

Ю. М. Лелюк,
к. е. н., Полтавська державна аграрна академія

ІНТЕГРАЦІЯ ІНТЕРНАЛЬНИХ ТА ЕКСТЕРНАЛЬНИХ ТЕОРІЙ ЦИКЛУ В КОНТЕКСТІ ІМПУЛЬСНО-РОЗПОВСЮДЖУВАЛЬНОГО ПІДХОДУ

В статті з позицій імпульсно-розповсюджувального підходу розглядаються можливі напрями дослідження сучасної циклічної динаміки. Наголошується на недопустимості механістичного використання методології фізичної науки при аналізі економічних циклів. Особлива увага приділяється проблемі "імітаційної пульсації" та виникненню "хибних" циклів. Доводиться, що факторами, які зумовили переключення режиму хвилеподібного ряду під час світової фінансової кризи виступили екологічні фактори.

The article deals with the possible directions of modern cyclical dynamics investigations in the context of impact extended approach. The fact of infeasibility of the physical methods mechanical applying is stressed. The paper is concerned with problems of "imitative pulsation" and "erroneous" cycles by Y. Slutskiy. It is proved, that ecological factors were the ones the wave regime switching at the time of world financial crisis was determined by.

Ключові слова: інтернальні та екстернальні теорії циклу, імпульсно-розповсюджувальний підхід, екзогенні та ендегенні фактори циклу, екологічні фактори циклу, "хибні" цикли Є. Слуцького, антициклічна політика.

Key words: internal and external cycle theories, impact extended approach, exogenous and endogenous cycle factors, ecological cycle factors, "erroneous" cycles by Y. Slutskiy, anticyclical policy.

АКТУАЛЬНІСТЬ ПРОБЛЕМИ

Світова фінансова криза 2008—2010 років наочно довела, що економічна наука не здатна адекватно виконувати одну із найважливіших своїх функцій — прогностичну. Це зумовило активізацію дискусії в професійному середовищі економістів щодо напрямів зміни як методології економічних досліджень, так і наукової парадигми економічної науки в цілому. Особлива увага при цьому приділяється проблематиці циклічної динаміки економічних систем. На наш погляд, це не є випадковим, оскільки цикл виступає як форма існування економіки і всі економічні процеси об'єктивно підпорядковані циклічному руху. У зв'язку з цим вивчення механізмів циклоутворення як національних економік, так і світової економічної системи в сучасних умовах набуває особливої гостроти та актуальності.

Між тим, в економічній науці не існує єдиного загально визнаного теоретичного підходу до пояснення циклічних коливань. Всі теорії циклу поділяються на інтернальні (пояснюють виникнення коливань ділової активності внутрішніми причинами самої економічної системи) та екстернальні теорії (пояснюють циклічні коливання зовнішніми причинами). Зазвичай екстернальні теорії циклу розглядають як такі, що вважають першопричиною коливань зовнішні (по відношенню до економічної системи) шоки: наприклад, розповсюдження нової технології, зміну цін на енергоносії тощо. Але, як на наш погляд, екстернальні причини виникнення циклічних коливань повинні розглядатися більш широко: з одного боку, у контексті розуміння економіки як відкритої системи, що втягнена у різнопланові глобалізаційні процеси, а з іншого боку — у контексті розуміння економічної системи як складової загальної біо-соціальної системи.

Протиставлення інтернальних та екстернальних теорій циклу не сприяє розумінню циклічної природи економічного розвитку та обґрунтуванню релевантних методів антициклічної політики. Очевидно, що кожна теорія циклу зі своїх позицій більш-менш адекватно відображає певну причину циклічної динаміки. Але, оскільки економіка відноситься до типу складних систем, пояснити її циклічний рух тільки з позицій "одна причина — одна прогнозована група наслідків" неможливо. Саме тому аналіз циклічної динаміки повинен базуватися на комплексному застосуванні різних теоретичних та методологічних підходів.

АНАЛІЗ ОСТАННІХ НАУКОВИХ ДОСЛІДЖЕНЬ ТА ПУБЛІКАЦІЙ

До екстернальних теорій традиційно відносять теорію нововведень (цикл пояснюється стрибкоподібним використанням у виробництві важливих науково-технічних відкриттів), розроблену Й. Шумпетером та Е. Хансеном; психологічну теорію (циклічний рух економіки пов'язується із хвилями оптимізму та песимізму, які охоплюють населення), представлену в роботах А. Пігу, Дж. Кейнса та інших; теорію сонячних плям (виникнення економічних циклів пов'язується із сонячною активністю та виникненням плям на Сонці), започатковану У. Джебсонсом; та інші теорії. До інтернальних теорій відносять теорію промислових циклів К. Маркса та Ф. Енгельса, кредитно-грошові концепції Р. Хоутрі та І. Фішера, теорію недоспоживання Ж. Сисмонді, теорію перенагромадження капіталу М. Туган-Барановського та Г. Каселя та інші. Важливим є висновок, який можна зробити з інтернальних та екстернальних теорій циклу: якщо циклічні коливання породжуються екстернальними факторами, то цикл є регулярним, якщо інтернальними — нерегулярним, а якщо діють і екстернальні, і інтернальні фактори, то чіткої регулярності не спостерігається. У роботах Є. Слуцького, Р. Фріша, Ф. Кідланда, Е. Прескотта циклічні коливання розглядаються як результат впливу на економічну систему випадкових шоків, що порушують економічну рівновагу і викликають, у свою чергу, внутрішні коливання самої економічної системи. У сучасній економічній літературі, на жаль, недостатньо розроблені фундаментальні питання дослідження механізму циклоутворення, не показана багаторівневість його дії та сучасні закономірності його функціонування. Відповідно недостатньо відпрацьована методологія антициклічної політики.

МЕТА РОБОТИ

Метою даної статті є обґрунтування напрямів використання імпульсно-розповсюджувального підходу як такого, що дозволяє поєднати екстернальні та інтернальні теорії циклу при аналізі сучасної циклічної динаміки.

ВИКЛАД ОСНОВНОГО МАТЕРІАЛУ ДОСЛІДЖЕННЯ

Досягти певної інтеграції інтернального та екстернального підходів дозволяє, як на наш погляд, імпульс-

но-розповсюджувальний підхід. Він був обґрунтований в працях Є. Слуцького і отримав подальший розвиток в роботах лауреата Нобелівської премії 1969 року Рагнара Фріша [5, с. 49]. Згідно з підходом "імпульс — розповсюдження", економіка стикається із великою кількістю імпульсів, які дають поштовх циклічним коливанням. Поширення цих коливань за допомогою дії мультиплікатора та акселератора повинно мати затухаючий характер. Але, оскільки подібних імпульсів багато, то економічна система, відчуваючи постійні зовнішні поштовхи (наукові відкриття, зміна політичних сил, що прийшли до влади, різкі зміни відносних цін на ті чи інші блага, війни та революції тощо), опиняється в ситуації, що характеризується постійними циклічними коливаннями різної сили та тривалості. Таким чином, поштовхом до виникнення циклічних коливань виступають зовнішні причини, а механізми їхнього розповсюдження описуються внутрішніми факторами.

Подібна інтеграція інтервальних та екстервальних теорій в межах імпульсно-розповсюджувального підходу може створити підвалини для формування напрямів дослідження, що матимуть неодноточні наслідки не тільки для процесів циклоутворення, але й для економічної науки в цілому. Один з таких напрямів, як на наш погляд, містить приховану загрозу для розвитку економічної методології. Загроза ця полягає в наступному. Якщо розглядати зовнішні імпульси та викликані ними коливання, то начебто логічно використовувати при аналізі подібних коливань певні фізичні закономірності. Йдеться, зокрема, про використання методів "квантової теорії і статистичної термодинаміки, які гарантують виникнення флуктуацій, для розв'язання важливих фінансових проблем" [6, с. 14]. У зв'язку з цим з'являється навіть новий напрям — еконофізика, що застосовує методологію фізики для аналізу економічних процесів. Не ставлячи під сумнів можливість існування подібної науки або можливість використання методології інших наук при поясненні економічних процесів (оскільки Світ єдиний, то і методи пояснення явищ у різних сферах життя можуть бути схожими), зауважимо, що економічна наука має свої специфічні методи пізнання і свій предмет дослідження. Той факт, що сучасна економічна наука опинилася в певному кризовому стані і уточнює як свій предмет, так і свою методологію, не означає заперечення економіки як науки. Подальший розвиток еконофізики в цілому, і циклів з позицій біфуркацій та другого закону термодинаміки призведе, як на наш погляд, до більш глибокого рівня математизації методологічного апарату економічної науки. Але саме в цьому ми і бачимо загрозу. Адже математизація економіки, що активно відбувалася в другій половині ХХ століття, призвела до підміни економічної теорії та політичної економії іншою наукою — економетрикою. Між тим, жодна прикладна наука (і економетрика в тому числі) не може розвиватися без теоретичної основи. Ігнорування різноманітних соціально-економічних факторів (наприклад, інститутів чи поведінкових особливостей ринкових акторів) призвело до того, що економічна наука в цілому втратила можливість адекватно пояснювати сучасні економічні процеси, а її математизовані напрями перетворилися у набори моделей та систем рівнянь, які в угоду математичній "красі" ігнорують величезні групи змінних, що характеризують імпульси циклічної динаміки [3, с. 62]. Це у жодному разі не означає, що ми закликаємо відмовитися від математичного апарату дослідження економічних явищ у цілому та циклів зокрема. Ми визнаємо, що найцікавіші відкриття відбуваються саме на стику різних наук, тому синтез підходів з позицій фізики і економіки цілком можливий. Але ми підкреслюємо: використання методології фізики чи математики при дослідженні економічних процесів має обмежений (допоміжний) характер, а сама економічна наука має як свій методологічний інструментарій, так і свій предмет дослідження. Проблема, як на наш погляд, має дві площини. Перша полягає у різному розумінні невизначеності в економіці та у фізиці чи математиці. Якщо

для останніх невизначеність "вписується" у розуміння теорії ймовірностей (існує кількісно описана ймовірність настання чи ненастання певної події), то для економіки, за словами Кейнса, це принципово інша невизначеність: ми просто не знаємо і не можемо знати, скажімо, ціну на мідь через двадцять років. Тому використання математичних підходів в економіці або перехід до еконофізики повинні мати обмежений характер. Друга площина проблеми має онтологічний аспект і стосується питань, пов'язаних зі структурою наукового знання в цілому. В економічній науці в явній чи неявній формі передбачається уявлення про загальну структуру світу. Але, якщо йдеться про структуру світу, то повинні розглядатися і різноманітні взаємозв'язки між елементами такої структури, у тому числі — і між економічними явищами та законами [1]. Відповідно, уявлення про структуру світу, які є панівними на даний період часу у фізиці, не можуть не впливати на економічну онтологію. У той же час встановлення схожих рис між науковим фізичним знанням та економічним знанням, а також виділення у фізиці та економіці онтологічних засад, дозволяє говорити про можливість використання результатів, отриманих під час дослідження онтологічних основ наукового фізичного знання для аналізу основ економічного знання [8, с. 49]. В економічній науці часто проводяться паралелі між економічним та фізичним знанням, зокрема при поясненні маржиналізму; аналогічно можна провести певні паралелі між класичними та неокласичними економічними теоріями, з одного боку, та субстанціональною та реляційною парадигмами у фізичному науковому знанні — з іншого боку [8, с. 51]. Але навіть у такій площині не йдеться про механічне перенесення методології однієї науки на іншу і заміну економічної науки на еконофізику.

Перспективним, як на наш погляд, напрямом дослідження циклічної динаміки в контексті імпульсно-розповсюджувального підходу є аналіз зовнішніх імпульсів, що породжуються системою більш високого рівня, ніж суто економічна система: ноосферою, за термінологією Вернадського. Спробуємо обґрунтувати свою позицію детальніше.

Перш за все варто зазначити, що ми згодні з позицією С.Ю. Румянцевой щодо розуміння необхідності узагальнення закономірностей економічного циклу для виявлення найпростіших абстрактних механізмів з метою створення логічної бази для розуміння конкретних та конкретно-всезагальних проявів економічної динаміки. Внутрішній механізм економічного циклу дозволяє визначити, чи є той або інший прояв циклічної динаміки іманентним даній економічній системі. Якщо цикл не має внутрішніх джерел свого руху в даній економічній системі, а привнесений в її структуру ззовні, з боку інших економічних систем, то він не притаманний даній системі. Відповідно, у цій ситуації таким циклом ефективно управляти не можна — управляти циклічним механізмом можна лише тоді, коли його джерело знаходиться всередині керованої системи. Система із циклами, привнесеними ззовні, буде підпорядкованою іншій системі, для якої ці цикли мають внутрішній механізм розвитку. Таким чином, система із іманентними циклами здатна здійснювати вплив на динаміку інших систем, пов'язаних із нею ланцюжками зворотних зв'язків [7, с. 32].

Для рівня національної економіки такими циклами, що не іманентні їй, а привнесені ззовні і викликають значні коливання ринкової кон'юнктури, виступають, наприклад, цикли системи більш високого порядку — глобальної економіки. Прикладом може служити сучасна спадна хвиля довгого циклу, що має джерело в іншій країні (наприклад, США), але знаходить свій прояв у циклічних коливаннях української економіки як цикл, що не має ендогенної природи. Проте розуміння системи більш високого порядку по відношенню до національної економіки не повинно обмежуватися лише розглядом суто економічної площини (двомірним простором). Дійсно, з такої позиції саме глобальна економіка виступає для національної економіки системою більш високого порядку. Та якщо перейти до

своєрідного "тримірному простору", то для економічної системи такою системою більш високого порядку виступає ноосфера. І, відповідно, притаманні їй механізми внутрішнього руху (або порушення дії цих механізмів) неминуче викликають циклічні коливання в системі нижчого рівня — національній та глобальній економіці.

Як відомо, свого часу Є. Слуцький обґрунтував гіпотезу про генерування так званих "хибних" циклів. Було сформульовано аргументи, які повинні були викликати сумнів у М. Кондратьєва щодо побудови економічної теорії на основі довгих хвиль. Перший з цих аргументів полягав в тому, що при багаторазовому складанні випадкових чисел методом ковзної середньої (яким користувався М. Кондратьєв) можна отримати хвилюподібні процеси; інакше кажучи, джерелом циклічних коливань може виступати складання випадкових причин. Згідно з другим аргументом, отримані хвилюподібні ряди мають тенденцію до імітації гармонійних рядів (протягом більшої або меншої кількості хвиль) і характеризуються приблизною періодичністю. Через певну кількість періодів цей режим порушується, при цьому перехід до іншого режиму може здійснюватися або поступово від одного "середнього" режиму до іншого такого ж, або ж різко, раптово — до принципово іншого режиму, поблизу особливих критичних точок. Отже, певна "правильність" притаманна навіть хаосу рядів, що не мають внутрішнього зв'язку [4, с. 25].

Високо цінуючи підхід Туган-Барановського та Кондратьєва до теоретичного осмислення природи економічних циклів, Є. Слуцький, таким чином, застерігав від можливої помилки при аналізі статистичних рядів макроекономічних показників: за гармонійні ряди, яким притаманні циклічні коливання, можна помилково прийняти імітацію гармонійних рядів із приблизною періодичністю [4, с. 28]. Така "імітаційна пульсація", що викликана не внутрішніми причинами, притаманними економічній системі, а зовнішніми (по відношенню до економічної сфери) поштовхами може створювати враження, нібито є внутрішньою циклічною динамікою економіки. Відповідно, державна антициклічна політика, спрямована на пом'якшення таких коливань, матиме вкрай низьку ефективність, що наближається до нульових значень, оскільки методи та механізми такої політики спрямовані на внутрішні елементи системи, у той час як хвилюподібні коливання викликані зовнішніми елементами. Як на наш погляд, незадовільна результативність антициклічних заходів, що вживалися урядами країн під час розгортання світової фінансової кризи, значною мірою може бути пояснена саме тим, що вони мали інтервальний характер, у той час як причини, що зумовили "переключення режиму хвилюподібного ряду" мали екстернальний характер.

Останнім часом серед економістів все частіше висловлюється точка зору щодо унікальності світової фінансової кризи 2008—2010 років; аналізується її структурний, цивілізаційний характер тощо. Якщо за робочу гіпотезу прийняти, що сама криза була моментом переключення режимів коливань "хибних" циклів поблизу певної критичної точки (за Є. Слуцьким), то "нетиповість" кризи можна пояснити саме хвилюподібним характером коливань, породжених зовнішніми факторами. Але логічно виникає питання: які саме фактори виступили в цій ситуації зовнішніми? Інакше кажучи: яка система більш високого порядку зумовила через механізм обернених зв'язків "хибні" цикли в економічній системі?

Відповідь, на наш погляд, є очевидною. Такою системою більш високого порядку могла бути тільки екологічна система. Ми розділяємо позицію А.А. Вугальтера: оскільки природне середовище руйнується не стільки природним шляхом, скільки внаслідок діяльності людини, то і завданням людини в процесі власного життєзабезпечення є постійне відновлення власної екологічної ніші, при цьому момент відновлення включає в себе і процес руйнування. Вирішення цього завдання було певним чином відкладено епохою цивілізації (період зсуву у часі) і тільки зараз починає себе реалізовувати [2, с. 16]. На-

громаджені проблеми в екологічній сфері мають лавиноподібний рух і поступовими, "косметично-ремонтними" методами вже, очевидно, вирішені бути не можуть. У контексті проблематики даної статті нас цікавить, що саме вони впливають на систему більш низького порядку — економічну, породжуючи в ній "хибні" цикли.

На абстрактному рівні економічний цикл (як породжений внутрішніми причинами, так і "хибний") може бути представлений як сукупність процесів, що відображають кількісні та якісні прояви економічних змін [7, с. 32]. Кількісні характеристики циклу, зумовленого екологічними причинами, можуть бути описані за допомогою, наприклад, динаміки цін на енергоносії, або показників інтенсивності використання природних ресурсів. Якісні прояви економічних змін у такому циклі описуються, наприклад, використанням певного типу енергоносія, ступенем його вичерпаності, його доступністю тощо. Введення подібних показників до системи індикаторів циклу дозволить більш якісно прогнозувати циклічну динаміку та сприятиме визначенню найбільш релевантних заходів державної антициклічної політики.

ВИСНОВКИ

Таким чином, використання імпульсно-росповсюджувального підходу при визначенні механізмів виникнення та поширення циклів повинно здійснюватися не механістично (шляхом простого "перенесення" законів фізики при аналізі економічних імпульсів та переходом від економіки до екофізики), а через усвідомлення природи економічного циклу як форми руху економічної матерії, розуміння взаємозв'язку ендегенних та егзогенних факторів циклоутворення, виокремлення іманентних економічній системі циклів та визначення екстернальних факторів, що породжують "хибні цикли". Все це матиме не тільки теоретичне, але й практичне значення: цільова спрямованість державної антициклічної політики повинна зосереджуватися на вирішенні проблем, пов'язаних із першопричиною циклу, а не на ліквідації наслідків. Це дозволить суттєво підвищити ефективність державного антициклічного регулювання.

Література:

1. Бодырев И. Онтология ортодоксальной экономической науки: проблемы построения и интерпретации [Электронный ресурс]. — Режим доступа: <http://institutions.com/general/1076-ontologiya-ortodoksalnoj-ekonomicheskoy-nauki>.
2. Вугальтер А.А. Логика общественно-экономического процесса / А.А.Вугальтер. — Киев: Ника-Центр, 2001. — 235 с.
3. Ефимов В.М. Дискурсивный анализ в экономике: пересмотр методологии и истории экономической науки / В.М. Ефимов // Вопросы регулирования экономики. — 2011. — Том 2. — № 3. — С. 5—79.
4. Ключин П.М. Є.Є. Слуцький та російська економічна думка першої третини ХХ ст.: штрихи до портрету економіста-теоретика / П.М. Ключин // Історія народного господарства та економічної думки України. — 2009. — Вип. 42. — С. 17—30.
5. Лоуса Ф. Вклад Евгения Слуцкого в анализ экономических циклов / Лоуса Ф. // Экономическая школа. — Вып. 5. — С.-Петербург, 1999. — С. 49—55.
6. Моцний Ф. Економіка — фізична наука? / Ф. Моцний // Дзеркало тижня. — 2010. — № 17 (30 квітня — 14 травня 2010 р.). — С. 14.
7. Румянцева С.Ю. Проблема движения экономической материи и механизм экономического цикла / С.Ю. Румянцева // Проблемы современной экономики. — 2012. — № 1 (41). — С. 29—34.
8. Тарароев Я.В. Онтологические основания физического знания и современная экономическая теория / Я.В. Тарароев, Н.А. Иваненко // Вопросы философии. — 2011. — № 12. — С. 47—56.

Стаття надійшла до редакції 28.09.2012 р.