

Итак, можно отметить, что наряду с общей для стран переходной экономики целью – добиться коренного преобразования экономики, каждая страна на этом пути пользуется различными методами, достижения при этом их различны. Практика показала, что переход к рыночной экономике оказался более сложным, продолжительным и противоречивым, чем ожидалось. Кроме того, все чаще, теоретиками и практиками-экономистами подчеркивается необходимость более сбалансированной внешнеэкономической политики, ориентирующейся не только на страны с развитой рыночной экономикой, но и на восстановление и развитие экономических связей со странами СНГ.

Методологические проблемы эконометрического моделирования в условиях формирования рыночных отношений

Хацкевич Г. А., докт. экон. наук, профессор, ИУП, г. Минск

Эконометрический подход к изучению социально-экономических процессов традиционно осуществляется на основе: вербальных моделей экономической теории; статистической информации; методов обработки полученной информации, разрабатываемых математической статистикой. Методология эконометрического моделирования служит для решения двух основных задач: 1) проверки обоснованности экономических моделей, отслеживающей соответствие модельных расчетов реальным наблюдениям за поведением показателей макроэкономики; 2) экспертной поддержки, необходимой для выработки рациональных управленческих решений. Попытка создания исчерпывающей системы моделей, охватывающей широкий спектр экономических взаимосвязей, неизбежно влечет за собой снижение точности и надежности выводов. Традиционно для построения эконометрической модели необходимо выполнить шесть основных этапов: 1) постановочный; 2) априорный; 3) параметрический; 4) сбора информации; 5) идентификационный; 6) верификационный. Для получения достоверных выводов предполагают наличие следующих ограничений: 1) отсутствие систематических ошибок в наблюдениях, позволяющее элиминировать влияние случайной переменной путем усреднения; 2) отсутствие автокорреляции в случайной переменной модели; 3) отсутствие неодинаковой точности изменения экзогенных переменных в различные моменты времени проведения моделирования; 4) отсутствие коллинеарности экзогенных переменных; 5) отсутствие резких изменений в структуре или параметрах модели (разладка) в процессе наблюдения за переменными модели.

Проблема обработки неоднородных наблюдений за макроэкономическими показателями, которая связана с влиянием на рыночные механизмы

директивных решений, принимаемых органами управления, заключается в нарушении указанных выше условий. Поэтому возникают проблемы смещения в оценках параметров модели, мультиколлинеарности экзогенных переменных, автокорреляции эндогенной переменной, разладки структуры и параметров модели, вследствие которых традиционные методы моделирования теряют свою состоятельность. В известных работах представлены модифицированные методы эконометрического моделирования, которые сохраняют эффективность в условиях нарушений классических предположений. Кроме того, такие методы позволяют оценивать точность получаемых выводов в текущем времени и определять ретроспективную границу обоснованного учета показателей.

Заметим, что эконометрический анализ правомерен при исследовании экономических процессов, подверженных интенсивному влиянию случайных (неконтролируемых) факторов. К числу таких процессов прежде всего относится потребительский спрос в связи с наличием существенных колебаний конъюнктуры, отражающихся на доходах как потребителей, так и продавцов. Эконометрическое моделирование потребительского спроса реализуется в работе в соответствии с комплексным подходом, учитывающим основные факторы, которые оказывают влияние на совокупный потребительский спрос (рис. 1).

Традиционный эконометрический инструментарий не в полной мере оснащен методами обработки процессов, описывающих экономику переходного периода. Известен аппарат, позволяющий производить расчет и анализ социально-экономических процессов с помощью:

1) специальных методов, обеспечивающих выбор длины интервала группировки данных из равенства энтропийных функционалов выборочного и теоретического распределения дохода. Поскольку традиционное лог-нормальное распределение не всегда адекватно отражает распределение доходов, то проведены исследование и сделан анализ основных непрерывных вероятностных распределений дохода, для которых реализован метод оптимальной группировки;

2) оригинального метода, измеряющего влияние вертикальных связей экспортного производства на темп роста ВВП;

3) современных методов, оценивающих нестационарные социально-экономические процессы. Эти методы содержат нейронные сети, эвристические процедуры оценки динамики цен, аддитивные методы оценки инфляционных ожиданий потребителей.

Вышеуказанные методы позволяют обеспечивать оперативное исчисление параметров социально-экономических процессов, апробация которых проведена на рынках потребления Республики Беларусь.

На рис. 1 указаны три основных подхода.

1. Аналитический подход, основанный на использовании регрессионных моделей (на примере зависимости потребительского спроса от располагаемого дохода и цен).

2. Структурный подход, в основе которого лежит предпосылка о том, что каждой социальной группе населения присуща своя специфика потребления и спрос зависит только от дохода. Для реализации данного подхода выполнен анализ степени неравномерности доходов работников промышленности – крупнейшей отрасли экономики Республики Беларусь.

3. Конструктивный подход, основанный на принципе моделирования социально-экономических параметров в рамках детального исследования спроса путем формирования бюджетной функции, в соответствии с расходами на приобретение благ потребительской корзины.

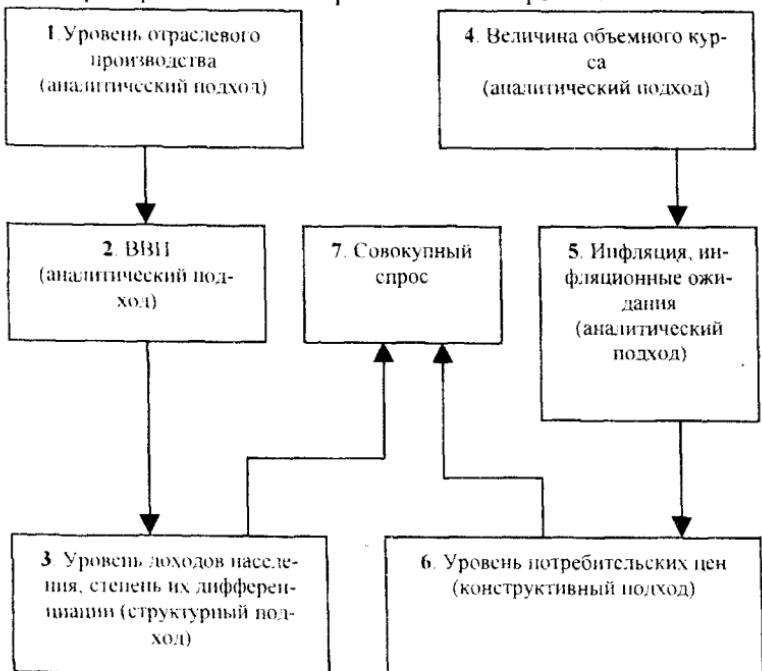


Рис. 1. Взаимосвязь основных факторов, обеспечивающих платежеспособный спрос населения

Проведенные исследования позволяют сделать вывод, что современные методы эконометрики, содержащие векторные модели с коррекцией ошибок, которые основаны на проверке коинтеграции нестационарных экономических временных рядов, должны сочетаться с эвристическими моделями, адекватными переходной экономике.