

Хохич Дмитро Григорович

*к.е.н, доцент, докторант кафедри економічної теорії
ДВНЗ «Київський національний економічний університет
імені Вадима Гетьмана»*

ТАРГЕТУВАННЯ ДІЛОВОГО ЦИКЛУ: МЕТОД ТІНБЕРГЕНА

В передмові до книги Я. Тінбергена, першого лауреата Нобелівської премії з економіки «Метод і його застосування в інвестиційній активності (статистичне тестування теорії ділового циклу)» (1939 р.) вказується на те, що її потрібно вважати початком другого етапу дослідження ділового циклу, що здійснюється під егідою Ліги націй. (Першим етапом була робота проф. фон Хаберлела «Процвітання і депресія»). Кінцева мета цих досліджень полягає в статистичній перевірці альтернативних теорій ділового циклу, наведених фон Хаберлером. Мова йде виключно про статистичний метод, який пропонується використовувати для аналізу економічних фаз ділового циклу.

В першій главі книги, Тінберген розглядає деякі логічні проблеми пов'язані з цим методом; в другій главі він в загальному вигляді описує аналіз множинних кореляцій; в наступних трьох главах він застосовує свій метод до вивчення трьох предметних областей, а саме коливання інвестиційної активності, житлового будівництва та інвестицій в рухомий склад залізничі.

Друга глава, в якій міститься короткий і зрозумілий виклад статистичного методу, має неабияке значення для розуміння того як потрібно застосувати даний метод в економічному аналізі.

Для розуміння статистичного методу Тінбергена, звернемося до методології Дж. Кейнса, який вступив з ним в дискусію з приводу практичного застосування цього методу при дослідженні явищ і процесів економічної динаміки. Суть дискусії зводиться до того, чи потрібно трактувати економіку як точну науку, а відповідно чи претендує на визнання та достовірність висновків кількісний (статистичний) метод в академічному середовищі.

Тінберген підкреслює значення статистики в економічному аналізі. Він пише: «Важливо враховувати, яку роль відіграє статистик в цьому аналізі. Теорії, які він піддає перевірці, дістаються йому від економіста. Відповідно, відповідальність за них повинна покладатися на економіста, оскільки жоден статистичний тест не здатен довести достовірність теорії» Однак чи здатний статистичний тест довести, що теорія невірна? Тут Тінберген уточнює: «Можливо насправді довести, що теорія невірна або в меншій мірі неповна, якщо продемонструвати, що під неї не підпадає певний набір фактів» [1, с. 12]. Але чи не заходить він дуже далеко? Можна показати, що невірні в кращому випадку тільки ті теорії, де з точки зору економіста, що висунув їх, приймаються різні умови.

Так чи інакше, Тінберген погоджується з тим, що основна задача, що вирішується за допомогою його методу зводиться до розуміння того, в якій мірі проявляється кожне з причинно-наслідкових відношень, у випадку якщо до того їх якісний характер був вірно проаналізований економістом. Коли наперед відомо, які вихідні причини (і коли дотримані всі інші умови), що стосуються адекватності пропонованого методу, Тінберген, володіючи статистичними фактами, заявляє, що він в змозі вказати, наскільки важлива та чи інша причина в кількісному відношенні. Якщо заздалегідь відомо (припускаючи, що умови про які буде сказано далі, будуть виконані), що ділові цикли в якійсь мірі залежать від поточної ставки відсотка, а в якійсь – від коефіцієнту народжуваності двадцятирічної давності і що вони є незалежними факторами в лінійному кореляційному взаємозв'язку, – то виявляється, що цей метод здатен виявити їх відносну значимість. Економісту спростувати таку теорію буде достатньо складно, оскільки потрібно довести, що дані фактори не є істинними причинами такого впливу, або вони залежать один від одного, або кореляції не лінійні, або наявні інші важливі властивості економічного середовища, в силу яких на протязі певного періоду часу це середовище неоднорідне (можливо через вплив нестатистичних факторів).

Дослідницький потенціал даного методу в основному залежить від економіста, який повинен представити не просто той чи інший перелік підходящих значимих причин, а повний їх

перелік. Наприклад, припустимо приймаються до уваги три фактори; навіть, якщо вони дійсно істинні, цього не достатньо; інших значимих факторів не повинно бути. Якщо існує додатковий, не врахований фактор, то, користуючись даним методом, ми не в змозі виявити відносно кількісну значимість перших трьох. Якщо це дійсно так, то даний метод має практичне застосування, тільки коли економіст здатен заздалегідь представити правильний і бездоганно повний аналіз значимих факторів. На думку, Тінбергена, цей метод не пов'язаний ні з науковими відкриттями, ні з критикою вже отриманих результатів. Він являє собою спосіб надання кількісної визначеності тому, що досліднику і так вже відомо після проведеного теоретичного аналізу, – за певної умови.

Ця умова полягає в тому, що всі значимі фактори повинні бути вимірними, і можливо, слід додати, що дослідник повинен володіти адекватними статистичними засобами для їх кількісного виміру. Тінберген особливо виділяє цю умову: «наше дослідження за своєю природою обмежується вивченням тих явищ, які можна виміряти. Розуміється, явища, що не підлягають кількісному виміру можуть інколи здійснювати важливий вплив на хід розвитку подій; тому результати представленого аналізу слід доповнити інформацією про ступінь подібного впливу; цю інформацію можна отримати з інших джерел». [1, с. 11] Таким чином, Тінберген стверджує, що його метод можна з користю застосовувати, якщо тільки деякі фактори можна виміряти, а результати вивчення цих факторів доповнюються іншою інформацією. Але він не говорить нам, як саме це можна зробити. Його метод вирахування відносної значимості вимірних факторів суттєвим чином залежить від передумови, згідно якої вони містять вичерпну інформацію.

Вимога вимірності всіх значимих факторів є надзвичайно важливою. Адже ця умова виключає із сфери застосування даного методу всі ті економічні задачі, в рамках яких можуть бути значимі політичні, соціальні і психологічні фактори, такі як урядова політика, прогрес в області наукових винаходів і очікування. Зокрема, через це, на думку Кейнса, цей метод складно застосувати до проблеми ділового циклу, що пояснюється наступним чином.

По-перше, чи потрібно проводити попередній аналіз до того моменту, щоб впевнитися в незалежності факторів, що підлягають аналізу? Адже при використанні факторів, що не є повністю незалежними, дослідники зіштовхуються з серйозними труднощами, що вводять в оману, так звану «хибною» кореляцією. По-друге, Тінберген займаючись «аналізом послідовностей» працює з неодночасними подіями та часовими лагами. Однак, що виникне, якщо досліджуване явище саме впливає на фактори за допомогою яких проводиться аналіз? Наприклад, досліджуючи інвестиційні коливання, Тінберген ставить їх в залежність від коливання норми прибутку. Але що, якщо коливання норми прибутку саме частково залежать від коливання інвестицій? В зв'язку з цим, Тінберген вказує на труднощі «в загальному вигляді», де він наголошує, що «потрібно проявляти акуратність» [1, с. 17]. Далі вказує на те, що труднощі можна подолати завдяки деякому корегуванню часового лагу [1, с. 39]. Досліднику не так легко опанувати, яким способом Тінберген вирішує подібного роду логічну проблему, щоб можна було до кінця її зрозуміти. По-третє, на практиці, залежність базових факторів один від одного має важливе значення. Наприклад, для Тінбергена базовими факторами для коливання інвестицій є: прибуток, ціна капітальних благ, процентні ставки, норма прибутку, індекс виробництва споживчих благ, темп росту загального рівня цін. Незалежність базових факторів один від одного має важливе значення для дослідника. Нехтуючи даною умовою в методі Тінбергена, можна отримати недостовірні висновки, що призводять оптимістично налаштованих статистиків до «хибної» кореляції.

Метод Тінбергена направлений на таргетування рядів економічної динаміки, але має суттєві недоліки. Як зазначає, Кейнс в критиці метода Тінбергена, кінцевою його метою є доведення чи спростування будь-якої теорії на якісному рівні, а також визначення кількісних орієнтирів на майбутнє, тобто перехід від статистичного опису до індуктивного узагальнення у випадку простої кореляції [2, с. 560].

В епоху множинної кореляції, практика в такому відношенні не зазнала суттєвих змін. Найважливіша умова полягає в тому, що економічне середовище на протязі деякого

періоду часу повинно залишатися незмінним і однорідним у всіх значимих відношеннях, за виключенням тих факторів, які дослідник розглядає окремо. Ми не можемо бути впевнені, що такі умови збережуться в майбутньому, навіть якщо знаходимо їх у минулому. Але, якщо такі умови все таки знаходяться у минулому, то в такому випадку виникає деяка основа для індуктивного аналізу. Головне протиріччя застосування методу множинної кореляції до аналізу складних економічних проблем полягає в очевидній відсутності будь-якого адекватного ступеня однорідності економічного середовища.

Список використаних джерел

1. Tinbergen J. A Method and its Applications to Investment Activity. (Statistical Testing of Business-Cycle Theories I.) Geneva: League of Nations, 1993.
2. Keynes J. M. Professor Tinbergen's Method // The Economic Journal. 1939. Vol. 49, №195. P. 558 – 570.

Волкова Олена Михайлівна

*к.е.н., доцент кафедри економічної теорії
ДВНЗ «Київський національний економічний університет
імені Вадима Гетьмана»*

РОЛЬ ДЕРЖАВИ У БОРОТЬБІ З БІДНІСТЮ

Світ сучасного суспільства, пронизаний інформаційними технологіями, має контрастну картину за рівнем розвитку населення. На цьому фоні проблема бідності є однією з найбільшочіших і такою, що ламає гармонію та цілісність міжнародного суспільного розвитку. Вона несе за собою не тільки матеріальні труднощі, низький поріг реалізації особистості, але й психологічний дискомфорт, синдром бідності, який обмежує людину у її розвитку. Також бідність стає спусковим курком таких деструктивних явищ як війни, революційні заворушення, голод, хвороби тощо. Тому виникає питання щодо ефективності процесів суспільної організації та самоорганізації, які проявляються у вигляді конкуренції,