

Под редакцией

**Пола Самуэльсона  
и Уильяма Барнетта**

**О чем думают  
экономисты**

**Беседы с нобелевскими  
лауреатами**



КРИЗИС  
МИРОВАЯ ЭКОНОМИКА  
МОНЕТАРИЗМ  
СВОБОДНЫЙ РЫНОК  
РАВНОВЕСИЕ

**альпина**  
ПАБЛИШЕР

# Коллектив авторов О чем думают экономисты: Беседы с нобелевскими лауреатами

*Текст предоставлен правообладателем*

*[http://www.litres.ru/pages/biblio\\_book/?art=22055866](http://www.litres.ru/pages/biblio_book/?art=22055866)*

*О чем думают экономисты: Беседы с нобелевскими лауреатами / Под ред. П. Самуэльсона и У. Барнетта. – 2-е изд.: Альпина Паблишер;*

*Москва; 2016*

*ISBN 978-5-9614-4442-1*

## **Аннотация**

В книгу вошли беседы с выдающимися умами современной экономической науки. Такие имена, как Пол Самуэльсон, Василий Леонтьев, Милтон Фридман, Роберт Лукас и другие не требуют особого представления. Книга дает уникальную возможность узнать мнение этих блестящих специалистов по наиболее актуальным вопросам современной экономики и политики, взглянуть на экономическую науку по-новому.

Книга очень информативна. По сути, это краткое изложение эволюции экономической теории за последние полвека, представленная в легкой и доступной форме.

Для тех, кто интересуется важнейшими тенденциями мировой экономики или изучает экономические науки.

# Содержание

Выдержки из книги	7
Предисловие к русскому изданию	11
Вступительное слово	14
Предисловие	19
1. Интервью Василия Леонтьева Данкану Фоули	24
2. Интервью Дэвида Касса Стивену Спиру и Рэндаллу Райту	26
3. Интервью Роберта Лукаса-младшего Беннетту Маккаллуму	28
4. Интервью Яноша Корнаи Оливье Бланшару	31
5. Интервью Франко Модильяни Уильяму Барнетту и Роберту Солоу	35
6. Интервью Милтона Фридмана Джону Тейлору	39
7. Интервью Пола Самуэльсона Уильяму Барнетту	42
8. Интервью Пола Волкера Перри Мерлингу	46
9. Интервью Мартина Фельдштейна Джеймсу Потерба	52
10. Интервью Кристофера Симса Ларсу Петеру Хансену	54
11. Интервью Роберта Шиллера Джону	56

Кэмпбеллу	
12. Интервью Стэнли Фишера Оливье Бланшару	58
13. Интервью Жака Дреза Пьеру Деэ и Омару Ликандро	60
14. Интервью Томаса Сарджента Джорджу Эвансу и Сеппо Хонкапохья	62
15. Интервью Роберта Ауманна Серджиу Харту	65
16. Интервью Джеймса Тобина и Роберта Шиллера Дэвиду Коландеру	69
Литература	71
Введение к истории мысли	72
1. Интервью с Василием Леонтьевым	92
2. Интервью с Дэвидом Кассом	127
3. Интервью с Робертом Лукасом-младшим	180
4. Интервью с Яношем Корнаи	202
5. Интервью с Франко Модильяни	240
Конец ознакомительного фрагмента.	251
Комментарии	

# О чем думают экономисты: Беседы с нобелевскими лауреатами

Переводчики *Е. Калугин (главы 3-16), Е. Пестерева (предисловие, введение, главы 1, 2)*

Редактор *О. Нижельская*

Руководитель проекта *С. Турко*

Технический редактор *Н. Лисицына*

Корректор *Е. Чудинова*

Компьютерная верстка *А. Абрамов*

© Blackwell Publishing Ltd, 2007

© Издание на русском языке, перевод, оформление. ООО «Альпина Паблишер», 2016

Издано по лицензии Blackwell Publishing Ltd, Oxford

*Все права защищены. Произведение предназначено исключительно для частного использования. Никакая часть электронного экземпляра данной книги не может быть воспроизведена в какой бы то ни было форме и какими бы то ни было средствами, включая размещение в сети Интернет и в корпоративных сетях, для публичного или коллективного использования без письменного разрешения владельца ав-*

*торских прав. За нарушение авторских прав законодательством предусмотрена выплата компенсации правообладателя в размере до 5 млн. рублей (ст. 49 ЗОАП), а также уголовная ответственность в виде лишения свободы на срок до 6 лет (ст. 146 УК РФ).*

**\* \* \***

# Выдержки из книги

«Одно из величайших заблуждений в истории экономической мысли состоит в том, что любое изменение на фондовом рынке имеет разумное объяснение...»

*Роберт Шиллер, профессор Йельского университета, автор книги «Иррациональный оптимизм»*

«После войны в Эфиопии и вмешательства фашистских держав (Германии и Италии) в гражданскую войну в Испании мои антифашистские настроения становились все сильнее. Я решил уехать из Италии. Последнее, что меня подтолкнуло, был тесный союз Муссолини с Гитлером, который привел к принятию антисемитских законов и сделал невозможным проживание в Италии тех, кто желал сохранить уважение к себе».

*Франко Модильяни, лауреат Нобелевской премии, профессор Массачусетского технологического института*

«Доказано, что торговля позволяет избежать массовой миграции из бедных стран в богатые. Американцы утратили традиционную монополию на передовые технологии и капитал... Сегодня любая, даже незначительная победа профсоюза приближает тот день, когда американская промышленность переберется за рубеж в поисках трудовых ресурсов...

"Обиженная" рабочая сила вынуждена искать убежище под крылом новой системы жесткого корпоративного управления».

**Пол Самуэльсон**, лауреат Нобелевской премии, профессор Массачусетского технологического института

«Я встречался с Никсоном году в семидесятом... Он хотел, чтобы я убедил Артура [Бёрнса] поскорее увеличить количество денег в обращении [*смеется*], а я сказал президенту: "Вы действительно этого хотите? Ведь в результате вы столкнетесь с еще большей инфляцией – если, конечно, вас переизберут". И он ответил: "Об этом мы будем думать, когда нас переизберут". Типичная картина. Нет никаких сомнений, что именно было важно для Никсона».

*Милтон Фридман, лауреат Нобелевской премии, профессор Гуверовского института при Стэнфордском университете*

«Одного из моих близких друзей не только арестовали, но судили и расстреляли. Были арестованы многие мои лучшие друзья... Меня объявили "предателем" социализма... Когда вскрылись ужасные преступления этой системы (тюремные наказания, пытки, убийства невинных людей), мои самые искренние убеждения стали казаться наивными и постыдными».

*Янош Корнай, профессор Гарвардского университета и Института специальных исследований «Коллегиум Будапешт» в Венгрии*

«Теория узлов, как и теория чисел, была абсолютно, абсолютно бесполезной. Этим меня узлы и привлекли... Пятьдесят лет спустя "абсолютно бесполезную", "чистейшую" теорию преподают на втором курсе медицинских вузов».

«На поведение Кеннеди в тот период оказала влияние школа теории игр... и теперь ставят ему в заслугу то, как он вел себя во время [Карибского] кризиса... Киссинджер говорил о применении теоретико-игрового мышления в дипломатии периода холодной войны... Тогда люди действительно думали, что наступает конец света».

*Роберт Ауманн, лауреат Нобелевской премии, профессор Иерусалимского университета*

## ОТЗЫВЫ О КНИГЕ

«Высший пилотаж!»

*Одед Галор, профессор Университета Брауна, Иерусалимского университета, редактор Journal of Economic Growth*

«Уникальный взгляд изнутри... увлекательное чтение для всех интересующихся экономической наукой и ее ролью в современном обществе».

*Сенно Хонкапохья, профессор Кембриджского университета*

«*People Magazine* для интеллектуалов – с

картинками!»

*Роджер Фармер, Калифорнийский университет*

«Эти удивительно откровенные интервью очень назидательны. Этот замечательный сборник должен прочитать каждый».

*Адриан Пейган, Австралийский национальный университет*

«Они ругаются и сплетничают о своих коллегах. Они рассказывают о том, что до сих пор было известно только посвященным».

*Lawrence Journal World*

# Предисловие к русскому изданию

Перед читателем книга, которая продолжает серию, предлагаемую Московской школой управления СКОЛКОВО. Серия объединяет литературные труды ярких и незаурядных авторов, и «Беседы с нобелевскими лауреатами» должны по праву занять в ней особое место. Дело не только в том, что под одной обложкой здесь собраны интервью самых выдающихся деятелей современности в области экономики. Поскольку многие из этих ученых являются специалистами по макроэкономике, широкий ряд вопросов, обсуждавшихся в ходе бесед, связан с самыми различными и наиболее животрепещущими проблемами политического, экономического и социального развития общества

Масштаб личности интервьюируемого определяет не только широкий охват рассматриваемых проблем – беседы с такими уникальными людьми демонстрируют, насколько велики их жизненные устремления и объем задач, которые они себе ставят в профессиональном плане. И это, безусловно, имеет огромный воспитательный эффект для любого молодого человека, который делает первые шаги в своей карьере – как в бизнесе, так и в другой области.

Участниками представленных интервью стали, в числе прочих, бывшие и нынешние руководители центральных банков, а также бывший глава Комитета экономических со-

ветников при президенте США. Поэтому особенно интересно «звучат» в книге обсуждения механизмов государственного регулирования экономики и, в частности, бизнеса, возрастающей роли инструментов экономической политики в периоды кризисов, особенности взаимоотношений правительства и экономических советников в странах Европы и в США. Богатый опыт экономистов-практиков такого уровня делает их суждения и выводы убедительными, а рассказы о карьере и жизненном пути – бесценными.

Жанр интервью – довольно нестандартный формат для представления в книге подобного материала. Однако в данном случае он более чем уместен и оправдан. Прежде всего, в беседе автор даже самых сложных экономико-математических моделей вынужден наиболее популярно и доходчиво объяснить своему визави основные идеи исследований. Кроме того, интервьюера, как правило, интересует и биография собеседника, в частности, поворотные моменты в его судьбе и карьере, решающие факторы в выборе тем исследований. Искренние и эмоциональные ответы придают разговору особый характер и «вкус». Несмотря на то, что текст в ряде интервью нельзя назвать простым, пытливым читатель будет в конце концов вознагражден – книга насыщена фактами и историями, она невероятно познавательна.

Еще один аспект, связанный с материалом книги, имеет для нас большое значение. В беседах этих великих людей важное место занимает тема традиций тех учебных заведе-

ний, в которых они учились и работали, а это университеты и бизнес-школы с мировыми именами – Йельский университет, Массачусетский технологический институт, Гарвардская школа бизнеса и другие. Любому читателю станут понятнее принципы, которые лежат в основе создания престижного учебного заведения, а также подходы, позволяющие этот престиж поддерживать и сохранять.

Студенты и преподаватели найдут в этой книге полезные для себя примеры того, на что способны талантливые люди в качестве наставников, как они заражают учащихся своими идеями, делают их единомышленниками в поисках самых трудных ответов, как за счет этого создается удивительная атмосфера, в которой протекает наиболее конструктивное сотрудничество всех участников учебного процесса. Уверен, что эти примеры не оставят никого равнодушным и опыт учебных заведений с мировой славой поможет – и не только нам, в Московской школе управления СКОЛКОВО – формировать лучшие традиции российского бизнес-образования.

*Андрей Волков,*

*ректор Московской школы управления СКОЛКОВО*

# **Вступительное слово**

## **О связи биографий отдельных ученых с биографией науки**

*Пол Самуэльсон*

Эта книга – нечто большее, чем сумма ее отдельных частей. Сомерсет Моэм когда-то сказал, что «необходимо узнать две страны, чтобы знать одну». Другими словами, иногда один плюс один – это больше, чем два. Адам Смит и Эллин Янг называли это феноменом растущей отдачи при увеличении масштабов производства.

Когда какая-нибудь область знания (неважно, экономика, религия или акупунктура) находится на стадии быстрого развития, тех, кто идет в ее авангарде, не слишком заботит, кто именно «изобрел» дифференциальное исчисление – Ньютон или Лейбниц. А экономическая наука, как показывают собранные в книге интервью, находится сейчас именно на такой стадии. Эта книга позволяет сделать шаг назад и взглянуть на науку так, как не удастся отдельным ученым с их узкой специализацией. Ведь те, кто преуспевают в экономической науке XXI века, совершенно не задумываются о том, что сделал для теории предельной производительности Джон Бейтс Кларк и чего не сделал Иоганн Генрих фон

Тюнен.

Этим, в частности, объясняется тот факт, что когда-то историю экономической мысли преподавали студентам, а теперь она интересует только узкую группу экспертов. Результат – неоправданный снобизм, наглядно иллюстрируемый шуткой Бернарда Шоу: «Те, кто может, делают. Те, кто не может – преподают». История науки вполне заслуживает того, чтобы присутствовать в университетской программе. Динамичный рост в отдельных областях экономики должен дополняться анализом целого, а не просто суммы его составляющих. Эта книга дает именно такую картину всей современной экономической науки и показывает ее связь с судьбами знаменитых экономистов, способствовавших развитию этой науки.

Докажем еще раз, как полезно рассматривать не один, а множество случаев, и проанализируем приписываемое Сократу высказывание: «Не изучая жизнь, не стоит и жить». Когда-то я прочитал превосходную книгу о крупнейших философах – таких как Спиноза, Кант, Гегель, Витгенштейн, Рассел – и сделал вывод, что Сократ был абсолютно не прав. Их судьба – сплошная цепь испытаний: суициды, разводы, постоянная депрессия, целибат. Проще всего это объяснить тем, что занятия философией лишают людей способности радоваться жизни. Но правильней было бы сказать, что ранее сиротство или врожденная дислексия и т. п. подталкивают человека к тому, чтобы стать философом, а не жизнерадост-

ным барменом. Объективное и глубокое понимание целого в любой сфере знаний важно, но дается оно не так легко, как приобретение навыков бармена.

Но вернусь к экономике, экономистам и к вопросу о том, почему в этой науке сложились те направления, о которых рассказывается в книге. Один крупный консервативный экономист как-то объяснил, что его антипатия к государству восходит к поражению, нанесенному его южным предкам со стороны более развитого северного соседа. А вот еще один факт. Джоан Робинсон как-то написала, что ее отрицательное отношение к вступлению Великобритании в Общий рынок объяснялось тем, что «в Индии [времен Неру] друзей у нее было больше, чем на континенте». Да, на мировоззрение иногда действительно влияют какие-то личные моменты. Но можем ли мы полностью доверять тому, что человек пишет о себе сам? Та Робинсон, которую я знал, вполне могла думать в 60-е годы, что ее разновидность «постфабианского» социализма в Индии прижилась бы лучше, чем на континенте. И, к сожалению, думая так, она, возможно, была бы права.

Научные труды в силу самого их характера не предназначены для того, чтобы раскрывать личные мотивы своих авторов. Пытаясь понять, чем так привлекательна эта книга, следует ответить на вопрос, должны ли нас вообще волновать те личные причины, по которым выдающиеся экономисты выбирают для себя те или иные темы исследования? И если да, то позволяет ли формат интервью получить наиболее точное

представление об этих причинах?

Закончу одним не самым достойным предположением относительно движущих мотивов и прошлых, и нынешних экономических исследований. Шерлок Холмс сказал: «*Шерше ля фам*». Когда Уилли Саттона спросили, почему он грабил банки, он ответил: «Потому, что в них хранятся деньги». Мы, экономисты, работаем, прежде всего, для того, чтобы заслужить уважение коллег, позволяющее нам самим больше уважать себя. Когда после Депрессии, в период Нового курса Рузвельта у желающих появилась прекрасная возможность найти работу, сначала полевели младшие по должности преподаватели. Затем, не желая от них отставать, полевели, и даже в еще большей степени, их старшие товарищи. А пострейгановский, посттэтчеровский электорат сместился вправо, следует к цели, определяемой только деньгами, и идет, увы, лишь в одном направлении. Пожинаем, так сказать, плоды собственного труда.

Мы, экономисты, любим цитировать последние строки вышедшей в 1936 г. «Общей теории» Кейнса – поскольку они льстят нашему тщеславию и чувству собственной значимости. Но нужно признать: сумасшедшие во власти способны *самостоятельно воспроизводить* свое безумие и во все не нуждаются в помощи ни покойных, ни нынешних экономистов. Сплошь и рядом продукция экономистов истеблишмента – только то, что и лидеры, и массы уже жаждали воспринять. Мы, экономисты, вовсе не пытаемся оставаться

в высшей лиге, пропагандируя идеи какого-нибудь ученого чудака из прошлого.

Эта книга – действительно нечто большее, чем сумма ее частей. Она дает редкую возможность взглянуть на экономическую науку так, чтобы понять насколько личные мотивы и жизненный опыт выдающихся современных ученых определяют их научный вклад.

# Предисловие

## О целях и содержании этой книги

### *Уильям Барнетт*

[1]

Интервью, вошедшие в сборник, дают уникальную возможность познакомиться с размышлениями ряда крупнейших экономистов мира, работа которых способствовала развитию современной экономической мысли. Особый характер сборнику придает источник этих интервью. Впервые они были опубликованы в весьма авторитетном, коллегиально рецензируемом журнале издательства Cambridge University Press *Macroeconomic Dynamics*, редактором которого я являюсь. Статьи в подобных научных журналах обычно рецензируются, что обязывает авторов публиковать только то, что считается приемлемым с точки зрения рецензентов и редакторов этих журналов. Эти ограничения делают невозможным спонтанное, ничем не скованное обсуждение, которое характерно для массовой прессы. Но именно публикация в этих профессиональных журналах особенно ценится учеными, поскольку она несет на себе печать одобрения коллег, а также соответствия высоким требованиям науки. Поэтому, издавая свои работы в таких журналах, ученые общаются друг с другом, и это вызывает уважение со стороны коллег.

Непосвященному может показаться странным, что даже мировым знаменитостям, лауреатам Нобелевской премии не разрешается обращаться в научном журнале к другим экономистам, не соблюдая ограничений, накладываемых коллегиальным рецензированием. Осознавая эту проблему, я ввел в *Macroeconomic Dynamics* постоянную рубрику, посвященную интервью<sup>[2]</sup>. В каждом номере этого журнала публикуется не более одного интервью – во всех остальных отношениях это строго рецензируемый научный журнал. Но издающему журнал издательству – Cambridge University Press – было разъяснено, что интервью – это цитата и поэтому не может правиться рецензентами, младшими редакторами и редакторами, издателем или мной. Цитаты редактировать нельзя, так как это вопрос свободы слова и свободы печати.

С самого основания журнала интервьюерам и интервьюируемым сообщают о том, что они могут говорить в интервью все, что пожелают, хотя остальные материалы журнала коллективно рецензируются. В результате ведущие ученые в этой области получили возможность свободно высказываться по любым вопросам, которые они хотели бы обсудить со своими коллегами, включая личные, религиозные или политические. Персональные выпады, упреки в нечестности или предвзятости или в преследовании по религиозным или политическим мотивам, а также слишком резкие высказывания о политиках, представителях органов власти или о государственной политике, обычно не допускаемые на страницы

специальных журналов, из этих интервью не вычеркиваются. Интервьюируемые вправе требовать их публикации. Ту эмоциональность высказываний, которая характерна для некоторых из этих интервью, невозможно найти в других экономических журналах. Из этих интервью ничего не вычеркнуто ни редакционным советом, ни Cambridge University Press, хотя в одном интервью<sup>1</sup> Cambridge University Press действительно не решилось полностью привести известное англосаксонское ругательство.

В эту книгу вошли интервью восьми нобелевских лауреатов (Василия Леонтьева, Роберта Лукаса, Франко Модильяни, Роберта Солоу, Милтона Фридмана, Пола Самуэльсона, Роберта Ауманна и Джеймса Тобина), двух управляющих центральных банков – Пола Волкера (экс-председателя Федеральной резервной системы США) и Стэнли Фишера (управляющего Банка Израиля), а также председателя Совета экономических консультантов США Мартина Фельдштейна. Другие участники интервью входят в число будущих претендентов на Нобелевскую премию по экономике. Несмотря на широкую известность интервьюеров и интервьюируемых, столь объективный рассказ об их жизни и взглядах вы найдете только в этой книге или в тех интервью, что послужили ее основой и были впервые опубликованы в *Macroeconomic Dynamics*.

Ниже перечислены те не менее важные интервью, кото-

---

<sup>1</sup> Имеется в виду интервью Дэвида Касса. – Прим. пер.

рые были также опубликованы в *Macroeconomic Dynamics* и которые планируется включить в готовящийся второй том этой книги наряду с другими еще не опубликованными интервью. Второй том будет не менее информативным, и обе книги позволят получить наиболее полное представление о взглядах самых влиятельных экономистов мира.

Интервью Аллана Мельцера Беннету Маккаллуму  
(*Macroeconomic Dynamics*, vol. 2, no. 2, 1998).

Интервью Элханана Хелпмана Дэниелу Трефлеру  
(*Macroeconomic Dynamics*, vol. 3, no. 4, 1999).

Интервью Уильяма Брока Майклу Вудфорду  
(*Macroeconomic Dynamics*, vol. 4, no. 1, 2000).

Интервью Карла Шелла Стивену Спиру и Рэндаллу Райту  
(*Macroeconomic Dynamics*, vol. 5, no. 5, 2001).

Интервью Акселя Лейонхуфвуда Брайану Сноудону  
(*Macroeconomic Dynamics*, vol. 8, no. 1, 2004).

Интервью Анны Шварц Эдварду Нельсону  
(*Macroeconomic Dynamics*, vol. 8, no. 3, 2004).

Интервью Гильермо Кальво Энрике Мендоса  
(*Macroeconomic Dynamics*, vol. 9, no. 1, 2005).

Интервью Ассара Линдбека Торвальдуру Гильфасону  
(*Macroeconomic Dynamics*, vol. 10, no. 1, 2006).

Следуя высоким стандартам в нашей науке, мы попросили написать введение к этой книге одного из ведущих миро-

вых авторитетов в области истории экономической мысли – Роя Вайнтрауба. Введение Вайнтрауба следует за этим предисловием. Кроме того, один из соредкторов этой книги, Пол Самуэльсон, написал к ней краткое, но очень содержательное вступительное слово (которое предшествует этому предисловию)<sup>[3]</sup>. Чтобы показать, как много интересного содержится в этих интервью и каких нестандартных взглядов придерживаются собеседники, ниже коротко цитируются их наиболее оригинальные высказывания. Несмотря на то что эти цитаты приводятся вне контекста и не могут служить заменой полным текстам интервью, они дают представление о содержании этой важной и увлекательной книги.

Все собранные в книге интервью по тексту полностью совпадают со своими оригиналами, опубликованными в журнале *Macroeconomic Dynamics*, однако некоторые фотографии были опущены. Далее приводится ряд высказываний, которые можно найти в этой книге.

# 1. Интервью Василия Леонтьева Данкану Фоули

Василий Леонтьев, более всего известный как создатель одного из основных инструментов планирования – метода анализа «затраты-выпуск», получил Нобелевскую премию по экономике в 1973 г., будучи профессором Гарвардского университета. Он родился в России в 1905 г. Следующие цитаты показывают, что можно узнать из интервью о его жизни и взглядах:

Маркс не был хорошим математиком. Он все время путался в цифрах и выкладках, и в его трудовой теории стоимости далеко не все сходится.

Я уехал из Советского Союза в 1925 г. У меня действительно были проблемы с властями.

Ричард Гудвин был моим учеником... Он не мог найти постоянную работу, поэтому и уехал в Англию. Полагаю, все дело было в политике. Он был левым.

Отвечая на вопрос, каким он видит будущее экономической науки, В. Леонтьев сказал:

Думаю, значение проблем распределения доходов увеличится. Как я уже упомянул, труд не будет более так важен, и главным будет просто управлять системой. Люди будут получать доходы через систему социального обеспечения. Уже сейчас мы получаем их

через социальное обеспечение и пытаемся придумать предлоги для оказания людям социальной помощи. Огромную роль при этом, полагаю, будет играть государство, и те экономисты, которые стараются ее минимизировать, боюсь, не совсем понимают, как работает экономическая система. Мне кажется, если бы мы сейчас упразднили государство, то наступил бы полный хаос... Это было бы ужасно.

Василий Леонтьев умер в 1999 г., через год после публикации его интервью в *Macroeconomic Dynamics*.

## 2. Интервью Дэвида Касса Стивену Спиру и Рэндаллу Райту

Дэвид Касс обогатил экономическую теорию ценнейшими идеями, включая идею «равновесия солнечных пятен», разработанную им вместе с Карлом Шеллом. Влияние Касса, а также Хирофуми Узава и Карла Шелла на экономику было столь велико, что это дало мощный толчок развитию всей экономической мысли. Главное, что обсуждалось в ходе этого интервью, – достижения этой науки. Когда я поступил в аспирантуру Университета Карнеги-Меллона, Касс там преподавал, но, к моему большому сожалению, вскоре ушел. По причинам, о которых говорится в этом интервью, он перешел в Университет штата Пенсильвания.

У Касса есть одна примечательная черта характера, хорошо известная его коллегам и наглядно проявившаяся в следующем эпизоде:

Нам нужно было пригласить нового декана. В [университете] Карнеги в этом процессе активно участвовал преподавательский состав... Мы согласились с кандидатурой Арни Вебера... и это обернулось и для университета, и для меня настоящей катастрофой... Арни вызвал меня в свой кабинет под каким-то предлогом и сказал, что я – предмет роскоши и делаю совсем не то, что нужно. Я

занимаюсь экономической теорией, а этого школа бизнеса позволить себе не может. Он говорил со мной настолько вызывающе, что вывел меня из себя. Я ответил ему: «Да пошел ты..., Арни!»... Да, я так и сказал: «Да пошел ты...».

О лауреате Нобелевской премии Роберте Лукасе, преподававшем в то время в Университете Карнеги-Меллона, Касс говорит:

Боб был сторонником чикагской школы и придавал большое значение тому, что называлось эмпирической проверкой, и что, по правде говоря, не вызывало у меня никакой симпатии и интереса.

Внеся в теорию реального экономического цикла существенный вклад в виде модели Касса-Купманса, Касс, тем не менее, говорит:

...Беда в том, что теория реального экономического цикла превратилась сегодня чуть ли не в религию.

### 3. Интервью Роберта Лукаса-младшего Беннетту Маккаллуму

Роберт Лукас получил Нобелевскую премию по экономике в 1995 г., будучи профессором Чикагского университета. В своем введении к этому интервью Беннетт Маккаллум пишет:

Боба Лукаса многие считают наиболее влиятельным экономистом последних 25–30 лет, по крайней мере, из тех, кто занимается макроэкономикой и теорией монетаризма.

Из этой книги вы узнаете, что интерес к экономике в Лукасе, тогда еще семи-восьмилетнем мальчишке, впервые пробудил его отец своими рассуждениями об организации перевозок молока при социализме. О своих аспирантских годах в Чикагском университете Лукас вспоминает следующее:

Когда я был аспирантом, отношение к любому планированию было в университете настолько отрицательным, что нас не учили думать, *как следует* распределить ресурсы в данной ситуации или *как* использовать имеющуюся информацию, чтобы сформировать ожидания. А ведь именно эти «как» и должны быть всегда первыми вопросами экономиста. Мой отец ошибался, считая, что при социализме молоко перевозилось бы эффективно, но он правильно

думал о том, *как нужно* перевозить молоко.

Также он замечает:

Меня радуют успехи теории общего равновесия в макроэкономике, но огорчает то снижение интереса к деньгам, к которому привели эти успехи.

О значении технологических потрясений он говорит следующее:

Если мы обсуждаем американскую депрессию 30-х годов или депрессию в Индонезии сегодня или в Мексике пять лет назад, то я бы сказал, что технологические потрясения – лишь незначительная деталь всей картины. А вот в послевоенных Соединенных Штатах их роль была намного больше.

На вопрос, является ли инерционность цен важным экономическим феноменом, Лукас отвечает:

Да. На практике дефляция наносит современной экономике намного больший ущерб, чем это предсказывает имеющаяся у нас сегодня теория денег.

О денежно-кредитной политике Лукас говорит:

...Меня беспокоит та негативная динамика, которая также беспокоила Викселля, а позднее и Питера Хауитта.

Далее он замечает:

Я вовсе не утверждаю, что нестабильность денежно-кредитной системы не способна нанести большого

урона, – просто в Соединенных Штатах за последние 50 лет она его не наносила.

О современной микроэкономике Лукас говорит:

В последние 15 лет микроэкономика для многих (но не в Чикагском университете!) стала синонимом теории игр, и это вызывает сожаление.

## 4. Интервью Яноша Корнаи Оливье Бланшару

Для многих экономистов Янош Корнаи – настоящий герой. Еще во время проживания в своей родной коммунистической Венгрии, он приобрел известность среди западных экономистов, несмотря на все препятствия и даже угрозу для его жизни. Оливье Бланшар в своем введении к этому интервью поясняет:

Эти трудности не помешали ему подвергнуть социалистическую систему такой обстоятельной критике, какой она не подвергалась до сих пор.

В настоящее время Корнаи работает как в Гарвардском университете, так и в Институте специальных исследований «Коллегиум Будапешт». В своем интервью он, в частности, рассказывает:

Одного из моих близких друзей не только арестовали, но судили и расстреляли. Арестованы были многие мои лучшие друзья. Меня объявили «предателем» социализма и уволили.

Я по-прежнему восхищаюсь Марксом как интеллектуальным гигантом; многие его идеи по-прежнему остаются полезными. Однако он был абсолютно не прав по ряду фундаментальных вопросов.

До 1963 г. мне не выдавали паспорта. Например, у

меня на протяжении нескольких лет было постоянное приглашение от Лондонской школы экономики, но поехать в Лондон я не мог.

Говоря о своей ранней книге «Сверхцентрализация» и событиях, которые привели к ее созданию, Корнаи замечает:

Разочарование я впервые испытал в 1953 г., ... когда стали известны многие факты, о которых прежде умалчивали... Когда я узнал о многочисленных преступлениях системы (тюремные заключения, пытки и убийства невинных людей), мои самые искренние убеждения стали казаться наивными и постыдными. Также я начал осознавать, что с экономической точки зрения этот режим нефункционален и неэффективен, порождает дефицит и подавляет инициативу и спонтанность.

Он продолжает:

«Сверхцентрализация» привлекла внимание всего мира, так как была первой книгой гражданина страны социалистического блока, в которой он критиковал систему.

Далее он отмечает, что в предисловии ко второму изданию «Сверхцентрализации»...

...охарактеризовал Корнаи периода 1954–1956 гг. как «наивного реформатора».

О своей книге «Антиравновесие» он говорит:

Мне несколько обидно, что она осталась

практически незамеченной. Первыми и чуть ли не единственными, кто уделил ей хоть какое-то внимание, были Эрроу и Купманс; затем она как-то затерялась... Сдается мне, что умение задавать правильные вопросы, по крайней мере, в нашей профессии, отнюдь не прибавляет вам репутации».

Рассказывая о своей книге «Экономика дефицита», он заявляет:

Нефункциональность социализма имеет системный характер... Я был не слишком похож на остальных так называемых реформаторов, которые добивались незначительных изменений в коммунистической системе. В этом смысле это книга революционна... Чтобы система стала функциональной, нужно изменить ее целиком».

Заговорив затем о своей книге «Социалистическая система», он отмечает:

Главной задачей здесь было показать, что классическая сталинская система, какой бы репрессивной и жестокой она ни была, была органичной, в то время как более либеральная полуреформированная система горбачевского типа таковой не была и легко поддавалась распаду. Я предсказал это распад.

О нынешней посткоммунистической Восточной Европе Корнаи говорит:

Думаю, что люди, принадлежавшие к элите прежнего социалистического режима, за редким исключением, окончательно забыли Коммунистический манифест, но у них есть немало друзей из прошлого. Сейчас эти связи имеют огромное значение в бизнесе, политике, культурной жизни. Люди, знавшие друг друга при старой системе, точно знают, кто им друг, а кто – враг.

## 5. Интервью Франко Модильяни Уильяму Барнетту и Роберту Солоу

Франко Модильяни получил Нобелевскую премию по экономике в 1985 г., будучи профессором MIT (Массачусетского технологического института). Это интервью у него взяли Нобелевский лауреат 1987 г. Роберт Солоу и я. Поскольку интерес к экономике во мне пробудили лекции, которые Модильяни читал аспирантам и которые я посещал, будучи еще студентом последнего курса MIT, я чувствовал особую ответственность за то, чтобы замечательная жизнь и заслуги Модильяни нашли в этом интервью адекватное отражение. Многие из заданных мной вопросов должны были развеять слухи, упорно ходившие среди студентов. Из интервью вы узнаете, насколько они были правдивы.

Модильяни покинул Италию вместе со своими родителями в период правления Муссолини. Он объясняет в своем интервью:

После войны в Эфиопии и вмешательства фашистских держав (Германии и Италии) в гражданскую войну в Испании мои антифашистские настроения становились все сильнее. Я решил уехать из Италии. Последнее, что меня подтолкнуло, был тесный союз Муссолини с Гитлером, который привел к принятию антисемитских законов и сделал

невозможным проживание в Италии тех, кто желал сохранить уважение к себе.

Как довольно подробно объясняется в этом интервью, сначала семья переехала во Францию, а затем в США. Но Модильяни, чтобы защитить диссертацию, возвращался из Парижа в Рим, несмотря на фашистский режим:

Затея была далеко не безопасной, поскольку меня могли арестовать. Я поддерживал контакты с антифашистскими группами в Париже и поэтому рисковал угодить в тюрьму.

Он рассказывает, что во время пребывания в Риме у них с отчимом был особый условный сигнал опасности. Многие говорили, что Франко Модильяни – родственник знаменитого художника и скульптора Амедео Модильяни, но это оказалось только слухом.

Его первой работой в США стало преподавание в университете Новая школа в Нью-Йорке. Он получил предложение от Гарварда, но всем на удивление его отклонил, что сам объясняет следующим образом:

Отказаться от этого предложения меня упорно убеждал декан факультета, профессор Бербэнк, который, как я позже обнаружил, имел репутацию ксенофоба и антисемита.

Отвергнув предложение Гарварда, Модильяни перебрался в Иллинойский университет, где зарплата была выше, чем в Гарварде. О своих годах в Иллинойсе он вспоминает:

Ректор университета пригласил замечательного нового декана Говарда Боуэна. Но старые и некомпетентные преподаватели не могли смириться с тем, что Боуэн привел с собой талантливых людей. Они сумели выжить Боуэна, воспользовавшись «охотой на ведьм», развернувшейся в то время под руководством печально известного сенатора Джозефа Маккарти. Маккартистское крыло выборных попечителей возглавлял знаменитый футболист Ред Грейндж. Я испытал тогда такое отвращение, что хлопнул дверью. Местная пресса до сих пор вспоминает: «Наконец в Коммерческом колледже наступил покой, правда, сильно напоминающий кладбищенский». Мой уход старые преподаватели встретили с радостью, прямо пропорциональной их некомпетентности. Однако 40 лет спустя этот университет сочтет необходимым присвоить мне почетную степень!

В этом интервью, данном незадолго до биржевого кризиса 2000 г., Модильяни сказал в том числе следующее:

Думаю, что фондовый рынок США в настоящий момент действительно представляет собой огромный пузырь, который вот-вот лопнет. Полагаю, курс акций завышен процентов на 25. Лично я ожидаю коллапса, поскольку если картина такова, измениться постепенно она не сможет».

В этом интервью он во всеуслышание сделал прогноз и

оказался прав. Неудивительно, что один из учеников Модильяни, Роберт Шиллер, автор знаменитой книги «Иррациональное изобилие», назвал его «своим героем».

О Роберте Барро, который также был его учеником, Модильяни говорит следующее:

На мой взгляд, теорема Барро, несмотря на свою элегантность, бессодержательна. Не понимаю, почему столь многих убедило предположение, основанное на неправдоподобном допущении, что все люди заботятся о своем потомстве, как о самих себе.

Модильяни подразумевает идею Барро в отношении принципа эквивалентности Рикардо и соответствующую точку зрения на роль государственного долга. О денежно-кредитной политике и правиле Фридмана он говорит:

В борьбе между моей рекомендацией проявлять осмотрительность (или здравый смысл) и рекомендацией Фридмана пренебречь осмотрительностью и слепо подчиняться правилам... мой совет победил без каких-либо усилий. Сегодня ни одна страна мира не пользуется безоглядно правилом Фридмана.

Ф. Модильяни умер в 2003 г.

## 6. Интервью Милтона Фридмана Джону Тейлору

Милтон Фридман получил Нобелевскую премию по экономике в 1976 г., будучи профессором Чикагского университета. Алан Гринспен, бывший глава Федеральной резервной системы США, сказал о Милтоне Фридмане следующее:

Он повлиял на наши представления о денежно-кредитной политике и других важнейших экономических проблемах намного больше, чем кто-либо из живущих во второй половине двадцатого столетия.

О «Великой инфляции» 70-х годов Фридман заявлял:

Думаю, во многом виноват Артур Бёрнс... С момента его появления в Федеральной резервной системе большую роль в происходящем стала играть политика. Для Никсона она, безусловно, имела значение – я знаю это из личного опыта. Я встречался с Никсоном, думаю, году в семидесятом или в семьдесят первом... Он хотел, чтобы я убедил Артура [Бёрнса] поскорее увеличить количество денег в обращении [смеется], а я сказал президенту: «Вы действительно этого хотите? Ведь в результате вы останетесь с еще большей инфляцией – если, конечно, вас переизберут». И он ответил: «Об этом мы будем думать, когда

нас переизберут». Типичная картина. Нет никаких сомнений, что именно было важно для Никсона.

В связи с этим могу сказать, что я сам работал в Совете управляющих Федеральной резервной системы с июля 1973 по декабрь 1981 г., т. е. в том числе в период председательства Бёрнса. Также я встречался с ним, по его просьбе, в Американском институте предпринимательства уже по окончании срока его полномочий в Совете. Он сказал, что действительно заслуживает во многом порицания, но дело было вовсе не в политическом давлении. Он утверждал, что заблуждался совершенно искренне, так как не понимал, что естественный уровень безработицы становился выше. Результатом этого непонимания, по его словам, стала плохо организованная попытка снизить безработицу до такого низкого уровня, который невозможно было бы сохранить. Конечно, если бы Белый дом действительно оказывал на Бёрнса политическое давление, то вряд ли он мне бы в этом признался.

О Никсоне в интервью Фридман говорит:

Коэффициент интеллекта у него был выше, чем у Рейгана, но он был гораздо более беспринципным. Он был политиком до мозга костей.

Фридман вспоминает, что когда Бёрнс был аспирантом,

...он жил в Гринич-виллидже. У него были длинные волосы и длинные ногти. И, знаете, характер у него был

вовсе не такой, каким стал потом.

О своих взглядах в годы учебы в университете Фридман говорит:

Возможно, я даже охарактеризовал бы себя как социалиста.

На вопрос об использовании математики в экономике Фридман отвечает:

Повторю то, что сказал об экономике Альфред Маршалл: переведите свои результаты на английский язык, а потом сожгите математические расчеты.

Отвечая на вопросы о перспективах единой европейской валюты, Фридман замечает:

Думаю, это было бы чудом, хотя, пожалуй, чудо – это сказано слишком сильно. Полагаю, что эта затея вряд ли будет иметь большой успех.

Также в этом интервью Фридман сказал:

Курс евро в настоящее время занижен; а американского доллара – завышен... Евро по отношению к доллару вырастет, а доллар – упадет.

Так оно и случилось.

## 7. Интервью Пола Самуэльсона Уильяму Барнетту

Пол Самуэльсон получил Нобелевскую премию по экономике в 1970 г., будучи профессором МІТ. Я сам учился в МІТ с 1959 по 1963 г. У студентов всех специальностей в институте было два кумира, совершенно затмивших собой остальных преподавателей: великий математик Норберт Винер и великий экономист Пол Самуэльсон. В МІТ, где все штатные профессора – всемирно известные ученые, затмить собой остальных могли только самые выдающиеся ученые своего времени.

Думаю, что мощный интеллект Самуэльсона и в наши дни пугает многих экономистов. К моему удивлению, найти экономиста, который согласился бы взять у него интервью, оказалось нелегко. В конце концов, я нашел такого (В.В. Чари из Миннесотского университета). Но обратно он летел на самолете, в аэропорту ленты с записью интервью пропустили через сканер для досмотра багажа. Рентгеновские лучи уничтожили запись. В результате вместо того, чтобы искать другого желающего, я провел интервью сам. И получил незабываемые впечатления.

В течение всей своей карьеры Пол Самуэльсон делал в среднем по одной работе в месяц. Однажды он сказал:

Пусть тот, кому хочется, пишет законы для этой страны – пока я могу писать для нее учебники.

Широко известен факт: когда защита Сэмюэльсоном диссертации в Гарварде подходила к концу, великий экономист Йозеф Шумпетер повернулся к [будущему] нобелевскому лауреату Василию Леонтьеву и спросил: «Ну что, Василий, мы уже в прошлом?»

По поводу интерпретации Кейнса Лейонхуфвудом Самуэльсон в интервью отмечает: «Я знал, что она неверна».

Из интервью вы также узнаете точку зрения Самуэльсона относительно «беспрецедентного рейгановского бюджетного дефицита».

Вспоминая своего первого преподавателя экономики, Аарона Директора, Самуэльсон замечает:

Он был единственным из ныне живущих, кто мог назвать Милтона Фридмана своим абсолютным единомышленником.

Самуэльсон вспоминает о том, как в годы Депрессии был студентом и одним из его преподавателей был Фрэнк Найт:

В то время выбирали только между коммунизмом и фашизмом. Сам Найт ни за что бы не выбрал последний. Позже, конечно, он оправился от этого состояния и отрекся от своего широко растиражированного текста. Где-то в моем архиве до сих пор хранится экземпляр его заявления,

предрекавшего гибель демократии.

Рассказывая о своем обучении в Чикагском университете, он отзывается об экономическом факультете как о «догматически-консервативном». Аспирантуру он заканчивал уже в Гарвардском университете, и об этом периоде он замечает:

Накануне Второй мировой войны вся научная жизнь здесь и за рубежом была проникнута антисемитизмом.

О своих преподавателях в Гарварде Самуэльсон говорит следующее:

Гитлер (и Ленин) немало сделали для американской науки. Леонтьев, Шумпетер и Хаберлер вернули Гарвард к жизни после периода застоя.

Он продолжает, что по завершении учебы,

...когда МІТ сделал мне хорошее предложение, мы подумали: это поможет проверить, так ли уж в Гарварде хотят, чтобы я остался. Когда выяснилось, что большинство на этом вовсе не настаивают, мы переехали на три мили вниз по реке Чарльз.

Характеризуя свое влияние на Белый дом в период президентства Кеннеди, Самуэльсон замечает:

Завербовать себя в группу его советников я позволил сенатору Джону Ф. Кеннеди крайне неохотно... И я вступал в бой только тогда, когда им требовалась поддержка «тяжелой артиллерии из Кембриджа».

По поводу глобализации Самуэльсон говорит:

Доказано, что торговля позволяет избежать массовой эмиграции из бедных стран в богатые. Американцы утратили традиционную монополию на передовые технологии и капитал... Свободной торговле не нужно помогать *всем* и *езде*... Сегодня любая, даже незначительная победа профсоюза приближает день, когда промышленность переберется за рубеж... Подавляемая рабочая сила вряд ли будет функционировать в новых условиях безжалостного корпоративного управления.

Учитывая вышесказанное, вы, наверное, уже не удивитесь, когда прочтете:

В качестве ведущего рубрики я опубликовал – с месячным интервалом – наверное, несколько тысяч газетных и журнальных статей.

## 8. Интервью Пола Волкера Перри Мерлингу

В 1975–1979 гг. Пол Волкер был президентом Федерального резервного банка Нью-Йорка, а в 1979–1987 гг., при Картере и Рейгане, – председателем Совета управляющих Федеральной резервной системы.

Об отношении Артура Бёрнса к приостановлению конвертируемости доллара в золото Волкер говорит:

Бёрнс ничего такого делать не хотел. Он не соглашался до самого конца. Не думаю, что у него были какие-либо осуществимые идеи по реформированию системы, если не считать того, что он, похоже, думал о возможности договориться об изменении цены на золото, не приостанавливая конвертируемость.

О собственных переживаниях в период этой вынужденной реформы он говорит:

Эту печальную историю я запомнил надолго... В переговорах о реформировании системы я представлял американскую сторону. Не знаю, насколько мы действительно были близки к соглашению. Было очень трудно. Однако к моменту заключения соглашения резкий рост цен на нефть был использован в качестве предлога для прекращения переговоров.

Я сам работал в Совете управляющих Федеральной ре-

зервной системы почти все годы «монетаристского эксперимента» – с 1979 по 1982 г., и для меня было совершенно ясно, что Волкер вполне искренне стремился обуздать с помощью монетаристской политики ту измерявшуюся двузначными цифрами инфляцию, которая наблюдалась в конце 70-х. Но когда эта политика привела к рецессии, среди монетаристов того времени стало модно говорить, что на самом деле Совет не проводил монетаристскую политику, а только говорил о ней и использовал как прикрытие для продолжения прежней политики. Я никогда не соглашался с подобной интерпретацией, и Волкер в этом интервью объясняет, что же действительно произошло:

Мне больно слышать, как некоторые члены Совета, встретившие с таким энтузиазмом смену курса, говорят: «А разве это не просто пиаровский трюк с целью избежать обвинений в связи с повышением процентных ставок?» Я никогда не считал это трюком, но многие думали, что, в общем, так оно и было. Тогда часто говорили, что мы просто хотели создать дымовую завесу.

Касаясь цели введения в этот трехлетний период контроля за темпом роста денежной массы, Волкер далее поясняет:

В тех условиях волатильной инфляции у нас не было другого хорошего ориентира, позволяющего определить, на сколько мы можем повысить процентные ставки.

По поводу введения денежно-кредитного контроля Волкер замечает:

В начале 70-х был принят закон, который привел в замешательство президента Никсона, – дающий президенту право требовать введения денежно-кредитного контроля. Предусматривалась двухэтапная процедура. Президент мог потребовать введения контроля, но осуществлять контроль должна была Федеральная резервная система. И вот Картер решил, что и ему необходим такой контроль. Мне эта идея не понравилась... Но президент хотел что-нибудь сделать... И я сказал в Совете: «Давайте, чтобы выполнить эту просьбу или требование, введем какой-то кредитный контроль, но пусть он будет минимальным»... В принципе Совету вообще не следовало ничего делать... Система потребления просто рухнула... Мы отменили этот контроль, как только смогли.

Высказывая мнение о том, что лучше: сделать валютные курсы плавающими или ввести со временем единую международную валюту, Волкер замечает:

Для многих стран, особенно небольших и открытых, плавающая валюта создаст такие проблемы, которые перевесят преимущества, связанные с проведением независимой денежно-кредитной политики... Нам нужно придумать такой действительно международный стандарт, который сможет играть роль, выполняемую

ранее золотом.

О дерегулировании Волкер говорит следующее:

Возможные последствия дерегулирования финансовой сферы волновали меня всегда... Когда в 1960-е я работал в министерстве финансов, Райт Патман, популист из Техаса и председатель Комитета по банковскому делу и валюте Палаты представителей, в одной из своих речей пожаловался на то, что у нас слишком мало банковских крахов, и слишком редко принимаются рискованные решения. Что ж, этот недостаток мы исправили!

Следующее высказывание Волкера раскрывает его отношение к современному управлению рисками:

Вся концепция покоится на идее кривых нормального распределения, но когда наступает финансовый кризис, никакого нормального распределения быть не может.

О Центральном банке России, он говорит:

Его репутации большой ущерб нанесли обвинения, возможно, и необоснованные, в коррупции в ее самых вопиющих формах.

Интересно, что это интервью было получено после довольно любопытной переписки. В августе 1999 г. я послал Полу Волкеру письмо с просьбой дать интервью для публикации в *Macroeconomic Dynamics*. В письме от 5 января 2000 г. он ответил мне согласием, но сделал следующую при-

писку:

Извините, что долго не отвечал. Возможно, мне помешала моя аллергия на «денежные агрегаты Divisia»<sup>[4]</sup>.

Понять причину его колебаний нетрудно. В конце 70-х, когда я работал в Совете управляющих Федеральной резервной системы (в секции специальных исследований), я предложил использовать денежные агрегаты Divisia. Во время «монетаристского эксперимента» 1979–1982 гг. мои показатели росли вдвое медленнее официальных простых денежных агрегатов. Я неоднократно говорил, что официальные денежные агрегаты неточно отражают ограничительный характер проводимой политики, и что эта политика приведет к рецессии. Возможно, рецессия, которая наступила, как я предупреждал, и была причиной аллергии Волкера. Впоследствии я опубликовал эти данные и материалы в своей статье в журнале Американской статистической ассоциации *American Statistician*. Когда я отправил свою статью в этот журнал, его редактор Гэри Кох отдал ее на рецензию сразу шести рецензентам. Он сообщил мне по телефону о своих опасениях, связанных с тем, что после публикации моих результатов редакция будет завалена письмами недовольных читателей. Я заверил его, что те, кто посылают такие письма, вряд ли читают его журнал. Эта статья опубликована в моей книге (1984 г.). Но было и кое-что еще. После того, как экономика оправилась от рецессии (а я оставил Совет,

чтобы преподавать в Техасском университете), произошел резкий скачок в простых денежных агрегатах, а в моих показателях Divisia – нет. 26 сентября 1983 г. главный «монетарист» Милтон Фридман в своей статье на целую полосу в журнале *Newsweek* написал:

Взрывной рост денежной массы в июле 1982 – июле 1983 г. не оставляет нам никакой возможности найти приемлемое решение... В результате обязательно произойдет новый виток стагфляции – рецессия в сочетании с ростом инфляции и высокими процентными ставками... Неопределенность заключается лишь в том, когда эта рецессия начнется.

Но в тот же самый день, 26 сентября 1983 г., я сказал в своей статье на целую полосу в журнале *Forbes*:

Люди напрасно паникуют по поводу роста количества денег в обращении в этом году... Темп роста агрегатов Divisia не сильно отличается от прошлогоднего... «Явный взрывной рост» можно считать статистическим всплеском.

Стагфляция так и не началась, как и было предсказано в опубликованном мною анализе. А монетаристы и по сей день не оправились от этого дважды произошедшего публичного посрамления. Рассказ об этих событиях и посвященные им материалы можно найти в моей книге (1997)<sup>[5]</sup>.

## 9. Интервью Мартина Фельдштейна Джеймсу Потерба

Мартин Фельдштейн два года был председателем Совета экономических консультантов при Рональде Рейгане, оставив ради этого преподавание в Гарвардском университете. В предисловии к этому интервью Джеймс Потерба отмечает:

Он часто предупреждал о той цене, которую придется в конечном счете заплатить за большой бюджетный дефицит, хотя у политиков эта точка зрения была крайне непопулярной.

Далее Потерба говорит:

В своей лекции в 1995 г. для Американской экономической ассоциации он обратился к ученым-экономистам с настойчивым призывом проанализировать предложения по реформе системы социального обеспечения и тем самым положил начало весьма активному осуждению политики, развернувшейся во второй половине этого десятилетия.

В Гарварде у Фельдштейна было более 60 аспирантов, а с 1977 г. он является президентом Национального бюро экономических исследований. В 1992 г. его избрали президентом Американской экономической ассоциации.

Отвечая на вопрос о своих исследованиях в области аме-

риканского здравоохранения, он замечает:

[В отрасли] наблюдалась такая динамика: чем выше цена, тем сильнее стремление к страхованию, а чем больше объемы страхования, тем выше цена рыночного равновесия... Мои оценки говорили о том, что существующая система недалеко от взрыва, и потребуется какая-то внешняя сила, чтобы остановить рост относительных расходов на медицинское обслуживание... Увеличение доли этих расходов, оплачиваемой самим пациентом, улучшило бы функционирование рынка здравоохранения.

Вспоминая о том, как в 1982–1984 гг., в период президентства Рональда Рейгана, он был председателем Совета экономических консультантов, Фельдштейн говорит:

Очень скоро стало ясно, что бюджетный дефицит будет для нас колоссальной проблемой.

Из этого интервью вы также узнаете о том, что Мартин Фельдштейн раз в неделю завтракает с Полом Волкером.

## 10. Интервью Кристофера Симса Ларсу Петеру Хансену

Крис Симс – член Национальной академии наук, одно время он также был президентом Эконометрического общества. Симс внес весомый вклад в современную эконометрику своими работами по методологии анализа многомерных временных рядов.

На мой взгляд, работа Симса 1971 г. – одна из самых блестящих публикаций по эконометрике и статистике. Сам Симс рассказывает о ней следующее:

Поскольку работа по бесконечномерным пространствам по своей тематике отличалась от того, что обычно появлялось в экономических журналах, я послал ее в журнал *Annals of Mathematical Statistics*... Его редактор написал мне: «Извините, что прошло столько времени. Мне никак не удавалось найти хоть какого-нибудь рецензента. Прилагаю заключение рецензента». Рецензент писал: «О чем эта работа, я на самом деле так и не понял, но проверил некоторые теоремы и, похоже, они верны, так что, думаю, нам следует ее опубликовать».

Говоря о прикладной эконометрике, он, в частности, отмечает:

...технические условия, в которых отклики

на предполагаемые нарушения денежно-кредитной политики, явно абсурдны, чаще всего не заявляются. У некоторых это вызывает определенное беспокойство.

Также он говорит:

Специалисты по эконометрике не сумели справиться с проблемами субъективной оценки, являющимися ключевыми в моделировании макроэкономической политики.

Отвечая на вопрос о своем отношении к моделям макроэкономической политики, Симс заявляет:

Сегодня эти модели находятся в плачевном состоянии.

# 11. Интервью Роберта Шиллера Джону Кэмпбеллу

Своей широкой известностью Роберт Шиллер обязан своей знаменитой книге «Иррациональное изобилие», в которой ему поразительно точно удалось предсказать раздувание «мыльного пузыря» на фондовом рынке, который лопнул очень скоро после публикации этой книги. Книга вышла в свет в марте 2000 г., когда рынок был на подъеме. Как он поясняет в этом интервью, книга была написана «с головокружительной скоростью». В своем интервью Шиллер говорит:

Одно из величайших заблуждений в истории экономической мысли состоит в том, что любое изменение на фондовом рынке имеет разумное объяснение...

Далее он отмечает:

Модель ожидаемой приведенной стоимости для агрегированных курсов акций просто вопиюще неверна.

Из этого интервью вы узнаете о влиянии, которое оказали на его взгляды его супруга Джинни, психолог, и ее коллеги. Обсуждая в целом роль экономистов, Шиллер замечает:

Выбирая себе направление исследования, экономисты поддаются стадному чувству, и тот, кто не

прельстится общими темами, может многое выиграть.

## 12. Интервью Стэнли Фишера Оливье Бланшару

С мая 2005 г. Стэнли Фишер руководит Банком Израиля. Его интервьюировал профессор экономики МІТ Оливье Бланшар. Интервью проводилось во время их совместной пробежки по нью-йоркскому Центральному парку. Ранее Стэнли Фишер был главным экономистом Всемирного банка, первым заместителем главы Международного валютного фонда, президентом Citigroup International и профессором экономики МІТ. По словам Оливье Бланшара, еще преподавая в МІТ, Стэнли Фишер «...практически приобрел статус гуру», а теперь превратился во «властелина вселенной и VIP-персону мирового масштаба». Из этого интервью вы узнаете о юных годах Стэнли Фишера, проведенные им в Южной Родезии, которая теперь называется Зимбабве.

В частности, в интервью он говорит:

Когда я был студентом, этим великим человеком был Даг Хаммаршёльд<sup>2</sup>. Потом его убили – совсем рядом, в Конго, которое было тогда бельгийской колонией. Я знал, что он сделал для людей много хорошего, а мои родители воспитали меня так, что я тоже хотел приносить людям пользу. Я понял, что приносить людям пользу мне поможет экономика... Наверное, это

---

<sup>2</sup> Генеральный секретарь ООН, погибший в Африке в 1961 г. – *Прим. пер.*

и двигало мной все это время.

## 13. Интервью Жака Дреза Пьеру Деэ и Омару Ликандро

Жак Дрез – один из самых известных и глубокоуважаемых европейских экономистов, заслуживший признание по обе стороны Атлантики за вклад в развитие истории экономической мысли и других направлений экономической науки. Защитив в 1958 г. диссертацию в Колумбийском университете, Дрез основал знаменитый бельгийский центр экономических исследований – Центр исследования операций и эконометрики. Звания почетного доктора его удостоили 15 университетов по обе стороны Атлантики. Из интервью вы узнаете о лувенско-байесовской школе, совместном бельгийско-французском исследовании по общему рыночному равновесию в условиях негибких цен и рационирования, а также о других направлениях экономических исследований и политики, известных в США не так хорошо, как в Европе.

Особый интерес представляет его высказывание о политическом влиянии экономистов в США и в Европе:

Принято считать, что в Европе экономисты менее влиятельны, чем в Соединенных Штатах. Два замечания по этому поводу. Во-первых, в Европе нет ни одного экономического органа, сопоставимого с американским правительством. Почему? Потому что Европа – это союз, конфедерация государств, поэтому

полномочия на уровне всего союза ограничены; процесс принятия решения на этом уровне сложен и имеет ограничения. Экономические советники Комиссии не участвуют в работе принимающего решения органа, т. е. в Совете министров. В США, напротив, главный экономический советник присутствует на заседаниях правительства, на которых принимаются решения. Поэтому лишних звеньев при передаче информации здесь нет; экономический советник находится прямо на месте событий. Кроме того, в Соединенных Штатах правительство имеет гораздо больше прямых полномочий, чем Совет министров в Европе. В связи с этим в Европе экономические советники влияют на принимаемые политические решения намного меньше, чем в Соединенных Штатах.

## 14. Интервью Томаса Сарджента Джорджу Эвансу и Сеппо Хонкапохья

Как книга Самуэльсона «Основы экономического анализа» математизировала неоклассическую микроэкономику и научила целое поколение экономистов точному микроэкономическому анализу, так книги Сарджента математизировали современную макроэкономику и обучили целое поколение экономистов точному макроэкономическому анализу. Сказанное Сарджентом в этом интервью отличает та же проницательность которая характерна для всех его опубликованных работ.

Например, по поводу развития метода калибровки в эмпирических экономических исследованиях и его связи с теорией статистики Сарджент замечает следующее:

Метод калибровки может дать менее удачные результаты, поскольку вы прибегаете к нему, только если не доверяете полностью своей модели, или думаете, что ваша модель выбрана отчасти или совершенно неправильно, или же доверяете модели и набору данных кого-то другого больше, чем собственным. Помню, поначалу Боб Лукас и Эд Прескотт были очень увлечены эконометрикой, в основе которой лежала теория рациональных ожиданий. Ведь она просто предполагала предъявление

к нам самим тех высоких требований, за несоблюдение которых мы критиковали кейнсианцев. Но после того как Боб Лукас и Эд Прескотт лет пять оценивали модели рациональных ожиданий по критерию отношения правдоподобий, они оба сказали мне, что этому критерию не удовлетворяют слишком много хороших моделей. Идея калибровки состоит в том, чтобы игнорировать одни результаты вашей модели и сохранить другие. Калибровка задумывалась как сбалансированный ответ на утверждение, что ваша, пусть и неверная, модель все равно является ценным инструментом количественного анализа политики.

Далее он говорит:

В 80-е гг. в некоторых случаях имело смысл сказать: «Максимизировать функцию правдоподобия слишком сложно, а, кроме того, если мы это сделаем, то выплеснем нашу модель вместе с водой». В этом веке возможности сказать эту фразу стало меньше.

О Нейле Уоллесе Сарджент замечает:

Нейл думает, что модели предпочтения ликвидности бесполезны, и не воспринимает ограничений, связанных с этими моделями. Что для Нейла может быть хуже, чем модель предпочтения ликвидности с таким ограничением? Только модель с *двумя* подобными ограничениями.

Далее Сарджент сообщает:

Нейл попросил меня убрать его фамилию со всех

работ, написанных нами совместно, за исключением той, которая посвящена товарным деньгам, – на мой взгляд, не самой лучшей.

Конечно, фамилия Уоллеса так и осталась на всех этих работах. О соавторстве с ним Сарджент рассказывает следующее:

Прочитав введение к одной из наших статей в *JPE* (*Journal of Political Economy*), Боб Лукас сказал мне, что, наверное, ни один рецензент не смог бы сказать о нашей работе ничего более уничижительного, чем то, что написали мы сами. И эти критические слова были написаны Нейлом.

## 15. Интервью Роберта Ауманна Серджиу Харту

Роберт Ауманн получил Нобелевскую премию по экономике в 2005 г., будучи профессором Иерусалимского университета, за месяц до того, как его интервью появилось в *Macroeconomic Dynamics*. Многие считают его одним из самых блестящих математиков мира, идущим в авангарде развития экономической теории игр. Ауманн родился в Германии, получил образование в США, но постоянно проживает в Израиле и исповедует ортодоксальный иудаизм. Свою первую диссертацию (по алгебраической топологии) он защитил в МІТ, а вторую – в Принстоне. В своем интервью он рассказывает:

Вообще-то интерес к математике появился у меня еще в средней школе, в йешиве раввина Якоба Йозефа (еврейской дневной школе), находившейся в восточной части Нью-Йорка... Закончив школу, я долго выбирал, что изучать: Талмуд или светские предметы в университете. Какое-то время я делал и то, и другое. Это продолжалось один семестр, а потом мне стало трудно, и я принял нелегкое решение бросить йешиву и заняться математикой.

Говоря о своем обучении и исследованиях в аспирантуре МІТ, Ауманн замечает:

Теория узлов, как и теория чисел, была абсолютно, абсолютно бесполезной. Этим меня узлы и привлекли... Пятьдесят лет спустя «абсолютно бесполезную», «чистейшую» теорию преподают на втором курсе медицинских вузов.

О конференции 1961 г. он вспоминает следующее:

Киссинджер говорил о применении теории игр в дипломатии холодной войны... Тогда люди действительно думали, что наступает конец света.

Говоря о Карибском кризисе, Ауманн замечает:

Кеннеди был под влиянием теории игр... Ее идеи пропагандировали Киссинджер и Герман Кан<sup>3</sup>. Теперь ему ставят в заслугу то, как он вел себя во время [Карибского] кризиса; вот уж поистине – чтобы узнать вкус пирога, нужно его съесть.

Говоря о «рациональности», Ауманн замечает:

Большая ошибка говорить, что война иррациональна... Объявляя все зло в мире иррациональным, мы отказываемся принимать против него какие-либо меры. Зло необязательно иррационально – оно может быть и опасным, и рациональным. Говорить, что война иррациональна, – весьма ошибочно... Игнорируя ее как нечто иррациональное, мы не решим эту проблему.

---

<sup>3</sup> Американский футуролог, директор и основатель Гудзоновского института. – *Прим. пер.*

Отвечая на вопрос о своем отношении к религии, Ауманн заявляет:

Религия очень отличается от науки. Главное в религии – не то, как мы моделируем реальный мир... Религия – это опыт, главным образом, эмоциональный и эстетический... Когда вы играете на пианино, занимаетесь скалолазанием, противоречит ли это вашей научной деятельности? Не противоречит; это просто лежит в другой плоскости... В науке мы думаем о мире определенным образом, в религии – по-другому. Эти две вещи сосуществуют, никак не конфликтуя.

Вспоминая, как в 1930-е гг. его семья покинула Германию, Ауманн, в частности, говорит:

Мы уехали в 1938 г. Вообще-то мы хотели сделать это еще в 1933 г., когда к власти пришел Гитлер, но по какой-то причине не сделали. Моих родителей убедили, что все не так плохо, все будет в порядке, все утрясется. Немцы не позволят командовать такому сумасшедшему и т. д. и т. п. Знакомая история. Но она показывает, что когда находишься в самой гуще событий, предвидеть будущее очень нелегко. Это сейчас все очевидно, а тогда, в разгар кризиса, все было непонятно.

Подобным образом Ауманн комментирует события Шестидневной войны 1967 г.:

Это теперь нам ясно, что в этом конфликте Израиль должен был победить. Но в то время было совсем не очевидно, что Израиль выстоит... Премьер-министр

Эшколь был очень встревожен. Выступая по радио, он запинался, его волнение было таким явным, таким ощутимым... Во время этого кризиса здесь был Герб Скарф<sup>4</sup>. Когда недели за две до начала войны он уезжал, и мы прощались, мы оба думали, что, возможно, уже больше не увидимся.

По другому поводу он замечает:

Бихевиористская экономика, а именно как она осуществляется на практике, вызывает у меня серьезные сомнения. Сегодня *подлинная* бихевиористская экономика – это эмпирическая экономика. Эмпирическая экономика – это и есть бихевиористская экономика. Когда вы занимаетесь эмпирической экономикой, вы наблюдаете, как ведут себя люди в реальной жизни.

---

<sup>4</sup> Скарф, Герберт, профессор экономики Йельского университета. – *Прим. пер.*

## 16. Интервью Джеймса Тобина и Роберта Шиллера Дэвиду Коландеру

Джеймс Тобин получил Нобелевскую премию по экономике в 1981 г. – в то время он был профессором Йельского университета. Это совместное интервью Джеймса Тобина и Роберта Шиллера в Йеле отличалось от других, опубликованных в *Macroeconomic Dynamics*, и было в журнале названо не интервью, а диалогом. Обычно интервьюировали одного человека, и речь шла о работе и жизни именно этого экономиста. Данное интервью имело форму беседы двух людей и ведущего – на конкретную тему, а именно: «Йельская школа экономики». Первую скрипку в диалоге явно играл Тобин, но интересно сравнить шиллеровский фрагмент этого интервью с интервью Томаса Сарджента. Интервью Шиллера и Сарджента во многом отличаются, но оба дают глубокое, запоминающееся и явно различное представление о современной макроэкономике.

Похоже, что участники диалога больше симпатизируют фридмановскому направлению консервативной чикагской школы, чем более поздней концепции реальных экономических циклов. Отвечая на вопрос ведущего: «Что вы думаете о теоретиках реального экономического цикла?», Тобин говорит:

Ну, это просто враги... Это те, с кем мы боремся все эти годы. Это практически повторение конфликта между самим Кейнсом и экономистами, которых он считал классиками.

Он продолжает:

«Представители неоклассической школы и сторонники теории реального экономического цикла придерживаются гораздо более крайних взглядов, чем люди, с которыми в свое время не соглашался Кейнс, но это все тот же спор. Как ни странно, идеи Пигу были гораздо более разумными и заслуживающими доверие, чем идеи Лукаса и некоторых других неоклассиков.

Шиллер в этом диалоге говорит:

Йельская школа должна считаться политически намного более либеральной, чем консервативная чикагская... Каким нам видится Тобин? Мне он представляется человеком высокой морали, относящимся к другим с подлинным сочувствием. Это означает, что он видит, как страдают люди, и хочет это исправить. И такое впечатление он производит в большей мере, чем многие экономисты.

Джеймс Тобин умер в 2002 г.

# Литература

Barnett, W.A. (1984) Recent monetary policy and the Divisia monetary aggregates. *American Statistician* 38, 165–172. Reprinted in W.A. Barnett & A. Serletis (eds.) (2000) *The Theory of Monetary Aggregation*, Ch. 23, pp. 563–576. Amsterdam: Elsevier.

Barnett, W.A. (1997) Which road leads to stable money demand? *The Economic Journal* 107, 1,171–1,185. Reprinted in W.A. Barnett & A. Serletis (eds.) (2000) *The Theory of Monetary Aggregation*, Ch. 24, pp. 577–592. Amsterdam: Elsevier.

Keynes, J.M. (1936) *The General Theory of Employment, Interest, and Money*. New York: Harcourt, Brace & World.

Lucas, R.E. (2000) Inflation and welfare. *Econometrica* 68(2), 247–274.

Sims, C. (1971) Distributed lag estimation when the parameter space is explicitly infinite-dimensional. *Annals of Mathematical Statistics* 42, 1622–1636.

# **Введение к истории мысли**

## **Экономисты беседуют**

### **с экономистами – с**

#### **точки зрения историка**

#### *Рой Вайнтрауб*

Результатом затеянного редактором *Macroeconomic Dynamics* Уильямом Барнеттом масштабного и долгосрочного проекта стал ряд интервью, которые одни выдающиеся экономисты дали другим, хорошо информированным о научной деятельности интервьюируемых. Таким образом эта книга – сборник бесед и об экономике, и о жизни экономистов, о том, как вообще сегодня живет и работает сообщество ученых, занимающихся общественными науками.

У этой книги есть одна особенность. Хотя она и предоставляет читателю редкую возможность присутствовать при беседах выдающихся людей и больше узнать об этих знаменитостях, сама по себе это еще не история экономической науки, хотя так и кажется, что собеседники говорят для истории. И все же есть различие между тем, что считают важным для истории историки экономической науки, а что – ученые-экономисты. Интервьюируемые пытаются дать свою, небеспристрастную версию исторических событий, та-

кую, в которой они сами играли бы видную роль<sup>[6]</sup>, и то, что их интервьюирует бывший ученик или нынешний коллега, старший или младший, только усугубляет проблему. Я говорю «проблему», так как «ученых-экономистов и историков обычно интересуют разные вещи в прошлом, и они хотят использовать свою историю в разных целях и соответственно выбирают себе источники и пишут соответствующие статьи и доклады» (Хьюз, 1997, с. 26). Это хорошо понимают историки науки и, в меньшей степени, сами ученые. Большинство экономистов понимают это не так хорошо:

Есть две основные причины для беспокойства. Во-первых, существует проблема спорной интерпретации и сложности проведения исторического анализа, когда имеешь дело с тем, что вполне может оказаться старой актерской байкой (к тому же рассказываемой в беседе между двумя, возможно, враждующими актерами)... [Во-вторых], встречаются ученые, желающие сохранить на свою историю особые права, и потому не терпят никаких отклонений от «официальной» (героической, событийной или популярной) версии (там же, с. 27).

Обе эти проблемы всплывают в беседах. Первую иллюстрирует тот фрагмент интервью Милтона Фридмана, где речь идет о его работе во время Второй мировой войны в Группе статистических исследований. Здесь Фридман высказывает мнение, что идеи экономистов в области оптимизации повлияли на формирование взглядов военных, в то

время как многие пишущие об этом периоде историки считают, что причину и следствие здесь нужно поменять местами. А в качестве забавного (по крайней мере, для меня) примера второй проблемы я бы отметил то место в интервью Пола Самуэльсона, где он риторически вопрошает, не будет ли его понимание собственных работ на какую-нибудь тему по биологии по-новому интерпретировано «будущими Филипами Мировски и Роями Вайнтраубами».

Однако беспристрастное обсуждение может приводить к эмоционально непростым ситуациям:

Кроме того, для некоторых ученых история – столь ценный источник, что если история не оправдывает или не узаконивает науку так или иначе, то она ее практически делегализирует (а иногда и «подрывает»), а это может породить глубокую враждебность к профессиональным историкам науки и их писаниям (там же, с. 28).

Некоторые из этих проблем дают о себе знать в интервью Роберта Ауманна, где говорится, что многое в теории игр было разработано математиками и экономистами для использования в условиях «холодной войны». Это, а также, в случае Ауманна, и явная связь между потребностями министерства обороны Израиля и наличием в этой стране множества специалистов по теории игр, опровергают аксиому о политической беспристрастности ученого-экономиста. Однако эти вопросы могут подниматься (особенно бывшим учени-

ком Ауманна Хартом) только с оговоркой, что их постановка, похоже, имеет своей целью «делегализировать» определенную серьезную работу в области теории игр.

Как документы, на основе которых пишется история, записи собранных в этом томе бесед имеют нечто общее с более традиционными устными источниками. Но у них действительно есть некоторые недостатки:

Одно то, что историк объясняет ученому – его мнения и воспоминания будут сохранены и могут использоваться историками в будущем, – может заставить ученого войти в какой-то образ, даже надеть, если хотите, какую-то маску, отражающую, по его мнению, то, что должно остаться в памяти о нем самом, о его жизни и достижениях (Деворкин 1990, с. 47).

Иными словами, говоря о приводимых далее записях бесед, если эти материалы были изданы с одобрения интервьюируемых (а в некоторых случаях даже переписаны ими), это означает, что экономисты, по существу, сами отвечают за содержание своих интервью, и в эту книгу не вошел ни один материал, который противоречил бы их собственному пониманию своей работы.

Но и при этом следует учесть:

Какими бы ни были намерения этих ученых, память может их подвести, а неверно сформулированные историками вопросы провоцируют некорректные ответы, и, следовательно, искаженное видение истории.

На самом деле есть веские основания полагать, что сам вопрос предопределяет ответ. Нередко бывает, что историк, уже досконально знающий свой предмет, имеет более широкий и совершенно иной взгляд на жизнь и личность интервьюируемого ученого, особенно если этот ученый работал не в одиночку, а в большой организации, как работают сегодня большинство ученых.

В основе своей эти беседы – конечно, не совсем устные рассказы, по той очевидной причине, что, за исключением двух интервью, это не беседы, проведенными историками в едином формате устного повествования. Когда выдающегося экономиста интервьюирует другой хорошо известный экономист, достаточно знакомый с предметом исследований интервьюируемого, эта беседа не может быть беспристрастной. Например, одно из отличий интервью, которое берет историк, от интервью, которое берет коллега, заключается в том, что историк скорее всего не очень знаком с теми конкретными идеями, областью исследования и методами анализа, которые интервьюируемый ученый считает своим вкладом в науку, – исходя из этого он строит свои ответы. Беседуя с коллегой, интервьюируемый, скорее, перейдет к обсуждению специальных проблем и вряд ли станет оправдывать (не говоря уже о том, чтобы объяснять) свое желание работать именно с данным материалом<sup>[7]</sup>. Поэтому, если эти интервью будет читать неспециалист, ему будет сложнее следить за всеми поворотами в обсуждениях. Беседа может показаться

перегруженной профессиональными терминами, тогда как историк скорее всего направит разговор в нужное русло, понятное читателю. Но вопросы, которые обычно задает историк, редко похожи на вопросы, обсудить которые хочется экономисту.

Именно по этой причине пространные отчеты о развитии современной физики были подготовлены не физиками, а Центром истории физики Американского института физики (AIP) в Нью-Йорке. Расшифрованные стенографические записи интервью, взятых в рамках этой долгосрочной программы, хранятся в библиотеке Нильса Бора AIP. Этот проект реализуется профессиональными историками, каждый из которых получил специальную подготовку как специалист по устной истории. И благодаря связи биографии интервьюируемых с их работой эти историки прекрасно информированы о характере и направлении исследований интервьюируемых.

Для экономики подобного центра не существует<sup>[8]</sup>. Задачи историков экономической науки выполняют «одиночки», и не существует такого источника, за счет которого мог бы финансироваться подобный крупный проект. Взамен историки, которые все же проводят подобные интервью, готовятся к ним, как могут, изучая записи того, что является хорошими устными рассказами, и, быть может, справляясь по одному или нескольким учебникам, объясняющим, как именно можно превратить устный рассказ в историю науки – см.,

например, работы Деворкина (1990) и Эверетта (1992).

Вошедшие в этот том беседы не проводились в такой единой манере: редактор не потребовал от интервьюеров, чтобы они предварительно прослушали «курс изустной истории». Не потребовал он и приведения их записей в единый вид, чтобы они, как отчеты АР, отражали определенный набор вопросов, хотя и с возможностью отклонения от этих тем в зависимости от того, как будет развиваться разговор.

Эту напряженность в отношениях между учеными как историками и историками науки хорошо описал Стивен Браш (1995). По его словам, конфликты между ними могут иметь самые разные причины, начиная от убеждения некоторых историков, что ученые не в состоянии написать исторический труд из-за обязательного презентизма и «либеральничания», и кончая мнением некоторых ученых, что компетентно определить, что именно важно для истории, способен только тот, кто сам участвовал в создании науки. Эту позицию четко сформулировал Андре Вейль (1978), выдающийся математик, заявивший в своем выступлении на Всемирном конгрессе математиков, что «историей математики лучше всего могут заниматься те из нас, кто сами являются или были активными математиками, или, по крайней мере, постоянно находятся в тесном контакте с активными математиками» (р. 440).

Однако инстинкты и социализация экономистов и историков экономической науки заставляют их задавать о прошлом

неодинаковые вопросы. Большинство экономистов рассматривает развитие экономической науки как решение серии проблем, которые возникают либо в мире, называемом экономикой, либо при разработке инструментов и методов, а также совершенствовании теоретических схем. То есть для большинства экономистов заниматься экономической наукой означает решать проблемы, а история этой науки – это последовательность проблем, возникших, решенных, сформулированных заново и снова решенных. Для них экономист – это тот, кто обучен и призван обществом распознавать эти экономические проблемы, а также действовать в мире, в котором формулировка и решение подобных проблем составляет суть профессии экономиста. Именно поэтому в приводимых ниже интервью мы слышим, как интервьюер спрашивает, как возникла та или иная проблема, и, кроме того, ведет речь о подходе и инструментах, которые потребовались для ее решения и которые составляют вклад интервьюируемого в науку. По существу интервьюер и интервьюируемый ведут себя как экономисты, сотрудничающие с целью улучшения понимания обществом того, как возникли эти проблемы, как разрабатывались инструменты и приобретались знания, необходимые для их решения. Обсуждение таких тем, как образование интервьюируемого, его профессиональное окружение и т. п., имеет своей целью выяснить, каким образом его формирование, включая интеллектуальную и эмоциональную подготовку, позволили ему от-

ветить на те конкретные вопросы, которые поставила перед обществом экономика и экономическая наука. Это полностью согласуется с таким написанием истории экономической мысли, которое историки обозначают словом OTSOG-ery, производным от аббревиатуры OTSOG (On the Shoulders of Giants, «на плечах гигантов», цитата из приписываемого Исааку Ньютону изречения, что он мог видеть дальше или двигать науку вперед потому, что стоял на плечах гигантов и т. д.). Эта точка зрения разделяется многими учеными и отражается в процедуре и результатах присуждения Нобелевской премии по экономике, когда Комитет по присуждению премий перечисляет конкретные заслуги награжденных. Поэтому в центре обсуждения именно научный вклад, а ученые по существу информируют о своем вкладе всех остальных членов сообщества экономистов.

Однако историка, очевидно, интересует другое<sup>[9]</sup>. Для историка главное – это контекст, поэтому, создавая серьезную историю, они относятся к подобным беседам как к исходному материалу для ограниченного применения. Историческое повествование не есть последовательность – сначала одного, потом другого, третьего и т. д. Скорее это сплетение множества историй в полотно, вовлекающее частное, а также условное, в контекстуализацию всех этих последовательных объектов. Историка интересует более масштабный, более многослойный рассказ<sup>[10]</sup>, чем простое «я пришел, увидел проблему, которую требовалось решить, и придумал, как это сде-

лать».

Позвольте мне теперь перейти к более конкретному анализу этих бесед, чтобы понять, как характер и опыт этих индивидуумов соотносятся с некоторыми более масштабными хрониками, создаваемыми историками экономической науки на протяжении последних десятилетий.

Во-первых, следует признать, что Самуэльсон, Фридман, Леонтьев и Модильяни принадлежат не к тому поколению, представителями которого являются большинство интервьюируемых. По своему менталитету это люди конца 1930-х – 1940-х гг. Это период, когда дали о себе знать два важнейших фактора, оказавших влияние на развитие экономики в XX веке – Великая депрессия и Вторая мировая война (к этой группе экономистов может быть причислен и Джеймс Тобин, который младше их всего на несколько лет).

Сегодня историки начинают понимать, что рассказ о развитии неоклассической экономической теории как о поступательном движении от маржиналистской революции конца XIX века к современности – это выдумка, особенно если говорить о развитии американской экономической науки. Ряд недавних исследований вполне убедительно продемонстрировал историкам: то, что в послевоенный период возникло как неоклассическая экономическая теория, было всего лишь одним из возможных способов заниматься экономической наукой (см. Morgan and Rutherford, 1998; Weintraub, 2002, Mirowski, 2002, Yonay, 1998). И дело было не только

в том, что институционализм – американское направление в экономической науке – был постепенно вытеснен неоклассической теорией, а в том, что еще в 1930-е гг. было несколько вариантов неоклассической теории, состязавшихся между собой за внимание экономистов. Кроме того, теоретический вклад Кейнса в его книге 1936 г. исчерпал себя одновременно с распространением мнения, что рекомендации в отношении экономической политики, вытекавшие из общей теории Кейнса, уже обсуждались намного раньше в ходе дискуссий о государственном регулировании (Hutchison, 1968; Davis, 1971; Howson and Winch, 1997).

Но история развития экономической науки – это также небольшая часть более крупной истории, такой, в которой экономика в XX веке стала научной дисциплиной в совершенно особом смысле слова. По мнению большинства людей, отличительная особенность экономики как науки – систематизированное представление основного содержания этой дисциплины в математическом виде. То есть люди ассоциируют науку с такими различными теориями и законами, которые можно выразить математически, и которые подтверждаются либо противоречат цифровым данным, генерированным самостоятельно, хотя концептуально и связанным с данными теориями. Конечно, многое в экономической науке действительно имеет это сходство с работой, выполняемой в других областях науки. Но свойства науки, по крайней мере, развитой науки, определяются не только тем, как выгля-

дят ее «тексты». В наши дни никто не проводит экспериментов по физике частиц в лаборатории, устроенной в собственном подвале. Никто не пытается проводить эксперименты с управляемым ядерным синтезом в гараже. Современная наука – это огромные масштабы, масштабы финансирования и используемых людских ресурсов. Давно ушли в прошлое времена, когда, гуляя в 1930-е гг. по университетскому кампусу, можно было обнаружить, что химический факультет находится в одном здании с экономическим факультетом и факультетом французского языка. Осмотрев современный университет, занимающийся, в частности, биологическими исследованиями и сотрудничающий с каким-нибудь медицинским научным центром, можно понять, как изменились эти масштабы. Мы думаем о Манхэттенском проекте и понимаем, с чего началась «большая наука», но нередко не учитываем того, как изменились после Второй мировой войны масштабы экономических исследований. В наши дни, когда в аспирантуры многих вузов ежегодно поступают десять, двадцать, а то и более человек, трудно оглянуться в прошлое и вспомнить, что до 1960-х гг. учеба в аспирантуре была делом совсем не таким обычным. Просто не было столько выпускников. Но в постспутниковую эру, когда стало больше и учащихся, и наставников для этих учащихся, специализация и разделение труда привели к тому, что исследования стали проводиться «группой специалистов по экономике труда» университета X или «группой специалистов по го-

сударственным финансам» университета Y. Теперь будущие аспиранты воспитываются в этих группах точно так же, как они воспитываются в лаборатории профессора X или профессора Y. Ушли в прошлое те времена, когда профессор экономики мог целое десятилетие руководить подготовкой диссертаций по многим специальностям. Такого больше нет, как нет в наши дни и того, чтобы физик-теоретик руководил подготовкой экспериментальной диссертации.

Большая наука возникла в ходе Второй мировой войны вместе с колоссальной работой по созданию атомной бомбы и непосредственным участием ученых в решении военных задач. Проектирование и производство самолетов, радаров, систем наведения, вычислительных систем – все это появилось в военный период благодаря сотрудничеству ученых, инженеров, специалистов по военному планированию и стратегии, а также ученых, занимающихся общественными науками, и особенно экономистов. Инструменты и симметрия в анализе, которые Самуэльсон исследовал в своей довоенной диссертации, полностью использовались во время войны, когда оптимизационный анализ стал главным в деятельности исследовательских групп экономистов, подключенных Советом по прикладной математике к работе Радиационной лаборатории Массачусетского технологического института, Группы статистических исследований в г. Колумбия и вскоре возникшего центра RAND в Санта-Монике. Дело не только в том, что благодаря этим связям эконо-

мическая наука стала более «научной», но и в том, что она стала больше напоминать то, что мы сегодня считаем наукой. Пиаровский призыв продолжить государственную поддержку науки на таком же высоком (как в военное время) уровне, был сделан Ванневаром Бушем в его книге «Наука. бесконечная граница» (1945)<sup>[11]</sup>, но, конечно, экономическая наука была на этой границе. В результате экономика как наука должна была «вкусить от щедрот» Национального научного фонда, а также получить поддержку через армию, военно-воздушные силы и управление исследованиями ВМС.

В собранных в книге беседах обнаруживается не столько акцент на отдельных технических деталях, новшествах и анализе, сколько связь проблем, которые изучали интервьюируемые, с вопросами более общего характера. В интервью Леонтьева мы находим даже несколько жалоб на излишнее внимание экономистов к методам экономического анализа. Тем не менее нельзя сказать, чтобы эти методы вообще не обсуждались. Слушая более молодых экономистов (Фишера, Касса, Лукаса), мы узнаем из научных бесед о проблемах, которые, как предполагается, будут решены. До некоторой степени это, конечно, сугубо американская точка зрения. Проблемы в работе, с которыми сталкивались Жак Дрез и Янош Корнай, совершенно отличаются от тех, которые знакомы экономистам в Соединенных Штатах. Тем не менее эта книга подтверждает, что направление, господствующее сегодня в экономической науке, – во многом американское изобр-

речение, и его интеллектуальную мощь поддерживает американская система высшего образования, а именно рост в послевоенный период количества университетов, занимающихся наукой. Хотя Волкер долгое время состоял на государственной службе, а Фишер в последние годы работал в частном секторе, экономическая теория – университетская дисциплина. Это не просто предмет, который преподается в университетах, потому что имеет большое значение для государственной политики. Конечно, по сравнению с прошлыми временами, положение изменилось. Эти беседы отражают судьбы тех, кто внес вклад в развитие экономической науки. Их исследования – это валюта, используемая в отдельных научных сообществах. Преподавание, научное руководство аспирантами и разработка новых методов экономического анализа, пригодных для решения возникающих экономических проблем – этими видами деятельности занимаются в основном в университетах, а не в научно-исследовательских институтах или государственных учреждениях.

Еще одной особенностью этих бесед, которая заинтересовала бы историков, является то, что, хотя экономические исследования проводятся в университетах, нередко сами исследователи привлекают к ним другие круги. Это все равно, как если бы ядерные физики, все еще активно занимаясь наукой, выносили свои проблемы на обсуждение широкой публики. Особое внимание здесь нужно обратить на работу, сделанную Мартином Фельдштейном в Националь-

ном бюро экономических исследований, а также Полом Волкером, занимавшим высокие должности в государственных структурах. Корнаи может тоже рассказать интересные истории о связи экономики с политикой, истории, которые все более узнаваемы, поскольку историки считают: история экономической мысли – это не просто повествование о том, как зародились и получили развитие и распространение великие идеи, но и о том, как эти идеи преодолели границы жестко организованных профессиональных сообществ и стали достоянием более широкого круга людей, интересующихся экономикой. Это рассказ о растущем значении экономистов в общественной жизни. Процесс возрастания такого значения складывался под влиянием двух факторов – президентства Рузвельта и создания в 1940-х гг. Экономического совета при президенте США (после принятия закона о занятости 1946 г.). Историки стали понимать, что история экономической мысли не просто история, рассказанная самими учеными-исследователями, а история изменения значения и влияния идей (см. Bernstein, 2001).

В этой передаче идей или экономических знаний конечными потребителями являются не только государство и военные. Существует также множество фондов, которые длительное время спонсировали экономическую науку и экономические исследования в собственных интересах. Хорошо известна история поддержки фондом Рокфеллера международных исследований в области экономического цикла в пе-

риод между двумя мировыми войнами, и многие современные работы по экономическим циклам, а также эконометрические модели восходят, конечно, к тем годам. Фонд Волкера (не имеющий отношения к Полу Волкеру) в 1940-х гг. финансировал реконструкцию экономического факультета Чикагского университета и помог автору «Капитализма и свободы» [Милтону Фридману] опубликовать эту книгу; кроме того, он выделил средства на приглашение Хайека в Чикаго. Всем этим я хочу сказать, что идеи экономистов дают всходы. Как замечательно выразился Кейнс, «на самом деле, вряд ли миром правит что-либо еще» (Keynes, 1936, p. 383). Поэтому собранные здесь интервью позволят глубже узнать о возникновении и развитии экономических идей, а значит помогут лучше понять наш мир.

## Литература

Barber, W.J. (1975) The Kennedy years: purposeful pedagogy. In C.D. Goodwin (ed.), *Exhortation and Control: The Search for a Wage-Price Policy 1945–1971*. Washington, D.C.: The Brookings Institution.

Bernstein, M. (2001) *A Perilous Progress: Economists and Public Purpose in Twentieth-Century America*. Princeton, NJ: Princeton University Press.

Brush, S.G. (1995) Scientists as historians. *Osiris* 10, 215–231.

Bush, V. (1945) *Science: The Endless Frontier*. Washington, D.C.: Government Printing Office.

Davis, J.R. (1971) *The New Economics and the Old Economists*. Ames, IA: University of Iowa Press.

DeVorkin, D.H. (1990) Interviewing physicists and astronomers: methods of oral history. In J. Roche (ed.), *Physicists Look Back: Studies in the History of Physics*, pp. 44–65. Bristol and New York: Adam Hilger.

Everette, S.E. (1992) *Oral History: Techniques and Procedures*, U.S. Army Center for Military History; available at [www.army.mil/cmh-pg/books/oral.htm](http://www.army.mil/cmh-pg/books/oral.htm)

Gaudilliere, J.-P. (1997) The living scientist syndrome: memory and history of molecular regulation. In T. Soderqvist (ed.), *The Historiography of Contemporary Science and Technology*. Amsterdam: Harwood Academic Publishers.

Houson, S. & Winch, D. (1977) *The Economic Advisory Council, 1930–1939: A Study in Economic Advice During Depression and Recovery*. Cambridge, U.K.: Cambridge University Press.

Hughes, J. (1997) Whigs, prigs, and politics: problems in the contemporary history of science. In T. Soderqvist (ed.), *The Historiography of Contemporary Science and Technology*. Amsterdam: Harwood Academic Publishers.

Hutchison, T.W. (1968) *Economics and Economic Policy in Britain, 1946–1966: Some Aspects of their Interrelation*. London: George Allen & Unwin.

Keynes, J.M. (1936) *The General Theory of Employment, Interest, and Money*. New York: Harcourt, Brace & World.

Klamer, A. (1984) *Conversations with Economists*. Totowa, NJ: Rowman & Allanheld.

Kragh, H. (1987) *An Introduction to the Historiography of Science*. New York: Cambridge University Press.

Mirowski P.E. (2002) *Machine Dreams*. Cambridge, MA: Harvard University Press.

Morgan, M.S. & Rutherford, M. (eds.) (1998) *From Interwar Pluralism to Postwar Neoclassicism*. Durham, NC: Duke University Press.

Weil, A. (1978) *History of Mathematics: Why and How*. International Congress of Mathematicians, Helsinki, Academia Scientiarum Fennica.

Weintraub, E.R. (1999) How should we write the history of twentieth century economics? *Oxford Review of Economic Policy* 15(4), 139–152.

Weintraub, E.R. (2002) *How Economics Became a Mathematical Science*. Durham, NC: Duke University Press.

Weintraub, E.R. (ed.) (2002a) *The Future of the History of Economics*. Durham, NC: Duke University Press.

Weintraub, E.R. (2005) Autobiographical memory and the historiography of economics. *Journal of the History of Economic Thought* 27(2), 1–11.

Yonay, Y.P. (1998) *The Struggle over the Soul of Economics: Institutional and Neoclassical Economics in America between*

*the Wars*. Princeton, NJ: Princeton University Press.

# 1. Интервью с Василием Леонтьевым

**Беседовал Данкан Фоули**

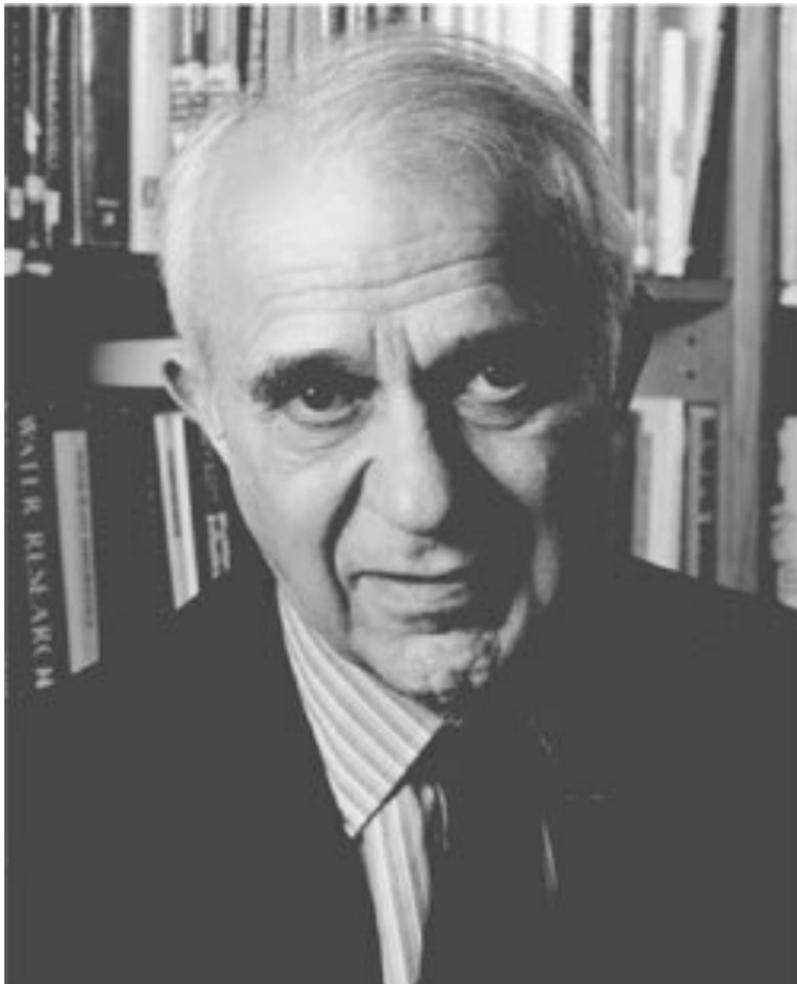
*Колледж Барнарда, Колумбийский университет*

14 апреля 1997 г.

Василий Леонтьев – один из тех, кто определил облик экономической науки XX века. Он разработал теорию анализа «затраты – выпуск» и методы построения на основе технико-экономических данных таблиц «затраты – выпуск», ставших самым мощным и широко используемым инструментом структурно-экономического анализа. В 1940-е и 1950-е гг. эта теория сыграла также важную роль в уточнении концепции общего экономического равновесия. Кроме того, Леонтьев внес фундаментальный вклад в развитие теорий спроса, международной торговли и экономического роста. В круг его научных интересов входили монетаристская теория, эконометрика, экономика охраны окружающей среды, проблемы народонаселения, распределения, разоружения, индуцированного технического прогресса, международного перелива капитала, роста, экономического планирования, а также советской и других социалистических экономик. Леонтьев активно участвовал в разработке национальной и международ-

ной политики в области технологий, торговли, демографии, экологии и контроля над вооружениями. Также он был влиятельным критиком современных экономических теорий, методов и подходов. Нобелевскую премию по экономике Леонтьев получил в 1973 г.

Наша беседа с Василием Леонтьевым состоялась 14 апреля 1997 г. в его нью-йоркской квартире в одном из небоскребов рядом с парком «Вашингтон-скуэр». Леонтьев сидел на диване в гостиной, а миссис Леонтьева занималась своими делами где-то в глубине квартиры и время от времени осведомлялась о его самочувствии. В записи голос Леонтьева звучит то уверенно и громко, то едва не превращается в шепот. Он то оживлен, то задумчив, то озадачен, то вновь воодушевляется – но при этом остается всегда обаятельным. Иногда его слова заглушают часы, отбивающие каждые четверть часа, и характерный шум нью-йоркской улицы. Я отредактировал текст интервью, чтобы сделать его более связным и легким для понимания.



**Рис. 1.1.** Василий Леонтьев

**Фоули:** Была большая дискуссия о связи метода «затраты – выпуск» со схемами воспроизводства из второго тома «Капитала» Маркса. Какую роль сыграл Маркс, и сыграл ли

вообще, в вашем становлении как экономиста? Вдохновили ли вас его схемы воспроизводства? Повлияли ли они на ваши взгляды?

**Леонтьев:** Дипломную работу я писал в России и именно там изучал марксизм, но не являюсь воинствующим экономистом-марксистом. Разрабатывая свой метод «затраты – выпуск», я пытался устранить недостатки классического и неоклассического анализа спроса и предложения. Я всегда считал его ужасно бессистемным. Полагаю, вы читали мое президентское послание?<sup>5</sup> Мне казалось, что теория общего равновесия не объясняет, как использовать фактические данные, и я специально разработал метод «затраты – выпуск», чтобы обеспечить фактическую основу, зарегистрировать факты систематическим образом и тем самым сделать механизм функционирования системы более понятным.

**Фоули:** Сыграла ли структура марксовых схем воспроизводства какую-либо роль в формировании вашей концепции?

**Леонтьев:** На самом деле нет. Маркс не был хорошим математиком. Он все время путался в цифрах и формулах, его трудовая теория стоимости не слишком содержательна, но, в сущности, я интерпретирую Маркса, и Маркс интересен мне только как классический экономист. А повлиял на меня, возможно, Кенэ, его идеи. Очень трудно сказать, что именно

---

<sup>5</sup> Послание Американской экономической ассоциации, президентом которой В. Леонтьев был избран в 1970 г.

на нас влияет. В университете я учился на экономиста. Уже тогда я регулярно читал всех экономистов начиная с XVII века. Я просто читал и читал и поэтому получил очень хорошую подготовку в области истории экономической мысли, и, как мне кажется, могу оценить состояние этой науки.

**Фоули:** В самые первые годы советской власти вы жили в Советском Союзе?

**Леонтьев:** Я уехал из Советского Союза в 1925 г. У меня возникли проблемы с властями, и я вынужден был уехать, чтобы продолжать работать.

**Фоули:** Думал ли кто-либо в то время о статистике как основе планирования в Советском Союзе?

**Леонтьев:** Нет. В сущности, первым, что имело к этому хоть какое-либо отношение, был анализ национального дохода. Как и любой подобный анализ, он был слишком обобщенным. Вам дается одна цифра, в то время как я считал, что для понимания того, как функционирует система, одной цифры недостаточно. Хочется выяснить, как это можно детализировать. Я не собирался улучшать систему – просто пытался разобраться, как она работает. Конечно, прежде чем исправлять, хорошо бы понять, но мне кажется, что понять, как работает экономическая система, – это вообще первая задача экономиста.

**Фоули:** Тогда, в 1925 г., вы эмигрировали в Берлин?

**Леонтьев:** Да, в Берлин. Я очень быстро защитил диссертацию. Я тогда работал с двумя профессорами – был ас-

систентом у профессора Зомбарта, очень интересного историка и экономиста, и у Борткевича, экономиста-математика. Но профессор Зомбарт в математике не разбирался.

**Фоули:** Интересовал ли их статистический аспект составления таблиц «затраты – выпуск»?

**Леонтьев:** Нет, хотя экономисты в своих эмпирических исследованиях обязаны опираться на факты. Но многие, особенно лучшие экономисты, любят теоретизировать, оперировать абстрактными категориями.

**Фоули:** Как долго вы пробыли в Берлине?

**Леонтьев:** Около двух лет. После получения степени я работал в Институте мировой экономики (большом институте в Киле). Меня пригласили в штат, и, в сущности, именно там я и разработал свой метод «затраты – выпуск».

**Фоули:** Занимались ли другие ученые в Киле этой проблемой или вопросами, с ней связанными?

**Леонтьев:** Нет, я действовал совершенно самостоятельно.

**Фоули:** Наверное это был колоссальный труд – создать статистическую основу для анализа «затраты – выпуск».

**Леонтьев:** Да, конечно. Я решил, что следует показать, как этот метод работает на практике, и попросил помочь в этом одного человека. Национальное бюро экономических исследований пригласило меня в Соединенные Штаты. Я получил кое-какие деньги от фондов, и мы с моим помощником работали очень много, использовали всю возможную

информацию, включая техническую, и прежде всего, естественно, данные переписи. Перепись в США была лучшим статистическим документом развития экономики. Позднее меня пригласили в Гарвард – там я проработал 45 лет. Когда началась война, интерес к методу «затраты – выпуск» возрос. Я был своего рода консультантом по экономическому планированию – работал для военно-воздушных сил, что во время войны имело, конечно, большое значение. Самая лучшая матрица «затраты – выпуск» была построена в военно-воздушных силах. У них была и таблица «затраты – выпуск» для экономики Германии – это помогало им выбирать цели. Обычно я не вмешиваюсь в чьи-то дела, но если вы над чем-то работаете, то должны понимать соответствующие задачи. В случае ВВС это был выбор целей и тому подобного, поэтому метод «затраты – выпуск» и вызывал у них такой интерес.

**Фоули:** Как вы оценивали работу Кейнса в 1930-е гг.? Не изменилось ли с тех пор ваше отношение к нему?

**Леонтьев:** Нет, абсолютно нет. Мое отношение было довольно критическим, так как я считал, что он разработал свою теорию, чтобы подвести основу под собственные рекомендации в области политики. Кейнс был больше политиком, чем аналитиком. Я так никогда и не стал кейнсианцем, хотя и написал одним из первых ряд статей, посвященных его взглядам. Вы найдете их среди моих работ. Но я пытался анализировать его концепцию системно, то есть не политический аспект, а просто подход, который был, по-моему,

слишком прагматичным. Хотите исправить систему – хорошо, но сначала опишите ее, а уж затем улучшайте.

**Фоули:** Была ли у вас в то время альтернативная теория экономической депрессии?

**Леонтьев:** Нет. Мне кажется, для теоретического осмысления экономических колебаний требуется прежде всего понимать, что эти процессы носят динамический характер. Я по-прежнему считаю, что эти колебания обусловлены определенного рода разницей, дифференциальными уравнениями. Структурные изменения имеют, конечно, большое значение, особенно сейчас. Динамика имеется всегда. Это система взаимосвязей, система уравнений, но количественный подход все равно важен. Поскольку я уделял много внимания связи между наблюдением и теорией, одновременно я разрабатывал теорию анализа по методу «затраты – выпуск», которая на самом деле является математической, и сам пытался собрать данные. Думаю, мне удалось повлиять на содержание курса экономической статистики.

**Фоули:** Да. Метод «затраты – выпуск» и анализ национального дохода – два важнейших достижения 1940–50-х гг.

**Леонтьев:** Согласен. Думаю, что здесь нет противопоставления. Метод «затраты – выпуск», на мой взгляд, просто намного более подробен. К примеру, Стоун, которому было поручено разработать систему показателей экономической статистики для ООН, придавал огромное значение методу «затраты – выпуск» как основе для агрегирования показате-

лей при расчете национального дохода.

**Фоули:** В системе подобного рода обычно всегда пытаются смоделировать воздействия как со стороны спроса, так и со стороны предложения.

**Леонтьев:** Попытки отдельно анализировать спрос всегда вызывали у меня определенное беспокойство. Мне кажется, что хозяйства – это только часть всей системы. В правильной теории хозяйства – просто крупный сектор экономики.

**Фоули:** Это согласуется с идеей классической школы о том, что воспроизводство населения – один из аспектов воспроизводства экономической системы.

**Леонтьев:** Совершенно верно. Об этом писал еще Кенэ.

**Фоули:** О взаимосвязи между структурными изменениями и колебаниями деловой активности мы говорили и с Ричардом Гудвином.

**Леонтьев:** Ричард Гудвин – мой бывший студент. Он учился у меня, был моим ассистентом. Он не смог найти себе в Гарварде постоянную работу и уехал в Англию. Он был хорошим другом и очень интересным человеком.

**Фоули:** Мы как-то говорили об этом с Гудвином. В конце 1940-х у него была работа в Гарварде, но не постоянная.

**Леонтьев:** Да, постоянную работу он получить не смог, поэтому и уехал в Англию.

**Фоули:** Он сказал то же самое, но меня несколько удивило, что человек, занимавшийся в конце 1940-х такими ис-

следованиями, не смог получить место в штате.

**Леонтьев:** Думаю, это из-за политики. Он был левым.

**Фоули:** И это перевесило его научные заслуги?

**Леонтьев:** Да, честно говоря, дело было именно в этом.

**Фоули:** Так вы и сегодня стали бы искать основную причину циклических колебаний экономики в лагах, в структурных изменениях со стороны предложения?

**Леонтьев:** Да, в структурных изменениях, но нужно быть очень осторожным, поскольку система, динамичная система, без структурных изменений имела бы лаги, а также скрытые внутренние причины колебаний. В настоящее время большое значение имеет, конечно, технический прогресс. Это существенный фактор экономических изменений и причина изменений социальных.

**Фоули:** Как вы считаете, эти колебания носят затухающий или взрывной характер?

**Леонтьев:** С точки зрения математики они не обязательно должны быть затухающими. Но тогда возникает вопрос, почему не происходит взрыва? Существуют некие силы, которые не дают взорваться, в том числе экономические – такие как политика и прочие нелинейные воздействия.

**Фоули:** В 1930-е гг. у вас были разногласия с Маршаком по поводу анализа спроса.

**Леонтьев:** Да, подробностей я теперь уже не помню, но, думаю, в подходе Маршака был логический изъян.

**Фоули:** Сыграло ли это какую-то роль в разработке мето-

да «затраты – выпуск»?

**Леонтьев:** Это было уже после того, как я разработал метод «затраты – выпуск», который на самом деле был создан в период работы в Киле, а также в Национальном бюро. В Национальном бюро я вел «подрывную деятельность», так как при Митчелле оно занималось узкопрактическими вопросами, а у меня было очень сильное теоретическое чутье. Чтобы понять процесс, нужно иметь теорию. Там я организовал подпольный теоретический семинар. Он был подпольным, поскольку не соответствовал принципам Национального бюро.

**Фоули:** В 1940-е гг. между Национальным бюро и Фондом Коулза были довольно острые разногласия по поводу соотношения ролей эмпирического метода и теории. Купманс написал тогда очень острую статью.

**Леонтьев:** Поскольку я считал, что огромную, важнейшую роль играет математика, я был бы, конечно, на стороне Комиссии Коулза.

**Фоули:** Но институционально вы были ближе к Национальному бюро...

**Леонтьев:** Совершенно верно. Мне всегда казалось – и об этом я как раз писал в своем президентском послании – что если вы действительно хотите разбираться в эмпирической науке, то у вас должны быть факты. И проблема в том, как организовать эти факты. Теория, в сущности, и «организует» факты.

**Фоули:** Ваша позиция была своего рода синтезом двух этих точек зрения.

**Леонтьев:** Да, именно так.

**Фоули:** В 1940-е гг. Комиссия Коулза разработала весьма специфический подход к эконометрике и решению проблем измерения. Вызвал ли он у вас понимание?

**Леонтьев:** Нет. Я сразу выступил с критикой.

**Фоули:** Ожидали ли вы, что метод «затраты – выпуск» будет использоваться при разработке государственной политики после Второй мировой войны? Это период интересен тем, что служит образцом для последующих десятилетий.

**Леонтьев:** Прежде всего, не только государственной, но и отраслевой. Я вспоминаю, что когда значительно позднее возник вопрос о месте автомобильной промышленности в американской экономике, нашлась ассоциация промышленников, которая сказала: «Идите к Леонтьеву», поскольку я опубликовал одну работу, в которой в качестве примера использовалась автомобильная промышленность. Я опубликовал эмпирическую работу, а мой принцип, хоть мне и не всегда удавалось его соблюдать, заключался в том, чтобы использовать фактические данные всякий раз, как делаешь какой-либо теоретический вывод, – то есть не просто говорить, но действительно понимать, как это работает.

**Фоули:** И вы использовали метод «затраты – выпуск» для прогнозирования, скажем, развития автомобильной промышленности или других конкретных отраслей?

**Леонтьев:** Совершенно верно. Во времена холодной войны был такой экономист Хоффенберг. Он много занимался эмпирическим анализом, сыграл очень важную роль в построении таблицы «затраты – выпуск» для Соединенных Штатов. Это был действительно статистик с блестящей интуицией. А чтобы заниматься статистикой, как вы понимаете, нужно владеть совершенно особыми приемами. Когда я строил первую таблицу затрат и результатов, а подготовил я ее довольно быстро, я много звонил по телефону. Я обзванивал компании, особенно сбытовые, и получал от них данные.

**Фоули:** Вы спрашивали у дистрибьюторов, как их заказчики распределяются по секторам?

**Леонтьев:** Именно так! Я просто обратился напрямую к дистрибьюторам.

**Фоули:** Была ли у американского правительства в 1946 г. работающая таблица «затраты – выпуск»?

**Леонтьев:** Да-да. В министерстве торговли, в Бюро экономического анализа. Национальный доход рассчитывало Бюро экономического анализа, и у них была таблица учета затрат и результатов. Хотя самую лучшую таблицу построили в Министерстве труда. Фрэнсис Перкинс, министр труда при Рузвельте, написала мне, что президент задал ей вопрос, что произойдет с американской экономикой после войны. Она сообщила, что они не знают, как на него ответить. Они попытались посмотреть в литературе, но не знают, как подойти к проблеме. А тогда как раз вышла одна из моих

первых статей, и они спросили: «Может быть, вы научите нас, как это сделать?» Ко мне прислали представителя министерства, и я сказал: нужны фактические данные и хорошая теория. В то время, при Рузвельте, правительство было очень умным и активным. Прекрасно, сказали они мне, соберите данные. Приезжайте в Вашингтон и соберите фактические данные. Но я сказал: нет. В Вашингтоне фактические данные собирать нельзя. Я должен делать это в Гарварде. И они открыли в Гарварде отделение Бюро статистики труда, в школе Литтауэра. Я нашел людей, в основном не экономистов, а инженеров, и мы построили таблицу «затраты – выпуск». Следующая подробная таблица учета затрат и результатов была построена на деньги Министерства обороны. А у него денег было достаточно. Строить таблицу «затраты – выпуск», не имея средств, очень трудно, поскольку это очень ресурсоемкое занятие.

**Фоули:** Конкурировали ли между собой после войны кейнсианское управление спросом и ориентированный больше на совершенствование структуры экономики подход к формированию экономической политики, основанный на анализе затрат и результатов?

**Леонтьев:** Думаю, что кейнсианский подход определенно победил. Особой конкуренции, думаю, не было. Победил Кейнс.

**Фоули:** Почему это произошло?

**Леонтьев:** Потому, что Кейнс был очень прагматично

ориентирован. По духу он был в большей степени политик, причем превосходный политик. Думаю, он разработал свою теорию, в сущности, чтобы обосновать собственные рекомендации в области политики. Он был невероятно умен.

**Фоули:** Но, похоже, что и у вас были политические контакты в Министерстве труда, Министерстве обороны и Министерстве торговли.

**Леонтьев:** О да. Но, вы знаете, они были иными. Намного более скромными. Министерство труда изучало вопросы, связанные с предложением на рынке труда, разными навыками и т. д. То есть занималось намного более узкими вещами. У них по-прежнему есть подразделение, занимающееся анализом затрат и результатов, – Бюро статистики труда.

**Фоули:** Оглядываясь назад, можно сказать, что в конце 1940-х гг. в экономической науке произошел синтез методологий. Какова была роль метода «затраты – выпуск» в выработке консенсуса методологий в экономической теории и эконометрике? Способствовал ли метод выработке этого консенсуса?

**Леонтьев:** Видите ли, я несколько скептически относился к идее отыскания подходящей кривой. Я думал о технических данных. Адекватное представление о структуре экономики имеют не статистики, а производственники, но, конечно, смоделировать технические показатели очень сложно. Моя идея состояла в том, чтобы не определять структуру косвенным путем, с помощью эконометрических или ста-

тистических методов, а напрямую обратиться к источникам технических и экономических данных. У меня были кое-какие предложения на этот счет, реализовать которые помешало отсутствие средств. Эмпирический анализ стоит очень дорого.

**Фоули:** И анализ затрат и результатов обходится дороже косвенного статистического исследования.

**Леонтьев:** О да, намного дороже. Мы воспользовались косвенными статистическими методами. Думаю, у меня очень хорошо развита теоретическая жилка. В сущности, я теоретик. Но я был убежден, что теория – это просто построение концепций, позволяющих понять, как функционируют реальные системы. Это просто организационный принцип, в то время как для многих экономистов теория – нечто самостоятельное.

**Фоули:** Некоторые экономисты считают, что теория должна давать прогноз или объяснять поведение.

**Леонтьев:** Да. Думаю, если знать или договориться о том, что такое формальный характер математической системы, то благодаря общему характеру системы можно делать определенные прогнозы. Я опубликовал пару статей по прогнозированию. В количественном анализе есть краткосрочные и долгосрочные проблемы, и мне кажется, что обычное прогнозирование подходит для краткосрочных проблем; но технический прогресс, являющийся движущей силой всего экономического развития, – процесс долгосрочный.



**Рис. 1.2.** Участники семинара профессора Леонтьева (август 1948 г., Зальцбургский семинар по американским исследованиям): 1) Фридрих Зайб (Германия), 2) Бьёрн Ларсен (? Норвегия), 3) Хельге Зейп (Норвегия), 4) Лендерт Койк (? Голландия), 5) Жерар Дебрё (Франция), 6) Поль Виндинг (Дания), 7) Роберт Солоу (США), 8) Миссис Роберт Солоу (США), 9) Марио ди Лоренцо (Италия), 10) Арво Пуукари (Финляндия), 11) Жак Мэйе (Франция), 12) Одд Аукруст (Норвегия), 13) профессор Уильям Райс (США), 14) Джозеф Клацман (Франция), 15) неизвестный (Германия), 16) Бьярк Фог (Дания), 17) профессор Василий Леонтьев (США), 18) Пер Сильве Твейте (Норвегия)

**Фоули:** Следовательно, с этой точки зрения, конкретные гипотезы, касающиеся поведения людей или формирования ожиданий или предпочтений, играли бы вспомогательную роль.

**Леонтьев:** Да, вспомогательную. Я думаю так, поскольку мне кажется, что особенно при рыночной, капиталистической системе, крупные промышленники действительно играют большую роль, и они стараются получить прибыль, выбирать технологии, максимизирующие прибыль – в основном, в краткосрочной перспективе. Конечно, нужно учитывать и государственную политику, но бизнес – это, конечно, система краткосрочного типа.

**Фоули:** В таких отраслях, как транспорт или электроэнергетика, которые требуют долгосрочных инвестиций, это может создать проблемы.

**Леонтьев:** Согласен. Машиностроение, электроэнергетика, и, полагаю, охрана окружающей среды, которая сегодня особенно важна, требуют долгосрочного планирования.



**Рис. 1.3.** Йозеф Шумпетер, Василий Леонтьев и Пол Сузи в Гарварде, конец 1940-х гг.

**Фоули:** Вы говорили о проблеме денег и ресурсов. Была ли в США в 1950-х гг. конкуренция за ресурсы между методом, традиционно применяемым для расчета национального дохода, и методом «затраты – выпуск»?

**Леонтьев:** Мне кажется, что, по крайней мере, в Министерстве торговли поняли ценность метода «затраты – выпуск» для расчета национального дохода. Дело в том, что одно время (а, возможно, и сейчас) при расчете национального дохода, в основном, суммировались результаты анализа «затраты – выпуск». Финансирование – это всегда проблема.

Для анализа затрат и результатов, особенно анализа технического прогресса, нам нужно больше инженерных знаний, так как сегодня движущей силой технического прогресса является прогресс научный.

**Фоули:** Считаете ли вы, что существует обратная связь и узкие места в экономике учитываются при определении приоритетных направлений научных исследований?

**Леонтьев:** Несомненно. Прежде всего это всегда было характерно для оборонной промышленности. Научный прогресс пошел военным на пользу.

**Фоули:** В 1960-е и в начале 1970-х гг. в экономической науке произошло еще одно важное изменение, сдвиг от кейнсианского консенсуса к тому, что теперь называют моделями рациональных ожиданий и концепциями рыночного клиринга и идеального предвидения. Вы в то время преподавали в Гарварде. Как вы оценивали происходящее в вашей науке? Какие факторы предопределили эти изменения?

**Леонтьев:** Раньше в экономическом мышлении доминировал Кейнс. Не знаю, способствовала ли вся революция в теории ожиданий продвижению вперед, и в какой степени. С точки зрения математики это очень тонкая вещь, а я теперь уже не так внимательно слежу за литературой, но думаю, что особого анализа в отношении ожиданий не было. Одни разговоры. Я не увидел никакого существенного вклада в теорию ожиданий, за исключением краткосрочного прогнозирования циклических изменений, которое, конечно, имеет

большое значение.

**Фоули:** Так вы не думаете, что этот сдвиг стал результатом определенного эмпирического превосходства этого нового подхода?

**Леонтьев:** Нет, я так не думаю.

**Фоули:** Может быть, кейнсианство просто себя исчерпало?

**Леонтьев:** Полагаю, что да.

**Фоули:** Вы сказали, что точка зрения Кейнса с самого начала не показалась вам убедительной, так что, полагаю, вы заметили это без особого сожаления?

**Леонтьев:** Да. Я не отношу себя к монетаристам, но думаю, что более глубокий анализ денежного потока способствовал бы большему развитию этого направления.

**Фоули:** Была разработана отчетность о движении денежных средств.

**Леонтьев:** Да, но очень агрегированная. Чтобы понять, как работает экономическая система, большое значение имеет дезагрегирование.

**Фоули:** Быть может, стоило увязать анализ денежных потоков с анализом затрат и результатов на тех же уровнях агрегирования?

**Леонтьев:** О, да, но я не видел, чтобы кто-либо пытался это сделать. Конечно, денег здесь нет, но думаю, что денежные потоки очень важны. Иногда мне казалось, что можно увязывать денежные потоки не сверху вниз, а снизу вверх,

так как я думаю, что в каждой компании есть кто-то, кто отвечает за денежные потоки (бюджеты, кредит и т. д.) и обязан составлять планы. Сейчас планируются только денежные потоки, и есть тот, кто делает то же самое в банке. И, если я не ошибаюсь, менеджер компании, следящий за тем, чтобы у нее было достаточно заемных средств, сотрудничает с менеджером по кредитам в банке, который очень часто отвечает за отдельные компании. Я сделал несколько предложений относительно того, как с этим можно было бы поработать. Интересно было бы получить одни и те же цифры от двух разных людей. Было бы очень полезно понять, как они взаимодействуют, выбирая направление краткосрочных инвестиций.

**Фоули:** Экономическая теория об этом особо не задумывалась. Большинство моделей исходят из определенных условий равновесия, но вы сказали, что было ошибкой начинать с равновесия, противопоставляемого явно выраженной динамике.

**Леонтьев:** Конечно.

**Фоули:** Когда в 1974 г. вы ушли из Гарварда вскоре после получения Нобелевской премии, вы выступили с острой критикой этого направления в экономике и призвали к переоценке и переориентации методов экономических исследований. Как вы считаете, произошла ли эта переориентация?

**Леонтьев:** Нет.

**Фоули:** Оценка сегодняшней экономики как науки оста-

ется у вас прежней?

**Леонтьев:** Да. Мне кажется, нам нужны от экономистов объективные, практические рекомендации. Основа нашего понимания того, как функционирует экономика, не очень прочна. Практические рекомендации могут и должны больше основываться на понимании того, как работает эта система.

**Фоули:** Сегодня вы неоднократно упоминали о роли математики. Некоторые утверждают, что теперь в экономической науке слишком доминирует математический формализм.

**Леонтьев:** Полностью с ними согласен. Очень многие экономисты-математики были просто математиками, но не настолько хорошими, чтобы стать чистыми математиками. Поэтому математика в экономике, которая всегда была скучна, дала им превосходную возможность превратиться в экономистов.

**Фоули:** Но, с другой стороны, именно вы активно способствовали повышению роли математики в экономической теории. Когда математика полезна, а когда становится просто формализмом?

**Леонтьев:** Мне кажется, что математика – это просто логика. Общий подход – это самое важное. Думаю, например, что именно математика дает нам веские основания считать, что все циклические колебания объясняются лагами – это динамика. Это действительно математический подход. Ма-

тематики это знают. Действительно, одна из наиболее серьезных проблем, с которой я столкнулся в своей теоретической работе, заключалась, в частности, в том, как избежать взрывных колебаний, поскольку в этих больших матрицах столько значений, и некоторые из них порождают взрывную динамику.

**Фоули:** Какое математическое образование вы получили?

**Леонтьев:** Я изучал математику, но очень рано захотел расширить свой кругозор в этой области, когда понял, что математическое доказательство имеет для экономистов большое значение. Я много читал, в университете прослушал базовый курс, всегда старался заниматься не только теоретическими, но и эмпирическими исследованиями. В экономике это требует владения математическими методами, например, системным анализом.

**Фоули:** Но вы также говорите, что сначала должно прийти видение экономической структуры и взаимосвязей.

**Леонтьев:** Полагаю, что нужно и то, и другое – если у вас есть только это видение, оно ничего не даст. Когда до своего прихода в Национальное бюро экономических исследований я работал над методом «затраты – результаты», для меня было крайне важно хорошо представлять себе математические соотношения. В экономике используется математика не самого высокого порядка. Например, те, кто перевел на язык математики неоклассическую экономическую тео-

рию, не предложили никаких особо интересных идей. Конечно, кое-что они предложили, но ничего особенно интересного относительно механизма функционирования экономической системы они не представили, и эмпирический анализ для них в конечном счете был не важен.

**Фоули:** Из разговоров на эту тему с другими я понял следующее: многие очень надеялись, что формализация экономики позволит сделать какие-то важные открытия.

**Леонтьев:** Без цифровых данных это невозможно. Без цифровых данных это никогда ничего не даст. Можно только установить какие-то принципы равновесия и неравновесия.

**Фоули:** Вы полагаете, что этим реальный вклад в науку этой программы более или менее и ограничивается?

**Леонтьев:** Полагаю, что да. Они добились бы большего прогресса, если бы располагали действительно качественной, очень подробной эмпирической информацией. Было бы интересно, например, понять, как современный технический прогресс повлиял на спрос на труд. Он мог уменьшить этот спрос и даже породить социальные проблемы, поскольку труд – это не просто один из факторов производства. И тогда вам нужно будет поддерживать труд. Полагаю, что государству теперь приходится субсидировать население через расходы на образование, здравоохранение и, конечно, социальное обеспечение (а, возможно, и какую-то социальную помощь), но всего важнее социальное обеспечение. Мне кажется, что в конечном счете система социального обеспече-

ния будет предусматривать перераспределение доходов для того, чтобы у людей были средства на приобретение потребительских товаров. Уже сейчас это очень развито – меня поражает, какие средства расходуются на социальное обеспечение моей семьи.

**Фоули:** Это кейнсианская проблематика – поддержка спроса через государственные субсидии.

**Леонтьев:** Да. Но это не только поддержка спроса. Кейнс поддерживал занятость, чего в данном случае нет. Поддерживается только спрос. Вы кормите людей. Техника снизит или, во всяком случае, не увеличит занятость. Я думаю, что техника, конечно, конкурирует с трудом, обычным трудом. Если у вас все производят автоматы, вы, естественно, не будете нанимать столько людей.

**Фоули:** То есть это иллюстрирует вашу мысль о том, что изучение реальной структуры происходящего должно опираться на солидный фундамент?

**Леонтьев:** Да. Технический прогресс всегда, даже в доисторические времена, был движущей силой экономического развития, но сейчас, когда он ускоряется научными исследованиями, такого рода анализ крайне важен. Экономисты пытались его провести, но в основном делали общие заявления. Как только электроэнергия становится дешевле, технический прогресс приобретает большое значение. Сейчас производство требует гораздо больше электроэнергии.

**Фоули:** Как вы думаете, присуждение Нобелевской пре-

мии по экономике в целом способствует улучшению условий для того, чтобы проводить экономические исследования?

**Леонтьев:** Вы знаете, есть одна проблема. Думаю, что скоро они не смогут найти достойных кандидатов. Проблемы уже начались.

**Фоули:** Оказало ли получение премии какое-либо влияние на вашу работу или жизнь как ученого?

**Леонтьев:** В какой-то мере – на мою жизнь... Но не на работу. Естественно, стало легче получать заказы. Но отнюдь не легче получать финансирование. Теперь, например, я вообще не могу получить никакого финансирования. Так что, полагаю, моя научная жизнь стала легче, но, как я уже сказал, продолжение деятельности Нобелевского комитета проблематично. Думаю, что уже сейчас его внимание постепенно переключается с экономистов-теоретиков на институциональных экономистов. И теперь возникает проблема, поскольку в конкретных экономических исследованиях можно, по крайней мере, говорить о какой-то иерархии, а также крупных шагах вперед, прорывах, тогда как в институциональной школе я действительно не вижу никаких крупных прорывов. Меня беспокоит, что экономисты сегодня недостаточно интересуются институциональными изменениями, обусловленными появлением новых технологий, которое я определенно считаю движущей силой.

**Фоули:** Было немало споров о том, должна ли экономика взять за образец какую-нибудь другую науку, в частности,

физику или биологию, и если да, то какую. Считали ли вы когда-нибудь, что экономика должна стать чем-то вроде физики или биологии общества?

**Леонтьев:** Думаю, особого толка от этого не будет. Экономисты-математики, естественно, любят смотреть на физику. Думаю, идея Дарвина была действительно интересной, и, в определенном смысле, Дарвин был великим интеллектуальным революционером. Он совершил колоссальную революцию не только в биологии, но и в анализе всех жизненных процессов. Думаю, Дарвин – да, Ньютон и Дарвин – внесли огромный вклад в понимание причин социальных изменений. Дарвинизм очень важен, хотя, конечно, интересен тот факт, что на Дарвина оказал влияние Мальтус. Что именно вас интересует?

**Фоули:** В последнее время я занимался, в том числе, и эволюционным моделированием научно-технического прогресса. На всем длительном отрезке времени, пока технический прогресс будет иметь решающее значение, также будет существовать проблема глобального потепления.

**Леонтьев:** О да. Совершенно согласен. Технологии играют существенную роль.

**Фоули:** В более краткосрочной перспективе большое значение может иметь замена существующих технологий, но думаю, что в долгосрочной перспективе важнее будет направление, уклон научно-технического прогресса. Вопрос в том, существует ли способ его контролировать.

**Леонтьев:** Вот именно. Не обязательно сознательно, но... Теперь, конечно, связь между научным и техническим прогрессом стала гораздо теснее. Трудно даже представить себе технический прогресс без прогресса науки, и, учитывая глобальное потепление, эти вещи приобретают особое значение. А что мы можем сделать? Мы можем сделать многое. Например, снизить темпы экономического развития.

**Фоули:** Эта идея непопулярна в мире, жаждущем развиваться как можно быстрее.

**Леонтьев:** Удивительно, насколько отстали в техническом отношении многие менее развитые страны. Начав вырубать деревья, вы добьетесь этого очень быстро.

**Фоули:** Если бы вам представили молодого ученого, которому пришла в голову такая же новаторская, но дорогостоящая идея, как метод «затраты – выпуск», то как бы вы посоветовали ему действовать?

**Леонтьев:** Я порекомендовал бы ему что-нибудь опубликовать. Не знаю, кто сегодня получает деньги. Последнее время я не следил за изменениями в этой области, ведь мне уже за 90. Но, конечно, много денег тратится не на исследования, а на сбор данных. У некоторых экономистов есть хорошие идеи, и они действительно могут сделать что-то с этими данными, но экономика сегодня все ближе и ближе к технологиям. Чтобы использовать влияние научно-технического прогресса на изменения в экономике, вы не можете просто рассчитать какую-нибудь кривую предложения; у вас

действительно должна быть масса информации. Я описал, как это можно сделать, и мне почти удалось найти на это деньги. Мне кажется, что, имея действительно подробные данные, можно было бы даже сделать определенный прогноз, предсказание. Я связался с сообществом производственников, с представителями различных отраслей, и они готовы были снабдить меня информацией. Думаю, что в этом будущем этой работы, во взаимодействии между экономикой и отдельными отраслями, наукой и системой производства.

**Фоули:** Были ли у вас когда-либо личные или научные контакты с Пьеро Сраффа, наполовину англичанином, наполовину итальянцем, работавшим над линейными моделями?

**Леонтьев:** Нет, я никогда с ним не встречался. Но, думаю, он был очень интересным человеком. Интересным было его видение. Думаю, анализ затрат и результатов не обязательно линеен. Я интерпретировал бы его как одно из направлений неоклассической теории. Сраффа интересовало нечто иное, не прямые зависимости. Я вовсе не настаиваю на линейной зависимости, только учитываю то, что иметь дело с нелинейными системами ужасно сложно. Что делают математики даже при расчетах? Они выделяют в составе системы подсистемы с линейными зависимостями, а затем снова складывают их в единое целое. Вот как большинство из нас использует математику в сфере, в которой большое значение имеют цифровые данные.

**Фоули:** Я хотел спросить вас о связи метода «затраты –

выпуск» с анализом на основе производственной функции. Сегодня в экономике производства, похоже, доминируют производственные функции.

**Леонтьев:** О да. Производственная функция слишком гибка. Прежде всего, связывать всё это в единое целое глупо. Я представляю себе различные методы производства как кулинарные рецепты, в которых указаны даже такие моменты, как температура и прочее, а также то, что нужно знать, чтобы приготовить данное блюдо. Этот подход позволяет нам анализировать технический прогресс. Техническая производственная функция была, в сущности, попыткой не заниматься эмпирическим анализом. Понимаете, при наличии производственных функций он и не нужен. Вы делаете догадку относительно нескольких параметров вместо того, чтобы подробно анализировать происходящее, и если вы пытаетесь обобщить производственные функции, то это опасно, очень опасно.

**Фоули:** Что вы думаете о преимуществах и недостатках увязки отраслевых показателей с показателями фирмы или предприятия?

**Леонтьев:** Думаю, что институциональная структура производства, структура производства в разрезе предприятий в какой-то мере отражает технологию, но это очень тонкий вопрос, поскольку проблема того, как экономическая деятельность распределяется между различными создаваемыми людьми организациями, совсем не проста. Эта структу-

ра имеет определенное отношение к реальному распределению, но не прямое. Создаваемые людьми организации очень сложны. Вы можете осуществить эту увязку в одном отношении и не осуществить в каких-то других, но я согласен и с тем, и с другим подходом, особенно учитывая, что и предприятиями дело не ограничивается. Теперь даже предприятия имеют сложную институциональную структуру.

**Фоули:** Одна из практических проблем заключается в том, что когда вы дезагрегируете затраты и результаты, то обнаруживаете, что одна и та же фирма начинает появляться сразу в нескольких отраслях. Это также связано с поднятой вами ранее темой финансов. Финансы появляются на уровне фирмы.

**Леонтьев:** Полностью согласен, и здесь мы согласимся с необходимостью целостности, связывания воедино. Институциональные структуры меняются очень легко. Поэтому, если говорить об управлении, то фирма совершенно не отражает технологий. Одна и та же компания может производить мороженое и варить сталь. Этого, я думаю, избежать нельзя, но, возможно, в силу собственных интересов я скорее приветствовал бы подход «сначала предприятие – потом компания», поскольку предприятие – нечто однородное. И это очень интересная проблема.

**Фоули:** В чем, по-вашему, будущее экономической, и в частности, макроэкономической науки?

**Леонтьев:** Думаю, значение проблем распределения до-

ходов возрастет. Как я уже упомянул, труд не будет больше играть такую роль, и главное будет заключаться в том, чтобы просто управлять системой. Люди будут получать свои доходы через систему социального обеспечения. Уже сейчас мы получаем их через социальное обеспечение и пытаемся придумать всякий раз предлог для оказания людям социальной помощи. Огромную роль при этом, полагаю, будет играть государство, и те экономисты, которые пытаются ее сейчас минимизировать, боюсь, демонстрируют поверхностное понимание того, как работает экономическая система. Мне кажется, если бы мы сейчас упразднили государство, то наступил бы полный хаос. Сегодня планирование, естественно, играет определенную роль, но я не считаю его основной функцией государства. Государство, на мой взгляд, имеет большое значение, и это значение в условиях научно-технического прогресса должно возрасти. Когда задумываешься над тем, что произошло бы с системой, если бы мы совершенно упразднили государство, то понимаешь, что это было бы ужасно.

**Фоули:** Но вы думаете, что это особенно справедливо из-за того давления, которое научно-технический прогресс при капитализме оказывает на общественное устройство, и из-за ослабления взаимозависимости между трудом и доходом?

**Леонтьев:** О да. Совершенно верно. Рынок труда – недостаточный инструмент для перехода от производства к потреблению.

**Фоули:** Задам вам еще только один вопрос. Вы всю жизнь наблюдали изнутри за тем, что происходит внутри сообщества американских экономистов и более широкого сообщества американских ученых и политиков. Если бы вы были антропологом, то как бы охарактеризовали экономистов – как особое племя или культуру по сравнению с физиками или биологами?

**Леонтьев:** Это зависит от того, каких экономистов вы имеете в виду. Ученые-экономисты – это просто часть научного истеблишмента, но, полагаю, что мы, экономисты, незаменимы как бухгалтеры. Чтобы управлять системой, нужно разделять взгляды и принципы менеджеров, и экономисты – это просто особая разновидность менеджеров, если не считать экономистов-ученых, которые не подпадают под это определение.

**Фоули:** А видите ли вы какую-либо разницу между учеными-экономистами и учеными других специальностей или инженерами-производственниками, с которыми работаете?

**Леонтьев:** В экономической науке существуют разные тенденции. Некоторые видные экономисты просто доказали пару теорем или переписали классические или неоклассические учебники.

**Фоули:** Вы имеете в виду, что экономисты выше ценят работы по классификации и формализации, чем те, которые позволяют узнать что-то новое о самом мире?

**Леонтьев:** Да. С моей точки зрения, это важное замеча-

ние. Поскольку меня интересуют проблемы общества, я считаю экономику общественной наукой. Экономисты обязаны, безусловно, вносить свой вклад в понимание того, как развивается человеческое общество, и здесь представители экономической науки должны сотрудничать с антропологами и другими учеными.

## 2. Интервью с Дэвидом Кассом

**Беседовали Стивен Спир,**  
*Университет Карнеги-Меллона,*

и

**Рэндалл Райт,**  
*Пенсильванский университет,*  
13 февраля 1998 г.

Дэвида Касса, несомненно, можно назвать одним из отцов современной теории экономической динамики. Фундаментальный вклад в эту теорию он внес своими работами по проблемам оптимального роста, моделям перекрывающихся поколений, равновесию солнечных пятен, а также моделям общего равновесия с неполными рынками. Его изыскания во многом определили то, как мы сегодня занимаемся и микро-, и макроэкономическими исследованиями. Труды Касса сыграли важную роль в разработке современной макроэкономической теории: модели Касса-Купманса заложили основу теории реальных экономических циклов; анализ моделей экономической динамики, его общий инструментарий и методы позволили нам углубить понимание монетаристской теории, а также внесли огромный вклад в развитие экономики внешней неопределенности. Касс не только первоклассный ученый, но и яркая, в высшей степени свобододолю-

бывая личность.

Проводя это интервью, мы хотели, прежде всего, получить информацию о биографии Дэвида Касса и его подходе к экономическим исследованиям. Также, учитывая название и целевую аудиторию журнала *Macroeconomic Dynamics*, мы пытались вовлечь его в обсуждение современной макроэкономической науки и того влияния, которое оказали на ее развитие его работы. Некоторые фрагменты нашей беседы ради экономии места были сокращены, но то, что осталось, практически не редактировалось. Как известно большинству читателей, Дэвид Касс долгое время сотрудничал с Карлом Шеллом.

Мы встретились с Дэйвом в его заваленном журналами, книгами и компакт-дисками кабинете на экономическом факультете Пенсильванского университета незадолго до обеденного перерыва. Он был в своих обычных джинсах и футболке и выглядел таким же взъерошенным, каким выглядит обычно. Мы поговорили немного в кабинете, затем продолжили за обедом, а потом вновь вернулись в кабинет, проведя за разговором несколько часов. Тот февральский день был не по сезону теплым, пятница, тринадцатое, если быть точным. Этот день принято считать несчастливым, но для нас, по крайней мере, он оказался очень удачным. Надеемся, что вы получите от этой беседы такое же удовольствие, какое получили и мы.



**Рис. 2.1.** Дэвид Касс, 3 июня 1994 г. по случаю присвоения ему Женевским университете том почетной степени доктора экономических наук

**MD (Macroeconomic Dynamics):** Давайте начнем с того, что поговорим о вашей учебе в аспирантуре и вашем наставнике Хирофуми Узава. Как вы впервые с ним познакомились?

**Касс:** О'кей. Программа подготовки аспирантов в Стэнфордском университете показалась мне совершенно бессистемной. Приведу вам один пример. В том году, когда я поступил в Стэнфорд, у них был устный квалификационный экзамен в первом семестре, и все понимали его полную абсурдность. В дальнейшем это требование отменили, но в тот момент экзамен уже был запланирован, и его решили оставить. У меня экзамен (а я в то время даже не знал точно своих преподавателей) принимали Кен Эрроу и кто-то еще. Узнав об Эрроу, я пришел в ужас. Когда Кен задал мне вопрос, я довольно глупо ответил. А у него есть эта способность принять чей-то ответ и затем отредактировать его таким образом, чтобы он показался очень содержательным. Вот мой экзамен и состоял из того, что я давал Эрроу короткие ответы, а он затем старался придать им какой-то смысл.

Главное заключалось в том, что они отменили требование обязательной сдачи этого экзамена, но все равно его провели, и это было типично. В Стэнфорде аспиранты были в основном предоставлены самим себе. Четкой программы не было. Я уже не помню точно, как впервые познакомился с Узавой, но там была группа экономистов-математиков, зани-

мавшихся не на факультете, а в небольшом домике в кампусе, который назывался Серра-Хаус. В нее входили стэнфордцы, которых я особенно ценил: Эрроу, Узава, Скарф. Были там и другие специалисты по применению математики в социальных науках. Карл Шелл откуда-то знал о Серра-Хаусе с самого начала, и мы стали там заниматься.

**MD:** Вы и Карл поступили в один и тот же год?

**Касс:** Да. И именно Карл привел меня в Серра-Хаус. Не помню, как мы познакомились с Узавой, но как-то познакомились. Возможно, он вел семинар или что-то в этом роде. Было очевидно, что он действительно занимается наукой и хорошо руководит аспирантами, и мы к нему прикрепилась. После этого последние два года в Стэнфорде (а всего я провел там четыре года) я в основном работал в Серра-Хаусе, сотрудничая с Узавой. Он постоянно вел семинары. На мой взгляд, Узава – ужасный лектор, но потрясающий педагог. Его величайшее достоинство заключается в том, что когда он вам преподает, то объясняет, как занимается наукой. Если он не подготовится, то расскажет вам о статье, над которой сейчас работает, об ошибках, которые сделал, и о том, как их можно исправить. Он объясняет, почему решил сделать то или это, и это все равно, как если бы вас учили проводить исследования.

Поэтому я прослушал у него несколько курсов и нашел их замечательными, но по обычным меркам они были, наверное, катастрофой. Он преподавал эконометрику и хотел рас-

считать какую-то оценочную функцию, кажется, функцию оценки максимальной достоверности ограниченной информации, но, как выяснилось, почти ничего о ней не помнил. Полкурса состояло из того, что Узава приходил и начинал доказывать теорему об этой функции и тратил на это час или полтора, а потом вдруг понимал, что снова пошел не тем путем, и говорил: «Извините». В следующий раз он все начал сначала – это было невероятно! Но это было интересно. У него действительно были хорошие мозги для того, чтобы выполнить работу с нуля и придумать, как решить проблему.

Учиться у Узавы было одно удовольствие. Работая с аспирантами, я стараюсь делать так, как делал Узава. Он относился к ним как к равным, и с каждым проводил массу времени, причем в разной обстановке. Не только в своем кабинете – он мог, например, пойти с аспирантом в бар или куда-нибудь еще. Он тратил на нас невероятное количество времени. Теперь я думаю, что Узава, наверное, никогда не читал того, что я писал. Уверен, что не читал. Но он всегда хотел об этом поговорить. Он всегда вовлекал своих аспирантов в беседы, и на семинарах у него была группа таких вовлеченных аспирантов. Все аспиранты знали, кто из них что делает. Конечно, у него был свой конек – теория роста, а точнее, применение самых разных вариационных исчислений, принципа максимума, к моделям роста. Поэтому начало профессиональной деятельности у нас у всех было по сути одинаковым, но у меня по личным причинам уже с админи-

страцией университета штата Пенсильвания возникли проблемы. Ее представители хотели, чтобы я не смешивал свою профессиональную деятельность с общественной, но я ответил, что это не соответствует моим представлениям о том, как нужно строить работу с аспирантами. Вот так я бы ответил на ваш вопрос о том, как я познакомился с Узавой, – а конкретные подробности нашей первой встречи я уже не помню.

**МД:** Знали ли вы уже тогда, что хотите заниматься теорией роста?

**Касс:** Вовсе нет.

**МД:** Какова была тема ваших исследований во время учебы в университете?

**Касс:** Экономика России.

**МД:** Экономика России?

**Касс:** Да. Это действительно странно, поскольку языки давались мне, наверное, хуже всего.

**МД:** Где вы учились?

**Касс:** В Орегонском университете. Я всегда считал, что должен стать юристом, так как в моей семье это традиция. Я отучился год в Гарвардской школе права и ненавидел каждую проведенную там минуту. В основном я занимался тем, что перечитывал великую русскую литературу и сдавал экзамены исключительно благодаря дедуктивному мышлению. Я запоминал несколько определений и от них отталкивался – этого вполне хватало. Затем я пошел в армию. Чего мне дей-

ствительно хотелось, так это вернуться в аспирантуру и заниматься экономикой, поэтому я решил остаться на Западном побережье. Мне очень повезло. Я ничего не знал об аспирантурах, но похоже было на то, что выбирать следовало между Беркли и Стэнфордом. Чисто случайно я выбрал Стэнфорд, а не Беркли, но, думаю, это было чертовски хорошее решение, поскольку я попал к преподавателям действительно мирового класса.

**MD:** А почему вы решили в аспирантуре заниматься именно экономикой?

**Касс:** Мне нравилась экономика, и я понимал, что мой диплом – только верхушка айсберга. Тогда на занятиях только-только начинали использовать уравнения, и меня увлекла эта идея – идея формализовать общественную науку.

**MD:** Наверное, ваша математическая подготовка, когда вы поступили в аспирантуру, была довольно слабой?

**Касс:** На самом деле этой подготовки у меня вообще не было. В моем университете преподавали тригонометрию, алгебру, геометрию и все. Помню, что в первый день учебы в Стэнфорде я попал к преподавателю макроэкономики, которого звали Боб Слайтон. На первом же занятии он записал модель общего равновесия и решил рассчитать мультипликатор, являющийся просто производной от этой модели. Он исписал всю доску и одну из стен аудитории, а я не понял из всего этого ни слова. Я знал, что такое производная, но не знал, что такое частная производная. То, что он де-

лал, называлось нахождением частной производной. Конечно, в те дни, занимаясь нахождением частной производной, люди на самом деле не понимали, что делают. Они записывали формы дифференциала, которые в дифференциальной топологии называются касательными пространствами, и занимались исчислением на комплексных многообразиях, но на самом деле в нем не разбирались. Этот метод еще не был освоен должным образом.

После этого занятия я пришел домой и сказал себе, что недостаточно подготовлен, чтобы учиться в аспирантуре по экономике. Поэтому я записался на математический анализ и статистику и высидел до конца все занятия Слайтона, а они были превосходны. Иное дело – занятия по микроэкономике. Их вел некто Мелвин Редер, специалист по экономике труда. В первый день он пришел, водрузил свои ноги на стол, сказал что-то уничижительное об экономической теории, и больше я к нему не ходил. Первый семестр я провел, изучая введение в матанализ и теорию вероятности. Теорию вероятности преподавал, как я потом узнал, специалист мирового класса. Это было замечательно, поскольку он иллюстрировал все понятия примерами. Потом вы могли легко подготовиться к экзамену, так как хорошо представляли себе, что это за предмет – теория вероятности.

**MD:** Ваша совместная работа с Карлом началась еще в Стэнфорде?

**Касс:** Нет. Самое забавное в Стэнфорде, и, возможно, это

присуще и другим программам подготовки аспирантов, заключалось в том, что они отбирали людей, из которых, по их мнению, могли получиться звезды. Карл изучал математику в Принстоне и поступил в Стэнфорд, в основном, потому, что знал о Кене Эрроу. Карл был именно такой будущей звездой (лучшим выпускником его не выбрали, и я уже забыл, как звали того, кого выбрали, – он оказался полным разочарованием). Поскольку я решил в первый год не записываться на экономику, я редко общался с аспирантами-экономистами и с Карлом познакомился, наверное, только к концу второго года. Он привел меня в Серра-Хаус, где аспиранты Узавы работали все вместе, и мы знали проблемы друг друга и поэтому могли легко общаться. Но вообще-то никто из нас не писал работы совместно. Мы с Карлом стали писать вместе намного позже, в начале 1970-х, но опять-таки Карл знал мою диссертацию, а я знал диссертацию Карла, и то, как она готовилась, поэтому вопрос о том, кто и какой вклад сделал, будучи еще аспирантом у Узавы, всегда оставался открытым.

**MD:** А что заставило вас выбрать такую тему диссертации?

**Касс:** Оптимальный рост? В основном, увлечение Узавы принципом максимума.

**MD:** Какую теорию роста вы знали до этого?

**Касс:** В тот период было принято проводить грань между тем, чем мы хотели заниматься – оптимальным или запланированным ростом, – и описательной теорией экономи-

ческого роста а-ля Солоу. Он потратил тонну бумаги с тех пор, когда начал с весьма известной односекторной модели, а затем перешел к многочисленным работам, посвященным моделям конкурентного роста, – моделям, в которых было больше товаров, и, возможно, какая-то особая технология. Он все время повторял, как нужно описывать конкурентное равновесие и его эффективность (то, что Маленво проделал намного элегантнее в своей заслуженно знаменитой работе «Эконометрика»). Так что это описательная теория роста. Затем была известная всем работа Рамсея, и Узава очень увлекся двухсекторными вариантами неоклассической модели экономического роста. Он написал на эту тему несколько работ. Потом решил заняться теорией оптимального роста и написал работу, посвященную в основном двухсекторной модели с линейной функцией цели. Он практически заново создал математический анализ отклонений (это человек с весьма оригинальным мышлением) и затем открыл для себя принцип максимума и очень им увлекся. Узава также вел семинар по истории экономической мысли, и на этом семинаре он углубился в прошлое, взял оттуда все великие имена в экономике, начиная от Рикардо, Маркса, и... представил то, чем они занимались, в качестве модели роста. Работа Узавы оказала на меня большое влияние. О Рамсее я тогда и не слышал.

**MD:** Это любопытно, поскольку о Рамсее иногда говорят как о «скрытом» классике. А другие тоже не слышали о Рам-

сее? А Узава?

**Касс:** Нет, не думаю – я услышал о Рамсее не раньше, чем написал первую главу своей диссертации по оптимальному росту. И тогда я, честно говоря, пришел в некоторое замешательство.

**МД:** Как вы открыли для себя Рамсея?

**Касс:** Теперь уже не помню. Возможно, кто-то о нем упомянул. Возможно, Узава знал о нем, но на самом деле нет – он считал меня первопроходцем. В каком-то смысле это совершенно не так. Действительно, я испытывал, как правило, некоторую неловкость, поскольку эта работа всегда цитируется, хотя я думаю о ней как об упражнении, практически воссоздающем модель Рамсея и делающем по сравнению с ней лишь небольшой шаг вперед.

**МД:** У Рамсея не было дисконтирования, а у вас оно было. Это одно из отличий, не так ли?

**Касс:** У Рамсея дисконтирования не было. Он много говорил о корректности функции социального благосостояния с моральной точки зрения. Тьяллинг Купманс тоже придавал ей большое значение, когда писал подобную работу. Без дисконтирования подходить к этим проблемам оказывается гораздо сложнее, поскольку даже если требуется найти функцию для функционала, эта функция может оказаться бесконечнозначной, и вам придется использовать какой-нибудь особый прием, чтобы ее интерпретировать. Чтобы получить однозначно определенную функцию, нужно понять разни-

цу между полезностью потребления и полезностью потребления, соответствующего «золотому правилу». Очень интересно, между прочим, что проблема Рамсея – это обратный пример того, как обычно поступают сегодня. Думаю, что в макроэкономических исследованиях делают именно так, даже не задумываясь об этом – когда применяют динамическую оптимизацию, а также выполняются условия трансверсальности, о чем я тоже писал в своей диссертации, и это совершенно неправильно. Проблема Рамсея – контрпример этого подхода. У вас есть оптимум, но он не удовлетворяет условию трансверсальности.

**МД:** Это касается моделей, в которых не используется дисконтирование?

**Касс:** Да, это характерно для моделей без дисконтирования. Это имеет отношение к тому условию в теории капитала, которое называется отсутствием стесненности и при котором становится необходимой трансверсальность. По сути именно этот фактор дает вам возможность использовать теорему о разделяющей гиперплоскости. Ну, вот, я уже и забыл, о чем вы спрашивали!

**МД:** Как вы пришли к проблемам оптимального роста?

**Касс:** Вообще-то, хотя Узава всегда возвращался к истокам, читал литературу и всегда черпал в ней вдохновение, этого я у него совсем не перенял. Я просто решил поработать над этой тематикой, поскольку эти подходы были новыми и перспективными и поэтому казались интересными.

Принцип максимума, кое-какие дифференциальные уравнения и прочее я решил освоить самостоятельно – разговаривая с людьми, наблюдая за работой Узавы, и, главным образом, читая книжки по математике. В то время нашей библиотекой была оригинальная книга Понтрягина о принципе максимума. Это тоже весьма интересно, потому что в этой книге очень много геометрии, а Понтрягин был слепым.

**МД:** Она была на русском? Тогда у вас было неоспоримое преимущество.

**Касс:** На русском я мог прочесть немного, но ее перевели. Как бы то ни было, он был слепым, и все же его способ мышления было чисто геометрическим; он как бы рисует то, о чем пишет. И вот я просто объединил подходы этих двоих. Узава решил, что это потрясающе. Не знаю, почему – наверное потому, что над этой проблемой работал Тьяллинг Купманс, а он был для Узавы чем-то вроде кумира. Вообще-то Узава нравилось обходить других. Как-то он обсуждал с Купмансом эту проблему, и Купманс рассказывал о своих исследованиях, Узава прервал его и сказал: «А у меня есть аспирант, который эту проблему решил». Купманс тогда очень разволновался. Он всегда нервничал по поводу авторства, первенства и тому подобного, и у нас с ним была переписка. Купманс также очень интересовался вариантами без дисконтирования и решил в некотором смысле намного более сложную проблему помимо того, что решил проблему и с применением дисконтирования. Купманс проделал ана-

лиз от начала и до конца – делая расчеты для всех условий.

**MD:** Потом вы стали искать себе работу.

**Касс:** Расскажу вам в этой связи историю, дающую представление об особенностях характера Узава. Первоначально он хотел, чтобы после защиты диссертации я работал в университете Пердью, где был очень хороший факультет, но потом он узнал от Купманса, что Фонд Коулза нанимает людей. Узава решил, что работа в Фонде лучше. Но его представление о том, как нужно помогать аспиранту с трудоустройством, было своеобразным: он считал, что иметь сразу два предложения аморально. Поэтому зимой я отправился в Бостон, имея в своем активе только интервью в Фонде Коулза и пару других, о которых я договорился сам, и которые оказались ужасными. Большую часть времени я провел в гостиничном номере, где смотрел футбол, а жил я в одном номере с Карлом, который прошел сотни собеседований! Настал последний день прохождения интервью, и все зависело от того, чем закончится мое знакомство с Фондом Коулза, которое состоялось во время обеда с участием Купманса, Герба Скарфа и не помню кого еще, вероятнее всего, Джима Тобина. Я немного рассказал о своей диссертации, но Купманс уже о ней знал и решил спросить меня, над чем я буду работать через десять лет. Как и любой аспирант, я не думал даже о том, что будет через два месяца. И уж тем более понятия не имел, над чем буду работать в будущем!

По какой-то причине они не смогли взять меня в штат,

как обещал вначале Купманс. Он предложил мне поработать в Фонде Коулза научным сотрудником один год, с тем чтобы этот срок был затем продлен, и я стал не только научным сотрудником, но и доцентом. Вы не поверите, какая в те дни была зарплата, даже с учетом инфляции. Моя зарплата, когда я начинал, составляла 8000 долларов в год.

**МД:** Расскажите нам о Йеле.

**Касс:** В Йеле была замечательная аспирантура. В то время у Фонда Коулза было много денег и стремление привлечь большое количество младших преподавателей. Мы размещались в отдельном здании, в небольшом домике. Такие люди, как, в частности, Тобин, нас реально поддерживали. Я вспоминаю о своих днях в Йеле с большим удовольствием. Первое время я много общался с Недом Фелпсом. Потом, конечно, познакомился с Мэнни Яари – мы говорили с ним о многих вещах и, в конце концов, написали работы, основанные только на этих обсуждениях. Именно так появилась статья о потребительском кредите.

**МД:** Тогда вы и занялись моделями перекрывающихся поколений?

**Касс:** Да, мы занимались ими вместе с Мэнни.

**МД:** Многих ли тогда, в 1960-е гг., интересовали модели перекрывающихся поколений? Можно предположить, что нет, поскольку опубликованная в 1950-х работа Самуэльсона долго не привлекала к себе особого внимания.

**Касс:** Да, она долго не вызывала отклика. Работу Касса и

Яри много цитировали, и, думаю, в основном потому, что она возродила интерес к модели перекрывающихся поколений. Я не придаю этой работе особого значения, поскольку мы столкнулись с большими проблемами. Не хочу, чтобы мои слова потом цитировались, но, по-моему, немного в ней выдержит проверку временем.

**MD:** Так вы с Яри обсуждали разные проблемы, а потом заговорили о перекрывающихся поколениях. Говорили ли вы о них ранее с Карлом?

**Касс:** Нет, не думаю. Как мне помнится, я впервые задумался о них в первый год своей работы в Фонде Коулза.

В продолжение темы Коулза следует сказать, что на второй и третий год моего пребывания там пришло большое пополнение из Массачусетского технологического института: Джо Стиглиц, Марти Вейцман, Билл Нордхаус и другие. Обстановка стала просто замечательной. У нас с Джо Стиглицем был общий кабинет. Я, наверное, никогда бы не познакомился с Джо и не стал бы воспринимать его всерьез, поскольку он все делает быстро и неаккуратно. Но мы сидели вместе, и я наблюдал, как утром Джо приходил, садился и говорил: «Сегодня я напишу статью». Он садился за свою пишущую машинку и писал статью. Меня это неизменно поражало, поскольку я работал медленно. И вот у меня вошло в привычку – когда Джо говорил, что сегодня напишет о чем-нибудь статью, – заводить о ней разговор. Он приходил с какой-нибудь идеей, и я его спрашивал: «А откуда ты

знаешь, что это так?» Вообще-то мы и написали с ним множество работ потому, что я задавал ему этот вопрос. Одна из них по-прежнему часто цитируется. Это работа о выборе портфеля – а именно, как свести этот выбор к тому, чтобы выбирать только между двумя активами. Думаю, эта работа была сложной, и мы получили действительно серьезные результаты, но в ней просто обосновывалось упрощение. Оказывается, чтобы доказать необходимость упрощения выбора, необходимо было обязательно исходить из допущений о предпочтениях.

В общем, в Фонде Коулза все было необычно, все настраивало на работу. Почти каждый делился своей идеей с другим. Никто не пытался их скрыть. Все идеи обсуждались.

**МД:** Яри к вам наведывался?

**Касс:** Нет, в Коулзе он получил свою первую работу. Его назначили, насколько я помню, доцентом, но временно, как это обычно и делалось. Я тоже, пока там находился, был доцентом. Затем пришла пора подумать о постоянной работе, и он должен был решить, вернуться в Иерусалимский университет Израиля или остаться в Фонде Коулза. Вообще-то, на мой взгляд, Йельский университет принял несколько очень глупых кадровых решений. Отчасти это было связано с тем, что университет хотел постоянно готовить младших преподавателей; они не хотели, чтобы у них было много старших преподавателей. Поэтому они и отвергли Мэнни. Другая серьезная ошибка – отклонение кандидатуры Неда Фелпса. А

ведь у него такой творческий ум! Как и у Яари. К ним обоим я испытываю колоссальную симпатию и уважение. А им наотрез отказали.

Если хотите, и я был одним из тех молодых людей, оставлять которых у себя университет не собирался. Не думаю, что они всерьез хотели взять меня в штат, и честно говоря, когда я смог на это претендовать, у меня было маловато публикаций, возможно, всего пять или шесть. Помню, я искал работу и отправился в Университет Джонса Хопкинса, где декан факультета сказал мне, что они не могут всерьез рассматривать мою кандидатуру, поскольку у меня недостаточно публикаций. Но Ричард Сайерт еще за несколько лет до этого по какой-то причине решил, что хочет видеть меня в Университете Карнеги-Меллона. Поначалу я считал (возможно, вы не захотите оставлять это в записи), что этот университет – серьезное место, но потом обнаружил, что статьи там обычно пишут так: просто применяют теорему Куна-Такера к решению какой-нибудь проблемы. Меня такая перспектива не устраивала. Но потом я приехал в Карнеги и познакомился кое с кем из младших преподавателей. Я очень хорошо знал Роберта Лукаса, и это послужило для меня сильной приманкой.

**МД:** Как вы познакомились с Лукасом?

**Касс:** Ну, Боб был в Чикагском университете, наверное, просто его заканчивал, когда Узава перевелся туда из Стэнфорда. Боб никогда не работал с Узавой, но работа Боба, по-

видимому, тоже не вызывала там большого интереса у других преподавателей, так как он хотел заниматься примерно тем же, что и Узава. Поэтому он стал чем-то вроде протеже Узавы. Я не хотел бы преувеличивать значение этого эпизода, но помню, как впервые получил возможность оценить интеллект Боба. Он дал мне какую-то задачу, связанную с динамической моделью «затраты – выпуск», – насколько мне помнится, что-то насчет отраслевой структуры, вхождения в отрасль фирм, а также их ухода с рынка. Как бы то ни было, я познакомился с Лукасом, потому что Узава наблюдал за работой свои аспирантов и обычно проводил конференции, пока был в Чикаго, где он также создал группу аспирантов. Лукас присутствовал на одной из первых конференций, на которую я поехал, – так я с ним и познакомился. Он был очень умен, очень серьезен, мы прекрасно ладили, и поэтому он стал одной из приманок, побудивших меня перебраться в Карнеги-Меллон. Я знал, что он был не тот человек, чтобы просто применять условия Куна-Такера, и он явно не соответствовал тому стереотипу, который у меня сложился.

И вот я отправился в Карнеги на разведку и познакомился там с другими людьми. Очень интересным человеком оказался, например, Лен Рэппинг. Сначала он был стойким приверженцем ориентированной на рынок чикагской школы, затем, в период войны во Вьетнаме, полностью поменял свои взгляды, но все равно оставался очень интересным и умным парнем. Другим, кого я помню и кто действительно произвел

на меня впечатление, был Герберт Саймон – действительно интересный и творческий человек. Тогда я сказал себе: «Твой стереотип ошибочен, и отправиться туда будет очень интересно». Когда я приехал в Карнеги, это было очень хорошее место и вовсе не школа бизнеса; у них была программа MBA, но не традиционная школа бизнеса.

**MD:** Это было году в семидесятом?

**Касс:** Да, именно в 1970 г. Преподавателей было мало и сравнительно мало желавших получить степень MBA. Мы учили их так же, как учили аспирантов. И в те времена, в отличие от нынешних, они поступали, и считалось, что они будут справляться, а не предъявлять претензии, что материал слишком сложен или не имеет отношения к бизнесу. Карнеги стал первым университетом, в котором ввели количественные методы, и особенно в экономике, как общую основу, используемую во многих сферах бизнеса. Яркий тому пример – превращение в нечто серьезное курса по финансам. Специалистам по финансам это не понравится, но скажу, что изучение этой дисциплины сводится, в сущности, к изучению экономических методов, и впервые это стали применять в Карнеги, и именно благодаря особенностям организации преподавательского процесса. Если возникала необходимость прочитать какой-нибудь курс, это просто кому-нибудь поручали. Мертону Миллеру и Франко Модильяни поручили читать курс финансов, и так они вдвоем его и читали. Когда что-то ставило их в тупик, они применяли эконо-

мическую методологию.

В Карнеги все действительно было замечательно. Программа MBA использовалась и для поиска талантливых аспирантов. Преподавать будущим выпускникам MBA было приятно, потому что их можно было учить серьезным вещам. Вам не нужно было дозировать информацию, поскольку предполагалось, что они будут изучать программирование, серьезную экономику, серьезную эконометрику и т. д. Другая особенность Карнеги заключалась в том, что там была очень хорошая система стимулирования сотрудничества между преподавателями, благодаря которой у них оставалось время на проведение исследований. Как и в Фонде Коулза, там действительно было все продумано – преподавательская нагрузка, вознаграждение за работу в летнее время, оплата транспортных и некоторых других расходов до тех пор, пока вы не становились таким признанным специалистом, что могли зарабатывать и в других университетах. Поэтому я не испытываю ничего, кроме уважения, к Университету Карнеги-Меллона, к Высшей школе промышленного администрирования (GSIA) при этом университете, а также к команде, возглавляемой Ричардом Сайертом. К Дику я испытываю колоссальное уважение.

**MD:** Над чем вы работали в те дни?

**Касс:** Сайерту я благодарен в том числе и за то, что он, в сущности, оплатил мне годовой отпуск, выпавший на период между моим пребыванием в Фонде Коулза и в Университете

Карнеги-Меллона, и я провел этот год в Токио, где написал несколько работ. Одна мне понравилась больше, чем остальные. Думаю, это одна из моих лучших работ, хотя, полагаю, и не самая читаемая. В ней решается следующая проблема: в неоклассической модели роста, если использовать в качестве критерия потребление, можно получить такие конкурентные равновесия, которые будут неоптимальными, неэффективными. В принципе вы можете получить перенакопление капитала. Лучший тому пример был придуман Недом Фелпсом: если посмотреть на ту же неоклассическую модель, а также обратить внимание на устойчивое состояние, которое находится выше траектории «золотого правила», то можно отойти от этого устойчивого состояния немного назад к уровню капитала, соответствующего «золотому правилу», получить прирост потребления и всегда после этого иметь более высокое потребление. Более высокая точка все равно будет означать конкурентные цены, просто они не будут ценами эффективности. Посмотрев на эти альтернативные траектории, вы можете исключить те из них, которые неэффективны при условии трансверсальности. Поэтому условие трансверсальности – условие, достаточное для того, чтобы исключать перенакопление капитала.



**Рис. 2.2.** Конференция в Университете Карнеги-Меллона в честь Ричарда Сайерта, 11 сентября 1993 г. Слева направо: Дэвид Касс, Роберт Лукас, Алан Мельтцер, Эдвард Прескотт и Тимоти Магуайр

Для меня было крайне интересно выяснить, какое условие является достаточным, а какое – необходимым? Трансверсальность – это условие, достаточное для эффективности, но не являющееся необходимым. Сама траектория «золотого правила» – это, как я сказал ранее, контрпример. Траектория «золотого правила» эффективна, а при каком-то критерии и парето-оптимальна, но здесь условие трансверсальности не выполняется, поскольку процентная ставка однозначно равна нулю. Мы с Мэнни Яари начали работать над этой

проблемой за два года до этого и получили одно решение в виде условия, которое было не так легко интерпретировать. Теперь я знаю, почему мне не понравилось это условие. Я хотел получить такое условие для траектории цены, которое было бы и необходимым, и достаточным, поэтому в Японии я работал над этим целый год и получил полное решение. Мне действительно нравится эта работа.

Итак, я провел год в Японии, работая над этой проблемой, а написал пару статей о том, о чем хотел написать. Одна из них была вполне в духе Солоу. Я взял модель Викселля, точечную модель «затраты – выпуск» и проанализировал конкурентное равновесие. Эта работа мне тоже нравится, но она очень специальная. Сомневаюсь, что ее вообще кто-то читал. В том году мы с Джо закончили нашу работу, посвященную выбору портфеля. Главным камнем преткновения для нас стало то, что в этой работе надо было выполнить расчеты в конкретных параметрических формах, а ни Джо, ни я не любили этим заниматься или не были настолько старательными, чтобы иметь дело с параметрическими формами. Поэтому нам с огромным трудом удалось договориться, как правильно записать эти примеры, чтобы проиллюстрировать нашу теорему. В окончательный вариант этой работы все равно вкрались алгебраические ошибки; почему-то никто из нас не потрудился ее вычитать.

Затем я какое-то время, образно говоря, сидел на берегу с удочкой. Я больше работал над теорией роста. Я заин-

тересовался общей проблемой устойчивости конкурентных динамических систем, которая тогда была очень немодной, поскольку завершалась эпоха неоклассического роста. Мы с Карлом написали на эту тему статью, которая мне очень нравится, хотя даже тогда она, возможно, уже была немного архаичной.

**MD:** Когда вы впервые стали работать с Карлом Шеллом?

**Касс:** В то время мы с Карлом написали действительно первую совместную работу. Карл тогда был в Пенсильванском университете. Как бы то ни было, вернувшись в Карнеги, я написал несколько небольших работ – в частности, по гамильтоновскому подходу к эффективному производству и по дуализму; однако крупных работ не было. Наверное, именно в Карнеги я начал общаться с программистами и делать вещи, связанные с программированием. С кем я действительно много разговаривал (помню его очень хорошо, он умер несколько лет назад), так это с Робертом Джерослоу, программистом и специалистом по математической логике. Он был исключительно умен. Тогда все носились с интегральным программированием, поиском алгоритмов, которые позволили бы решать проблемы интегрального программирования. Алгоритмов было много, но никто не понимал, почему они работают, а Бобу действительно удавалось придумать для любого алгоритма такой контрпример, который всегда являлся несходящимся. Мы часто с ним разговаривали. У него появился интерес к экономике, а я снова за-

интересовался программированием и написал по нему ряд работ.

После этого мы с Карлом стали писать работу по устойчивости, на которую ушло несколько лет. Затем в какой-то момент (не знаю даже, как рассказать об этом) декан Сайерт стал ректором, и нам нужно было пригласить нового декана. В Карнеги в этом процессе активно участвовал весь преподавательский состав, и мы много спорили, кто именно нам нужен. По какой-то причине мы остановились на Арни Вебере, специалисте по экономике труда из Чикагской школы бизнеса. Это оказалось и для университета, и для меня настоящей катастрофой, поскольку он не имел ни малейшего понятия о традициях Карнеги. Он не понимал, что в Карнеги любили математику, и, в том числе, математику в экономике, а это означало, что вокруг должно быть много экономистов. Доказательством этого может служить тот факт, что вскоре после своего назначения он вызвал меня к себе кабинет под каким-то предлогом, и у нас состоялась беседа. Он сказал, что я – предмет роскоши и занимаюсь совсем не тем, чем нужно. Действительно, моих исследований по экономической теории бизнес-школа, наверное, не могла себе позволить. Но он высказался в такой оскорбительной манере, что я просто вышел из себя. Я ответил ему: «Да пошел ты... Арни!»

**МД:** Так и сказали?

**Касс:** Да, буквально так и сказал и решил, что, раз я ра-

ботаю с Карлом, возможно, имеет смысл перебраться в Пенсильванский университет, хотя у меня и были некоторые опасения, поскольку я знал, что там очень увлекаются эконометрическими моделями. Однако они сделали мне хорошее предложение, и я не смог отказаться.

**МД:** Не могли бы мы подробнее поговорить о ваших годах в Карнеги?

**Касс:** Да, конечно.

**МД:** Одним из самых способных аспирантов, с которыми вы работали, был Финн Кидланд?

**Касс:** Да-да, Финн Кидланд. Я входил в состав диссертационного совета, когда он защищался, и много работал с ним над несколькими разделами его диссертации. Его диссертация была вся посвящена программированию. Другим таким аспирантом был Уильям Барнетт. Не помню, состоял ли я официально в совете по его защите. Помню, что мы много разговаривали, но, возможно, он ушел еще до того, как закончил аспирантуру. В основном я работал с теми, кто поступил в мой первый год в Карнеги, например, с Джоном Дональдсоном и Робертом Форсайтом. Они особенно мне запомнились.

**МД:** Работа Кидланда и Эда Прескотта положила начало разработке теории реального экономического цикла, а основная модель этой теории – модель Касса-Купманса. Говорили ли вы с Финном когда-нибудь о теории роста?

**Касс:** Нет, как я уже сказал, Финн в период аспирантуры

занимался программированием.

**MD:** Давайте поговорим теперь об использовании Лукасом модели перекрывающихся поколений.

**Касс:** Скажу вам, что эта статья в *Journal of Economic Theory*, о которой мы говорим, очень любопытна. Меня не особенно интересовала макроэкономика, но что меня поразило, и это относится также к одной моей более поздней работе, так это сделанное Лукасом для нахождения равновесия допущение, что переменные состояния очевидны (собственно, тогда мне впервые и пришла в голову идея солнечных пятен). Мы с ним вели длинные дискуссии, и я спрашивал: «Боб, а почему в этой модели это и есть фактическое пространство состояний?». Этот вопрос всплыл (сейчас я забегаю вперед) уже после того, как я перебрался в Пенсильванский университет. В какой-то момент мы с Карлом начали его обсуждать и разработали то, что мы затем назвали идеей солнечных пятен. Но для меня первоначальным толчком послужили разговоры с Лукасом.

**MD:** Также в работе Лукаса впервые в экономике были применены сжимающие отображения.

**Касс:** Да, Бобу нравилось использовать сжимающие отображения для получения фиксированных точек. Думаю, он мог всегда использовать этот метод. Возможно, он даже не знает теорему Брауэра! Нет, на самом деле он ее знает. Просто ему нравятся сжимающие отображения. Как бы то ни было, теория капитала, как я ее понимал, гласила, что, исполь-

зую пространство фундаментальных состояний, можно работать с неопределенностью, равно как и со временем. Поэтому индекс товара мог показывать время, неопределенность и всевозможные характеристики товара, например, местонахождение. Но теория роста гласила, что равновесие – это просто цены, зависящие от пространства базовых состояний. Боб пошел дальше, и решил (не знаю даже, как лучше сказать), что оно больше похоже на функцию от переменных базовых состояний или, если сформулировать точнее, пространство состояний само генерируется каким-то базовым процессом через наблюдаемые переменные. Таким образом, само пространство состояний может быть, например, деньгами и какими-то случайными экономическими шоками. Деньги – одна из переменных состояний, хотя на самом деле они определяются базовым пространством состояний. Состояния мира описываются деньгами и случайными переменными, связанными с экономическим шоками, которые характерны для отдельных территорий.

Главный вопрос – что такое пространство состояний?

**MD:** Другой фундаментальной работой была работа Брока и Мирмана.

**Касс:** Работа Брока и Мирмана стала своего рода вехой, поскольку они попытались ввести в неоклассическую модель неопределенность. Где я познакомился с Баззом Броком? Базз был аспирантом в Университете Беркли, и его диссертация, кажется, была посвящена оптимальному росту в много-

секторной модели. Наверное, тогда я с ним и познакомился. Наши пути пересекались еще не раз, например, когда позже в течение года я работал в Калифорнийском технологическом институте, Базз тоже был там какое-то время. Мы немного общались, когда Брок работал над теорией роста, а потом наши пути просто как-то разошлись. Он по-прежнему очень активен. Просто я не очень следил за его исследованиями.

**MD:** Когда вы работали в Университете Карнеги-Меллона, Лукас и Прескотт приступили к новой макроэкономической работе. Насколько это было интересно для вас?

**Касс:** На самом деле я за этой работой не следил.

**MD:** Вы считаете, эта работа была больше микроэкономической?

**Касс:** Она явно была микроэкономической, хоть и называлась макроэкономической, и, знаете, по какой-то причине я никогда особенно не обсуждал ее с Бобом. Не знаю почему. У нас были прекрасные личные отношения, но отчего-то мы о ней почти не говорили. Мы по-разному подходили ко многим проблемам, поэтому редко обсуждали работу, разве что когда отпраивлялись вместе обедать, но вряд ли это можно назвать научной дискуссией. Наверное, все дело было в том, что Боб принадлежал к Чикагской школе и придавал большое значение эмпирической проверке, что бы под этим ни подразумевалось, то есть тому, что, честно говоря, не вызвало у меня ни малейшей симпатии и интереса. Поэтому у нас были различные точки зрения на то, зачем люди зани-

маются теорией и каково ее значение, и я все еще придерживаюсь мнения, что теория – это в большей мере способ организации ваших мыслей, того, как вы думаете о мире. Наиболее надежны теории тогда, когда следует привести контрпримеры, опровергающие какие-либо излишне самонадеянные утверждения. Когда вам удастся построить модель, которая доказывает отсутствие какого-либо явления, именно тогда [*неодобрительно смеивается*]... Никто не может сколько-нибудь уверенно утверждать, что какое-то предположение верно. И это подводит нас к вопросу о том, когда утверждение истинно, а когда нет, если вы хотите выразить его количественно. Вы можете предлагать идею, оставаясь на качественном уровне, – как, например, в случае с кривой Лаффера. Построенные вами модели, которые, однако, будут давать совершенно разные результаты, сделают эти смелые предположения более чем сомнительными. Не знаю, как выглядят цифровые данные. Вероятно, большинство регрессий очень разнородны: если вы возьмете какие-либо данные, подгоните под них какую-нибудь кривую и потом заявите, что обобщили данные с помощью этой кривой, то ваше утверждение будет сомнительным.

**MD:** Наверное, сейчас самое время спросить, что вы думаете о так называемой калибровке теоретических моделей, пропагандируемой в последние лет десять Прескоттом и другими.

**Касс:** Основная проблема, связанная с калибровкой, на

мой взгляд, заключается в уровне абстракции модели, к которой применяется калибровка. Я имею в виду, если вы калибруете что-то, например, по сути напоминающее неоклассическую модель, то лично мне совершенно непонятно, что это может означать. Когда я об этом думал (а я, честно говоря, не продумывал это в деталях), то понятие калибровки в целом и наличие, как вы говорите, модели, хорошо подогнанной к фактическим данным, показались мне довольно неопределенными. Например, чтобы сказать, что благодаря калибровке генерируются для определенных значений параметра временные ряды с теми же свойствами, которые присущи и наблюдаемым временным рядам, думаю, что сначала нужно договориться о том, что это означает, когда два временных ряда близки друг к другу. Когда я обратил внимание на существующие работы по экономическому циклу, мне показалось довольно неясным, что именно подлежит калибровке и что такое хорошая модель. Возможно, я несправедлив к сторонникам теории реального экономического цикла, поскольку в этой области работают действительно талантливые исследователи, которые, наверное, уже уточнили идею калибровки и ушли от простых расчетов, связанных с первоначальной неоклассической моделью роста. Но, видимо, ушли не очень далеко, поскольку мы все еще имеем дело с агрегированными временными рядами. Мой ученик Джон Дональдсон, который работает в этой области, очень хороший специалист, и я его очень уважаю.

Проблема с теорией реального экономического цикла заключается, как я полагаю, в том, что сегодня она превратилась чуть ли не в религию. Мы обсуждали эту тему с Виктором [Риос-Рулем], которого я очень уважаю, и он считает – и практически в этом убежден – что это единственный способ смотреть на мир, смотреть на экономику. А когда кто-нибудь говорит мне, что существует один-единственный способ чего-либо, я всегда воспринимаю это скептически. Я не верю, что применение теории общего равновесия – единственный способ смотреть на мир. Думаю, меня многому научила теория игр, научила концентрироваться на стратегических идеях и учитывать значение стратегии и несовершенство информации.

**MD:** Разве теория общего равновесия не требует того же?

**Касс:** Вполне возможно, но есть и другие способы работы с несовершенной информацией, и все они важны. Но я также думаю, что модель общего равновесия сама по себе имеет значение, что она по-прежнему важный эталон, и что с помощью этой теории можно еще многое сделать.

**MD:** В этом вы сходитесь с Прескоттом.

**Касс:** Да, совершенно верно. Но, возможно, Прескотт занимает более крайнюю позицию. Я очень многому научился, преподавая в Пенсильванском университете, где работали хорошие специалисты по теории игр. Действительно, я многому научился и вполне мог бы читать курс теории игр – только потому, что работал в Пенсильванском университете.

те – и для этого не обязательно даже было читать какие-то статьи.

**МД:** Давайте поговорим о тех годах в Пенсильванском университете, которые связаны с моделями перекрывающихся поколений.

**Касс:** Если память мне не изменяет, мы с Карлом Шеллом снова стали обдумывать модель перекрывающихся поколений где-то в середине или конце 1970-х. Если нужно сказать точнее, то я бы назвал 1977 г. Расскажу, с чего все началось, насколько я помню. У нас с Карлом состоялась дискуссия, поскольку здесь проходил семинар, который вели младшие преподаватели, и мы в нем также участвовали. Нам пришлось вернуться к истокам и прочесть кое-какие классические работы по макроэкономике, которые люди хотели обсудить. Одной из таких работ была работа Лукаса 1972 г. Не помню, почему один из нас решил ее представить, но она заставила меня снова задуматься над тем, о чем я спрашивал Боба, – а именно о пространстве состояний, и мы с Карлом обсудили эту проблему. Карл сообразил, что мы можем формализовать идею о том, чтобы иметь в пространстве состояний произвольные переменные. Так Карл разработал первый пример равновесия солнечных пятен, думаю, именно тот, который он впоследствии использовал в своей так называемой лекции Маленво. Это линейная модель перекрывающихся поколений (OLG), в которой от солнечных пятен зависит распределение ресурсов домохозяйств, но не их благо-

состояние, и я раскритиковал этот пример. Я сказал: «Карл, этот пример неубедителен. С точки зрения благосостояния он значения не имеет».



**Рис. 2.3.** Капустник на экономическом факультете Пенсильванского университета, во время которого преподаватели и аспиранты исполняли пародии друг на друга. Касс выступает в сопровождении оркестра Рэнди Уайта, 3 марта 1998 г. Слева направо: Рэнди Райт, Дэвид Касс, Андрей Шевченко (аспирант-экономист), Гвен Юди (Университет Джорджтауна) и Боен Йованович (за фортепьяно)

Мы собирались на конференцию по теории роста, которую мы с Карлом организовали в Сквом-Лейк (штат Нью-Гемпшир). И после этого спора я почти все время, пока проходила конференция, провел у себя в номере, пытаюсь разработать пример равновесия солнечных пятен в модели перекрывающихся поколений, при которой солнечные пятна действительно влияли бы на распределение ресурсов. Первым примером, который я подготовил, был пример с квадратичной функцией полезности. Он был таким сложным! Мы с Карлом рассказали о нем на конференции, но нашу идею никто не понял. Никто ничего не понимал до последнего дня, пока мы действительно не представили нашу работу, и тогда единственным, кто понял, что мы имеем в виду, был Стив Сэллоп. Мы были обескуражены.

**МД:** Речь шла об оптимизации в модели перекрывающихся поколений?

**Касс:** Да, это была модель перекрывающихся поколений, но в этой модели (как может подтвердить Стивен Спир, поскольку его диссертация была как раз об этом) вы должны очень осторожно выбирать свою функцию полезности. Помню, я решил, что не смогу получить равновесие солнечных пятен для стандартных параметрических форм, и мне понадобятся кросс-продуктовые параметры, поэтому... как бы то ни было, мы с Карлом вернулись к нашей идее и знали, что она очень перспективна. Реакция на нее со стороны наших коллег несколько обескуражила нас, поэтому к работе

над ней мы приступили далеко не сразу. Энтузиазм Карла был колоссальным – он много об этой идее говорил. В конце 1970-х он отправился в Париж, где прочитал свою лекцию Маленво, на которую всегда ссылается, поскольку хочет, и совершенно справедливо, чтобы мы отстояли свой приоритет.

Среди тех, с кем он часто обсуждал эту тему, был Костас Азариадис. Думаю, что Карл неоднократно объяснял Костасу свою идею, и тот в конце концов ею заинтересовался и написал на эту тему работу. Он понял, что, используя не подход, основанный на полезности, а систему вероятностей Маркова первого порядка, можно получить равновесие солнечных пятен. Вообще-то эту мысль в целом развивает в своей диссертации Стив, решив проблему задолго до того, как это сделали, например, Азариадис и Геснери. Но кое за что я все же должен Костаса поблагодарить. Когда он написал свою работу или, возможно, еще до этого, мы поняли, что если собираемся развивать эту идею, то пора уже этим заняться.

**MD:** И это привело к появлению статьи в *Journal of Political Economy*?

**Касс:** В статье в *JPE* был описан простой стандартный пример, не требовавший использования схемы перекрывающихся поколений, хотя мы и основывались на одном из свойств модели перекрывающихся поколений – расхождении в результате ограничения участия на некоторых рынках.

Гораздо позже мы написали работу, показывающую, что есть еще один аспект модели перекрывающихся поколений – каким-то образом в ней играет роль бесконечность времени. Мы разработали пример с полными рынками и неограниченным участием – попробую сейчас его описать. В принципе это была модель перекрывающихся поколений, где вся неопределенность существует только в первом периоде, вы получаете либо альфу, либо бету и можете купить страховку на любой случай, но из-за бесконечности модели вы все равно получите равновесие солнечных пятен. Поэтому можно сказать, что существуют две причины равновесия солнечных пятен: одна из них имеет отношение к временной структуре перекрывающихся поколений, а другая – к недостаточному доступу к рынкам активов.

**MD:** Кажется, Джим Пек исследовал вторую причину в своей диссертации?

**Касс:** Да, верно. Я довольно долго не очень задумывался о солнечных пятнах, особенно в модели перекрывающихся поколений, но он делает обобщение относительно нестационарных равновесий солнечных пятен в модели OLG. Думаю, солнечные пятна действительно интересны, но даже когда мы с Карлом написали статью для *JPE*, мой интерес изменился. И я стал обдумывать проблему общего равновесия, в которой вы можете создать модель конечной размерности. Конечно, у нас есть простая, но очень важная теорема, которая гласит, что если имеются все необходимые условия пер-

вой теоремы благосостояния, то невозможно получить солнечные пятна. Затем мы используем то, что Карл обычно называл теоремой филладельфийского фолка – она заключается в том, что если вы нарушите любое из этих условий, то можете получить равновесие солнечных пятен. Это не совсем верно, поскольку она говорит только о том случае, когда у вас есть теорема, в которой  $A$ ,  $B$  и  $C$  предполагают  $D$ , и если вы откажетесь от одного из этих допущений, то скорее всего вывод будет неверным. Но, конечно, может быть и так, что вывод в любом варианте будет верным. Полагаю, что именно здесь мнения мое и Карла несколько расходятся, но он очень заинтересовался отсутствием выпуклости. Его примеры разработаны верно. Но не вполне правомерно заявлять, что если имеется какая-либо невыпуклость, это означает наличие солнечных пятен, поскольку (как указали Гераклес Полемарчакис и я) невыпуклость может наблюдаться в производстве. И, так как максимизация прибыли соотносится с гиперплоскостью, вы можете заменить все значения под гиперплоскостью и назвать это множеством производственных возможностей, и вы снова получите первую теорему благосостояния.

Пример в *JPE* – реальный простой пример, в котором есть два состояния мира, и мы в рамках модели перекрывающихся поколений рассматриваем два класса домохозяйств. В ответ на изменившиеся условия в мире один класс может продать активы, а другой не может, поскольку родился позже и

поэтому обязан торговать только на рынке реального товара. Это один пример. Но мне захотелось придумать и другие примеры равновесия солнечных пятен. В частности, в начале 1980-х я отправился на год в Париж, и первое, чем я решил заняться, – это придумать другие примеры равновесия солнечных пятен в условиях отсутствующего рынка. Почему-то я решил, что это можно сделать с помощью модели, в которой у вас есть активы, но их недостаточно для изменения состояния мира. Так я заинтересовался неполными рынками. Это еще одна статья, которая мне очень нравится, – она называется «Основной пример». Мне с трудом удалось ее опубликовать, поскольку я написал ее в стиле, принятом в *JPE*, как своего рода продолжение первой статьи, а, по мнению сторонников чикагской школы, солнечные пятна ничего не объясняют и вообще неинтересны. Вот с чем мне пришлось столкнуться.

**MD:** В знаменитой публикации Карекена и Уоллеса Касс и Шелл, в частности, говорят, что, по определению, модель перекрывающихся поколений – единственная динамическая дезагрегированная модель, которая может считаться интересной макроэкономической моделью.

**Касс:** Здесь я должен вернуться к тому, как создавалась модель перекрывающихся поколений. Этой моделью я заинтересовался из-за солнечных пятен. А затем Окуно и Зилча (возможно, это произошло на той же конференции в Сквом-Лейк) представили доклад, в котором пытались доказать, что

если ввести в модель перекрывающихся поколений деньги, то равновесие, при котором деньги будут иметь нетривиальную цену, обязательно будет парето-оптимальным. В их доказательстве был изъян.

**MD:** Нейл Уоллес не раз говорил об этом в Миннесоте.

**Касс:** В своей работе они пытались доказать то, во что верил Нейл. Я видел их доказательство, читал его очень внимательно – и в нем есть ошибка. Я решил, что оно, возможно, неверно, поскольку строится на определенных свойствах функций полезности и прочего, и поэтому решил придумать контрпример. Я придумал множество контрпримеров того, как можно ввести деньги и по той или иной причине (гетерогенности, нестационарности и т. д.) не получить парето-оптимальности. Я снова заинтересовался моделью перекрывающихся поколений. Мы с Карлом действительно в нее верили и стали работать над ней в более общем плане, когда завершили работу над солнечными пятнами. Мы действительно в то время считали ее единственной серьезной моделью, в которой деньги имели какое-либо значение. Конечно, впоследствии появились довольно известные работы, посвященные другим моделям, в которых деньги играют основную роль.

**MD:** Хотя с математической точки зрения эти модели не сильно отличаются от вашей?

**Касс:** Я как раз собирался об этом сказать. Модель Кийотаки-Райта мне очень нравится, но я уже говорил вам, Рэн-

ди: мне кажется, что важнейшая особенность обеих этих моделей – неограниченность горизонта планирования. Ограничив свой поиск, вы тоже не добились бы, чтобы деньги имели какое-либо значение. Поэтому, хотя нам и не хватило фантазии придумать другую модель, а эта, например, была бы вашей моделью с поиском и неограниченным горизонтом, думаю, вы были правы, утверждая, что необходимость введения денег обусловлена временными границами модели. Я по-прежнему считаю, что деньги имеют ценность постольку, поскольку люди думают, что деньги будут ее иметь. И единственный способ заставить их думать именно таким образом – не принуждать людей инвестировать. И в этом модель Кийотаки-Райта схожа с моделью перекрывающихся поколений.

**МД:** Это интересно, поскольку существуют такие модели с неограниченным горизонтом, в которых деньги роли не играют. Поэтому горизонт не является достаточным условием.

**Касс:** Точно так же, как неограниченный горизонт не обязательно обеспечивает деньгам какую-то роль. Кроме того, у вас должно быть определенное несовершенство, какое-то нарушение условий действия первой теоремы благосостояния, например, ограничение участия или неконкурентное поведения (поисковая модель).

**МД:** Согласны ли вы с тем, что в монетаристской теории еще немало вопросов, которые только предстоит решить?

**Касс:** Да, конечно. Было бы хорошо, но, наверное, невоз-

можно, иметь непротиворечивую модель, в которой мы могли бы уйти от того, что при бесконечном будущем деньги имеют ценность, но трудно представить себе, как это можно сделать. У Джона Геанакопласа есть модель, модель неполных рынков с деньгами и с ограничениями, связанными с предоплатой. В этой модели деньги имеют ценность, поскольку их выпускает банк, и вы обязаны их ему возвращать. Но по большому счету банк эти деньги просто выбрасывает, и на самом деле эта модель не является закрытой. И это, конечно, ее недостаток.

**МД:** Какие проблемы возникают в связи с бесконечным горизонтом планирования?

**Касс:** Когда-то в 1980-е я изменил свое отношение к бесконечному горизонту. Думаю, что в итоге причина моих возражений была связана с рациональными ожиданиями, хотя я определил бы рациональные ожидания скорее с точки зрения общего равновесия, чем с позиций макроэкономики. В моем понимании рациональные ожидания означают, что у вас есть однозначно определенное пространство состояний, и что в этих состояниях каждый индивидуум разделяет общие ожидания относительно цен, которые будут превалировать в дальнейшем. В результате этих ожиданий на нынешних рынках установится равновесие, и когда наступит завтрашнее состояние, учитывая эти планы, единственным равновесием на рынке реального товара будет равновесие по ценам, которые прогнозируются. Но есть небольшая пробле-

ма: ведь возможно и другое равновесие. Ни у одной известной мне модели равновесия нет разумной процедуры реального достижения цен равновесия, поэтому неясно, почему фактические цены совпадут с прогнозируемыми. Возвращаясь к этому вопросу, скажу, что я в состоянии понять, почему могу захотеть использовать рациональные ожидания как эталон, если мы делаем не слишком долгосрочный прогноз. Но обычно при этом необходимо принять допущение, что вы знаете, какова мировая структура. Существует, на мой взгляд, большая разница между этим допущением и неявным допущением о том, что вы будете знать ее всегда. Эта проблема меня очень беспокоит.

**MD:** Считаете ли вы, что для каких-то релевантных вопросов целесообразнее использовать краткосрочную модель?

**Касс:** Думаю, что можно использовать краткосрочную модель, но когда вы достигнете определенного периода – при условии, что вы его достигнете, – у людей появятся основания ожидать, что за ним последует и другой период. Это своего рода индуктивный аргумент. Вы не можете «отсечь» мир потому, что в последнем периоде люди все равно будут ожидать наступления еще одного периода. Я имею в виду то, что мне понятен этот аргумент, но мне просто не нравится вывод, что модель должна быть бесконечноразмерной. Исходя из своего опыта я считаю, что бесконечноразмерные и конечноразмерные модели изоморфны. Но они не изоморфны

с точки зрения наделения ролью бумажных денег, и это меня беспокоит. Поэтому я хочу ввести одно из тех искусственных допущений, над которыми я обычно смеялся. В частности, допущение о том, что люди получают пользу от того, что не тратят деньги, или что их вынуждают не тратить деньги, чтобы модель была закрытой. Для меня такое допущение предпочтительней введения бесконечного горизонта. Я совершил полный круг. Я знаю, что мы с Карлом в своей защите модели перекрывающихся поколений часто смеялись над подобными искусственными закрытыми моделями, но теперь я отношусь к ним с большей симпатией.

**МД:** Продолжая разговор о неполных рынках, можно сказать, что одна из нынешних тенденций в макроэкономическом анализе – финансовая интеграция.

**Касс:** Думаю, что введение финансов в макроэкономический анализ имеет первостепенное значение, но также я считаю, что предметом этого анализа в основном станут отсутствующие рынки.

**МД:** Кое-кто находит модели неполных рынков слишком специальными, так как определенная категория рынков просто закрыта.

**Касс:** Они действительно очень специальные, но первый шаг к пониманию этой проблемы – построение модели, в которой вы это допустили. Сейчас во многих работах делается попытка оправдать отсутствующие рынки, например, тем, что, если имеется пространство конечных состояний, то то-

гда идиосинкратические переменные должны казаться частью определения пространства состояний. Тогда вы не сможете получить рынки для идеосинкратического риска из-за проблемы морального риска. Другая возможность – недостаток информации. Сегодня люди пытаются создавать более формальные модели, работающие на основе стандартной, несовершенной в том или ином отношении информации, что приводит к тому, что вы получаете неполные рынки. Они хотят, чтобы эта неполнота стала эндогенной.

Еще один способ сделать это – сохранить структуру модели неполных рынков, но ввести агентов, оптимизирующих структуру активов. Не думаю, что эти модели очень удачны, наверное, потому, что они требуют, например, чтобы агенты, собирающиеся создать инструменты, могли прогнозировать (поскольку это равновесие Нэша), что будут вводить и затем делать другие агенты, и каковы будут равновесия. Чтобы построить формальную модель, вы обязаны сделать это серьезное допущение в отношении информации. Это служит примером того, какие проблемы могут возникать. Знаете, люди очень хорошо их осознают, хотя я все равно думаю, что много вещей, справедливых в модели, в которой неполные рынки просто допускаются, будут справедливыми и в моделях, в которых вы объясняете, почему у вас имеется неполнота. Я в этом убежден. Один из результатов моего изучения неполных рынков, которым я весьма доволен, – то, что я сделал предварительные наброски, по которым затем мы с Ивом Ба-

ласко написали работу. Джон Геанакоплос с Эндрю Масколеллом написали примерно в то же время статью, показывающую, что в условиях неполных рынков вы получаете значительную неопределенность равновесий в реальном смысле слова. Думаю, что этот результат сохранит свое значение.

**MD:** На самом деле мы возвращаемся таким образом к монетаристским моделям, поскольку все это предполагает ненейтральную денежно-кредитную политику в условиях неполных рынков.

**Касс:** Да, и я собираюсь сделать еще один шаг. Простейший вариант неопределенности возникает из-за того, что с неполными рынками вы можете выбрать в разные периоды разные масштабы цен. Но другая причина, порождающая еще большую неопределенность, – то, что вы можете сделать параметром модели структуру активов.

**MD:** Разве вы не говорили, что рациональные ожидания и рыночное равновесие еще не определяют окончательно всего, что касается солнечных пятен или динамики?

**Касс:** Верно. Это своего рода саморазрушение.

**MD:** Некоторые высказывают подобные суждения в силу приверженности кейнсианской макроэкономической теории. А вы?

**Касс:** Нет. Должен признать, что это своего рода аномалия, поскольку в конечном счете носит разрушительный характер. Я использовал как точку отсчета конкурентную модель равновесия, а у нее нет предсказательной силы, поэтому

это своего рода саморазрушение. Мне это очень интересно. Мне интересно попытаться сообразить, что именно определяет равновесие. Я все еще нахожусь на том этапе, когда не знаю ответа.

**МД:** Это, безусловно, очень интересная интеллектуальная задача на будущее.

**Касс:** Да, это интеллектуальная головоломка. И должен признать, что на протяжении всей моей карьеры в экономике меня постоянно интересовала какая-нибудь интеллектуальная загадка, пусть и не модная, не имеющая никакого практического значения – и бог знает почему. Могу привести наглядный пример: я несколько лет работал над проблемой характеристики парето-оптимальности и эффективности в бесконечноразмерной модели роста.

**МД:** В чем, по вашему мнению, будущее микро- и макроанализа, теории общего равновесия и теории игр? Что впереди?

**Касс:** Я планирую свою работу на довольно краткосрочную перспективу. И так было всегда. Я думаю заранее только о следующей проблеме, над которой собираюсь работать. Я всегда оказывался в очень невыгодном положении, когда пытался получить гранты, поскольку не имел даже смутного представления о том, над чем буду работать в будущем!

**МД:** Значит, мы возвращаемся к вопросу, который, как вы сказали, Купманс задал в отношении рынка труда, не правда ли?

**Касс:** Да, возможно, вся проблема именно в этом! Мы совершили полный круг. Но вообще-то я знаю, что в науке большую роль играет счастливая случайность. Я имею в виду, что если бы вы сказали мне 15 лет назад, что я буду заниматься общим равновесием с неполными рынками, то я бы ответил: «Вы с ума сошли?» Счастливая случайность в данном случае состоит в том, что я хотел разработать примеры равновесий солнечных пятен с отсутствующими рынками и понял, что существует немало интересных вопросов, связанных с моделью, которую я хочу для этого использовать. В частности, причина, по которой я занялся неопределенностью, заключается в том, что в модели солнечных пятен, при условии отсутствующего финансового инструмента, вы получаете континуум равновесий солнечных пятен; это оказывается общим свойством неполных рынков. Вопрос, который я пытаюсь решить сейчас, – что может реально уменьшить количество равновесий. Максимум, на что можно надеяться – конечное число равновесий, и я не думаю, что ответ в том, чтобы ввести деньги для нормализации цен, поскольку все равно существует что-то, являющееся базовым элементом модели, ее эндогенным фактором, и это – структура активов. Ее необходимо эндогенизировать. Поэтому вопрос заключается в том, получаете ли вы по-прежнему неопределенность, когда действуете в соответствии с этой схемой. Мне это интересно.

**MD:** Так вы хотите эндогенизировать структуру активов?

**Касс:** Да, эндогенизировать структуру активов. Есть примеры, когда вы эндогенизируете структуру активов и как будто в определенном смысле объясняете равновесие, но на самом деле это не так. Хороший тому пример – работа Альберто Бизина, его диссертация, в которой он, в сущности, вводит идею, взятую из теории игр. Идея заключается в том, что некоторые домохозяйства начинают использовать новые финансовые инструменты, и делают это по методу Нэша. За данность берется то, что делают все остальные домохозяйства, и затем определяется изменение равновесия в зависимости от их действий, после чего ведется поиск оптимального решения. Основная проблема сегодня связана с тем, что равновесие Нэша, как известно, предполагает множество вариантов. Единственное, что при этом уменьшается, так это количество равновесий после того, как определен набор финансовых инструментов. Так или иначе, в его модели есть раздел, который касается реальной неопределенности и который показывает, что у вас не так уж много вариантов равновесий, связанных с данной структурой активов. Но зато у вас множество равновесий, связанных с равновесием Нэша. Вы просто отодвинули неопределенность на один шаг назад.

**МД:** Несколько минут назад вы рассказывали о том, как занимаетесь исследованиями, о том, как смотрите на модель и думаете о вопросах, на которые она, по вашему мнению, поможет ответить. Не могли бы вы продолжить эту тему?

**Касс:** То, что заставляет меня заниматься наукой, отли-

чается от того, что заставляет заниматься наукой подавляющее число людей. Меня никогда не привлекало то, что многие называют проблемами реального мира. Во мне намного больше от структуралиста. Я изучаю некоторые вопросы потому, что для меня это интересные загадки, и не важно, какое экономическое значение они имеют.

**MD:** Интересная особенность вашей биографии как ученого – вы могли работать над этими проблемами по какой угодно причине (ничуть не интересуясь, скажем, реальной политикой), и все же модель Касса-Купманса – это основа современной теории экономического цикла, результаты вашей работы по перекрывающимся поколениям используются во многих практических исследованиях в области теории монетаризма, а выводы, сделанные вами в ходе изучения солнечных пятен, учитываются при разработке макроэкономической политики.

**Касс:** В этом и состоит красота истинно интеллектуальной научной дисциплины. В ней есть место для таких людей, как я.

**MD:** Где-то в самом низу пищевой цепи?

**Касс:** Нет... Вы просто что-то узнаете! Никогда не следует смеяться над тем, как подходит к вопросу интеллектуал. Ведь неизвестно, когда придуманное им в конце концов станет действительно интересным, но по другим причинам.

**MD:** Но на это может уйти лет 20 или 30.

**Касс:** На это может уйти вечность. Или это не случится

НИКОГДА.

### 3. Интервью с Робертом Лукасом-младшим

6

**Беседовал Беннетт Маккаллум**

*Университет Карнеги-Меллона*

Лето 1998 г.

Роберт Лукас – один из признанных и влиятельнейших экономистов последних 25–30 лет, по крайней мере среди тех, кто занимается макроэкономикой и монетаризмом. Его работы заставили кардинально пересмотреть и оживить науку, увидеть влияние рациональных ожиданий. Благодаря ему появилась равновесная теория циклических колебаний, описание аналитических составляющих, необходимых при использовании эконометрических моделей для разработки государственной политики. За эти достижения в 1995 г. он был награжден Нобелевской премией по экономике. Кроме того, его значительный вклад по другим направлениям мог бы «потянуть» еще не на одну награду. Среди них – основополагающие труды по определению стоимости активов, экономическому росту и развитию, определению курса валют, наибо-

---

<sup>6</sup> Впервые опубликовано в *Macroeconomic Dynamics*, 3, 1999, p. 278–291.  
Copyright © 1999 Cambridge University Press.

лее благоприятной фискальной и инфляционной политике, инструментам анализа динамических рекурсивных моделей.

Чикагский университет сыграл особую роль в жизни ученого. Здесь он получил степень бакалавра и доктора наук и в 1975 г. приступил к работе на факультете. Он также был деканом экономического факультета Чикагского университета и на протяжении двух семестров – главным редактором *Journal of Political Economy*. Но несмотря на это, я и ряд моих коллег в Карнеги-Меллон любим время от времени вспоминать, что Роберт Лукас с 1963 по 1974 г. был здесь профессором в Высшей школе промышленного администрирования. В этот период он опубликовал свои основные научные труды, за которые впоследствии получил Нобелевскую премию. Поэтому я не мог удержаться от соблазна и не задать собеседнику несколько вопросов о времени, проведенном в нашем университете.

Многие исследователи были поражены знаниями Лукаса, а также ясностью мысли и элегантностью стиля его работ, выбором тем для изучения. Последнее подчеркивает всю серьезность целей ученого. В каждом из его проектов в основе решения проблемы лежал неподдельный интерес с точки зрения теоретических изысканий и одновременно – несомненная важность для перспективного развития экономической политики. Свои исследования Лукас никогда не направляет на решение задач незначительных, о чем он во время интервью еще раз напомнил.

По словам близких и коллег, Роберт Лукас – человек, который никогда не использует три слова, если можно обойтись одним, но его он выберет с особой тщательностью. Это интервью – яркое тому подтверждение. В отличие от обычной практики, используемой журналом при проведении интервью, это интервью – с разрешения редактора – прошло в заочной форме с помощью писем и электронной почты. В результате оно меньше, чем предыдущие интервью, но, думаю, читатели по достоинству его оценят. Несмотря на все трудности, связанные с проведением интервью, я получил от этой работы огромное удовольствие и узнал много нового.



**Рис. 3.1.** Роберт Лукас-младший

**Маккаллум:** Начнем с того, как и когда вы стали интересоваться экономикой и почему выбрали ее в качестве профессиональной деятельности.

**Лукас:** Когда мне было семь или восемь, мой отец как-то спросил, не заметил ли я, сколько грузовичков различных компаний приезжает в наш квартал: один из них привозил молоко от компании Darigold, другой – от Carnation и т. д. Мы насчитали пять или шесть компаний. Отец спросил, считаю ли я, что есть какая-то разница в молоке, которое те привозят. Я ответил – нет. Тогда он сказал, что при социализме молоко в квартал будет привозить всем один грузовик, а сэкономленное время и бензин будут использоваться для чего-нибудь еще.

Не думаю, что это можно считать моим первым серьезным разговором на экономические темы, но этот эпизод – самое раннее из того, что я помню.

Взгляды моих родителей сформировались в 1930-е, и они, как и я, не разделяли идеи свободного рынка. Мы считали, что экономикой необходимо управлять разумно, и каждый день мы обсуждали подробно, как это могло бы быть и что для этого необходимо сделать.

В 1950-е, поступая в Чикагский университет, я понимал, что научная деятельность для меня – это то, что нужно. В колледже мои интересы и предпочтения привели меня к изучению истории. Во время обучения в магистратуре я начал серьезно изучать экономику.

**Маккаллум:** А почему вы отправились учиться в Чикаго?

**Лукас:** Я мог остаться дома и поступить в Вашингтонский университет в Сиэтле. Но Чикагский университет дал мне стипендию, покрывающую все расходы на обучение. Это был шанс вырваться из родного города, что для меня в то время было необходимо.

**Маккаллум:** А почему вы решили переключиться на экономику?

**Лукас:** Я переключился на экономику с экономической истории, не имея ни малейшего представления о том, как работает экономика или чем занимаются экономисты. Но вскоре я открыл для себя, что важнейшую роль в экономике играют математические выкладки, и такой подход к обоснованию человеческого поведения мне был близок.

**Маккаллум:** Как вам удалось получить столь глубокие знания в математике?

**Лукас:** Все забывают, что в начале 1960-х, чтобы стать экономистом, больших математических познаний не требовалось. Еще в колледже, прежде чем серьезно заняться историей, я изучал вычислительную математику и дифференциальные уравнения. Из «Основ» Самуэльсона<sup>7</sup> я, как и другие мои коллеги, узнал об использовании математики в экономике. Во время учебы в магистратуре я прошел курс линей-

---

<sup>7</sup> Имеется в виду работа П. Самуэльсона «Основы экономического анализа» (Foundations of Economic Analysis, 1947). – Прим. ред.

ной алгебры и углубленный курс вычислительной математики. Кроме того, посещал курс математической статистики, который читали на факультете статистики Чикагского университета. Даже имея такой багаж знаний, я продолжал заниматься самообразованием и с большей частью того математического аппарата, который сейчас использую, я ознакомился уже после окончания магистратуры.

**Маккалум:** Когда вы учились в аспирантуре Чикагского университета, кто из преподавателей оказал на вас большее влияние?

**Лукас:** Самое большое влияние, так или иначе, на всех студентов, и на меня в том числе, оказал Милтон Фридман. Оба его курса по теории цен были удивительны. Он просто изменил наше представление о мире. В то время я впитывал в себя все, как губка, многому научился и у других преподавателей. Эл Харбергер в то время занимался количественными моделями общего равновесия, которые и сегодня выглядят достаточно современно. Мартин Бейли, Карл Крист и Гарри Джонсон также были нашими учителями в области макроэкономики. Грег Льюис на одном из своих семинаров рассказал нам о своей книге о профсоюзах, из которой я также многое узнал.

Среди более молодых преподавателей я бы выделил Цви Грилихеса, который преподавал эконометрику и поддерживал таких «технарей», как я. Дейл Йоргенсон, работавший в университете по приглашению в 1962–1963 гг., также про-

извел на меня большое впечатление. И еще Дон Бир – он вел бесподобный курс математики для экономистов.



**Рис. 3.2.** Луис Чен, Роберт Лукас и Чи-Ва Иен. Пик Виктория, Гонконг

**Макалум:** У меня ощущение, что Узава также в какой-то степени оказал на вас влияние. Я ошибаюсь?

**Лукас:** Узава пришел в Чикагский университет через год после того, как я его закончил, поэтому он не был моим преподавателем. Но я участвовал в двух летних конференциях по теории экономической динамики, организованных Узавой и Дэвидом Кассом – в Чикаго и в Йеле. Конференции да-

ли мне возможность поближе познакомиться с лучшими молодыми экономистами-теоретиками. Мне импонировал идеализм и серьезный подход Узавы и Касса. Я был польщен тем, что завоевал такое доверие и меня пригласили на конференцию, где я узнал много нового.

**Маккаллум:** Чьи семинары-практикумы вы посещали регулярно?

**Лукас:** Тогда семинары-практикумы проводились реже, чем сейчас. Все, что касалось вопросов эконометрики и математической теории, рассматривалось на семинаре по эконометрике. Его вели Цви [Грилихес] и Лестер Телсер. Кроме меня, в нем постоянно принимали участие и Мертон Миллер и Дэн Опп из бизнес-школы. Эл Харбергер вел семинар-практикум по государственным финансам, который посещали все студенты, работавшие с ним, включая меня. Грег Льюис приглашал меня сделать доклад на своих семинарах по трудовым отношениям, но я посещал его семинары лишь время от времени.

**Маккаллум:** То есть вы не посещали семинары-практикумы по денежным системам и банкам?

**Лукас:** В те времена принять участие в семинаре-практикуме можно было только по приглашению, но меня на семинары по денежным системам и банкам никто не приглашал — на это не было и причин. Эта область не входила в сферу моих интересов. Меня больше интересовали эконометрика и государственные финансы. К тому же я не работал с Фрид-

маном.

**Маккаллум:** Вы стали старшим преподавателем (доцентом. – *Прим. пер.*) в Карнеги-Меллоне (в то время Технологический институт Карнеги) в 1963 г. Это так?

**Лукас:** Да, я приступил к работе в Высшей школе промышленного администрирования в сентябре 1963 г. В то же время, что и Трен Долбир, Мел Хайнич, Морт Кэмиен, Лестер Лейв и Тим Магуайр. Мы были в первом наборе нового декана факультета Дика Сайерта.

**Маккаллум:** Как вы начали заниматься изучением рациональных ожиданий? Насколько сильно повлиял на вас Джон Мут?

**Лукас:** Когда я покидал Чикагский университет, Цви Грилихес посоветовал мне обратить внимание на работы Джона Мута, поскольку я мог бы у него многому научиться. Это был очень хороший совет! Я на самом деле многому научился у Джека, но прошло еще несколько лет, прежде чем я по-настоящему воспринял идею рациональных ожиданий. Это произошло во время работы с Эдом Прескоттом над «Инвестированием в условиях неопределенности».

**Маккаллум:** Как вы думаете, как Мут пришел к своей гипотезе рациональных ожиданий?

**Лукас:** Его статья «Рациональные ожидания и теория движения цен» очень информативна и интересна. Здесь можно увидеть, как повлияли на автора работы Герберта Саймона по поведенческой экономике и как Мут на них реа-

гировал, а также как все это привело его к абсолютно неповеденческой гипотезе – рациональных ожиданий. (Однажды я пытался обсудить это с самим Гербертом как пример огромного влияния, которое он оказал на всех нас, но он обиделся и не принял мое предложение).

Джек был соавтором монографии «Планирование производства, запасов и рабочей силы», написанной совместно с Хоултом, Модильяни и Саймоном. Этот труд был посвящен нормативам, анализу операций. В нем описывалось, как менеджеры должны принимать решения с точки зрения своих ожиданий в отношении различных переменных – например, объема продаж. Я уверен, что именно работа над этой монографией подтолкнула Мута к мысли, что ожидания необходимо рассматривать более серьезно, не ограничиваясь их использованием в уравнениях регрессии для корректировки данных.

Один из главных уроков, которые я получил в Карнеги от Мута и, возможно, даже больше от Дейва Касса, заключался в том, что наиболее эффективно проблемы распределения можно рассматривать с точки зрения нормативов, даже если цель этого рассмотрения – просто объяснить поведение, а не изменить его.

Атмосфера Чикагского университета, когда я там учился, не располагала ни к какому изучению планирования – нас не учили размышлять. Например, о том, как *необходимо* распределить ресурсы в той или иной ситуации? Как лю-

ди *должны* использовать доступную им информацию, чтобы сформировать свои ожидания? Эти вопросы *должны быть* важнейшими для любого экономиста. Мой отец ошибался, когда думал, что при социализме доставка молока будет эффективной, но он был прав, когда думал о том, как она *должна* быть организована.

**Маккаллум:** Что еще в Высшей школе промышленного администрирования оказало влияние на вас в плане профессионального развития?

**Лукас:** Я уже упоминал о влиянии Герберта Саймона, Дэвида Касса и Эда Прескотта, когда отвечал на ваш вопрос о влиянии Мута. Если говорить в целом, то Высшая школа промышленного администрирования дала возможность пообщаться с разными людьми, чьи взгляды на экономику были мне близки – такими как Леонард Рэппинг и Алан Мелтцер, а также теми, кто мог рассматривать проблемы с таких сторон, что я никогда бы сам не додумался – среди них Саймон, Мут, Касс и Прескотт.

**Маккаллум:** Какова была атмосфера в Чикагском университете, когда вы вернулись в 1974–75 гг.? Что помогло вам двигаться дальше в профессиональном плане?

**Лукас:** В Чикаго впервые в жизни я начал на постоянной основе читать студентам курс макроэкономики (как Алан Мелтцер в Карнеги-Меллон). Это мне очень помогло. Я научился объединять идеи и мысли в одной области, чтобы донести их до студентов. Такой опыт мне помог написать «Что

такое деловой цикл» (Understanding Business Cycles) и «Проблемы и методы в теории деловых циклов» (Problems and Methods in Business Cycle Theory).

**Маккаллум:** Вы получили Нобелевскую премию за развитие и изменение основ макроэкономического и монетаристского анализа, а также развитие и применение гипотезы рациональных ожиданий. Прежде чем мы перейдем к другим интересующим вас темам, вы не хотели бы рассказать немного об этом? Вам нравится, как эволюционирует макроэкономика?

**Лукас:** Как и большинству ученых, я полагаю, мне нравится, когда развиваются процессы, которые подтверждают мои сомнения и доказывают мои гипотезы. Поэтому я доволен успехами теории общего равновесия в макроэкономике и огорчен тем, что не говорится о теориях денег, которые привели к этим достижениям. Отдельное удовольствие – это ощущение того, как много я узнал, исследуя теорию реального делового цикла. И сегодня я рассматриваю взаимосвязь между теорией и данными, а также факторы колебаний совершенно по-другому, чем 15 лет назад.

**Маккаллум:** Насколько, по-вашему, существенна роль технологических шоков в деловых циклах с точки зрения количественной оценки?

**Лукас:** Ответ зависит от того, о каких циклах мы говорим. Если это депрессия 1930-х гг. в США или то, что случилось в Мексике в 1994 г. и что происходит сегодня в Ин-

донеции, то тогда я могу сказать, что технологические шоки играют незначительную роль. С другой стороны, если же мы говорим о колебаниях в США в послевоенный период, влияние технологических и других факторов значительно выше и достигает 80 %.

**Маккаллум:** Но «технологические и другие факторы» могут включать в себя создание преференций, увеличение госрасходов, изменение условий торговли и возможно что-то еще. А как насчет чисто технологических шоков – шоков, относящихся только к сфере производства, – в США в послевоенное время?

**Лукас:** Я не знаю, как разделить упоминаемые мной 80 % между этими и другими факторами. Я не уверен, что существует такое понятие, как «чисто технологический шок». Для меня существуют две категории шоков: шоки, с которыми на конкурентных рынках можно справиться без каких-либо государственных интервенций (в том числе те, о которых шла речь), и шоки, которые требуют валютного регулирования и валютного контроля.



**Рис. 3.3.** Эд Прескотт, Том Сарждент, Роберт Лукас и Баз Брок на конференции

**Маккаллум:** Как вы считаете, можно ли рассматривать жесткость цен как важный экономический феномен?

**Лукас:** Да. На практике дефляционные процессы проходят более болезненно в современной экономике, чем мы ожидаем, исходя из монетаристской теории. Поэтому я сторонник того, что мы подразумеваем под «жесткостью цен».

**Маккаллум:** Среди монетаристов существуют разногласия в отношении главных целей Европейского центрального банка, важнейшими из них называют инфляцию и рост денежной массы. Что вы думаете по этому поводу?

**Лукас:** Это классический вопрос для любого центрального банка. Мне нравится политика, которую вы озвучили в вопросе, – формулирование цели с точки зрения номинального объема ВВП и затем использование правила постепенной реакции для монетарной базы, чтобы система продолжала двигаться к поставленной цели. Если вы захотите заменить «номинальный ВВП» на «уровень инфляции», такая политика будет выглядеть привлекательно, но уже меньше. Если же вы замените «монетарную базу» на «денежный агрегат M1», то такая политика, как мне кажется, будет выглядеть еще более привлекательной.

Если же вы замените «монетарную базу» на «краткосрочную процентную ставку», то получите версию той политики, которая сегодня, видимо, нравится всем. Я сторонник всего, что касается стабильности цен, но я не понимаю, как конкретно эта система работает. Кроме того, меня, как и Викселля и Питера Хауитта, беспокоит плохая динамика.

**Маккаллум:** Вы на самом деле считаете, что социальные расходы при циклических колебаниях невелики, как описано в вашем выступлении на Янссоновских чтениях (Jahnsson Lectures)? Насколько верны эти цифры?

**Лукас:** Я не пишу сказок! Я никогда ничего не пишу, чтобы просто кого-то спровоцировать! Может быть, те цифры, о которых вы говорите, слишком малы, но если это на самом деле так, то это моя ошибка, а не заведомо спланированная провокация, чтобы привлечь внимание к проблеме. Цифры,

которые я приводил, касаются периода колебаний потребления в США в послевоенные годы, с учетом всех характерных рисков. Как уже говорилось в ходе чтений, расходы во время кризиса 1930-х гг. были значительно выше, поскольку в те годы отсутствовало страхование от безработицы и многое другое, что есть в современной системе соцобеспечения.

Причина, по которой эти расходы не столь велики, заключается в том, что они распределены в соответствии с колебаниями потребления, которые в послевоенные годы в США были незначительны. Как можно увеличивать расходную часть при условии, что уровень потребления почти не меняется? Не говоря уже о нерасположенности к огромным рискам. Конечно, такая пониженная изменчивость потребления может, в частности, иметь место в результате разумной денежно-кредитной политики, проводимой в эти годы. Я не утверждаю, что нестабильность денежно-кредитной системы не способна принести большого вреда, но только за прошедшие 50 лет в США этого не произошло.

**Маккаллум:** Давайте поговорим о микроэкономике. Как на ваш взгляд она изменилась, скажем, за последние 25 лет?

**Лукас:** За последние 15 лет во многих университетах (Чикагский к их числу не относится) микроэкономика стала синонимом теории игр, и это печально. Почти 99 % всех успешных моделей экономики до сих пор основываются на идее конкурентного равновесия. Но теория игр дала нам возможность рассуждать о распределении ресурсов, используя

более конкретную, порой закрытую информацию, а также о проблемах репутации. Это огромный шаг вперед в сравнении с тем, что мы с вами изучали в магистратуре.

**Маккаллум:** Ряд ваших важнейших открытий связан с теорией определения стоимости активов, теорией экономического роста и развития, а также ролью экономической теории в эконометрике и анализе при выборе экономической политики. Давайте поговорим немного об этом. Как вы пришли к этим открытиям?

**Лукас:** Нагляднее всего это можно показать на примере того, как я писал свою работу по теории определения стоимости активов. Я проводил в своем офисе в Чикаго собеседование с Пентти Коури, который только что получил ученую степень в Массачусетском технологическом институте и искал работу. Он не горел желанием тратить время на пустые разговоры и спросил меня сразу: «А как бы вы определили стоимость активов в такой модели экономики?» Коури описал модель, которая впоследствии вошла в мою работу. Я подошел к доске и начал писать уравнения Беллмана и равенства спроса и предложения, и через несколько минут стало очевидно, что нет необходимости выяснять стоимостную функцию, чтобы получить функциональное уравнение для определения стоимости активов. Коури не вмешивался в то, что я говорил и делал. Таким образом, я все написал сам, как и все остальное.

**Маккаллум:** А как насчет вашего большого интереса к

концепциям экономического роста и развития? Это результат участия в Янссоновских чтениях или вы всегда интересовались этой областью?

**Лукас:** Я преподавал студентам курс по теории экономического развития в Карнеги-Меллоне. Он был в списке курсов по выбору. Сколько себя помню, я всегда интересовался этой областью. Но мои изыскания были в большей степени интуитивными. Я чувствовал, где могу добиться большего успеха. Я обнаружил, что в своих исследованиях деловых циклов съезжаю в колею, протоптанную многими учеными задолго до меня, и подумал, что было бы лучше найти себе еще какую-нибудь тему.

**Маккаллум:** В научных кругах многие довольно лестно отзываются о стиле ваших работ. Вы работаете над стилем?

**Лукас:** Спасибо за комплимент. Я очень много правлю и переписываю в своих работах, хотя в первую очередь думаю о логике изложения, а не о стиле. Кроме того, я много читаю. И среди этих авторов многие действительно по-настоящему хорошо пишут. Думаю, что-то я и у них перенял.

**Маккаллум:** Как вам удалось бросить курить?

**Лукас:** Я начал курить в 13 лет и бросил, когда мне исполнилось 56. Я плохой советчик в этом вопросе. Я избавился от никотиновой зависимости с помощью специальных никотиновых пластырей. Этому также способствовали и другие факторы – страх, постоянное недовольство близких, всеобщее неодобрение и т. д.

**Маккаллум:** В 1980-е гг. вы вместе с Полом Ромером сделали немало в области теории экономического роста. Вы были научным руководителем, когда Пол писал диссертацию? Расскажите о вашей совместной работе над этой темой.

**Лукас:** В своем курсе макроэкономики я долгое время использовал известную во многих странах модель Солоу – (экспериментальную) модель экономического роста. Пола интересовала эта тема, и он самостоятельно разработал модель, в основе которой лежали растущая доходность и экстерналии. Я ничего о ней не знал. Шервин Розен и Тед Шульц рассказали Полу о работе Эллина Янга. Но тут я тоже ни при чем.

Модель, о которой говорится в диссертации Ромера, заставляет по-новому взглянуть на специфические проблемы, которые до этого нигде особо не суммировались и не учитывались. Полу помог Жозе Шейнкман, в том числе и успешно защитить свою диссертацию.

**Маккаллум:** Нет ли у вас желания заняться разработкой экономической политики страны на практике? Как вы думаете, год-другой практической работы может существенно повлиять в ту или иную сторону на то, чем занимается экономист-теоретик?

**Лукас:** В конце 1960-х, когда Джордж Шульц был министром труда в администрации Никсона, он приглашал меня на работу в качестве советника. Тогда эту должность в итоге занял мой друг Джек Гулд. Это была интересная работа,

поскольку Никсон рассчитывал на поддержку Шульца в гораздо большем спектре экономических вопросов, а не только тех, что непосредственно касались его ведомства. Позднее Шульц перешел на работу в Административно-бюджетное управление, и если бы я согласился тогда на его предложение, я бы перешел туда вместе с ним. Шульц звонил мне лично, чем поразил моего секретаря в университете, да и меня тоже. Но, так или иначе, в то время я был слишком увлечен своими исследованиями и не хотел прерывать работу и переезжать в Вашингтон.

Жалею ли я об этом? Когда я отказался от этой работы, Артур Лаффер оценил мой поступок. Думаю, что мне, Артуру и экономике США порознь лучше, чем вместе, кроме того я могу получать какое-то удовольствие, помогая использовать закон Парето при принятии решений.

**Маккаллум:** Вы не думали о том, чтобы в какой-нибудь газете или популярном журнале вести постоянную колонку, посвященную вопросам экономики?

**Лукас:** Не сейчас, может быть позже. Мне нравится ощущать вкус открытия и интеллектуального прогресса, который я получаю, занимаясь теоретической экономикой. Для этого необходимо тратить много времени на проблемы, которые человек часто не понимает и, может быть, вряд ли когда-нибудь поймет. Это тяжелый труд. И чем старше и известнее вы становитесь, тем больше у вас в жизни появляется интересных и приятных вещей, а также причин не вы-

полнять эту работу. Всё, что мне нужно, – это найти такие причины.

## 4. Интервью с Яношем Корнаи

8

**Беседовал Оливье Бланшар**

*Массачусетский технологический институт*

10 июня 1998 г.

Большинство из нас можно назвать «кабинетными экономистами». Независимо от того, будет ли наше мнение в итоге верным или ошибочным, мы потеряем не так много, самое большее – свою репутацию. Но это не относится к Яношу Корнаи. Большую часть жизни все, что он говорил, могло обернуться для него тюрьмой или чем-нибудь похуже. Он стоял перед тяжелым выбором. Он мог пойти по пути «сам-издата» и публиковаться нелегально, но тем самым сузить аудиторию своих потенциальных читателей. С другой стороны, он мог, исключив из своих работ все, что попадало под официальный запрет, публиковаться открыто и, тем самым, получить доступ к более широкой читательской аудитории. Все это не помешало ему в его стремлении донести до нас свои критические взгляды на социалистическую систему того времени. В этом интервью, я надеюсь, удастся показать, до какой степени переплелись жизнь и работа Яноша Кор-

---

<sup>8</sup> Впервые опубликовано в *Macroeconomic Dynamics*, 3, 1999, p. 427–450. Copyright © 1999 Cambridge University Press.

наи, и как он пришел к тому, во что верит по сей день. Сегодня его жизнь протекает между Гарвардом и исследовательским институтом Коллегиум Будапешт. Наша беседа состоялась в моем офисе, когда я в июне 1998 г. посетил Гарвардский университет.



**Рис. 4.1.** Янош Корнай, 1997 г.

**Бланшар:** Ваша первая книга «Сверхцентрализация управления экономикой» (Overcentralization in Economic

Administration, 1957) была посвящена проблемам плановой экономики. На первый взгляд, книга представляет собой технический анализ промышленности в условиях централизованного планирования. Но из предисловия, которое вы написали ко второму изданию книги в 1989 г., следует, что это была лишь часть большого исследования социалистической системы, многое из которого вы не хотели публиковать.

Можно ли сказать, что ваши взгляды формировались именно в то время? Рассматривали ли вы реформирование социалистической системы как решение ее проблем? (Вы коснулись этого вопроса в своем предисловии ко второму изданию вашей книги.) Какую часть исследований роли и внутренней движущей силы коммунистической партии (главная тема работы «Социалистическая система» (Socialist System), опубликованной в 1992 г.) вы уже провели к тому времени?

**Корнаи:** В моей жизни было несколько периодов. В молодости я поддерживал идеи социализма. Затем я стал все больше критиковать сталинский тип коммунизма.

**Бланшар:** А когда именно начался период разочарования в идеях коммунизма?

**Корнаи:** Это началось в 1953 г., после смерти Сталина, когда многое, что до этого времени тщательно скрывалось, вдруг стало известно, и это повлекло за собой изменения во всех коммунистических странах. Моя реакция была катарсической и была связана в большей степени с вопросами морали: ужасные преступления, совершенные системой, – тю-

ремное заключение, пытки, убийства невинных людей – все это пошатнуло мою искреннюю веру в идеи коммунизма, то, во что я верил, стало вдруг наивным и постыдным. Одновременно, я начал осознавать, что режим был с экономической точки зрения также нефункционален и неэффективен, и только создавал дефицит товаров и подавлял любую инициативу и проявление самостоятельности.

«Сверхцентрализация» (Overcentralization) – это моя первая попытка изложить свои критические взгляды на социалистическую систему. Моя книга в то время привлекла внимание всей мировой общественности, поскольку это была первая работа, критикующая систему и написанная человеком, живущим в одной из стран Варшавского блока, а не кем-то из советологов. Я работал над книгой в течение 1955–1956 гг. Это была моя диссертация.

**Бланшар:** Вы сами выбрали тему диссертации? Был ли у вас научный руководитель?

**Корнай:** Тему я выбрал сам. А научным руководителем был Тамаш Наги – профессор, преподаватель политэкономии в Будапештском экономическом университете имени Карла Маркса.

**Бланшар:** Вы писали свою работу примерно в одно время с происходившими тогда революционными событиями?

**Корнай:** Да, я завершил ее в сентябре 1956 г., когда в Венгрии начали происходить серьезные изменения – как в политике, так и в сознании. Аналогичные события произо-

шли в Праге 12 лет спустя, в 1968 г. Люди в Венгрии стали все более откровенно выражать свое отношение к существующей системе и все больше ее критиковать... Кстати, в Венгрии существует система открытой защиты диссертаций. Моя защита проходила за несколько недель до революционных событий 23 октября, на ней присутствовало несколько сот человек....

**Бланшар:** Как они узнали об этом мероприятии? Людская молва?

**Корнаи:** Да, безусловно. Черновики моей работы, уже ходившие в народе, также привлекли многих на это мероприятие. А после моей публичной защиты и вплоть до 23 октября в большинстве ежедневных газет появилось много статей с весьма положительными комментариями моей диссертации.

Но позвольте мне вернуться к моей личной истории, чтобы ответить на вопрос о том, можно ли путем реформ сделать социализм работающей системой. Почти 30 лет спустя, в предисловии ко второму изданию «Сверхцентрализации» я охарактеризовал ученого Корнаи периода 1954–1956 гг. как «наивного реформатора». Это была искренняя наивность – в то время я и не думал о том, что необходимы изменения на уровне политической системы, я принимал ее как данность и не выступал против нее. Государство как собственник для меня также было аксиомой, и конечно я не мог выступать за проведение приватизации. Мне хотелось совместить существующую систему с рыночной эконо-

микой – примерно так, как через 20 лет это произошло во времена горбачевской *перестройки*. Этот этап моей жизни тоже можно назвать своего рода *перестройкой*. В этом предисловии я также упомянул тех, кого считал людьми, близкими мне по духу и взглядам: Дьёрдь Петер и Тибор Лиска в Венгрии, Влодзимеж Брус в Польше, Ота Сик в Чехословакии, и, конечно же, Михаил Горбачев в России. Их реформаторские идеи появились в разное время: Дьёрдь Петер был первым – он озвучил свои идеи еще в 1955 г., в то время как Михаил Горбачев начал свои реформы лишь в конце 1980-х гг. В моем списке есть как ученые, так и действующие политики. Несмотря на различия, их объединяло то, что в определенный момент своей жизни все они – включая меня в 1950-е гг. – думали, что можно было сохранить политическую структуру, в основе которой лежит монополия Коммунистической партии и государственная собственность, и все, что необходимо сделать, чтобы система работала, – это заменить бюрократический подход к управлению на рыночный.



**Рис. 4.2.** Во время поездки с лекциями в Индии. Калькутта, 1975 г.

Однако я изменил свое мнение, когда обнаружил причины, почему рыночный социализм не мог существовать. Я стал все чаще высказывать сомнения в возможности существования рыночного социализма, в том числе в своих более ранних работах. В ряде последующих работ я дискутировал по поводу своих наивных идей реформирования, но когда я писал книгу в 1955–1956 гг., я был еще очень наивен.

**Бланшар:** Эта книга была хорошо принята на Западе, но по меньшей мере не очень хорошо воспринята властями Венгрии. Насколько для вас был неожиданным такой прием

дома? Как это отразилось на вас, на вашей работе?

**Корнаи:** Драматические и разрушительные события 1956 г. изменили мою жизнь, изменили мой взгляд на мир, мое *мировоззрение*. Этому способствовали и события, которые затронули меня лично. Один из моих близких друзей был не просто арестован, он был осужден и казнен. Многие из моих друзей были арестованы, другие эмигрировали, на меня же после вышедшей накануне революции книги повешили ярлык «предателя» идей социализма. Меня уволили, и я остался без работы.

Не только мои личные переживания, но в первую очередь великие исторические события – краткий миг победы и ужасное поражение, заставили меня пересмотреть свои взгляды. Я уже больше не мог поддерживать идею необходимости руководства страной Коммунистической партией по политическим и этическим причинам. Я не могу сказать, что это произошло мгновенно: переосмысление политических взглядов – это процесс, но все произошло довольно быстро.

События 1956 г. также разрушили и мою программу исследований. В течение долгих лет жестоких репрессий я не мог опубликовать все то, что хотел. Я руководствовался принципами самоцензуры, в основе которой лежало мое представление об ограничениях свободы высказывания в своих публикациях. Это повлияло и на мой выбор темы исследования, и на то, насколько далеко я мог зайти в обнародовании его результатов. В период репрессий, последовав-

ших за событиями 1956 г., я решил выбрать для себя менее политизированную тему: математическое планирование, а точнее – использование линейного программирования в планировании, что в итоге привело меня к неоклассическим идеям.

**Бланшар:** Что касается математического программирования, вы самостоятельно изучили эту область или у вас уже были какие-то математические знания?

**Корнаи:** Нет, мне пришлось самому постигать эту дисциплину. Я посещал курсы по математике, линейной алгебре, вычислительной математике и т. п. Но практически я сам дошел до всего, изучая специальную литературу и работая с математиками и специалистами в области вычислительной техники, которые в свою очередь не были экономистами. Позднее меня пригласили в Вычислительный центр Венгерской академии наук, где я занимался линейным программированием. Из книги Дорфмана, Самуэльсона и Солоу, вышедшей в 1958 г., я узнал об использовании модели линейного программирования в экономике. Эта книга была для меня в то время своего рода библией. В этот период мне была очень близка неоклассическая теория, и какое-то время я принимал ее идеи практически безоговорочно.

**Бланшар:** Ваша следующая книга, ставшая известной, – «Антиравновесие» (Anti-Equilibrium, 1971). Эта серьезная работа была посвящена общей теории равновесия и ее недостаткам. Вы уже упоминали вкратце о вашем переходе от

«Сверхцентрализации» к «Антиравновесию». Но когда вы разочаровались в идеях неоклассической теории?

**Корнаи:** В моей профессиональной жизни как экономиста было два периода разочарования. Первое – связанное с потерей веры в идеи марксизма, мы уже обсудили. Я начал свою профессиональную карьеру как истинный последователь идей Маркса, затем я в них разочаровался и в итоге отверг их полностью. Но до сих пор я отношусь к Марксу с большим уважением, для меня он остается гением мысли. Многие его идеи и в наши дни живы и главное – практичны и эффективны. Однако он ошибался во многих фундаментальных вопросах. Затем наступил период моей безоговорочной приверженности неоклассической теории. И в этом было меньше эмоций, а больше всего – разума. Тем не менее, стремясь понять окружающий меня мир со всеми его сложностями, я начал задавать вопросы, но в неоклассической теории ответов не нашел. Эта неудовлетворенность подвигла меня на анализ сильных и слабых сторон теории. Я попытался тщательно все проанализировать и подойти к оценке критически. Мой отказ от идей неоклассической теории был лишен политической окраски. Все, что я хотел сделать, так это выявить недостатки теории.

С того времени я больше никогда не был заложником какой-либо доктрины. Меня можно назвать своего рода эклектичным экономистом, вобравшим в себя идеи различных школ. Я всегда начинаю выражать недовольство, когда

кто-то пытается меня поместить в какую-то определенную «ячейку».

**Бланшар:** Насколько тесно вы общались с теми, кто в то время работал над общей теорией равновесия?

**Корнаи:** Совместно с Тамашем Липтаком я написал работу о двухуровневой системе планирования, которую потом напечатали в журнале *Econometrica*. Эдмон Маленво прочитал нашу статью и пригласил меня принять участие в конференции в Кембридже. Это было в 1963 г. Но к этому времени мой паспорт был аннулирован. Много лет подряд меня, например, приглашали в Лондонскую школу экономики, но выехать я не мог.

В 1962–1963 гг. объявили всеобщую политическую амнистию. После чего режим Яноша Кадара начал постепенно двигаться от политики репрессий в сторону так называемого «гуляшного коммунизма», более мягкого, либерального варианта коммунистического строя. С того времени все больше людей стали получать возможность выезжать за границу. В итоге я тоже получил разрешение поехать на конференцию в Кембридж.

Там я встретил несколько по-настоящему гениальных людей. С Эдмоном Маленво и Тьяллингом Купмансом мы, можно сказать, подружились. Они оба стали моими наставниками и очень мне помогли. На конференции я также встретил Роя Рэднера, Лайонела Маккензи и Роберта Дорфмана. Это было мое первое знакомство с Западом. Затем в

1968 г. по приглашению Кеннета Эрроу, я приехал в Стэнфорд. К тому времени я уже подготовил черновик «Антиравновесия», который и показал Эрроу и Купмансу. Они прочли мой труд и были очень щедры на комплименты. Они не защищали общую теорию равновесия или что-то еще, что я критиковал – даже наоборот. В результате оба настаивали на том, чтобы я опубликовал книгу.

**Бланшар:** Вероятно, они разделяли ваши взгляды...

**Корнаи:** Да, они во многом со мной согласились. Оба потом ссылались на мою книгу в своих нобелевских лекциях.

**Бланшар:** В своей книге «Антиравновесие» вы задаете несколько направлений для исследования. Спустя 27 лет с момента выхода книги были изучены многие вопросы: асимметричность информации; описание фирм с точки зрения теории игр; договорные отношения на рынке труда; роль государства и законов; невыполнение договоров и т. д. Вы довольны сегодняшним состоянием экономической науки?

**Корнаи:** Очень интересный вопрос, но прежде чем ответить на него, я бы хотел добавить еще один пункт в ваш список. Сегодня большой интерес проявляется к невальрасовой модели экономики, и это была одна из проблем, рассматриваемых мной в «Антиравновесии».



**Рис. 4.3.** Представление президентского обращения в рамках североамериканских встреч Эконометрического общества в Чикаго в 1978 г. Слева от Яноша Корнаи – Тьялинг Куп манс, председатель этой сессии

Возвращаясь к вопросу, доволен ли я сегодняшним со-

стоянием экономической науки, могу сказать одно. Да, я ощущаю большее удовлетворение состоянием науки сегодня, чем раньше. Когда я писал книгу, я думал, что необходимо попытаться дистанцироваться от идей неоклассической теории, которая казалась мне смирительной рубашкой в неменьшей степени, чем революционное мышление. Но жизнь доказала, что я ошибался. Прогресса можно достичь эволюционным путем намного чаще, чем я представлял себе.

Мне хотелось бы добавить еще пару слов личного характера. Я доволен тем прогрессом, который мы наблюдаем в изучении перечисленных нами направлений. Как автор книги, я немного огорчен тем, что эта работа не нашла должного отклика. Первыми и практически последними были высказывания Эрроу и Купманса, а затем все как-то сошло на нет.

**Бланшар:** Это была очень важная книга. На моей родине, во Франции, она стала одной из немногих, которая получила широкую известность. Об этом мало кто говорит, но ваша книга стала частью общедоступных знаний. То же самое случилось со многими другими вашими идеями. Может быть, это и означает успех...

**Корнаи:** Может быть, вы и правы, а может – и нет. Не знаю. В любом случае, мне кажется, что, задавая вопросы по теме, вы тем самым вряд ли упрочите свою репутацию, по крайней мере, в нашей профессии. Однако я все же верю, что для исследовательского процесса очень важно задавать вопросы по теме, даже если никто не сможет дать на них кон-

структивного ответа.

**Бланшар:** Как раз вопрос по теме. Как вы ощущали себя тогда и сейчас по отношению к господствующим западным экономическим течениям? Стали ли они вам ближе после того, как вас пригласили работать в Гарвард в 1986 г.?



**Рис. 4.4.** Конференция на корабле во время путешествия по реке Янцзы, Китай, 1985 г. Среди участников – Джеймс Тобин и Отмар Эммингер, экс-президент Бундесбанка

**Корнаи:** Если в двух словах, то можно сказать, что мои исследования лишь наполовину принадлежат главным направлениям в экономической науке. Общественная наука, на мой взгляд, не является набором конкретных утвержде-

ний об устройстве мира – это когнитивный процесс. Я уверен, что основные экономические течения, особенно сформулированные, сложившиеся неоклассические теории, играют важную, но пока еще ограниченную роль в этом процессе. Я бы выделил три основных этапа в когнитивном процессе. Сначала вы чувствуете, что есть какая-то научная загадка, и пытаетесь решить ее, основываясь в большей степени на здравом смысле и интуиции. Затем наступает следующая стадия, когда в процесс включается неоклассическая теория, которая пытается помочь отшлифовать вашу мысль с помощью разного рода предположений, определений и утверждений. Завершает процесс третий этап – интерпретация полученных результатов. На мой взгляд, то, что мы называем основными экономическими течениями, очень полезно и применимо на второй стадии процесса, но от них мало толку на первой и последней стадиях. Это не просто критика того, что экономисты – последователи основных течений, пишут и публикуют, а в большей степени критика того, как мы учим наших молодых и будущих коллег. Мы не учим их тому, что связано с первой и третьей стадией процесса, вместо этого мы слишком большой акцент делаем на вторую стадию и таким образом заставляем их мыслить ограниченно.

**Бланшар:** Я бы сказал, что скорее традиционный подход в экономической науке складывается сначала из того, что вы делаете что-то самостоятельно, потом публично, а третья стадия становится все более системным процессом.

**Корнаи:** Я согласен с тем, что вы сказали, но лишь отчасти. Формулирование правильного вопроса и попытка его решить на основе здравого смысла – это, бесспорно, делается самостоятельно. Если на ранней стадии исследователь будет связан со специальной терминологией и у него не будет возможности для публичных обсуждений научной загадки, его мышление будет весьма однобоким. Мы, скорее всего, обсудим далее проблемы посткоммунистического переходного периода, но сначала позвольте мне привести пример. В свое время шло активное обсуждение преимуществ градуализма как наиболее эффективного подхода к реформированию экономики по сравнению с теорией большого взрыва. Сегодня же вы можете найти немало прекрасных работ по теории большого взрыва. И одновременно существует масса интересных работ, рассказывающих о преимуществах градуализма. И что?!

В конце концов контекст определяет, как тот или иной феномен должен быть интерпретирован. А мы пока не учим наших студентов применять на практике теоремы и утверждения исходя из контекста. Вот почему многие западные экономисты, активно выступавшие в качестве советников правительств восточноевропейских стран и России в реформировании системы, в определенный момент осознали, что все зависит от контекста. Они не были к этому готовы, несмотря на то, что у них была очень хорошая база экономических знаний. У них не хватало знаний в области политоло-

гии, социологии, психологии, истории и т. п. Вы можете получить степень ученую степень в Гарварде или Массачусетском технологическом институте, не углубляясь в изучение этих предметов. И это не вина неоклассического подхода. Он предлагает программу рабочих исследований. Но с точки зрения развития мышления он односторонний и слишком узкий.

**Бланшар:** Что ж, пойдём дальше. В 1980 г. вы опубликовали работу «Экономика дефицита» (Economics of Shortage). После «Сверхцентрализации», за которую вас уволили и вам пришлось заняться математическим планированием, а также «Антиравновесия», изменившего вас в интеллектуальном и политическом плане, вы вновь возвращаетесь к проблемам соцсистемы. Вы уже касались этой темы, но не хотели бы поговорить об этом подробнее?

**Корнаи:** Да, конечно, мои предпочтения в работе с годами менялись. С одной стороны, какое-то направление было для меня постоянным, как например, устойчивый феномен невальрасового состояния экономики, особенно, при социалистической экономике дефицита или рынке продавцов. Я рассматривал эти проблемы в «Антиравновесии». Примерно треть книги посвящена вопросам, касающимся рынка продавцов в сравнении с рынком покупателей. В 1972 г. я написал книгу «Гонка или гармоничный рост», критикующую сталинскую модель роста. В этой книге я выступил против идеи несбалансированного роста. Но, с другой стороны, вы

совершенно правы – с годами я переключился на вопросы, которые связаны с политикой в большей степени.



**Рис. 4.5.** Вручение юбилейного сборника в Коллегии Будапешт в январе 1998 г. Слева направо – Янош Корнай, профессор Йено Колтай и доктор Янош Гакс

И тому было много причин. Прежде всего, Венгрия медленно, но верно двигалась в сторону ослабления ограничений на свободу слова. Другой причиной можно считать мою растущую мировую известность, прежде всего за счет работ по математической экономике и математическому планиро-

ванию. Все это давало мне пространство для маневра у себя на родине. У меня был принцип – если я чувствовал, что в том или ином случае у меня были определенные ограничения, то я старался повысить эту ограничительную планку еще процентов на 20. И хотя общая тенденция того времени в Венгрии все же была направлена на постепенное расширение ограничений, я все же старался быть выше их. Такая стратегия позволила мне раскрывать в своих книгах хронические проблемы существовавшей системы, но одновременно держаться в рамках определенных политических табу.

**Бланшар:** Вы упоминали о том, что в 1956 или 1957 г. вас уволили. Вы потом вернулись?

**Корнаи:** Да, я вернулся. Самое смешное в этой истории, что один и тот же директор прославлял меня до октября 1956 г., потом осудил и уволил, а после 1956 г. пригласил обратно в Институт экономики – и я вернулся. Еще одна типичная для того времени вещь – это определенная последовательность событий: сначала я стал членом Американской и Британской академий и только затем – членом Венгерской академии наук. Я стал приглашенным профессором в Стэнфорде и Йеле, а уже после этого меня пригласили вести семинар в Будапештском экономическом университете, который, к слову, так и не предложил мне постоянного места профессора. Но власти Венгрии знали обо всем, что со мной происходит, поэтому они представляли степень моей востребованности за рубежом, что в итоге расширяло для меня воз-

возможности, связанные с публикацией работ.

**Бланшар:** Табу, которое вы упоминали, касалось роли коммунистической партии?

**Корнай:** В то время в Венгрии существовало четыре табу. (В России и Чехословакии – намного больше). Во-первых, вы не можете ставить под сомнение принадлежность Венгрии к Варшавскому договору. Во-вторых, не обсуждается монополия на власть коммунистической партии. В-третьих, вы не вправе отрицать доминирующую роль государственной собственности. И, в-четвертых, нельзя критиковать Маркса. В отличие от России и Чехословакии, в Венгрии никто от вас не ждал, что вы будете говорить не то, что на самом деле думаете, – лишь бы показать свою лояльность. Вам было необходимо не затрагивать этих четырех вопросов.

Каждый должен был сделать свой тяжелый выбор – как жить дальше. Я говорю об этом, поскольку сегодня это отнюдь не очевидно. Одни решали уходить в подполье и публиковать работы в виде «самиздата», таким образом избегая табу, – что и сделали некоторые мои друзья. Я восхищался их смелостью. Цена такого выбора – отказ от более широкой аудитории. Другие выбирали побег за границу. Я выбрал совсем иной путь, как и некоторые другие представители венгерской интеллигенции. Я публиковал свои мысли официально, но многое недоговаривал. Это тоже было рискованно, особенно в моменты ухудшения общей политической ситуации в стране: например, при частичной реставрации стали-

низма это могло закончиться увольнением и даже арестом. Это также было не менее рискованно и в обычной политической обстановке того времени. Путь, который я выбрал, заставил принять меня очень сложное решение: я должен был скрывать некоторые свои идеи и взгляды. Я никогда не лгал. Я всегда писал только правду или то, как я действительно думал, но умышленно всей правды я не писал. У меня оставалась надежда, и, наверное, вполне оправданная, что многие читатели прочтут между строк все недосказанное. Иногда я даже пытался делать намеки, и – вполне возможно – небезуспешно.



**Рис. 4.6.** Совещание Научно-консультативного совета Европейского банка реконструкции и развития, Будапешт, 1992 г. Слева направо: Жан-Поль Фитусси, Кеннет Эрроу,

Я написал «Экономику дефицита» в Швеции, где мы с женой много обсуждали во время наших продолжительных прогулок по лесу, какие главы *не* стоит включать, какой должен быть конец у книги и пр. Если вы внимательно прочтете вступление, то найдете темы, которые я намеренно исключил из обсуждения – в том числе монополию политической власти коммунистической партии и вопрос государственной собственности. Этим я хотел сказать своим читателям, что «знаю, что есть и другие вопросы, которые необходимо обсуждать; и пусть это будет вашим домашним заданием». Я горд тем, что многие читатели, в том числе из Китая, России и Польши, уже после 1990 г. признавались мне: они понимали, о чем я пытался сказать в этой работе.

**Бланшар:** Если бы вам надо было определить основной вклад «Экономики дефицита» в развитие экономической мысли, это могло бы быть введение понятия «мягкое бюджетное ограничение»? Сегодня, когда социализм как экономическая система практически не существует, насколько актуально это понятие? Какова его концепция?

**Корнай:** Давайте разделим вопрос на две части. Сначала вы спросили меня, каков, на мой взгляд, основной вклад работы и сразу же перешли к вопросу мягкого бюджетного ограничения. В то время для читателя в Восточной Европе, России или Китае теория мягкого бюджетного ограни-

чения не была столь важна. Для него главной идеей книги была мысль о системности дисфункциональных свойств социализма. Я хочу особо подчеркнуть, что этот посыл позволял мне дистанцироваться от остальных так называемых реформаторов, которые пытались внести лишь небольшие изменения в коммунистическую систему. И с такой точки зрения это революционная книга, ее главный вывод – косметические изменения и поверхностные реформы не смогут ничего изменить. Вы должны изменить всю систему, избавиться от ее дисфункциональных свойств. Это и есть главный посыл книги. И я думаю, что он оказал большое влияние. Люди в коммунистических странах намного меньше интересовались мягкими бюджетными ограничениями, им была интересно это главное утверждение. Вот почему книга выдержала три издания в Венгрии, было продано 100 000 экземпляров в Китае и 80 000 в России...

**Бланшар:** Получается, что тиражи ваших книг превышали тиражи некоторых триллеров?

**Корнаи:** Да, только гонорары за триллеры обычно больше. Я не получил ни цента за 100 000-ный тираж в Китае, только письмо от местного издателя, который информировал меня о том, что моя книга была признана «бестселлером года в номинации non-fiction». Из России я тоже мало что получил. Здесь самое главное – политическая и интеллектуальная отдача, а не денежное вознаграждение. Я был счастлив, что мои идеи дошли до столь широкого круга читателей.

Концепция же мягкого бюджетного ограничения оказала большее влияние на Западе, чем на Востоке. Она согласовывалась с неоклассической теорией, и в то же время немного отходила от нее и развивала ее. Думаю, поэтому моя концепция была и остается актуальной. Возможно были и другие важные открытия в моей работе, но я не связывал результаты со стандартной неоклассической теорией и поэтому не получил широкого отклика от моих коллег.

Отвечая на вторую часть вопроса по поводу мягкого бюджетного ограничения, хочу сказать, что это актуально не только для соцсистемы. Этот феномен широко распространен и практически доминирует при социалистической экономике, особенно при проведении рыночно-социалистических реформ, когда система становится менее жесткой и больше ориентирована на получение прибыли. Очень жаль, однако, что общая обоснованность концепции до конца не признана. По моему мнению, в несоциалистической рыночной экономике также очень много примеров, аналогичных синдрому мягкого бюджетного ограничения. Мой бывший студент из Лондонской школы экономики Чэн Ган Сюй сейчас пишет работу, посвященную анализу кризиса в Восточной Азии и использует эту же концепцию для описания происходившего там. Взаимоотношения между государством, банками и корпорациями показывают наличие признаков синдрома мягкого бюджетного ограничения. Помощь ненадежным заемщикам в Японии, Корее и Индонезии со сто-

роны Международного валютного фонда – а они слишком большие, чтобы позволить им упасть, – опять же представляет собой пример использования мягкого бюджетного ограничения. Поэтому я считаю применение моей концепции во многих случаях обоснованной: в здравоохранении, в промышленности, везде, где государственный, финансовый и промышленный секторы так или иначе связаны друг с другом.

**Бланшар:** Я думаю, что сегодня у идеи мягкого бюджетного ограничения гораздо более широкое поле применения, чем вы очерчиваете. Безусловно, ее использовали и для описания азиатского кризиса. Но какое влияние оказала ваша работа внутри социалистического блока – как на реформы предпереходного периода, так и на сам переходный период?

**Корнаи:** Я думаю, что все ведущие реформаторы в соц-странах прочли «Сверхцентрализацию», и книга оказала какое-то влияние на их образ мыслей. Далее, они также изучали экономические реформы, которые прошли в Венгрии в 1968 г. К примеру, Китай взял венгерский опыт за образец, когда в 1970-е гг. руководство страны проводило реформы. Таким образом, опосредовано, но я оказал все же некоторое влияние на реформы. Как это всегда бывает с любого рода влиянием в интеллектуальной сфере, очень трудно его разделить на свое и чужое, поэтому я не могу определить точно свой вклад в этот процесс.

В любом случае, это влияние материализовалось только

по прошествии большого отрезка времени – 10 или даже 20 лет с момента появления моей книги («Сверхцентрализация»). Ко времени начала первых рыночно-социалистических реформ в Венгрии, а затем в Китае, Польше и Советском Союзе, я уже отказался от идеи рыночного социализма. Я стал очень критично относиться к этой идее, делая акцент на ограничения реформирования социалистической системы. В таком духе были написаны все мои статьи по реформам в Венгрии, но, что более важно, таким должно было стать заключение, которое сделал бы читатель «Экономики дефицита». Один из моих друзей назвал подобное отношение к реформам «скептицизмом к преобразованиям». В 1970-х и 1980-х гг. такое скептическое отношение стало нарастать и в Восточной Европе. Это стало еще одним подтверждением того, что частичных реформ недостаточно. Думаю, что в осознании этот факта есть и моя доля участия.

**Бланшар:** Читая «Социалистическую систему» (The Socialist System, 1992), я так до конца и не понял, какую часть кризиса вы предсказали до, а какую объяснили после. Предчувствовали ли вы, каким будет переходный период на самом деле?

**Корнаи:** Позвольте мне сказать несколько слов о самой книге, прежде чем мы начнем обсуждать вопрос верных и неверных прогнозов. «Социалистическая система» – это попытка описать систему целиком, что было непростой задачей, поскольку в большинстве книг рассматривается лишь

тот или иной аспект системы. Великим первооткрывателем этой «парадигмы системы» был конечно же Карл Маркс, который описал ее в «Капитале».

**Бланшар:** А как насчет Шумпетера?

**Корнаи:** Работы Шумпетера, его взгляды на предпринимательство и созидательное разрушение оказали на меня огромное влияние. Конечно, в своей книге «Капитализм, социализм и демократия» (Capitalism, Socialism and Democracy) он старается дать комплексный анализ обеих систем. Но эти две книги и еще ряд работ (например, Людвиг фон Мизеса и Фридриха фон Хайека) просто исключительные. В типичном американском учебнике по экономическим системам не пишут о капитализме так, как я писал о социализме. Он не дает вам представление об общей модели капитализма, включая описание политической, идеологической и социальной составляющих.

**Бланшар:** Он не является междисциплинарным.

**Корнаи:** Да, вы правы. При написании книги я стремился охватить все взаимосвязи и взаимозависимость между политической структурой, идеологией, отношением к собственности, а также поведением различных субъектов – одним словом, системные характеристики. А также показать динамику системы.

Несмотря на то что я начал работу над книгой только в 1986–1987 гг., ее основные идеи и структура уже давно были у меня в голове. Что мой анализ соцсистемы предсказал – в

отличие от других – так это то, что «лоскутные» реформы не усилят, а, наоборот, ослабят систему. Главная идея книги заключалась в следующем: классическая, сталинская система, какой бы она ни была репрессивной и brutальной, была более гармоничной и логически последовательной, чем более свободная полуреформированная горбачевская система, подверженная эрозии. И я предсказал эту эрозию. Но что я не мог предвидеть, так это ее скорость и срок. Должен признаться, что события 1989–1990 гг. были для меня совершенной неожиданностью. Я не представлял, что развал советской системы произойдет так быстро. Это превзошло мои ожидания.

К концу 1980-х гг. стало ясно, что венгерская версия системы быстро разрушается. Но для меня память о событиях 1956 г. в Будапеште и 1968 г. в Праге до сих пор жива, поэтому я не думаю, что мои опасения по поводу вмешательства России были безосновательны. Русские танки сделали бы свою работу снова, как в 1956-м или в 1968-м. Поэтому важнейшим фактором были масштабы преобразований в Советском Союзе, а не в Восточной Европе. Позвольте мне повторить: я не ожидал, что разрушение системы, начавшееся при Горбачеве, будет таким скоротечным.

**Бланшар:** Допускали ли вы, что в Венгрии все пройдет не лучше, чем в Чехии или Польше? Можете ли сказать сегодня, почему? Помогли ли предыдущие реформы Венгрии после смены системы?

**Корнаи:** Не думаю, что можно подходить ко всем с одной меркой и говорить, что тот лучше, а этот хуже. При проведении странового анализа в первую очередь необходимо смотреть на стартовые условия, и из этого исходить в своей оценке изменений в стране. Я уже упоминал в «Социалистической системе», что макроэкономика в странах, где проходили реформы, была хуже, чем в странах, где реформ не было. И причина этого проста и очевидна. Венгерское руководство хотело вернуть лояльность граждан к системе с помощью популистских мер. Как только в стране начались рыночно-социалистические реформы, появились проблемы на макроуровне: высокая инфляция, растущий дефицит бюджета, увеличение спроса на кредиты, отрицательный торговый баланс и необузданный рост внешнего долга. Наглядно это можно представить, если сравнить Венгрию и Чехословакию. Относительно либеральная Венгрия, в которой проходили реформы, имела самый высокий размер долга на душу населения среди стран бывшего соцлагеря. Венгрия создала для своих граждан самую щедрую систему соцобеспечения и тратила на нее огромные деньги. В работе, которую я написал в 1992 г., я назвал Венгрию страной преждевременных социальных благ, поскольку, несмотря на свою бедность, страна тратила на соцобеспечение в процентном соотношении столько же, сколько и Швеция, что еще больше ухудшало ее макроэкономические показатели. Одновременно, более склонный к репрессиям чехословацкий лидер Гу-

став Гусак не поддавался искушению провести реформы.

Таким образом, счет в игре был не в пользу Венгрии. Чем более глубокими были реформы, тем хуже становилось состояние макроэкономики в стране. Это означает, что в какой-то мере у Венгрии стартовые условия были намного хуже, чем у Чешской Республики.

С другой стороны, реформы оказали также и положительное воздействие. На микроэкономическом уровне особое влияние имели такие факторы, как право на частную собственность, хорошо работающее законодательство, наличие прослойки топ-менеджеров и кадровых ресурсов, понимающих принципы работы рыночной экономики. Все это позволило привлечь в Венгрию иностранные инвестиции. В конце концов можно сказать, что в этой стране реструктуризация экономики прошла лучше, чем где-либо. Поэтому надо всегда осторожно давать оценку тем или иным изменениям.

**Бланшар:** Ваш тезис, что ситуация на макроуровне может быть хуже, а на микроуровне лучше, очень интересен и важен.

**Корнаи:** Совершенно верно. Но это видно только тогда, когда вы рассматриваете сразу несколько показателей, например, уровень реструктуризации, технологических изменений, приток иностранного капитала и новых технологий и т. д., а не останавливаетесь на анализе одного из них.

**Бланшар:** Могло ли мягкое бюджетное ограничение в предпереходный период привести к более мягкому бюджет-

ному ограничению и в постпереходный период?

**Корнаи:** Давайте вернемся к сравнению Венгрии и Чехии. Венгрия больше себя проявила в области усиления бюджетных ограничений. Она была первой страной в Восточной Европе, где появился по-настоящему жесткий закон о банкротстве – наряду с законами по бухгалтерскому и финансовому учету и банкам, соответствовавшие западным стандартам. Именно в результате появления нового законодательства в стране прокатилась волна банкротств. Безусловно, это повысило уровень эффективности производства в Венгрии, но и одновременно вызвало рост безработицы. Кто-то может спросить, это хорошо или плохо. В любом случае, в Чехии наблюдался невероятно низкий уровень безработицы. Но я не уверен, что в постсоциалистической экономике низкая безработица сама по себе является достоинством.

**Бланшар:** Я тоже не уверен. Что вы думаете об экономических исследованиях, посвященных переходному периоду? Насколько правильные вопросы там рассматривались?

**Корнаи:** Западные экономисты, заинтересовавшиеся переходным периодом, задавали правильные вопросы, но список проблем, которые они изучали, был неполным. Так или иначе, проблема не в вопросах, а больше в ответах. Порой ответы на вопросы были слишком упрощенными. Очень часто они рассматривались вне реального политического и социального контекста, хотя тщательный анализ мог бы помочь распознать правильные и ошибочные ответы, а также их со-

ответствие сегодняшней ситуации.

**Бланшар:** Был ли это способ быстро получить знания на основе собственного опыта? Изменились ли исследования в лучшую сторону, скажем, если сравнивать 1990 и 1992 или 1993 гг.?

**Корнаи:** Быстрых улучшений качества исследований не было, и тому были причины. Во-первых, многие эксперты приезжали в Восточную Европу, поскольку считали: сделать это необходимо. Они просто сказали себе: «А почему бы не посоветовать какой-нибудь из этих стран, что следует делать». Они приехали и уехали. Только малая часть из них сохранила свой прежний энтузиазм и веру в то, что они делают. Они и стали экспертами в этой области. Я не думаю, что таких людей много за пределами Восточной Европы или что они работают с такими организациями, как Всемирный банк или МВФ, у которых существуют свои проблемы. Во-первых, в подобных организациях довольно странная практика назначений: если вы, например, эксперт в области посткоммунистических реформ, то вас могут, отправить, скажем, в Кению или Колумбию. Это сильно затрудняет процесс исследований. Во-вторых, предполагается, что эксперты должны быть вне политики, то есть быть технократами, в то время как большая часть исследуемых ими вопросов по определению сильно увязана с политикой. Каждый их совет содержит скрытую или явную оценку.

**Бланшар:** Могли те, кто занимался изучением соцсисте-

мы в этих же странах и за их пределами, используя свои знания, как-то помочь процессу реформирования?

**Корнаи:** Большинство экономистов в Восточной Европе были во многом не готовы решать проблемы, которые возникли во время переходного периода. Я имею в виду Восточную Европу в целом. Возможно, Венгрия и Польша были в лучшем положении, чем другие страны, так как за несколько лет до преобразований они занялись вопросом повышения качества экономического образования у себя. Однако большинство тех, кто занял определенные посты, были плохо подготовлены к выполнению подобной работы. И хотя многие западные экономисты не понимают политических и социальных особенностей стран переходного периода, многие из восточноевропейских коллег не понимали определенных вещей в экономике, а это, на мой взгляд, намного хуже. (Я даже не уверен, понимают ли они политические и социальные проблемы.) Многие из них имеют прекрасное образование, обладают хорошей интуицией, получили отличные навыки управления еще во времена социалистической системы или полурыночной экономики, но они не экономисты. Только немногие из них получили серьезное образование в западных университетах. Те, у кого хорошая база знаний в экономической сфере, сегодня занимаются исследованиями. Некоторые даже пытаются получить место преподавателя в каком-нибудь западном университете. Конечно, пройдет еще много лет, прежде чем мы догоним в этом от-

ношении Запад.

Вместе с тем я считаю, что знания у экономистов – как на Западе, так и на Востоке – односторонние. И больше всего меня расстраивает то, что вместо объединения идей наблюдается недоверие сторон друг к другу, их нежелание дискутировать. Очень редко команды формируются таким образом, чтобы знания каждого из членов дополняли друг друга. Но как бы то ни было, такой вид взаимодействия необходим.

**Бланшар:** Вы считаете, что лет через десять Центральная Европа будет выглядеть так же, например, как Португалия или Италия? Или политическое и экономическое наследие социализма будет продолжать действовать?

**Корнаи:** Думаю, будет своего рода конвергенция. Но также думаю, что мы увидим следы прошлого – как можно их увидеть в Японии, наблюдая в настоящее время все, что происходит в стране. Япония так и не стала похожа на Соединенные Штаты или Великобританию, как любая латиноамериканская страна не похожа на мусульманскую.

Думаю, что в дальнейшем в центральноевропейских странах сохранятся идеалы, ценности и ожидания, доставшиеся в наследство от ушедших времен, а также социальные нормы, которые, возможно, впоследствии и исчезнут. В обществах этих стран сохраняются идеалы равенства в распространении доходов. Они до сих пор сидят глубоко в сознании людей. Существует сильное сопротивление реформам, например, со стороны государственной системы соцобеспечения,

что в определенной степени соответствует западноевропейским традициям, в частности Германии или Австрии и даже Франции или Швеции. А также со стороны всего сообщества. Когда в стране аристократическое общество сменяется буржуазным, связи между аристократами все равно остаются. Думаю, что люди, принадлежащие бывшей социалистической элите, в большинстве своем уже забыли о том, что написано в «Манифесте коммунистической партии», но сохранили связи со старыми товарищами. Сегодня такие связи очень сильны в бизнесе, политике, культуре. Те, кто знал друг друга при старой системе, знают, кто друг, а кто враг, и это невозможно разрушить за один день. Однако десять лет – это относительно короткий срок. Задайте этот вопрос лет через 20 или 30.

**Бланшар:** Многие из этих людей, занимающих новые посты, кажутся весьма компетентными.

**Корнаи:** Существует естественный отбор – если вы некомпетентны, наличие только нужных друзей недостаточно, поэтому вы либо уходите на пенсию, либо переходите на более заурядную работу. Но если у вас есть правильные друзья, плюс определенные способности и таланты, тогда вы можете выполнять и новые роли. В любом случае, несмотря на то что эти особенности и установки будут сохраняться еще долго, посткоммунистические страны станут «нормальными» капстранами.

## **Литература**

Dorfman, R., Samuelson, P.A. & Solow, R.M. (1958) *Linear Programming and Economic Analysis*. New York: McGraw – Hill.

## 5. Интервью с Франко Модильяни

9

**Беседовали Уильям Барнетт**

*Канзасский университет*

и

**Роберт Солоу**

*Массачусетский технологический институт*

5–6 ноября 1999 г.

Франко Модильяни оказал большое влияние на такие научные сферы, как экономика и финансы. И хотя многие достижения в этих областях чаще всего со временем теряли свою силу, исследования Модильяни, наоборот, приобретали все большую актуальность. Его знаменитая статья о предпочтении ликвидности, написанная в 1944 г., не только оставалась в программе обязательного чтения для нескольких поколений экономистов-кейнсианцев, но и стала частью списка работ, на которые ссылаются все экономисты. Его выводы о гипотезе потребления и сбережений в процессе жизненного цикла дали первый толчок для встраивания в макроэкономику конечных моделей жизненного цикла и сыграв

---

<sup>9</sup> Впервые опубликовано в *Macroeconomics Dynamics*, 4, 2000, p. 222–256. Copyright © 2000 Cambridge University Press. В период подготовки интервью Уильям Барнетт преподавал в Вашингтонском университете в Сент-Луисе.

ли основополагающую роль в развитии в макроэкономике модели перекрывающихся поколений, созданную Морисом Аллэ, Полом Самуэльсоном и Питером Даймондом. Работы Модильяни и Миллера, посвященные структуре капитала и стоимости предприятия, изменили сферу корпоративных финансов и оказали сильное влияние на последующие исследования в области инвестиций, оценки доходности финансовых активов, а также на недавние исследования, связанные с практикой применения деривативов. Модильяни получил премию памяти Нобеля по экономике в 1985 г.

В макроэкономической политике Модильяни до сих пор сохраняет свое влияние на обоих континентах. В США он сыграл ведущую роль в создании эконометрической модели общенациональной экономики по заказу Федеральной резервной системы (ФРС), также он довольно часто принимает участие в заседаниях ученых-консультантов при Совете управляющих ФРС, которые проходят два раза в год в Вашингтоне. Его влияние в Европе особенно очевидно: в Италии, например, практически каждый житель считает его знаменитостью, поскольку о нем постоянно рассказывают СМИ. В других странах Европы Модильяни стал известен благодаря совместной работе видных европейских и американских ученых, вышедшей под названием «Манифест экономистов по вопросу безработицы в странах Евросоюза». Под ним подписались ряд известных экономистов, а ряд других высказали документу свое одобрение.

Интервью с Франко Модильяни было составлено из двух бесед, состоявшихся в разное время в разных местах. Первое интервью провел Роберт Солоу в загородном доме Модильяни на острове Мартас-Виньярд. Далее расшифровкой первого интервью и проведением второй беседы занимался Уильям Барнетт. Вторая встреча состоялась в квартире Модильяни, расположенной на верхнем этаже небоскреба с видом на реку Чарльз недалеко от Гарвардского университета в Кембридже (штат Массачусетс). Беседа продолжалась 2 дня с перерывами на ланч и изумительное эспрессо, приготовленное самим Модильяни в специальной кофеварке. Подобная кофеварка могла принадлежать только человеку, который относился к кофе очень серьезно. Несмотря на то, что значение работ Модильяни для экономистов и финансистов очевидно, только его студенты осознают его влияние в полной мере. Роберт Шиллер из Йельского университета в своем письме по поводу публикуемого интервью выразил это как нельзя лучше, обратившись к Модильяни со словами «мой герой».



**Рис. 5.1.** Франко Модильяни (дата неизвестна)

**Барнетт:** В своем разговоре с Робертом Солоу вы отметили, что мало чему научились в период своего студенчества в Италии и поэтому перебрались в Соединенные Штаты. Не могли бы вы подробнее рассказать, когда вы покинули Италию и почему?

**Модильяни:** После войны в Эфиопии и интервенции фашистских держав в Испанию во время гражданской войны мои антифашистские настроения становились все сильнее. Я решил уехать из Италии. Последним, что меня подтолкнуло, был тесный союз Муссолини и Гитлера, который привел к принятию антисемитских законов и сделал невозможным проживание в Италии тех, кто желал сохранить уважение к себе. К тому времени я уже познакомился со своей будущей женой, Серенной – мы были обручены. Ее отец также разделял антифашистские настроения и собирался покинуть Италию. И когда приняли эти законы, мы упаковали свои чемоданы и уехали во Францию. В 1939 г. мы провели несколько месяцев во Франции, готовясь отбыть в Соединенные Штаты. Мы покинули Францию в августе 1939 г. в день подписания известного всем пакта между Гитлером и Сталиным, который в результате все равно привел к нападению Германии на Россию. Я приехал в Америку, не имея никаких предварительных договоренностей с каким-либо университетом. Мне очень хотелось изучать экономику. Я получил стипендию от Новой школы социальных исследований отчасти бла-

годаря тому, что в школе было много представителей интеллигенции, которые придерживались антифашистских взглядов. Один из таких известных эмигрантов-антифашистов, Макс Асколи, мне и помог получить стипендию.

**Барнетт:** Франко, я так понимаю, после того, как вы покинули Италию, вы потом вернулись в страну, чтобы защитить диссертацию. Насколько рискованным был такой шаг?

**Модильяни:** Да, это правда. К тому времени как мы уехали из Рима в Париж, я уже сдал все экзамены, но диссертацию не защитил. В июле 1939 г., перед тем как отправиться в США, я решил все же получить степень и вернуться в Рим, чтобы защитить диссертацию. Это было небезопасно, к тому времени меня могли уже запросто арестовать. Я поддерживал связь с антифашистами в Париже, и поэтому существовала реальная угроза преследования – я мог оказаться в тюрьме. К счастью, ничего такого не случилось. Мой тесть очень волновался, и мы договорились, что в случае какой-либо опасности он подаст знак. Мы условились, что будем спрашивать, как дела у дяди Бена. Если он чувствовал себя неважно, то мы должны быть готовы уйти. Если он умер, то мы должны уйти немедленно. Нам так ни разу и не понадобился этот условный знак, но я не чувствовал себя спокойно до тех пор, пока не защитился и мы не уехали в августе в США.

**Барнетт:** Известный художник и скульптор Амедео Модильяни родился в Италии в Ливорно в 1884 г. и умер в Па-

риже в 1920 г. Он ваш родственник?

**Модильяни:** Мне не известны какие-либо сведения о нашем родстве.

**Солоу:** Франко, первое, о чем я хотел бы поговорить, это о вашей работе «Предпочтительность ликвидности и теория процента и денег» («Liquidity Preference and the Theory of Interest and Money»), опубликованной в *Econometrica* в 1944 г. Вам тогда было 25 лет?

**Модильяни:** Да, около того. Когда я учился в Италии, я мало что получил из практических знаний. Нам не преподавали ту экономику, которую можно было бы использовать на практике. Нам лишь рассказывали что-то о корпоративном государстве. Поэтому все, что я узнал, я узнал уже в Новой школе социальных исследований в Нью-Йорке под руководством Джейкоба Маршака.

**Солоу:** Когда это было?

**Модильяни:** Это было с 1939 по 1941–1942 гг.

**Солоу:** И вашим руководителем был Яша Маршак?

**Модильяни:** Яша Маршак был моим наставником. На его занятиях мы изучали Кейнса и *общую теорию*. Я посещал два различных семинара, но в дополнение ко всему получил от него много полезных советов и огромную поддержку. Он советовал мне, что читать, и убедил в необходимости использования математического аппарата – я прошел курс вычислительной математики и тщательно изучил великую книгу всех времен «Математический анализ для эконо-

мистов» (Mathematical Analysis for Economists), написанную Роем Алленом, и серьезно изучал статистику, посещая лекции Абрахама Вальда в Колумбийском университете. Кроме того он помог мне принять участие в удивительном неформальном семинаре, где помимо Маршака выступали такие люди, как Тьяллинг Купманс и Оскар Ланге. К моему большому сожалению, Маршак в 1942 г. уехал из Нью-Йорка в Чикаго. Его заменил не менее выдающийся человек Абба Лернер. Мы с ним часто беседовали о Кейнсе. В то время Лернер продвигал идею так называемого функционального финансирования.

**Солоу:** Да, это известный принцип.

**Модильяни:** Функциональное финансирование и подвигло меня к написанию статьи в 1944 г. В функциональном финансировании только фискальная политика могла влиять на совокупный спрос. Таким образом, это и была экономика, которую я позднее назвал кейнсианской. Я пытался спорить с Лернером и доказать ему, что Кейнс об этом не говорил. Первопричиной статьи, вышедшей в 1944 г., и была попытка показать идеи Кейнса в перспективе.

**Солоу:** Находясь под покровительством Маршака или Лернера, прочли ли вы что-нибудь о более ранних математических моделях кейнсианской экономики, например, работы Хикса или Оскара Ланге?

**Модильяни:** Да, я был знаком с их работами. Как вы можете увидеть по моим публикациям, они оказали на ме-

ня влияние. Работа Хикса, посвященная Кейнсу и классическим теориям, – это грандиозная вещь. Она стала отправной точкой для моей статьи за исключением того момента, что Хикс жестко рассматривал заработную плату как данную величину и какие-либо альтернативы не допускал. Это была раз и навсегда определенная система.

**Солоу:** Позднее он дал ей название – «модель с фиксированными ценами».

**Модильяни:** Фиксированные цены позволяли номинально использовать их, как если бы они были реальными, а денежную массу – и как номинальную и как реальную.



**Рис. 5.2.** Встреча лауреатов Нобелевской премии. Стокгольм, декабрь 1991 г. Слева направо – Кеннет Эрроу, Франко Модильяни, Пол Самуэльсон и Роберт Солоу

**Барнетт:** До приезда в Массачусетский технологический институт (MIT) вы успели поработать в целом ряде других американских университетов, в том числе в Новой школе социальных исследований, Женском колледже в Нью-Джерси (теперь Колледж Дугласа), в Бард-колледже при Колумбийском университете, в Чикагском и Иллинойском университетах, в Технологическом институте Карнеги (теперь Университет Карнеги-Меллона), в Северо-западном университете. Какой период своей жизни в США вы бы назвали наиболее продуктивным для вас – до того как вы приехали в MIT?

**Модильяни:** Наиболее продуктивными были, несомненно, те восемь лет или где-то около того (1952–1960 гг.), которые я провел в Технологическом институте Карнеги с исключительными преподавателями и студентами, под руководством двух выдающихся людей – декана факультета Джорджа Баха и Герберта Саймона. Я работал над новой учебной программой для бизнес-школ, писал интересные работы, некоторые из которых много лет спустя и были номинированы на Нобелевскую премию: работы о гипотезе потребления и сбережений в процессе жизненного цикла, а также совместные работы Модильяни – Миллера.

**Барнетт:** Я слышал, что когда вы преподавали в Новой

школе, вы получили предложение от экономического факультета Гарвардского университета, который в то время был лучшим экономическим факультетом в США. Но, к удивлению преподавателей, вы отвергли предложение. Почему?

**Модильяни:** Потому что глава факультета профессор Гарольд Бербанк, которого попросили пригласить меня на работу, был против и сделал все для того, чтобы я отказался. Как я узнал позже, Бербанк был ксенофобом и антисемитом. Он сказал, что я, возможно, не выдержу конкуренции с такими молодыми талантами, как Александер, Дьюзенберри, Гудвин. «Довольствуйтесь тем, чтобы быть большой рыбой в маленьком пруду», – ему не понадобилось много времени, чтобы убедить меня отказаться. После разговора с Бербанком я встретился за обедом с Шумпетером, Хаберлером и Леонтьевым, которые уже были настроены на то, чтобы меня поздравить со вступлением в их ряды. Они здорово меня отчитали за то, что я поддался давлению со стороны Бербанка. Так или иначе, я никогда не жалел о своем решении. В то время в Гарварде платили мало, и, с точки зрения карьеры, я двигался намного быстрее, чем мне удалось бы в Гарварде.

# Конец ознакомительного фрагмента.

Текст предоставлен ООО «Литрес».

Прочитайте эту книгу целиком, [купив полную легальную версию](#) на Литрес.

Безопасно оплатить книгу можно банковской картой Visa, MasterCard, Maestro, со счета мобильного телефона, с платежного терминала, в салоне МТС или Связной, через PayPal, WebMoney, Яндекс.Деньги, QIWI Кошелек, бонусными картами или другим удобным Вам способом.

# Комментарии

1.

Хочу поблагодарить Билла Купера из Техасского университета в городе Остин, подсказавшего мне идею создания этой книги.

2.

Интервью ученых-статистиков можно найти в журнале *Statistical Science*, а интервью специалистов по эконометрии – в журнале *Econometric Theory*. Но обычно в этих интервью обсуждаются более узкие вопросы, соответствующие профилю журнала, а не общая эволюция экономической мысли.

3.

В письме, адресованном мне, Пол Самуэльсон написал: «Меня совсем не беспокоит, что моя проза обращена к наиболее эрудированным читателям. Роберт Браунинг сказал: "Человек должен постигать то, что выше его понимания, иначе к чему же тогда небеса?"» В связи с этим в своем вступительном слове Пол пояснил, что «специально не приводит знаменитые последние слова из «Общей теории». Тем не менее для тех, кто не отвечает установленным Полом высоким стандартам эрудиции, процитирую здесь высказывание Кейнса (издание 1936, с. 383–384), о котором Пол упоминает во

вступительном слове: «Люди, считающие себя совершенно свободными от каких-либо интеллектуальных влияний, обычно рабски привязаны к какому-нибудь экономисту прошлого. Безумие сумасшедших во власти, слышащих вокруг голоса, подпитывает какой-нибудь ученый писака, сочинявший несколько лет назад. Я убежден, что власть заинтересованных кругов сильно преувеличена по сравнению с властью постепенно распространяющихся идей... Рано или поздно, к счастью или нет, выяснится, что опасны именно идеи, а не заинтересованные круги».

**4.**

Интересно, что этому противоречит более свежее высказывание Лукаса (2000, р. 279): «Я разделяю широко распространенное мнение, что M1 – слишком узкий агрегат для этого периода [90-х годов], и думаю, что расчет показателей по методу Divisia скорее позволит решить эту проблему».

**5.**

Онлайновый отчет для прессы, подготовленный журналом Economic Journal Королевского экономического общества, можно найти в Интернете по адресу: <http://www.res.org.uk/society/mediabriefings/pdfs/1997/July/barnett.asp>.

**6.**

Это проявилось уже в опубликованных ранее (в 1984 г.) интервью со специалистами по макроэкономике, с которыми Арьо Кламер беседовал о том, что в то время называлось неоклассической экономикой, но теперь ассоциируется с кейнсианством, противопоставляемым такому направлению макроэкономики, как теория реального экономического цикла.

7.

Я заметил, что хотя и Перри Мерлинг, и Дэвид Коландер могут рассматриваться как специалисты по истории экономической мысли, оба они считают себя прежде всего экономистами.

8.

Частичным исключением являются интервью, взятые специалистами по изустной истории у экономистов, работавших в разное время на администрацию президента США. В этом случае историки в Национальных архивах нередко интервьюируют экономистов или следят за тем, как их интервьюируют, и передают пленки и записи на хранение в соответствующую президентскую библиотеку. Например, есть серия интервью Уолтера Хеллера, Кермита Гордона, Джеймса Тобина, Гарднера Экли и Пола Самуэльсона, взятых в 1964 г. и записанных Джозефом Печманом (из института Брукингса) для программы изустной истории

библиотеки Кеннеди (Barber, 1975).

## 9.

Хотя я и не буду развивать здесь эту мысль, должен отметить, что в этих интервью обсуждение биографии интервьюируемого сводится, как правило, к выяснению того, при каких обстоятельствах он сделал свой вклад в экономическую науку. Поэтому мы не обнаруживаем в них обычного для мемуаров излишнего внимания к первым годам взрослой жизни (Вайнтрауб, 2005).

## 10.

Другие способы, которыми специалисты по истории экономической мысли могут создавать подобные истории, подробнее обсуждаются в работах Вайнтрауба 1999 г. и 2002 г. (pp. 256–272).

## 11.

В интервью Самуэльсона я обратил внимание на его особую роль в подготовке доклада Буша.