «95% экономической теории — это всего лишь здравый смысл, которому придали сложный вид с помощью специальной терминологии и математики»³.

В действительности же создаваемые экономистами простые модели совершенно необходимы для понимания того, как устроено общество. Их делают ценными именно простота, формализация и отказ учитывать многие обстоятельства реального мира. Эти качества — необходимая особенность, а не ошибка. Полезной модель делает ее способность ухватить некий аспект реальности. Абсолютно необходимой (при правильном применении) модель становится тогда, когда может ухватить *наиболее релевантный в данном контексте аспект реальности*. Различные контексты — разные рынки, социальные условия, страны, эпохи и так далее — требуют разных моделей. На этом месте экономисты обычно и спотыкаются. Они часто от-

2. В оригинале игра слов: *rigor* — строгость, *rigor mortis* (лат.) — трупное окоченение (*Mathematics brought rigor to economics. Unfortunately it also brought mortis*). — *Прим. пер.*

3. Ha-Joon Chang, *Economics: The User Guide* (London: Pelican Books, 2014), 3; Ха-Джун Чанг, *Как устроена экономика* (Москва: Манн, Иванов и Фербер, 2015), 8.

казываются от самого ценного, что предлагает их профессия, — многообразия моделей, ради поиска одной-единственной универсальной модели. Если выбирать модели благоразумно, они становятся источником знания. Если использовать их догматически, результатом будет чрезмерное самомнение и неэффективная государственная политика.

Многообразие моделей

Экономисты строят модели, чтобы охватить важные аспекты социальных взаимодействий. Обычно это те взаимодействия, которые происходят на рынках применительно к товарам и услугам. Экономисты довольно широко представляют себе, что такое рынок. Продавцы и покупатели могут быть индивидами, фирмами или иными коллективными образованиями. Изучаемые товары и услуги могут быть почти любыми, включая такие явления, как государственные должности или статус, для которых не существует рыночных цен. Рынки могут быть местными, региональными, национальными, а также международными; они могут существовать в физической форме, как в случае базара, или виртуально, как международная торговля. Традиционно экономистов интересует в основном работа рынков: эффективно ли они расходуют ресурсы? Можно ли их улучшить, и если да, то как? Как распределяются выгоды от обмена? Однако экономисты также используют модели, чтобы разобраться в работе других институтов — школ, профсоюзов, правительств.

Но что представляют собой экономические модели? Удобнее всего рассматривать их как упрощения, предназначенные для того, чтобы пока-

зять работу отдельных взаимосвязей изолированно от прочих искажающих факторов. Модель рассматривает конкретные причины и следствия и показывает, как они влияют на всю систему. При создании модели строится вымышленный мир, раскрывающий определенные виды связей между частями целого — связей, которые было бы трудно заметить, изучая реальный мир во всей его полноте и сложности. Модели в экономике не отличаются от вещественных моделей, к которым прибегают врачи и архитекторы. Пластмассовая модель дыхательной системы, которую вы можете увидеть в кабинете врача, подчеркивает определенные детали строения легких, оставляя в стороне прочие части человеческого тела. Архитектор может построить одну модель для представления ландшафта вокруг здания и другую — чтобы показать внутреннее устройство дома. То же самое и с моделями экономистов, разница лишь в том, что они получают не вещественное, а символическое воплощение с помощью слов и математических формул.

Основная модель в экономической науке — модель спроса и предложения, знакомая каждому, кто когда-либо изучал начала экономики. Это та самая схема с перекрещивающимися кривыми: нисходящей кривой спроса и восходящей кривой предложения, на осях которой отложены цены и объемы⁴. Вымышленный мир этой модели эконо-

4. Диаграммы спроса и предложения с перекрещивающимися кривыми, предположительно, впервые появились в печати в 1838 году, в книге французского экономиста Антуана Огюстена Курно. Сегодня Курно более известен своими работами о дуополии, а местом первого появления диаграммы считают популярный учебник Альфреда Маршалла, вышедший в 1890 году. См.: Thomas M. Humphrey, «Marshallian Cross Diagrams and Their

номисты называют «совершенно конкурентным рынком», в котором действуют множество потребителей и производителей. Все они преследуют свои экономические интересы, и нет никого, кто мог бы повлиять на рыночную цену. Эта модель многое оставляет за кадром: у людей есть иные мотивы, помимо практической выгоды; рациональность часто нарушают эмоции и упрощенные способы рассуждений, ведущие к ошибкам; некоторые производители являются монополистами и так далее. Но все же она позволяет выявить некоторые простые взаимосвязи, свойственные реальной рыночной экономике.

Некоторые из них очевидны каждому. Так, рост издержек производства повышает рыночные цены и снижает объемы спроса и предложения. Еще пример: когда растет стоимость электроэнергии, растут суммы в счетах за коммунальное обслуживание и домохозяйства начинают искать способы сэкономить на отоплении и электричестве. Но иные взаимосвязи не столь очевидны. Например, закон может облагать налогом как производителей, так и потребителей товара (например, нефти), однако это никак не скажется на том, кому на самом деле придется его платить. Налог может быть наложен на нефтяные компании, но реально платить его будут потребители, покупая бензин по более высоким ценам. Или же дополнительные расходы могут быть переложены на потребителей — например, в виде налога с продаж, однако нефтяным компаниям придется взять эти расходы на себя, так как от них требуют устанавливать более низкие цены.

Uses before Alfred Marshall: *The Origins of Supply and Demand Geometry*, *Economic Review* (Federal Reserve Bank of Richmond), March/April 1992, 3–23.

Исход зависит от «ценовой эластичности» спроса и предложения. Если снабдить эту модель внушительным списком дополнительных предпосылок (о них позднее), то она даст ряд весьма сильных выводов о том, насколько хорошо работают рынки. В частности, конкурентная рыночная экономика эффективна в том смысле, что в ней невозможно улучшить благосостояние одного человека, не ухудшив положение других. (Экономисты называют это состояние «эффективность по Парето»).

Теперь возьмем совершенно другую модель, называемую «дилемма заключенного». Она впервые появилась в работах математиков, но стала краеугольным камнем значительной части работ в современной экономической науке. Обычно ее представляют на примере двух людей, которым угрожает тюремное заключение в случае, если хотя бы один из них признается в преступлении. Давайте представим ее как экономическую проблему. Предположим, две конкурирующие фирмы должны решить, направлять ли значительные средства на рекламу. Реклама может помочь переманить часть клиентов другой фирмы. Но если рекламу дают обе фирмы, воздействие их рекламы на потребителей взаимно нивелируется. В итоге обе фирмы тратят деньги впустую.

Мы могли бы предположить, что обе фирмы решат не тратить много на рекламу, но модель показывает, что эта логика не работает. Когда фирмы принимают решение независимо друг от друга и заботятся только о собственной прибыли, то у каждой есть стимул давать рекламу, независимо от того, что будет делать другая фирма⁵: если

5. Строго говоря, необходимо принять еще одно допущение: фирмы лишены возможности давать друг другу вызы-

другая фирма не рекламируется, то вы с помощью рекламы сможете переманить ее клиентов; если другая фирма дает рекламу, то вы с помощью рекламы сможете предотвратить уход ваших клиентов. Таким образом, две фирмы достигают плохого равновесия, в котором обе вынуждены впустую расходовать ресурсы. Такой рынок, в отличие от описанного в предыдущем абзаце, уже совсем не эффективен.

Очевидная разница между двумя моделями состоит в том, что одна из них описывает сценарий со множеством участников рынка (например, рынок апельсинов), тогда как другая описывает конкуренцию между двумя крупными фирмами (возможно, взаимодействие между производителями самолетов «Боинг» и «Эйрбас»). Но было бы ошибкой думать, что это единственная причина того, что один рынок эффективен, а другой — нет. Имеют значение и другие предпосылки, встроенные в каждую из моделей. Изменяя эти предпосылки, а они часто не выражены в явном виде, мы получим иные результаты.

Возьмем третью модель, которая ничего не говорит насчет количества участников рынка и описывает совершенно иные результаты взаимодействия. Назовем ее моделью координации. Фирма (или фирмы, количество не имеет значения) решает, стоит ли инвестировать средства в судостроительные предприятия. Она знает, что если удастся наладить производство достаточно в больших объе-

вающие доверие обещания, которые бы не было выгодно нарушить в дальнейшем. Например, каждая фирма могла бы пообещать другой, что не будет использовать рекламу. Однако эти обещания не заслуживают доверия, поскольку каждой фирме выгодно использовать рекламу независимо от действий другой фирмы.

мах, оно будет прибыльным. Но один из ключевых видов сырья — дешевая сталь, производство которой должно находиться поблизости. Решение компании сводится к следующему: инвестировать в судостроение, если поблизости есть сталеплавильное производство; не инвестировать, если такого производства нет. Теперь посмотрим на ход рассуждений потенциального инвестора в производство стали в том же регионе. Допустим, что верфи — единственные потенциальные потребители стали. Производители стали приходят к выводу, что они получают прибыль только в случае, если в округе есть судостроительный завод, который купит их сталь.

Здесь возможны два исхода — экономисты называют такое состояние «множественным равновесием». Есть «хороший» исход, когда сделаны оба вида инвестиций, и хозяева верфи вместе со сталеварами получают прибыль и радуются. Равновесие достигнуто. Но есть и «плохой» исход, когда не сделано никаких инвестиций. Второй исход тоже является равновесием, поскольку решения об отказе от инвестиций взаимно подкрепляют друг друга. Если нет верфи, производитель стали не станет строить завод; если нет стали, не будет построена верфь. Такой результат почти не зависит от количества потенциальных участников рынка. Он зависит прежде всего от трех других факторов: 1) имеет место экономия от масштаба (иными словами, для прибыльности необходимо производить большие объемы продукции); 2) сталеплавильные заводы и верфи нуждаются друг в друге; и 3) отсутствуют альтернативные рынки и источники сырья (например, сырье нельзя получить посредством внешней торговли).

Три модели — три разных представления о том, как работают (или не работают) рынки. Ни одно из них не является правильным или неправиль-

ным. Каждое описывает один из важных механизмов, которые имеют или могут иметь место в реальных экономиках. И мы снова видим, насколько важно выбрать «правильную» модель, то есть ту, которая лучше всего подходит к конкретным обстоятельствам. Принято считать экономистов бездумными фанатиками рынка: они-де думают, что свободные рынки позволяют решить любую проблему. Да, многие экономисты имеют такую склонность. Но экономическая наука совершенно точно учит другому. Правильный ответ на почти любой вопрос в экономике таков: «Зависит от обстоятельств». Различные модели, каждая из которых одинаково уважаема, дают разные ответы.

Модели не просто предупреждают нас о возможности разных исходов. Они полезны тем, что говорят нам, от *чего* именно зависят возможные исходы. Рассмотрим несколько важных примеров. Приведет ли установление минимальной оплаты труда к снижению или к повышению занятости? Ответ зависит от того, конкурируют ли между собой отдельные работодатели (то есть могут ли они влиять на величину заработной платы в своем регионе)⁶. Приведет ли приток капитала в развивающуюся экономику к ускорению или к замедлению экономического роста? Это зависит от того, ограничен ли рост экономики страны недостатком объектов для инвестиций или их низкой прибыльностью, скажем, из-за высоких налогов⁷. Приведет ли сокращение дефицита бюджета к усилению или

6. David Card and Alan Krueger, *Myth and Measurement: The New Economics of the Minimum Wage* (Princeton, NJ: Princeton University Press, 1997).

7. Dani Rodrik and Arvind Subramanian, «Why Did Financial Globalization Disappoint?» *IMF Staff Papers* 56, no. 1 (March 2009): 112–138.

к снижению экономической активности? Это зависит от степени доверия к правительству, а также от кредитно-денежной и валютной политики⁸.

Ответ на каждый из вопросов зависит от некоторой критически важной особенности положения дел в реальном мире. Модели выявляют такие особенности и показывают, как они влияют на результат. В каждом случае имеется стандартная модель, которая дает ответ в общем случае: введение минимального размера оплаты труда снижает занятость, приток капитала ускоряет экономический рост, сокращение бюджетного дефицита снижает экономическую активность. Но ее выводы верны только в той степени, в какой использованные в модели *критически важные предпосылки* — те особенности реального мира, о которых сказано выше, соответствуют реальности. Если это не так, то следует использовать модели с иными предпосылками.

Далее я подробнее рассмотрю вопрос критически важных предпосылок и приведу больше примеров экономических моделей. Но сначала приведу пару аналогий, объясняющих, что такое модели и что они дают.

Модели как басни

Один из способов понять экономические модели — рассматривать их как басни. В этих коротких рассказах обычно действуют немногочисленные глав-

8. Daniel Leigh et al., «Will It Hurt? Macroeconomic Effects of Fiscal Consolidation», in *World Economic Outlook* (Washington, DC: International Monetary Fund, 2010), 93–124, <http://www.imf.org/external/pubs/ft/weo/2010/02/pdf/c3.pdf>.

ные герои, живущие в безымянном, обобщенном месте (некая деревня, некий лес), действия и взаимодействия которых приводят к исходу, служащему своего рода уроком. Персонажами могут быть действующие подобно человеку животные, неодушевленные объекты, а также люди. Басня — это воплощенная простота: контекст, в котором разворачивается история, обрисован очень приблизительно, а действия персонажей обусловлены стилизованными мотивами, такими как жадность или ревность. Басня не стремится к реалистичности и не имеет целью дать полную картину жизни персонажей. Она жертвует реализмом и многозначностью ради ясности сюжетной линии. Важно отметить, что у басни всегда есть понятная мораль: честность — лучшая политика; хорошо смеется тот, кто смеется последним; беда не приходит одна; не бей лежачего и так далее.

Экономические модели похожи на басни. Они просты, и действие в них происходит в абстрактной обстановке. Они не претендуют на реалистичность большей части своих предпосылок. И хотя в них вроде бы действуют реальные люди и фирмы, поведение главных героев очень стилизовано. Неодушевленные объекты («случайные шоки», «экзогенные параметры», «природа») часто участвуют в модели и направляют ход событий. Сюжетная линия построена вокруг очевидных взаимосвязей причин и следствий. И мораль, или, как ее называют экономисты, выводы для государственной политики, обычно довольно очевидна: свободные рынки эффективны, оппортунистическое поведение в стратегическом взаимодействии может ухудшать положение всех его участников, стимулы имеют значение и так далее.

Басни коротки и сразу переходят к делу. Они не оставляют читателю ни единого шанса не по-

нять суть истории. Рассказ о зайце и черепахе отпечатывается в вашем уме идею о важности постепенного, пусть и медленного, прогресса. Эта история становится удобным образцом, позволяющим быстро объяснить ситуацию, и применяется во множестве схожих ситуаций. Может показаться, что сравнение экономических моделей с баснями принижает их «научный» статус. Но привлекательность моделей отчасти основана на том, что они работают в точности так же, как басни. Студент, узнавший о концепции баланса спроса и предложения, надолго сохранит уважение к власти рынков. Разобравшись в сути дилеммы заключенных, вы уже никогда не сможете рассматривать вопросы кооперации по-прежнему. Даже если отдельные подробности забудутся, модель будет служить шаблоном для понимания и объяснения мира.

Эта аналогия не ускользнула от внимания лучших представителей экономической науки. В моменты раздумий о своем деле они готовы признать, что создаваемые ими абстрактные модели подобны басням. Как отмечает известный экономист-теоретик Ариэль Рубинштейн, «слово „модель“ звучит более научно, чем „басня“ или „сказка“, однако я не вижу особой разницы между ними»⁹. Как писали философ Аллан Гиббард и экономист Хал Варриан, «[экономическая] модель всегда рассказывает какую-то историю»¹⁰. Философ науки Нэнси Картрайт использует термин «басня» применительно к экономическим и физическим моделям, хотя и считает, что экономические модели больше

9. Ariel Rubinstein, «Dilemmas of an Economic Theorist», *Econometrica* 74, no. 4 (July 2006): 881.

10. Allan Gibbard and Hal R. Varian, «Economic Models», *Journal of Philosophy* 75, no. 11 (November 1978): 666.

похожи на притчи¹¹. По словам Картрайт, в отличие от басен, где мораль очевидна, в экономических моделях необходимо порядком потрудиться, чтобы объяснить результаты и прийти к выводам относительно государственной политики. Такая сложность обусловлена тем, что каждая модель верна лишь в определенном контексте и выводы из нее применимы лишь в определенных обстоятельствах.

Но и здесь аналогия с баснями остается полезной. Басен очень много, и каждая дает образец действий для какого-то одного стечения обстоятельств. Вместе взятые, морали всех басен могут показаться противоречащими одна другой. Некоторые басни превозносят достоинства доверия и кооперации, тогда как другие советуют полагаться только на себя. Некоторые восхваляют должные приготовления, другие предупреждают об опасности чересчур подробного планирования. Некоторые говорят, что нужно тратить деньги на удовольствия, другие говорят, что нужно сберечь на черный день. Иметь друзей — хорошо, но иметь слишком много друзей — уже не очень-то хорошо. У каждой басни есть однозначная мораль, но в совокупности басни способствуют сомнениям и создают неопределенность.

Поэтому мы должны решать, применима ли басня в данной ситуации. Экономические модели требуют того же. Мы уже видели, как разные модели приводят к разным выводам. Эгоистическое поведение может привести как к эффективности (в случае модели полностью конкурентного рынка), так и к убытку (модель дилеммы заключен-

11. Nancy Cartwright, «Models: Fables v. Parables», *Insights* (Durham Institute of Advanced Study) 1, no. 11 (2008).

ных), в зависимости от наших допущений относительно обстоятельств дела. Как и в случае басен, здравое рассуждение — необходимое условие для выбора из множества взаимно противоречивых моделей. К счастью, задачу выбора между моделями могут облегчить эмпирические данные; при этом сам процесс анализа данных остается в большей степени делом умения, чем науки (см. главу 3).

Модели как эксперименты

Если сравнение с баснями вас не привлекает, можете рассматривать модели как лабораторные эксперименты. Эта аналогия может показаться неожиданной. Если сравнение с баснями выглядит как уподобление моделей упрощенным небылицам, то сравнение с лабораторными экспериментами опасно тем, что придает им видимость излишней научности. В конце концов, во многих культурах лабораторные эксперименты составляют вершину научной респектабельности. Именно с их помощью ученые в белых халатах постигают «истину» об устройстве мира и правильности конкретных гипотез. Могут ли экономические модели хотя бы приблизиться к тому образцу?

Посмотрим, что представляет собой лабораторный эксперимент на самом деле. Лаборатория — искусственная среда, построенная для изоляции объектов эксперимента от воздействия среды реального мира. Исследователь создает экспериментальные условия, которые должны выявить предполагаемую причинно-следственную связь, изолируя изучаемый процесс от иных потенциально важных воздействий. Скажем, если на результаты эксперимента влияет сила тяжести, ис-

следователь проводит эксперимент в вакууме. Как объясняет финский философ Ускали Маки, при создании экономических моделей применяется тот же способ изоляции, отделения и идентификации. Главное различие в том, что в лабораторном эксперименте целенаправленно манипулируют физической средой, чтобы достичь изоляции, необходимой для наблюдения причинной связи, тогда как в модели это достигается благодаря манипуляциям с предпосылками¹². Модели выстраивают умоглядные среды, чтобы протестировать гипотезы.

Вы можете возразить, что в лабораторном эксперименте, при всей искусственности создаваемой в нем среды, действие все же происходит в реальном мире. Мы понимаем, когда эксперимент удался, а когда — нет, по крайней мере в данном варианте. Экономическая модель, напротив, полностью искусственный конструкт, существующий только в нашем сознании. Однако разница между ними скорее в степени, чем в сути. Результаты экс-

12. Uskali Mäki, «Models Are Experiments, Experiments Are Models», *Journal of Economic Methodology* 12, no. 2 (2005): 303–315. Обратите внимание, что изолировать эффект в экономической модели — задача более сложная, чем может показаться. Нам всегда приходится делать некие допущения относительно прочих обстоятельств. Поэтому Нэнси Картрайт утверждает, что эффект всегда является результатом совместного взаимодействия множества причин и в экономической науке мы никогда не сможем в полной мере разделить причину и следствие. См.: Cartwright, *Hunting Causes and Using Them: Approaches in Philosophy and Economics* (Cambridge: Cambridge University Press, 2007). В общем случае это верно, однако тем и ценно разнообразие моделей в том, что позволяет манипулировать факторами среды в поиске того из них, который вносит существенный вклад в эффект (если такой фактор вообще есть).

перимента тоже могут потребовать значительной экстраполяции, прежде чем их можно будет применить к реальному миру. Сработавшее в лабораторных условиях может не получиться вне лаборатории. Например, лекарство может оказаться неэффективным в условиях реального мира, которые не учитывались — не «контролировались» — в условиях лабораторного эксперимента.

Именно это различие имеют в виду философы науки, когда говорят о разнице между внутренней и внешней валидностью. Считается, что хорошо организованный эксперимент, в котором удастся выявить причинно-следственную связь в определенной обстановке, обладает высокой степенью «внутренней валидности». Однако его «внешняя валидность» зависит от того, насколько результат эксперимента воспроизводим в иной обстановке, вне условий лаборатории.

Так называемые полевые эксперименты, проводимые не в лаборатории, а в условиях реального мира, также должны выдерживать это испытание. Подобные эксперименты в последнее время стали очень популярны среди экономистов, и порой их рассматривают как способ получать новое знание без помощи моделей; иными словами, предполагается, что полевые эксперименты дают знание об устройстве мира, свободное от груза предположений и гипотез о причинно-следственных связях, которым нагружены модели. Но это не совсем так. Вот вам пример: в Колумбии удалось существенно улучшить качество образования с помощью случайного распределения среди населения ваучеров на обучение в частных школах. Но нет никакой гарантии, что в США или в Южной Африке подобная программа даст тот же результат. Окончательный результат зависит от многих факторов, изменяю-

щихся от страны к стране. Уровень доходов, предпочтения родителей, разрыв в качестве обучения между частными и государственными школами, стимулы, которыми руководствуются школьные учителя и администраторы — значение имеют все эти факторы, а также многие другие потенциально важные обстоятельства¹³. Для перехода от «сработало там» к «сработает здесь» придется сделать много дополнительных шагов¹⁴.

Разница между настоящими экспериментами, проводимыми в лаборатории (или в полевых условиях), и мысленными экспериментами, которые мы называем «моделями», меньше, чем можно подумать. В обоих случаях необходимо приложить усилия, чтобы экстраполировать их результаты там и тогда, когда нам это будет нужно. В свою очередь, качественная экстраполяция требует сочетать разумный выбор, данные из других источников и упорядоченные рассуждения. Сила обоих видов эксперимента в том, что они дают нам знание о мире за пределами тех рамок, в которых проводится эксперимент, благодаря нашему умению выявлять сходства и проследивать соответствия между разными ситуациями.

Как и в случае настоящих экспериментов, ценность моделей состоит в их способности изолировать и выявить отдельные причинно-следственные

13. Колумбийское исследование, на которое я ссылаюсь, известная работа: Joshua Angrist, Eric Bettinger, and Michael Kremer, «Long-Term Educational Consequences of Secondary School Vouchers: Evidence from Administrative Records in Colombia», *American Economic Review* 96, no. 3 (2006): 847–862.

14. Nancy Cartwright and Jeremy Hardie, *Evidence-Based Policy: A Practical Guide to Doing It Better* (Oxford: Oxford University Press, 2012).

связи, по одной за раз. То обстоятельство, что эти связи в реальном мире действуют наряду со многими другими, вносящими искажения в их работу, является затруднением, общим для всех, кто пытается давать научные объяснения. В этом плане у экономических моделей даже есть преимущество. Контингентность — зависимость от определенных постулируемых условий — уже встроена в них. Как мы увидим в главе 3, этот недостаток определенности мотивирует нас искать ту из множества конкурирующих моделей, которая дает лучшее описание непосредственной реальности.

Нереалистичные предпосылки

Потребители гипертрофированно рациональны, эгоистичны, всегда предпочитают потратить больше, чем меньше, имеют длинный горизонт планирования, простирающийся в бесконечность. Экономические модели обычно строятся из множества подобных нереалистичных предпосылок. Разумеется, многие модели более реалистичны в одном-двух из этих аспектов. Но даже в этих более замысловатых моделях нет-нет да и появятся другие нереалистичные предпосылки. Упрощение и абстрагирование с необходимостью требуют, чтобы многие элементы оставались противоречащими фактам, то есть нарушающими законы реального мира. Как лучше всего думать об этом дефиците реалистичности?

В 1953 году один из величайших экономистов XX века Милтон Фридман дал ответ на этот вопрос, наложивший глубокий отпечаток на всю науку¹⁵.

15. Milton Friedman, «The Methodology of Positive Economics», in *Essays in Positive Economics* (Chicago: University of Chicago

Фридман пошел намного дальше утверждения о том, что нереалистичные предпосылки являются необходимой частью создания теории. Он заявил, что реалистичность предпосылок просто не имеет значения. Важно только одно: даст ли теория верные предсказания. Если да, то предпосылки в основе такой теории вовсе не обязаны иметь сходство с реальным миром. И хотя это довольно грубый пересказ более сложно организованного рассуждения, он передает суть, которую вынесли из эссе Фридмана его читатели. Это был восхитительно раскрепощающий довод, и он давал экономистам право на создание любых моделей, основанных на сколь угодно отклоняющихся от практического опыта предпосылках.

Однако было бы неверно думать, что реалистичность предпосылок вообще никогда не имеет значения. Как указывает экономист из Стэнфордского университета Пол Пфляйдерер, с моделью можно начинать работать лишь после того, как через «фильтр реалистичности» пропущены *критически важные* предпосылки модели¹⁶. (Снова этот термин «критически важные предпосылки». Вскоре я вернусь к нему.) Все дело в том, что мы никогда не можем быть уверены в предсказательном успехе модели. Предсказание, как сказал бы комик Граучо Маркс¹⁷, всегда имеет дело с будущим. После того как событие произошло, мы можем состря-

Press, 1953); Милтон Фридмен, «Методология позитивной экономической науки», *THESIS*, 1994, вып. 4, 20–52.

16. Paul Pflaiderer, «Chameleons: The Misuse of Theoretical Models in Finance and Economics» (Stanford University, 2014) Working Paper No. 3020, <https://www.gsb.stanford.edu/faculty-research/working-papers/chameleons-misuse-theoretical-models-finance-economics>.

17. Отсылка к афоризму Граучо Маркса «Прогнозы делать трудно, особенно прогнозы на будущее». — *Примеч. пер.*

пать почти неограниченное количество разнообразных моделей, объясняющих действительность. Но большинство этих моделей будут бесполезны: они не дадут корректного предсказания хода событий в будущем, когда обстоятельства изменятся.

Предположим, что у меня есть данные о частоте ДТП в некоем районе за последние пять лет. Я отмечаю, что больше всего аварий происходит в конце рабочего дня, в промежутке между 17.00 и 19.00. Самое разумное объяснение состоит в том, что в это время на дороге становится больше машин, так как люди возвращаются домой с работы. Но предположим, что исследователь выдвигает альтернативную теорию. Во всем виноват Джон, говорит он. Мозг Джона испускает невидимые волны, которые действуют на всех водителей. Стоит ему выйти из конторы на улицу, как его мозговые волны нарушают движение транспорта и провоцируют рост числа происшествий. Эта теория, возможно, глупа, однако она все же «объясняет» учащение ДТП в конце рабочего дня.

В данном случае мы знаем, что вторая модель не является полезной. Если Джон сменит распорядок дня или выйдет на пенсию, то окажется, что у нее нет никакой предсказательной ценности. Количество происшествий не пойдет на убыль после того, как Джон перестанет бродить по улицам. Это объяснение ошибочно потому, что неверна его критически важная предпосылка — про Джона, испускающего мозговые волны, нарушающие движение транспорта. Чтобы модель приносила пользу в смысле соответствия действительности, ее критически важные предпосылки тоже должны в достаточной степени соответствовать действительности¹⁸.

18. См.: Gibbard and Varian, «Economic Models», 671.

Что такое критически важная предпосылка? Предпосылку можно назвать критически важной, если ее изменение в сторону потенциально большей реалистичности приведет к значительному изменению выводов из модели. Многие предпосылки, если не большинство, не являются в этом отношении критически важными. Возьмем модель рынка с совершенной конкуренцией. Ответы на многие интересующие нас вопросы не будут принципиально зависеть от деталей модели. Милтон Фридман в своем методологическом эссе рассматривает акциз на сигареты. Мы можем с уверенностью предсказать, что повышение акциза приведет к росту розничных цен на сигареты, пишет он, безотносительно к тому, много или мало фирм на рынке и являются ли разные марки сигарет полностью взаимозаменяемыми или нет. Схожим образом любое ослабление — в разумных пределах — требования совершенной рациональности не намного изменит этот результат. Даже если фирмы не ведут расчеты с точностью до последнего знака после запятой, мы можем быть более-менее уверены, что они заметят повышение акциза, который вынуждены платить. Эти частные предпосылки не являются критически важными в свете того, как поставлен вопрос и как используется модель — например, для оценки влияния акциза на цену сигарет. Поэтому недостаток реализма в этих предпосылках не особенно важен.

Предположим, нас интересует другой вопрос: влияние регулирования цен на производителей сигарет. Теперь уровень конкуренции в отрасли, который зависит отчасти от готовности потребителей переключаться между разными марками, становится очень важным. В модели рынка совершенной конкуренции ценовое регулирование приводит

к сокращению предложения фирмами. Снижение цены снижает прибыльность, и фирмы в ответ сокращают продажи. Но в модели рынка с одной фирмой-монополистом установление умеренного потолка цен (то есть на уровне не намного ниже нерегулируемой рыночной цены) фактически вынуждает фирму *повышать* выпуск. Чтобы понять, как работает этот механизм, пригодится некоторое владение математикой. Монополист обычно наращивает прибыль за счет ограничения продаж и повышения рыночных цен. Регулирование цен лишает монополиста способности устанавливать цену, тем самым ослабляя стимул к снижению выпуска. Монополист реагирует повышением продаж¹⁹. Продавать больше сигарет теперь становится единственным способом увеличить прибыль.

Если мы хотим предсказать последствия от регулирования цен, то допущение насчет уровня рыночной конкуренции становится критически важным. Реалистичность этой конкретной предпосылки теперь имеет значение, и немалое. Применимость модели зависит от того, насколько критически важные предпосылки соответствуют реальному миру. А что именно делает предпосылку критически важной, отчасти зависит от того, для чего применяется модель. Далее я вернусь к этому вопросу, когда буду подробнее рассматривать, как мы выбираем модель для использования в конкретных обстоятельствах.

Полностью оправданно, и даже необходимо, усомниться в эффективности модели в том случае, если ее критически важные предпосылки очевид-

19. Здесь действует тот же принцип, что и в случае роста занятости после установления умеренного порога минимальной заработной платы.

но противоречат фактам, как в случае с Джоном и его мозговыми волнами. В подобных случаях мы вправе сказать, что создатель модели чрезмерно упростил ее и вводит нас в заблуждение. Однако правильным ответом будет не отказываться от моделей как таковых, а разработать альтернативную модель с более адекватными предпосылками. Противоядие от плохой модели — хорошая модель.

В конце концов, нам в любом случае не уйти от некоторой нереалистичности предпосылок. Как отмечает Картрайт, «критиковать экономические модели за использование нереалистичных предпосылок — как критиковать Галилея за то, что в экспериментах с катящимся шаром он использовал доску, отшлифованную для максимального снижения трения»²⁰. Но подобно тому, как нам не хотелось бы применять открытый Галилеем закон тяготения к шару, брошенному в банку меда, нет оправдания использованию моделей, критически важные предпосылки которых чрезвычайно сильно отклоняются от действительности.

О моделях и математике

Экономические модели состоят из ясно сформулированных предпосылок и механизмов поведения. Это делает их весьма подходящими для выражения на языке математики. Полистайте любой академический журнал по экономике и вы обнаружите почти бесконечный поток уравнений и греческих символов. По стандартам естественных наук используе-

20. Nancy Cartwright, *Hunting Causes and Using Them: Approaches in Philosophy and Economics* (Cambridge: Cambridge University Press, 2007), 217.

мая экономистами математика не особенно сложна: зачатков многомерного и оптимизационного анализа обычно бывает достаточно для понимания большей части экономических теорий. Тем не менее математический формализм действительно требует определенных усилий от читателя. Он укрепляет барьер постижимости между экономической наукой и большинством других наук об обществе. Он также подпитывает недоверие к ней неэкономистов: использование математики производит впечатление, что экономисты отстранились от реального мира и витают в придуманных ими самими абстракциях.

В молодости, когда я был студентом колледжа, я точно знал, что буду получать докторскую степень, поскольку мне нравилось писать и заниматься исследованиями. Но меня интересовало множество разнообразных социальных явлений, и я не мог выбрать между политологией и экономикой. Я подал заявление в две аспирантуры, но отложил окончательное решение на время обучения по междисциплинарной магистерской программе. Хорошо помню случай, который положил конец моей нерешительности. В библиотеке Школы Вудро Вильсона в Принстонском университете я взял полистать последние выпуски журналов *American Economic Review (AER)* и *American Political Science Review (APSR)*, ведущих изданий в обеих дисциплинах. Посмотрев на них одновременно, я вдруг понял, что если я получу докторскую степень по экономике, то смогу читать *APSR*, но если я получу докторскую степень по политологии, то большая часть написанного в *AER* будет мне непонятна. Оглядываясь на прошлое, я понимаю, что мое заключение было не вполне верным. Статьи по политической философии в *APSR* могут быть так же трудны для понимания, как любая из статей в *AER*, несмотря

на всю математику. И с тех пор политология значительно продвинулась по пути экономики в части овладения математическим формализмом. Тем не менее в моем наблюдении все же имелось зерно истины. И по сей день экономическая наука остается единственной наукой об обществе, которая почти полностью неприступна для тех, кто не прошел необходимого обучения в аспирантуре.

Причина, по которой экономисты используют математику, часто понимается неправильно. Она не имеет отношения к сложности, утонченности или к притязаниям на познание высшей истины. Экономическая наука использует математику для двух целей, ни одна из которых не является поводом для гордости: обеспечить ясность и последовательность. Во-первых, математика гарантирует, что элементы модели — предпосылки, механизмы поведения и основные выводы — сформулированы ясно и прозрачно. Если модель выражена в математической форме, то ее суть и применимость становятся очевидны каждому, кто может ее прочитать. Такая ясность крайне полезна, но зачастую недооценивается. Мы по-прежнему ведем бесконечные споры о том, что на самом деле имели в виду Карл Маркс, Джон Мейнард Кейнс или Джозеф Шумпетер. И хотя все трое внесли гигантский вклад в экономическую науку, они формулировали свои модели преимущественно (но не исключительно) в словесной форме. Напротив, никто не ломает перья в спорах о том, что имели в виду Пол Самуэльсон, Джо Стиглиц или Кен Арроу в теоретических работах, которые принесли им Нобелевские премии. В математических моделях приходится расставлять абсолютно все точки над *i*.

Второе достоинство математики состоит в том, что она обеспечивает внутреннюю последователь-

ность модели — попросту говоря, она гарантирует, что выводы следуют из предпосылок. Это очень рутинный, но необходимый вклад. Некоторые доказательства настолько просты, что очевидны сами по себе. Другие требуют большей осторожности, особенно из-за существования когнитивных искажений, которые подталкивают нас к тем выводам, которые нам хочется получить. Иногда это приводит к полностью ошибочным выводам. Чаще доказательство оказывается некорректно построенным, без внимания к критически важным предпосылкам. И как раз здесь математика служит удобным средством контроля. У Альфреда Маршалла, великого экономиста докейнсианской эпохи и автора первого настоящего учебника экономики, было отличное правило: использовать математику как удобный язык для изложения модели, затем перевести на обычный язык, а затем выбросить всю математику! Или, как я говорю своим студентам, экономисты используют математику не потому, что они очень умные, а потому, что они недостаточно умные.

В бытность молодым начинающим экономистом я однажды посетил лекцию выдающегося экономиста сэра Уильяма Артура Льюиса, специалиста по экономике развивающихся стран, получившего в 1979 году Нобелевскую премию по экономике. Льюис обладал непревзойденным умением доходить до самой сути сложных экономических отношений с помощью простых моделей. Но, как и многие экономисты старой закалки, он обычно представлял свою аргументацию в словесной, а не в математической форме. Темой той лекции были факторы, определяющие условия внешней торговли (то есть соотношения импортных и экспортных цен) в бедных странах. Когда Льюис закончил, один из присутствующих молодых и бо-

лее математически ориентированных экономистов встал и набросал на доске несколько уравнений. Он заметил, что поначалу не понимал, о чем говорит профессор Льюис. Но, сказал он далее ошарашенному Льюису, теперь-то он понял, как это работает: у нас есть вот эти три уравнения, которые задают эти три неизвестных параметра.

Таким образом, роль математики в экономических моделях — сугубо инструментальная. В принципе, модели не требуют использования математики, и не математика делает модели полезными или научными²¹. Как показывает пример Артура Льюиса, некоторые выдающиеся представители экономической науки вообще редко прибегают к математике. Том Шеллинг, разработавший ряд ключевых понятий современной теории игр, таких как надежность, обязательство и сдерживание, получил Нобелевскую премию за работу, почти лишенную математики²². У Шеллинга был редкий талант объяснять довольно сложные модели стратегического взаимодействия индивидов с помощью одних только слов, примеров из реальной жизни, самое большое — одного-двух рисунков. Его

21. За пределами экономической науки термин «рациональный выбор» стал синонимом направления в социальных науках, опирающегося преимущественно на математические модели. Такое употребление термина смешивает несколько разных вещей. Заниматься научным изучением общества с помощью моделей не предполагает обязательного использования ни математики, ни предпосылки о рациональности индивидов.

22. Thomas C. Schelling, *The Strategy of Conflict* (Cambridge, MA: Harvard University Press, 1960); Schelling, *Micromotives and Macrobehavior* (New York: W. W. Norton, 1978); Томас Шеллинг, *Стратегия конфликта* (Москва: ИРИСЭН, 2007); Томас Шеллинг, *Микромотивы и макроповедение* (Москва: Издательство Института Гайдара, 2016).

работы оказали значительное влияние как на науку, так и на экономическую политику.

И все же я должен заметить, что вся глубина его рассуждений и точность аргументации в полной мере открылись мне лишь после того, как я увидел его доводы в более полном математическом представлении.

Нематематические модели широко распространены в социальных науках за пределами экономики. Вы всегда можете заметить, что ученый собирается прибегнуть к модели, если он начинает со слов «Предположим, у нас есть»... и затем описывает некую абстрактную ситуацию. Вот, например, как социолог Диего Гамбетта исследует последствия разных представлений о природе научного знания: «Представим два общества — идеальные типы, которые различаются только в одном отношении»...²³. В работах по политологии часто упоминаются зависимые и независимые переменные — верный признак того, что автор использует некое подобие моделей, хотя и в отсутствие явно сформулированной теоретической схемы.

Словесно выраженные доказательства, которые кажутся интуитивно понятными, после тщательного математического разбора часто оказываются несостоятельными или неполными. Дело в том, что «словесная форма» позволяет игнорировать неочевидные, но потенциально значимые связи. Например, множество эмпирических исследований показали, что государственное вмешательство отрицательно связано с объемами выпуска: в субсидируемых отраслях производительность растет мед-

23. Diego Gambetta, «„Claro!“ An Essay on Discursive Machismo», in *Deliberative Democracy*, ed. Jon Elster (Cambridge: Cambridge University Press, 1998), 24.

леннее, чем в отраслях, не получающих субсидий. Как понимать эти результаты? Принято заключать, особенно среди экономистов, что государство при вмешательстве в экономику обычно руководствуется неправильными мотивами, а именно стремится поддержать слабые отрасли в ответ на действия политических лоббистов. Звучит разумно — и слишком очевидно даже для того, чтобы просто продолжать исследования. Однако стоит математически описать действия государства, вмешивающегося исходя из лучших побуждений — субсидирующего отрасли ради повышения эффективности всей экономики, как мы увидим, что этот вывод необоснован. Отрасли, которые показывают низкие результаты из-за неправильно функционирующих рынков, чаще становятся объектом государственного вмешательства — но не в той степени, которая позволила бы полностью преодолеть их недостатки. Следовательно, отрицательная корреляция между фактом представления субсидии и производительностью ничего не говорит о том, желательно или нежелательно вмешательство государства, поскольку оба типа вмешательства ведут к появлению одной и той же наблюдаемой нами корреляции. Не очень понятно? Ну так посмотрите на математические расчеты²⁴!

24. Dani Rodrik, «Why We Learn Nothing from Regressing Economic Growth on Policies», *Seoul Journal of Economics* 25, no. 2 (Summer 2012): 137–151. Отклонимся от экономической науки: вот как Джон Мейнард Смит, выдающийся теоретик эволюционной биологии, объясняет в своем видео, почему важно развивать математику: <http://www.webofstories.com/play/john.maynard.smith/52;jsessionid=3636304FA6745B8E5D200253DAF409E0>. Мейнард описывает свою неудовлетворенность словесно выраженной теорией, объясняющей, почему некоторые животные, например антилопы, совершают высо-

С другой стороны, слишком многие экономисты теряют голову от математики и забывают о ее инструментальной природе. Избыточная формализация — математика ради математики — встречается в экономике сплошь и рядом. Некоторые направления экономической науки, такие как математическая экономика, больше напоминают прикладную математику, чем какую-либо из наук об обществе. Для них отправной точкой становится не реальный мир, а другая математическая модель. Вот как начинается аннотация к одной из работ этого направления: «Мы определяем новые характеристики вальрасианского равновесия ожиданий, основанного на механизме вето, в условиях различных информационных экономик с полным и конечным пространством агентов»²⁵. Один из ведущих и наиболее математически ориентированных экономических журналов, *Econometrica*, в какой-то момент ввел мораторий на теорию «социального выбора» — абстрактные модели механизмов голосования — поскольку статьи в этой области стали настолько математически сложными,

кие прыжки во время бега, демонстрируя поведение, называемое «стоттинг». Это поведение выглядит неэффективным, поскольку снижает скорость движения животного. В теории говорится, что высокие прыжки — это способ показать потенциальному хищнику, что антилопу не стоит преследовать: она бежит настолько быстро, что может скрыться даже тогда, когда совершает подобные неэффективные движения. Смит вспоминает, как он пытался математически смоделировать этот сценарий, но так и не сумел получить желаемый результат — доказать, что стоттинг может быть эффективным, если используется как сигнал для хищника.

25. Marialaura Pesce, «The Veto Mechanism in Atomic Differential Information Economies», *Journal of Mathematical Economics* 53 (2014): 33–45.

что были понятны лишь посвященным, и утратили связь с политической жизнью²⁶.

Прежде чем сурово осудить подобные работы, стоит отметить, что ряд самых полезных прикладных применений экономики основывались на моделях, очень сильно нагруженных математикой и совершенно непонятных внешнему наблюдателю. Теория аукционов, основанная на абстрактной теории игр, практически неприступна даже для многих экономистов²⁷. Однако на ее основе были сформулированы принципы аукционов, с помощью которых Федеральной комиссии по связи удалось максимально эффективно распределить национальный частотный спектр между телефонными и телевизионными компаниями, а также привлечь в федеральный бюджет более 60 млн долларов.²⁸ Модели соответствия и проектирования рынка, в равной степени математизированные, сегодня применяются для распределения жителей определенных районов по больницам, а студентов — по государственным школам. В каждом случае оказалось, что модели, которые выгля-

26. Jon Elster, *Explaining Social Behavior: More Nuts and Bolts for the Social Sciences* (Cambridge: Cambridge University Press, 2007), 461; Юн Эльстер, *Объяснение социального поведения. Еще раз об основах социальных наук* (Москва: ГУ-ВШЭ, 2011), 465.

27. Относительно недавнее введение в эту теорию см. в работе: Paul Milgrom, «Auctions and Bidding: A Primer», *Journal of Economic Perspectives* 3, no. 3 (Summer 1989), 3–22. Более детальное описание можно найти в: Paul Klemperer, *Auctions: Theory and Practice* (Princeton, NJ: Princeton University Press, 2004).

28. Golden Goose Award, «Of Geese and Game Theory: Auctions, Airwaves — and Applications», *Social Science Space*, July 17, 2014, <http://www.socialsciencespace.com/2014/07/of-geese-and-game-theory-auctions-airwaves-and-applications>.

дели чрезвычайно абстрактными и слабо связанными с реальным миром, много лет спустя нашли множество полезных применений.

Хорошие новости состоят в том, что, вопреки распространенному мнению, математика ради математики не позволит вам далеко продвинуться в экономической науке. Ценится «умная математика»: умение по-новому подойти к давно известной проблеме, найти решение неподдающейся проблемы или предложить новый подход к эмпирическому исследованию содержательной проблемы. На самом деле акцент на математических методах в экономической науке уже давно прошел свой пик. Сегодня в ведущих журналах намного приветливее принимают эмпирически ориентированные или политически релевантные модели, чем чисто теоретические упражнения в математике. «Звезды» своей профессии и наиболее часто цитируемые экономисты — не гении математики, а те, кто пролил свет на общественно значимые проблемы, такие как бедность, государственные финансы, экономический рост и финансовые кризисы.

Простота против сложности

В том, что не касается математики, экономические модели обычно довольно просты. Чтобы в них разобраться, обычно достаточно карандаша и бумаги. В этом одна из причин того, что модели оставляют без внимания многие аспекты реального мира. Но, как мы видели, недостаток реалистичности сам по себе не является поводом для критики. Возвращаясь к примеру Милтона Фридмана, модель, включающая цвет глаз бизнесменов, может быть реалистичнее любой другой, но она не будет

лучше всех прочих²⁹. И все же именно от предположений зависит, будут ли некоторые воздействия считаться значимыми или нет. Быть может, голубоглазые бизнесмены в целом глуповаты и систематически занижают цены своих продуктов. Стратегические решения создателя модели о том, что именно стоит упростить ради разрешимости модели, могут значительно повлиять на содержательные выводы.

Не лучше ли предпочесть простоте сложность? Насущность вопросу придают два взаимосвязанных новшества последних лет. Во-первых, грандиозный скачок в вычислительных возможностях и связанное с ним резкое снижение стоимости вычислений облегчило работу с большими вычислительными моделями. Эти модели состоят из тысяч уравнений и учитывают нелинейные связи и сложные взаимодействия. Компьютеры могут решить их, даже если человеческому разуму это не под силу. Хорошо известный пример — климатические модели. Большие вычислительные модели встречаются в экономической науке, хотя редко бывают столь масштабными. Большинство центральных банков применяют модели из множества уравнений для прогнозов экономики и предсказания эффектов денежной и налоговой политики.

Второе новшество — это появление «больших данных» и прогресс в статистических и вычислительных техниках, способных выявлять в таких данных структуры и закономерности. «Большие данные» — огромный массив количественной информации, создаваемый в ходе нашего пользования Интернетом и социальными медиа, почти

29. Friedman, «Methodology of Positive Economics»; Фридмен, «Методология позитивной экономической науки».

полная и непрерывная запись того, где мы находились и чем занимались, минута за минутой. Возможно, мы достигли или вскоре достигнем той стадии, когда выявленные на таких данных закономерности позволят раскрывать тайны социальных отношений. «Большие данные дают шанс увидеть общество во всей его сложности», — пишет один из ведущих сторонников этого подхода³⁰. Тогда наши традиционные экономические модели устареют, как устарели конные повозки после появления автомобиля.

Безусловно, сложность на первый взгляд выглядит привлекательно. Кто станет отрицать, что общество и экономика являются сложными системами? «Все по-разному представляют себе, что делает сложную систему „сложной“, — пишет математик и социолог Дункан Уоттс, — но общепризнано, что сложность возникает, когда множество взаимосвязанных частей взаимодействуют нелинейным образом». Любопытно, что первый же пример, который приводит Уоттс, это экономика: «Экономика Соединенных штатов, например, является продуктом индивидуальных действий миллионов людей, а также сотен фирм, тысяч государственных агентств и бесчисленного множества прочих внешних и внутренних факторов, начиная от погоды и Техаса и заканчивая процентными ставками в Китае»³¹. Как замечает Уоттс, нарушения в одной части экономики (например, в ипотечном кредитовании) могут усилиться и вызвать крупные потря-

30. Alex Pertland, *Social Physics: How Good Ideas Spread — The Lessons from a New Science* (New York: Penguin, 2014), 11.

31. Duncan J. Watts, *Everything Is Obvious: Once You Know the Answer* (New York: Random House, 2011), Kindle edition, locations 2086–92.

сения во всей экономике, подобно «эффекту бабочки» в теории хаоса.

Указание Уоттса на экономику любопытно потому, что на сегодняшний день ни одна попытка создать крупномасштабную экономическую модель не увенчалась успехом. А если говорить прямо, то я не припомню ни одного важного экономического вывода, сделанного на основе таких моделей. Напротив, они часто вводят в заблуждение. В 1960-х и 1970-х годах на волне чрезмерного доверия к правильности доминировавшей на тот момент макроэкономической ортодоксии были созданы несколько больших симуляционных моделей американской экономики, основанных на кейнсианских принципах. В условиях стагфляции конца 1970-х и 1980-х годов эти модели работали довольно плохо. Впоследствии от них отказались и перешли к «неоклассическому» подходу с рациональными ожиданиями и ценовой гибкостью. Вместо упования на подобные модели, было бы намного полезнее одновременно просчитывать в уме несколько небольших моделей, как кейнсианских, так и неоклассических, и понимать, когда пора переходить от одной модели к другой.

Без небольших и более прозрачных моделей большие вычислительные модели совершенно невразумительны. Я имею в виду два момента. Во-первых, встроенные в большие модели предпосылки и поведенческие отношения должны откуда-то браться. В зависимости от того, верите ли вы в кейнсианскую или в неоклассическую модель, вы создадите разные крупномасштабные модели. Если вы считаете, что экономические отношения преимущественно нелинейны либо непоследовательны, вы построите иную модель, чем если бы вы полагали, что они линейны и «гладки». Эти пред-

варительные представления не следуют из сложности как таковой; их источником неизбежно является начальное теоретизирование.

Во-вторых, и с другой стороны, предположим, что мы можем построить относительно свободные от теории большие модели с помощью техник анализа больших данных, основанных на наблюдаемых эмпирических закономерностях, таких как паттерны потребительских расходов. Такие модели могут предсказывать будущее, как это делают модели погоды, но никогда не дадут нового знания. Потому что они подобны черному ящику: мы видим, что получается на выходе, но не работающий внутри механизм. Чтобы извлечь знание из этих моделей, нам нужно выявить и прицельно изучить скрытые за ними причинно-следственные механизмы, приводящие к тому или иному результату. Соответственно, придется сконструировать уменьшенную версию большой модели. Только после этого мы можем говорить о понимании происходящего. Более того, когда мы оцениваем предсказания сложной модели — она предсказала нынешнюю рецессию, но предскажет ли следующую? — наше суждение будет зависеть от природы этих скрытых причинно-следственных механизмов. Если они правдоподобны и обоснованны (согласно тем же стандартам, по которым мы оцениваем небольшие модели), то у нас есть основание для уверенности. Но никак не наоборот.

Рассмотрим большие вычислительные модели, которые широко применяются в анализе соглашений о международной торговле между странами. Эти соглашения влияют на политику импорта и экспорта в сотнях отраслей, связанных рынками труда, капитала и других услуг. Изменения в работе одной отрасли затрагивают все остальные. Если

мы хотим понимать последствия от введения торговых соглашений в масштабе всей экономики, то нам потребуется модель, которая учитывает все эти взаимодействия. В принципе, именно это делают так называемые вычислительные модели общего равновесия. Они строятся отчасти на основе уже существующих моделей международной торговли и отчасти на *ad hoc* предположениях, призванных воссоздать наблюдаемые в экономике закономерности (такие как продаваемая за рубежом доля национального выпуска). Именно выводы из этих моделей приводят ученые мужи в СМИ, когда сообщают, скажем, что Трансатлантическое партнерство по торговле и инвестициям между США и Европой создаст много-много миллионов долларов экспортных прибылей и личных доходов.

Несомненно, подобного рода модели дают некоторое представление о порядке величин, с которыми придется иметь дело при принятии решения. Но они заслуживают доверия только в той мере, в какой их выводы могут быть обоснованы и подтверждены существенно меньшими и простыми моделями. Пока объяснение не станет прозрачным и интуитивно понятным — то есть пока не созданы меньшие по масштабу модели, приводящие к похожим выводам, — сложность сама по себе не дает особенных преимуществ, кроме разве что большего числа подробностей.

Как тогда быть с конкретными содержательными выводами из сложных моделей, таких как переломные моменты, комплементарность, множественное равновесие или зависимость от пройденного пути? Действительно, «нестандартные» результаты, которыми гордятся сторонники теорий сложности, резко отличаются от более линейного и сглаженного поведения привычных рабо-

чих моделей экономистов. Безусловно верно и то, что иногда такой более заостренный формат лучше подходит для описания событий реального мира. Однако все эти результаты не только могут быть получены в меньших и более простых моделях, но изначально именно в них они и появились. Модели переломных моментов, описывающие внезапную смену агрегированного поведения после того, как достаточное число индивидов изменяют свое поведение, впервые разработал и применил к различным социальным ситуациям Том Шеллинг. Его хрестоматийный пример, разработанный в 1970-х годах, описывает коллапс районов со смешанным составом жителей и их превращение в полностью сегрегированные сообщества после того, как достигнут определенный порог доли покидающего район белого населения. Экономисты уже давно заметили и изучали возможности множественного равновесия, часто в контексте высоко стилизованных моделей. Я приводил пример такой модели в начале этой главы (история о кораблестроителе и игре с координацией). Зависимость от пройденного пути свойственна крупному классу динамических экономических моделей. И далее в том же духе.

Критик скажет, что экономисты считают такие модели исключениями на фоне «нормальных» случаев, для которых используют привычную модель конкурентного рынка. И будет отчасти прав: экономисты склонны слишком часто прибегать к некоторым стандартным моделям в ущерб всем другим. В некоторых обстоятельствах простая модель может оказаться, скажем так, чересчур простой. Нам нужно больше подробностей. Но штука в том, чтобы изолировать только те взаимодействия, которые являются значимыми согласно гипотезам,

и никакие более. Как следует из приведенных выше примеров, модели могут делать все это и по-прежнему оставаться простыми. Нет модели, которая всегда лучше других. Запомните: моделей не одна, а несколько.

Простота, реализм и реальность

В исключительно коротком — всего в один абзац — рассказе аргентинского писателя Хорхе Луиса Борхеса «О точности в науке» говорится о мифической империи из далекого прошлого, картографы которой очень серьезно относились к своему делу и стремились к совершенству. Стремясь запечатлеть как можно больше подробностей, они рисовали огромные карты. Карта провинции вырастала до размера города; карта империи заняла целую провинцию. Со временем даже такой уровень детализации стал недостаточным, и коллегия картографов создала карту империи в масштабе 1:1, размером с саму империю. Но следующие поколения, менее преданные искусству картографии и более нуждавшиеся в помощи при мореплавании, не нашли применения этим картам. Они отвергли их и бросили разрушаться в пустыне³².

Рассказ Борхеса иллюстрирует несостоятельность довода о том, что модели должны усложняться, чтобы приносить больше пользы. Экономические модели релевантны и дают нам знание

32. Jorge Luis Borges, «On Exactitude in Science», in Jorge Luis Borges, *Collected Fictions*, trans. Andrew Hurley (New York: Penguin, 1999); Хорхе Луис Борхес, «О строгой науке», в: Хорхе Луис Борхес, *Новые расследования. Произведения 1942–1969 годов* (Санкт-Петербург: Амфора, 2000), 567.

о мире именно *потому*, что они просты. Для релевантности не нужна сложность, и сложность может затруднить обеспечение релевантности. Простые модели — обязательно во множественном числе — это то, без чего невозможно обойтись. Модели никогда не являются истиной; но в моделях есть истина³³. Мы можем понять мир, лишь упростив его.

33. Uskali Maki, «Models and the Locus of Their Truth» *Synthese* 180 (2011): 47–63.

Наука экономического моделирования

МОДЕЛИ делают экономику наукой. Говоря это, я не имею в виду науки типа физики или химии, которые стремятся открыть фундаментальные законы природы. Экономическая наука — наука об *обществе*, а у общества нет фундаментальных законов (по крайней мере, в том смысле, в каком они есть у природы). В отличие от камня или планеты, люди способны действовать и выбирать, что им делать. Действия создают почти бесконечное пространство возможностей. В лучшем случае мы можем говорить о тенденциях, о свойственных данному контексту закономерностях и о возможных последствиях. Также я не имею в виду науки типа математики, выдвигающие точные суждения (пусть даже и об абстрактных сущностях), которые могут быть однозначно определены как верные или неверные. Экономическая наука имеет дело с реальным миром, и поэтому в ней все намного запутаннее. Экономисты часто впадают в заблуждение именно потому, что воображают себя учеными вроде физиков и математиков.

Что касается критиков, то они склонны высмеивать претензии экономистов на научность — по их мнению, экономисты лишь притворяются, что занимаются наукой. Кейнс видел весьма скромное будущее для экономики, что нехарактерно для экономиста: «Как было бы прекрасно, если бы экономисты

заставили думать о себе, как о дантистах — скромных, честных мастерах своего дела!» — писал он в 1930 году¹. Возможно, стоматология — даже чересчур амбициозный ориентир, принимая во внимание разнообразие болезней, поражающих человеческое общество. Добрая толика скромности уместна не только применительно к тому, как много знают экономисты, но и к тому, как много они способны узнать.

Сделав эти оговорки, давайте посмотрим, что делает модели научными. Во-первых, как я объяснил в предыдущей главе, модели проясняют суть гипотез, делают ясной их логику и показывают, от каких факторов они зависят, а от каких — нет. По большому счету модели нужны для прояснения интуитивных догадок и расстановки всех точек над *i*, что само по себе важно. Но довольно часто они вносят более существенный вклад: позволяют нам заметить неочевидные возможности и неожиданные последствия. Во-вторых, модели делают возможным накопление знания за счет расширения набора достоверных объяснений — и нашего понимания — многих общественных явлений. В этом смысле развитие экономической науки подобно расширению библиотеки: оно происходит за счет увеличения коллекций. В-третьих, модели предполагают использование эмпирического метода; они говорят нам, как приложить конкретные гипотезы и объяснения к реальным обстоятельствам. Они делают возможной проверку доказательств на правильность. И даже если эмпирических данных недостаточно для выявления правильных моделей,

1. John Maynard Keynes, *Essays in Persuasion* (New York: W. W. Norton, 1963), 358–373; Джон Мейнард Кейнс, «Экономические возможности наших внуков», *Вопросы экономики*, 2009, № 6, 67.

модели предлагают способ устранения разногласий. Наконец, модели ставят в основу производства знания общепризнанные профессиональные стандарты, а не существующие иерархии, основанные на рангах, личных связях или идеологии. Статус работы экономиста зависит, в общем и целом, от ее качества, а не от личности этого экономиста.

Проясняя гипотезы

Постулат с эпическим названием «Первая фундаментальная теорема экономики благосостояния» — один из бриллиантов в короне экономической науки. (Вскоре мы познакомимся с его близким конкурентом). Аспиранты первого года обычно тратят весь первый семестр на то, чтобы уразуметь доказательство этой теоремы, по пути обучаясь математике (действительному анализу и топологии), которую большинство из них никогда больше не будет использовать. Эта теорема — не что иное, как математическое выражение ключевого условия того, что в предыдущей главе названо «моделью рынка совершенной конкуренции». Вкратце его суть в том, что конкурентная рыночная экономика эффективна. Точнее говоря, при условии соблюдения предпосылок этой теоремы рыночная экономика обеспечивает максимальный объем выпуска по сравнению с любой другой хозяйственной системой. Не существует способа улучшить этот результат, то есть никакое перераспределение ресурсов не улучшит положение одного человека без ухудшения положения другого². Заметьте, что

2. В свою очередь, «Вторая фундаментальная теорема экономики благосостояния» показывает, как альтернативные

в этом определении эффективности (эффективность по Парето, названная в честь многосторонне одаренного итальянца Вильфредо Парето) ничего не говорится о справедливости или иных социальных ценностях: «эффективным» будет и такой результат рыночного взаимодействия, при котором один человек получает 99% совокупного дохода, при условии, что его потери от любого перераспределения будут превышать выгоду всех остальных.

Это очень сильный и не банальный вывод (забудем пока о проблемах справедливого распределения). Скажем прямо: сегодня идея рынка уверенно ассоциируется с эффективностью во многом потому, что нам больше двух веков твердят о преимуществах рынков и капитализма. На первый взгляд совсем неочевидно, что миллионы потребителей, работников, фирм, вкладчиков, инвесторов, банков и спекулянтов, каждый из которых преследует исключительно свою личную выгоду, вместе придут хоть к чему-то, отличному от экономического хаоса. Однако модель говорит, что результат на самом деле эффективен.

Первая фундаментальная теорема экономики благосостояния известна в обиходе экономистов под названием «Теорема о невидимой руке рынка». Основоположник экономической науки Адам Смит первым сформулировал ее в общем виде. Смит, хотя и не использовал термин «невидимая рука» именно в этом контексте, утверждал, что де-

эффективные результаты могут быть достигнуты с помощью адекватного перераспределения ресурсов; она вводит различие между эффективностью и распределением. Недавние работы показали, что это различие нарушается, если нарушается одна из предпосылок этих двух теорем, такая как существование всех необходимых рынков или полнота информации.

централизованное принятие решений отдельными потребителями и производителями на рынке приведет к коллективной выгоде. «Не от благожелательности мясника, пивовара или булочника ожидаем мы получить свой обед, а от соблюдения ими своих собственных интересов», — писал он в своей знаменитой работе³.

Довод Смита о том, что ценовые стимулы превращают рынок в чрезвычайно эффективное средство координации, работающее без участия человека, наглядно проиллюстрировал Милтон Фридман в популярной телевизионной передаче «Свобода выбора», которую он вел в 1980-х годах, на старте волны рыночных реформ правительств Р. Рейгана и М. Тэтчер. Держа в руке карандаш, Фридман восхищался возможностями свободных рынков: тысячи людей со всего мира работали, чтобы сделать этот карандаш, отмечал он, чтобы добыть графит, обработать древесину, собрать составные части и продать получившийся продукт. И именно система цен, а не какое-то центральное правительство, обеспечила координацию их действий с тем, чтобы карандаш в итоге оказался в руках у потребителя⁴.

В отличие от объяснений Адама Смита и Милтона Фридмана, «Первая фундаментальная теорема» опирается на высоко абстрактную и почти непреодолимую для постижения логику. Впервые

3. Adam Smith, *An Inquiry into the Nature and Causes of the Wealth of Nations*, 5th ed. (1789; repr., London: Methuen, 1904), I.ii.2; Адам Смит, *Исследование о природе и причинах богатства народов* (Москва: Эксмо, 2007), 78.

4. Пример с карандашом взят из эссе: Leonard E. Read «I, Pencil: My Family Tree as Told to Leonard E. Read» (Irvington-on-Hudson, NY: Foundation for Economic Education, 1958), <http://www.econlib.org/library/Essays/rdPncl.html>.

в полном виде ее сформулировали в начале 1950-х годов Кеннет Эрроу и Жерар Дебре, применившие математический аппарат, на тот момент незнакомый большинству экономистов⁵. Стиль этого труда можно оценить по первой же фразе статьи Дебре 1951 года: «Деятельность изучаемой нами экономической системы может быть представлена как преобразование количества товаров l (которое может быть или не быть полностью делимым) силами n производственных единиц и потребление его силами m потребительских единиц»⁶. Несмотря на то, что статьи Эрроу и Дебре имеют фундаментальное значение и принесли обоим экономистам Нобелевские премии, читают их редко. (Признаюсь, что сам я впервые их просмотрел, когда писал эту книгу). Экономисты изучают их по учебникам и иным вторичным источникам.

«Первая фундаментальная теорема» так важна потому, что по-настоящему *доказывает* гипотезу о невидимой руке рынка. Иными словами, она показывает, что при определенных предпосылках эффективность рыночной экономики не является простым совпадением или вероятностью; она логически следует из предпосылок. Ценой сложной математики мы получаем возможность сделать

5. Kenneth J. Arrow, «An Extension of the Basic Theorems of Classical Welfare Economics», in *Proceedings of the Second Berkeley Symposium on Mathematical Statistics and Probability*, ed. J. Neyman (Berkeley: University of California Press, 1951), 507–532; Gerard Debreu, «The Coefficient of Resource Utilization», *Econometrica* 19 (July 1951): 273–92.

6. Есть шуточная история о том, что в 1983 году к Дебре, получившему Нобелевскую премию, пристал один журналист, желавший выяснить его мнение о перспективах развития экономики. Дебре немного поразмыслил и затем сказал: «Представим экономику с n товаров и m потребителей»....

по-настоящему однозначное заключение. Модель показывает, как именно получается этот результат. В частности, в ней в явном виде выведены те конкретные предпосылки, которые должны выполняться для гарантированного достижения эффективности.

Список этих предпосылок на самом деле весьма обширен. Необходимо, чтобы потребители и производители были рациональны и стремились только к максимизации своей экономической выгоды. Должны существовать рынки для всего на свете, включая полный набор будущих рынков, покрывающих все возможные стечения обстоятельств. Информация должна быть полной — имеется в виду, например, что потребители полностью осведомлены обо всех характеристиках товаров еще до того, как купят и начнут пользоваться ими. Нужно исключить возможность монополистического поведения производителей, нарастающей отдачи от масштаба и «экстерналии» (такие как загрязнение окружающей среды или распространение новых знаний, полученных в ходе НИОКР). Разумеется, экономисты со времен Адама Смита знали, что подобные обстоятельства могут мешать работе невидимой руки. Но Эрроу и Дебре собрали все доводы воедино и сделали их явными и точными.

«Первая фундаментальная теорема» описывает целиком гипотетический мир; она не претендует на описание какого-либо реального рынка. Для переноса этой концепции в условия реального мира потребуются здравый смысл, эмпирические данные и дальнейшая теоретическая работа. Позиция относительно ее применимости в экономической политике — своего рода лакмусовая бумажка. С точки зрения экономистов-либералов и полити-

ков-консерваторов, теорема утверждает превосходство общества, живущего по законам рынка. С точки зрения левых, длинный перечень предпосылок демонстрирует фактическую недостижимость эффективности посредством рынков. Сама теорема мало что решает в спорах о государственной политике в реальном мире. Но никто не станет отрицать, что благодаря ей и порожденной ею литературе мы лучше, чем когда бы то ни было, понимаем условия, при которых работает — или не работает — невидимая рука рынка Адама Смита⁷.

Теперь посмотрим на другой важный пример того, как экономическое моделирование помогает прояснить аргументацию, которая в противном случае может быть неочевидной. В 1938 году молодой Пол Самуэльсон принял вызов польско-американского математика Станислава Улама, предлагавшего назвать хоть один тезис в науках об обществе, который был бы одновременно истинен и нетривиален. Самуэльсон назвал сформулированный Давидом Рикардо «Принцип сравнительных преимуществ». «Используя четыре числа, как по волшебству, он показывает, как международная торговля позволяет получить самый настоящий „бесплатный завтрак“»⁸. Доказательство, которое Рикар-

7. Предпосылки, необходимые для выполнения теоремы о невидимой руке рынка, являются *достаточными*, а не *необходимыми*. Иными словами, рынки могут быть эффективны и в том случае, если некоторые допущения не соблюдаются. Эта лазейка позволяет некоторым экономистам утверждать, что свободные рынки желательны даже в том случае, когда выполнены не все критерии Эрроу—Дебре.

8. Paul Samuelson, «The Past and Future of International Trade Theory», in *New Directions in Trade Theory*, eds. A. Deardorff, J. Levinsohn, and R. M. Stern (Ann Arbor, MI: University of Michigan Press, 1995), 22.

до предложил в 1817 году, было столь же простым, сколько и значимым; он показал, что специализация на основе сравнительных преимуществ приносит экономические выгоды всем странам⁹. Нетривиальность этого принципа очевидна по тому, как часто его понимают неправильно даже самые продвинутые комментаторы. Приписываемое Аврааму Линкольну негативное отношение к международной торговле — «когда мы покупаем готовые товары из-за рубежа, мы получаем товары, а чужестранцы — деньги; когда мы покупаем готовые товары дома, мы получаем товары и сохраняем деньги», — может быть апокрифическим, но мало кто с легкостью поймет, что оно нелогично.

Задолго до Рикардо люди отлично понимали, что дешевый импорт из других стран позволяет стране экономить внутренние ресурсы, такие как труд и капитал, которые могут быть направлены на альтернативное применение¹⁰. Но оставалось непонятным, как именно торговля может быть выгодна обеим сторонам. В частности, может ли получить выигрыш от внешней торговли та страна, которая производит товары эффективнее всех прочих, расходуя меньше ресурсов, чем другие страны? Рикардо отвечал утвердительно. Он привел пример с конкретными цифрами, который стал одним из самых первых — и самых успешных — при-

9. David Ricardo, *On the Principles of Political Economy and Taxation* (London: John Murray, 1817), chap. 7; Давид Рикардо, *Начала политической экономии и налогового обложения. Избранное* (Москва: Эксмо, 2007), 153–168.

10. Dani Rodrik, *The Globalization Paradox: Democracy and the Future of the World Economy* (New York: W. W. Norton, 2011), chap. 3; Дэни Родрик, *Парадокс глобализации: демократия и будущее мировой экономики* (Москва: Издательство Института Гайдара, 2014), гл. 3.

менений моделей в экономической науке. Экономисты называют ее моделью внешней торговли «2×2»: две страны (Англия и Португалия) и два товара (сукно и вино).

Предположим, писал Рикардо, в Португалии требуется труд 80 рабочих, чтобы произвести некоторое количество вина, и труд 90 рабочих, чтобы произвести некоторое количество сукна. В Англии требуется соответственно 120 и 100 рабочих для производства тех же объемов обоих товаров. Заметьте, что Португалия превосходит по эффективности Англию в производстве и сукна, и вина. Тем не менее Рикардо показал, что Португалия выигрывает от экспорта вина в Англию в обмен на ввоз сукна. Португалии «выгоднее употреблять свой капитал предпочтительно на производство вина, за которое она получит больше сукна из Англии, чем она произвела бы сама, если бы она переместила часть своего капитала из виноделия в производство сукна»¹¹. Выгода создается за счет *сравнительного*, а не абсолютного преимущества. Страна выигрывает от экспорта того, что производит относительно лучше, и импорта того, что производит относительно менее успешно.

Если вам не очень понятно, вспомните слова Самуэльсона: этот принцип совсем не очевиден. Вам придется поразмыслить и сделать некоторые расчеты, прежде чем вы примете его.

Простая модель Рикардо позволила понять, от чего *не* зависит выигрыш от внешней торговли.

11. David Ricardo, *On the Principles of Political Economy and Taxation*, 3rd ed. (London: John Murray, 1821), chap. 7, para. 7.17, <http://www.econlib.org/library/Ricardo/ricP2a.html>; Рикардо, *Начала политической экономии и налогового обложения*, 158.

Стране не нужно быть лучше торгового партнера в производстве товара, чтобы с успехом экспортировать его. Также ей не нужно быть хуже партнера, чтобы что-то импортировать. Дальнейшее развитие модели теоретиками следующих поколений выявит и другие параметры, от которых не зависит выгодность внешней торговли. Неважно, о скольких товарах идет речь; сколько стран участвует в торговле; имеются ли товары и услуги, не подлежащие продаже, наряду с теми, которые торгуются; достигается ли торговый баланс в каждый момент времени; может ли капитал (или другие ресурсы) свободно перемещаться из одной отрасли в другую. Оказалось, что в отношении «Принципа сравнительных преимуществ» и выгоды от внешней торговли ни одно из этих упрощений не является критически важным.

Дальнейшие исследования также прояснили ограничения модели. Например, некоторые условия, при которых «Первая фундаментальная теорема» не работает, также могут вести к убыткам от внешней торговли. Можно привести примеры как минимум нескольких стран, которые терпели убытки от внешней торговли в присутствии экстерналий или экономии от масштаба. В 1950-х и 1960-х эта перспектива особенно беспокоила власти развивающихся стран, и в ответ они организовали барьеры для импорта, за которыми ожидали увидеть процветание собственной промышленности. И даже если внешняя торговля выгодна, это определенно не означает, что *каждый* гражданин останется в выигрыше. Наоборот, большинство существующих моделей заключает, что положение по меньшей мере некоторых групп ухудшится: например, положение работников в отраслях, конкурирующих с иностранными производителями, или

неквалифицированных рабочих в стране со сравнительно избыточным числом квалифицированных работников. Некоторые из тех, кто выступает в поддержку внешней торговли на том основании, что она выгодна каждому, не понимают, как на самом деле работает сравнительное преимущество.

«Принцип сравнительных преимуществ» и «Первая фундаментальная теорема экономики благосостояния» — два самых ярких и наиболее значительных примера того, как модели обнажают самую суть экономических гипотез: что именно они говорят, почему они работают, и в каких условиях их можно применять. Но они отражают стиль работы, общий для всей дисциплины. Финансовые спекуляции укрепляют или подрывают стабильность? Нужно ли помогать нуждающимся семьям денежными субсидиями или субсидиями на оплату обучения? Должна ли денежная политика быть гибкой или следовать жестким правилам? В каждом случае подход экономиста предполагает создание модели и проверку условий, при которых наиболее вероятен тот или иной результат.

Непосредственные свидетельства не заменят выстроенные подобным образом размышления. Возьмем крайний случай и предположим, что у нас есть данные, дающие однозначный ответ на один из поставленных вопросов. Такие данные неизбежно будут привязаны к определенному месту и времени: финансовые спекуляции действительно помогли стабилизировать фьючерсы на кукурузу на Чикагской бирже в 1995–2014 годах, а прямые денежные субсидии действительно оказались эффективнее субсидий на оплату начального школьного образования в Танзании в 2010–2012 годах. При всей полезности таких свидетельств, их придется встроить в экономические модели, прежде чем мы смо-

жем правильно их интерпретировать. Например, были ли денежные субсидии эффективнее субсидий на обучение потому, что давали семьям лучшие стимулы, или потому, что облегчали работу чиновников, реализующих эту программу? Экстраполяция данных на иные обстоятельства (или в будущее) также требует использования моделей. Скажем, способны ли финансовые спекуляции стабилизировать валютные рынки? Будет ли спекуляция фьючерсами на кукурузу по-прежнему стабилизировать рынок два года спустя? Для ответа на эти вопросы нужны модели — но они часто остаются невнятными и неявно выраженными. Чем в более явном виде сформулирована модель, тем прозрачнее допущения, которые мы делаем для истолкования и экстраполяции эмпирических данных.

Когда обычная интуиция нас подводит

В одной из многочисленных шуток экономистов о своей профессии говорится, что «экономист — это тот, кто видит, как что-то работает на практике, и спрашивает, работает ли это в теории». Выглядит абсурдно, но лишь пока мы не поймем, с какой легкостью можно впасть в заблуждение, полагаясь на интуицию, и как порой жизнь преподносит противоречащие интуиции результаты. Экономические модели помогают натренировать интуицию на то, чтобы учитывать вероятность таких неожиданных исходов. Сюрпризы могут принимать самые разнообразные формы.

Первая категория — это «взаимодействия общего равновесия». Этот термин, который не следует путать с «частным равновесием», или анализом

в рамках одного рынка, является замысловатым способом сказать, что мы отслеживаем эффекты обратной связи между различными рынками. Скажем, происходящее на рынках труда воздействует на рынки товаров, которые в свою очередь влияют на рынки капитала, и так далее. Отслеживание всей цепочки взаимодействий часто вносит серьезные оговорки, а иногда полностью опровергает выводы, полученные на основе простых моделей спроса и предложения, ограниченных одним рынком в один момент времени.

Возьмем иммиграцию, тему большого политического значения для США и ряда других развитых экономик. Как рост иммиграции, допустим, во Флориду, скажется на рынке труда штата? Первое соображение, что приходит в голову, основано на модели спроса и предложения: рост предложения рабочей силы должен вызвать снижение ее цены, то есть заработной платы. Такой результат иммиграции был бы вполне вероятен в отсутствие эффектов второго и третьего уровня.

Но что если местные рабочие в ответ на усиление конкуренции покинут штат и станут искать работу в других частях страны? Что если приток наемных рабочих приведет к росту инвестиций в физические активы штата, так как привлечет фирмы, строящие новые предприятия и открывающие новые бизнесы? Что если рост числа низкоквалифицированных работников затормозит внедрение новых технологий? Что если появление рабочих-мигрантов стимулирует спрос на производимые именно ими товары? Каждая из этих возможностей может нивелировать первоначальный эффект иммиграции. Нечто подобное произошло в 1980 году в Майами после значительного притока кубинских иммигрантов (их доля составляла 7%

трудовых ресурсов Майами) в результате Мариэльской переправы. Как выяснил экономист из Калифорнийского университета в Беркли Дэвид Кард, наплыв мигрантов почти не повлиял на уровень заработной платы и безработицы в Майами, даже среди наименее квалифицированных рабочих, чье положение больше всего было затронуто появлением мигрантов. И хотя о причинах этого еще спорят, похоже, тут сработало некое сочетание эффектов общего равновесия¹².

Вот другой пример того, почему важно мыслить в терминах общего равновесия. Предположим, что вы — высококвалифицированный специалист (инженер, бухгалтер или опытный механик), занятый в швейной промышленности США. Пойдет ли вам на пользу или во вред расширение торговли со странами с низкими уровнями доходов, такими как Вьетнам или Бангладеш? Если вы будете думать только о событиях в швейной отрасли, то есть в терминах частного равновесия, то придете к заключению, что ваше положение ухудшится. Эти страны наверняка начнут жестко конкурировать со швейными предприятиями США. Но давайте рассмотрим сторону экспорта. По мере расширения новых рынков (за счет средств, вырученных от торговли с США) вырастет экспорт на них продукции других отраслей американской экономики,

12. David Card, «The Impact of the Mariel Boatlift on the Miami Labor Market», *Industrial and Labor Relations Review* 43, no. 2 (January 1990): 245–257; George J. Borjas, «Immigration», in *The Concise Encyclopedia of Economics*, <http://www.econlib.org/library/Enc1/Immigration.html>; Örn B. Bodvarsson, Hendrik F. Van den Berg, and Joshua J. Lewer, «Measuring Immigration's Effects on Labor Demand: A Reexamination of the Mariel Boatlift» (University of Nebraska — Lincoln, Economics Department Faculty Publications, August 2008).

и в растущих экспортно ориентированных отраслях появятся новые возможности для занятости. Поскольку этим ориентированным на экспорт секторам понадобятся высококвалифицированные работники, они будут нанимать много инженеров, бухгалтеров и опытных механиков. И когда взаимодействия множества рынков прокатятся по всей экономике, ваш заработок может вырасти независимо от того, смените ли вы место работы или нет, из-за роста спроса на вашу профессию¹³.

К неожиданным результатам также может привести принцип «второго наилучшего решения». «Общая теория второго наилучшего» — один из самых полезных инструментов в арсенале прикладной экономики и один из самых неочевидных для неподготовленного ума. Ее впервые разработал Джеймс Мид в контексте внешнеторговой политики, а затем обобщили Ричард Липси и Келвин Ланкастер¹⁴. Ее ключевые постулаты гласят, что либерализация рынков или появление ранее не существовавших рынков не всегда приносит пользу

-
13. Это замечательная теорема Столпера — Самуэльсона, расширение базового «Принципа сравнительных преимуществ». Она гласит, что снятие торговых барьеров благоприятствует факторам производства, которые находятся в относительном избытке (независимо от сектора, в котором они применяются), и идет во вред тем, которые находятся в недостатке. Критически важное допущение в основании теоремы требует, чтобы факторы производства (работники разной квалификации и капитал) были мобильны между отраслями. См.: Wolfgang Stolper and Paul A. Samuelson, «Protection and Real Wages», *Review of Economic Studies* 9, no. 1 (1941): 58–73.
14. James E. Meade, *The Theory of International Economic Policy*, vol. 2, *Trade and Welfare* (London: Oxford University Press, 1955); Richard G. Lipsey and Kelvin Lancaster, «The General Theory of Second Best», *Review of Economic Studies* 24, no. 1 (1956–57): 11–32.

в случае, если на связанных с ними рынках продолжают действовать ограничения.

Вначале эта теория применялась к торговым соглашениям между группами стран, таких как Европейский общий рынок. Согласно таким договоренностям страны-участницы либерализуют свои торговые связи, снижая или снимая барьеры для взаимной торговли. Простой вывод из «Принципа сравнительных преимуществ» говорит, что все участники получают выгоду от торговли. Но этого может и не случиться. Преференциальные торговые договоренности ведут к тому, что Франция и Германия теперь больше торгуют между собой, и это хорошо. Это явление называется «эффект создания торговых связей». Но по той же причине Германия и Франция теперь меньше импортируют более дешевых товаров из Азии или Соединенных Штатов, что плохо. На языке экономистов это называется «эффект нарушения торговых связей».

Чтобы понять, как нарушение торговых связей снижает экономическое благосостояние, представьте, что США поставляют в Германию говядину по цене 100 долларов. Предположим, что Германия вводит пошлину в 20%, что повышает потребительскую цену на говядину на немецком рынке до 120 долларов. Тем временем Франция может поставлять то же количество говядины по цене всего лишь 119 долларов. До заключения приоритетных договоренностей между Францией и Германией французские поставщики облагались по тому же тарифу, что и американские производители, и не выдерживали конкуренции с ними. Теперь посмотрим, что произойдет, если Германия отменит пошлины на импорт из Франции, но сохранит пошлины на импорт из США. Ввозимая в Германию из Франции говядина внезапно становится дешевле американской

(110 долларов против 120), и импорт из США резко снижается. Немецкие потребители выигрывают 1 доллар, но немецкий бюджет теряет 20 долларов прибыли от таможенных платежей, которые ранее поступали от импорта говядины из США (и могли бы вернуться к потребителям или использоваться для снижения других налогов в Германии). В целом Германия оказывается в проигрыше.

Логика «второго наилучшего» действует в огромном множестве случаев. Один из самых известных — синдром «голландской болезни», получивший название по событиям, последовавшим за обнаружением в 1950-х годах в Нидерландах залежей природного газа. Многие наблюдатели отмечали, что в 1960-х годах конкурентоспособность голландской промышленности снизилась вслед за укреплением гульдена в ответ на приток доходов от добычи газа, что привело к потере доли рынка голландскими производителями. «Общая теория второго наилучшего» в явном виде перечисляет обстоятельства, при которых ажиотаж в связи с появлением нового ресурса может стать плохой новостью (в экономическом плане). Он закономерно ухудшает положение ряда отраслей, таких как обрабатывающая промышленность, вследствие роста курса национальной валюты¹⁵. Само по себе это не проблема: структурные изменения являются неотъемлемой частью экономического прогресса. Но все меняется, если продукция вытесняемых отраслей исходно находилась

15. Рост курса валюты — более наглядный механизм, но к тому же результату может привести рост уровня заработной платы отечественных работников. Для вытеснения отечественных производителей достаточно, чтобы выросла оплата труда внутри страны в валютном эквиваленте, а причиной может быть или рост зарплат, или рост курса национальной валюты, или их сочетание.

в дефиците — как из-за наложенных государством ограничений, так и потому, что эти отрасли служили источником технологических новшеств для других отраслей экономики. Экономические поте-ри из-за сжатия важных видов деятельности могут даже перевесить прямую выгоду от всплеска актив-ности в связи с появлением нового ресурса. И это не просто теоретическая проблема. Правительства богатых ресурсами стран Африки к югу от Сахары сталкиваются с этой проблемой ежедневно, потому что давление высоких зарплат в прибыльной добы-вающей отрасли подрывает конкурентоспособность обрабатывающей промышленности.

Взаимодействия «второго наилучшего» не все-гда опровергают выводы из стандартных моделей; иногда они подкрепляют доводы в пользу либера-лизации рынков. В примере с «голландской болез-нью» негативное воздействие на обрабатывающую промышленность станет благом в случае, если при-ходят в упадок «грязные» отрасли, которые нано-сят ущерб окружающей среде и не возмещают его. Но часто результат полностью переворачивает вы-воды, к которым приводят привычные соображе-ния, и оказывается, что мера, которая вроде бы вела в правильном направлении, на самом деле удаляет нас от цели. Минус на минус дает плюс. Поскольку конкуренция на рынках никогда не бы-вает совершенной, как в учебнике, проблемы «вто-рого наилучшего решения» постоянно возникают в реальном мире. Как сказал экономист из Прин-стонского университета Авинаш Диксит, «весь мир в лучшем случае — лишь второе наилучшее»¹⁶. Это означает, что нужно с осторожностью обращаться

16. Avinash Dixit, «Governance Institutions and Economic Activi-ty», *American Economic Review* 99, no. 1 (2009): 5–24.

с ключевыми экономическими моделями, предполагающими идеальное функционирование рынков. Зачастую их необходимо делать менее строгими, учтя некоторые наиболее важные несовершенства рынка. Выбор подходящей модели — ключ к успеху.

Третий вид неочевидных результатов происходит из стратегических действий и взаимодействий. Пример мы уже видели в дилемме заключенных. Оппортунистическое поведение приводит к результату, которого каждый из игроков предпочел бы избежать. В общем, как давно заметил Томас Шеллинг, понимание того, что имеет место стратегическое взаимодействие (то, что делаю я, повлияет на то, что делаешь ты, и наоборот), может обусловить совершение действий, бессмысленных в иных обстоятельствах¹⁷. Моя угроза разбомбить вас в случае невыполнения моих требований неубедительна, если вы в состоянии ответить мне тем же; поэтому угроза неэффективна. Но что если я буду вести себя как сумасшедший, и вы засомневаетесь в том, способен ли я вообще на рациональные решения?

Стратегические действия, имеющие целью направить взаимодействие к выгоде одного игрока, могут принимать разнообразные формы. Чтобы убедить вас, что я не пойду на дальнейшее снижение цен во время, остающееся до конца срока заключения договоренности, я могу просто прекратить всякие переговоры, следуя стратегии «сжжения мостов». Чтобы предостеречь вас от кон-

17. Thomas C. Schelling, *The Strategy of Conflict* (Cambridge, MA: Harvard University Press, 1960); Schelling, *Micromotives and Macrobehavior* (New York: W. W. Norton, 1978); Томас Шеллинг, *Стратегия конфликта* (Москва: ИРИСЭН, 2007); Томас Шеллинг, *Микромотивы и макроповедение* (Москва: Издательство Института Гайдара, 2016).

курунции со мной, я буду наращивать запас производственных мощностей вплоть до того, что в случае вашего вторжения в мой бизнес у меня возникнет соблазн начать агрессивную ценовую войну, которая в конечном счете приведет нас обоих к банкротству. Чтобы получить ваше доверие как заемщик, я могу заключить контракт с третьей стороной (хотя бы и с бандитами), по которому соглашаюсь нести большие издержки (бандиты сломают мне ногу) в случае, если не смогу вернуть вам долг¹⁸. Во всех этих случаях действия, лишённые смысла вне стратегического контекста, внезапно оказываются обоснованными в свете подразумеваемой цели — изменить соотношение выгод и издержек для конкурента или партнера.

Наконец, некоторые неочевидные результаты возникают вследствие проблемы «непостоянства предпочтений», которая описывает, если говорить в общем, конфликт между желательными состояниями в краткосрочном и долгосрочном периодах. Политики могут понимать, что в долгосрочном периоде печатание денег приведет лишь к инфляции, но зачастую не справляются с соблазном немного раздуть денежную массу ради того, чтобы прямо сейчас, в преддверии выборов, обеспечить рост экономической активности. Потребители могут знать о необходимости делать сбережения на старость, но зачастую не могут отказать себе в удовольствии полностью выбрать лимит на своих кредитных картах. Эти примеры похожи на случаи стратегического взаимодействия с той разницей, что здесь взаимодействие происходит между «сего-

18. Прекрасный пример обсуждения на конкретных примерах см. в: Avinash K. Dixit and Barry J. Nalebuff, *The Art of Strategy* (New York: W. W. Norton, 2008).

дня» и «завтра» одного и того же человека. Неспособность сегодняшнего «я» следовать желаемому способу действий вредит этому же «я» в будущем.

В общем виде решение этих проблем заключается в стратегии предварительных обязательств. Так, в примере с инфляцией политик может поручить проведение кредитно-денежной политики независимому центральному банку, который имеет единственной задачей обеспечение стабильности цен или управляется ультраконсервативным банкиром. В примере со сбережениями человек может поручить работодателю производить автоматические вычеты из заработка на пенсионные накопления. Парадоксальность данных случаев в том, что ограничение свободы действий агента приносит ему пользу, вопреки привычному экономическому правилу о том, что чем больше выбор, тем лучше. Но парадокс этот только кажущийся. То, что является парадоксом для одного класса моделей, часто немедленно получает объяснение в другом классе моделей.

Научный прогресс и последовательная смена моделей

Спросите экономиста, что делает экономику наукой, и он ответит что-то в духе «экономика является наукой потому, что мы используем научный метод: выдвигаем гипотезы и затем проверяем их. Когда теория не проходит проверку, мы отвергаем ее, после чего или создаем ее улучшенную версию, или заменяем другой. В конечном счете экономическая наука совершенствуется за счет создания теорий, которые все лучше объясняют мир».

Эта благостная картина имеет мало общего с тем, что экономисты делают на практике, и с тем, как на самом деле развивается дисциплина¹⁹. Начнем с того, что значительная часть деятельности экономистов резко отличается от гипотетико-дедуктивного шаблона, согласно которому гипотезы сначала формулируют, а потом сопоставляют с фактами из реального мира. Более распространена стратегия, в рамках которой толчком к созданию модели становится закономерность или результат, которые не в силах объяснить существующие модели, — например, кажущееся несуразным поведение банков, которые ограничивают размер кредита фирмам вместо того, чтобы просто повысить процентные ставки. Исследователь разрабатывает новую модель, которая, как он считает, лучше объясняет «отклоняющиеся» наблюдения.

В случае с ограничением суммы кредита разумным объяснением будет стремление снизить риски: повышение ставок выше определенного порога заставит заемщика ввязываться во все более рискованные проекты, поскольку для него установлен предел возможных потерь. Благодаря принципу ограниченной ответственности, заемщик будет

19. После выхода работы Томаса Куна «Структура научных революций» стало принято сомневаться даже в том, что естественные науки соответствуют этому идеализированному представлению. Кун отмечал, что ученые работают в рамках «парадигм», от которых они не готовы отказываться даже при наличии опровергающих их фактов. В отношении экономической науки мне важно другое: как наука, она развивается «горизонтально» (умножая количество моделей), а не «вертикально» (заменяя новыми моделями старые). См.: Thomas Kuhn, *The Structure of Scientific Revolutions* (Chicago: University of Chicago Press, 1962); Томас Кун, *Структура научных революций* (Москва: Прогресс, 1977).

обязан вернуть кредиторам лишь сумму, не превышающую стоимость его ликвидных активов²⁰. Полученная в итоге модель может быть представлена как выведенная дедуктивным путем из основных принципов. В конечном счете именно таким принято видеть научный метод экономистов. Но на самом деле в размышлениях, которые привели к созданию модели, велика доля индукции. А поскольку модель призвана объяснять определенную эмпирическую реальность, она не может быть напрямую проверена в той же самой реальности. Иными словами, ограничение суммы кредита само по себе не является проверкой нашей теории, поскольку именно оно и дало повод для создания теории.

Более того, даже если экономисты применяют по-настоящему дедуктивный подход с проверкой гипотез, результаты их трудов по большей части не проверяемы в строгом смысле этого слова. Наша дисциплина изобилует моделями, выводы которых противоречат друг другу, как мы видели ранее. Однако очень немногие из моделей, с которыми когда-либо работали экономисты, были отвергнуты столь окончательно, чтобы экономическая наука признала их очевидно ошибочными. Появляется немало исследований, которые претендуют на эмпирическое доказательство правильности той или иной модели. Но эти упражнения обычно дают нестабильные результаты, их выводы нередко ослабляются (или опровергаются) последующим эмпирическим анализом. Как следствие, смена предпочитаемых моделей в нашей профес-

20. Joseph E. Stiglitz and Andrew Weiss, «Credit Rationing in Markets with Imperfect Information», *American Economic Review* 71, no. 3 (June 1981): 393-410.

сии определяется не эмпирическими подкреплениями как таковыми, а скорее следует моде или переменчивым представлениям о том, какова правильная стратегия создания моделей.

Социология нашей профессии — предмет главы 5. Здесь же важнее то, что именно социальная реальность делает экономические модели столь трудными или даже недоступными для проверки. Во-первых, социальный мир редко дает недвусмысленные данные, позволяющие исследователю однозначно оценить валидность альтернативных гипотез. Большинство интересующих нас вопросов (в чем причина экономического роста? Действительно ли налоговая политика стимулирует экономику? Помогают ли денежные трансферты снизить бедность?) невозможно изучать в лаборатории. Причины, которые мы ищем, обычно скрываются за беспорядочным клубком взаимозависимостей в имеющихся данных. Несмотря на все усилия эконометриков, убедительные свидетельства причинно-следственных связей печально известны своей трудноуловимостью.

Еще большее препятствие создает невозможность ожидать от наших экономических моделей универсальной валидности. Можно поспорить о том, существует ли вообще множество универсальных законов, хотя бы и в физике²¹. Но, как я много раз по-

21. Вот что говорит физик Стивен Вейнберг: «Ни один из известных сегодня законов физики (возможно, за исключением общих принципов квантовой механики) в точности и универсально валиден. Тем не менее многие из них приобрели окончательно возможную форму и валидны в определенных известных обстоятельствах. Уравнения электрического тока и магнитного поля, сегодня известные как уравнения Максвелла, не те же самые уравнения, которые первоначально записал Макс-

вторял, экономическая наука — нечто иное. В ней контекст — превыше всего. То, что верно для одних обстоятельств, может не быть верным в других обстоятельствах. Некоторые рынки конкурентны, а некоторые — нет. Некоторые рынки требуют анализа в терминах «второго наилучшего», а некоторые — нет. И так далее. Поэтому неудивительно, что реакции разных обществ на весьма похожие политические меры часто существенно различаются (как, например, в случае приватизации государственных активов или либерализации импорта). В итоге искушенные экономисты используют разные модели, чтобы разобраться в причине такого расхождения результатов. Опора на множественные модели не отражает их неадекватности; она отражает вероятностный характер социальной жизни.

Экономическая наука накапливает знание не вертикально, когда лучшие модели приходят на смену худшим, а горизонтально, когда более новые модели объясняют те аспекты общественной жизни, которые ранее не рассматривались. Новые модели не замещают старые. Они привносят новое измерение, которое в некоторых обстоятельствах может быть более подходящим.

Рассмотрим, как эволюционировало понимание экономистами одного из самых главных вопро-

велл; это уравнения, к которым физики пришли спустя десятки лет последующей работы других физиков... Сегодня их рассматривают как приближение к тому, что является валидным в ограниченном контексте... но в этой форме и в этом ограниченном контексте они просуществовали более века и наверняка будут существовать вечно. Полагаю, что этот вид законов физики соответствует чему-то столь же реальному, как и все другие известные нам вещи» (Steven Weinberg, «Sokal's Noax», *New York Review of Books*, 43, no. 13 (August 8, 1996): 11-15).

сов в экономической науке: как на самом деле работают рынки? Сначала в центре внимания были рынки с совершенной конкуренцией, с большим числом производителей и потребителей, никто из которых не может воздействовать на рыночные цены. Именно в контексте подобных конкурентных рынков были сформулированы фундаментальные принципы эффективности рыночной экономики. Но довольно рано сложилось другое направление дисциплины, в котором анализировали результаты взаимодействий на рынках с несовершенной конкуренцией, монополизированных одним крупным производителем или контролируемых несколькими крупными фирмами. Существовало ясное понимание того, что поведение участников таких рынков в корне отличается от образцового конкурентного рынка.

В отличие от модели рынка с совершенной конкуренцией, которая существует только в одном варианте, количество и разнообразие моделей рынков с несовершенной конкуренцией ограничено лишь фантазией исследователя. Помимо моделей монополий и дуополий, у нас есть также «монополистическая конкуренция» (много фирм, каждая из которых обладает рыночной властью над своим товаром), конкуренция по Бертрону против конкуренции по Курно (различаются предпосылками о механизме ценообразования), статические модели против динамических (различаются степенью сговора, которую в состоянии обеспечить фирмы), одновременные модели против моделей последовательных шагов (определяют, есть ли преимущества у того, кто сделает ход первым), и так далее. За десятилетия работы с моделями мы уяснили, что несовершенная конкуренция может давать поразительное разнообразие результатов — в зависи-

мости от того, какие предпосылки мы примем в отношении этих и многих других параметров. Еще важнее то, что благодаря прозрачности предпосылок мы также разобрались, какая именно предпосылка обуславливает каждый из исходов.

В 1970-х годах экономисты начали моделировать другой аспект рынков: асимметрию информации. Это важная черта рынков реального мира. Работники лучше знают о своих возможностях, чем работодатели. Заемщики знают, насколько вероятен их дефолт, а кредиторам это неизвестно. Покупатели подержанных автомобилей не знают, покупают ли они «лимон» (автомобиль-развалюху), но это известно продавцам. Майкл Спенс, Джозеф Стиглиц и Джордж Акерлоф в своих работах показали, что такие рынки демонстрируют ряд характерных особенностей, включая сигналы (затратные инвестиции в поведение, которое не приносит немедленной ощутимой выгоды), нормирование (отказ предоставить благо или товар, даже по более высокой цене) и коллапс рынка. Эти исследования принесли всем трем экономистам совместную Нобелевскую премию в 2001 году, а также породили массу работ, продолжающих появляться и по сей день. В результате мы стали намного лучше понимать устройство рынков кредита и страхования, на которых асимметрия информации встречается сплошь и рядом²².

22. Вот как Джордж Акерлоф описал в своей нобелевской лекции этот переход в экономическом моделировании, частью которого стал он сам: «В начале 1960-х годов стандартная микроэкономическая теория почти целиком основывалась на модели полностью конкурентного общего равновесия. К 1990-м годам исследования в рамках этой модели составляли лишь одно из направлений в экономической теории. Тогда типичные

Сегодня экономисты все чаще обращают внимание на рынки, где потребители ведут себя не вполне рационально. Такая переориентация привела к возникновению нового направления, называемого поведенческой экономикой, которое стремится обобщить догадки психологов с помощью экономических приемов формального моделирования. Эти новые понятийные схемы очень перспективны в случаях, когда потребители демонстрируют поведение, которое не объясняют существующие модели — когда, например, они проходят полмили до другого магазина, где футбольный мяч стоит на 2 доллара меньше, но не делают этого, чтобы сэкономить 100 долларов при покупке дорогостоящей стереосистемы. Многие стандартные выводы более не применимы в случаях, когда поведение управляется нормами или эвристиками — практи-

статьи по экономической теории писали в совершенно ином стиле, чем сейчас, когда экономические модели применяются к конкретным рынкам и конкретным ситуациям. В этом новом стиле экономическая теория не просто исследует отклонения от единственной модели совершенной конкуренции. Напротив, в новом стиле экономическая модель специально настраивается для того, чтобы описывать все значимые особенности, свойственные рассматриваемой проблеме. Совершенная конкуренция — лишь одна модель из многих, хотя сама по себе она представляет интересный особый случай. Поскольку „Рынок лимонов“ [исследование, которое принесло Акерлофу Нобелевскую премию] стал одной из первых работ в этом новом стиле экономической науки, ее истоки и история создания — целая эпопея о ходе этих изменений» (Akerlof, «Writing the „The Market for „Lemons“: A Personal and Interpretive Essay» (2001 Nobel Prize lecture). http://www.nobelprize.org/nobel_prizes/economic-sciences/laureates/2001/akerlof-article.html?utm_source=facebook&utm_medium=social&utm_campaign=facebook_page.

ческими правилами, а не рассуждениями в терминах выгод и издержек. Принципы нерелевантности невозвратимых затрат (совершенные платежи, которые невозможно возместить) и эквивалентности финансовых и альтернативных издержек (стоимость использованных возможностей) не работают в условиях неполной рациональности, и это лишь два из многих возможных примеров.

Пусть и значительно упрощенное, это обзорное описание должно дать представление о растущей разнородности объяснительных моделей в нашей профессии. Мы вышли за пределы конкурентных моделей, перейдя к моделям несовершенной конкуренции, асимметричной информации и поведенческой экономики. Идеализированные безупречные рынки уступили место рынкам, которые подвержены самого разного рода провалам. Положение о рациональном поведении замещается результатами исследований психологов. Как правило, стимулом к расширению становится накопление эмпирических наблюдений, противоречащих существующим моделям. Например, почему многие фирмы платят работникам зарплату существенно выше рыночного уровня оплаты труда для работников схожей квалификации?²³ Почему родители чаще опаздывают забрать детей из детского сада, когда в нем вводится штраф за подобные опоздания?²⁴ Каждый вопрос вызывал появление новых моделей.

23. Andrew Weiss, *Efficiency Wages: Models of Unemployment, Layoffs, and Wage Dispersion* (Princeton, NJ: Princeton University Press, 1990).

24. Знаменитый эксперимент в израильском детском саду описан в работе: Uri Gneezy and Aldo Rustichini, «A Fine Is a Price», *Journal of Legal Studies* 29, no. 1 (January 2000): 1–17. Авторы трактуют такой результат как следствие изме-

Новые поколения моделей не делают модели прежних поколений ошибочными или менее релевантными; они просто расширяют спектр аналитических наработок в дисциплине. Заурядная модель рынка с совершенной конкуренцией остается незаменимой для ответа на множество вопросов, возникающих в реальном мире. В ряде ситуаций не стоит беспокоиться о возможной асимметрии информации, например, в случае повторяющихся покупок несложных потребительских товаров, поскольку со временем люди разберутся в том, каковы релевантные характеристики этих товаров, такие как качество и долговечность. И мы сильно ошибемся, если предположим, что потребительское поведение всегда направляется эвристиками, а рациональность почти не играет роли. Старые модели остаются полезными; мы лишь дополняем их.

Прогресс? Да, несомненно. Экономисты никогда не понимали рынки столь глубоко, как сейчас. Но это не тот прогресс, который имеет место в естественных науках. Здесь горизонтальное расширение не предполагает существования неизменных законов природы, ждущих своей очереди, чтобы быть открытыми. В экономике прогресс заключается в стремлении выявить и понять возможные пути развития общества.

Ицхак Гильбоа и его соавторы предлагают полезную аналогию — различие обучения на осно-

нения информационной среды, в которой родители принимают решения, более-менее следуя привычным принципам рациональности. Другая трактовка на основе идеи сдвига норм, который следует за вводом штрафов, представлена в работе: Samuel Bowles, «Machiavelli's Mistake: Why Good Laws Are No Substitute for Good Citizens» (unpublished book manuscript, 2014).

ве правил и на основе кейсов²⁵. Они пишут: «в повседневной, а также в профессиональной жизни люди используют как основанное на правилах, так и основанное на кейсах мышление для прогнозов, классификаций, диагностики, а также этических и юридических суждений». Преимущество рассуждений на основе правил в том, что они позволяют компактно представить большой объем информации, пусть и ценой некоторой потери точности в деталях. С другой стороны, рассуждения на основе кейсов работают через аналогии, опираясь на предыдущие кейсы, которые кажутся похожими. Когда релевантные данные не удается втиснуть в узкие рамки правил без потери большей части их релевантности, аргументация на основе кейсов становится особенно полезной. Как отмечают Гильбоа и соавторы, «некоторые из практик, сложившихся в экономической науке, станут понятнее, если учесть, что научное знание также может принимать вид коллекции кейсов». С этой точки зрения развитие экономической науки идет по пути расширения ее коллекции полезных кейсов.

Модели и эмпирические методы исследований

Множественность моделей — сильная сторона экономики. Однако для дисциплины с претензиями на научность подобное разнообразие может стать проблемой. Что это за наука, если в ней на каждый случай предусмотрена своя модель? Может ли на-

25. Itzhak Gilboa, Andrew Postlewaite, Larry Samuelson, and David Schmeidler, «Economic Models as Analogies» (unpublished paper, January 27, 2013), 6–7.

бор кейсов из аналогии Гильбоа считается настоящей наукой?

Да, может, — если мы будем помнить, что модели содержат информацию о том, в каких обстоятельствах они применимы. Они сообщают нам, когда есть возможность их использовать, а когда — нет. Продолжая аналогию, можно сказать, что экономические модели — это кейсы, к которым предлагается подробная инструкция по применению, объясняющая, как ими пользоваться. Это обеспечивается ясным представлением критически важных предпосылок и поведенческих механизмов.

Таким образом, мы можем хотя бы в принципе понять, принесет ли пользу данная модель для данных конкретных обстоятельств. Стоит ли применять к компьютерной отрасли модель конкуренции или модель монополии? Ответ зависит от наличия существенных барьеров (таких как высокие невозвратные затраты или монополистические практики), затрудняющих вход на рынок для потенциальных конкурентов. Стоит ли беспокоиться о трудностях, связанных с осложнениями ситуаций «второго наилучшего» типа «голландской болезни» или нарушения торговых связей? Ответ зависит в основном от того, имеют ли место и значение определенные несовершенства рынка — соответственно, возможность всем отраслям пользоваться результатами НИОКР в промышленности и торговые барьеры против третьих стран. На самом деле выбор модели зависит и от многих других факторов, что я более подробно покажу в следующей главе. Но возможность отсортировать модели по применимости в конкретных обстоятельствах возникает как раз потому, что модели в явном виде показывают, какие именно предпосылки должны соблюдаться для достижения определенных результатов. Мно-

жественность моделей не означает, что стодится любая из них. Она просто означает, что у нас есть выбор и нам нужен эмпирический метод для совершення этого выбора.

Я не хочу сказать, что эмпирическая верификация с необходимостью или всегда должна удаваться. Но даже когда эмпирические данные спорны, модели создают возможность для рационального и конструктивного обсуждения, поскольку позволяют выявить источники разногласий. В экономической науке споры о государственной политике обычно предполагают противопоставление нескольких моделей. Соображения и рекомендации, не подкрепленные моделью, обычно не пользуются авторитетом. А при наличии моделей всякому ясно, какие допущения относительно реального мира делает каждая из сторон. Этого может не хватить для разрешения спора. Обычно и не хватает, поскольку каждая из сторон по-своему интерпретирует действительность. Но мы хотя бы можем ожидать, что стороны в конечном счете договорятся по поводу того, в чем состоят их разногласия.

В экономической науке постоянно идут подобные споры. Например, полемика о результатах перераспределительного налогообложения в целом сводится к спорам о характере кривой предложения труда предпринимателей. Тех, кто полагает, что предприниматели не значительно реагируют на доходные стимулы, повышение налогов беспокоит значительно меньше, чем тех, кто полагает, что предприниматели высоко чувствительны к доходным стимулам. Пожалуй, самые ожесточенные баталии в нашей специальности вызывает тема кредитно-денежной и налоговой политики в период рецессии. Эти споры, по сути, ведутся

о том, что мешает восстановлению — кривая спроса или кривая предложения в экономике. Если вы считаете, что недостаточен совокупный спрос, то будете выступать за предоставление кредитно-денежных и налоговых стимулов. Если вы видите проблему в шоке предложения (например, из-за чрезмерно высоких налогов или неопределенности экономической политики), то ваш рецепт будет совсем другим. Время от времени накапливается достаточный эмпирический материал, чтобы сделать окончательный выбор в пользу определенного набора моделей перед прочими. Например, так произошло в экономике развития в 1960-х годах, когда «гипотеза о невежественном крестьянине» была отвергнута в пользу «гипотезы о расчетливом крестьянине» после того, как стало ясно, что чувствительность бедных фермеров к ценам намного выше, чем считалось ранее²⁶.

Мне довелось участвовать в дискуссиях о роли промышленной политики в странах с низкими и средними доходами населения²⁷. Она включает такие государственные меры, как предоставление дешевых кредитов или субсидий, которые призваны стимулировать структурные изменения — переход от традиционных малопроизводительных видов деятельности (таких как натуральное хозяйство) к современным высокопроизводительным производствам (таким как обрабатывающая промышленность). Критики привыкли относиться

26. Первым на это указал лауреат Нобелевской премии Теодор Шульц: Schultz, *Transforming Traditional Agriculture* (New Haven, CT: Yale University Press, 1964).

27. Например, см. мою онлайн-дискуссию в журнале *The Economist* с профессором Гарвардской школы бизнеса Джошем Лернером от 12–17 июля 2010 года: <http://www.economist.com/debate/debates/overview/177>.

к этим мерам с презрением, называя их «назначением победителей» — иными словами, бесплодной затеей. Годы экономических исследований показали, что в условиях, свойственных развивающимся экономикам, такие меры вполне оправданны. По ряду причин, связанных с провалами как рынка, так и государства, современные фирмы и производства не смогли бы достичь должного уровня развития, предоставленные действию одних только рыночных сил. Исследования также показали, что у государства есть много способов стимулировать позитивные структурные изменения, не прибегая к назначению победителей — например, можно инвестировать в группу новых отраслей, как это делают фирмы, занимающиеся венчурными инвестициями. И самое главное, благодаря использованию различных моделей стало очевидно, что на самом деле предмет спора — не промышленная политика и не экономическая наука, а качество государственного управления. Если правительство ставит правильные цели и его вмешательство хотя бы временами эффективно, то определенные виды промышленной политики будут полезны. Напротив, если правительство безнадежно коррумпировано, промышленная политика лишь ухудшит положение дел. Заметьте, что в данном случае исследования вывели основание для разногласий в сферу государственного управления, где экономисты не являются специалистами.

Модели, авторитет и иерархия

В 2010 году два известных экономиста, Кармен Рейнхарт и Кеннет Рогофф, опубликовали работу, ставшую поводом для политической битвы с чрез-

вычайно высокими ставками²⁸. Из работы следовало, что уровень госдолга выше 90% ВВП значительно замедляет экономический рост. Политики-консерваторы в США и чиновники Евросоюза уцепились за эту статью в надежде обосновать свои постоянные призывы к режиму жесткой экономии в финансовой сфере. И хотя сами Ренхарт и Рогофф намного осторожнее комментировали результаты своего исследования, статья стала самым веским доводом в борьбе консерваторов за снижение государственных расходов, невзирая на экономический спад.

И тогда Томас Хернтон, аспирант факультета экономики в Массачусетском университете в Амхерсте, сделал то, что ученые должны делать «на автомате»: он повторил расчеты других ученых и подверг их критике. Помимо относительно мало важной ошибки в расчетах, он обнаружил в оригинальной работе Рейнхарт—Рогоффа несколько методологических решений, которые ставили под вопрос устойчивость результатов работы. Что еще важнее, хотя величина долга и темпы роста оставались отрицательно коррелированными, свидетельства в пользу 90% порога оказались довольно слабыми. И, как отметили также многие другие исследователи, корреляция могла возникнуть потому, что низкие темпы роста вели к высокой задолженности, а не наоборот. И когда Херндон в соавторстве с профессорами Массачусетского университета Майклом Эшем и Робертом Поллиным опубликовал свои критические замечания, грянул гром²⁹.

28. Carmen M. Reinhart and Kenneth S. Rogoff, *Growth in a Time of Debt*, NBER Working Paper 15639 (Cambridge, MA: National Bureau of Economic Research, 2010).

29. Thomas Herndon, Michael Ash, and Robert Pollin, «Does High Public Debt Consistently Stifle Economic Growth? A Critique of Reinhart and Rogoff» (Amherst: University of Mas-

Поскольку 90%-й порог величины госдолга приобрел политическую значимость, его последующее опровержение также имело более широкое политическое значение. Рейнхарт и Рогофф мужественно противостояли обвинениям многих комментаторов в том, что они с готовностью (если не намеренно) согласились участвовать в политическом обмане. Они защищали свои эмпирические методы и настаивали на том, что не являются ярыми борцами против бюджетного дефицита, какими их изображали критики. Несмотря на возражения, их обвинили в предоставлении научного прикрытия набору политических мер, которые на самом деле были мало подтверждены.

Споры об анализе данных в работе Рейнхарт—Рогоффа отодвинули на задний план то, что по сути происходившее было благотворным процессом тщательной проверки и усовершенствования экономического исследования. Рейнхарт и Рогофф быстро признали совершенную ими ошибку в расчетах. Параллельно проведенный анализ прояснил природу данных, их ограничения и то, как использование других методов обработки данных изменило бы результат. В конце концов, Рейнхарт и Рогофф не особенно расходились с критиками в трактовке приводимых данных и в выводах для экономической политики; они определенно не верили в жестко установленный 90%-й порог и признавали возможность по-другому трактовать корреляцию между высоким госдолгом и медленным ростом. Позитивная сторона этой истории показывает, что экономика может двигаться вперед, развиваясь по научным законам. Невзирая на возмож-

sachusetts at Amherst, Political Economy Research Institute, April 15, 2013).

ные различия политических взглядов, обе стороны говорили на одном языке об эмпирических данных и по большей части разделяли один подход к разрешению несогласий в части методики.

СМИ часто представляли это столкновение как историю о том, как двое всемирно известных гарвардских профессоров оказались побиты аспирантом с менее известного и менее ортодоксального факультета. Это сильное преувеличение. Но данный конфликт иллюстрирует важный аспект экономической науки, роднящий нашу профессию с другими науками: в конечном счете значение научной работы определяется не принадлежностью к организациям, статусом или связями автора; оно зависит от того, насколько работа соответствует требованиям дисциплины к исследованиям. Авторитет работы следует из ее внутренних качеств — насколько она удачно построена, насколько убедительны доказательства, а не из личности, знакомств или идеологии, которую разделяет исследователь. И поскольку эти стандарты известны всем представителям профессии, каждый может указать на слабую работу и назвать ее таковой³⁰.

30. О различиях между общественными науками, стандарты аргументации и доказательства которых проходят этот тест, и теми науками, чьи стандарты его проваливают, см.: Jon Elster, *Explaining Social Behavior: More Nuts and Bolts for the Social Sciences* (Cambridge: Cambridge University Press, 2007), pp. 445–467; Юн Эльстер, *Объяснение социального поведения. Еще раз об основах социальных наук* (Москва: ГУ–ВШЭ, 2011), 449–470. Совершенно иная интерпретация экономической науки предложена в работе Marion Fourcade, Etienne Ollion, and Yann Algan, *The Superiority of Economists*, MaxPo Discussion Paper 14/3 (Paris: Max Planck Sciences Po Center on Coping with Instability in Market Societies, 2014). Эти авторы трактуют консенсус относительно академической «табели о рангах»

Быть может, это не особенно впечатляет, но лишь до тех пор, пока вы не осознаете, как это необычно на фоне многих других общественных или большинства гуманитарных наук³¹. В этих областях крайне редко возможна ситуация, когда аспирант выигрывает спор, подвергая сомнению работу ведущих ученых, которая время от времени бывает в экономической науке. Но благодаря моделям, облегчающим выявление ошибки, в экономической науке это может сделать каждый.

У такой очевидной демократичности идей есть оборотная сторона — уже не столь благотворная. Поскольку экономисты пользуются единым языком и методами, они склонны игнорировать или отвергать точку зрения неэкономистов. Критиков не принимают всерьез (какая у вас модель? какие у вас данные?), пока они не выразят готовность следовать правилам экономистов. Только настоя-

в дисциплине как форму жесткого контроля со стороны ведущих факультетов экономики. Столь же убедительным будет объяснение консенсуса как результата существования общих норм относительно того, какую работу считать хорошей, что свойственно и многим естественным наукам.

31. В своей знаменитой мистификации физик Алан Сокал направил в ведущий журнал культурологических исследований статью, имевшую целью описать, как квантовая гравитация приведет к созданию «либеральной постмодернистской науки». Статья, пародировавшая витиеватый стиль изложения, популярный среди продвинутых специалистов по культурным исследованиям, вскоре была опубликована. Сокал объявил, что намеревался оценить научные стандарты дисциплины, проверив, опубликует ли журнал статью, «по-либеральному щедро приправленную чепухой». Alan Sokal, «A Physicist Experiments with Cultural Studies», April 15, 1996, http://www.physics.nyu.edu/sokal/lingua_franca_v4.pdf.

щие члены клуба экономистов рассматриваются как приемлемые участники экономических дебатов — отсюда парадоксальная ситуация: экономисты очень чувствительны к внутренней критике, но крайне малочувствительны к критике извне.

Ошибочное vs. то, что не дотягивает до ошибки

Австрийский физик Вольфганг Паули, первооткрыватель квантовой физики, был известен своей требовательностью и язвительным остроумием. Будучи молодым и никому не известным студентом, он однажды сопроводил реплику Эйнштейна на коллоквиуме таким замечанием: «Знаете, то, что говорит этот мистер Эйнштейн, не так уж и глупо». Паули особенно критически относился к доказательствам с претензией на научность, но плохо сформулированным и не допускающим практической проверки. Когда один начинающий физик показал ему подобную работу, он ответил: «Это даже не дотягивает до ошибочного».³²

Паули имел в виду, что правильность работы невозможно проверить, поскольку в ней нет ясного, связного доказательства. Предпосылки, причинно-следственные связи и выводы были прописаны столь невнятно, что предполагаемый научный вклад работы становился недоказуемым ни при каких обстоятельствах. «Даже не дотягивает до ошибки» — это самый убийственный комментарий к работе ученого, который только можно вообразить. Я прослушал порядочное количество

32. R. E. Peierls, «Wolfgang Ernst Pauli, 1900–1958», *Biographical Memoirs of Fellows of the Royal Society* 5 (February 1960): 186.

выступлений, которые оставили у меня в точности тоже ощущение, и могу сказать, что это случалось нередко. Невзирая на мою очевидную пристрастность, и да простят меня коллеги-неэкономисты, отмечу, что темноты такого рода намного реже встречаются в экономической науке, чем в прочих дисциплинах.

Статус науки, который я присваиваю экономике, не предполагает особого величия. Он далеко отстоит от позитивистского идеала, который впервые сформулировал Огюст Конт в начале XIX века, когда сочетание логических рассуждений и эмпирических свидетельств производит максимально достоверное знание о природе общественной жизни³³. Но генерализуемость и проверяемость экономических предпосылок ограничены. Экономическая наука — просто упорядоченная интуиция — интуиция, которая приобретает ясность за счет логики и подкрепляется за счет убедительных свидетельств. Как писал Эйнштейн, «вся наука является не чем иным, как усовершенствованием повседневного мышления»³⁴. Лучшие образцы экономических моделей предлагают лишь подобное усовершенствование — и ничего более.

33. Мое видение экономической науки намного ближе к прагматической традиции в эпистемологии, чем к позитивистской.

34. Albert Einstein, «Physics and Reality», in *Ideas and Opinions of Albert Einstein*, trans. Sonja Bargmann (New York: Crown, 1954), 290; Альберт Эйнштейн, «Физика и реальность», в: Альберт Эйнштейн, *Собрание научных трудов*, т. 4 (Москва: Наука, 1967), 200.

ГЛАВА 3
Навигация
между моделями

МОДЕЛИ делают экономику наукой. *Полезной* наукой она становится, когда применение моделей расширяет наше понимание того, как устроен мир и как сделать его лучше. Чтобы выбрать модель, нужно отобрать те, что будут релевантны и полезны в конкретных обстоятельствах, и отбросить все остальные. Как практически проводится такое просеивание — и, что важнее, как его следует проводить, — предмет данной главы. Но сразу должен предупредить: эти методы — в той же степени искусство, что и наука. Разумное суждение и опыт здесь незаменимы, а образование помогает лишь отчасти. Возможно, поэтому программы аспирантур по экономике уделяют этому искусству слишком мало внимания.

Университеты снабжают новоиспеченных кандидатов наук порядочным запасом моделей, но не дают формального обучения правилам выбора между ними — ни курсовой работы, ни домашних заданий, ни закрепляющих упражнений. В результате они обычно работают лишь с самыми новыми моделями, которые появились в новейшем поколении исследований и захватили внимание специалистов. Хорошими прикладными экономистами становятся те выпускники, кому удастся набрать необходимых навыков по ходу дела, поскольку на протяжении всей профессиональной жизни

экономистам приходится решать непростые вопросы выбора между вариантами государственной политики. Но, к сожалению, немногие толковые практики утруждают себя систематизацией своего опыта в книгах или статьях, которые могли бы принести пользу менее опытным представителям дисциплины.

Для дисциплины, официально претендующей на научность, экономика уделяет недостаточное внимание вопросам выбора подходящей модели. Как я уже говорил, принято считать, что экономическая наука движется вперед за счет улучшения существующих моделей и проверки гипотез. Модели непрерывно совершенствуются, и когда-нибудь будет создана одна уточненная универсальная истинная модель. Не прошедшие проверку гипотезы отвергаются; прошедшие проверку остаются. В таком представлении нет места идее о том, что экономисты должны одновременно держать в голове множество моделей и продумывать процедуру перехода от конкретных обстоятельств к подходящим моделям.

Это не принесло бы особого вреда, если бы экономисты занимались только расширением своей коллекции моделей, иными словами, если бы экономисты были чистыми теоретиками. Но большинство экономистов решают и более практические задачи. Их особенно интересуют два взаимосвязанных вопроса: как на самом деле устроен мир и как сделать его лучше? Судя по тому, какое внимание работы экономистов привлекают в общественных дискуссиях, мир тоже надеется извлечь из них практическую пользу. Ответ на второй вопрос обычно требует ответа на первый вопрос. Позитивный и нормативный анализ — исследования того, что есть, и того, что должно быть, — тесно переплетены. В терминах

экономистов оба вопроса можно сформулировать так: Какую модель взять за основу?

Я уже делал акцент на том, что модель никогда не является точным описанием реальности. Как говорят Дэвид Коландер и Рональд Куперс, «Научные модели в лучшем случае предлагают полуправду»¹. Поэтому когда экономисты задают вопрос «Какая модель взята за основу?», они не ищут самое лучшее из возможных описание изучаемого рынка, региона или страны. Даже если бы они сумели создать такое описание, оно было бы слишком сложным и потому бесполезным. Они ищут модель, которая выведет на первый план *главную действующую причину или причины*. Эта модель станет лучшим объяснением происходящего и с наибольшей вероятностью сумеет предсказать последствия наших действий.

Представьте, что в вашем автомобиле есть какие-то неполадки и вы хотите выяснить, что сломалось и как это починить. Вы можете разобрать всю машину на части, деталь за деталью, в надежде в итоге найти поломку. Это не просто займет много времени, но и не обязательно приведет к решению. В конце концов, автомобиль — это система. Проблема может быть не в отдельных компонентах, а в том, как взаимодействуют (или перестали взаимодействовать) различные компоненты. Или же вы можете для начала провести диагностику того, в какой из подсистем автомобиля (тормоза, коробка передач и т. д.) возникла неисправность. Диагноз может основываться на множестве разнообразных сигналов: что случилось в момент поломки, как ведет себя машина при включении зажигания,

1. David Colander and Roland Kupers, *Complexity and the Art of Public Policy* (Princeton, NJ: Princeton University Press, 2014), 8.

и, разумеется, на данных более тонкой программной диагностики, которую сегодня повсеместно используют в автомастерских. Вся эта работа в итоге выведет вас к виновнику: системе охлаждения или зажигания. Теперь вы можете заниматься только той подсистемой, которая нуждается в починке.

Для работы автомобиля нужны все его части: система передач, охлаждения, зажигания. Поэтому мы можем сказать, что все они являются «причинами» движения машины. Но только одна из них окажется главенствующим механизмом в объяснении поломки автомобиля. Работа прочих несущественна для рассматриваемого вопроса. Более сложная и реалистичная модель автомобиля (скажем, полномасштабная действующая копия, подобная знаменитой карте Борхеса размером во всю империю) не принесет особой пользы. Пользу принесет понимание того, на чем сосредоточить усилия. Точно так же «корректной» будет та экономическая модель, которая изолирует критически важные связи, позволяя понять, что из происходящего является настоящей причиной. И способ выбора правильной модели не сильно отличается от диагностики, которую мы проводим для автомобиля.

Диагностика для стратегии роста

Мой собственный момент вскричать «Вот оно!» во время диагностики случился, когда я помогал правительствам развивающихся стран в реализации экономических программ. Страны были самые разные: от Южной Африки до Сальвадора, от Уругвая до Эфиопии. Но в каждом случае передо мной и моими коллегами стоял один и тот же ключевой вопрос: какую политику должно проводить прави-

тельство, чтобы ускорить рост экономики и повысить доходы всех общественных слоев и особенно неблагополучных групп населения?

Недостатка в предложениях для реформ обычно не наблюдалось.

- Некоторые аналитики предлагали повышать квалификацию работников, обучать их и улучшать ситуацию с социальным капиталом в стране.
- Некоторые предлагали заняться макроэкономической политикой и рекомендовали способы укрепить кредитно-денежную и налоговую политики.
- Некоторые считали, что стране нужна большая открытость во внешней торговле и к зарубежным инвестициям.
- Некоторые говорили, что налоги на частный бизнес слишком высоки, а бизнес несет и много других издержек.
- Некоторые рекомендовали проводить промышленную политику в целях перестройки экономики и поощрения развития новых высокопроизводительных отраслей.
- Некоторые советовали сократить коррупцию и укрепить права собственности.
- Некоторые выступали в поддержку инвестиций в инфраструктуру.

До недавнего времени международные организации, такие как Всемирный банк, обычно собирали все рекомендации в один документ и *voilà!* — готова стратегия роста. К 1990-м годам политикам пришлось признать, что эта схема не работает. Постановка целей политики развития в виде длинейшего списка рекомендаций ставила перед правительствами практически невыполнимую задачу,

с которой у них не было шансов справиться. Властям раз за разом не удавалось провести большую часть намеченных реформ. А те, которые получалось реализовать, не обязательно оказывались самыми нужными, и экономики едва откликнулись на них. Тем временем советчики со стороны избегали позора, перекладывая вину на клиентов и ссылаясь на «недостатки реформ» или на «усталость от реформ»².

Я и мои коллеги выступали за стратегический подход с выделением более узкого перечня реформ. Целью реформ должны стать самые серьезные препятствия, чтобы исключить ситуацию, когда правительства, затратив большие объемы политического капитала, получают на выходе весьма незначительный экономический рост. Но какие из реформ приведенного выше длинного списка соответствуют этому запросу?

Ответ зависел от выбранной модели роста. Те из нас, кто рассматривал рост в терминах «неоклассической модели», подчеркивали роль предложения физического и человеческого капитала и барьеры для его увеличения. Те, кто предпочитал модели «эндогенного» роста, в которых рост направляется инвестициями в новые технологии, ратовали за создание среды для рыночной конкуренции и инноваций. Те, кто интенсивно работал с моделями, ставившими на первое место качество институтов, концентрировались на правах собственности и исполнении контрактов. Приверженцы модели «дуальной экономики» изучали условия для структурной трансформации и перехода от тра-

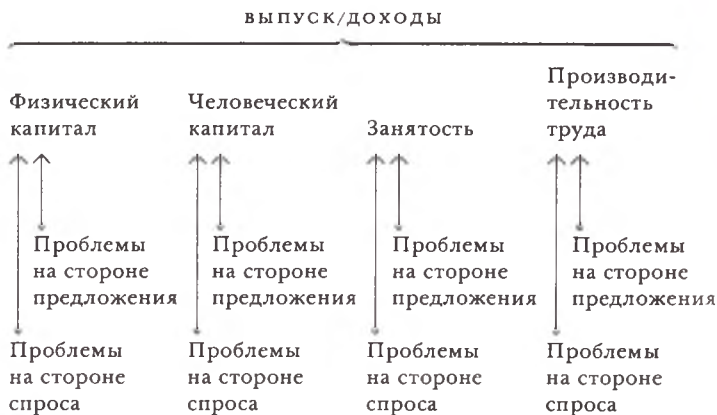
2. Dani Rodrik, «Goodbye Washington Consensus, Hello Washington Confusion?: A Review of the World Bank's *Economic Growth in the 1990s: Learning from a Decade of Reform*», *Journal of Economic Literature* 44, no. 4 (December 2006): 973–987.

диционных видов экономической деятельности, таких как натуральное хозяйство, к современным фирмам и промышленности. Каждая из этих моделей предлагала свою отправную точку для решения проблемы и выделяла свой набор приоритетов.

Когда стало ясно, что разница в подходах к экономической политике следует из предпочтения разных моделей, дискуссия стала намного вразумительнее. Теперь мы поняли, какова отправная точка у каждого из нас. Что еще важнее, мы смогли начать сокращать различия в наших позициях, «на коленке» сличая отдельные модели с имеющимися данными. Что мы увидим, если эта модель верна — то есть если она выявляет самый важный механизм в основании экономического роста в данном конкретном случае? Какого рода данные помогут выбрать из двух моделей с разными следствиями более релевантную? Поскольку мы были лишены роскоши ждать накопления необходимых данных или проводить рандомизированные или лабораторные эксперименты на реальных экономиках, ответы приходилось искать в реальном времени с теми данными, которые были.

В итоге мы создали дерево решений, которое помогло нам перемещаться между потенциально пригодными моделями³. Дерево выглядело примерно так, как приведенный здесь график, который опускает многие детали. Начав с вершины дерева, мы спросили, относится ли недостаток инвестиций к стороне предложения или к стороне спроса. Иными словами, что привело к недостат-

3. Ricardo Hausmann, Dani Rodrik, and Andres Velasco, «Growth Diagnostics», in *The Washington Consensus Reconsidered: Towards a New Global Governance*, eds. J. Stiglitz and N. Serra (New York: Oxford University Press, 2008).



Низкая отдача от частных инвестиций и, как следствие, недостаточный спрос на инвестиции из-за следующих причин:

провалы государства: высокие налоги; недостаточная защита прав собственности или недостаток гарантий соблюдения контрактов; коррупция; макроэкономическая нестабильность и инфляция...

провалы рынка: провалы товарных рынков (провалы координации, негативные внешние эффекты, связанные с риском фирм потерять обученных работников)...

проблемы на других рынках: неоптимальные значения других составляющих производственной функции: человеческий капитал, занятость, технологии; неудачное географическое расположение...

ДИАГНОСТИЧЕСКИЕ СИГНАЛЫ?

От моделей роста к диагностике роста

Источник: Dani Rodrik, «Diagnostics before Prescription», *Journal of Economic Perspectives* 24, no. 3 (Summer 2010): 33–44. Обратите внимание: показаны только некоторые детали.

ку инвестиций — недостаток предложения фондов или низкая отдача? Если имели место ограничения на стороне предложения, мы бы спросили, в чем была причина — в недостатке сбережений или в плохой работе финансовой системы? Если имели место ограничения на стороне спроса, мы бы спросили, что вызывает низкую отдачу от частных инвестиций — провалы рынка или провалы государства. Если источник проблемы — провалы государства, то чем они вызваны — высокими налогами, коррупцией или нестабильностью политики? И далее в том же духе.

Для каждого узла дерева решений мы постарались разработать способы неформальной эмпирической проверки гипотез, помогающие сделать выбор между моделями, которые поведут нас по разным путям. Например, если основная проблема в экономике — неадекватное предложение капитала, как считает неоклассическая модель роста, то стоимость кредитов будет обратно связана с объемами инвестиций. Снижение расходов на пользование заемными средствами будет сопровождаться сильной ответной реакцией инвестиций. Далее, любое увеличение трансфертов из-за рубежа, таких как переводы от работающих за границей или иностранная помощь, вызовет всплеск отечественных инвестиций. Самый медленный рост покажут сектора, наиболее капиталоемкие или самые зависимые от заемных средств. Соответствуют ли следствия из модели наблюдаемому поведению изучаемой экономики? Если да, то ответом на вопрос «Какую модель взять за основу?» будет именно неоклассическая модель роста.

С другой стороны, в экономике, страдающей от недостаточного спроса на инвестиции, частные инвестиции будут отзываться в основном на коле-

бания рентабельности на товарных рынках. Например, когда предпринимателям мешает коррупция, их главной проблемой будет низкая окупаемость инвестиций. Доступность фондов не сильно повлияет на их поведение. Приток денежных переводов от работающих за рубежом или иностранного капитала вызовет всплеск потребления, а не инвестиций. (Именно такой случай показан на графике). Данные следствия также могут быть проверены на соответствие наблюдаемой реальности⁴.

И хотя имеющиеся данные редко позволяют окончательно разрешить подобные вопросы, часто удается перейти от длинного перечня проблем к существенно более короткому списку. В случае Южной Африки мы смогли довольно быстро исключить ряд факторов, в которых политики склонны видеть причины медленного роста: недостаток квалификации, низкое качество государственного управления, макроэкономическая нестабильность, неразвитая инфраструктура и недостаточная открытость внешней торговле. Наблюдаемое на тот момент поведение экономики не подтверждало вывод о том, что какой-либо из этих факторов был важным ограничителем роста. Использование моделей заставило нас мыслить в терминах не частного, а общего равновесия (в масштабах всей экономики). Например, предприниматели вечно сетуют на трудности поиска квалифицированных работников, и поэтому многие наблюдатели полагали, что ключевым препятствием для роста яв-

4. Более подробное объяснение процесса с примерами из многих стран см. в: Ricardo Hausmann, Bailey Klinger, and Rodrigo Wagner, *Doing Growth Diagnostics in Practice: A «Mindbook»*, CID Working Paper 177 (Cambridge, MA: Center for International Development at Harvard University, 2008).

ляется недостаток квалифицированной рабочей силы. Но этот вывод опровергался тем фактом, что самый быстрый рост показывали именно те сектора экономики, где преимущественно используется квалифицированный труд (например, финансовый сектор). Каким бы ни было препятствие для роста экономики, проблема не в недостатке квалифицированных работников. Использованный подход позволил выявить ряд других критически важных проблемных зон — в частности, высокую стоимость неквалифицированного труда и низкую конкурентоспособность большей части промышленных предприятий⁵.

Достоинство диагностического анализа в том, что он не предполагает, будто одна и та же модель подходит для всех стран. Изучая Сальвадор, государство в Центральной Америке, мы пришли к выводу, что причины неудач экономики в этой стране лучше всего описывает модель сбоя рынка в современных отраслях. Недостаток инвестиций и медленный рост не могли быть объяснены нехваткой средств, низким качеством институтов и экономической политики, низкой квалификацией работников, дороговизной рабочей силы или иными возможными факторами. Например, экономика Сальвадора получала значительный объем денежных переводов из-за рубежа и благодаря высокому кредитному рейтингу обладала широким доступом к международным рынкам капитала. Таким образом, недостаток предложения инвестиций не был причиной проблем. Наоборот, недо-

5. Ricardo Hausmann, *Final Recommendations of the International Panel on ASGISA*, CID Working Paper 161 (Cambridge, MA: Center for International Development at Harvard University, 2008).

статок инвестиций был следствием трудностей, которые испытывали фирмы, пытавшиеся начать работу в самых современных высокопроизводительных отраслях экономики. Некоторые из этих трудностей обусловлены постоянными сбоями координации, подобные рассмотренным в главе 1. Например, производство консервированных ананасов не будет прибыльным без постоянных грузовых авиаперевозок, дающих доступ на рынок США. Но грузовые авиаперевозки не станут прибыльными в отсутствие множества экспортеров, в том числе заводов по производству консервированных ананасов. Прочие проблемы включали неадекватную информацию об издержках и рынках в новых сферах бизнеса из-за отсутствия фирм-пионеров, чей опыт мог бы дать ценные сигналы тем, кто планирует войти на рынок. Соответственно, на этих проблемных областях и были сосредоточены наши рекомендации в отношении экономической политики⁶.

Также диагностический подход не предполагает, что базовая модель для каждой страны никогда не меняется. При смене обстоятельств более релевантной может стать другая модель. Собственно, если первоначальный диагноз в целом верен и правительство эффективно подошло к проблемам, то базовая модель обязательно станет другой. Например, преодоление провалов рынка в современных отраслях промышленности ведет к росту значимости инфраструктурных ограничений (например, доступ к портам и источникам энергии).

6. Ricardo Hausmann and Dani Rodrik, «Self-Discovery in a Development Strategy for El Salvador», *Economia: Journal of the Latin American and Caribbean Economic Association* 6, no. 1 (Fall 2005): 43–102.

Или же более важным препятствием станет недостаток квалификации. Выбор модели — динамический процесс, а не разовое решение.

Общие принципы выбора модели

Теперь давайте отвлечемся от деталей диагностики роста. Накопленный опыт позволяет сформулировать общие правила и приемы выбора модели. Ключевой навык — умение постоянно переключаться между моделями-кандидатами и реальным миром. Назовем этот процесс «верификацией». В основе процесса выбора модели лежит некая комбинация четырех отдельных стратегий верификации:

1. Проверить критически важные предпосылки модели на предмет того, насколько они отражают особенности рассматриваемой ситуации.
2. Проверить, действительно ли работают заявленные в модели механизмы.
3. Проверить, подтверждаются ли прямые следствия из модели.
4. Проверить, соответствуют ли в целом наблюдаемым результатам побочные следствия (те, которые являются вспомогательными для данной модели)

Верификация критически важных предпосылок

Как я уже говорил, для эмпирической релевантности модели важна реалистичность ее *критически важных* предпосылок. Это те предпосылки, изме-

нение которых привело бы к существенно иному результату. Многие предпосылки в этом смысле безобидны. Другие могут быть критически важными не для всех вопросов, на которые призвана отвечать модель.

Рассмотрим случай, когда правительство обеспокоено высокой ценой на нефть и подумывает о введении ценового порога. Для ответа на этот вопрос нужно иметь представление — модель — того, как работает рынок нефти. Давайте существенно упростим ситуацию и ограничимся рассмотрением двух соперничающих моделей: моделью конкуренции и моделью монополии. Сторонники модели конкуренции видят в высоких ценах результат недостаточного предложения относительно спроса. В данной модели введение ценового порога — потолка, выше которого нефтяные компании не вправе устанавливать цены, — не будет особенно эффективным. Оно создаст разрыв между объемом нефти, на который есть спрос у потребителей, и тем количеством, которое готовы предложить производители. Появятся нормирование, очереди или какой-то другой способ обойти разрыв. Рыночная цена нефти скорее даже вырастет из-за снижения общего предложения. Некоторые люди сумеют получить нефть по более низкой цене, так как окажутся первыми в очереди или войдут в число получающих ее по нормативу, но всем остальным придется заплатить более высокую цену. В общем, это не самая лучшая политика.

Сторонники модели монополии видят в высоких ценах результат того, что нефтяная отрасль действует как картель. В этой модели отрасль искусственно создает дефицит, ограничивая предложение для рынка, чтобы обеспечить рост цен и нарастить свои прибыли. В данной модели введе-

ние порога цен даст совсем другой результат. После установления ценового порога фирмы больше не смогут определять рыночные цены, изменяя размер своих продаж. Теперь они вынуждены принимать установленные цены; иными словами, они будут вести себя так же, как фирмы на рынке с совершенной конкуренцией⁷. Если потолок цен не слишком низок, общее предложение может вырасти и рыночная цена снизится. Картель распадётся, и ценовой порог окажется эффективной мерой, потому что сработает как средство антимонопольного регулирования.

Каковы критические и некритические предпосылки в описаниях мира в данных моделях? Во-первых, обе модели описывают сторону предложения в отрасли — то, как действуют фирмы-производители нефти. Следовательно, можно оставить без внимания предпосылки относительно потребителей и того, как они совершают свой выбор. Не особенно важно, являются ли они полностью рациональными, обладают ли полной информацией, различаются по уровню дохода или предпочтениям, имеют ли долгосрочные горизонты планирования. Единственная критически важная предпосылка на стороне спроса — вогнутость кривой спроса, означающая, что при прочих равных рост цены на нефть вызывает снижение потребления нефти. Это предположение оправдано в самых разных обстоятельствах и может быть эмпирически проверено. Все эти сюжеты могут стать критически важными в определенных контекстах (например, когда мы обсуждаем распре-

7. Здесь я оставляю за кадром некоторые вопросы о механизме работы картеля и просто предполагаю, что картель действует как единая монополия.

делительные эффекты от налогов на добычу нефти), но в данном случае они не помогут нам сделать выбор между двумя соперничающими моделями. Вторая критически важная предпосылка состоит в том, что стратегическое поведение, за исключением ценообразования, тоже не имеет значения. Так что мы можем заодно игнорировать неявные или явные допущения насчет, скажем, кадровой или рекламной политики фирм.

По-настоящему критически важная предпосылка здесь одна: в первом случае фирмы имеют рыночную власть, во втором — нет. В модели монополии фирмы полагают, что могут повысить рыночную цену за счет ограничения предложения, тогда как в модели конкуренции они не питают таких надежд. В некотором роде эта предпосылка характеризует психологию фирм. Мы не в состоянии забраться в голову к менеджерам и узнать, что они думают на самом деле. Спросив их напрямую, мы тоже скорее всего не получим надежного ответа, ввиду их заинтересованности в исходе дела. Но мы можем изучить наиболее распространенные условия и узнать, какое из представлений более оправданно.

Количество и размеры фирм в отрасли будет играть особенно важную роль. Если количество фирм велико и нет доминирующих фирм, то маловероятно, что фирмы вообще смогут или захотят действовать неконкурентно. Другое важное обстоятельство — насколько легко новым фирмам войти в отрасль. Даже если фирм в отрасли немного, угроза появления новых конкурентов может отвлечь их от идеи воспользоваться рыночной силой. Кроме того, нефтяная отрасль скорее глобальная, чем национальная. Конкуренция с иностранными производителями может стать источником ры-

ночной дисциплины даже при небольших объемах импорта. Наконец, чем проще потребителям заместить нефть альтернативными источниками энергии, тем менее вероятно, что нефтяные фирмы смогут воспользоваться рыночной силой. В принципе, каждый из этих факторов можно наблюдать и измерять. Ведь именно подобного рода диагностические процедуры в рабочем порядке проводят национальные антимонопольные структуры, если подозревают фирмы в обладании (и злоупотреблении) рыночной властью.

Зачастую критически важные предпосылки моделей не формулируются в явном виде. Неспособность выявить такие предпосылки может приводить к серьезным проблемам на практике. Экономисты и политики усвоили это на горьком опыте шумихи вокруг рыночной либерализации в 1980–1990-х годах. Многие считали, что отказ от регулирования цен и снятие рыночных ограничений будут достаточны для эффективной работы рынков и эффективного распределения ресурсов. Но все модели рыночной экономики подразумевают существование различных общественных, юридических и политических институтов. Должны соблюдаться права собственности и выполняться контракты, должна быть гарантирована справедливая конкуренция, нужно предотвращать мошенничество и вымогательство, нужно обеспечивать соблюдение законности. Если эти институциональные основания не развиты или слабы, как в большинстве развивающихся стран, то либерализация рынков не только не даст ожидаемых результатов, но даже ухудшит ситуацию. Например, в странах бывшего СССР приватизация государственных предприятий часто вела не к появлению эффективных рынков, а к обогащению инсайдеров и полити-

ческих воротил. Критически важные предпосылки, необходимые для эффективной работы рынков, скрывались в тени того обстоятельства, что в развитых рыночных экономиках уже существовали сильные институты поддержки рынка. Западные экономисты принимали их наличие как данность.

Когда разочаровывающие результаты развивающихся и постсоциалистических экономик указали практикам на это «слепое пятно», они отреагировали привычным для себя образом: разработали новое поколение моделей, подчеркивающих значимость институтов. Так было заново открыто давно известное знание: еще сам Адам Смит подчеркивал роль государства в создании условий для свободной конкуренции, а специалисты по экономической истории, например, Дуглас Норт, давно указывали на развитые права собственности как причину экономического могущества Великобритании⁸. Формализация и расширение этих идей помогли экономистам лучше понять, как наличие, состав и форма институтов воздействуют на результат экономической деятельности. Благодаря этим моделям принципиально важная роль институтов в экономическом развитии снова вышла на первый план.

Верификация механизмов

Выводы из модели возникают в результате совмещения предпосылок с представлением о причинно-следственном механизме. В примере с нефтя-

8. Douglass C. North and Robert Paul Thomas, *The Rise of the Western World: A New Economic History* (Cambridge: Cambridge University Press, 1973).

ной отраслью критически важным механизмом является связь между предложением фирм и рыночной ценой: когда отрасль ограничивает предложение, рыночная цена растет; когда предложение увеличивается, рыночная цена снижается. Заметьте: модели не предполагают, что реальный мир устроен именно так; они выводят эту зависимость как следствие. Взаимосвязь между предложением в отрасли и рыночными ценами — не предпосылка, а *результат*, следующий из предпосылок, в частности, о вогнутости кривых спроса и о том, что рыночные цены определяются в момент равенства объемов спроса и предложения.

В нашем примере с нефтью применяется довольно нехитрый механизм, который легко и просто проходит верификацию. Взаимосвязь объема предложения и цен интуитивно понятна, и имеется множество примеров из реальной жизни, когда резкое сжатие предложения вызывало зримое изменение цен в предполагаемом направлении; возьмите для примера нефтяной шок 1973–1974 годов. Нам не требуется видеть кривую спроса или знать точное определение рыночного равновесия (а оба этих абстрактных понятия не имеют материальных соответствий), чтобы поверить в обоснованность механизма, на который опирается модель. Но в других случаях механизм может быть основан на более сложном поведении, и потребуются более основательные доказательства. Когда доказательства неубедительны, стоит обеспокоиться тем, применима ли в данном случае выбранная модель.

Рассмотрим снова модель «голландской болезни». Она описывает конкретный механизм того, как обнаружение природного ресурса может навредить работе экономики. В результате ресурсного бума курс отечественной валюты растет, а рен-

табельность промышленного производства падает. Поскольку промышленность принято считать источником технологических новшеств («позитивные утечки» на жаргоне экономистов) для всей экономики, удар по промышленности ведет к более масштабному ущербу. Здесь связь между реальным курсом валюты и благополучием в обрабатывающем секторе имеет принципиальное значение. Если мы хотим применить эту модель для объяснения кризиса в богатой ресурсами стране, то нам придется доказать, что положение промышленности действительно ухудшилось. Если рабочий механизм в основании модели не находит никакого подтверждения в реальном мире, то эта модель — не лучшее объяснение происходящему. Необходимо переключиться на модель, дающую альтернативное объяснение вредных последствий ресурсного бума. Например, можно проверить модель, в соответствии с которой прибыль от ресурса вызывает конфликты среди конкурирующих элит, всплеск внутренней борьбы и нестабильности. Теперь причинный механизм совершенно другой, но он по-прежнему доступен для верификации.

Верификация прямых следствий

Многие модели создаются для объяснения регулярно наблюдаемых явлений. Сама их конструкция предполагает, что прямые следствия соответствуют реальности. Но прочие модели выводятся из базовых принципов с помощью типичных для нашей профессии аналитических приемов. Они могут быть математически элегантно и хорошо сочетаться с преобладающими на сегодняшний день подходами к созданию моделей. Однако это

не обязательно делает их более полезными, особенно если их выводы слабо соотносятся с реальностью.

Макроэкономисты особенно подвержены этой проблеме. В последние десятилетия они приложили значительные усилия для разработки макромоделей, которые требуют продвинутого математического аппарата и населены полностью рациональными, живущими вечно индивидами, способными разрешать сложные проблемы динамической оптимизации в условиях неопределенности. На жаргоне экономистов эти модели называются «моделями с микроосновами»: макроэкономические следствия не просто постулируются, а выводятся из поведения индивидов. В принципе, это неплохо. Например, агрегированное сберегательное поведение следует из проблемы оптимизации, в которой типичный потребитель максимизирует свое потребление с учетом межвременных (действующих на протяжении всей жизни) бюджетных ограничений⁹. Напротив, кейнсианские модели идут более коротким путем, принимая предпосылку о фиксированном соотношении сбережений и национального дохода.

Тем не менее эти модели вносят весьма ограниченный вклад в решение классических вопросов макроэкономики: почему случаются экономические бумы и спады? Что вызывает безработицу? Какова роль бюджетно-налоговой и кредитно-денежной политики в стабилизации экономики? Стремясь сделать модели удобными для работы,

9. Ранний пример таких моделей «реального экономического цикла» см. в работе: Finn E. Kydland and Edward C. Prescott, «Time to Build and Aggregate Fluctuations», *Econometrica* 50, no. 6 (1982): 1345-1370.

экономисты оставляют без внимания многие важные аспекты реального мира. В частности, они допускают отсутствие несовершенств и помех на рынках труда, капитала и товаров. Подъемы и спады экономики приписываются экзогенным и невнятно определяемым «шокам» в технологиях и потребительских предпочтениях. Безработные и не искали работу, которую не смогли найти; их существование отражает оптимальное для работника соотношение между свободным временем и трудом. Неудивительно, что эти модели плохо прогнозируют такие важные макроэкономические параметры, как инфляция и рост¹⁰.

Пока в экономике все шло благополучно и безработица была низкой, эти недостатки не особенно бросались в глаза. Но на фоне последствий финансового кризиса 2008–2009 годов их непригодность стала заметнее и обходилась дороже. Новомодные модели просто не могли объяснить размах и продолжительность последовавшей за кризисом рецессии. Требовалось как минимум сделать их более реалистичными в части учета несовершенств финансовых рынков. Традиционные кейнсианские модели, несмотря на недостаток микрооснований, все же могли объяснить, почему экономики застревают в состоянии высокой безработицы, и казались актуальными как никогда. Тем не менее сторонники новых моделей не спешили расставаться с ними — и не потому, что эти модели больше соответствовали реальности, а потому, что они выглядели именно так, как должны выглядеть модели.

10. Rochelle M. Edge and Refet S. Gürkaynak, *How Useful Are Estimated DSGE Model Forecasts?* Finance and Economics Discussion Series (Washington, DC: Divisions of Research & Statistics and Monetary Affairs, Federal Reserve Board, 2011).

Стратегия моделирования взяла верх над реалистичностью выводов.

Приверженность экономистов определенным общепринятым соображениям о принципах моделирования (на основе предпосылок о рациональных и прогнозирующих будущее индивидах, хорошо функционирующих рынках и т. д.) часто мешает им заметить очевидный конфликт модели с реальным миром. Специалист по теории игр из Йельского университета Барри Нейлбафф уделял реальному миру больше внимания, чем прочие, но даже он попался в эту ловушку. Как-то вечером в Израиле Нейлбафф и еще один специалист по теории игр оказались в одном такси. Водитель не включил счетчик, но пообещал пассажирам, что возьмет цену ниже той, которую показал бы счетчик. У Нейлбаффа и его коллеги не было оснований верить водителю. Но они разбирались в теории игр и рассудили так: когда они доберутся до точки назначения, переговорная сила водителя будет очень небольшой. Ему придется взять те деньги, которые согласятся заплатить пассажиры. Поэтому они решили, что предложение водителя выгодно, и поехали. Прибыв на место, водитель запросил 2500 шекелей. Нейлбафф отказался и предложил 2200 шекелей. Пока он пытался сторговаться, разозленный водитель заблокировал двери машины и с головокружительной скоростью вернулся туда, где взял пассажиров. Там он выкинул их из машины, крича: «Посмотрим, куда вы теперь доедете за 2200 шекелей»¹¹.

11. Barry Nalebuff, «The Hazards of Game Theory», *Haaretz*, May 17, 2006, <http://www.haaretz.com/business/economy-finance/the-hazards-of-game-theory-1.187939>. См. также: Avinash Dixit and Barry Nalebuff, *Thinking Strategically: The Compet-*

Оказалось, что стандартная теория игр была плохим советчиком в том, что происходит на самом деле. Малая толика индукции помогла бы Нейлбаффу и его коллегам осознать, что в реальном мире люди не ведут себя как рациональные автоматы, наполняющие модели теории игр!

В наши дни они едва бы допустили подобный просчет. Экспериментальные исследования проводятся намного чаще, и специалисты по теории игр намного лучше представляют, в каких обстоятельствах стандартные предпосылки приводят к неверному результату. Рассмотрим «игру в ультиматум», расчеты в которой напоминают те, что были проделаны в истории с таксистом. Два игрока должны договориться о том, как разделить 100 долларов. Один участник делает безальтернативное предложение, которое другой участник должен принять или отвергнуть. Если второй участник принимает предложение, обе стороны получают то, о чем договорились. Если он отказывается, оба не получают ничего. Если оба игрока «рациональны», первый игрок оставит почти все деньги себе и предложит другому крохотную долю (возможно, всего 1 доллар). Второй игрок согласится, поскольку даже символическая сумма лучше, чем ничего. В реальности, разумеется, люди играют в эту игру совсем иначе. Большинство предлагает сумму в интервале 30–50 долларов, а любая меньшая сумма обычно отвергается вторым участником. Стандартная теория игр обладает слабой предсказательной силой для этой игры. В этом одна из причин, почему экономисты перешли к другим типам моделей. Недавние работы в русле поведенческой эконо-

itive Edge in Business, Politics, and Everyday Life (New York: W. W. Norton, 1993), chap 1.

мики учитывают представления о справедливости и поэтому более применимы к ситуациям реальной жизни, напоминая игру в ультиматум.

Лабораторные эксперименты проводятся на людях, обычно на студентах колледжей, и давно получили широкое распространение в психологии. Благодаря этим исследованиям экономисты многое узнали об иных, нежели материальный эгоистический интерес, мотивах поведения людей, таких как альтруизм, реципрокность (взаимность) и доверие. Если эксперименты раз за разом дают результаты, отличающиеся от тех, что предсказывают модели конкуренции и рынков, то эти модели отвергаются или отправляются на доработку. Но многие экономисты по-прежнему скептически настроены насчет ценности лабораторных экспериментов из-за того, что они проводятся в искусственно созданной обстановке. Кроме того, заявляют они, денежные ставки испытуемых в экспериментах обычно невелики, а студенты колледжей не могут репрезентировать население в целом.

Один из видов экспериментов, к которым экономисты обратились в последние годы (полевые эксперименты), в принципе не подвержен подобной критике. В таких экспериментах экономист обычно действует вместе с местными организациями, которые случайным образом разделяют людей или сообщества на экспериментальную (подвергнутую воздействию) и контрольную группы, и наблюдают, отличаются ли реальные результаты от предсказанных в модели, которая рекомендует это воздействие. Один из самых первых подобных экспериментов был проведен на этапе разворачивания программы по борьбе с бедностью в Мексике в 1997 году, о которой я упоминал во Введении. Программа, которая первоначально называлась *Progresa*, за-

тем *Oportunidades*, а теперь *Prospera*, стала первой из популярных ныне программ обусловленных денежных трансфертов, которые предлагают нуждающимся семьям денежную помощь при условии, что их дети исправно посещают школу и проходят регулярные медосмотры. Как отмечает экономист Сантьяго Леви, сыгравший ведущую роль в разработке и внедрении программы, целью было привлечь некоторые базовые экономические принципы для достижения лучших результатов¹². Предполагалось, что прямые денежные трансферты будут эффективнее в борьбе с бедностью, чем уже используемые субсидии на покупку еды. А элемент обусловленности выплат гарантировал бы, как надеялись, улучшение ситуации с образованием и здоровьем.

Хотя программа была общенациональной, ее собирались внедрять постепенно. Поэтому Леви посетила мысль, что он может провести чистую проверку эффективности программы. Случайно отбирая сообщества для участия в программе на раннем этапе, он сможет создать независимые экспериментальную и контрольную группы. Разницу в результатах между двумя группами можно будет трактовать как эффект программы *Progresa*. Последующие замеры показали, что *Progresa* снизила на 10% долю лиц, находящихся за чертой бедности; повысила посещаемость средней школы мальчиками и девочками на 8 и 14%, соответственно; и примерно на 12% снизила заболеваемость среди детей младшего возраста¹³. Эти позитивные

12. Santiago Levy, *Progress against Poverty: Sustaining Mexico's Progres-Oportunidades Program* (Washington, DC: Brookings Institution, 2006).

13. *Mexico — PROGRESA: Breaking the Cycle of Poverty* (Washington, DC: International Food Policy Research Institute, 2002),

результаты подкрепили концепцию в основе программы, после чего похожие программы обусловленных денежных трансфертов ввели правительства других стран, от Бразилии до Филиппин.

После эксперимента с программой *Progresa* рандомизированные полевые эксперименты наводнили дисциплину. Схожие техники применялись для оценки самых разнообразных социальных программ, от бесплатного распространения обработанных инсектицидами надкроватных сеток в Кении до раздачи родителям в Пакистане отчетов об относительной успеваемости их детей в школе по сравнению с другими детьми того же района. В сущности, каждый из этих экспериментов является проверкой лежащей в их основе экономической модели: в Кении это модель роли негативных ценовых стимулов, препятствующих применению надкроватных сеток; в Пакистане — модель роли, которую родители, получившие более полную информацию, могут сыграть в повышении успеваемости детей. Они показали, сколь мощным может быть воздействие творческих решений в случае, если правильно выявлены ключевые ограничения.

Например, Тед Мигель и Майкл Кремер обнаружили, что применение относительно дешевых противоглистных препаратов среди школьников в Кении приносит существенные выгоды в плане посещаемости школы и в конечном счете в отношении будущих заработков¹⁴. Эстер Дафло, Рема Ханна и Стивен Риан установили, что камеры в школь-

<http://www.ifpri.org/sites/default/files/pubs/pubs/ib/ib6.pdf>.

14. Edward Miguel and Michael Kremer, «Worms: Identifying Impacts on Education and Health in the Presence of Treatment Externalities», *Econometrica* 72, no. 1 (2004): 159–217.

ных классах, фиксирующие присутствие учителя, на 21% снизили абсентеизм среди учителей в сельской Индии¹⁵. Были и важные негативные результаты. Полевые эксперименты на сегодняшний день доказали, что микрофинансирование — предоставление небольших ссуд, обычно женщинам или группам женщин, — не особенно эффективно в борьбе с бедностью¹⁶. Эти результаты резко контрастируют с модой на микрофинансирование в кругах специалистов по политике экономического развития. Они охладили пыл сторонников модели, согласно которой именно недостаток доступа к заемным средствам является одним из самых значимых ограничений в жизни бедных домохозяйств.

В Массачусетском технологическом институте, Йельском университете и Калифорнийском университете в Беркли действуют крупные центры, занятые проведением полевых экспериментов для оценки мер политики и проверки моделей. Очевидная слабость полевых экспериментов состоит в том, что они малополезны для решения многих центральным вопросам экономической науки. Например, трудно представить себе проведение эксперимента в масштабах всей экономики, который позволил бы прояснить макроэкономические вопросы относительно роли налоговой или валютной политики. И, как обычно, нужна осторожность в интерпретации результатов эксперимента, поскольку они могут оказаться неприменимыми

15. Esther Duflo, Rema Hanna, and Stephen P. Ryan, «Incentives Work: Getting Teachers to Come to School», *American Economic Review* 102, no. 4 (June 2012): 1241–78.

16. David Roodman, «Latest Impact Research: Inching towards Generalization», Consultative Group to Assist the Poor (CGAP), April 11, 2012, <http://www.cgap.org/blog/latest-impact-research-inching-towards-generalization>.

в иных условиях (снова привычная проблема внешней валидности).

Иногда экономисты проверяют обоснованность следствий из моделей в так называемых натуральных экспериментах. Такие эксперименты проводятся на основе случайного отбора, но не по инициативе исследователя, а по воле стечения обстоятельств, которые никак не связаны с самим исследованием. Одним из первых подобных проектов в экономике стала работа экономиста из Массачусетского технологического университета Джошуа Ангрита по изучению воздействия военной службы на зарплатные перспективы мужчин на рынке труда. Чтобы обойти проблему, связанную с тем, что поступающие на военную службу мужчины от природы отличаются от остальных, Ангрисл обратился к призывным лотереям периода войны во Вьетнаме, когда отбор в армию носил случайный характер. Он обнаружил, что мужчины, проходившие службу в начале 1970-х годов, десятилетие спустя зарабатывали на 15% меньше тех мужчин, которые никогда не служили в армии¹⁷.

Экономисты из Колумбийского университета Дональд Дэвис и Дэвид Вайнштайн использовали данные о развитии городов Японии, подвергшихся американским бомбардировкам во время Второй мировой войны, для проверки двух моделей роста городов. Одна модель основывалась на идее экономии от масштаба (снижение издержек производства по мере роста плотности населения), другая — на идее местных преимуществ (таких как доступ

17. Joshua D. Angrist, «Lifetime Earnings and the Vietnam Era Draft Lottery: Evidence from Social Security Administrative Records», *American Economic Review* 80, no. 3 (June 1990): 313–336.

к естественному морскому порту). Хотя территории для бомбардировки очевидно выбирались не случайно, ее последствия позволяли в естественных условиях отследить, когда города, перенесшие значительные разрушения, остаются в бедственном положении, а когда им удается восстановить прежнее благополучие. Модель экономии от масштаба предполагала, что города не смогут восстановиться после резкого сокращения размеров, тогда как модель местных преимуществ предсказывала обратное. Дэвис и Вайнштайн обнаружили, что большая часть японских городов вернулась к предвоенным размерам в течение 15 лет, что подтверждало вторую модель¹⁸.

Для верификации прямых выводов различных моделей на предмет соответствия реальному миру экономисты применяют самые разнообразные стратегии — от неформальных и несистематических до продуманных и количественных. Если возможно проводить эксперименты в обстановке, достаточно приближенной к искомой, то экспериментальные методы проверки в целом дают более надежные результаты. Тем не менее многие вопросы экономической политики или не могут быть проверены в эксперименте, или требуют ответов в режиме реального времени, лишая исследователей приятной возможности проводить длительные полевые эксперименты. В таких случаях остается только тщательное наблюдение в сочетании со здравым смыслом.

18. Donald R. Davis and David E. Weinstein, «Bones, Bombs, and Break Points: The Geography of Economic Activity», *American Economic Review* 92, no. 5 (2002): 1269–1289.

Верификация побочных следствий

Значительное преимущество работы с моделями состоит в том, что они предлагают широкий выбор следствий, выходящих за пределы исходного наблюдения или проблемы, вдохновившей на создание модели. Такие дополнительные выводы облегчают выбор модели. Они позволяют экономисту вернуться от индукции к дедуктивному способу анализа, что существенно упрощает выбор модели.

В середине 1990-х годов я изучал одну эмпирическую закономерность, которая почти не привлекала внимания экономистов: страны, более открытые внешней торговле, имели более крупные государственные сектора. Данный факт впервые отметил политолог из Йельского университета Дэвид Кэмерон применительно к подгруппе стран — членов Организации экономического сотрудничества и развития (ОЭСР)¹⁹. Мои собственные исследования показывали, что та же зависимость наблюдалась почти во всех странах мира (то есть в тех из них, которые располагали необходимыми статистическими сведениями). Вопрос: почему? Кэмерон выдвинул гипотезу, что государственные расходы служили буфером — страховкой для общества и стабилизатором для экономики против многообразных шоков, связанных с внешней торговлей. Результаты корреляционного анализа явно подтверждали это объяснение.

Для индуктивного рассуждения этого вполне достаточно. Но с данной гипотезой можно было бы продвинуться на шаг дальше, спросив, какие до-

19. David R. Cameron, «The Expansion of the Public Economy: A Comparative Analysis», *American Political Science Review* 72, no. 4 (December 1978): 1243–1261.

полнительные следствия она имеет для реального мира. Здесь-то и начинается этап дедукции. Если предположение Кэмерона верно, то анализ должен показать, что размер государственного сектора более чувствителен к колебаниям в экономике, чем к открытости внешней торговли. Это следствие породило дополнительную, более изящную гипотезу, которая допускала проверку на реальных данных. Когда я провел первый эмпирический тест, посмотрев на эффекты волатильности, создаваемой внешними факторами торговли (ценами экспортных и импортных товаров на мировых рынках), результаты сошлись. Я заключил, что модель буферизации риска имеет под собой значительные основания²⁰.

Я и мои коллеги часто прибегали к подобному подходу в нашей работе по диагностике проблем экономического роста. Мы постоянно искали вспомогательные следствия гипотезы, чтобы посмотреть, подтверждаются ли они. Во-первых, если экономический рост замедляется из-за «узких мест» в определенной сфере, то относительные цены на соответствующие ресурсы должны быть сравнительно высокими. Недостаток физического капитала (то есть заводов и оборудования) должен выражаться в высоких процентных ставках; недостаток навыков должен приводить к высоким премиям для квалифицированных работников на рынке труда; и так далее. Во-вторых, изменение доступности ресурсов, в которых ощущается недостаток, должно вызывать значительный отклик в экономической активности. В экономиках,

20. Dani Rodrik, «Why Do More Open Economies Have Bigger Governments?» *Journal of Political Economy* 106, no. 5 (October 1998): 997–1032.

испытывающих недостаток капитала, приток денежных переводов и иных средств извне должен вызывать бурный рост инвестиций; тот же приток в экономиках, где существуют ограничения на отдачу с капитала, должен стимулировать потребление в ущерб инвестициям.

В-третьих, серьезные препятствия должны привести к тому, что фирмы и домохозяйства станут инвестировать в способы обойти эти препятствия. Если поставки электричества недостаточны, то мы увидим высокий спрос на частные генераторы. Если деятельность крупных фирм излишне зарегулирована, мы увидим, что фирмы стараются остаться небольшими. Если нестабильность валюты доставляет серьезные неудобства, мы увидим переход к иностранной валюте в повседневных и в финансовых транзакциях («долларизацию»). Наконец, относительно преуспевающими должны быть те фирмы, деятельность которых меньше привязана к недостающим ресурсам. Как любит говорить мой бывший коллега по Гарварду Рикардо Хаусманн, причина, по которой мы встречаем в пустыне множество верблюдов и мало бегемотов, очень проста: одно животное живет в воде, а другому животному вода почти не нужна²¹. Точно так же в экономике вроде той, что существует в странах Южной Африки, все встреченные нами преуспевающие фирмы будут опираться на высококвалифицированный труд, поскольку неквалифицированная рабочая сила здесь чрезвычайно дорога.

21. Hausmann, Klinger, and Wagner, *Doing Growth Diagnostics in Practice*. Здесь я во многом следую изложенному в этой работе обобщению «диагностических сигналов».

Снова о внешней валидности

В общем и целом выбор модели чем-то напоминает процесс подтверждения внешней валидности в лабораторном или полевом эксперименте. У нас есть идея, которая работает в определенных условиях (модель); вопрос в том, будет ли она работать в других условиях (реальный мир). Внешняя валидность моделей зависит от того, в каких условиях они применяются. Отказавшись от притязаний на универсальность моделей и смирившись с вероятностным характером знания, мы возвращаем моделям их эмпирическую релевантность.

Внешняя валидность — не тот вопрос, на который может ответить наука, хотя, как мы видели, творческое использование эмпирических методов может быть полезным. Во многом оно опирается на логику рассуждений по аналогии. Вот как это формулирует Роберт Сагден: «Разрыв между миром модели и реальным миром необходимо преодолевать с помощью индуктивного вывода... который зависит от субъективных суждений о „сходстве“, „существенности“ и „достоверности“»²². Хотя мы вполне можем представить выражение понятий вроде «сходства» в формальных или количественных терминах, подобная формализация в большинстве контекстов будет мало полезной. В извлечении пользы из моделей неизбежно сохраняется элемент искусства.

22. Robert Sugden, «Credible Worlds, Capacities and Mechanisms» (unpublished paper, School of Economics, University of East Anglia, August 2008).

Модели и теории

ВЫ МОГЛИ заметить, что до сих пор я старался по возможности избегать слова «теория». Хотя иногда термины «модель» и «теория» используются как синонимы (не в последнюю очередь экономистами), лучше их не смешивать. Слово «теория» — очень претенциозное. В общем виде оно обозначает набор идей или гипотез, призванных объяснить определенные факты или явления. Иногда подразумевается, что теория — это то, что было проверено и верифицировано; в иных случаях она может носить гипотетический характер. Два примера теорий из физики — общая теория относительности и теория струн. Считается, что теория Эйнштейна была полностью доказана последующими экспериментальными исследованиями. Теория струн, созданная относительно недавно и имеющая целью свести воедино все силы и частицы, известные в физике, пока что получила ограниченное эмпирическое подтверждение. Теория эволюции Дарвина, основанная на идее естественного отбора, не может быть верифицирована напрямую или экспериментальным путем, потому что эволюция видов занимает очень много времени, но подтверждается множеством косвенных данных.

Как в этих примерах из естественных наук, подразумевается, что теория обладает общей и универсальной валидностью. Одна и та же теория эволю-

ции применима и в северном, и в южном полушарии, а быть может, применима и к жизни на других планетах. Экономические модели — другие. Они зависят от контекста, и их почти бесконечное множество. В лучшем случае их объяснение носит частный характер, и они не претендуют на то, чтобы быть чем-то большим, чем абстракцией, созданной для прояснения конкретных механизмов взаимодействия и причинно-следственных связей. Выводя за рамки анализа все остальные возможные причины, эти мысленные эксперименты позволяют изолировать и выявить эффекты небольшого количества причин. Они не дают полного объяснения явлений реального мира в случаях, когда могут одновременно действовать множество причин.

Чтобы понять разницу между моделями и теориями, а также их возможные пересечения, нам сначала нужно понять разницу между тремя типами вопросов.

Во-первых, есть вопросы вида «Как фактор A влияет на параметр X ?». Например, как повышение минимального уровня заработной платы влияет на занятость? Как приток капитала влияет на темпы экономического роста в стране? Как увеличение государственных расходов влияет на инфляцию? Как мы видели, экономические модели отвечают на этот вопрос, предлагая убедительные описания причинно-следственных связей и проясняя, как эти связи зависят от конкретных обстоятельств. Заметьте, что ответить на эти вопросы — не значит сделать прогноз, даже если мы вполне уверены в адекватности нашей модели. В реальном мире происходит много другого наряду с эффектами, которые мы анализируем. Мы можем правильно предсказать, что увеличение минимальной заработной платы снизит занятость, но в реальном

мире этот эффект может оказаться смазан общим подъемом спроса, ведущим к росту занятости. Подобные вопросы — законная область использования экономических моделей.

Во-вторых, есть вопросы вида «Почему?», в которых необходимо найти объяснение наблюдаемой совокупности фактов и событий. Почему случилась промышленная революция? Почему неравенство в США выросло после 1970-х годов? Почему произошел глобальный финансовый кризис 2008 года? В каждом случае мы можем придумать теории, и не только экономические, которые претендуют на способность ответить на этот вопрос. Но эти теории будут частными, а не универсальными. Их цель — пролить свет на конкретные исторические эпизоды, а не описывать общие законы и тенденции.

Тем не менее формулировка подобных теорий представляет трудности для аналитика. Экономическая модель тщательно исследует все следствия конкретной причины. Она отвечает на вопрос, который статистик Эндрю Гельман назвал вопросом «прямой причинно-следственной связи». Но чтобы объяснить событие после того, как оно произошло, необходимо изучить все возможные причины. Снова пользуясь терминологией Гельмана, это вопрос «обратного причинно-следственного заключения». Для этого необходимо искать конкретные модели или их комбинацию, которые смогут объяснить изучаемые факты. Процесс предполагает отбор и анализ моделей такого вида, как мы видели в прошлой главе. Правильно выбранные модели — необходимый элемент для конструирования подобных теорий, как мы увидим далее¹.

1. Andrew Gelman, «Causality and Statistical Learning», *American Journal of Sociology* 117 (2011): 955–66; Andrew Gelman and

Наконец, есть серьезные, вечные вопросы экономики и социальной науки. От чего зависит распределение дохода в обществе? Капиталистическая система стабильна или неустойчива? Каковы источники общественной кооперации и доверия, и почему они различаются в разных обществах? Все это вопросы из области больших теорий. Успешный ответ объяснит прошлое, а также станет ориентиром в будущем. В этом плане они выступают аналогом физических законов природы в социальном мире. Современную экономическую науку часто критикуют за нежелание заниматься такими вопросами. Где сегодняшние Карл Маркс или Адам Смит? Удалось бы им получить место хотя бы во второсортном университете? Эта критика справедлива. Но можно привести разумный контраргумент: в социальных науках невозможно сформулировать универсальные теории, и лучшее, что мы можем сделать, — получить последовательность согласованных объяснений.

В экономической науке есть свои большие теории — преимущественно модели большого масштаба, претендующие на способность объяснять происходящее в обществах с рыночными экономиками. Мы увидим, что они могут значительно помочь в прояснении проблемы. Но я покажу, что общие экономические теории — не более чем строительные леса, выстроенные вокруг эмпирических закономерностей. Они являются одним из способов организации мышления, а не самостоятельной объяснительной схемой. Сами по себе они не могут повлиять на реальный мир. Только в сочетании с до-

Guido Imbens, *Why Ask Why? Forward Causal Inference and Reverse Causal Questions*, NBER Working Paper 19614 (Cambridge, MA: National Bureau of Economic Research, 2013).

статочным анализом контекста они могут стать полезными.

Далее я перейду к теориям промежуточного типа, призванным объяснять определенные события в экономике. Я сконцентрируюсь на одном конкретном вопросе: почему неравенство в США так сильно выросло после 1970-х годов? Мы оценим относительный вклад различных моделей и покажем, как подобный процесс продуцирует полезное знание, хотя и не ведет к созданию неоспоримой и широко признаваемой теории.

Теория стоимости и ее распределения

Возможно, самый фундаментальный вопрос в экономической науке — «Что создает стоимость?». Для экономиста это вопрос о том, чем обусловлены цены на различные товары и услуги в рыночной экономике. В экономической науке «теория стоимости» — это теория о ценообразовании. И если современному читателю этот вопрос больше не кажется фундаментальным или особенно интригующим, то лишь потому, что он уже лишился флера загадочности благодаря достижениям теоретиков, пробившихся через окружавшую его толщу заблуждений.

Классические экономисты, такие как Адам Смит, Давид Рикардо и Карл Маркс, придерживались мнения, что стоимость определяется издержками производства. Если производство обходится дороже, то цена должна быть выше. В свою очередь, издержки производства зависят от оплаты труда рабочих, либо тех, кто был непосредственно занят в рассматриваемом виде деятельности, либо

тех, кто трудился для производства используемого оборудования. Эти соображения легли в основу «теории стоимости», которую следует отличать от более ранних теорий, таких как теория французских физиократов, считавших первичным источником стоимости землю.

Но одно дело — сказать, что труд создает стоимость, а другое — объяснить уровень заработной платы. Взгляды классических экономистов на этот счет были весьма мрачными. Они считали, что размер заработка стремится к уровню, необходимому для поддержания существования — достаточно-му, чтобы кормить, одевать и обеспечивать жильем семью. Если заработки слишком сильно превысят этот уровень, то результатом станет рост населения (потому что станет выживать больше детей), а также рабочей силы. Как следствие, заработки вернуться обратно к своему «естественному» уровню. Поэтому в наибольшем выигрыше от экономического и технологического прогресса будут владельцы земли, предложение которой ограничено. Именно этот способ мышления, обычно ассоциируемый с работами Томаса Мальтуса, обусловил знаменитое высказывание писателя XIX века Томаса Карлейля, назвавшего экономику «мрачной наукой».

Маркс, чье влияние сохранилось и в XX веке, также был сторонником теории стоимости. Он тоже полагал, что уровень оплаты труда занижен, но в его теории виновниками выступали капиталисты, которые эксплуатировали рабочих и сохраняли контроль над ними благодаря «резервной армии безработных». По мнению Маркса, капиталисты присваивали создаваемую рабочими добавочную стоимость. Но их победа была пирровой, поскольку конкуренция между капиталистами в конечном счете вела к снижению нормы

прибыли и вызывала общий кризис капиталистической системы.

Трудовая теория стоимости, объясняющая ценообразование только факторами со стороны производства, почти не говорит о потребителях. Но разве сторона спроса не играет роли? Разве цены не реагируют также на предпочтения потребителей и любые изменения в их предпочтениях? В центре внимания классического подхода была долгосрочная перспектива. Он мало что мог сказать о краткосрочных колебаниях или о том, от чего зависят *относительные* цены.

Полноценный синтез сторон спроса и предложения в вопросе формирования цены принесла маржиналистская революция конца XIX века. Маржиналисты, в том числе Уильям Стенли Джевонс, Леон Вальрас, Ойген фон Бем-Баверк, Альфред Маршалл, Кнут Виксель и Джон Бейтс Кларк, подняли анализ на следующий уровень: от наблюдаемых количественных сущностей к ненаблюдаемым гипотетическим математическим конструктам, таким как «потребительская полезность» и «производственные функции». Они также обобщили классический подход, допустив замещение различных средств производства, таких как труд и капитал; например, теперь можно было анализировать, как фирмы замещают труд машинами по мере изменения цен ручного труда и машин. Использование недвусмысленных математических выражений позволило им описать зависимость цен, издержек и объема выпуска на различных рынках как результат одновременного действия потребительских предпочтений и состояния технологий производства (и взаимодействия между ними).

Маржиналисты внесли ключевой вклад в современную теорию стоимости: они поняли, что цены

определяются предельными издержками. Например, рыночная цена нефти определяется не *средними* издержками производства или потребительской ценностью нефти, а издержками и ценностью *последней* проданной единицы нефти. В ситуации рыночного равновесия издержки на производство и потребительская ценность этой последней (предельной) единицы в точности равны и являются рыночной ценой. В противном случае рынок не находился бы в равновесии и требовалась бы коррекция, чтобы вернуться к равновесному состоянию. Когда рыночная цена последней единицы выше потребительской ценности, потребители будут покупать меньше; когда рыночная цена ниже — потребители покупают больше. Аналогично, когда рыночная цена выше, чем издержки производства последней единицы товара, фирма расширяет производство; когда они ниже, фирма сокращает производство.

Маржиналисты обнаружили, что кривые предложения и спроса представляют собой не что иное, как предельные издержки производителей и предельную ценность для потребителей. Рыночная цена — это точка пересечения кривых. Ответ на вопрос, что определяет стоимость — издержки производства или потребительская выгода — таков: ценность зависит от предельного состояния обоих факторов.

Подход маржиналистов к определению цены в равной степени применим к издержкам производства. Доходы рабочих (оплата труда) определяются предельной производительностью труда, а доходы капиталистов (рента) определяются предельным продуктом капитала, то есть тем, насколько последние единицы труда и капитала увеличивают выпуск фирмы. Теперь предположим,

что производство ведется при неизменной норме прибыли, то есть удвоение объема использованного капитала и труда удваивает объем выпуска. Это допущение математически гарантирует, что оплата предельной производительности труда, капитала и иных средств производства обеспечивает полное размещение дохода, созданного производством с применением всех использованных в нем средств производства. Иными словами, теперь у нас есть теория распределения (кто что получает) в дополнение к теории стоимости.

Эта теория объясняет, каким образом национальный доход распределяется между трудом и капиталом. Если мы продвинемся дальше в выделении различных типов труда, то установим также распределение дохода между работниками разного уровня квалификации, например, теми, кто не закончил среднюю школу, закончил среднюю школу или закончил колледж. Это так называемое функциональное распределение дохода. Сочетая знание о нем с информацией о типе и объеме принадлежащего людям капитала, мы можем, в свою очередь, вывести распределение дохода между индивидами или домохозяйствами (распределение личных доходов).

Насколько полезны такие теории? На первый взгляд, неоклассический синтез дает убедительные ответы на два фундаментальных вопроса в экономической науке: что создает стоимость и что определяет ее распределение. Эти теории многое прояснили. В частности, теперь мы понимаем, что производство, потребление и цены подобны системе и взаимно зависят друг от друга. И у нас есть убедительный анализ функционального распределения дохода. Но эти теории основаны на ненаблюдаемых концепциях предельной полезно-

сти, предельных издержек и предельного продукта. Потребуется ввести дополнительные предпосылки и много дополнительных построений, прежде чем с ними станет можно работать в части измерения и объяснения. Кроме того, они далеко не универсальны. Дальнейшие исследования показали, что, даже в рамках своей внутренней логики, эти теории зависят от определенных обстоятельств.

Мы уже видели, что схема спроса и предложения, на которой основана теория стоимости, предполагает соблюдение ряда важных условий. Могут отсутствовать условия для совершенной конкуренции, а рынок может быть монополизирован небольшой группой производителей. Поведение потребителей может быть далеко от рационального. В производстве может действовать принцип экономии от масштаба, и предельные издержки могут снижаться по мере роста объемов выпуска, входя в противоречие с требованием роста предельных издержек, необходимым для получения стандартной восходящей кривой предложения. И в любом случае, как вообще возникают такие концепции, как «производственная функция» и «полезность»? Ведь фирмы явно различаются в способности получать доступ, перенимать и применять имеющиеся технологии. Потребительские предпочтения редко бывают постоянными; они принимают разные формы вслед за событиями в экономическом и социальном мире. Открыть эти «черные ящики» — новая теоретическая задача, которая до сих пор не разрешена в полной мере.

Неоклассическая теория распределения имеет свои слабые места. Например, понятие «капитала» как единого измеримого фактора производства вызывала значительные споры среди экономистов. Но пока отложим этот щекотливый вопрос в сто-

рону. Если говорить только о заработной плате, позволяет ли теория предельной производительности объяснить динамику размера оплаты труда?

Ответ таков: это зависит от конкретной постановки вопроса и особенностей изучаемого случая. Порядка 80–90% различий в уровне оплаты труда между странами не объясняются различиями в национальном уровне производительности. Невозможно непосредственно наблюдать предельную производительность; мы можем измерить только среднюю производительность труда (разделив валовый внутренний продукт на уровень занятости). Но если соотношение среднего и предельного уровня не сильно различается между странами, то сильную межстрановую связь заработной платы и средней производительности труда можно трактовать как подтверждение теории. И это не тривиальный результат. Например, он позволяет утверждать, что заработки в Бангладеш или Эфиопии составляют лишь малую долю заработка в США в первую очередь из-за низкой производительности труда в этих странах, а не из-за эксплуатации труда или институтов принуждения. Порой институты важны, но они отвечают за очень небольшую долю межстрановых различий в результатах распределения доходов между трудом и капиталом².

Но давайте посмотрим, что происходило в США после 2000 года. В 2000–2011 годах средняя реальная заработная плата росла на 1% в год, с 32 долларов в час до 35 долларов в час (в ценах 2011 года). В то же время продуктивность труда росла на 1,9% в год, то есть почти вдвое быстрее заработной платы. Отчасти разрыв связан с тем фактом, что цены

2. Dani Rodrik, «Democracies Pay Higher Wages», *Quarterly Journal of Economics* 114, no. 3 (August 1999): 707–38.

на товары, потребляемые американскими рабочими, росли быстрее цен на производимые ими товары. Так что потребительская способность работников росла медленнее, чем их производительность; уже одно это обстоятельство можно совместить со стандартной теорией лишь с большой натяжкой. Эффект относительных цен, однако, объясняет около четверти разрыва, а остальные три четверти остаются загадкой³.

Оставаясь строго в пределах границ неоклассической теории распределения, мы бы сказали, что в этом периоде произошло резкое падение предельного вклада труда в выпуск. Возможно, виной тому растущее использование машин и иных форм капитала, а также перемещение труда вслед за новыми технологиями. Действительно, так рассуждают многие экономисты, когда объясняют замедление роста заработной платы в последние десять лет. Но к тому же результату могли привести изменения, не учитываемые в неоклассической теории — изменения в переговорной силе сторон, трудовых нормах и экономической политике, например, введение минимального размера оплаты труда. Сделать выбор между альтернативными объяснениями непросто, потому что неоклассическая теория ссылается на математическое представление базовой технологии (та самая «производственная функция») и изменения в ней, которые не доступны непосредственному наблюдению. В конце концов, не проверяемая теория не особенно полезна.

3. Lawrence Mishel, *The Wedges between Productivity and Median Compensation Growth*, Issue Brief 330 (Washington, DC: Economic Policy Institute, 2012). Мишель делает акцент на *медианной* заработной плате, которая росла существенно медленнее средней заработной платы, из-за растущего неравенства уровня зарплат.

Существует множество альтернативных теорий. Некоторые подчеркивают роль прямых переговоров между работодателями и работниками, когда широкое распространение профсоюзов и коллективных договоров может влиять на распределение прибыли предприятия между двумя сторонами. Зарботки высокооплачиваемых работников, таких как высшие руководители, также во многом определяются путем переговоров⁴. Другие модели выводят на первый план роль норм — например, представлений о приемлемости разрыва между зарботком высшего руководства и рядовых сотрудников. Большинство экономистов признают, что работники США и Европы сильно выиграли от перехода к более эгалитарному обществу в 1950-х и 1960-х годах. Третьи модели предполагают, что отдельные фирмы могут платить зарплату выше рыночного уровня из соображений максимизации прибыли, не отказываясь от концепции предельной продуктивности как таковой. Например, превышающая рыночную «эффективная» зарботная плата, как ее называют, может быть оправдана для работодателей как средство мотивировать работников или минимизировать текучку рабочей силы (чтобы снизить издержки найма и обучения). Эти нюансы уводят нас в сторону от моделей общего назначения, и мы снова возвращаемся к узкоспециализированным моделям, которые могут быть релевантными в различных контекстах.

Большие теории в конечном счете дают меньше, чем обещают. Их обобщающий подход выяв-

4. Thomas Piketty, Emmanuel Saez, and Stefanie Stantcheva, *Optimal Taxation of Top Labor Incomes: A Tale of Three Elasticities*, NBER Working Paper 17616 (Cambridge, MA: National Bureau of Economic Research, 2011).

ляет конечные причины явлений, но нуждается в значительном подкреплении подробностями, специфичными для данного контекста. Как я уже говорил, лучше рассматривать теории как строительные леса вокруг фактов.

Теория циклов деловой активности и безработицы

Публикация докторской диссертации Пола Самуэльсона под названием «Основания экономического анализа» в 1947 году разделила экономическую науку на микро- и макроэкономику. Область микроэкономики — теория цен, рассмотренная в предыдущем разделе. Макроэкономика имеет дело с поведением экономических агрегатов — в частности, с инфляцией, общим выпуском и занятостью. Макроэкономика считает своим главным вопросом колебания экономической активности, которые экономисты называют «деловым циклом». Здесь тоже нет недостатка в больших теориях. С каждой следующей волной исследований мы узнавали много нового. Но попытки создать большую унифицированную теорию делового цикла обречены на неудачу.

Классические экономисты не видели особой разницы между работой отдельных рынков и функционированием всей экономики. В частности, безработицу трактовали как следствие того, что заработная плата (рыночная цена труда) установлена на неверном уровне. Если заработная плата слишком высока, работодатели наймут слишком мало работников, равно как завышенная цена на яблоки приведет к чересчур низкому потреблению яблок. Это так называемый сценарий классической безра-

ботицы. Схожим образом общий уровень цен в экономике определяется количеством денег в системе и ликвидностью. Устойчивый рост цен — следствие чрезмерного количества денег в обращении.

Подход классических экономистов к деловому циклу определялся их представлением о том, что на макроуровне (хотя этот термин тогда еще не использовался) экономика самостоятельно стабилизируется. Со временем безработица исчезнет, так как недостаток работы снизит уровень заработной платы. Рост инфляции тоже остановится сам собой: вызванное им снижение конкурентоспособности на внешнем рынке создаст торговый дефицит, подкрепляемый оттоком золота за рубеж, который в свою очередь приведет к корректирующему снижению внутреннего предложения денег. Такие предположительно автоматические механизмы коррекции гарантируют, что деловой цикл, инфляция и безработица позаботятся о себе сами. Концентрированным выражением этой экономической традиции стал золотой стандарт, который просуществовал вплоть до XX века. По правилам золотого стандарта страны определяли стоимость своей валюты относительно золота. Например, в США цена золота в период с 1834 по 1933 год оставалась неизменной (20,67 долларов за унцию)⁵. Правительства поставили денежную политику на «экономический автопилот», отказавшись от всякого вмешательства в свободное передвижение денег между границами. Идеи налоговой или

5. Единственное исключение — промежуточный период во время эры бумажных денег в 1861–1878 годах. Michael D. Bordo, «The Classical Gold Standard: Some Lessons for Today», *Federal Reserve Bank of St. Louis Review*, May 1981, 2–17.

стабилизационной политики в том виде, в каком мы знаем их сейчас, еще не существовали. Правительства не могли (и не должны были) ничего делать, кроме как не мешать автоматическим корректировкам.

Джон Мейнард Кейнс думал иначе. Консерватор-революционер, он сформулировал доктрину, предназначенную для спасения капитализма от присущих ему очагов нестабильности. Кейнс утверждал, что безработица может быть равновесным состоянием экономики и сохраняться на протяжении долгого времени. Работа классических механизмов коррекции займет слишком много времени — годы, возможно даже десятилетия, а в долгосрочном периоде, как гласит его знаменитое выражение, «мы все умрем». Кроме того, Кейнс утверждал, что правительства могут многое. Когда частный спрос недостаточен для обеспечения необходимой занятости, заявлял Кейнс, правительство должно вмешаться и увеличить расходную часть бюджета. Даже если расширение государственных программ выразится в том, что люди копают канавы, а затем засыпают их обратно, итогом станет рост занятости и повышение национального дохода. Великая депрессия значительно способствовала внедрению этих идей, так как правительствам пришлось отреагировать на катастрофический рост безработицы, которая в США достигла четверти от численности рабочей силы.

Кейнс писал очень ловко и остроумно, но не формулировал модели в явном виде, и ход его рассуждений временами оставался неясен. И по сей день историки экономики спорят, что этот великий теоретик имел в виду в том или ином фрагменте. Едва высохли чернила в его главной работе «Общая теория занятости, процента и денег»

(опубликованной в 1936 году), как начали появляться модели, авторы которых пытались действовать в рамках концепции Кейнса. Самой известной среди них стала работа Джона Хикса «Господин Кейнс и „классики“»⁶, которая в течение десятков лет пользовалась значительным влиянием. Модель Хикса стала тем инструментом, который позволил идеям Кейнса трансформировать стандартную макроэкономику — хотя многие, в том числе сам Кейнс, считали, что эта работа лишь отчасти отражает содержание «Общей теории». Кейнс прямо говорил, что не интересуется разработкой моделей на основе своих идей. Он считал более важным транслировать некоторые «сравнительно простые фундаментальные идеи», чем воплощать их в конкретных формах⁷.

В кейнсианском понятийном аппарате решающее значение имела идея возможности дисбаланса между сбережениями и инвестициями в экономике. Чтобы бухгалтерский баланс сошелся, эти два параметра должны когда-нибудь сравняться: все сбережения должны стать инвестициями, и все инвестиции должны осуществляться за счет сбережений (без учета средств, которые можно занять за рубежом или дать в кредит другим странам). Но Кейнс подчеркивал возможность того, что ме-

6. J. R. Hicks, «Mr. Keynes and the „Classics“: A Suggested Interpretation», *Econometrica* 5, no. 2 (April 1937): 147–159; Джон Р. Хикс, «Господин Кейнс и „классики“: попытка интерпретации», в: Джон Мейнард Кейнс, *Общая теория занятости, процента и денег. Избранное* (Москва: Эксмо, 2007), 343–356.

7. John M. Keynes, «The General Theory of Employment», *Quarterly Journal of Economics* 51, no. 2 (February 1937): 209–223; Джон Мейнард Кейнс, «Общая теория занятости», в: Джон Мейнард Кейнс, *Общая теория занятости, процента и денег. Избранное* (Москва: Эксмо, 2007), 356–367.

ханизм восстановления баланса приведет экономику к появлению безработицы. Предположим для примера, что первоначальные сберегательные намерения домохозяйств превышают уровень инвестиций. Кейнс полагал, что инвестиции зависят от психологических факторов («стадное чувство»), во многом внешних по отношению к макроэкономическим параметрам, таким как процентная ставка. Если уровень инвестиций по каким-то иным соображениям постояен, то коррекция должна произойти за счет сбережений. Как происходит снижение сбережений до уровня, который требуется для обеспечения равновесия инвестиций и сбережений?

Ответ классических экономистов акцентировал роль ценовой корректировки, включая процентные ставки. Снижение уровня цен или процентной ставки стимулирует домохозяйства больше потреблять и в перспективе снижает уровень сбережений. Кейнс считал, что подобная ценовая коррекция, даже в сторону снижения, будет слишком медленной. Он подчеркивал роль корректировок уровня совокупного выпуска и занятости. Поскольку уровень сбережений домохозяйств зависит от их доходов, снижение выпуска (а, следовательно, снижение доходов и занятости) также снизит сбережения и сократит разрыв между ними и инвестициями. Кроме того, в случае экономического спада резко вырастет безработица, и люди так сильно захотят попридержать деньги, что процентная ставка станет нечувствительна к изменениям в экономической ситуации. Это кейнсианская «ловушка ликвидности». В данном сценарии коррекция возможна только путем достаточно резкого сокращения выпуска и занятости. Высокая норма сбережений на уровне домохозяйств оборачивается про-

тив них же на уровне всего общества. Начинается экономический спад.

В этой модели колебания в ходе делового цикла рассматриваются как следствие автономных изменений совокупного спроса. Недостаточный спрос — основополагающая причина безработицы. Случись в это время рост частных инвестиций или потребительских расходов, и проблема была бы решена. В отсутствие обоих факторов действовать придется государству: нужно повысить бюджетные расходы, чтобы компенсировать недостаток частного спроса. Такое видение макроэкономики с акцентом на стороне спроса оставалась господствующим до 1970-х годов. На его основе создавались все более разнообразные модели, в том числе крупномасштабные компьютерные версии, способные генерировать количественные прогнозы состояния крупных макроэкономических агрегатов, таких как уровень занятости и коэффициент использования полезных мощностей.

Дальше случились две вещи: нефтяной шок и Роберт Лукас. Нефтяной кризис 1973 года, последовавший за введением нефтяного эмбарго членами Организации стран — экспортеров нефти (ОПЕК), спровоцировал переход экономики в новое состояние, с которым экономисты еще не сталкивались: спад и инфляция одновременно, или «стагфляция». Модели спроса не годились для объяснения ситуации, которая явно была вызвана шоком предложения. Разумеется, кейнсианскую модель можно модифицировать таким образом, чтобы она учитывала эффекты роста цен на факторы производства. Многие экономисты именно этим и занялись. Но потом появился Лукас, экономист из Чикагского университета и будущий лауреат Нобелевской премии, и предложил ряд идей,

которые совершили революцию в макроэкономике и в конце концов нанесли кейнсианской модели гораздо больший ущерб.

В конце 1970-х годов Лукас снова ввел в макроэкономику новый вариант классического подхода. Как и некоторые другие авторы (в частности, Том Сарджент, тогда работавший в Миннесотском университете), Лукас утверждал, что кейнсианские модели развивают слишком механистическое представление о том, как индивиды действуют в экономике и как они реагируют на экономическую политику государства⁸. По словам другого чикагского экономиста Джона Кокрейна, Лукас и Сарджент вернули в макроэкономику людей⁹. Они отказались от изучения агрегированных связей, например, между потреблением и доходом, и начали моделировать индивидуальные решения потреблять, сберегать и выходить на рынок труда, как это делается в традиционной микроэкономике, но расширили эти модели до макроуровня. Так были созданы «микроосновы» более масштабной теории.

Смена стратегии моделирования имела ряд важных последствий. В частности, в модель были напрямую встроены бюджетные ограничения — как индивидов, так и государства. Частное потребление зависит как от текущего, так и от будущего дохода, а бюджетный дефицит сегодня вызовет повышение налогов (или снижение государственных расходов) завтра. Эта стратегия также потребовала пересмотреть представления о формирова-

8. Robert E. Lucas and Thomas Sargent, «After Keynesian Macroeconomics», *Federal Reserve Bank of Minneapolis Quarterly Review* 3, no. 2 (Spring 1979): 1–18.

9. John H. Cochrane, «Lucas and Sargent Revisited», *The Grumpy Economist* (blog), July 17, 2014, <http://johnhcochrane.blogspot.jp/2014/07/lucas-and-sargent-revisited.html>.

нии ожиданий. Как утверждали Лукас и Сарджент, если люди рациональны в принятии потребительских решений, то они должны быть рациональны и в прогнозах будущего. Прогнозы должны быть совместимы с базовой моделью экономики — так появилась гипотеза «рациональных ожиданий», вскоре захватившая умы экономистов. Идея рациональных ожиданий вскоре стала эталоном для всех моделей ожиданий, которые экономисты используют в том числе для изучения реакций частного сектора на изменение экономической политики.

Лукас, Сарджент и их последователи утверждали, что подобные модели с микроосновами в состоянии ухватить ключевые черты делового цикла и объяснить временную безработицу, не прибегая к кейнсианским предпосылкам, таким как медленная ценовая корректировка. Предпосылка рациональных ожиданий предполагала, что люди не совершают предсказуемых ошибок, но не исключала возможность случайных ошибок в случаях неполной информации о ценах. «Шоки» потребительских вкусов, предпочтений относительно занятости или уровне доступных технологий (то есть шоки кривых спроса и предложения) могут порождать колебания в совокупном выпуске и занятости. Не менее важно, что новая теория намного критичнее оценивала возможности государства по стабилизации экономики. Любая стабилизационная политика на деле приведет к обратному результату. Если люди знают, что государство проводит политику стимулирования экономики за счет увеличения денежной массы и налогов, то они станут вести себя таким образом, что сделают невозможным достижение целей этой политики. Например, активная кредитно-денежная политика побудит фирмы повышать цены, подстегивая инфляцию без роста выпуска и занято-

сти. Налоговое стимулирование вызовет лишь эффект вытеснения — сокращение расходов на стороне частного сектора.

Но не эмпирическая обоснованность принесла победу (по крайней мере, победу в академическом мире) «новому классическому подходу», как его стали называть. Соответствие модели реальному миру и реалистичность ее ключевых компонентов вызывали серьезнейшие сомнения. Но в середине 1980-х годов, одновременно с появлением новой теории, в экономике США начался период экономического роста, высокой занятости и ценовой стабильности. Создавалось впечатление, что новая эра «великой умеренности» сумела обуздать колебания делового цикла. Как следствие, реалистичность описаний и предсказаний нового классического подхода казалась не имеющей значения, по крайней мере в практическом плане.

Значительная часть привлекательности теории была связана с самой моделью. Микроосновы, математический аппарат, новые методики, тесные связи с теорией игр, эконометрикой и другими высокоуважаемыми областями экономики — все это производило впечатление, что новая макроэкономика на многие световые годы опередила кейнсианские модели. «Именно так и должны выглядеть макроэкономические модели» — таким был явный или неявный упрек каждому, кто осмеливался усомниться в правильности стратегии, составляющей подоплеку модели. К тому времени кейнсианские подходы к моделированию на основе идей Хикса почти вышли из употребления. Но само кейнсианство не исчезло. В конечном счете сторонникам активной роли государственной политики в стабилизации экономики пришлось разработать свои варианты моделей с микроосновами (их назвали но-

выми кейнсианскими моделями), чтобы сохранить свой вес в дисциплине.

Отрыв новой классической теории от реальной экономики достиг пика после глобального финансового кризиса 2008 года. Причина неспособности экономистов предвидеть этот кризис — предмет следующей главы. Кризис был спровоцирован преимущественно провалами работы финансовой системы; кейнсианская и новая классическая макромоделли хранили на этот счет гробовое молчание. Но когда американская экономика вошла в рецессию и начался рост безработицы, вопрос поиска спасения непосредственно относился — или должен был относиться — к вотчине макроэкономики. Однако популярные макромоделли, преемники подхода Лукаса — Сарджента, едва ли могли помочь. В начале 2003 года Лукас писал: «Ключевая задача предотвращения депрессии была решена для всех возможных ситуаций»¹⁰. В последующие годы многие размышляли о способах преодоления большой депрессии, так как ее не должно было быть.

Новая и старая модели сходились в одном. Когда экономическая неопределенность резко повышает потребность в безопасности и заставляет домохозяйства и фирмы сберегать максимально возможное количество наличных денег, то Федеральная резервная система (ФРС) должна создавать дополнительную ликвидность, печатая деньги, много денег. Рост количества денег в обращении предупреждает дефляцию и более суровую рецессию. Милтон Фридман много лет назад указывал, что отсутствие подобных действий стало крупнейшей ошибкой ФРС во время Великой депрес-

10. Robert E. Lucas Jr., «Macroeconomic Priorities», *American Economic Review* 93, no. 1 (March 2003): 1–14.

сии в 1930-х годах. Лукас горячо одобрил решение руководителя ФРС Бена Бернанке, специалиста по Великой депрессии, влить в экономику сотни миллионов долларов ликвидности в 2008–2009 годах¹¹. Первоначальный план президента Обамы по предоставлению пакета налогово-бюджетных стимулов в 2009 году также получил широкую поддержку (включая одобрение Лукаса), хотя его и сочли отчаянной и крайней мерой¹².

Но когда финансовая паника улеглась и эти меры более не требовались, новые классические модели рекомендовали ограничиться осторожной политикой сдерживания. Проводимые ФРС меры количественного смягчения (расширение денежной массы) следовало быстро прекращать — в противном случае они привели бы к инфляции. Экономисты, учившиеся на этих моделях, продолжали твердить об опасности инфляции и призывали ФРС ужесточить политику, несмотря на то, что безработица оставалась высокой, экономика работала плохо и — что примечательно — инфляция так и не нача-

11. Robert E. Lucas, «Why a Second Look Matters» (выступление на Совете по международным отношениям в Нью-Йорке 30 марта 2009 года), <http://www.cfr.org/world/why-second-look-matters/p18996>.

12. Holman W. Jenkins Jr., «Chicago Economics on Trial» (interview with Robert E. Lucas), *Wall Street Journal*, September 24, 2011, <http://online.wsj.com/news/articles/SB1000142405311904194604576583382550849232>. Опрос 37 ведущих экономистов в 2014 году показал, что все они, кроме одного, полагали, что пакет стимулов снижал безработицу, и большинство считали, что преимущества пакета превышали расходы на его реализацию. Justin Wolfers, «What Debate? Economists Agree the Stimulus Lifted the Economy», *The Upshot, New York Times*, July 29, 2014, <http://www.nytimes.com/2014/07/30/upshot/what-debate-economists-agree-the-stimulus-lifted-the-economy.html?ref=upshot>.

лась. Они выступали против продолжения политики налоговых стимулов, нацеленных на повышение совокупного спроса и занятости, поскольку считалось, что подобные меры лишь вытесняют частное потребление и инвестиции. Экономика должна была выкарабкаться своими силами. Когда этого не случилось, Лукас и другие усмотрели причину в препятствиях, чинимых находившейся у власти Демократической партией. Они заявляли, что восстановление шло медленно из-за высокой неопределенности, которую создает перспектива роста налогов и других вмешательств государства¹³. Бизнес не хотел инвестировать, а потребители не хотели тратить потому, что действовали в обстановке искусственно созданной неопределенности из-за чрезмерно активной деятельности правительства.

Многие другие считали, что рецессия подтвердила правильность первоначальных идей Кейнса. Как громогласно заявлял Пол Кругман, экономист и ведущий рубрики в газете *New York Times*, недостаточность и преждевременное прекращение политики налоговых стимулов обрекли экономику на излишне высокую и длительную безработицу¹⁴. Брэд Дюлонг из Калифорнийского университета в Беркли и Ларри Саммерс из Гарварда утверждали, что опасения насчет дефицитного бюджета неоправданно; налоговые стимулы окупятся, когда помогут экономике восстановиться¹⁵.

13. Holman W. Jenkins Jr., «Chicago Economics on Trial» (interview with Robert E. Lucas), *Wall Street Journal*, September 24, 2011, <http://online.wsj.com/news/articles/SB1000142405311904194604576583382550849232>.

14. Paul Krugman, «The Stimulus Tragedy», *New York Times*, February 20, 2014, <http://www.nytimes.com/2014/02/21/opinion/krugman-the-stimulus-tragedy.html>.

15. J. Bradford DeLong and Lawrence H. Summers, «Fiscal Policy

Все эти люди — хорошо известные и выдающиеся экономисты. Кругман получил Нобелевскую премию за новаторскую работу, встроившую несовершенную конкуренцию в теорию международной торговли. Саммерс был министром финансов в администрации Обамы. Но для новых классических моделей, которые стали господствовать в дисциплине, они были чужаками.

Поле для столкновения кейнсианцев и сторонников новой классической модели стал вопрос о том, где корень проблемы: на стороне спроса или на стороне предложения. В принципе, в распоряжении экономистов были инструменты, позволяющие выявить среди соперничающих концепций самую релевантную. Принципы выбора модели, рассмотренные в предыдущей главе, как нельзя лучше подходят для такой задачи. Кейнсианцы резонно отмечали, что если бы проблема была в недостаточном предложении, то имелись бы признаки инфляционного давления, но их не было. Рост безработицы коснулся всех секторов экономики и не был связан с конкретной ситуацией в какой-либо отрасли, что тоже указывало на общее сжатие спроса как на источник проблем¹⁶. Тем временем другая сторона представила данные, почерпнутые из сообщений печати, изменений налогового кодекса и несогласованности прогнозов, которые подтверждали рост неопределенности политики и позволяли отчасти объяснить рост безработицы и снижение экономического роста (как в динамике, так и ме-

in a Depressed Economy», *Brookings Papers on Economic Activity*, Spring 2012, 233–274.

16. Edward P. Lazear and James R. Spletzer, «The United States Labor Market: Status Quo or a New Normal?» (paper prepared for the Kansas City Fed Symposium, September 13, 2012).

жду отдельными штатами США)¹⁷. Неизвестно, изменил ли хоть кто-нибудь из спорящих свое исходное мнение под воздействием представленных доказательств. Когда сильна вера в обоснованность теории, как было в этом случае, эмпирический анализ не является решающим, особенно если его приходится проводить в режиме реального времени.

Что мы можем сказать в заключение об этих больших теориях делового цикла? Разумеется, они не бесполезны. Классическая, кейнсианская и новая классическая теории принесли полезное знание. Кейнсианский подход не подходил для ситуации 1970-х годов, но многие из его ключевых выводов остаются обоснованными и полезными и сегодня. Новый классический подход заставил задуматься о необходимости понимать, каким будет отклик индивидов на политику государства. Оба подхода потерпели неудачу в качестве «больших теорий», применимых во все времена, независимо от обстоятельств. В качестве моделей, описывающих конкретные ситуации, они остаются чрезвычайно ценными.

Теории как объяснения конкретных событий

Теперь давайте вернемся к промежуточному типу экономической теории, который я упомянул в начале главы. Имея меньше претензий на масштаб-

17. Scott R. Baker, Nicholas Bloom, and Steven J. Davis, «Measuring Economic Policy Uncertainty» (unpublished paper, Stanford University, June 13, 2013); Daniel Shoag and Stan Veuger, «Uncertainty and the Geography of the Great Recession» (unpublished paper, John F. Kennedy School of Government, Harvard University, February 25, 2014).

ность, такая теория стремится выявить причины конкретной совокупности событий. Она не претендует на то, чтобы дать общее объяснение всех событий похожего вида. Обычно она исторически и географически специфична.

Здесь я рассмотрю пример теорий, объяснявших рост неравенства в США и некоторых других развитых экономиках с конца 1970-х годов. Хотя эти теории общепризнаны, от них не ожидают применимости в иной обстановке. Объяснения, которые я рассмотрю, не претендуют на то, чтобы растолковать, скажем, рост неравенства в США во время «Позолоченного века» перед началом Первой мировой войны или снижение неравенства во многих латиноамериканских странах после 1990-х годов. Они обладают качеством *sui generis*¹⁸.

Постепенный рост неравенства в США, начавшийся в середине 1970-х годов, убедительно подтвержден данными статистики. Коэффициент Джини — популярная мера неравенства, которая изменяется от 0 (нет неравенства) до 1 (максимальное неравенство, когда весь доход достается одному домохозяйству), вырос от 0,40 в 1973 году до 0,48 в 2012 году, то есть на 20%¹⁹. Доля национального дохода, получаемая 10% богатейших граждан страны, выросла с 32 до 48%% за тот же период²⁰. Что же вызвало столь резкие перемены?

Одним из факторов, приведших к росту нера-

18. *Sui generis* (лат.) — уникальный, единственный в своем роде. — Прим. пер.

19. Данные Бюро переписей США см. в «Income Gini Ratio for Households by Race of Householder, All Races», FRED Economic Data, Federal Reserve Bank of St. Louis, <http://research.stlouisfed.org/fred2/series/GINIALLRH#>.

20. The World Top Incomes Database, <http://topincomes.parisschoolofeconomics.eu/#Database>.

венства, стал рост «надбавки за квалификацию» — разрыва между заработками высоко- и низкоквалифицированных работников. Когда экономисты впервые столкнулись с появлением этого разрыва в конце 1980-х годов, у них быстро нашлось убедительное объяснение — глобализация. За последние годы увеличилась зависимость экономики США от международной торговли. Развитые экономики Европы и Японии во многом догнали США по производительности и навязали Штатам жесткую конкуренцию. Кроме того, много растущих экспортеров появилось в Восточной Азии (Южная Корея, Тайвань, Китай), где заработная плата составляла лишь малую часть от американских зарплат.

Со времен Рикардо «Принцип сравнительных преимуществ» претерпел множество доработок. Господствующая версия теории (теория обеспеченности факторами производства, которую впервые предложили Эли Хекшер и Бертил Олин в начале XX века) предсказывала изменение относительных заработков именно в том направлении, которое имело место в США. Согласно этой теории, США будут экспортировать товары, для производства которых требуется квалифицированный труд, и будут импортировать товары, для производства которых требуется неквалифицированный труд. Большая открытость международной торговле идет на благо американским квалифицированным рабочим, продукция которых теперь выходит на более крупные рынки, но вредит низкоквалифицированным работникам, которые сталкиваются с усилением конкуренции. Как в начале 1990-х годов отметил экономист из Калифорнийского университета в Лос-Анджелесе Эдвард Лимер, «нашим низкоквалифицированным работникам противостоят полчища низкооплачиваемых

низкоквалифицированных работников по всему миру»²¹. Как следствие, разрыв между заработками двух типов работников будет расти. Из теории следует даже более жесткий вывод: неквалифицированные работники потеряют не только в относительном, но и в абсолютном выражении. Большая открытость во внешней торговле снизит их жизненный уровень²².

На этом этапе обсуждение можно было бы завершить, однако экономисты обратили внимание на другие события, которые не сочетались с теорией факторов производства. Взять хотя бы то, что «надбавка за квалификацию» выросла и у торговых партнеров США с низкой оплатой труда — в странах Азии и Латинской Америки. Это было проблемой для теории, поскольку она предсказывала этим странам движение надбавки за знания в противоположном направлении. Неквалифицированные работники должны выиграть от роста зарплат в странах, экспортирующих товары, для производства которых требуется низкоквалифицированный труд. Далее, отдельные отрасли в США тоже опровергали предсказания теории. Фирмы замещали неквалифицированный труд квалифицированным — то есть шло повышение квалификации работников — там, где им следовало бы делать обратное, так как внешняя торговля удешевляла

21. Edward E. Leamer, *Wage Effects of a U.S. — Mexican Free Trade Agreement*, NBER Working Paper 3991 (Cambridge, MA: National Bureau of Economic Research, 1992), 1.

22. Таково следствие из теоремы Столпера — Самуэльсона, расширяющей теорию обеспеченности факторами производства. Wolfgang Stolper and Paul A. Samuelson, «Protection and Real Wages», *Review of Economic Studies* 9, no. 1 (1941): 58–73.

стоимость неквалифицированного труда²³. Это хороший пример того, как экономисты могут с помощью побочных следствий модели проверять или — как было здесь — опровергать определенное объяснение.

Подобные противоречащие факты не обязательно означают, что глобализация не является важной причиной роста экономического неравенства. Но из них следует, что будь глобализация настоящей причиной, то ее влияние выражалось бы иными способами, а не теми, которые акцентирует теория факторов производства. Вскоре сложилась альтернативная модель эффекта глобализации, основанная на роли иностранных инвестиций и переноса производства за рубеж. Для промышленного производства требуется множество различных комплектующих. Предположим (вполне обоснованно), что товары, требующие самой высокой квалификации труда, производятся в США, тогда как прочие менее требовательные к квалификации рабочих товары производятся в развивающейся стране, такой как Мексика. По мере того как глобализация упрощает перенос производства за рубеж за счет снижения пошлин, стоимости перевозки и связи, американские фирмы переносят часть производств в Мексику. Стоит ожидать, что за рубеж будет вынесено производство тех комплектующих, которое будет требовать самой низкой квалификации американских рабочих. Однако в Мексике те же самые комплектующие окажутся в числе самых требовательных к квалификации

23. Eli Berman, John Bound, and Zvi Griliches, «Changes in the Demand for Skilled Labor within US Manufacturing: Evidence from the Annual Survey of Manufacturers», *Quarterly Journal of Economics* 109, no. 2 (1994): 367–397.

работников. В результате, отчасти парадоксальным образом, на производствах в США, и Мексики начнется процесс повышения квалификации работников. Относительный спрос на квалифицированных работников растет в обеих странах, равно как и надбавка за квалификацию. Как показали Роб Фенстра и Гордон Хадсон, первыми предложившие эту гипотезу, пример мексиканских *maquiladoras*, заводов в зонах свободной торговли, согласуется с этой моделью²⁴.

Главной альтернативой доводу о роли глобализации были технологические изменения. В тот момент быстро развивались информационные и коммуникационные технологии, а также расширялось применение компьютеров. В норме быстрый технологический прогресс, повышающий производительность труда, должен улучшать качество жизни всех людей. Но некоторые могут выиграть больше прочих. Новые технологии требуют квалифицированных работников, так что спрос на работников с дипломом колледжа и выше растет намного быстрее спроса на менее квалифицированных рабочих. Экономисты назвали этот процесс «технические изменения, изменяющие требования к квалификации работников» (*skill-biased technological change, SBTC*)²⁵.

24. Robert C. Feenstra and Gordon H. Hanson, «Foreign Direct Investment and Relative Wages: Evidence from Mexico's Maquiladoras», *Journal of International Economics* 42 (1997): 371–394.

25. Frank Levy and Richard J. Murnane, «U.S. Earnings and Earnings Inequality: A Review of Recent Trends and Proposed Explanations», *Journal of Economic Literature* 30 (September 1992): 1333–1381; John Bound and George Johnson, «Changes in the Structure of Wages in the 1980s: An Evaluation of Alternative Explanations», *American Economic Review* 83 (June 1992): 371–392.

Гипотеза *SVTC* объясняла рост надбавки за квалификацию. Кроме того, в отличие от модели обеспеченности факторами производства, ее выводы соответствовали процессу роста квалификации работников в фирмах и отраслях. Работодатели нанимали больше квалифицированных работников из-за автоматизации и растущего использования компьютеров. Когда технологические изменения охватили остальной мир, теория пригодилась для объяснения роста неравенства оплаты труда в развивающихся странах. К концу 1990-х годов экономисты, изучавшие внешнюю торговлю и занятость, почти единодушно полагали, что именно технические изменения со смещением требований к квалификации рабочих стали главной причиной роста надбавки за квалификацию. Считалось, что внешняя торговля тоже сыграла определенную роль, но ее вклад составил не более 10–20% прироста неравенства.

В скором времени появились новые сомнения. В 1990-е годы темпы появления новых технологий оставались высокими, однако размер надбавки за квалификацию не менялся. (В 2000-х годах ее рост возобновится с удвоенной силой). Значительная часть динамики заработной платы не могла быть объяснена с помощью одной только теории *SVTC*. Например, значительно выросло неравенство по оплате труда внутри квалификационных категорий, таких как выпускники колледжей. Рост требований рабочих мест к квалификации и доли высококвалифицированных профессий наблюдался как минимум с 1950-х годов, но не усиливал неравенство. Пусть рост неравенства заработков был спровоцирован технологическими изменениями; но возможно, именно усиление глобализации стимулировало распространение новых технологий

после 1970-х годов. Наконец, важной составляющей роста неравенства наверняка стал рост доходов на верхних уровнях доходного распределения — у 1% работников с наибольшими доходами. Тенденция к росту высоких доходов, в свою очередь, во многом определялась доходами от капитала (от акций и облигаций), а не заработной платой.

Эти соображения показали, что одной теории *SBTC* не достаточно для объяснения динамики неравенства. Третья, разнородная группа объяснений рассматривает широкий спектр политических мер и изменений установок, которые произошли с конца 1970-х годов. Создатели макроэкономической политики стали уделять больше внимания ценовой стабильности и меньше — вопросам занятости. Профсоюзы стали меньше, рабочие утратили договорную силу, стало опускаться отставание роста минимального размера оплаты труда от роста цен. Утратили влияние нормы трудовой этики, осуждавшие большой разрыв в оплате труда между самыми высоко- и низкоквалифицированными работниками. Дерегуляция и бурное развитие финансового сектора открыли такие возможности для обогащения, которые были немыслимы десятилетиями назад²⁶.

В итоге оказалось, что ни одна модель не в состоянии полностью объяснить динамику неравенства в США после 1970-х годов. Не нашлось и удачного способа оценить относительный вклад различных теорий. Некоторые теории (модели)

26. Lawrence Mishel, John Schmitt, and Heidi Shierholz, «Assessing the Job Polarization Explanation of Growing Wage Inequality», Economic Policy Institute, January 11, 2013, <http://www.epi.org/publication/wp295-assessing-job-polarization-explanation-wage-inequality>.

улучшили наше понимание механизмов, посредством которых на изучаемую проблему могли повлиять внешняя торговля, технологии и иные факторы. Благодаря неудаче других теорий мы убедились в непригодности ряда механизмов, которые на начальном этапе казались не менее убедительными. Окончательный вывод не сделан, но процесс нас многому научил.

На самом деле теории — просто модели

Как мы видели, в экономической науке теории либо столь всеобъемлющи, что слабо помогают в познании реального мира, либо столь узки, что ухватывают в лучшем случае один определенный срез действительности. Я показал этот парадокс на примере определенных теорий, но сказанное применимо и к другим областям экономической науки. История не была благосклонна к теоретикам, претендовавшим на открытие универсальных законов капитализма. В отличие от природы, капитализм сконструирован людьми и поэтому очень изменчив.

Однако если судить по частоте использования термина «теория», экономическая наука полна теорий. Есть теория игр, теория контрактов, теория поиска, теория роста, теория денег, и так далее. Но не позволяйте терминологии обмануть вас. На самом деле каждая из них — просто определенный набор идей, который следует применять разумно и с должным вниманием к изучаемой ситуации. Каждая служит скорее набором инструментов, чем универсальным объяснением изучаемого явления. Если не ждать от них большего, теории могут быть довольно полезными и релевантными.

Почти полвека назад Альберт Хиршман, один из самых творческих умов среди экономистов, пожаловался на обуявшую представителей общественных наук «тягу к теоретизированию», и описал, как поиск больших парадигм может стать «препятствием для понимания»²⁷. Он опасался, что тяга к всеобъемлющим теориям помешает ученым заметить роль случайности и разнообразия возможностей, с которыми их сталкивает реальный мир. Большая часть происходящего сегодня в экономической науке отражает стремление к более скромной цели: поиск объяснения для одной причины кряду. Когда амбиции затмевают эту цель, неприятности не заставляют себя долго ждать.

27. Albert O. Hirschman, «The Search for Paradigms as a Hindrance to Understanding», *World Politics* 22, no. 3 (April 1970): 329-43.

Когда экономисты ошибаются

НАВЕРНОЕ, эта речь выпускника была самой короткой за всю историю. Во время церемонии вручения дипломов Калифорнийского университета в Беркли в мае 2007 года макроэкономист Том Сарджент поднялся на подиум и сказал, что считает речи выпускников слишком длинными. И сразу перешел к делу. Экономическая наука, заявил он, «это организованный здравый смысл». Он зачитал список из 12 пунктов, которым «учит наша замечательная наука». Первым пунктом было «Многие желаемые вещи не осуществимы». Вторым — «Индивидам и сообществам приходится идти на компромиссы». В четвертом пункте Сарджент прошелся по роли государства: «Каждый реагирует на стимулы... Поэтому система социальной защиты не всегда работает так, как запланировано». Следующий пункт «Приходится искать компромисс между справедливостью и эффективностью» означал, что правительства могут улучшить распределение дохода только ценой некоторых экономических потерь¹.

Скорее всего, Сарджент не видел противоречий в своем списке. Действительно, его выступление

1. Thomas J. Sargent, «University of California at Berkeley Graduation Speech», May 16, 2007, https://files.nyu.edu/ts43/public/personal/UC_graduation.pdf.

одобрили бы экономисты обоих полюсов политического спектра. Но были и несогласные, например, экономист и блогер Ноа Смит. В этом списке, сетовал Смит, десять из двенадцати указаний Сарджента были «предостережениями против попыток силами государства бороться с неравенством или помогать людям». С критикой выступил также Пол Кругман. Он упрекнул Сарджента в попытке представить как универсальную истину идеи, применимые только к хорошо функционирующей рыночной экономике в условиях полной занятости. Возьмем наблюдение Сарджента о компромиссе между равенством и эффективностью. Смит писал, что на самом деле поступаться эффективностью не придется, если соблюдается одна из базовых предпосылок экономической науки (о том, что возможны такие трансферты между индивидами, которые не приведут к неэффективности). Кругман сослался на результаты недавних эмпирических исследований о том, что неравенство может затруднять экономический рост².

Критики тезисов Сарджента были правы. В экономической науке довольно мало непреложных истин, если исключить такие общие места, как «стимулы имеют значение» или «опасайся непредвиденных последствий». Все ценные уроки, которые преподносит «замечательная профессия», носят контекстуальный характер. Это формули-

2. Noah Smith, «Not a Summary of Economics», *Noahpinion* (blog), April 19, 2014, <http://noahpinionblog.blogspot.com/2014/04/not-summary-of-economics.html>; Paul Krugman, «No Time for Sargent», *New York Times Opinion Pages*, April 21, 2014, <http://krugman.blogs.nytimes.com/2014/04/21/no-time-for-sargent/?module=BlogPost-Title&version=Blog%20Main&contentCollection=Opinion&action=Click&pgtype=Blogs®ion=Body>.

ровки вида «если — то», в которых «если» значит не меньше, чем «то».

Вместе с тем Сарджент удачно обобщил типичные рассуждения *самих* экономистов. Пусть и за вычетом Смита и Кругмана, но большинство экономистов действительно верят, продолжая тот же пример, в неизбежность выбора между справедливостью и эффективностью. Заметьте, те же самые экономисты отлично знают, что определенные модели (и некоторые эмпирические свидетельства) говорят об обратном. Но существование этих данных никак не препятствует почти полному единодушию.

Есть много важных вопросов, по поводу которых сходятся во мнениях почти все экономисты. Несколько лет назад Грег Мэнкью, профессор Гарвардского университета и автор ведущего учебника экономики, привел целый список в своем блоге³. Вот некоторые ключевые пункты (значения в скобках обозначают долю экономистов, которые согласны с утверждением).

1. Введение потолка арендной платы снижает количество и качество доступного жилья (93%).
2. Пошлины и квоты на импорт обычно снижают общее экономическое благополучие (93%).
3. Гибкие и плавающие валютные курсы — эффективное средство регулирования международной валютной системы (90%).
4. Налоговая политика (например, снижение налогов и/или повышение государственных расходов) оказывает значительный стимулирующий

3. Greg Mankiw, «News Flash: Economists Agree», February 14, 2009, *Greg Mankiw's Blog*, <http://gregmankiw.blogspot.com/2009/02/news-flash-economists-agree.html>.

- эффект в экономике с уровнем занятости ниже полного (90%).
5. США не должны препятствовать работодателям переносить рабочие места в другие страны (90%).
 6. США должны отменить сельскохозяйственные субсидии (85%).
 7. Большой дефицит федерального бюджета негативно влияет на экономику (83%).
 8. Установление минимального размера оплаты труда повышает безработицу среди молодых и неквалифицированных работников (79%).

Степень согласия с этими утверждениями удивит вас лишь в том случае, если вы не читали предыдущие главы. Мы уже обсудили модели, которые противоречат по меньшей мере четырем пунктам из восьми. Если арендодатели действуют как монополисты, то контроль величины арендной платы (предельный размер платы, которую может взимать арендодатель) не обязательно ограничивает предложение жилья; ограничения внешней торговли не обязательно снижают эффективность; налоговые стимулы не всегда работают; введение минимального размера оплаты труда не всегда повышает безработицу. Для всех этих случаев предложены модели с несовершенной конкуренцией, несовершенными рынками или неполной информацией, которые приводят к противоположным результатам. То же верно для других утверждений в списке Мэнкью.

Экономическая наука говорит нам о том, каковы те явные условия — критически важные предпосылки, при которых верен данный вывод или обратный ему. Однако почти все опрошенные экономисты (90% или больше) оказались готовы поручиться за универсальную валидность определенного набора критически важных предпосылок.

Возможно, они идут на этот рискованный шаг, так как верят, будто эти предпосылки больше соответствуют реальному миру. Или они считают, что этот набор моделей «в среднем» работает лучше любого другого. Пусть так, но разве, как ученые, они не обязаны снабдить подобающими оговорками тезисы, в поддержку которых выступают? Не должно ли их беспокоить, что столь категоричные утверждения могут привести к ошибке?

Мы подошли к одному из центральных парадоксов экономической науки: единство среди разнородности. Экономисты работают со множеством моделей, выводы из которых сплошь и рядом противоречат друг другу. Однако их позиции по злободневным вопросам часто оказываются намного ближе, чем это можно ожидать на основании имеющихся свидетельств.

Позвольте внести ясность: экономисты постоянно ведут жаркие споры по множеству вопросов. Какой должна быть верхняя граница ставки подоходного налога? Нужно ли повышать минимальный размер оплаты труда? Способствуют ли патенты появлению инноваций? В этих и многих других вопросах экономисты часто видят аргументы и «за», и «против». Говорят, что президент Гарри Трумэн, разозленный противоречивыми и уклончивыми рекомендациями советников, сказал, что ему нужен «одноглазый экономист». Бернард Шоу, как считается, однажды сказал: «Даже если всех экономистов выстроить в одну линию, они все равно будут далеки от решения вопроса». Согласие между экономистами — скорее редкость, чем норма. А когда оно все же случается, необходимо остановиться и разобраться, что к чему.

Порой согласие вызывают безобидные соображения: да, стимулы имеют значение. Иногда скла-

дывается согласие относительно утверждений, адекватных в определенных географических или исторических обстоятельствах⁴: да, советская экономическая система была крайне неэффективна. В других случаях согласие отражает оценку факта, основанную на накопленных свидетельствах: да, введенные президентом Обамой в 2009 году налоговые стимулы снизили безработицу. Проблема возникает, когда становится всеобщей уверенность в универсальной правильности вывода из конкретной модели, критически важные предпосылки которой с высокой вероятностью не соблюдаются во множестве ситуаций (например, предпосылки совершенной конкуренции или совершенной информированности потребителей).

Когда экономисты путают одну модель с *единственной* моделью, это может привести к двум видам ошибок. Во-первых, это ошибки бездействия, когда появляется зона нечувствительности, мешающая увидеть надвигающиеся неприятности. Например, большинство экономистов не смогли заметить опасное стечение обстоятельств, приведшее к глобальному финансовому кризису 2007–2008 годов. Во-вторых, это ошибки действия, когда заикленность на определенном видении мира

4. Роджер Гордон и Гордон Даль сообщают об «общем согласии» группы экономистов с экономических факультетов ведущих вузов по весьма специфическим вопросам, таким как «новая политика федеральной резервной системы в 2011 году приведет к увеличению роста ВВП по меньшей мере на 1% к 2012 году». Они также обнаружили, что степень согласия выше, когда рассматриваемому вопросу уделяется много внимания в научной литературе. Gordon and Dahl, «Views among Economists: Professional Consensus or Point-Counterpoint?» *American Economic Review: Papers&Proceedings* 103, no. 3 (2013): 629–35.

заставляет экономистов рекомендовать такую государственную политику, провал которой можно предсказать задолго до ее начала. В эту категорию попадают выступления экономистов в защиту так называемого Вашингтонского консенсуса и финансовой глобализации. Рассмотрим оба типа ошибок подробнее.

Ошибки бездействия: финансовый кризис

Вскоре после того, как разразился финансовый кризис, ученый-юрист и экономист из Чикагского университета Ричард Познер подверг своих коллег-экономистов суровой критике. Он писал, что ведущие экономисты уверены: о повторении депрессии и речи быть не может, спекулятивные пузыри никогда не надуваются, глобальные банки надежны и устойчивы, а национальный долг США не дает оснований для беспокойства⁵. Но все эти представления оказались ошибочными. Пузырь строительного бума, лопнувший в 2008 году, обвалил тесно связанный с ним финансовый сектор США, так что для стабилизации сектора потребовалось масштабное государственное вмешательство. Кризис одновременно распространился в Европе и остальном мире, вызвав самый сильный экономический спад со времен Великой депрессии. Безработица в США достигла пика в 10% в октябре 2009 года и лишь к концу 2014 года сни-

5. Richard A. Posner, «Economists on the Defensive — Robert Lucas», *Atlantic*, August 9, 2009, <http://www.theatlantic.com/business/archive/2009/08/economists-on-the-defensive-robert-lucas/22979>.

зилась до 5,6%. Когда я пишу эти слова в конце 2014 года, в странах Еврозоны остается безработным почти каждый четвертый молодой работник.

Еще до кризиса состояние экономики США беспокоило многих экономистов. Но беспокойство вызывали прежде всего низкая норма сбережений и непомерный дефицит счета текущих операций (большое превышение импорта над экспортом). Когда рассматривались сценарии так называемой жесткой посадки, в центре внимания была возможность резкого ослабления доллара США, что вновь разогнало бы инфляцию и подорвало бы доверие к американской экономике. Однако кризис ударил там, где этого ожидали очень немногие. Самым уязвимым местом экономики США оказался рынок жилья и раздувшийся финансовый сектор, который накачивал его деньгами.

Слабо регулируемый теневой банковский сектор породил множество новых аббревиатур, обозначающих новые финансовые инструменты. Предполагалось, что новые производные инструменты перераспределяют риски к тем, кто готов за них платить. Вместо этого они упростили проведение рискованных сделок и злоупотребление операциями с кредитным плечом. Они также создали связи между разрозненными сегментами экономики, которые тогда никто в полной мере не осознавал, и в результате кризис на одном конце привел к коллапсу на другом. За немногими, хотя и заметными, исключениями, такими как будущий нобелевский лауреат Роберт Шиллер и будущий глава Центрального банка Индии чикагский экономист Рагу Раджан, экономисты проглядели масштаб проблем в секторах жилья и финансов. Шиллер давно указывал на чрезмерную волатильность стоимости активов, делая особый акцент на пузыре цен на жи-

лье⁶. Раджана беспокоила обратная сторона того, что тогда превозносили как «финансовые инновации»; он уже в 2005 году предупреждал, что банкиры идут на излишний риск, по поводу чего удостоился прозвища «луддит» от Ларри Саммерса, тогдашнего президента Гарвардского университета⁷.

Не вызывает сомнений, что экономисты в целом прозевали кризис. Многие интерпретируют это как признак полного упадка экономической науки. Дисциплина нуждается в переосмыслении и перестройке. Однако этот эпизод особенно любопытен тем, что на самом деле есть множество моделей, способных объяснить происходящее «под капотом» экономики.

Пузыри — периоды устойчивого роста стоимости активов без связи с их базовой ценностью — явление не новое. Они были известны со времен тюльпанной лихорадки XVII века и пузыря «Компании Южных морей» начала XVIII века. Они рассматривались в моделях различной сложности, включая модели на основе предпосылки о наличии полностью рациональных дальновидных инвесторов (так называемые рациональные пузыри). Финансовый кризис 2008 года обладал всеми признаками банковской паники, а эта тема тоже находится в ведении экономической науки. Модели самореализую-

6. Robert Shiller, *Irrational Exuberance*, 2nd ed. (Princeton, NJ: Princeton University Press, 2005).

7. Raghuram G. Rajan, «The Greenspan Era: Lessons for the Future» (заметки к симпозиуму, проходившему под спонсорством Федерального резервного банка Канзас-Сити в г. Джексон-Хол, штат Вайоминг, 27 августа 2005 года), <https://www.imf.org/external/np/speeches/2005/082705.htm>; Charles Ferguson, «Larry Summers and the Subversion of Economics», *Chronicle of Higher Education*, October 3, 2010, <http://chronicle.com/article/Larry-Summersthe/124790>.

щейся паники (провала координации, при котором закрытие кредитных линий, рациональное на индивидуальном уровне, приводит к системному дефициту ликвидности — состоянию, нерациональному на коллективном уровне) были хорошо известны изучавшим экономику, равно как условия, способствующие возникновению паники. Во всех учебниках финансов отмечалась необходимость страхования вкладов (в сочетании с государственным регулированием) для предотвращения банковской паники.

Основной вклад в развитие кризиса внесло излишне рискованное поведение управляющих финансовых институтов. От этого зависел размер их компенсаций, но их поведение не соответствовало интересам акционеров банков. Разрыв между интересами управляющих и акционеров — центральный элемент в моделях принципал-агент. Эти модели рассматривают ситуации, когда «принципал» (регулятор, избиратели или акционеры) пытается контролировать действия «агента» (регулируемой фирмы, избранного правительства или высшего менеджмента корпорации). Появление в этом процессе затруднений и потеря эффективности не должны были стать сюрпризом для экономистов. Другой источник искажения стимулов был связан с деятельностью кредитных рейтинговых агентств, которые оценивали пулы секьюритизированных ипотек. Работу агентств оплачивали те же самые финансовые институты, чьи ценные бумаги они оценивали. Наличие у них стимулов к завышению рейтингов в угоду хозяевам должна была быть очевидной даже для экономиста-первокурсника.

Затрагивающие всю экономику последствия падения стоимости активов тоже не были в новинку экономистам после волны финансовых кризисов

в развивающихся странах с самого начала 1980-х годов. Никто из изучавших эти эпизоды не должен был равнодушно наблюдать за нарастанием долгов частных лиц и корпораций в сфере жилой недвижимости и строительства в США и Европе. Последствия распродажи активов для снижения долга, прокатившиеся по всей экономике и нараставшие по мере того, как банки, фирмы и домохозяйства одновременно пытались снизить свою задолженность и накопить финансовые активы, тоже напоминали предшествующие финансовые кризисы.

Не недостаток моделей помешал экономистам понять, что происходит. На самом деле к началу кризиса рассмотренные выше модели уже доказали свою незаменимость для понимания того, почему, например, решение Китая накопить большие объемы золотовалютных резервов в итоге побуждает владельца ипотеки в Калифорнии принимать на себя чрезмерные риски. Все промежуточные этапы (из-за роста спроса на долларовые активы снижается процентная ставка; стремление сохранить прежний уровень прибыли побуждает недостаточно контролируемые финансовые институты искать более рискованные инструменты; расширение инвестиционных портфелей за счет краткосрочных займов повышает уязвимость финансовой системы; акционеры не способны держать в узде вышший менеджмент банков; надувается пузырь цен на жилье) легко объяснимы в рамках существующих концепций. Но экономисты излишне полагались на одни модели в ущерб другим, что привело к большим проблемам.

Многие из предпочитаемых моделей строились вокруг «гипотезы эффективных рынков»⁸. Гипо-

8. Eugene F. Fama, «Efficient Capital Markets: A Review of Theo-

тезу сформулировал Юджин Фама, чикагский профессор финансов, впоследствии получивший Нобелевскую премию — как ни странно, в один год с Робертом Шиллером. Если коротко, в ней говорится, что рыночные цены отражают всю доступную продавцам информацию. Для индивидуального инвестора из гипотезы эффективных рынков следует невозможность играть против рынка без доступа к инсайдерской информации. Для руководителей центральных банков и финансовых регуляторов гипотеза эффективных рынков — предупреждение о бесплодности попыток направить рынок в том или ином направлении. Поскольку вся релевантная информация уже содержится в рыночных ценах, любое вмешательство скорее нарушит работу рынка, нежели скорректирует ее.

Гипотеза эффективных рынков не предполагает, что наблюдатели могли предсказать финансовый кризис. На самом деле, поскольку в ней стоимость активов считается непредсказуемой, из нее следует прямо противоположное: кризис *не* мог быть предсказан. Тем не менее модель как-то не бьется с реальностью: за длительным ростом цен активов последовал резкий спад. Чтобы объяснить его, не отказываясь от гипотезы эффективных рынков, нужно поверить, что финансовый коллапс был вызван наплывом «плохих новостей» о перспективах экономики, которые рынки мгновенно транслировали на уровень цен. (Примерно об этом говорил сам Фама в 2013 году⁹). Этот вывод разворачивает

ry and Empirical Work», *Journal of Finance* 25, no. 2 (May 1970): 383–417.

9. Фама признает, что не видит причины для столь радикального ухудшения экономических перспектив, но добавляет, что он не макроэкономист, а макроэкономика никогда не блистала умением предсказывать наступление

общепринятое представление о причинах и следствиях, которое говорит о переходе от финансового кризиса к общей рецессии.

Чрезмерное внимание к гипотезе эффективных рынков в ущерб моделям пузырей и других патологий финансового рынка выдает наличие у экономистов ряда предубеждений более общего характера. Финансовым рынкам стали приписывать огромные возможности. Дошло до того, что рынки стали считать двигателем общественного прогресса. Они не просто служат эффективными посредниками между сберегателями и инвесторами; они также распределяют риск, направляя его к тем, кто лучше прочих мог с ним справиться, и предоставляют кредит домохозяйствам, в том числе бедным или не имеющим кредитной истории, которые ранее не имели доступа к средствам. Финансовые инновации позволяют держателям портфелей получить максимальную прибыль при минимальном риске.

Более того, рынки стали рассматриваться не только как неизменно эффективные и устойчивые, но и как саморегулирующиеся. Если крупные банки ввяжутся в махинации, рынки заметят это и накажут их. Инвесторы, принявшие неудачные решения и идущие на излишние риски, будут вытеснены с рынка; ведущие себя ответственно будут вознаграждены за свое благоразумие. Глава Федеральной резервной системы Алан Гринспен, выступая в 2008 году перед комиссией конгресса с признанием своей персональной вины, красноречиво и пространно описывал умонастроения большинства экономистов; он признался, что «те из нас,

рецессий. John Cassidy, «Interview with Eugene Fama», *New Yorker*, January 13, 2010, <http://www.newyorker.com/news/john-cassidy/interview-with-eugene-fama>.

кто считали, что эгоистический интерес кредитных институтов стоит на страже капитала акционеров, пребывают в состоянии потрясенного неверия в происходящее»¹⁰.

Напротив, государство доверия не вызывало. Чиновники и регуляторы обслуживали определенные интересы или были некомпетентны — или и то, и другое вместе. Чем меньше они делали, тем лучше. Все равно финансовые рынки достигли такой сложности, что всякая попытка регулировать их оказывалась бесплодной. Финансовые институты всегда находили способ обойти правила. Правительство было обречено плестись на шаг позади. Подобные настроения среди экономистов легитимизировали и сделали возможной мощную волну финансовой дерегуляции, заложившей основания для кризиса. И никого не удивляло, что эти взгляды разделяют некоторые из самых высокопоставленных правительственных экономистов, такие как Ларри Саммерс и Алан Гринспен.

В общем, экономисты (и те, кто к ним прислушивался) чрезмерно уверились в правильности преобладавших на тот момент моделей: рынки эффективны, финансовые инновации улучшают соотношение уровня риска и доходности, саморегулирование работает превосходно, а вмешательство правительства неэффективно и вредно. О других моделях они забыли. Слишком многие мыслили как Фама, и слишком немногие — как Шиллер. С экономическими основаниями профессии все было отлично, но имелись очевидные проблемы с ее психологией и социологией.

10. Edmund L. Andrews, «Greenspan Concedes Error on Regulation», *New York Times*, October 23, 2008, http://www.nytimes.com/2008/10/24/business/economy/24panel.html?_r=0.

Ошибки действия: Вашингтонский консенсус

В 1989 году Джон Уильямсон проводил в Вашингтоне конференцию высокопоставленных представителей правительственных структур Латинской Америки. В качестве экономиста Института международной экономики — экспертной организации при правительстве (теперь она называется «Институт мировой экономики Петерсона») Уильямсон долгое время изучал экономики этого региона. Он отметил поразительное единство представлений политиков по поводу реформ, рекомендуемых странам Латинской Америки. Практически идентичные идеи поступали от международных финансовых институтов, таких как Всемирный банк и Международный валютный фонд, и от различных экономических агентств при правительстве США. Экономисты с дипломами американских университетов тогда занимали важные посты в правительствах Латинской Америки и поспешно проводили именно такую экономическую политику. В написанной для конференции статье Уильямсон назвал повестку этих реформ «Вашингтонским консенсусом»¹¹.

Термин прижился — и начал жить своей собственной жизнью. Он стал обозначать претенциозную программу, которая, как отмечали критики, стремилась превратить развивающиеся страны в хрестоматийные примеры экономик, основан-

11. John Williamson, «A Short History of the Washington Consensus» (исследование оп заказу Fundación CIDOB к конференции «From the Washington Consensus towards a New Global Governance» в Барселоне 24–25 сентября 2004 года).

ных на свободном рынке. Возможно, это гипербола, но она точно описывает общую тенденцию. Программа отражала стремление освободить эти экономики от ограничений государственного регулирования. Специалисты по экономической политике в Латинской Америке и их советники в Вашингтоне были убеждены, что именно вмешательство правительства подавило экономический рост и спровоцировало долговой кризис 1980-х годов. Формулу лекарства можно выразить в трех словах: «стабилизировать, приватизировать и либерализировать». Впоследствии Уильямсон многократно оспорит эту трактовку, говоря, что его список описывал умеренные реформы, далекие от «рыночного фундаментализма» — общего термина для представления о рынках как о решении всех проблем публичной политики. Но термин «Вашингтонский консенсус» очень уж хорошо соответствовал сути времени.

Сторонники «Вашингтонского консенсуса» — в исходной или расширенной версии — представляли его как образцовое направление экономической науки. Они полагали, что проводимая политика отражает именно то, чему учит «правильная» экономическая наука: свободные рынки и конкуренция обеспечивают эффективное размещение ограниченных ресурсов. Государственное регулирование, ограничения внешней торговли и государственная форма собственности создают убытки и затрудняют экономический рост. Но эта версия экономики не выходила за пределы того, о чем говорится в базовых учебниках, — и ее сторонники просто обязаны были это знать.

Одна из проблем состояла в том, что «Вашингтонский консенсус» обходил вопрос о более глубоких институциональных основаниях рыночной эко-

номики, без которых ни одна из рыночно-ориентированных реформ не могла с надежностью привести к намеченным благотворным результатам. Возьмем простейший пример: в отсутствие верховенства закона, соблюдения контрактов и достаточно развитого антимонопольного законодательства вероятным исходом приватизации может стать как стимулирование конкуренции и обеспечение эффективности, так и создание монополий в интересах коррумпированных политиканов. По мере осознания важности институтов (после слабых результатов политики в духе «Вашингтонского консенсуса» во многих странах) их начали учитывать в программах реформ. Но одно дело обнулить ввозные пошлины или отменить верхний порог процентных ставок и совсем другое — оперативно выстроить институты, которые в развитых экономиках складывались десятилетиями, если не веками. Пользу принесет та программа реформ, которая не станет выдавать желаемое за действительное, а будет работать с имеющимися институтами.

Кроме того, «Вашингтонский консенсус» предлагал универсальный рецепт. Предполагалось, что все развивающиеся страны довольно похожи — страдают от похожих недугов и нуждаются в одинаковом наборе реформ. Местный контекст почти не учитывался, равно как необходимость ранжировать предлагаемые реформы по степени безотлагательности и выполнимости. Когда страны одна за другой не давали нужного ответа на реформы, первым побуждением сторонников реформ было расширение списка рекомендаций — вместо того чтобы попытаться скорректировать уже запущенные реформы. В итоге первоначальная версия «Вашингтонского консенсуса» дополнилась растущим перечнем дополнительных мер в отношении рын-

ков труда, стандартов финансовой деятельности, государственного управления, правил работы центральных банков и тому подобного¹².

Экономисты, продвигавшие принципы «Вашингтонского консенсуса», забыли о том, что действуют в исконно неоптимальном мире «второго наилучшего». Как говорилось в главе 2, в среде, где рынки подвержены множественным несовершенствам, привычные представления о результатах экономической политики могут подвести. Приватизация, дерегуляция и либерализация торговли — все эти меры могут иметь непредвиденные последствия. Могут потребоваться определенного рода ограничения рынков. Реформы экономической политики в таких средах требуют использовать модели, которые в явном виде учитывают препятствия, связанные с существованием «второго наилучшего решения».

Рассмотрим, как предположительно должно было работать снятие ограничений во внешней торговле — один из ключевых пунктов программы «Вашингтонского консенсуса». После снятия барьеров фирмы, неспособные конкурировать с иностранными предприятиями, сократят выпуск или будут ликвидированы, освобождая ресурсы (работников, капитал, управляющих) для использования в других частях экономики. В то же время более эффективные, способные конкурировать с иностранцами сектора будут расширяться, поглощая высвободившиеся ресурсы и создавая условия для ускорения экономического роста. В странах Латинской Америки и Африки, применивших

12. Dani Rodrik, «Goodbye Washington Consensus, Hello Washington Confusion?: A Review of the World Bank's *Economic Growth in the 1990s: Learning from a Decade of Reform*», *Journal of Economic Literature* 44, no. 4 (December 2006): 973–987.

эту стратегию, первую часть плана в значительной степени удалось реализовать, чего не скажешь о второй. Основной удар пришелся на промышленные предприятия, ранее защищенные от импорта торговыми барьерами. При этом развитие новых экспортно ориентированных видов деятельности, основанных на современных технологиях, запаздывало. Вместо этого работники массово перетекали в менее производительные неформальные сектора, такие как мелкая торговля. Совокупная производительность снизилась.

Что же произошло? Многие из затронутых рынков не работали так, как предполагалось. Рынки труда не обладали достаточной гибкостью, чтобы быстро переместить трудовые ресурсы в новые, более эффективные сектора. Рынки капитала не сумели оказать поддержку появлению экспортно ориентированных фирм. Национальная валюта оставалась переоцененной, что делало промышленность неспособной к глобальной конкуренции. Провалы координации, утечка знаний и высокие издержки выхода на новые рынки мешали потенциальным игрокам закрепиться в новых областях, дающих сравнительные преимущества. А правительства, связанные недостатком наличных средств, были неспособны инвестировать в развитие инфраструктуры или оказать другие виды поддержки молодым предприятиям.

Результаты применения принципов «Вашингтонского консенсуса» резко контрастировали с опытом азиатских стран. Последние осуществляли стратегии включения в глобальную торговлю, явно исходящие из принципов «второго наилучшего». Вместо поспешной либерализации внешней торговли Южная Корея, Тайвань и затем Китай начали развивать свой экспорт с помощью прямого

субсидирования отечественных производителей. Неэффективные предприятия получали защиту на начальных стадиях перехода, чтобы предотвратить масштабные сокращения, которые с высокой вероятностью привели бы к расширению наименее производительных неформальных сфер деятельности, таких как розничная торговля. Эти страны также прибегали к макроэкономическим и финансовым способам регулирования, чтобы сохранить конкурентоспособность своих валют на мировых рынках. Все они проводили промышленную политику, нацеленную на развитие новых отраслей промышленности и снижение зависимости экономик от природных ресурсов. И в каждой стране стратегия не ограничивалась этими общими принципами, а была точно подстроена под ее особенности.

Многие изучавшие опыт Азии и успех этих «неортодоксальных» политик приходили к выводу, что данные случаи доказывают ошибочность положений стандартной экономической науки. Эта интерпретация ошибочна. Действительно, многие меры экономической политики азиатских стран лишены смысла в рамках экономических моделей, предполагающих идеальное функционирование рынков. Но эти модели явно не годились для использования в данных обстоятельствах. Очень малая часть стратегий Китая или Южной Кореи не могла быть объяснена с помощью моделей, которые учитывают значительные проблемы, связанные с действием принципа «второго наилучшего», с которыми сталкивались эти страны¹³. Эти аль-

13. Dani Rodrik, «Getting Interventions Right: How South Korea and Taiwan Grew Rich», *Economic Policy* 10, no. 20 (1995): 53–107; Rodrik, «Second-Best Institutions», *American Economic Review* 98, no. 2 (May 2008): 100–104.

тернативные модели оказываются незаменимыми в случаях, когда экономисты имеют дело с тем, как на самом деле работают — или не работают — рынки (малочисленность фирм в условиях низких доходов населения, труднопреодолимые входные барьеры, низкая информированность, неработоспособные институты).

Сфера, в которой экономистам удалось дальше всего продвинуться в реализации идей «Вашингтонского консенсуса» — и нанести наибольший ущерб, стала финансовая глобализация. Первоначальный список Уильямсона не включал снятие трансграничных ограничений на движение капитала; Уильямсон скептически относился к возможным преимуществам финансовой глобализации. Однако к середине 1990-х годов уничтожение барьеров для свободного движения капитала по всему миру рассматривалось как последний рубеж, который должны преодолеть все рыночные экономики. Снятие ограничений на движение капитала между странами стало предварительным условием членства в Организации экономического сотрудничества и развития (ОЭСР) — клубе богатых стран. А ведущие экономисты Международного валютного фонда (МВФ) стремились закрепить принцип свободного движения капитала в основах деятельности этой организации.

В основе всей этой активности лежали идеи выдающихся экономистов, таких как Стэнли Фишер, тогда профессор Массачусетского технологического университета. Фишер начал работать в МВФ в 1994 году в должности заместителя управляющего директора и ведущего экономиста. Он прекрасно знал, что либерализация движения капитала через национальные границы может привести к нестабильности. История существования свободного ка-

питала предоставляла достаточно поводов для опасений. Именно финансовые эксцессы предыдущего (между Первой и Второй мировыми войнами) периода финансовой глобализации — повторяющиеся финансовые паники и крахи, болезненные периоды адаптации экономики к внезапным переменам настроения участников рынка и крайне ограниченные возможности управлять взлетами и падениями макроэкономики — имел в виду Кейнс, когда в конце Второй мировой войны призывал установить контроль над движением капитала.

Фишер не забыл об этих рисках; он просто считал, что на них стоит пойти. Свободное движение капитала обеспечит более эффективное глобальное размещение сбережений. Капитал двинется оттуда, где он в избытке, туда, где его не хватает, тем самым ускоряя экономический рост. Резиденты бедных стран получают доступ и к большему разнообразию инвестиционных активов, и к рынкам иностранного капитала, что позволит им диверсифицировать инвестиционные портфели. В то же время риски дестабилизации можно снизить, совершенствуя управление макроэкономикой и повышая качество финансового регулирования¹⁴. Фишер признавал недостаточность систематических данных в поддержку идеи о пользе большей мобильности капитала для развивающихся стран, но считал, что получение таких данных — лишь вопрос времени.

Модель, неявно лежащая в основании идей Фишера, как и многие другие, значительно преуменьшала роль сложностей, обусловленных действием

14. Stanley Fischer, «Capital Account Liberalization and the Role of the IMF», September 19, 1997, <https://www.imf.org/external/np/speeches/1997/091997.htm#1>.

принципа «второго наилучшего». Он предполагал, что дефекты национальной макроэкономики и регулирования возможно преодолеть при наличии достаточной политической воли. В реальности осуществить подобные изменения оказалось куда сложнее, отчасти потому, что экономисты, собственно говоря, плохо представляют себе, что именно нужно делать. Выяснилось, что свободное движение капитала в сочетании с внутренними макроэкономическими и финансовыми нарушениями приводит к чрезвычайно неблагоприятным последствиям. Доступ к рынкам иностранного капитала позволял отечественным банкам наращивать краткосрочный внешний долг, а неосмотрительным правительствам — заимствовать куда больше, чем на внутренних рынках. Результатом стала полоса болезненных кризисов в Таиланде, Южной Корее, Индонезии, Мексике, России, Аргентине, Бразилии, Турции и других странах. В конечном счете МВФ пришел к выводу, что полная либерализация движения капитала не является той целью, к которой стоит стремиться всем без исключения странам¹⁵.

Была и другая проблема. Сторонники финансовой глобализации придерживались модели роста, в которой главным двигателем было предложение сбережений и инвестиционных фондов. В этой модели считалось, что расширение доступа к иностранному финансированию должно стимулировать внутренние инвестиции и обеспечить ускорение экономического роста. Однако в раз-

15. «The Liberalization and Management of Capital Flows: An Institutional View», International Monetary Fund, November 14, 2012, <http://www.imf.org/external/np/pp/eng/2012/111412.pdf>.

вивающихся странах, которые сняли ограничения на доступ к иностранному капиталу, не выросли ни инвестиции, ни темпы роста. Отсутствие позитивной динамики инвестиций и темпов роста означало, что причина низкого экономического роста кроется в чем-то другом. Фирмы не инвестировали не потому, что не имели доступа к средствам, а потому, что (по самым разным причинам) не видели перспектив окупаемости вложений. Усилившийся приток капитала стимулировал не инвестиции, а потребление. Более того, приток капитала даже ухудшал положение, поскольку завышал курс национальной валюты, что еще больше снижало прибыльность отраслей, которые потенциально могли бы работать на экспорт. Такая альтернативная модель явно более точно описывает реальное положение дел во многих развивающихся странах и в странах с переходной экономикой, и в ней свободное движение капитала выступает губительным «подарком».

Хорошие новости состоят в том, что большинство экономистов вынесли из этого опыта полезные уроки. В наши дни принято считать, что в случае и «Вашингтонского консенсуса», и финансовой глобализации имело место усердие не по разуму в применении универсального подхода, переоценивающего преимущества нерегулируемых рынков. Сегодня утверждение о том, что нет такого набора мер экономической политики, который подходил бы для любой страны, и что реформы должны адаптироваться к конкретным обстоятельствам, стало практически мантрой для специалистов по экономике развития, финансовых экспертов и международных агентств. «Типовые проекты» реформ больше не актуальны; выбор моделей актуален как никогда.

Психология и социология экономики

Есть ли в экономической науке что-то особенное, что делает ее представителей более подверженными ошибкам бездействия и действия? Например, могут ли политологи и антропологи претендовать на то, что их дисциплины показали себя лучше в общественных дебатах? Я в этом не уверен. Одно из различий состоит в том, что экономистов лучше видно. Поскольку многие экономисты подвизаются в сфере публичной политики и к ним обращаются за советами по поводу экономической политики, их ошибки (в случае появления таковых) более заметны. Тем не менее стоит поразмыслить о том, что заставляет экономистов заблуждаться.

Для начала давайте признаем, что общественность редко получает информацию обо всем спектре мнений внутри экономической науки. Подавляющее большинство экономистов видит себя учеными и исследователями, чья работа заключается в написании научных статей, а не в разглашательствах о текущих событиях или в защите определенных политических мер. К ним редко обращаются журналисты или эксперты Конгресса, да и случись такое, они бы уклонились от разговора. Когда они захотят принять участие в обсуждении общественно значимых вопросов, то формулируют свое мнение со столь многочисленными оговорками, что не находится желающих прислушаться к их словам. Большинство экономистов — настоящие кабинетные ученые, которые с готовностью признаются, что недостаточно компетентны, чтобы комментировать вопросы государственной политики, по крайней мере, без дополнительного погружения в вопрос.

Хорошо слышны голоса тех экономистов, которые либо в чем-то твердо убеждены, либо готовы пренебречь множеством мелких, но важных подробностей в рекомендациях по экономической политике. Либо то и другое одновременно. Именно у них есть однозначное мнение по обсуждаемым вопросам, и они закономерно пользуются большим вниманием у СМИ, правительственных экспертов и в коридорах власти. Зачастую они оказываются успешными «предпринимателями от экономической политики» и изменяют мир к лучшему ради общего блага. Аукционы по распределению частот беспроводной связи и дерегуляция авиаперевозок — идеи, которые политики приняли благодаря усилиям убежденных в их правильности экономистов¹⁶. В других случаях, как мы видели, распиаренные идеи бывают более сомнительными, и утверждения их сторонников принимаются с большим скептицизмом или даже отвергаются большинством представителей профессии. Но лишь немногие критики из числа экономистов сочтут нужным делать публичные заявления на этот счет.

На пике увлечения идеями «Вашингтонского консенсуса» я вместе с одним аспирантом написал статью, которая подвергала критике безоговорочное принятие либерализации внешней торговли как способа обеспечить экономический рост в развивающихся странах¹⁷. Мы отмечали, что характер связи между торговой политикой и ростом зависел

16. Edward López and Wayne Leighton, *Madmen, Intellectuals, and Academic Scribblers: The Economic Engine of Political Change* (Stanford, CA: Stanford University Press, 2012).

17. Francisco Rodríguez and Dani Rodrik, «Trade Policy and Economic Growth: A Skeptic's Guide to the Cross-National Evidence», in *Macroeconomics Annual 2000*, eds. Ben Ber-

от используемой модели и рассматриваемой страны. Мы также указывали на отсутствие скольконибудь убедительных или единообразных доказательств. После обсуждения и представления статьи я получал отзывы двух видов. Убежденные сторонники «Вашингтонского консенсуса» считали, что я зря мутил воду и мешал полезному делу либерализации внешней торговли. Но многие другие выражали признательность и жаловались, что давление сторонников либерализации торговли выходит далеко за пределы того, чему имеется обоснование в экономических исследованиях. Второй вид отзывов оказался для меня неожиданным, так как они поступали от людей, не участвующих в публичных дискуссиях. Несмотря на свой скептический настрой, они предпочитали не высказываться вслух. В результате информация для публики не отражала позицию всей дисциплины, которая на самом деле была далеко не столь однозначной.

Безусловно верно, что экономисты говорят о рынках лучше, чем следует. Попросту говоря, экономистами движут собственнические чувства. Они думают, что понимают, как работают рынки, и опасаются, что этого не понимает большая часть публики, причем оба эти предположения в значительной степени верны. Они знают, что провалы рынков могут принимать самые разнообразные формы, но считают, что общественность зачастую неверно информирована и преувеличивает масштабы проблем или необоснованно сомневается, так что они склонны чрезмерно защищать рынки. Предложение и спрос, рыночная эффективность, сравнительные преимущества, стимулы — все эти

nanke and Kenneth S. Rogoff (Cambridge, MA: MIT Press for NBER, 2001).

«коронные бриллианты» нашей профессии нуждаются в защите от невежественных масс. Ну или так принято считать.

Превознесение роли рынков в общественных дискуссиях сегодня почти вошло в профессиональную обязанность экономиста. Поэтому публичные выступления экономистов могут разительно отличаться от их же высказываний во время обсуждений внутри профессии. В кругу коллег недостатки рынков и способы улучшить положение дел с помощью экономической политики — законный предмет обсуждения. Именно новые и впечатляющие демонстрации провалов рынка создают их авторам репутацию в науке. Однако на публике экономисты склонны смыкать ряды и поддерживать свободные рынки и свободу торговли.

В результате возникает то, что я называю синдромом «варвар всегда неправ». Те, кто хочет ограничить рынки — организованные лоббисты, коррумпированные политики и им подобные, тогда как те, кто хочет освободить рынки, даже когда ошибаются, — имеют добрые намерения и поэтому намного менее опасны. Принимающий сторону первых подкрепляет позиции варваров, а принимающий сторону вторых в худшем случае добросовестно заблуждается без особого вреда делу.

При необходимости занять определенную позицию большинство экономистов скорее отдадут голоса той альтернативе, которая больше ориентирована на рынок. Мы можем видеть проявления этой склонности в приведенном в начале этой главы списке утверждений, с которыми согласно подавляющее большинство экономистов¹⁸. Из четырнадцати пунктов полной версии этого перечня

18. Mankiw, «News Flash: Economists Agree».

только один (о пользе налоговых стимулов в период рецессии) явно отдает предпочтение активным действиям государства¹⁹. Еще несколько пунктов отражают предпочтение других вариантов государственной политики: бюджет должен быть сбалансирован в пределах делового цикла, а не ежегодно; выплаты наличными предпочтительнее прочих форм помощи, в том числе бесплатного питания; систему социальной защиты нужно заменить «негативным подоходным налогом» (системой прогрессивного налогообложения, в которой бедные домохозяйства получают выплаты из бюджета). Почти все рекомендации предполагают большую опору на рынки и меньшее вмешательство государства.

Помимо очевидного предубеждения в пользу рынков, экономистам не всегда удается выстроить связи между моделями и реальным миром. Поскольку все экономисты проходят через примерно одинаковое обучение и пользуются едиными методами анализа, их деятельность сильно напоминает цеховую организацию. Модели могут быть продуктом анализа, размышлений и наблюдений, но представления экономистов-практиков о реальном мире складываются намного более эвристическим путем, как побочный продукт неформальных обсуждений и социализации в кругу себе подобных. Подобная замкнутость вскоре приводит

19. Сообщается, что 90% экономистов согласны со следующим утверждением: «налоговая политика (например, снижение налогов и/или повышение государственных расходов) оказывает значительный стимулирующий эффект в экономике с уровнем занятости ниже полного». Greg Mankiw, «News Flash: Economists Agree», February 14, 2009, *Greg Mankiw's Blog*, <http://gregmankiw.blogspot.com/2009/02/news-flash-economists-agree.html>.

к чрезмерной уверенности в правильности воспринятого знания или актуальной модели. Тем временем цеховое мышление делает профессию изолированной и невосприимчивой к критике извне. У моделей могут быть недостатки, но обсуждать их вправе только члены цеха. Возражения чужаков не принимаются в расчет, поскольку они не разбираются в моделях. Приоритеты нашей профессии таковы, что изящество построений ценится выше проницательности, занимательность — выше правильности, и поэтому модные тенденции и увлечения не проходят сами по себе.

Проблемы усугубляет тот факт, что общепринятая практика не требует от экономистов изучать, при каких обстоятельствах их модели могут оказаться полезными. Если спросить экономиста напрямую, он сможет до мельчайших подробностей воспроизвести предпосылки, соблюдение которых необходимо для получения определенного результата; в конце концов, в этом и есть сущность моделирования. Но спросите, какой стране подходит выбранная модель — Таиланду или Боливии, или какому рынку она больше соответствует — рынку услуг кабельного телевидения или рынку апельсинов, и им будет очень непросто дать внятный ответ. Стандарты профессии требуют, чтобы при создании модели были сделаны лишь самые общие утверждения о ее релевантности реальному миру. Определение конкретных обстоятельств, в которых модель может помочь в понимании действительности, остается на долю читателя или пользователя²⁰. Наличие такого «поправочного

20. Экономист из Университета Восточной Англии Роберт Сагден отмечает: «В экономической науке... принято считать, что создателю модели нет необходимости

коэффициента» повышает вероятность неправильного использования моделей. Вырванные из первоначального контекста, модели могут быть использованы там, где это неуместно.

Парадоксально, но эти проблемы даже более выражены в эмпирически ориентированных направлениях экономической науки, где почти все экономисты непосредственно работают с данными и свидетельствами из реального мира. Причина в том, что основополагающая модель зачастую не прописывается в явном виде на первом шаге. Эмпирическая природа анализа заставляет думать, что мы узнали что-то большее, чем на самом деле. Многие эмпирические исследователи полагают, что в их работе модели вовсе не нужны. В конце концов, они ведь просто изучают, как что-то работает или является ли фактор *A* причиной события *B*. Но за любыми утверждениями о причинно-следственных связях стоит определенная модель. Например, почему более высокий уровень образования приводит к более высокому заработку: из-за отдачи от образования как актива или из-за того, что образование стимулирует усерднее трудиться, что тоже приводит к более высокому заработку?²¹ Четкая формулировка модели проясняет природу получаемых с ее помощью результатов, а также подчеркивает их ситуационно обусловленный характер. Когда модель выведена в явном виде, мы

в явном виде обозначать, что именно его модель говорит нам о реальном мире». Sugden, «Credible Worlds, Capacities and Mechanisms» (unpublished paper, School of Economics, University of East Anglia, August 2008), 18.

21. Mark R. Rosenzweig and Kenneth I. Wolpin, «Natural „Natural Experiments“ in Economics», *Journal of Economic Literature* 38, no. 4 (December 2000): 827–74.

можем увидеть, от чего зависят результаты и можно ли распространить их на другие случаи.

Как мы видели, некоторые из самых интересных прикладных исследований сегодня проводятся в формате рандомизированных полевых экспериментов, когда исследователь проверяет, приводят ли определенные меры экономической политики к намеченным результатам. Предполагается, что эти эксперименты непосредственно демонстрируют, как устроен реальный мир, — в одних конкретных обстоятельствах. Но они опять-таки ничего не говорят о том, при каких именно условиях применимы результаты эксперимента — и в каких случаях нам не следует ожидать их применимости. Они могут легко создать впечатление, будто результаты носят обобщенный характер, тогда как на самом деле они сугубо контекстуальны.

Итоговый вывод заключается в том, что практики и профессиональные предубеждения экономистов дают богатую почву для обсуждений. Но создают ли эти недостатки непреодолимые проблемы, которые делают всю дисциплину внутренне ущербным подходом к изучению общества? Я так не думаю.

Власть и ответственность

Почему экономисты вообще получают столь много власти за пределами учебных аудиторий? Такой расклад совсем не очевиден, ибо большинство практикующих экономистов вполне удовлетворяются написанием научных статей для других экономистов и не стремятся к подобной власти.

Две тесно связанные причины предполагаемой власти экономистов немного противоречат одна

другой. Во-первых, наша дисциплина претендует на то, чтобы называться наукой; она дает знание, приносящее практическую пользу при решении вопросов государственной политики. Во-вторых, их модели предоставляют нарративы для описания действительности, которые легко укореняются в общественном сознании. В этих напоминающих басни схемах часто есть мораль, которая формулируется в запоминающихся фразах (например, «налогообложение убивает стимулы»), а также прекрасно согласуется с политическими идеологиями. Наука и рассказывание историй обычно дополняют друг друга, как я объяснял в главе 1. Работая в тандеме, они позволяют представлениям экономистов получать значительный вес в общественных дебатах.

Неприятности происходят, когда экономисты начинают считать одну из моделей единственно верной. Тогда нарратив получает собственную жизнь и отделяется от условий, в которых был сформулирован. Он превращается во всеобъемлющее объяснение, которое исключает альтернативные, и возможно более полезные, повороты сюжета. К счастью, противоядие существует — внутри самой экономической науки. Чтобы поправить дело, экономистам следует вернуться в учебные аудитории и освежить в памяти иные модели в своей коллекции.

В ранее написанной мною книге я говорил о двух породах экономистов, основываясь на известном различии за авторством британского философа Исайи Берлина. И хотя тогда я имел в виду специалистов по международной экономике, эту идею можно распространить шире²². «Ежи»

22. Dani Rodrik, *The Globalization Paradox: Democracy and the Future of the World Economy* (New York: W.W. Norton, 2011), chap. 6; Дэни Родрик, *Парадокс глобализации: демокра-*

захвачены одной большой идеей — рынки работают наилучшим образом, правительства коррумпированы, вмешательство в экономику ведет к неблагоприятным последствиям, — которые они применяют без остановки. «Лисы», напротив, лишены единого видения и придерживаются множества представлений о мире, некоторые из которых противоречат друг другу. Подход «ежа» к решению проблемы всегда предсказуем: решение заключается в освобождении рынков, невзирая на природу и контекст рассматриваемой экономической проблемы. «Лисы» ответят: «Все зависит от обстоятельств»; иногда они рекомендуют развивать рынки, иногда — расширять вмешательство государства.

Экономическая наука нуждается в том, чтобы в общественном обсуждении участвовали больше «лис» и меньше «ежей». Экономисты, умеющие переключаться от одной объяснительной схемы к другой, если того требуют обстоятельства, скорее направят нас в нужном направлении.

тия и будущее мировой экономики (Москва: Издательство Института Гайдара, 2014), гл. 6. См. также: Rodrik, «In Praise of Foxy Scholars», Project Syndicate, March 10, 2014, <http://www.project-syndicate.org/commentary/dani-rodrik-on-the-promise-and-peril-of-social-science-models>.

ГЛАВА 6

Экономическая наука и ее критики

ЭКОНОМИСТ, врач и архитектор вместе едут в поезде и начинают спор о том, чья профессия более почтенна. Врач замечает, что бог создал Еву из ребра Адама, так что он должен был быть хирургом. Тут вмешивается архитектор и говорит: «До появления Адама и Евы вселенная должна была быть создана из хаоса, и для этого точно требовался выдающийся архитектор». И тогда экономист произносит: «А откуда, по вашему мнению, взялся хаос?»¹.

Экономическая наука без критиков — как «Гамлет» без принца датского. Претензии дисциплины на научность, ее привилегированное положение среди социальных наук и видная роль ее представителей в общественных дебатах как магнитом притягивают недоброжелателей. Критики обвиняют экономистов в редуccionистском подходе к общественным явлениям, необоснованных претензиях на универсальное знание, игнорировании социального, культурного и политического контекстов, превознесении роли рынков и материальных стимулов и склонности к консерватиз-

1. Я услышал эту шутку в одной из радиопрограмм *BBC*, когда учился в колледже, и, что характерно, ее рассказывал экономист — Э.Ф. Шумахер. Экономисты и есть свои собственные самые суровые критики.

му. Я сам на протяжении всей этой книги жалуясь на две другие слабости экономики: недостаточное внимание к выбору модели и временами избыточный акцент на некоторых моделях в ущерб другим. Экономисты многократно вводили публику в заблуждение.

Но в этой главе я собираюсь показать, что более общая критика экономической науки по большей части бьет мимо цели. Экономическая наука — коллекция моделей, допускающая широкое разнообразие возможностей, а не набор готовых решений. Как сказали трое экономистов, сами критически относящиеся к своей науке, большинство недовольных «склонны упускать из виду разнообразие мнений внутри профессии и наличие множества новых идей, проходящих проверку на практике» и часто игнорируют тот факт, что «можно быть частью мейнстрима и не разделять „ортодоксальные“ представления»². Критики отчасти правы, когда говорят, что поведение экономистов предполагает обратное — они пропагандируют универсальные решения или рыночный фундаментализм. Но критики все же должны уяснить, что ведущие себя подобным образом экономисты не отражают истинного лица всей дисциплины. Эти экономисты заслуживают осуждения со стороны своих коллег не менее, чем со стороны неспециалистов. Стоит это понять, и значительная доля типичных критических заявлений оказывается неуместной или теряет свою остроту.

2. David Colander, Richard F. Holt, and J. Barkley Rosser, «The Changing Face of Mainstream Economics», *Review of Political Economy* 16, no. 4 (October 2004): 487.

Пересматривая привычные критические аргументы

В предыдущих главах нам уже встречались некоторые из наиболее распространенных критических аргументов в различных вариантах. Возьмем недовольство тем, что экономические модели чрезмерно простые. Это возражение обусловлено непониманием сути анализа. На самом деле простота — это обязательное требование в науке. Каждое объяснение, гипотеза, причинно-следственная связь непременно являются идеализацией; множество обстоятельств остается за кадром, так что мы можем сосредоточиться на сути дела. Сам термин «анализ» имеет греческое происхождение и обозначает разделение сложных вещей на более простые компоненты. Его антоним — «синтез», обозначающий объединение вещей. Ни анализ, ни синтез не возможны без этих простых элементов.

Разумеется, простое — не значит упрощенное. Как предположительно сказал Эйнштейн, «все надо делать так просто, как только можно, но не более того». Когда причинно-следственные механизмы тесно взаимодействуют между собой и не могут быть изучены изолированно, модели должны учитывать эти взаимодействия. Скажем, если урожай кофе одновременно повышает издержки производства и разрушает договоренности об удержании цен между ключевыми кофейными экспортерами, то мы не должны анализировать эффекты каждого фактора (шок предложения и снижение картелизации) по отдельности. Такие модели будут сложнее прочих. Но и им будет очень далеко до претензий на сколько-нибудь полное соответствие социальной реальности. Если сторонники сложности имеют в виду именно это, то возражений

быть не может. Напротив, когда основные взаимозависимости остаются туманными и неопределенными, а предполагаемые объяснения не опираются на простые элементы, сложность может привести только к непоследовательности.

Возьмем близкий довод критиков о том, что экономические модели основаны на нереалистичных предположениях. В этом экономическая наука действительно виновна на 100 процентов. Многие предположения в экономических моделях — совершенная конкуренция, полная информация, совершенное прогнозирование — очевидно не соответствуют действительности. Но, как я объяснял в главе 1, модели с нереалистичными предположениями могут быть полезны, как полезны лабораторные эксперименты, условия проведения которых разительно отличаются от существующих в реальном мире. И те и другие позволяют выявить причинно-следственные связи, изолируя их от прочих искажающих факторов. Внимания требуют только критически важные предположения — те, что напрямую влияют на содержательные результаты или изменяют ответ на поставленный вопрос. Вы же не станете конструировать самолет на основе закономерностей, выявленных в условиях вакуума.

Возьмем последствия налога на продажи автомобилей. Если мы изучаем эффекты, к которым приводит определенный уровень налога на продажи всех без исключения автомобилей, то не имеет особого значения, рассматривают ли потребители маленькие и большие автомобили как взаимозаменяемые. Вполне можно принять предположение, что эти типы автомобилей — полные субституты. Но если мы рассматриваем только налог на люксовые автомобили, то предположение о полной взаимозаменяемости перестает быть безобидной. Последствия

налога для бюджета и продаж автомобилей принципиально зависят от параметра, который экономисты называют «перекрестная эластичность спроса по цене» (чувствительность спроса на одну категорию товаров к ценам другой категории товаров). Чем выше эластичность (в абсолютном выражении), тем сильнее смещение потребления от больших к маленьким автомобилям и тем ниже налоговые поступления в бюджет. Экономисты должны быть уверены, что их рекомендации остались бы теми же, будь предпосылки более реалистичными.

Экономистов, принимающих индивида как единицу анализа, часто критикуют за невнимание к роли социальных и культурных детерминант поведения людей. Социологи и антропологи предпочитают искать объяснения на уровне сообществ или всего общества, а не на уровне индивидов. (Склонность экономистов объяснять совокупные результаты через решения индивидов называется «методологический индивидуализм»; схожим образом макроэкономика тяготеет к поиску микрооснов). Как утверждают критики, культурные практики и социальные нормы делают одни формы потребления ценными, а другие — неприемлемыми; они часто оказывают решающее воздействие даже на решения в таких экономических сферах, как потребление и занятость. Говорят, что одержимость экономистов выбором на уровне отдельных домохозяйств или инвесторов мешает им понять, что предпочтения и образцы поведения «социально конструируются» или навязываются структурой общества³.

3. Хороший обзор различий в подходах экономистов и антропологов см. в: Pranab Bardhan and Isha Ray, *Methodological Approaches in Economics and Anthropology*, Q-Squared

Никто и не спорит, что самые простые базовые экономические модели пренебрегают социальными и культурными истоками предпочтений и ограничений поведения людей. Но ничто не мешает расширить модели, учтя в них эти воздействия и соответственно переработав выводы. На самом деле одна из активно развивающихся исследовательских программ в экономической науке именно этим и занимается: анализирует, как идентичности, нормы и культурно заданные практики формируются в процессе взаимодействия индивидов между собой⁴. Всякий, кто не считает, что люди не способны к самостоятельным действиям, а их поведение целиком определяется неподвластными им внешними силами, согласится, что любое разумное объяснение социальных явлений должно исходить из действий, которые люди *решают* предпринять. Модели экономистов, в основе которых

Working Paper 17 (Toronto: Centre for International Studies, University of Toronto, 2006).

4. Примеры таких работ см.: Samuel Bowles, «Endogenous Preferences: The Cultural Consequences of Markets and Other Economic Institutions», *Journal of Economic Literature* 26 (1998): 75–111; George A. Akerlof and Rachel E. Kranton *Identity Economics: How Our Identities Shape Our Work, Wages, and Well-Being* (Princeton, NJ: Princeton University Press, 2010); Alberto Alesina and George-Marios Angeletos, «Fairness and Redistribution», *American Economic Review* 95, no. 4 (2005): 960–980; Alberto Alesina, Edward Glaeser, and Bruce Sacerdote, «Why Doesn't the United States Have a European-Style Welfare State?» *Brookings Papers on Economic Activity*, no. 2 (2001): 187–254; Raquel Fernandez, «Cultural Change as Learning: The Evolution of Female Labor Force Participation over a Century», *American Economic Review* 103, no. 1 (2013): 472–500; Roland Bénabou, Davide Ticchi, and Andrea Vindigni, «Forbidden Fruits: The Political Economy of Science, Religion, and Growth» (unpublished paper, Princeton University, December 2013).

лежит формальная фиксация ограничений на принятие этих решений (материальных, социальных, контекстуальных), хорошо подходят для подобного анализа. Если ставится цель грамотного изучения общества, то противопоставление анализа на уровне социума и индивида оказывается во многом ложным и непродуктивным.

Есть ли у экономистов предубеждение в пользу решений с главенством рынка? Это обвинение тоже справедливо. Однако, как я уже говорил ранее, проблема больше связана с тем, как именно экономисты ведут себя на публике, чем с содержательными особенностями дисциплины. В наше время научные карьеры делают те, кто изучает работу рынков, а не те, кто умеет приводить занимательные примеры, опровергающие классический принцип «невидимой руки» Адама Смита. Например, читателя может удивить, что Джагдиш Бхагвати, самый громогласный защитник свободы торговли среди экономистов, получил признание в науке как автор группы моделей, показавших, что либерализация торговли может ухудшить положение страны⁵. Чтобы устранить этот перекося, нужно не перестраи-

5. Джагдиш Бхагвати неустанно пропагандирует либерализацию торговли с 1980-х годов. В своих ранних научных работах он показал, что в открытой экономике возможно замедление экономического роста из-за сопутствующих колебаний мировых цен на статьи импорта и экспорта. Он также тщательно изучал роль искажений рынка и необходимые для их устранения действия государства, показав, что политика *laissez-faire* не является оптимальной для широкого спектра обстоятельств. См.: Jagdish Bhagwati, «Immiserizing Growth: A Geometrical Note», *Review of Economic Studies* 25, no. 3 (June 1958): 201–5; Bhagwati and V. K. Ramaswami, «Domestic Distortions, Tariffs and the Theory of Optimum Subsidy», *Journal of Political Economy* 71, no. 1 (February 1963): 44–50.

вать экономическую науку, а обеспечить более полное использование того разнообразия моделей, которые уже представлены в общественных дебатах.

Еще экономистов критикуют за то, что их теории невозможно надлежащим образом проверить. Эмпирический анализ никогда не дает для этого достаточных оснований, и теории редко отвергаются как недостоверные. Дисциплина бросается от одного набора предпочитаемых моделей к другому, следуя не столько эмпирическим свидетельствам, сколько моде и идеологии. И пока экономисты будут выдавать себя за физиков социального мира, это обвинение будет заслуженным. Однако, как я объяснял ранее, сравнение с естественными науками некорректно. Экономика — *общественная наука*, а это означает, что поиск универсальных теорий и выводов напрасен. Модель (теория) в самом лучшем случае валидна в данном конкретном контексте. Погоня за обобщенным эмпирическим подтверждением или опровержением лишена смысла.

Поэтому прогресс в экономической науке заключается в накоплении потенциально полезных моделей, среди которых более новые схватывают такие аспекты социальной реальности, которые просмотрели или игнорировали прежние модели. Когда экономист замечает новую закономерность, его первое побуждение — найти модель, которая может ее объяснить. Экономическая наука развивается также за счет совершенствования методов выбора модели, повышая соответствие моделей обстоятельствам реального мира. Как я объяснял в главе 3, это более искусство, чем наука, и эта проблема не получает в экономической науке должного внимания. Но работа с моделями дает то преимущество, что все необходимые для выбора модели элементы — критически важные пред-

посылки, причинно-следственные механизмы, прямые и побочные следствия — прозрачны и выражены в явном виде. Эти элементы позволяют экономистам проверять соответствие между моделью и реальной обстановкой, пусть и неформально и с оговорками, а не формально и окончательно.

Наконец, экономическую науку обвиняют в неспособности предсказывать. Как остроумно заметил Джон Кеннет Гэлбрейт (сам экономист), бог создал экономические прогнозы, чтобы обелить астрологов. Еще недавно ярчайшим доказательством считался глобальный финансовый кризис, случившийся в тот момент, когда подавляющее большинство экономистов уверовали в наступление вечной макроэкономической и финансовой стабильности. В предыдущей главе я показал, что это заблуждение — очередной результат типичного «слепого пятна»: склонности считать одну модель единственно верной. Парадоксально, но если бы экономисты серьезнее относились к своим моделям, они бы меньше верили в благие последствия финансовых инноваций и финансовой глобализации и их бы не застала врасплох последовавшая финансовая катастрофа.

Вместе с тем ни одна общественная наука и не должна претендовать на прогнозирование, как не должна и оцениваться на этом основании. Направление социальных изменений невозможно предсказать. На них влияет слишком много факторов. В терминах моделей можно сказать, что существует множество моделей будущего, включая те, которые еще не сконструированы! Самое лучшее, чего можно ожидать от экономики и прочих общественных наук, — это *условные* прогнозы: к каким результатам приведут отдельные изменения, по одному за раз, при условии неизменности прочих фак-

торов. Вот с этим хорошая модель справится. Она может дать примерное понимание, каким будет результат конкретных крупномасштабных изменений или что случится, если одни причины перекроют другие. Мы с достаточными основаниями можем быть уверены, что масштабное ценовое регулирование приведет к дефициту, неурожай кофе приведет к росту цен на него, а масштабное вливание денег центральным банком в обычных обстоятельствах приведет к инфляции. Но в этих примерах допущение «при прочих равных» является обоснованным и предсказания больше напоминают условные прогнозы. Проблема в том, что зачастую мы не можем ни определить, какие из возможных изменений действительно произойдут, ни уверенно судить об их относительном вкладе в итоговый результат. В таких случаях от экономиста требуется осторожность и умеренность вместо самонадеянности.

В оставшейся части главы я разберу два других критических аргумента, о которых пока почти не упоминал. Во-первых, я рассмотрю обвинение экономической науки в том, что она изобилует ценностными суждениями, так что большая часть того, что выдается за научный анализ, на деле не более чем выражение нормативных предпочтений в пользу рыночной экономики. Во-вторых, я оценю аргумент о том, что экономическая наука препятствует плюрализму мнений и враждебна к новым подходам и идеям.

Проблема ценностей

Большинство моделей в экономике предполагают эгоистическое поведение индивидов. Они стремятся максимизировать свои (возможно, и своих

детей) возможности потребления, и их не интересуется, что будет со всеми остальными. Во многих обстоятельствах это допущение достаточно реалистично. Противоположное допущение о полностью альтруистическом поведении будет лишено смысла. Изменение степени альтруизма и щедрости не приведет к существенному изменению большинства результатов.

Во многих исследованиях эта предпосылка принимает менее жесткую форму — допускается некоторая степень альтруизма и поведения с оглядкой на других людей. В некоторых обстоятельствах (например, в случае благотворительности или голосования во всеобщих выборах) для понимания происходящего обязательно нужно учитывать дополнительные мотивы, помимо эгоистического интереса. Тем не менее справедливо будет сказать, что эгоистическое поведение — предпосылка, характерная для экономической науки. Но модели предсказывают то, что произойдет *на самом деле*, а не то, что должно произойти. В подобного рода анализе нет места ценностным суждениям.

Главное достижение экономической науки — «Теорема о невидимой руке рынка» — делает экономистов в чем-то более равнодушными и терпимыми к эгоистическим проявлениям. В конечном счете ключевой посыл экономической науки в том и состоит, что сумма эгоистических действий ведет к пользе для всех. Действия группы эгоистических людей не обязательно приведут к экономическому и социальному хаосу. С точки зрения общества, средство против стремления одного человека к материальным благам — стремление к тем же благам многих других людей. Свободная и неограниченная конкуренция нивелирует патологические явления, которые могли бы возникнуть в ее отсутствие.

Здесь просматривается явная параллель с конституционным устройством Соединенных Штатов. Джеймс Мэдисон, Александр Гамильтон и другие люди, создававшие федеральную систему США, принимали как данность, что организация политической системы должна исходить из наличия преследующих собственный интерес организованных групп давления. Они разработали систему с учетом этого обстоятельства, снабдив ее механизмами сдержек и противовесов. Множественность центров власти и ограничения их полномочий, а также масштабы союза, не позволят ни одной группировке получить превосходство над другими. Было бы несправедливо критиковать федералистов за то, что они встроили эгоизм в политическую систему США; они полагали, что просто упорядочивают его последствия. Аналогичным образом экономисты, чьи модели населены эгоистичными потребителями, не выносят моральных суждений; они лишь описывают то, что происходит, когда потребители взаимодействуют в рамках рынка со столь же эгоистически настроенными фирмами.

Однако может ли столь значимая роль эгоистического интереса в экономических моделях вызывать смещение норм поведения в сторону эгоизма? Мы можем спросить, делают ли они такое поведение «нормальным» и вытесняют ли иные, более социально ориентированные способы действий. Есть один результат, который вроде бы подтверждает эти опасения: студенты колледжей, специализирующиеся на экономике, больше склонны к эгоистическому поведению, чем студенты иных специальностей. Их поведение лучше соответствует классическим экономическим моделям, таким как дилемма заключенных. Некоторые интерпретировали этот результат как свидетельство того, что

изучение экономической науки делает индивидов эгоистичнее.

На самом деле результаты говорят в пользу альтернативной гипотезы: определенные типы студентов с большей вероятностью решат заниматься экономикой, чем другие. Исследование поведения израильских студентов показало, что различия в ценностных установках между студентами-экономистами и прочими существует еще до того, как будущие экономисты приступают к изучению экономики. Швейцарские исследования показали, что студенты определенного типа, которые в будущем решают специализироваться по экономике (с уклоном в бизнес), с самого начала учебы в колледже менее склонны жертвовать средства нуждающимся студентам, и эта склонность не увеличивается с началом изучения экономики⁶. Таким образом, вполне вероятно, что экономическая наука привлекает особый тип студентов — тех, кто более эгоистичен! Но вот свидетельства в пользу того, что она каким-то образом делает людей эгоистичнее, менее убедительны.

Поскольку эгоистический интерес занимает видное место в экономических моделях, экономисты склоняются к решениям проблем государственной политики с помощью создания правильных стимулов. Возьмем климатические изменения и вопрос о том, как бороться с выбросами углекислого газа. Мнения общественности по этому вопросу различались, но экономисты были почти

6. Neil Gandal et al., «Personal Value Priorities of Economists», *Human Relations* 58, no. 10 (October 2005): 1227–52; Bruno S. Frey and Stephan Meier, «Selfish and Indoctrinated Economists?» *European Journal of Law and Economics* 19 (2005): 165–71.

единодушны: они рекомендовали ввести или налог на выбросы углекислого газа, или его близкий аналог, квоту на выбросы с продажей разрешений производителям⁷. В обоих вариантах целью было сделать выбросы более дорогими и тем самым снизить прибыльность использования фирмами угля. С точки зрения экономистов, эта политика правильная, поскольку подходит к проблеме с правильной стороны. Фирмы не принимают в расчет последствия своих решений для окружающей среды, и поэтому правильным решением будет вынудить их «интернализировать» внешние издержки, введя плату за выбросы.

Многим неэкономистам эта рекомендация не понравилась. Она превращала моральное обязательство («да не навредишь окружающей тебя среде») в подсчет издержек и выгод. Более того, некоторые говорили, что налог или платная квота на выбросы углекислого газа легитимизирует загрязнение среды. Фирмам как будто говорили: пока вы платите комиссию, нет ничего плохого в выбросах углекислого газа и приближении климатических изменений. Майкл Сэндел, политический философ из Гарвардского университета, в последние годы громко критикует вредное воздействие экономической науки на культуру общества. Вот что говорит Сэндел о материальном стимулировании:

Установление цены на хорошие стороны жизни может разрушить их. Это происходит потому, что рынки не только размещают товары; они

7. В мире совершенной информации эти две политики полностью эквивалентны, но в условиях неопределенности они дают очень разные результаты.

выражают и навязывают определенные установки относительно обмениваемых товаров. Выдача детям денег за чтение книг может побудить их читать больше, но также может приучить их рассматривать чтение как обузу, а не как источник подлинного наслаждения. Привлечение иностранных наемников для ведения наших войн может сберечь жизни наших сограждан, но может и разрушить суть идеи гражданства⁸.

Иными словами, опора на рынки и стимулы поощряет ценности, которые разрушительны для общественно важных целей.

Экономист ответил бы, что такие цели, как контроль над уровнем выбросов углекислого газа, он рассматривает с точки зрения эффективности, а не морали. Моралистические увещания — это прекрасно, но стимулы успешно работают. Столкнувшись с более серьезным отпором, экономисты начинают апеллировать к эмпирическим данным. Хорошо, скажут они, мы можем предоставить вам тысячи исследований, показывающих, что фирмы, например, снижают расходование нефти, когда ее цена растет; а покажите-ка подтверждения того, что моралистические увещания способны снизить выбросы углекислого газа.

Экономисты склонны принимать мир как данность, включая человеческий эгоизм, и конструировать решения с учетом этого ограничения. Они скажут (и будут правы), что эта работа определя-

8. Michael J. Sandel, «What Isn't for Sale?» *Atlantic*, April 2012, <http://www.theatlantic.com/magazine/archive/2012/04/what-isnt-for-sale/308902>. См. также: Sandel, *What Money Can't Buy: The Moral Limits of Markets* (New York: Farrar, Straus and Giroux, 2012); Майкл Сэндел, *Что нельзя купить за деньги. Моральные ограничения свободного рынка* (Москва: Манн, Иванов и Фербер, 2013).

единодушны: они рекомендовали ввести или налог на выбросы углекислого газа, или его близкий аналог, квоту на выбросы с продажей разрешений производителем⁷. В обоих вариантах целью было сделать выбросы более дорогими и тем самым снизить прибыльность использования фирмами угля. С точки зрения экономистов, эта политика правильная, поскольку подходит к проблеме с правильной стороны. Фирмы не принимают в расчет последствия своих решений для окружающей среды, и поэтому правильным решением будет вынудить их «интернализировать» внешние издержки, введя плату за выбросы.

Многим неэкономистам эта рекомендация не понравилась. Она превращала моральное обязательство («да не навредишь окружающей тебя среде») в подсчет издержек и выгод. Более того, некоторые говорили, что налог или платная квота на выбросы углекислого газа легитимизирует загрязнение среды. Фирмам как будто говорили: пока вы платите комиссию, нет ничего плохого в выбросах углекислого газа и приближении климатических изменений. Майкл Сэндел, политический философ из Гарвардского университета, в последние годы громко критикует вредное воздействие экономической науки на культуру общества. Вот что говорит Сэндел о материальном стимулировании:

Установление цены на хорошие стороны жизни может разрушить их. Это происходит потому, что рынки не только размещают товары; они

7. В мире совершенной информации эти две политики полностью эквивалентны, но в условиях неопределенности они дают очень разные результаты.

выражают и навязывают определенные установки относительно обмениваемых товаров. Выдача детям денег за чтение книг может побудить их читать больше, но также может приучить их рассматривать чтение как обузу, а не как источник подлинного наслаждения. Привлечение иностранных наемников для ведения наших войн может сберечь жизни наших сограждан, но может и разрушить суть идеи гражданства⁸.

Иными словами, опора на рынки и стимулы поощряет ценности, которые разрушительны для общественно важных целей.

Экономист ответил бы, что такие цели, как контроль над уровнем выбросов углекислого газа, он рассматривает с точки зрения эффективности, а не морали. Моралистические увещевания — это прекрасно, но стимулы успешно работают. Столкнувшись с более серьезным отпором, экономисты начинают апеллировать к эмпирическим данным. Хорошо, скажут они, мы можем предоставить вам тысячи исследований, показывающих, что фирмы, например, снижают расходование нефти, когда ее цена растет; а покажите-ка подтверждения того, что моралистические увещевания способны снизить выбросы углекислого газа.

Экономисты склонны принимать мир как данность, включая человеческий эгоизм, и конструировать решения с учетом этого ограничения. Они скажут (и будут правы), что эта работа определя-

8. Michael J. Sandel, «What Isn't for Sale?» *Atlantic*, April 2012, <http://www.theatlantic.com/magazine/archive/2012/04/what-isnt-for-sale/308902>. См. также: Sandel, *What Money Can't Buy: The Moral Limits of Markets* (New York: Farrar, Straus and Giroux, 2012); Майкл Сэндел, *Что нельзя купить за деньги. Моральные ограничения свободного рынка* (Москва: Манн, Иванов и Фербер, 2013).

ется их ориентацией на эмпирику и не имеет ничего общего с ценностями и этикой. И хотя порой они слишком поспешно отвергают решения, не основанные на стимулах, этот подход делает их более открытыми к принятию точки зрения оппонента, если она подтверждается эмпирическими данными.

В главе 2 я бегло упоминал о незапланированном эксперименте в реальных условиях, наделавшем много шума среди экономистов. В одном израильском детском саду, чтобы сократить вечерние опоздания родителей, ввели штраф для родителей, приходивших за ребенком позже положенного срока. Именно такую политику посоветовали бы экономисты: если хотите снизить частоту неких действий, сделайте их более затратными для совершающих их индивидов. К удивлению почти всех наблюдателей, после введения штрафа опоздания участились. Похоже, при наличии штрафа родители считали нормальным приходить поздно. Когда появился фактор денежного наказания, ослабели моральные запреты, ранее направлявшие поведение родителей. Говоря в терминах экономистов, сократились или были устранены моральные издержки опозданий. Как отметил экономист Сэм Боулз, это пример того, что материальные стимулы порой вытесняют поведение, опирающееся на нормы морали и принимающее во внимание интересы других людей⁹.

Урок для экономистов заключается в том, что иногда им нужен более широкий взгляд на чело-

9. Uri Gneezy and Aldo Rustichini, «A Fine Is a Price», *Journal of Legal Studies* 29, no. 1 (January 2000): 1–17; Samuel Bowles, *Machiavelli's Mistake: Why Good Laws and No Substitute for Good Citizens* (unpublished book manuscript, 2014).

веческое поведение (или на издержки и выгоды), чем используемый в базовых моделях. Как правило, экономисты охотно переключаются и вносят необходимые коррективы в модели, если данные указывают на неработоспособность базовой модели. В данном случае именно так и было. Но они по-прежнему будут рассматривать перестройку модели в терминах не морали, а релевантности и эффективности. Например, можно ли урок, извлеченный из истории с израильским детским учреждением, применить к регулированию выбросов углекислого газа? Реалистично ли будет предположить, что работу силовых установок определяют соображения, связанные с моральным императивом о недопустимости воздействий, ведущих к изменению климата, на которые существенно повлияет введение налога на выбросы углекислого газа? Что сильнее скажется на объеме выбросов: кампании по просвещению публики, повышение сознательности или моралистические увещевания? Для экономистов все эти вопросы — эмпирические, а не моральные.

Что же насчет более общей претензии Сэндела по поводу того, что рынки способствуют распространению «рыночных ценностей», что они вынуждают нас к рыночному обмену в тех сферах, где он неуместен? Как пишет Сэндел, «мы живем во время, когда почти все можно купить и продать». По его словам, «продается все». Вот некоторые примеры, которые Сэндел приводит в дополнение к комиссиям за выбросы углекислого газа: 90 долларов за возможность на сутки перейти в более комфортную камеру в тюрьме Санта-Ана; 8 долларов за возможность водителю автомобиля без пассажиров воспользоваться полосой, предназначенной для автомобилей с пассажира-

ми, в Миннеаполисе и других городах; 8 тыс. долларов за услуги индийской суррогатной матери; 250 тыс. долларов за право застрелить находящегося под угрозой исчезновения черного носорога; 1,5 тыс. долларов за возможность получить номер мобильного телефона врача¹⁰. Эти и другие примеры, полагает Сэндел, свидетельствуют о растущей роли рыночных ценностей в нашей общественной жизни.

Но что такое эти рыночные ценности? Все они сводятся к одной: эффективность. Единственное, что экономист может сказать о рынке, и только о хорошо работающем рынке, лишенном типичных несовершенств, — то, что он обеспечивает эффективное распределение ресурсов с максимальной точностью: нет никакой возможности сделать некоторых людей богаче, не делая других беднее. Всякий экономист, который на основе данных экономической науки выдвигает более масштабные доводы — о справедливости, законности или моральной ценности рынков, — просто нарушает профессиональную этику.

Разумеется, связка «рынок-эффективность» не препятствует отдельным экономистам приписывать рынкам дополнительные ценности. Например, личные ценностные убеждения экономиста побуждают его защищать свободу предпринимательства, апеллируя к либертарианской доктрине (представлению о недопустимости ограничения свободы заключать сделки со всеми желающими). Но эти представления — внешние по отношению к экономической науке. Тот факт, что их защищает экономист, не делает их достовернее тех, за которые ратует архитектор или врач. Равно как она

10. Sandel, «What Isn't for Sale?».

не отрицает допущения (при наличии достаточных данных), что в определенных обстоятельствах сокращение вмешательства в работу рынка приносит пользу, не сводимую к одной эффективности. Например, экономисты часто заявляют, что отмена топливных субсидий в развивающихся странах обеспечит, помимо большей эффективности, более равномерное распределение благ. Причина в том, что субсидии не только вызывают избыточное потребление топлива (источник их неэффективности), но и приносят выгоду преимущественно благополучным слоям населения (так как именно они в основном потребляют субсидируемое топливо). Но подобные доводы в каждом конкретном случае нуждаются в эмпирическом подтверждении.

Эффективность — это хорошо? Сама по себе — да. Мы можем без всякого колебания сказать, что эффективность — это параметр (ценность), который стоит принимать во внимание при сравнении альтернативных состояний общества. Но, разумеется, учитывать нужно не только его. Другая соперничающая ценность — справедливость, или такая несомненно моральная ценность, как альтруистическое и социально-ответственное поведение. Иногда эти соображения направляют наши действия в том же направлении, что и стремление к эффективности, тем самым подкрепляя довод о важности рынков. Иногда возникают противоречия, и приходится искать компромиссы. Окончательный ответ на вопрос, что можно, а что нельзя делать предметом рыночного обмена, должен приниматься после оценки множества компромиссных решений в самых разных сферах. Разные сообщества, скорее всего, придут к различным ответам. И даже в рамках одного сообщества ответ может меняться со временем. Снова повторю, что эконо-

мист не обладает особой квалификацией, позволяющей принимать подобные решения. В лучшем случае экономист может дать дельный совет.

Например, экономисты могут внести полезный вклад в дискуссии о том, нужно ли вводить плату за право автомобилю без пассажиров передвигаться по полосе, выделенной для движения автомобилей с пассажирами. Они способны сделать обоснованные прикидки о том, какие водители скорее согласятся дополнительно заплатить; какую выгоду получит тот, кто выигрывает от введения платы (быстрее прибывая к месту назначения); сколько составят поступления в бюджет владельцев дороги и как их можно будет использовать; как распределятся издержки от возможных заторов на выделенной полосе (кто и сколько заплатит?). Основанные на данных, ответы на эти вопросы могут убедить большинство людей в том, что с учетом всех обстоятельств введение такой платы является желательным. Тот же вид анализа для, скажем, возможности за плату перейти в более комфортабельную тюремную камеру может привести к противоположному выводу. В обоих случаях экономисты не вправе предлагать рыночные решения в качестве универсальных, не учитывая многочисленные соображения помимо стремления к эффективности.

Будем справедливы к Сэнделу, его критические доводы вполне оправданны. Экономисты действительно временами утрачивают осторожность и делают заявления намного более широкого характера, чем позволяет их профессия. Помните приведенный в предыдущей главе список утверждений, с которыми согласны большинство экономистов? Многие из них предполагают неявные ценностные суждения. Говоря, что нельзя огра-

ничивать внешнюю торговлю, можно переносить производство за рубеж, нужно отменить сельскохозяйственные субсидии, экономисты выносят суждения по вопросам, ответы на которые не могут быть получены с учетом одних только соображений эффективности. С ними неразрывно связаны соображения законности, этичности, справедливости и равного распределения благ. Справедливо ли требовать либерализации торговли, если от нее выигрывают преимущественно обеспеченные люди, а проигрывают — самые бедные работники во всей экономике? Справедливо ли пользоваться выгодами от переноса производства в бедные страны, где не соблюдаются базовые права работников, вынужденных выполнять тяжелую работу в опасных условиях труда? Те 90 и более процентов экономистов, которые согласны с этими утверждениями, должны или не догадываться о подобных вопросах, или систематически оценивать их как второстепенные по сравнению с соображениями эффективности. В обоих случаях возникают проблемы. Даже допуская, что эффективность последствий можно с легкостью предсказать в любых обстоятельствах (и можно пренебречь опасениями, которыми я поделился в предыдущей главе), в этих конкретных областях экономисты, несомненно, выходят за пределы своей компетенции.

Поскольку в ходе обучения экономистам преподают только один прием сравнительной оценки альтернативных социальных состояний — через призму эффективности распределения ресурсов, они особенно склонны совершать эту ошибку каждый раз, когда к ним обращаются за комментариями по поводу государственной политики. Они часто не видят разницы между эффективностью и прочими общественно значимыми целями. В та-

ких случаях полезно будет продемонстрировать обратное, не давая экономистам себя обмануть и напоминая им о типичных ошибках, связанных с выходом за пределы компетенций. Равно как экономисты должны напоминать общественности, что многие заявления, которые от их лица делают политики и иные «политические предприниматели», не получают полного подтверждения в экономической науке.

Один из самых ранних и влиятельных доводов в пользу рынка, не связанных с экономикой, состоит в том, что вовлеченность в рыночную деятельность способствует смягчению нравов. Как напоминает Альфред Хиршман в своей авторитетной книге «Страсти и интересы», мыслители конца XVII и XVIII веков полагали, что мотив погони за прибылью пересилит низменные мотивы поведения, такие как склонность к насилию и господству над другими людьми. Термин *doux* («кроткий») часто используется в сочетании *doux commerce* («торговля, смягчающая нравы») и указывает на то, что коммерческая деятельность способствует распространению цивилизованных и мирных взаимодействий. Хорошо известно высказывание Монтескье «Везде, где нравы кротки, есть и торговля, и везде, где есть торговля, там и нравы кротки». Как отмечал Самуэль Рикар, дедушка Давида Рикардо, благодаря торговле человек стремится к таким добродетелям, как рассудительность, честность и благоразумие. Он старается избегать пороков, ибо в противном случае лишится кредита и станет объектом скандала. Так следование своему интересу может усмирять порывы страстей¹¹.

11. Albert O. Hirschman, *The Passions and the Interest: Political Arguments for Capitalism before Its Triumph* (Princeton, NJ: Prince-

Философы прошлого приветствовали распространение рынков не по соображениям эффективности или расширения материальных ресурсов, а потому, что полагали, будто рынки сформируют более этическое и гармоничное общество. Парадоксальным образом, три века спустя рынки стали ассоциироваться в глазах многих с моральным разложением. И как сегодняшние защитники рынков переоценивают роль эффективности, так и их критики не учитывают разнообразные способы, которыми рынки вносят вклад в формирование духа сотрудничества.

Недостаток плюрализма

Одна из самых частых претензий к экономической науке называет ее частным клубом, где посторонним не рады. Критики считают, что такая эксклюзивность изолирует дисциплину и закрывает возможности для новых альтернативных подходов. Они заявляют, что экономическая наука должна стать более инклюзивной, более плюралистической и более открытой к неортодоксальным подходам.

Именно этот критический довод часто можно услышать от студентов, что отчасти обусловлено особенностями преподавания экономической науки. Например, осенью 2011 года группа студентов Гарвардского университета организовала протест,

ton University Press, 1977); Альберт Хиршман, *Страсти и интересы: политические аргументы в пользу капитализма до его триумфа* (Москва: Издательство Института Гайдара, 2012); см. также: Albert O. Hirschman, «Rival Interpretations of Market Society: Civilizing, Destructive, or Feeble?» *Journal of Economic Literature* 20 (December 1982): 1463–1484.

покинув аудиторию во время занятий по популярному вводному курсу экономики (*Economics-10*), который вел мой тогдашний коллега Грег Мэнкью. Их не устраивало, что курс под видом экономической науки пропагандирует консервативную идеологию и способствует сохранению социального неравенства. Мэнкью опроверг доводы протестующих как «плохо информированных». Он отметил, что у экономической науки нет идеологии; она лишь предлагает методы, позволяющие нам мыслить здраво и получать верные ответы, и не дает раз и навсегда установленных выводов в отношении государственной политики¹².

В апреле 2014 года студенческая группа, именуемая «Общество за посткризисную экономическую науку», выпустила 60-страничный манифест с призывами к основательной реформе экономического образования. Доклад включал вступительное слово Эндрю Хэлдана, высокопоставленного работника Банка Англии, и был восторженно воспринят многими другими экономистами. Он критиковал чрезмерно узкий подход к преподаванию экономической науки и призывал к большему плюрализму и включению в программу этики, истории и политики. Монопольное положение стандартной экономической парадигмы, писали студенты, препятствует «осмысленному критическому мышлению» и поэтому вредит экономической науке¹³.

12. Dani Rodrik, «Occupy the Classroom», Project Syndicate, December 12, 2011, <http://www.project-syndicate.org/commentary/occupy-the-classroom>.

13. Economics, Education and Unlearning: Economics Education at the University of Manchester, Post-Crash Economics Society (PCES), April 2014, <http://www.post-crasheconomics.com/download/778r>. Оксфордский экономист Саймон Рен-Льюис предлагает хороший разбор достоинств

Как понимать подобные претензии в свете очевидного существования множества моделей в экономической науке? Недовольство студентов обусловлено тем, что большая часть вводного курса по экономике — настоящая ода рынку. Он не дает представления о разнообразии выводов в экономической науке, и студент узнает о них лишь после того, как пройдет много других курсов по экономике. Преподавателей экономики обвиняют в чрезмерной узости и идеологической зашоренности потому, что экономисты — худшие враги самих себя в деле представления дисциплины посторонним. Вместо того чтобы дать слушателю представление о полном спектре направлений, предлагаемых их наукой, они рассказывают преимущественно о канонических моделях, которые акцентируют лишь один набор рекомендаций. Это особенно заметно во вводных курсах, где преподаватель стремится показать, как работают рынки. Как замечает экономист Саймон Рен-Льюис из Оксфордского университета: «Один из огорчительных моментов в преподавании экономической науки состоит в том, что часто студенты не видят большую часть всего интересного, что происходит в дисциплине»¹⁴. Можно ли винить студентов в требовании показать альтернативные подходы?

Сам я много раз нарушал привычные шаблоны экономистов, но это не нанесло заметного вреда моей карьере (по крайней мере, я так не думаю!). Возможно, большинство неэкономистов

и недостатков критических тезисов студентов в заметке «When Economics Students Rebel», Mainly Macro (blog), April 24, 2014, <http://mainlymacro.blogspot.co.uk/2014/04/when-economics-students-rebel.html>.

14. Wren-Lewis, «When Economics Students Rebel».

сочтет меня недостаточно радикальным, но внутри дисциплины мои взгляды часто считают неортодоксальными. Один коллега-экономист из Гарварда каждый раз говорит мне при встрече: «Как продвигается революция?». И несмотря на то, что выводы для экономической политики в большинстве моих работ отличаются от преобладающих в науке представлений, я никогда не сталкивался с дискриминацией со стороны других экономистов. Я не считаю, что редакторы журналов и коллеги были более суровы к моим научным работам из-за их выводов.

Но одно дело плюрализм в отношении выводов, и совсем другое — плюрализм в отношении методов. Нет ни одной научной дисциплины, в которой бы терпимо относились к подходам, слишком сильно отличающимся от общепринятых практик, и экономическая наука не прощает тех, кто не придерживается правильного способа «делать» науку. Будущий экономист должен четко формулировать модели и использовать подходящие статистические методы анализа. Модели могут включать самые разнообразные допущения; не будь такой возможности, было бы невозможно получать новые или отклоняющиеся от общепринятых выводы. Но не все предпосылки одинаково приемлемы. Применительно к экономической науке это означает, что чем сильнее отклонение от канонических предпосылок, тем больше усилий придется приложить к доказательству и обоснованию того, что дает подобное отклонение.

Чтобы считаться «своим», чтобы ваши работы воспринимали всерьез, вы должны действовать в соответствии с этими правилами. Мои работы принимались другими экономистами именно потому, что я следовал правилам. И я делаю это

не потому, что правила позволяют мне доказать принадлежность к «своим», а потому, что считаю их полезными. Правила упорядочивают мои исследования и гарантируют, что я понимаю, о чем говорю. При этом они не настолько ограничивают меня, чтобы помешать исследовать темы или использовать способы анализа, которые могут привести к неортодоксальным выводам.

Таким образом, экономическая наука оставляет мало возможностей для методологического плюрализма — намного меньше, чем для разнообразия в рекомендациях для экономической политики. Большинство экономистов скажут, что это правильно, потому что так обеспечивается защита от невнятных рассуждений и низкокачественных эмпирических данных. Некоторые методы лучше прочих. Формализованные аналитические схемы, в которых четко выстроены причинно-следственные связи, лучше словесных описаний, которые оставляют возможности для различных интерпретаций причин и следствий. Модели, которые объясняют общественные явления исходя из анализа создающего их поведения акторов (как делают экономисты, когда говорят о рыночной конкуренции, провалах координации или дилемме заключенных), лучше тех, которые приписывают способность к действию аморфным социальным сущностям. Эмпирический анализ, который уделяет внимание вопросам причинности и систематических ошибок в связи с пропущенной переменной, лучше того, в котором эти проблемы не учитываются.

Некоторые скажут, что эти ограничения суть методологическая «смирительная рубашка», мешающая появлению новых идей. Но жесткость правил, в рамках которых действует наша наука,

легко переоценить¹⁵. По моему опыту, экономическая наука всего за три десятилетия претерпела значительные изменения.

Рассмотрим те области, на которых я специализировался во время обучения в аспирантуре в середине 1980-х годов. Вот три темы, по которым я сдавал экзамены: экономическое развитие, мировая экономика и теория отраслевых рынков. Все три области претерпели значительные изменения. Самое главное, все они стали преимущественно эмпирически, а не теоретически ориентированными. Когда я работал над диссертацией, лучшие и самые яркие умы в этих областях занимались прикладной теорией, создавая математические модели, имевшие целью пролить свет на конкретные области экономики. Данные использовались как обоснование для построения модели, и иногда — для дополнительного подкрепления результатов. Но было необычным посвятить всю работу эмпирическому анализу. За эмпирическую проверку той или иной теории брались только менее способные студенты, у которых не было ярких идей и навыков теоретизирования.

В наши дни почти невозможно публиковаться в ведущих журналах двух направлений — экономики развития и мировой экономики, не включив в ста-

15. Даже относительно продвинутое представление посторонних об экономической науке обычно переоценивают жесткость дисциплины и недооценивают возможности изменений. Пример см. в работе Marion Fourcade, Etienne Ollion, and Yann Algan, *The Superiority of Economists*, MaxPo Discussion Paper 14/3 (Paris: Max Planck Sciences Po Center on Coping with Instability in Market Societies, 2014). В статье подчеркивается однородность дисциплины, несмотря на то, что в ней упоминаются многие изменения из числа тех, о которых я говорю далее.

тью серьезный эмпирический анализ. Исследования отраслевых рынков тоже стали более эмпирически ориентированными, хотя и в меньшей степени, чем две других области. Более того, навсегда поменялся взгляд на то, какой эмпирический анализ считается приемлемым. Сегодня стандарты профессии требуют намного большего внимания к качеству данных, выведению причинно-следственных связей из эмпирических свидетельств, и ко множеству ловушек статистического анализа. В целом этот поворот к эмпирике пошел на пользу профессии. Например, в мировой экономике эмпирические исследования дали новые результаты о важности различий в качестве и производительности между фирмами, участвующими в международной торговле, и расширили набор моделей, позволяющих учитывать это обстоятельство. В экономике развития новые данные привели к новациям в политике в сферах здравоохранения, образования и финансов, которые могут улучшить жизни сотен миллионов людей.

Другой способ оценить масштаб трансформации дисциплины — взглянуть на новые области исследований, появившиеся во множестве за последние десятилетия. Три из них заслуживают особого внимания: поведенческая экономика, рандомизированные контролируемые испытания и исследования институтов. Поразительно, что на все три области сильно повлияли (и в сущности дали толчок к их появлению) направления вне экономической науки — соответственно психология, медицина и история. Их рост опровергает обвинение экономической науки в изолированности и игнорировании достижений родственных дисциплин.

В ряде отношений самое сильное отклонение от стандартной экономической науки демонстрирует подъем поведенческой экономики, поскольку

она отвергает ключевую, почти неприкосновенную предпосылку экономических моделей о рациональности индивидов. Постулат рациональности не только оправдан во многих обстоятельствах, но и делает возможным моделирование поведения на основе стандартных математических техник оптимизации, в которых индивиды максимизируют (или, по ситуации, минимизируют) четко определенные функции целеполагания в рамках бюджетных и иных ограничений. Используя подобные техники, экономисты получают конкретные прогнозы того, как потребители будут выбирать, какие товары купить, как сберегают домохозяйства, как инвестируют фирмы, как работники ищут работу и так далее, а также как эти действия зависят от особенностей ситуации.

У данного постулата всегда находились критики из числа экономистов, такие как Герберт Саймон, который призывал использовать идею «ограниченной рациональности», и Ричард Нельсон, который предполагал, что фирмы руководствуются принципом проб и ошибок, а не оптимизации — и это не считая Адама Смита, который был самым первым представителем поведенческой экономики¹⁶. Но самое сильное воздействие на экономический мейнстрим оказали работы Даниэля Канемана и его соавторов¹⁷. Значимость этого вклада подтвердило вручение Нобелевской премии в юбилейном 2002 году

16. Herbert A. Simon, «A Behavioral Model of Rational Choice», *Quarterly Journal of Economics* 69 (February 1955): 99–118; Richard R. Nelson and Sidney G. Winter, *An Evolutionary Theory of Economic Change* (Cambridge, MA: Belknap Press of Harvard University Press, 1982).

17. Daniel Kahneman, Paul Slovic, and Amos Tversky, *Judgement under Uncertainty: Heuristics and Biases* (Cambridge: Cambridge University Press, 1982); Дэниел Канеман, Пол Словик

Канеману — первый случай вручения Нобелевской премии по экономике неэкономисту¹⁸.

Итогом экспериментов Канемана и его коллег стал длинный список поведенческих закономерностей, которые опровергали концепцию рациональности в том виде, как ее использует экономическая наука. Люди больше ценят объект, когда теряют его, чем когда получают (неприятие потери), делают чрезмерные обобщения на основе малого числа наблюдений (излишняя самоуверенность), придают меньшее значение свидетельствам, которые противоречат их представлениям (предвзятость подтверждения), поддаются мимолетным искушениям, хотя знают, что действуют себе во вред (слабый самоконтроль), высоко ценят справедливость и реципрокность (ограниченная эгоистичность) и так далее. Существование подобных типов поведения имеет важные следствия для многих направлений экономической науки. Например, гипотеза эффективности финансовых рынков (см. главу 5) исходит из того, что ожидания инвесторов лишены искажений. Начав встраивать новые результаты в свои модели, экономисты сумели объяснить аномалии финансовых рынков, которые долгое время не удавалось объяснить. Например, явно чрезмерную чувствительность цен активов к новостям можно объяснить склонностью людей более остро реагировать на свежую информацию¹⁹.

и Амос Тверски, *Принятие решений в неопределенности: правила и предубеждения* (Харьков:, 2005).

18. В 2009 году премию получила политолог Элинор Остром за исследования институтов и управления общественными ресурсами.

19. Werner F. M. De Bondt and Richard Thaler, «Does the Stock Market Overreact?», *Journal of Finance* 40, no. 3 (1985): 793–805.

Выводы, полученные в рамках социальной психологии, в дальнейшем применялись ко многим областям принятия решений, таким как сберегательное поведение, выбор медицинского страхования и использование удобрений бедными фермерами²⁰. Поведенческая экономика превратилась из маргинального направления в одну из самых динамично развивающихся областей экономической науки, привлекающую самых талантливых представителей профессии.

Рандомизированные контролируемые испытания — это другой вариант отклонения от стандартов. Они являют собой грандиозный скачок в сторону эмпирически-ориентированных исследований. Их цель — предоставить ясные, недвусмысленные и исчерпывающие данные. Эмпирические исследования в экономической науке всегда страдали от трудностей, сопряженных с выявлением истинных причинно-следственных связей. Мир не станет ждать, пока исследователь тщательно вычисляет, например, как именно субсидирование распространения обработанных инсектицидами надкроватных сеток влияет на заболеваемость малярией. Одновременно происходит множество

20. David Laibson, «Golden Eggs and Hyperbolic Discounting», *Quarterly Journal of Economics* 112, no. 2 (1997): 443–77; Brigitte C. Madrian and Dennis F. Shea, «The Power of Suggestion: Inertia in 401(k) Participation and Savings Behavior», *Quarterly Journal of Economics* 116, no. 4 (2000): 1149–1187; Jeffrey Liebman and Richard Zeckhauser, *Simple Humans, Complex Insurance, Subtle Subsidies*, NBER Working Paper 14330 (Cambridge, MA: National Bureau of Economic Research, 2008); Esther Duflo, Michael Kremer, and Jonathan Robinson, *Nudging Farmers to Use Fertilizer: Theory and Experimental Evidence from Kenya*, NBER Working Paper 15131 (Cambridge, MA: National Bureau of Economic Research, 2009).

других изменений, затемняющих искомый эффект. Экономисты начали изучать подобные вопросы с помощью рандомизации. Как мы видели, можно раздать надкроватные сетки случайно набранной выборке получателей (экспериментальная группа), и тогда не получившие сетки составят контрольную группу. Разница результатов двух групп может трактоваться как эффект вмешательства. Этот подход относительно прост, в сравнении со сложными статистическими техниками. Также он довольно эффективен в плане оценки того, какие меры в конкретном случае работают, а какие нет. Как и ранее, генерализация результатов каждого проекта остается под вопросом, поскольку требует экстраполяции на другие ситуации.

Полевые эксперименты оказались особенно подходящими к условиям бедных стран. Тогда очень много спорили о том, какие меры будут в этих условиях наиболее эффективны, и имелись возможности пробовать разные виды вмешательств. В условиях высокой бедности выигрыш от выявления эффективных вмешательств был очень велик. Некоторые аспекты рандомизированных контролируемых экспериментов остаются спорными. Критики отмечают, что сторонники метода преувеличивают значение результатов полевых экспериментов для изучения причин отставания в развитии и поиска подходящей политики²¹. Но мало кто станет отрицать, что эта новая волна исследований изменила вектор развития экономической

21. Например, см. Angus Deaton, «Instruments of Development: Randomization in the Tropics, and the Search for the Elusive Keys to Economic Development» (Research Program in Development Studies, Center for Health and Wellbeing, Princeton University, January 2009).

науки и обогатила наше понимание многих аспектов жизни развивающихся стран.

Результат полевых экспериментов — детальный анализ отдельных сообществ, зачастую всего одной деревни во всем проекте. Напротив, исследования институционального развития намного ближе к макроуровню, а также охватывают более длительные периоды. В центре внимания — институты, которые сделали возможным современный преуспевающий капитализм: верховенство закона, обеспечение исполнения контрактов и защита прав собственности, демократический строй. Эти исследования напрямую вдохновлены работами из других дисциплин — сравнительных исследований политического развития и истории. Однако выводы других дисциплин были уточнены и сформулированы в виде привычных экономистам моделей. Кроме того, значительные усилия были направлены на то, чтобы проверить идеи других наук с помощью продвинутого эмпирического анализа на основе современных статистических методов.

Несомненными лидерами нового направления стали Дарон Асемоглу, экономист из Массачусетского технологического института, и Джеймс Робинсон, политолог, получивший экономическое образование в Гарварде. Их первый большой исследовательский проект был представлен в статье «Колониальные истоки сравнительного развития» (в соавторстве с Саймоном Джонсоном), которая произвела настоящий фурор²². В статье говорилось, что образцы институтов, навязанные колонизатора-

22. Daron Acemoglu, Simon Johnson, and James A. Robinson, «The Colonial Origins of Comparative Development: An Empirical Investigation», *American Economic Review* 91, no. 5 (December 2001): 1369–1401.

ми много веков назад, по-прежнему влияют на происходящее. Обосновавшись на новых территориях, колонисты формировали институты, защищавшие права собственности и способствовавшие экономическому росту и развитию. Так было в США, Канаде, Австралии и особенно в Новой Зеландии. Там, где местные санитарные условия не позволяли основать поселения с большим количеством жителей, как в большей части Африки, колонисты формировали институты, более подходящие для экспроприации ресурсов и замедлявшие развитие. Необычайный успех статьи был обусловлен не столько самими выводами, сколько творческим подходом авторов к эмпирическому анализу для обоснования своей позиции. Коротко говоря, они привлекли сведения об уровне смертности среди первых западных поселенцев (таких как офицеры и миссионеры), чтобы определить, насколько местная среда колонии благоприятствовала формированию институтов по защите прав собственности²³.

У статьи нашлись свои критики. Но она вызвала волну новых исследований в политэкономии, институциональном развитии и сравнительной экономической истории, воскресив дух прежней эпохи в науках об обществе, когда экономическая наука не стояла особняком как самостоятельная

23. Авторы утверждали, что первые колонисты с большей вероятностью развивали «хорошие» институты там, где были ниже риски смертности. Более того, заболевания, от которых погибали поселенцы, отличались от болезней, поражавших местное население. Эти допущения позволили авторам использовать показатель смертности поселенцев как экзогенный источник различий в качестве институтов, не зависящий от прочих детерминант (таких как близость к торговым маршрутам), которые могли привести к различиям в темпах развития в долгосрочном периоде.

дисциплина. В чем были глубинные причины развития капитализма, помимо таких экономических детерминант, как сбережения и накопление капитала? Почему Испания и Португалия отстали в развитии, хотя были мировыми лидерами в Эпоху великих географических открытий? Каковы долгосрочные экономические последствия этнических или культурных различий? Все это давно известные вопросы, хотя методы, примененные для их решения, были новыми²⁴. Это также «большие» вопросы, проверяющие способность профессии успешно участвовать в разрешении самых значимых проблем в социальных науках.

Эти новые области исследований не дали окончательных ответов, равно как не изменили навсегда лицо экономической науки. Важно другое: они воспользовались знанием из других дисциплин и указали новые направления для экономической мысли. Их пример показывает, что видение экономики как изолированной и вырождающейся дисциплины, закрытой от внешних влияний, — более карикатура, чем реальность.

Амбиции и умеренность

Большая часть критики экономической науки сводится к обвинению, что экономисты применяют неправильные модели. Они должны использовать кейнсианские, марксистские или минскианские модели вместо неоклассических; изучать сторону спроса вместо стороны предложения; опираться

24. Хороший обзор этих работ можно найти в: Daron Acemoglu and James Robinson, *Why Nations Fail: The Origins of Power, Prosperity, and Poverty* (New York: Crown, 2012).

ся на идеи бихевиоризма вместо рациональности; на теорию сетей — вместо принципа методологического индивидуализма; учитывать роль структуры, а не только взаимодействий. Но просто переключиться на альтернативную концепцию, которая тоже не является универсальной и ухватывает только один срез действительности, — это не решение. Как я говорил ранее, на самом деле полезные знания из альтернативных подходов оперативно встраиваются в стандартные экономические модели. Все разделения внутри дисциплины можно объединить, если рассматривать экономику как коллекцию моделей и располагать системой навигации между моделями.

Примеры такого подхода подают самые успешные и знаменитые представители экономической науки. Хороший пример — французский экономист Жан Тироль, получивший в 2014 году Нобелевскую премию за работы по регулированию экономики. Как это обычно бывает, после объявления лауреатов журналисты стали засыпать его просьбами в общих чертах рассказать об исследованиях, принесших ему признание. Но его собеседников ждало разочарование. Тироль отнекивался: «Невозможно в двух словах выразить мой вклад в науку. Все дело в специфике отрасли. Способ регулирования платежных карт не имеет ничего общего с тем, как вы станете регулировать интеллектуальную собственность или деятельность железных дорог. Тут действуют множество идиосинкразических факторов. Именно они делают все таким интересным. Это очень обширная тема... ее не выразить в одном предложении»²⁵.

25. Binyamin Appelbaum, «Q. and A. with Jean Tirole, Economics Nobel Winner», *New York Times*, October 14, 2014 (<http://>

Экономисты, остающиеся верными своей дисциплине, как Тироль, с неизбежностью будут говорить уклончиво. Их наука учит, что категоричные взгляды возможны лишь применительно к крайне узкому кругу вопросов. Их ответами на большинство вопросов заведомо станут «Зависит от обстоятельств»; «Я не знаю», «Дайте мне несколько лет (и исследовательский бюджет) на изучение этой проблемы», «По этому поводу есть три позиции»..., или даже «Предположим, что у нас есть n товаров и k потребителей»... Поэтому они остаются уязвимы к критике за оторванность от жизни, приверженность абстрактным математическим моделям и хитроумной статистике, неспособность внести полезный вклад в изучение общества и решение его проблем.

Но, будучи наукой о компромиссах, экономика детально освещает все «за» и «против»: издержки и выгоды, известное и неизвестное, невозможное и допустимое, возможное и наиболее вероятное. Подобно тому как социальная реальность допускает широкий спектр возможностей, экономические модели напоминают нам о разнообразии сценариев. Разногласия среди экономистов в данных обстоятельствах вполне естественны, а скромность — самая лучшая установка. Для публики будет полезнее узнать о существовании таких разногласий и неопределенностей, чем утешаться обманчивой уверенностью в правильности ответов, предлагаемых экономической наукой.

Скромность также сделает экономистов добропорядочными членами более широкого академического сообщества социальных наук. Если они

станут заранее очерчивать границы своего знания и понимания общества, это поможет закрыть часть разрыва с другими, непозитивистскими традициями в общественных науках. В результате сложится более продуктивный диалог с теми, кто изучает социальную реальность через призму культурологических, гуманитарных, конструктивистских или интерпретационных подходов. Ключевой критический аргумент сторонников альтернативных подходов связан с опорой экономической науки на универсализм и редукционизм²⁶. Но если учесть многообразие экономических моделей и их привязку к определенному контексту, то различия оказываются менее серьезными, чем может показаться на первый взгляд. Например, на вопрос «Какова роль культуры?» экономист не может и не должен ответить «Культура не имеет значения». Он должен ответить «Так, давайте попробуем построить модель влияния культуры» — имея в виду «Давайте прямо перечислим наши предпосылки, причинно-следственный механизм и наблюдаемые следствия». Ни один разумный обществовед не оставит без внимания подобный ход исследования.

Экономисты по-прежнему могут стремиться к более амбициозным целям в роли публичных интеллектуалов и социальных реформаторов. Они могут выступать в защиту определенных мер политики и институтов на многих фронтах — для лучшего распределения ресурсов, высвобождения предпринимательского потенциала, стимулирования экономического роста и обеспечения равенства и борьбы с социальным исключением. Они

26. Например, см. эссе в сборнике: Paul Rabinow and William M. Sullivan, eds., *Interpretive Social Science: A Second Look* (Berkeley: University of California Press, 1987).

могут внести полезный вклад в общественные дискуссии по всем этим вопросам. Знакомство с разнообразными моделями общественной жизни, охватывающими самые разные способы поведения и их результаты, делает экономистов более чуткими к вероятностным сценариям социального прогресса, чем представителей других общественных наук²⁷. Но им нужно опасаться того, что, принимая на себя эту роль, они с неизбежностью выходят за пределы ясно очерченных научных границ своей дисциплины. И это следует проговаривать в явном виде. В противном случае экономисты дадут критикам все основания говорить, что они преступают границы своей компетенции и выдают за науку свои собственные ценностные суждения.

Экономическая наука предлагает множество способов улучшения положения и аналитических инструментов для работы с «большими» общественно значимыми вопросами нашего времени. Чего она не дает, так это однозначных универсальных ответов. Результаты исследований экономистов необходимо сочетать с ценностями, суждениями и оценками этического, политического или практического характера. Последние имеют очень мало общего с экономической наукой как дисциплиной, но являются неотъемлемой частью реального мира.

27. Именно о необходимости такого «вероятностного подхода» всегда говорил великий экономист и обществовед Альберт Хиршман. Он отвергал детерминистские подходы, распространенные в разных общественных науках, которые рассматривают результаты как жестко заданные «структурными» условиями, и напоминал о силе идей и незначительных действий, чье воздействие может оказаться решающим. См.: Philipp H. Lepenies, «Possibilism: An Approach to Problem-Solving Derived from the Life and Work of Albert O. Hirschman», *Development and Change* 39, no. 3 (May 2008): 437–459.

ЭПИЛОГ

Двадцать заповедей

Десять заповедей для экономистов

1. Экономическая наука — это набор моделей; цени их разнообразие.
2. Модель — всегда одна из многих, а не единственно верная.
3. Убедись, что твоя модель достаточно проста, чтобы изолированно рассматривать отдельные случаи и то, как они устроены, но не настолько проста, чтобы упустить из виду ключевые взаимосвязи между причинами.
4. Нереалистичность предпосылок — это нормально; нереалистичность *критически важных* предпосылок — плохо.
5. Мир (почти) полностью состоит из ситуаций «второго наилучшего решения».
6. Чтобы совместить модель с реальным миром, тебе понадобится провести эмпирическую диагностику, которая в большей мере дело техники, чем науки.
7. Не принимай единодушное мнение экономистов за окончательное знание о том, как устроен мир.
8. Не бойся сказать «не знаю», когда тебя спросят про экономику или политику.
9. Эффективность — это еще не все.
10. Подменяя общественные ценности своими, ты подрываешь основы своей профессии.

Десять заповедей для неэкономистов

1. Экономическая наука — это набор моделей, не приводящих к единому предопределенному выводу; отвергай все утверждения об обратном.
2. Не критикуй экономическую модель за ее предпосылки; спроси, как бы изменился результат, если некоторые самые неочевидные предпосылки стали более реалистичными.
3. Анализ требует простоты; опасайся непоследовательности под видом сложности.
4. Не позволяй математике запугать себя; экономисты используют математику не потому, что так уж умны, а потому, что они недостаточно умны.
5. Когда экономист что-то рекомендует, спроси, почему он уверен в том, что использованная им модель применима к данной проблеме.
6. Когда экономист использует термин «экономическое благополучие», спроси, что он имеет в виду.
7. Будь готов к тому, что экономист будет говорить одно на публике и другое — на семинаре.
8. Хотя экономисты (не все) и поклоняются рынку, но они знают о работе рынков больше тебя.
9. Если ты думаешь, что все экономисты мыслят одинаково, сходи на один из их семинаров.
10. Если ты думаешь, что экономисты особенно грубо обращаются с неэкономистами, сходи на один из их семинаров.

Научное издание

ДЭНИ РОДРИК
ЭКОНОМИКА РЕШАЕТ:
Сила и слабость «мрачной науки»

Главный редактор издательства Валерий Анашвили
Научный редактор издательства Артем Смирнов
Выпускающий редактор Елена Попова
Корректор Наталия Селина
Дизайн обложки Владимир Вертинский
Дизайн и верстка Сергей Зиновьев

Издательство Института Гайдара
125009, Москва, Газетный пер., д. 3-5, стр. 1

✠

Подписано в печать 25.01.2015.
Тираж 1000 экз. Формат 84×108/32. Заказ № 788.
Отпечатано способом ролевой струйной печати
в филиале «Чеховский Печатный Двор»
АО «Первая Образцовая типография»
142300, Московская обл., г. Чехов, ул. Полиграфистов, 1
Сайт: www.chpd.ru. Телефон (499) 270-73-59

**ИЗДАТЕЛЬСТВО
ИНСТИТУТА
ГАЙДАРА**

Спрашивайте в книжных магазинах

МОСКВА

Академия, специализированные магазины деловой книги в РАНХиГС, просп. Вернадского, 82,

(499) 270-29-78

Москва, ул. Тверская, 8, стр.1, (495) 629-64-83, 797-87-17

Москва на Воздвиженке, ул. Воздвиженка, 4/7, стр. 1,

(495) 797-87-17

Библио-глобус, ул. Мясницкая, 6/3, стр.1,

(495) 781-19-00

Московский дом книги, ул. Новый Арбат, 8,

(495) 789-35-91

Молодая гвардия, ул. Большая Полянка, 28,

(495) 780-33-70

Фаланстер, М. Гнездииковский пер., 12/27, стр. 3,

(495) 629-88-21, 504-47-95 falanster@mail.ru

Фаланстер на Винзаводе, 4-й Сыромятнический пер., 1,

стр. 6, (495) 926-30-42

Книжный клуб 36,6, ул. Бакунинская, 71, стр.10,

(495) 926-45-44

Аргумент, Ленинские горы, МГУ, д. 1, сектор «Б»,

(495) 939-42-95

Дом педагогической книги, (495) 629-54-35

Дом книги На Соколе, (499) 155-38-82

Циолковский, Пятницкий пер., 8, стр. 1,

(495) 951-19-02, primuzee@gmail.com

У Кентавра, книжная лавка в РГГУ, ул. Чайнова, 15,

(499) 973-43-01

БукВышка, университетский книжный магазин

(ВШЭ), ул. Мясницкая, 20, (495) 628-29-60

Гнозис, Турчанинов пер., 4, (499) 255-77-57

Додо Азов, Азовская ул., 24, корп. 3 (ТРЦ «Азовский»),
(926) 417-53-58

Додо Меридиан, Профсоюзная ул., 61 (ЦКИ
«Меридиан»), (915) 418-60-27

Додо Спейс, ул. Мясницкая, 7, стр. 2, (926) 044-15-61,
dodo.shops@gmail.com

Додо в Культурном центре ЗИЛ, ул. Восточная, 4,
корп. 1, (495) 675-16-36

Додо Царицыно, Визит-центр Государственный
музей-заповедник «Царицыно», ул. Тюриня
**Книжная экспедиция Управления делами
Президента Российской Федерации**: центральный
салон и 22 торговые секции, ул. Варварка, 9,
(495) 606-52-94

Книжный магазин «Тортуга», ул. Старая
Басманная, 15, (Сад им. Баумана), (926) 463-72-33,
tortugabookshop@gmail.com

ММОМА Art Book Shop в Институте *Strelka in Russian*,
Берсеневская наб., 14, стр. 5А

Ходасевич, Покровка, 6, +7-965-179-34-98

Гараж, павильон Центра «Гараж», Пионерский пруд,
Парк Горького, (495) 645-05-21

Сеть Читай-Город (Новый книжный), (495) 937-85-81,
177-22-11

Сеть Академкнига

ул. Вавилова, 55/7, (499) 124-55-00

Мичуринский просп., 12, (499) 932-74-79

Цветной б-р, 21, стр. 2, (499) 921-55-96

САНКТ-ПЕТЕРБУРГ

Санкт-Петербургский дом книги, Невский просп., 28
(дом Зингера), (812) 448-23-55

Подписные издания, Литейный просп., 57,
(812) 273-50-53

Порядок слов, наб. р. Фонтанки, 15, (812) 310-50-36

Все свободны, Мойка, 28, +7-911-977-40-47

Дом университетской книги (Издательство СПбГУ),
Менделеевская линия, 5, (812) 329-24-70, 329-24-71,
vitanova@spbu.ru

Свои Книги, ул. Репина, 41, (812) 966-16-91,



Институт экономической политики
имени Егора Тимуровича Гайдара —
крупнейший российский научно-исследова-
тельский и учебно-методический центр.

Институт экономической политики был
учрежден Академией народного хозяйства
в 1990 году. С 1992 по 2009 год был известен
как Институт экономики переходного
периода, бессменным руководителем
которого был Е. Т. Гайдар.

В 2010 году по инициативе коллектива
в соответствии с Указом Президента РФ
от 14 мая 2010 г. № 601 институт вернулся
к исходному наименованию, и ему было
присвоено имя Е. Т. Гайдара.

Издательство Института Гайдара основано
в 2010 году. Задачей издательства является
публикация отечественных и зарубежных
исследований в области экономических,
социальных и гуманитарных наук, трудов
классиков и современников.