Федеральное агентство по образованию

Государственное образовательное учреждение высшего

Профессионального образования

«Тихоокеанский государственный университет»

Кафедра «Экономическая теория и национальная экономика»

**Теории экономических циклов**

**Курсовая работа по дисциплине «Макроэкономика»**

КР. 070590475

Выполнил студент Дьячкова Е. А.

Проверил руководитель Золотарчук В. В.

Хабаровск – 2010 г.

СОДЕРЖАНИЕ

Введение………………………………………………………………………...3

1 глава. Теоретические основы исследования экономических циклов……..4

1.1. Понятие экономического цикла…………………………………………..4

1.2. Виды экономических циклов в зависимости от их продолжительности7

1.3. Классификация циклов по причине возникновения……………………11

2 глава. Антициклическая государственная политика……………………...15

2.1. Кейнсианская концепция циклического регулирования……………….15

2.2. Монетарная концепция антициклической политики…………………...17

2.3. Модель динамического стохастического общего равновесия…………22

Заключение…………………………………………………………………….28

Список использованных источников………………………………………...30

Приложение А. Модель экономического цикла…………………………….32

Приложение Б. Основные виды циклов……………………………………..33ВВЕДЕНИЕ.

Данная курсовая работа посвящена теориям экономических циклов.

Выбранная тема является актуальной, поскольку в наше время преобладающее место заняла идея взгляда на цикл как на единый процесс, последовательно проходящий через фазы кризисов и подъёмов, а не просто как на случайную последовательность кризисов, прерывающих время от времени ход воспроизводства. Предметом исследования является весь цикл, а не отдельные его фазы.

Цель курсовой работы состоит в раскрытии содержания экономического цикла, а также в необходимости характеристики механизмов основных воспроизводственных циклов и их роли в экономическом развитии. Для этого необходимо решить следующие задачи:

- раскрыть социально- экономическую сущность циклов;

- рассмотреть характер и закономерности развития различных видов циклов;

- раскрыть объективные причины циклов, их природу, показать воздействие циклических колебаний на национальное производство и занятость.

- рассмотреть основные фазы делового цикла;

- проанализировать возможность антициклического регулирования.

Работа имеет традиционную структуру и включает в себя введение, основную часть, состоящую из двух глав, заключение и список использованной литературы. Во введении обозначена актуальность выбора темы, поставлена цель, задачи исследования, объект и предмет исследования.

Источниками информации для написания курсовой работы послужили базовая учебная литература, справочная литература, статьи в периодических изданиях.

I глава. Теоретические основы исследования экономических циклов.

* 1. Понятие экономического цикла.

Термин экономический цикл означает следующие один за другим подъемы и спады уровней экономической активности в течение нескольких лет. Отдельные экономические циклы существенно отличаются друг от друга по продолжительности и интенсивности. Нет точной формулы для прогнозирования длительности и временной последовательности экономических циклов. По своей нерегулярности экономические циклы больше напоминают изменения погоды. Тем не менее, все они имеют одни и те же фазы, которые по-разному именуются различными исследователями.

В настоящее время широко используют терминологию, выработанную На­циональным бюро экономических исследований США (NВЕК.), согласно кото­рой цикл включает следующие четыре фазы: вершина (пик, бум), сжатие (рецес­сия, спад), дно (депрессия), оживление (расширение) /Приложение А/. Некоторые современные экономисты выделяют только две фазы: рецессию и подъем.

На пике наблюдается максимальная занятость, и производство работает на полную мощность. Уровень цен и норма процента достаточно высокие. Однако рост производства выходит за рамки платежеспособного спроса, и рост деловой активности падает. Тем самым цикл постепенно переходит в фазу спада, или кризиса. Кризис является наиболее яркой фазой экономического цикла.

Кризис — спад производства. Его экономическая функция сводится к насильственному и временному установлению пропорциональности между звеньями экономики (производством и потреблением, производством и обращением). Это главная фаза экономического цикла. В нем заключены основные черты цикла. Без кризиса не было бы цикла. Периодическое повторение кризиса придает рыночной экономике циклический характер.

Различают два вида кризисов: кризис перепроизводства и кризис недопроизводства. Для рыночной экономики наиболее характерен кризис перепроизводства. Он проявляется в следующем: из-за перепроизводства товары не находят сбыта, растут запасы нереализованной продукции, наблюдается массовое банкротство промышленных и торговых фирм. Растет спрос на денежный (ссудный) капитал, а предложение его резко сокращается, и повышается норма ссудного процента. Банки прекращают выдачу вкладов, они терпят крах, падает курс акций и других ценных бумаг. Растет безработица. Экономическая жизнь страны в целом дезорганизуется.

Так, первый промышленный кризис разразился в Англии в 1825 г. Кризис 1847-1848 гг., разразившийся в США и ряде европейских стран, по существу был первым мировым промышленным кризисом.

Кризисы, происходящие в сельском хозяйстве, называют агарными кризисами. Они не являются следствием развития кризиса в промышленности. Аграрные кризисы являются особой формой экономических кризисов. Их особенность проявляется:

1) в перепроизводстве или недопроизводстве сельскохозяйственной продукции;

2) в разорении мелких и средних сельскохозяйственных товаропроизводителей (фермеров);

3) в концентрации и централизации капитала и производства;

4) в продолжительности, т. е. носит затяжной характер. Они растягиваются на десятилетия, в течение которых в промышленности происходит несколько кризисов.

Первый аграрный кризис начался в 1873 г. и длился до середины 90-х гг. (1895г.), поразил Западную Европу, Россию и США. Второй аграрный кризис разразился в США, Канаде, Аргентине и Австралии, а затем перерос в мировой кризис и был преодолен в ходе второй мировой войны. Третий аграрный кризис начался в 1948 г., а с середины 50-х гг. принял мировой характер, поразил почти все страны мира.

После кризиса наступает фаза депрессии — застоя в экономике. Характеризуется тем, что производство и занятость достигают с самого низкого уровня — «дна экономики». Производство топчется на месте, происходит постепенное рассасывание товаров. Часть товаров уничтожается, а часть реализуется по заниженным ценам. Устаревшее оборудование ликвидируется, тем самым приостанавливается падение цен. (Например, в период экономического кризиса в 1929-1933 гг. в США был уничтожен урожай хлопка на площади до 10 млн. га, в Бразилии сожгли около пяти млн. свиней, ежегодно выбрасывали в море 10 млн. мешков кофе). Сохраняется высокий уровень безработицы. Затем экономика постепенно из состояния депрессии переходит в фазу оживления.

Оживление — это постепенное повышение уровня ссудного процента. Рабочая сила постепенно втягивается в производство, уровень безработицы сокращается, товары рассасываются. Предприниматели увеличивают спрос на новое оборудование, сырье. Решающим фактором перехода от депрессии к оживлению является обновление основного капитала.

Фаза оживления переходит в фазу подъема — быстрого роста производства, торговли, прибыли, курса акции и ценных бумаг, цен и занятости. Уровень производства превосходит его уровень в докризисном периоде, выходит за рамки платежеспособного спроса, и экономика переходит в состояние пика. Рынок переполняется нереализованными товарами, и начинается новый промышленный цикл.

Современные экономические циклы существенно отличаются от циклов XIX и первой половины XX века. Общие закономерности находят все менее видимое проявление. Некоторые фазы экономического цикла претерпевают значительные метаморфозы, а то и исчезают вовсе.

* 1. Виды экономических циклов в зависимости от их продолжительности.

Все циклы в реальной действительности не похожи друг на друга, каждый имеет свои специфические особенности, перепле­тения. При этом каждый кризис возникает как бы неожиданно и вызывается какими-либо совершенно исключительными обстоя­тельствами. В периоде между кризисами, как и в море в ясную погоду, возможны волнения, “барашки” в виде частичных, малых и промежуточных спадов, что дало основание говорить о разных типах экономических кризисов.

Существует более 1380 типов цикличности. Современная экономика в основном оперирует четырьмя из них: краткосрочным; среднесрочным; длинноволновым; столетним.

В табл. 1 /Приложение Б/ отмечены шесть наиболее часто упоминаемых; экономика опериру­ет по преимуществу четырьмя первыми из них.

Циклы Жуглара. Раньше всего экономическая наука выделила цикл 7-12 лет, который впоследствии получил имя Жуглара. Впрочем, этот цикл имеет и другие названия: «бизнес-цикл», «промышленный цикл», «средний цикл», «большой цикл». Как уже отмечали, первый промышленный кризис разразился в Англии в 1825 г., когда машинное производство заняло господствующее положение в ме­таллургии, машиностроении и других ведущих отраслях. Кризис 1836 г. возник сначала в Англии, а затем распространился и на США. Кризис 1847-1848 гг., разразившийся в США и ряде европейских стран, по существу, был первым ми­ровым промышленным кризисом. За ним последовали кризисы 1857 и 1866 гг. Наиболее глубоким был кризис 1873 г. Если в XIX в. промышленный цикл со­ставлял 10-12 лет, то в XX в. его продолжительность сократилась до 7-9 и ме­нее лет: в 1882, 1890, 1900, 1907 гг. Самое разрушительное действие на эконо­мику оказали экономические кризисы 1920-1921, 1929-1933, 1937-1938 гг. Среди них выделяется «великая депрессия» 1929-1933 гг., отличавшаяся особо глубоким и длительным падением производства.

После второй мировой войны промышленные кризисы происходили в 1948-1949, 1953-1954, 1957-1958,1960-1961,1969-1970, 1973-1974, 1981-1982 гг., при­чем самым разрушительным был кризис середины 70-х годов.

Цикл 7-12 лет был назван именем К. Жуглара (1819—1905 гг.) за его большой вклад в изучение природы промышленных колебаний во Франции, Великобри­тании и США на основе фундаментального анализа колебания ставок процента и цен. Как оказалось, эти колебания совпали с циклами инвестиций, которые, в свою очередь, инициировали изменения ВНП, инфляции и занятости. К приме­ру, Шумпетер (1939 г.) выделил 11 циклов Жуглара за период с 1787 по 1932 гг.

Циклы Китчина (циклы запасов). Китчин (1926 г.) сосредоточил свое внима­ние на исследовании коротких волн длиной от 2 до 4 лет на основе изучения финансовых счетов и продажных цен.

Циклы Кузнеца. В 1930-е годы в США появились исследования так называе­мого «строительного цикла». Дж. Риггольмен, В. Ньюмен и некоторые другие аналитики построили первые статистические индексы совокупного годового объема жилищного строительства и обнаружили в них следующие друг за дру­гом длительные интервалы быстрого роста и глубоких спадов или застоя. Тогда и появился термин «строительный цикл», определяющий эти двадцатилетние колебания. В 1946 г. С. Кузнец пришел к выводу, что показатели национального дохода, потребительских расходов, валовых инвестиций в оборудование произ­водственного назначения, а также в здания и сооружения обнаруживают взаи­мосвязанные двадцатилетние колебания. При этом он отметил, что в строитель­стве эти колебания обладают самой большой относительной амплитудой.

После выхода в свет работы Кузнеца термин «строительный цикл» практи­чески перестал употребляться, уступив место термину «длинные колебания», в отличие от «длинных волн» Кондратьева. В 1955 г. В. Льюис и П.0' Лири в качестве признания заслуг американского исследовате­ля предложили термин «цикл Кузнеца», который и стал вскоре общепринятым.

Циклы Кондратьева. Первые попытки в области создания теории длинных волн были предприняты на заре XX в. А. Гельфандом (Парвусом), Я. ван Гельдереном и С. де Вольфом. Однако наибольший вклад внес русский ученый Н. Д. Кондратьев (1892—1938 гг.), который опубликовал несколько основопо­лагающих работ в данной области. Он изложил результаты своих статисти­ческих экономических исследовании, касающихся динамики индексов товар­ных цен, процентных ставок, ренты, заработной платы, производства важнейших видов продукции и т. д. для ряда развитых стран за отдельные периоды в пределах временного интервала с 1770 по 1926 гг.

Начало «большого» подъема Кондратьев связывал с массовым внедрением в производство новых технологий, с вовлечением новых стран в мировое хозяй­ство, с изменениями объемов добычи золота. При этом общая картина подъема описывалась следующим образом: внедрение технических нововведений идет параллельно с расширением инвестиционного процесса, который, в свою оче­редь, стимулирует производство и спрос, способствующие росту цен. В этот пе­риод безработица уменьшается, заработная плата и производительность труда растут. Эти процессы затрагивают всю экономику, изменяют стиль жизни лю­дей. В начальный период дополнительные импульсы экономическому росту могут дать локальные войны. По мере развития циклического подъема войны становятся более разрушительными. Многие крупные социальные потрясения приходятся на конец «большого» подъема, а также на нижнюю точку цикла.

Свидетельством того, что экономика приближается к верхней точке большого цикла, являются начинающиеся на фоне изобилия недостаток отдельных товаров, сдвиги в структуре распределения доходов, рост издержек производства, замедле­ние роста прибылей и т. д. Возникает ситуация, известная теперь как стагфляция.

Существуют различные объяснения причин исчерпания энергии подъема. Одни видят причину в заметном увеличении нормы потребления, другие — в из­менении покупательной способности денег, третьи достижение «пика» связыва­ют с жизненным циклом продуктов и отраслей, создание которых явилось след­ствием крупных нововведений прошлых лет.

За каждым «большим» подъемом следует довольно короткий период, когда экономика как бы готовится к предстоящему длительному спаду, но в то же вре­мя сохраняется видимость процветания: люди по-прежнему полны надежд, лег­ко берут в долг. Поскольку реальная ситуация уже не та, происходит нагромож­дение задолженности, которое в любой момент грозит крахом. Это с неизбежностью и происходит, причем импульс может исходить от незначитель­ного события. Накопившиеся ранее противоречия выходят наружу: обнаружи­вается избыток производственных мощностей, происходят массовые ликвида­ции предприятий, растет безработица, цены падают. Кондратьев особенно подчеркивал депрессивное состояние сельского хозяйства как одно из главных препятствий длительного спада.

Подъем первого большого цикла Кондратьев связывал с промышленной ре­волюцией в Англии, второго — с развитием железнодорожного транспорта, третьего — с внедрением электроэнергии, телефона и радио, четвертого — с ав­томобилестроением. Пятый цикл современные исследователи связывают с раз­витием электроники, генной инженерии, микропроцессорами.

* 1. Классификация циклов по причине возникновения.

Теория внешних факторов. Основателем этого направления принято считать английского экономиста У. С. Джевонса (1835—1882 гг.), который связал экономический цикл с 11-лет­ним циклом солнечной активности. В 70-е годы XIX в. Джевонс опубликовал ряд работ, в которых исследовал влияние солнечных пятен на урожайность, на цены, на зерно и на торговый цикл. Однако Джевонс связывал цикличность солнечной активности преимущественно с сельским хозяйством и торговлей. Последователи У. С. Джевонса распространили действие солнечного цикла на всю экономику. Так, Х.С. Джевонс (сын) связал солнечный цикл с колебаниями занятости, а X. М. Мор разработал общую экономическую теорию солнечной цикличности./7/

В 1987 г. молодой японский экономист Симанака Юдзи исследовал цикли­ческое развитие Японии с 1885 по 1984 гг. Он пришел к мнению, что за это время произошло девять 11-летних солнечных циклов, которые совпали с циклами Жуглара. Симанака считает также, что цикл Кузнеца равен двум солнечным циклам (22 года), цикл Кондратьева — пяти солнечным циклам (55 лет).

Чисто монетарная теория. Чисто монетарное объяснение цикла наиболее полно изложено в работах анг­лийского экономиста начала XX в. Р. Хоутри. Для него цикл есть «чисто денеж­ное явление» в том смысле, что изменение денежного потока является единствен­ной и достаточной причиной изменения экономической активности, чередования процветания и депрессии, оживления и вялой торговли. Когда спрос на товары, выраженный в деньгах (или денежный поток), увеличивается, торговля становится оживленной, производство расширяется, цены растут. Когда спрос уменьшается, торговля ослабевает, производство сокращается, цены падают. Де­нежный поток, т. е. спрос на товары, выраженный в деньгах, непосредственно определяется «потребительскими затратами», т. е. расходами за счет дохода.

Не денежные факторы, такие как землетрясения, войны, забастовки, неуро­жаи и т. д., могут вызвать общее обнищание, другие, как, например, изменение урожайности, чрезмерное развитие определенных отраслей, могут вызвать час­тичную депрессию в отдельных отраслях промышленности. Но общая депрессия в смысле фазы цикла, то есть такое положение, при котором неиспользованные ресурсы и безработица имеют всеобщий характер, не может быть вызвана не де­нежными факторами или событиями, за исключением тех случаев, когда они приводят к падению потребительских издержек, т. е. к уменьшению денежного потока./10/

Согласно чисто монетарной теории, цикл есть не что иное, как точная копия в небольшом масштабе прямой денежной инфляции и дефляции. Депрессия вы­зывается падением потребительских издержек из-за сокращения суммы средств обращения и усиливается падением скорости обращения денег. С другой сторо­ны, во время фазы процветания преобладают инфляционные процессы. Если бы денежный поток можно было стабилизировать, то колебания экономической активности исчезли бы. Но этого не происходит, так как денежной системе при­суща неустойчивость.

Теория перенакопления. Центральное место в теории перенакопления занимает вопрос о чрезмерном развитии отраслей, изготовляющих товары производственного назначения, по отношению к отраслям, производящим потребительские товары: отрасли, изго­товляющие товары производственного назначения, подвержены воздействию экономического цикла гораздо сильнее, чем отрасли, производящие потреби­тельские товары повседневного спроса. Во время повышательной фазы цикла выпуск товаров производственного назначения растет, а во время понижатель­ной фазы цикла сокращается гораздо более резко, чем производство товаров кратковременного пользования.

Согласно воззрениям теоретиков перенакопления, описанное явление пред­ставляет собой симптом серьезной диспропорции, возникающей во время фазы подъема. Отрасли, производящие капитальные товары, получают (относитель­но) чрезмерное развитие. Таким образом, именно реальная диспропорция в структуре производства, а не просто нехватка денег является причиной кризиса.

Теория недопотребления. Родоначальником теории недопотребления является швейцарский экономист Ж. Сисмонди (1773—-1842 гг.). Существует множество разновидностей этой тео­рии, наиболее обоснованная из них применяет термин «недопотребление» в зна­чении «чрезмерных сбережений». Депрессии вызываются тем обстоятельством, что слишком большая часть текущего дохода сберегается и слишком незначи­тельная его часть расходуется на потребительские товары. Именно доброволь­ные сбережения, совершаемые отдельными лицами и компаниями, нарушают равновесие между производством и реализацией./11/

Причина чрезмерных сбережений заключается в неравномерном распределе­нии дохода. Подавляющая часть сбережений приходится преимущественно на тех, кто получает крупный доход. Если бы можно было повысить уровень зара­ботной платы и одновременно перераспределить национальный доход, то доля сбережений не была бы угрожающе большой.

Психологическая теория цикла. Можно выделить три подхода к объяснению цикличности: экзогенный, эндогенный и эклектический (синтезированный).

Экзогенный подход. Его сторонники считают, что причиной экономического цикла — в колебаниях внешних (экзогенных) фак­торов: войны, революции, политика, миграция населения, мощные открытия и изобретения, открытия крупных месторождений природных ресурсов — золота, урана, нефти и т. д.

Эндогенный подход. Его авторы объясняют причины цикла внутренними (эндогенными) факторами, которые дают импульс циклу. К ним относятся потребление, инвестиции, сбережения, госрасходы и т. д.

Эклектический подход объединяет экзогенный и эндогенный подходы. При этом сторонники этого подхода считают, что колебания внешних факторов дают толчок внутренним. Это может быть политика, направленная на сглаживание цикличности./12/

2 глава. Антициклическая государственная политика.

2.1. Кейнсианская концепция циклического регулирования.

В 1936 г. крупнейший английский экономист Джон Мейнард Кейнс после окончания «великой депрессии» 30-х годов выдвинул новое объяснение уровня занятости в капиталистической экономике и сформулировал новые принципы и инструменты государственного регулирования рынка. Согласно этой теории, при капитализме просто не существует никакого механизма, гарантирующего полную занятость, полная занятость — частный случай, а не закономерность. Капитализм не является саморегулирующейся системой, способной к бесконечному процветанию./9/

Кейнсианской теорией занятости отвергается положение о том, что ставка процента уравнивает сбережения и инвестиции. Субъекты сбережений и инвесторы — это разные группы населения. В условиях здоровой экономики население сберегает значительные суммы даже во время ее процветания. При этом по собственной инициативе. Корпорации и фирмы, располагая сбережениями в виде нераспределенных прибылей, принимают инвестиционные решения исходя из:

а) ожидаемой нормы чистой прибыли;

б) реальной ставки процента.

Кейнсианцы ставят под сомнение положение об эластичности цен и заработной платы.

Теоретической основой неоклассической модели послужили концепции неоклассического направления экономической мысли. Трансформация модели государственного регулирования заключалась в отказе от воздействия на воспроизводство через спрос, а вместо этого предполагалось использование косвенных мер воздействия на предложение. Сторонники экономики предложения считают необходимым воссоздать классический механизм накопления и возродить полную свободу частного предпринимательства. Экономический рост рассматривается как функция от накопления капитала, которое осуществляется из двух источников: за счет собственных средств, т.е. капитализации части прибыли и за счет заемных средств (кредитов). Поэтому в соответствии с этой теорией государство должно обеспечить условия для процесса накопления капитала и повышения производительности производства.

Главные препятствия на этом пути — высокие налоги на прибыль и инфляция. Высокие налоги ограничивают рост капиталовложений, а инфляция удорожает кредит и тем самым затрудняет использование заемных средств для накопления.

Поэтому неоклассики предложили осуществление антиинфляционных мероприятий на базе рекомендаций монетаристов и предоставление налоговых льгот предпринимателям.

Сокращение налоговых ставок сократит и доходы госбюджета, и увеличит его дефицит, что осложнит борьбу с инфляцией и выполнение государством других экономических функций.

Следовательно, следующим шагом станет сокращение государственных расходов, отказ от использования бюджета для поддержания спроса и осуществления широкомасштабных социальных программ и общее разгосударствливание экономики.

К мероприятиям по разгосударствливанию экономики относятся:

- политика приватизации государственной собственности;

- политика дерегулирования, которая означает ликвидацию регламентаций по ценам и заработной плате, либерализацию (смягчение) антитрестовского законодательства, дерегулирование рынка рабочей силы и др.

Таким образом, в неоклассической модели государство может лишь косвенно влиять на экономику. Главная же роль в реализации экономического развития страны отводится рыночным силам./6/

2.2. Монетарная концепция антициклической политики.

Несмотря на то, что в модели Тевеса присутствует рынок денег, в ней, как и в модели Хикса-Самуэльсона, причиной конъюнктурных циклов выступают экзогенные изменения спроса на блага. Монетарные концепции экономических циклов связывают колебания экономической активности с изменениями в кредитно-денежном секторе.

Основоположником монетарной концепции экономических циклов считается Р. Хаутри. По его представлению, исходным пунктом экономического цикла является рост предложения кредита со стороны банковской системы. Далее следуют снижение ставки процента, рост инвестиций и совокупного спроса; так возникает фаза подъема, которая сопровождается ростом уровня цен. Со временем экономический подъем прекращается под воздействием двух основных факторов: внутреннего и внешнего. Первый сводится к исчерпанию избыточных резервов коммерческих банков; второй - к сокращению валютных резервов страны вследствие увеличения импорта и сокращения экспорта из-за повышения уровня цен. Оба названных фактора создают дефицит на рынке денег, и ставка процента начинает повышаться, а объем инвестиций - снижаться. Ухудшение инвестиционного климата на этой фазе развития цикла связано также с тем, что к концу фазы подъема разрыв между темпами роста уровня цен и ставки номинальной зарплаты сокращается. В результате начинаются обратные процессы: спад производства и занятости, снижение денежной ставки номинальной зарплаты и уровня цен, рост чистого экспорта, увеличение валютных резервов и денежной базы. Тем самым подготавливается основа для очередной кредитной экспансии банковской системы.

Рассмотрим более детально концепцию монетарного экономического цикла на примере модели Лайдлера. Модель описывает взаимодействие рынков благ и денег в закрытой экономике без экономической активности государства. Для отображения динамики экономических параметров используются степенные функции.

Спрос на реальные кассовые остатки является функцией от реального дохода текущего периода: . Предложение денег в каждом периоде задается экзогенно. Поэтому равновесие на денежном рынке выражается следующим равенством: .



В реальном секторе выпуск продукции зависит от степени использования существующих производственных мощностей, представленных национальным доходом полной занятости: , где - коэффициент использования производственных мощностей. Тогда условие равновесия на рынке денег будет , а равновесный темп роста предложения денег



Для упрощения записи введем следующие обозначения  
. Теперь уравнение равновесного темпа роста предложения денег принимает вид



где gt - темп ускорения роста уровня цен.

Изменение темпа роста предложения денег не нарушит равновесия на денежном рынке, если выполняется равенство



Уравнение описывает развитие экономической конъюнктуры в модели Лайдлера.

При динамическом равновесии темпы роста денежной массы и производственных мощностей постоянны и уравнение упрощается



Как будет изменяться конъюнктура в экономике в случае отклонения от равновесного роста денежной массы, зависит от параметров уравнения, т.е. от изменений уровня цен (реакции монетарного сектора) и загрузки производственных мощностей (реакции реального сектора).

В рассматриваемой модели предполагается, что темп роста уровня цен определяется двумя факторами: степенью загрузки производственных мощностей (уровнем безработицы) и ожиданиями относительно

роста уровня цен (gte). Конкретно эта зависимость тоже выражается степенной функцией.



где характеризует реакцию занятости на повышение уровня цен ( > 1).



Соответственно темп ускорения роста уровня цен



Для определения ожидаемой в текущем периоде величины роста уровня цен Д. Лайдлер использует концепцию адаптивных ожиданий, в соответствии с которой существовавшее в предшествующем периоде предположение о степени роста уровня цен корректируется с учетом ошибки прогноза (разницы между фактическим и ожидавшимся ростом)



где - коэффициент корректировки ошибки прогноза.



Поэтому ожидаемый темп ускорения роста уровня цен:



Поскольку в соответствии с уравнением то ожидаемый темп ускорения роста уровня цен в итоге определяется только степенью использования производственных мощностей



С учетом выражения темп фактического ускорения уровня цен (см. уравнение становится функцией от степени использования производственных мощностей в текущем и предшествующем периодах:



Теперь уравнение, определяющее характер развития экономической конъюнктуры в случае превышения равновесного темпа роста предложения денег, можно представить в следующем виде:



где



В результате логарифмирования степенного уравнения получается однородное дифференциальное уравнение второго порядка, подобное уравнению в модели Самуэльсона-Хикса:



Равенство выполняется только при хt = хt-1 = хt-2 = 1. Это значит, что динамическое равновесие достигается при полном использовании производственных мощностей. В этом случае, как следует из формулы, уровень цен растет с постоянным темпом, который в соответствии с уравнением равен . Поскольку в состоянии динамического равновесия kt = const, то темп роста уровня цен прямо пропорционален темпу роста денежной массы. Иначе говоря, динамическое равновесие возможно при различных темпах инфляции лишь бы темп роста предложения денег соответствовал уравнению .



Отклонение от равновесного темпа роста предложения денег нарушает динамическое равновесие в экономике. Перейдет ли после этого экономика к новому равновесному состоянию или нет, зависит от свойств дифференциального уравнения.

Используя же методы анализа, которые были применены в модели Самуэльсона-Хикса, можно установить, что динамическое равновесие является устойчивым при следующих условиях:



Поскольку по своей природе параметры , и положительны, то условия «1» и «3» выполняются. Следовательно, определяющим является условие «2»: равновесие устойчиво, если .



Вспомним, что есть коэффициент корректировки прогнозной ошибки при формировании адаптивных ожиданий. Допущение, что на практике он не бывает больше двух, вполне правдоподобно, поэтому динамическое равновесие в модели Лайдлера является устойчивым. В частности, это означает, что в длинном периоде деньги нейтральны: после любого изменения их количества экономика вернется в равновесное состояние, но с другим темпом инфляции. В коротком периоде изменение денежной массы отражается на степени загрузки производственных мощностей, уровне занятости и величине национального дохода. Будет ли в этом периоде экономика переходить к новому равновесному состоянию монотонно или через затухающие колебания, зависит от дискриминанта характеристического уравнения. При



после монетарного импульса экономика перейдет к новому динамическому равновесию через затухающие конъюнктурные колебания. /16/



2.3. Модель динамического стохастического общего равновесия.

В последнее время все чаще говорят о том, что монетарная и, в более широком смысле, экономическая политика постоянно "онаучивается". И академическое сообщество, и центральные банки в целом якобы достигли консенсуса не только по поводу набора правил, которые следует применять в разных ситуациях, но и относительно того, что в практике "монетарной политики находят применение ключевые принципы науки". Эти принципы, в свою очередь, выводятся из так называемого нового неоклассического синтеза, или новой кейнсианской модели монетарной политики, основанной на модели динамического стохастического общего равновесия (Dynamic Stochastic General Equilibrium, далее - DSGE).

Сначала опишем обычный способ анализа экономической политики в рамках неоклассического подхода. В частности, мы сосредоточимся на макроэкономических (особенно краткосрочных) моделях деловых циклов.

Столкновение двух конкурирующих теорий деловых циклов - концепции реального делового цикла (real business cycle - RBC) и парадигмы новых кейнсианцев - завершилось в конце 1990-х годов созданием нового неоклассического синтеза. Каноническая модель, используемая в рамках нового неоклассического синтеза, по сути, является RBC-моделью DSGE с монополистической конкуренцией, номинальными несовершенствами и правилами монетарной политики.

Как и в модели реальных деловых циклов, отправной точкой новых моделей стала стохастическая версия традиционной неоклассической модели роста с переменным предложением труда: в экономике существует бесконечно живущее репрезентативное домохозяйство, максимизирующее свою полезность при межвременном бюджетном ограничении, и большое количество фирм с однородной технологией производства, подверженной внешним шокам. Данную модель можно отнести и к новому кейнсианству из-за наличия трех составляющих: денег, монополистической конкуренции и жестких цен. Деньги обычно выполняют только функцию меры стоимости, их ненейтральность в краткосрочном периоде обеспечивается номинальными жесткостями в виде постоянных цен. В результате центральный банк, меняя процентную ставку, может в краткосрочном периоде влиять на деловую активность в экономике. Поскольку данная модель является моделью реального делового цикла, можно вычислить "естественный" выпуск и реальную ставку процента, которые будут равновесными величинами при совершенно гибких ценах. "Естественный" выпуск и процентная ставка задают точку отсчета для монетарной политики: центральный банк не может непрерывно "подстегивать" уровень выпуска и процентную ставку в отрыве от их "естественных" значений, не вызывая инфляцию или дефляцию. Необходимо помнить, что предпосылка о несовершенной конкуренции (и других реальных жесткостях) означает, что "естественный" уровень выпуска общественно неэффективен.

При работе с данными канонические модели DSGE (подобные описанной выше) обычно расширяют для расчета динамики инвестиций. Кроме того, различного рода шоки (например, шоки государственных расходов и частного потребления) добавляются как в уравнение IS, так и в монетарное правило. Наконец, стандартные DSGE-модели приходится модифицировать (поскольку они слишком ориентированы на будущее), чтобы они соответствовали эконометрическим данным о совместном изменении номинальных и реальных переменных (например, функции "импульс-реакция" выпуска и инфляции на шоки монетарной политики). Чтобы отразить инертность реальных данных, DSGE-модели расширяют, вводя в них большое количество жесткостей - часто не имеющих теоретического обоснования, - например заранее определенные решения о ценах и расходах, индексация цен и зарплат в соответствии с инфляцией в предыдущие периоды, жесткая заработная плата, формирование привычек потребления, издержки "подстройки" инвестиций, меняющийся коэффициент использования основного капитала и т. д.

У DSGE-моделей есть как минимум три серьезных недостатка, ставящих под сомнение целесообразность анализа политики в рамках данного подхода.

С теоретической точки зрения, эти модели общего равновесия основываются на традиции, заложенной К. Эрроу и Ж. Дебре, с незначительными невальрасианскими элементами (например, жесткими ценами), поэтому им свойственны многие недостатки традиционных моделей общего равновесия.

Прежде всего, достаточные условия существования общего равновесия не обеспечивают ни единственности его, ни устойчивости. Кроме того, известно, что невозможно каким-либо образом наложить ограничения на характеристики агентов (первоначальные запасы, предпочтения), чтобы решение было единственным и устойчивым. Доказано, что даже если агенты практически идентичны (например, имеют одинаковые предпочтения и почти одинаковые первоначальные запасы), это все равно не гарантирует единственности и устойчивости равновесия.

Для получения единственного и устойчивого равновесия неоклассики вводят в модель репрезентативного агента (далее - РА). Если поведение всех гетерогенных агентов представить как поведение РА, то можно избежать проблем, возникающих при агрегировании, и обеспечить макроэкономическим моделям общего равновесия строгие вальрасианские микрооснования. Тем не менее предпосылка о РА далеко не безобидна. Во-первых, нет формальных оснований считать, что индивидуальная рациональность влечет за собой коллективную рациональность на макроуровне. Во-вторых, даже если забыть об этом и использовать фикцию РА для получения микрооснований макроэкономических моделей, анализ экономической политики, полученный с помощью этих моделей, нельзя считать надежным, потому что реакции РА на шоки или изменение параметров могут не совпадать с агрегированными реакциями всех агентов. В-третьих, даже если решить первые две проблемы, может случиться, что при наличии ситуаций а и b РА предпочитает а, в то время как все репрезентируемые им агенты предпочитают b. Наконец, предпосылка о РА добавляет сложностей на эмпирическом уровне, потому что при тестировании какого-либо утверждения, полученного с помощью модели РА, одновременно тестируется и сама гипотеза о РА. Поэтому отказавшись от тестируемого утверждения, мы бросаем тень и на гипотезу.

Вторая группа проблем связана с эмпирической оценкой DSGE-моделей. Обычно предполагается, что они отражают истинный процесс генерирования данных для наблюдаемых величин. Это означает, что получаемые выводы и результаты тестирования экономической политики достоверны, только если DSGE-модель имитирует неизвестный нам процесс генерирования данных.

Все эти проблемы возникли потому, что при создании DSGE-моделей никто не задумывался об упрощении оценки их параметров. Вследствие этого DSGE-модели слишком требовательны к данным, в них, например, используется больше ненаблюдаемых переменных, чем наблюдаемых.

В рамках неоклассической (DSGE) парадигмы существует внутреннее противоречие. С одной стороны, такие сильные предпосылки, как рациональные ожидания, полная информация и эффективные финансовые рынки, вводятся ex ante для точного и строгого математического рассмотрения проблем и выработки политических рекомендаций. С другой стороны, множество несовершенств (например, жесткие цены, потребители, следующие "правилам большого пальца") вводится ex post без всякого теоретического обоснования, только для того, чтобы DSGE-модель могла соответствовать данным. Если же принять менее строгие предпосылки, то удалось бы решить множество эмпирических вопросов без введения несовершенств ad hoc.

Другое противоречие связано с деловыми циклами. DSGE-модели можно использовать для оценки влияния различных вариантов монетарной политики, так как это настоящие модели делового цикла. Тем не менее в основу этих моделей положена теория цикла, в которой он объясняется экзогенно: экономика находится в устойчивом состоянии до тех пор, пока не попадает под действие экзогенных стохастических шоков. Деловой цикл не объясняется, а генерируется по принципу "deus ex machina". Возможно, именно поэтому многие DSGE-модели не соответствуют стилизованным фактам о деловом цикле, а теоретики вынуждены предполагать ряд серийно коррелированных шоков для воспроизведения колебаний, подобных наблюдаемым в реальности. Вопрос о том, как политики могут оценивать влияние контрциклической политики с помощью моделей, не объясняющих деловой цикл, остается открытым.

С нормативной точки зрения одним из предполагаемых преимуществ DSGE-подхода является возможность вывести оптимальные правила проведения экономической политики. Но политик, придерживающийся таких правил, сталкивается с весьма конкретными издержками (жесткими предпосылками, лежащими в основе DSGE-моделей), в то время, как выгоды его весьма туманны. Оптимальные правила проведения экономической политики не могут использоваться на практике, так как для этого требуется знать "истинную" модель экономики, точное значение каждого параметра и численное значение каждого шока в реальном времени. Более того, было показано, что когда истинная модель экономики и соответствующая функция потерь неизвестны, правила "большого пальца" эффективнее оптимальных правил проведения политики.

В последние два десятилетия все больше исследователей идут именно пути модификации предпосылок. Так как их не устраивали стандартные равновесные макроэкономические модели, они начали создавать принципиально новую парадигму - агентное моделирование (АСЕ). Основная задача агентного моделирования - построить модели, исходя из более реалистичных (основанных на эмпирических и экспериментальных микроэкономических наблюдениях) предпосылках о поведении и взаимодействиях агентов. Например, в соответствии с обширными данными, полученными из когнитивной психологии, предпосылки совершенной рациональности и предвидения заменяются ограниченной рациональностью и адаптивным поведением. В более общем смысле агенты в модели должны обладать "той же информацией, что и экономисты, моделирующие экономику". Новые идеи современной теории сетей и социальных взаимодействий предполагают отказ от нереалистичных предпосылок о взаимодействии агентов и обращение к прямым, нетривиальным типам взаимодействий. Наконец, неоднородность и нестабильность современных рынков заставляют отказаться от многих теоретических упрощений (предпосылка РА или идея равновесия) и сосредоточиться на неравновесной динамике, эндогенно поддерживающейся при взаимодействиях гетерогенных агентов. /18/

ЗАКЛЮЧЕНИЕ

Итак, условием устойчивости и стабильного экономического развития является равновесие, сбалансированность между общественным производством и потреблением, совокупным спросом и сово­купным предложением. Однако в рыночной экономике состояние равновесности периодически нарушается. Наблюдается определенная цикличность, повторяемость в функционировании нацио­нального хозяйства, когда периоды подъема экономики сменяются периодами спада и застоя. Цикличность можно определить как движение национальной экономики от одного макроэкономичес­кого равновесия к другому. В конечном итоге через цикличность проявляется экономический рост, ибо движение происходит не по кругу, а по спирали, отражая как долговременные, так и среднесрочные колебания конъюнктуры.

Мы приходим к выводу, что для экономики характерны колебания объема национального продукта и уровня цен. Экономические циклы всегда имеют одни и те же фазы: пик, спад, подъем и оживление, но циклы отличаются друг от друга по интенсивности и продолжительности.

Хотя для объяснения циклического развития экономики использовались такие исходные причинные факторы, как технические новшества, политические события, накопления денежной массы, обычно считается, что непосредственной детерминантой объема национального производства и занятости является объем общих расходов.

Как видим, назвать единственную причину циклического хода движения рыночной экономики оказывается весьма трудным делом. Поэтому многие современные экономисты огра­ничиваются общим указанием на то, что причина циклического движения заложена в сложном и противоречивом характере многообразных сил и факторов, оказывающих воздействие на движение рыночной экономики.

Все секторы экономики по-разному и в разной степени подвергаются воздействию экономического цикла. Цикл оказывает более сильное влияние на объем продукции и занятость в отраслях, производящих инвестиционные товары и товары длительного пользования, чем в отраслях, выпускающих товары кратковременного пользования.

Очевидно, что экономические циклы и кризисы не существуют вне связи с объективными условиями. Каждый цикл и кризис воспроизводит ту экономическую обстановку, в которой он развивается. Но оха­рактеризовать тот или иной цикл или кризис можно только с временного расстояния. Как сказал С. Есенин:

Лицом к лицу — лица не увидать. Большое видится на расстоянии.

Современная рыночная экономика функционирует в услови­ях активного воздействия на нее государства. Государственное воздействие на экономику способно существенно повлиять на ход экономического цикла, меняя характер экономической дина­мики: глубину и частоту кризисов, продолжительность фаз цик­ла и соотношение между ними. Под влиянием государственного воздействия меняется механизм циклического движения. Управление коммерческими циклами — чрезвычайно сложная задача, успешно решить которую правительство может лишь в том случае, если в стране существуют достаточно развитые рыночные механизмы. Лишь через эти механизмы можно регулировать экономические циклы с достаточной степенью надежности.

В заключение отметим, что явление цикличности — естественное свойство экономики, способ ее движения. Известный экономист П. Самуэльсон в своей книге «Экономика» отмечает, что цикл — объективное явление, присущее всем странам с рыночной экономикой, и связан с внутренним и внешним факторами. Таким образом, цикл свидетельствует о жизнеспособности строя, о праве его на существование и является закономерностью развития рыночной экономики.

Список использованных источников:

1. Агапова Т.А., Серегина С.Ф. Макроэкономика: Учебник /Под общей ред. проф. А.В. Сидоровича. – М.: МГУ им Ломоносова, “ДИС”, 1997.

2. Аукуционес С.П. Современные буржуазные теории и модели цикла: критический анализ. М.: Наука, 1984.

3. Булатов А. С. Экономика: Учебник. 3-е изд., перераб. и доп. – М.: Юристъ, 2002.

4. Вводный курс по экономической теории. М.: ИНФРА-М, 1997.

5. Джеффри Д. Сакс. Макроэкономика: глобальный побход: Учебник. М: «Дело», 1996 г.

6. Добрынин А. И. Экономическая: Учебник для вузов. – СПб: Изд. «Питер Паблишинг», 1997.

7. Ивашковский С. Н. Макроэкономика: Учебник. М: «Дело», 2004 г.

8. Камаев В. Д. Экономическая теория: Учеб. для вузов – 8-е изд., перераб. И доп. – М.: Гуманит. Изд. Центр ВЛАДОС, 2001.

9. Кондратьев М.Д. Проблемы экономической динамики. – М., 1989.

10. Кураков Л.П., Яковлев Г.Е. Курс экономической теории: Учеб. пособие. Чебоксары: Изд-во Чуваш. ун-та, 2001.

11. Липсиц И.В. Экономика: В 2 кн. Кн. 2: Учебник для 10 кл. общеобразоват. учрежд. – 3-е изд. – М.: Вита-Пресс, 1998.

12. Мамедов О.Ю. Современная экономика. М.: Феникс, 1996.

13. Николаева И. П. Экономическая теория: Учебник. М: «Дело», 2002 г.

14. Носова С.С., Талахадзе А.А. Экономика: Базовый курс лекций для вузов. – М.: Гелиос АРВ, 2001.

15. Хансен Э. Экономические циклы и национальный доход. М., 1959.

16. http://www.finanal.ru

17. <http://p-w-w.ru/index>

18. http://www.contrarian.ru

ПРИЛОЖЕНИЕ А

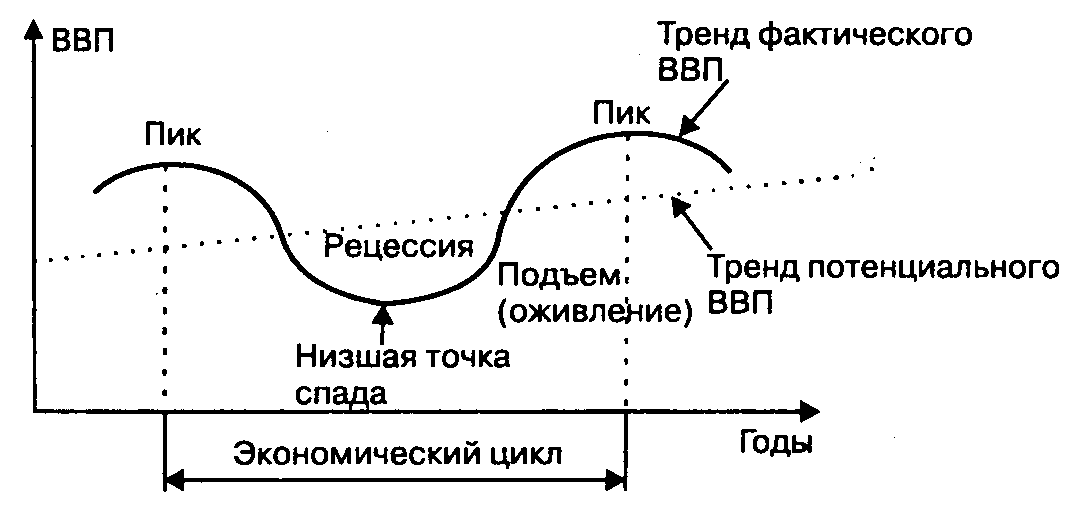


Рис. 1. – Модель экономического цикла.

ПРИЛОЖЕНИЕ Б

Таблица 1 – Основные виды циклов.

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| Тип | Длина цикла | Главные особенности |
| Китчина | 2-4 года | Величина запасов колебания ВНП, инфляции, занятости, товарные циклы |
| Жуглара | 7-12 лет | Инвестиционный цикл колебания в ВНП, инфляции и занятости. |
| Кузнеца | 16-25 лет | Доход Иммиграция Жилищное строительство совокуп. спрос доход |
| Кондратьева | 40-60 лет | Технический прогресс, структурные изменения |
| Форрестера | 200 лет | Энергия и материалы |
| Тоффлера | 1000-2000 лет | Развитие цивилизаций |