

ИСТОРИЯ ЭКОНОМИЧЕСКОЙ МЫСЛИ

УДК 330.88

Михаил Довбенко

ВЫДАЮЩИЙСЯ ИССЛЕДОВАТЕЛЬ ЭКОНОМИЧЕСКОГО НЕРАВЕНСТВА

Изложены основные результаты научных исследований Э.Дитона – лауреата Нобелевской премии 2015 года, американского ученого, отмеченного Нобелевским комитетом за усиление научного понимания различных аспектов процесса потребления, бедности и благосостояния.

Ключевые слова: лауреата Нобелевской премии 2015 года, процесса потребления, бедность, благосостояние

JEL: N200.

По решению Нобелевского комитета премии Риксбанка Швеции имени Альфреда Нобеля за 2015 год удостоен один из ведущих мировых специалистов по микроэкономике Э.Дитон. Эту престижную международную награду он получил за усиление научного понимания различных аспектов процесса потребления, бедности и благосостояния.

Дитон Энгус Стюарт (Deaton Angus Stewart) родился 19 октября 1945 года в г. Эдинбург (Шотландия), на сегодняшний день имеет британское и американское гражданство. Учился в Бристольском и Кембриджском университетах. Научную степень получил в 1974 году в Кембридже, где и работал на кафедре прикладной экономики вместе с нобелевским лауреатом 1984 года Р.Стоуном. С 1983 года трудится профессором экономики и международных отношений Принстонского университета (США). Сфера научных исследований: здоровье, благополучие и экономическое развитие. Он автор и соавтор шести книг и более полутора сотен научных работ. В 2009 году был избран президентом Американской экономической ассоциации, является членом Британской королевской академии наук, Американского философского общества, Королевского общества Эдинбурга и Американской академии искусств и наук. Он является членом Международного Эконометрического общества и в 1978 году стал первым лауреатом медали Р.Фриша, основанной этим обществом.

В экономическом сообществе Э.Дитон является признанным специалистом функций спроса. Учитывая высокую практическую важность функций спроса и их ключевую роль в микроэкономической теории, неудивительно, что они уже долгое время продолжают оставаться в центре внимания ученых и практиков. Так, чиновники всегда учитывают показатели ценовой эластичности при установлении налогов и тарифов. "Сила анализа потребительского спроса, – отмечает Э.Дитон, – заключается в его тесной связи с теорией и практикой, а важные теоретические предсказания были такими точными, так как они обеспечивали тесную связь между теорией и интерпретацией опыта. Невозможно проводить прикладной анализ спроса, не принимая во внимание одновременно как статистику, так и экономическую теорию" (Deaton, 1986). Такая точка зрения господствует в эконометрической литературе, посвященной анализу спроса, особенно в

Довбенко Михаил Владимирович (info@dovbenko.kiev.ua), д-р экон. наук; первый заместитель Председателя Комитета Верховной Рады Украины по вопросам финансовой политики и банковской деятельности.

исследованиях о системной оценке функций спроса, которые в совокупности моделируют потребительские расходы.

Среди вопросов, которые анализировал Э.Дитон в своих ранних работах (Deaton, 1977), была также проблема поведения домашних хозяйств и фирм как реакция на изменения в налоговой политике. Он стремился более точно выяснить роль налогообложения доходов физических лиц и косвенных налогов, а также одновременно проанализировать оптимальную ставку налога на доходы физических лиц и оптимальную структуру налога на товары. Оказывается, что взаимосвязь между этими налогами является критической: оптимальная структура налога на товары совсем другая при оптимальном налоге на доходы физических лиц, чем при его отсутствии.

В своих исследованиях ученые доказывали, что случай с дифференциальным налогообложением зависит от производных второго и более высокого порядка функций спроса (от более высоких моментов распределения). Обычные допустимые функциональные формы (как, например, постоянная эластичность) накладывают сильные ограничения на эти производные, однако исследователи не могли быть уверенными в том, что данные, полученные без этих ограничений, позволяют им определить эти производные с большей точностью. Из этого Э.Дитон вывел предсказания, что необходима большая осторожность при использовании теоретических результатов: "Вероятно, что эмпирически подсчитанные ставки налога, которые основываются на эконометрических оценках параметров, будут определяться структурно, а не измерителями, реально полученными, но на основе произвольных, непроверенных (и даже подсознательных) гипотез, выбранных ученым для практических целей" (Deaton, 1978).

Значительная часть ранних работ Э.Дитона была посвящена в основном поведенческим паттернам в расходовании денег, а также тому, как людям с разным достатком удается сочетать уровень доходов с образом жизни. Вообще, многие современные дискуссии по поводу государственной политики затрагивают вопросы, связанные с предложением труда. Так, например, споры, касающиеся социальных выплат, социального страхования и системы налога на прибыль, чаще всего концентрируются на стимулах к труду. Даже макроэкономический анализ безработицы и жесткости (негибкости) заработной платы нередко поднимает микроэкономические вопросы о выборе между досугом и предложением труда.

Между тем представление о предложении труда имеет много аспектов: количественный и демографический состав населения; удельный вес населения в трудоспособном возрасте, которое трудится за плату или ищет работу (эту величину называют уровнем участия в трудовых ресурсах или уровнем участия в рабочей силе); количество часов, отработанных в течение недели или за год; качество труда. Э.Дитон анализировал факторы, влияющие на решение членов домохозяйств, особенно женщин, в отношении того, работать за плату, и если "да", то сколько часов. Эконометрические инструменты, которые он использовал, включают в себя различные процедуры с ограниченными и цензурированными зависимыми переменными.

В то же время его исследования фокусировались на моделировании более понятных факторов, влияющих на последовательное (в течение жизни) индивидуальное равновесие предложения труда, свободного времени и потребления. Решение продленной на всю жизнь оптимизационной проблемы часто называют динамикой индивидуального равновесия. Общий подход заключается в том, чтобы предсказать, что совершенная определенность и специфицированность "жизненной" (то есть продленной на всю жизнь) полезности может быть представлена в виде аддитивной сепарабельной функции полезности. Использование ее давало следующее: если свободное время является нормальным благом в каждый период времени, то с аддитивной сепарабельности получалось, что промежутки свободного времени в различные моменты жизненного цикла должны быть чистыми знаменателями (поддерживая постоянную полезность на протяжении всего

срока жизни). Детальное рассмотрение этой проблематики Э.Дитон провёл в 1974 году (Deaton, 1974).

Работая со сравнительной динамикой, ученым приходилось быть достаточно аккуратными в выборе того, что следует зафиксировать. На протяжении многих лет они использовали один общий подход, названный "фришевским λ -фиксированным"¹, который изучает эффекты изменений временных траекторий равновесия в зависимости от колебаний, скажем, уровней заработной платы, видя при этом жизненную предельную полезность начального капитала (λ) фиксированной. Э.Дитон предложил альтернативную процедуру, названную " λ -варьирования". Она допускает варьирование λ как реакцию на изменение в уровнях заработной платы (Martin, Angus, Margaret, 1985). В каждом из этих случаев можно показать, что варьирование заработной платы на любую определенную дату может иметь последствия не только для этого момента времени, но и для других моментов времени.

Стоит отметить, что труды ученых, в т.ч. Э.Дитона, в которых исследуются факторы, влияющие на предложение женского труда, представляют хороший пример того, как взаимовлияние экономической теории, теории измерений и эконометрической техники способно повысить наше понимание важных общественно-политических вопросов. Но эта литература также показывает, что, несмотря на огромный прогресс в теории, технике и, в известной степени, в измерениях, все еще достаточно сложно добиться точных оценок таких важных величин, как эластичность. Однако многие эконометристы, которые изучают сферу предложения труда, настроены очень оптимистично. Среди потенциально важных вех исследований есть и наработки Э.Дитона в изучении процессов принятия решений семьями (или домашними хозяйствами) и его анализ значимости ограничений, налагаемых на количество отработанных часов (Deaton, Muellbauer, 1981).

Смещение своего внимания к опросам побудило Э.Дитона перейти от оценке усредненных показателей и величин к практическому анализу индивидуальных данных различных семей, особенно в части потребления. Предшественники молодого ученого и, в частности, М.Фридман, Ф.Модильяни ещё в 1950-х годах обосновывали свои теории и гипотезы относительно дохода, потребления и сбережения на общих агрегированных данных для страны в целом, используя для удобства концепцию среднестатистических граждан – репрезентативных потребителей. Расчеты Э.Дитона показали, что оценка агрегированных данных без углубления в детали может дать ложные результаты. Средний доход – достаточно обманчивый показатель социально-экономического развития государства, так как возможны как равномерное распределение доходов, так и широкое отклонение доходов от среднего уровня, в результате которого большинство населения окажется за чертой бедности.

Отсюда в научной литературе возник парадокс Э.Дитона, который заключается в том, что объемы потребления в целом изменяются не настолько резко, как колеблются совокупные доходы. Такой вывод, на первый взгляд, противоречит гипотезе на основе рациональных ожиданий, согласно которой все должно было быть наоборот: рациональные потребители, предсказывая свои будущие доходы, будут брать потребительские и ипотечные кредиты, резко увеличивая объем собственного потребления выше текущего уровня доходов, которые остаются относительно постоянными и растянутыми во времени. Э.Дитон доказывает, что разгадка парадокса – в несовершенстве агрегированных данных, тогда как для лучшего понимания макроэкономических процессов необходимо опуститься к рассмотрению динамики индивидуальных доходов и потребительских решений на микроуровне. На сегодня такой подход к более глубокому анализу экономических данных широко применяется макроэкономистам и считается более точным и эффективным.

¹ Еще называется "вопросительной концепцией Фриша". Она названа в честь нобелевского лауреата Рагнара Фриша.

Научные труды Э.Дитона способствовали решению сложной практической проблемы для экономистов относительно определения черты бедности и жизненных стандартов в различных государствах. Существует два популярных варианта определения благосостояния и бедности. Расчет средних доходов – простой, но довольно неточный способ, ведь официальная статистика не учитывает теневых заработков и их сезонных колебаний. Второй метод определения процента бедного населения – через подсчет объема потребления на индивидуальном уровне – технически более сложный, однако лучше отражает действительность.

Вместо совокупных статистических данных о доходах граждан ученый предлагает собственные методики анализа большего количества микроданных о реальных потребительских расходах на уровне домохозяйств и их групп. Такой подход в исследовании, несмотря на высокую стоимость сбора информации, имеет большое практическое значение в деятельности международных финансовых организаций – доноров развивающихся стран. Зная, на покупку каких товаров домохозяйства направляют дополнительные доходы, полученные от зарубежных доноров, можно лучше организовать процесс оказания помощи, максимально улучшая эффект и обеспечивая целевое использование выделенных средств.

Оценка потребления людей в килокалориях и других показателей реального объема полученных благ в развивающихся странах позволяет предоставить точное определение бедности. На основе исследования микроданных Э.Дитон сумел доказать, что черта бедности не может быть одинаковой для всех государств и выражаться цифрой минимального дохода. Расчет среднего дохода на человека не способен отразить реальную ситуацию, потому что дети потребляют значительно меньше продуктов, чем взрослые. При этом в странах с высоким уровнем рождаемости дети составляют большую часть населения, занижая среднестатистическую сумму дохода на гражданина, который в научном сообществе сопоставляли с потребностями взрослого человека и некорректно оценивали уровень бедности.

В 1997 году Э.Дитон опубликовал комплексную работу (*Deaton, 1997*), в которой рассмотрел ряд вопросов, связанных с оценкой моделей по кластеризованным данным опросов о стандартах жизни (*Living Standards Surveys*), которые проводились Всемирным банком в развивающихся странах. С его легкой руки микроэкономические исследования бедности и благосостояния на основе данных домохозяйств стали популярными в работе Всемирного банка, других международных организаций и активно используются финансово-экономическими блоками правительств многих стран мира.

В общем с другим нобелевским лауреатом Д.Канеманом исследовании "Высокие доходы улучшают оценку жизни, но не эмоциональное благосостояние" Э.Дитон на основе анализа опросов 450 тыс. американцев пришел к выводу, что рост уровня доходов и образования повышают самооценку качества собственной жизни респондентами, но частично улучшают их эмоциональное состояние. Почему не полностью? Соавторы показывают: после достижения суммы годового дохода в 75 тыс. долл. США предварительная связь между ростом доходов и ощущением счастья пропадает. Высокие доходы приносят удовлетворение жизнью, но не дарят счастье; тогда как низкие доходы ассоциируются с низкой оценкой жизни и с подавленным эмоциональным состоянием. Так заключают нобелевские лауреаты.

Неожиданным для самого ученого открытием, которым он делится в статье "Финансовый кризис и благосостояние Америки", стала прямая связь между ощущением благополучия американцев и динамикой индекса акций S&P500, хотя большинство жителей США не обладают портфелями соответствующих ценных бумаг. Э.Дитон объясняет выявленную зависимость тем, что индекс S&P500 был наиболее ярким индикатором состояния коллективного сознания под влиянием новостного фона, нагнетался средствами массовой информации. Для нас, украинцев, аналогичным триггером экономического благосостояния до сих пор служит курс доллара.

Еще одна научная публикация нобелианта "Две головоломки о счастье" является щедрой на парадоксальные результаты. В частности, чем выше религиозность штата, тем выше ощущение благополучия у его жителей, а также ... уровень социальных патологий: преступности, курения, разводов, венерических заболеваний и подростковой беременности. Э.Дитон объясняет этот парадокс тем, что высокая религиозность в неблагополучных регионах США является скорее не причиной, а следствием, своеобразной реакцией на враждебную среду. Или еще один его интересный вывод заключается в том, что все более высокая гендерная автономия женщин ассоциируется со снижением их оценки собственного благосостояния; причем если вопрос сформулировать: приносит ваша свобода счастье? – большинство женщин декларируют более высокий уровень удовлетворенности жизнью, чем в случае вопроса без фокусировки на гендерном равенстве. Не менее парадоксальным является его обобщение о том, что семейные пары, имеющие детей, демонстрируют более низкое удовлетворение жизнью, чем их бездетные коллеги, хотя всегда уверяют исследователей, что дети приносят им счастье и радость.

Своеобразным этапным итогом его исследовательской деятельности является книга "Большой побег: здоровье, богатство и происхождение неравенства" (Deaton 2013). Поскольку еще не сделан перевод на украинский язык, то остановлюсь на ее основных положениях. В ней изложена широкая история улучшения здоровья и материального благосостояния людей в Америке и мире в целом с древних времен до наших дней. Под большим побегом автор понимает бегство от бедности и болезней. Этот побег уже успешно осуществили некоторые народы, большинство стран мира находятся в процессе, а небольшому количеству менее удачных – только предстоит его начать.

Излагая историю и масштаб мирового прогресса, а также его основные причины, Э.Дитон утверждает, что спасение от высокой смертности было лишь поверхностно связано со спасением от бедности. На Западе основной причиной улучшения здоровья был не рост личного благосостояния. Непосредственными причинами этого было в большей степени улучшение коммунальных услуг, таких как водоснабжение и канализация. Относительно развивающихся стран за последние 50 лет на вопрос "Характеризуются ли быстро развивающиеся страны более высокими темпами снижения детской смертности?" довольно четко звучал ответ: "Нет". На пути к прогрессу, отмечает автор, во имя международного контроля над ростом населения организовывались совсем не обязательные порочные действия. Это говорит еще об одном большом побеге: все страны выбрались из мальтузианской ловушки доиндустриальной эпохи, когда рост населения обычно связывался с меньшими доходами и худшим здоровьем.

В книге детально описываются рекомендации относительно политики помощи беднейшим слоям мирового населения: сократить бюджеты в оказании помощи. Э.Дитон утверждает, что финансовая помощь не способствует росту. На самом деле, щедрая помощь становится препятствием на пути развития, который развращает институциональные системы, позволяя руководителям государств править без поддержки населения, поскольку нет необходимости взимать с населения налоги. При этом автор поддерживает некоторые виды помощи и способы ее предоставления – в частности, финансирование развития новых технологий, включая, например, лекарства. Он также отмечает, что внешняя помощь спасла миллионы жизней в бедных странах, особенно благодаря снижению уровня детской смертности от инфекционных заболеваний. Но даже роль помощи в развитии здравоохранения ограничена, поскольку она не способствует созданию базовых систем здравоохранения.

Действительно, сложно доказать, что в среднем помощь приносила пользу экономическому росту бедных стран. По мнению Э.Дитона, другие, более мощные инструменты мировой политики, например, касающиеся миграции, либерализации торговли и реформ субсидий, значительно лучше способствуют такому росту. Многие и, пожалуй, большинство средств, выде-

ляемых в прошлом для оказания помощи, было потрачено напрасно. Однако негативное влияние помощи также не настолько очевидно. Недавний анализ, проведенный сотрудниками МВФ, показывает, что в бедных странах с неразвитыми институтами помощь заменяет налоги примерно один к одному, но в среднем для стран-получателей каждый доллар полученной помощи снижает налоги, которые собирает правительство, всего на девять центов. Также есть свидетельства того, что даже в странах, которые зависят от финансовой помощи с существующей слабой системой управления, помощь иногда способствует созданию элементарной системы здравоохранения. За период с 2004 года по 2010 год средняя ожидаемая продолжительность жизни в Афганистане увеличилось с 42 до 62 лет, в немалой степени благодаря программе, которая финансируется Агентством США по международному развитию и проводится министерством здравоохранения. Благодаря этой программе 90% населения получило базовые медицинские услуги.

Ради миллионов людей, которым удалось спасти жизнь благодаря оказанной помощи и успешным проектам во многих секторах экономики разных стран, несмотря на многочисленные неудачи, систему оказания помощи необходимо реформировать, а не сокращать. Такие реформы вместе с либерализацией миграционной политики и усилением равенства в торговле, могли бы помочь еще миллионам людей осуществить свой большой побег от нищеты и болезней, о которых так хорошо говорит теперь уже нобелевский лауреат Э.Дитон в своей книге и исследованиях.

Литература

- Deaton Angus S. (1986). Demand Analysis. In: Griliches Zvi, Intriligator Michael D. (eds.), Handbook of Econometrics, Vol. 3. Amsterdam: North-Holland. (In English)
- Deaton, A.S. (1977). Equity, Efficiency and the Structure of Indirect Taxation. *Journal of Public Economics*. 299–312. (In English)
- Deaton, A.S. (1979). The distance function in consumer behaviour with applications to index numbers and optimal taxation. *Review of Economic Studies*. (In English)
- Deaton, A.S. (1978). Optimal taxes and the structure of preferences. Mimeo, University of Bristol. P.1. (In English)
- Deaton, Angus (1974). A Reconsideration of the Empirical Implications of Additive Preferences, *Economic Journal*, 84:334, June, P. 338–348. (In English)
- Martin Browning, Angus Deaton and Margaret Irish (1985). A Profitable Approach to Labor Supply and Commodity Demands over the Life-Cycle, *Econometrica*, 53:3, May. P. 503–543. (In English)
- Deaton, Angus and John M. Muellbauer (1981), Functional Forms for Labor Supply and Commodity Demands with and without Quantity Restrictions, *Econometrica*, 49:6. November, P. 1521–1532. (In English)
- Deaton, A. (1997). The Analysis of Household Surveys: A Microeconomic Approach to Development Policy, Baltimore, Johns Hopkins Press. (In English)
- Deaton, Angus (2013). The Great Escape: Health, Wealth, and the Origins of Inequality. Princeton: Princeton University Press. (In English)

Поступила в редакцию 06.04.2016 г.

A PROMINENT INVESTIGATOR OF ECONOMIC INEQUALITY

Mikhail Dovbenko

Author affiliation: Doctor of Economics, First Deputy Chairman of the Commission on Financial Policy and Banking of the Verkhovna Rada of Ukraine. E-mail: info@dovbenko.kiev.ua.

The paper describes the main results of research conducted by A.Deaton, Nobel Prize Winner for 2015, an American scientist, awarded for strengthening scientific understanding of various aspects of consumption, poverty and welfare.

Keywords: Nobel Prize winners for 2015, process of consumption, poverty, welfare.

JEL: N200.