Дагаев А.А.
ведущий научный сотрудник ИМЭМО РАН

Важней всего погода в доме…

эволюция и перспективы совершенствования методологии долгосрочного экономического прогнозирования [1]

Попытки заглянуть в будущее предпринимались задолго до нашей эры а те, кто их делал, были весьма почитаемы окружающими еще в то далекое время. Не случайно возник культ бога-прорицателя Аполлона в Древней Греции. Большое влияние на жизнь общества своего времени оказывало святилище Аполлона в Дельфах - легендарный Дельфийский Оракул. В средние века был написан трактат Нострадамуса «Столетия» (первое издание вышло в 1555 году), пользующийся широкой популярностью и в наше время. Однако серьезные усилия по научному обоснованию социально-экономических прогнозов получили заметное развитие лишь в послевоенные годы XX века благодаря прогрессу экономической теории и развитию стратегического планирования на всех уровнях управления - от отдельно взятого предприятия до крупных межгосударственных объединений и союзов (ЕС, СНГ, ЕврАЗ и пр.).

Качественные и регулярно подтверждаемые экономические прогнозы свидетельствуют о правильности используемых при их построении исходных теоретических гипотез и экономических моделей, а это дает основание для эффективного распределения ограниченных общественных ресурсов, экономического планирования и разработки эффективной долгосрочной социально-экономической стратегии.

Анализ научных публикаций показывает, что проблема выбора методологии прогнозирования еще далека от своего решения. В настоящее время в практике прогнозирования используются различные, во многом конкурирующие между собой подходы, что является следствием продолжающегося развития теории с учетом постоянно изменяющихся экономических условий и возможностей.

Большинство экспертов сходится во мнении, что разрабатывавшиеся в 70-е годы сложные модели не оправдали возлагавшихся на них ожиданий, поскольку не смогли предсказать реальное развитие экономических процессов. Вместе с тем, такие модели позволили выявить ряд недостатков существующей макроэкономической теории.

F.X. Diebold из Пенсильванского

университета и Национального бюро экономического анализа США отмечал еще в 1997 году в специальном исследовании[2], что «сообщения о смерти крупномасштабных моделей макроэкономического прогнозирования не преувеличены, однако многие наблюдатели интерпретируют ошибки некоторых ранних моделей как признак мрачного будущего для макроэкономического прогнозирования в целом. А это на самом деле неверно». По его мнению, макроэкономическое прогнозирование способствовало развитию мощного аппарата теории оценок, методов компьютерного моделирования, созданию компьютерных баз данных и многих других приложений. Более того, ошибки прошлого не обязательно означают бесперспективность работ в тех же направлениях, ведь на ошибках обычно учатся.

По мнению F.X. Diebold, в прогнозировании необходимо различать *неструктурированные (nonstructural)* и *структурные (structural)* подходы.

В первом случае рассматривается уменьшенный набор корреляций в наблюдаемых макроэкономических временных рядах без сильной привязки к экономической теории.

ошибки прошлого не обязательно означают бесперспективность работ в тех же направлениях, ведь на ошибках обычно учатся

Во втором случае экономические показатели рассматриваются и анализируются сквозь призму той или иной экономической теории. Поэтому структурные методы макроэкономического прогнозирования рождаются и умирают вместе с той теорией, на которую опираются, с учетом определенных лагов во времени.

Например, структурное макроэкономическое прогнозирование, взявшее за основу кейнсианскую систему принятия решений, строилось на достижениях теории 30-х и 40-х годов минувшего столетия. В тот период времени теория значительно опережала практику экономических изменений. Но ситуация изменилась после выхода в свет работ «Кейнсианская революция» (Klein, 1946) и «Эконометрические модели США: 1929-1952» (Klein and Goldberger, 1955).

Золотая эра методов структурного макроэкономического прогнозирования приходится на 50-е – 60-е годы, когда получила широкое развитие новая экономическая дисциплина – *эконометрика*. Эта эра подошла к закату в 70-е - 80-е годы. Причиной стала в значительной мере неспособность теории объяснить одновременное существование в реальной рыночной экономике высоких темпов инфляции и высокой безработицы, роль рациональных ожиданий[3] и ряд других экономических явлений.

Выражением кризиса кейнсианской модели макроэкономического прогнозирования стала так называемая «критика Лукаса» (Lucas R.E.)[4], который показал некорректность использования эконометрических моделей для оценки резуль-

татов политических решений в связи с тем, что последние меняют экономические «правила» и тем самым воздействуют на экономическое поведение. В результате высока вероятность того, что нарушатся исторически сложившиеся связи между переменными макроэкономической модели.

Поэтому современные макромодели часто бывают по своим масштабам значительно меньше прежних. Большее внимание в них уделяется не только важным для кейнсианской теории факторам спроса, но и роли существующих рациональных ожиданий. Эти модели пытаются учесть ключевые элементы, по которым центральные банки и б**о**льшая часть других экономических агентов судят о взаимосвязи инфляции, выпуска продукции и монетарной политики[5].

Наряду с построением общих макроэкономических прогнозов, активно развивается большое число *неструктурированных* (по F.X.Diebold) подходов, в рамках которых оцениваются на будущее отдельные элементы общей экономической системы, рынки и масштабы производства конкретных видов продукции, экономический потенциал новых технологий и последствия их применения в различных областях человеческой деятельности. Многие из таких подходов базируются на накопленном практическом опыте и создаются в ответ на реально существующие потребности общества и производства, вне связи с определенными макроэкономическими теориями. В указанном смысле их можно считать квазиавтономными по отношению к господствующей в тот или иной период времени парадигме экономического развития.

современные макромодели часто бывают по своим масштабам значительно меньше прежних

Окончание следует

[1] Исследование выполнено при финансовой поддержке РГНФ в рамках научно-исследовательского проекта РГНФ («Методология долгосрочного прогнозирования цикличной динамики экономики России»), проект № 04-02-00174а.

[2] Diebold F.X. The Past, Present and Future of Macroeconomic Forecasting. // Federal Reserve Bank of Philadelphia. Working Paper. No 97-20. Dec.1997.

[3] Методы, позволяющие учитывать рациональные ожидания в эконометрических моделях, разработали R.Fair (Specification, Estimation and Analysis of Macroeconomic Models. - Cambridge, Mass.: Harvard University Press, 1984) и J.Taylor (Macroeconomic Policy in a World Economy: From Econometric Design to Practical Operation. - New York: Norton, 1993).

[4] Lucas R.E. Econometric policy evaluation: a critic / Brunner K. and Meltzer A.H. (Eds.) //The Philips Curve and Labor Markets. Supplement to the Journal of Monetary Economics. 1976.

[5] P.Soderlind. Lecture Notes in Macroeconomic and Financial Forecasting. - Univ. of St.Gallen and CEPR, 2005.