

ІСТОРІЯ ЕКОНОМІЧНОЇ ДУМКИ

УДК 330.88

Михайло Довбенко

ВИДАТНИЙ ДОСЛІДНИК ЕКОНОМІЧНОЇ НЕРІВНОСТІ

Викладено основні результати наукових досліджень Е.Дітона – лауреата Нобелівської премії за 2015 рік, американського вченого, відзначеного Нобелівським комітетом за посилення наукового розуміння різних аспектів процесу споживання, бідності і добробуту.

Ключові слова: лауреата Нобелівської премії за 2015 рік, процес споживання, бідність, добробут

JEL: N200.

За рішенням Нобелівського комітету премією Ріксбанку Швеції імені Альфреда Нобеля за 2015 рік відзначений один із провідних світових спеціалістів з мікроекономіки Е.Дітон. Цю престижну міжнародну нагороду він отримав за посилення наукового розуміння різних аспектів процесу споживання, бідності і добробуту.

Дітон Енгус Стюарт (Deaton Angus Stewart) народився 19 жовтня 1945 року в м. Единбург (Шотландія), на сьогодні має британське і американське громадянство. Навчався у Бристольському і Кембриджському університетах. Науковий ступінь отримав у 1974 році в Кембриджі, де і працював на кафедрі прикладної економіки разом з нобелівським лауреатом 1984 року Р. Стоуном. З 1983 р. трудиться професором економіки і міжнародних відносин Принстонського університету (США). Сфера наукових досліджень: здоров'я, добробут і економічний розвиток. Він автор і співавтор шести книжок та більш як півтори сотні наукових праць. У 2009 році був обраний президентом Американської економічної асоціації, є членом Британської королівської академії наук, Американського філософського товариства, Королівського товариства Единбурга та Американської академії мистецтв і наук. Він є членом Міжнародного Економетричного товариства і в 1978 році став першим лауреатом медалі Р.Фріша, заснованої цим товариством.

В економічному співтоваристві Е.Дітон є визнаним фахівцем функцій попиту. Враховуючи високу практичну важливість функцій попиту та їхню ключову роль в мікроекономічній теорії, не дивно, що вони вже тривалий час продовжують залишатися в центрі уваги науковців і практиків. Так, урядовці завжди враховують показники цінової еластичності при встановленні податків і тарифів. "Сила аналізу споживчого попиту, – зазначає Е. Дітон, – полягає в його тісному зв'язку з теорією і практикою, а важливі теоретичні завбачення були такими точними, оскільки вони забезпечували тісний зв'язок між теорією та інтерпретацією досвіду. Неможливо проводити прикладний аналіз попиту, не беручи до уваги одночасно як статистику, так і економічну теорію" (Deaton, 1986). Така точка зору панує в економетричній літературі, присвяченій аналізу попиту, особливо у дослідженнях про системне оцінювання функцій попиту, котрі у сукупності моделюють споживчі витрати.

Довбенко Михайло Володимирович (info@dovbenko.kiev.ua), д-р екон. наук; перший заступник Голови Комітету Верховної Ради України з питань фінансової політики і банківської діяльності.

Серед питань, що аналізував Е.Дітон у своїх ранніх працях (*Deaton, 1977*), була також проблема поведінки домашніх господарств і фірм як реакції на зміни у податковій політиці. Він прагнув більш точно в'яяснити роль оподаткування доходів фізичних осіб і побічних податків, а також одночасно проаналізувати оптимальну ставку податку на доходи фізичних осіб та оптимальну структуру податку на товари. Виявляється, що взаємозв'язок між цими податками є критичним: оптимальна структура податку на товари зовсім інша при оптимальному податку на доходи фізичних осіб, аніж при його відсутності.

У своїх дослідженнях науковці доводили, що випадок з диференціальним оподаткуванням залежить від похідних другого і вищого порядку функцій попиту (і від більш високих моментів розподілу). Зазвичай допустимі функціональні форми (як, наприклад, постійна еластичність) накладають сильні обмеження на ці похідні, однак дослідники не могли бути впевненими в тому, що дані, які отримані без цих обмежень, дозволяють їм визначити ці похідні з більшою точністю. Із цього Е.Дітон вивів завбачення, що необхідна більша обережність при використанні теоретичних результатів: "Ймовірно, що емпірично підраховані ставки податку, котрі ґрунтуються на економетричних оцінках параметрів, будуть визначатися структурно, а не вимірниками, які реально отримані, але на основі довільних, неперевірених (і навіть підсвідомих) гіпотез, вибраних науковцем для практичних цілей" (*Deaton, 1978*).

Значна частина ранніх праць Е.Дітона була присвячена в основному поведінковим патернам у витрачанні грошей, а також тому, як людям з різним достатком вдається поєднувати рівень доходів зі способом життя. Взагалі, багато сучасних дискусій з приводу державної політики зачіпають питання, що пов'язані з пропозицією праці. Так, наприклад, спори, що стосуються соціальних виплат, соціального страхування і системи податку на прибуток, частіш за все концентруються на стимулах до праці. Навіть макроекономічний аналіз безробіття і жорсткості (негнучкості) заробітної плати нерідко порушує мікроекономічні питання про вибір між дозвіллям і пропозицією праці.

Між тим уявлення про пропозицію праці має багато аспектів: кількісний і демографічний склад населення; питома вага населення у працездатному віці, яке трудиться за плату чи шукає роботу (цю величину ще називають рівнем участі в трудових ресурсах чи рівнем участі в робочій силі); кількість годин, відпрацьованих протягом тижня чи за рік; якість праці. Е.Дітон аналізував фактори, що впливають на рішення членів домогосподарств, особливо жінок, відносно того, чи працювати за плату, і якщо "так", то скільки годин. Економетричні інструменти, які він використовував, включають у себе різні процедури з обмеженими і цензурованими залежними змінними.

Водночас його дослідження фокусувалися на моделюванні більш зрозумілих факторів, що впливають на послідовну (впродовж життя) індивідуальну рівновагу пропозиції праці, вільного часу та споживання. Рішення простягнутої на все життя оптимізаційної проблеми часто називають динамікою індивідуальної рівноваги. Загальний підхід полягає в тому, щоб завбачити, що досконала визначеність і специфікованість "життєвої" (тобто протягнутої на все життя) корисності може бути представлена у вигляді адитивної сепарабельної функції корисності. Використання її давало таке: якщо вільний час є нормальним благом у кожний період часу, то із адитивної сепарабельності виходило, що проміжки вільного часу в різні моменти життєвого циклу повинні бути чистими знаменниками (підтримуючи постійну корисність упродовж усього терміну життя). Докладний розгляд цієї проблематики Е.Дітон провів у 1974 році (*Deaton, 1974*).

Працюючи з порівняльною динамікою, науковцям доводилося бути досить акуратними у виборі того, що слід зафіксувати. Впродовж багатьох років вони використовували один загальний підхід, названий "фрішівським

λ-фіксованим"¹, що вивчає ефекти змін часових траєкторій рівноваги залежно від коливань, скажемо, рівнів заробітної плати, вбачаючи при цьому життєву граничну корисність початкового капіталу (λ) фіксованою. Е.Дітон запропонував альтернативну процедуру, названу "λ-варіювання". Вона допускає варіювання λ як реакцію на вимірювання в рівнях заробітної плати (Martin, Angus, Margaret, 1985). У кожному з цих випадків можна показати, що варіювання заробітної плати на будь-яку певну дату може мати наслідки не тільки для цього моменту часу, а й для інших моментів часу.

Варто відмітити, що праці науковців, у т.ч. Е.Дітона, в яких досліджуються фактори, що впливають на пропозицію жіночої праці, є гарним прикладом того, як взаємовплив економічної теорії, теорії вимірювань і економетричної техніки здатний підвищити наше розуміння важливих суспільно-політичних питань. Але ця література також показує, що, незважаючи на величезний прогрес в теорії, техніці і, до певної міри, у вимірюваннях, все ще досить складно домогтися точних оцінок таких важливих величин, як еластичність. Однак багато економетристів, які вивчають сферу пропозиції праці, налаштовані дуже оптимістично. Серед потенційно важливих віх досліджень є і напрацювання Е.Дітона у вивченні процесів прийняття рішень сім'ями (чи домашніми господарствами) та його аналіз значущості обмежень, що накладаються на кількість відпрацьованих годин (Deaton, Muellbauer, 1981).

Зміщення своєї уваги до опитувань спонукало Е.Дітона перейти від оцінки усереднених показників і величин до практичного аналізу індивідуальних даних різних сімей, особливо в частині споживання. Попередники молодого вченого і, зокрема, М. Фрідман, Ф. Модільяні ще в 1950-х роках обґрунтовували свої теорії та гіпотези відносно доходу, споживання і заощадження на загальних агрегованих даних для країни в цілому, використовуючи для зручності концепцію середньостатистичних громадян – репрезентативних споживачів. Розрахунки Е.Дітона показали, що оцінка агрегованих даних без поглиблення у деталі може дати неправдиві результати. Середній дохід є досить оманливим показником соціально-економічного розвитку держави, адже можливі як рівномірний розподіл доходів, так і широке відхилення доходів від середнього рівня, в результаті якого більшість населення виявиться за межею бідності.

Звідси у науковій літературі виник парадокс Дітона, який полягає в тому, що обсяги споживання в цілому змінюються не настільки різко, як коливаються сукупні доходи. Такий висновок, на перший погляд, суперечить гіпотезі на основі раціональних очікувань, згідно з якою все повинно було бути навпаки: раціональні споживачі, завбачуючи свої майбутні доходи, будуть брати споживчі та іпотечні кредити, різко збільшуючи обсяг власного споживання вище поточного рівня доходів, котрі залишаються відносно постійними та розтягнутими у часі. Е.Дітон доводить, що розгадка парадоксу – у недосконалої агрегованих даних, тоді як для кращого розуміння макроекономічних процесів необхідно опуститися до розгляду динаміки індивідуальних доходів і споживчих рішень на мікрорівні. На сьогодні такий підхід до глибшого аналізу економічних даних широко застосовується макроекономістами і вважається точнішим та ефективним.

Наукові праці Е.Дітона сприяли вирішенню складної практичної проблеми для економістів щодо визначення межі бідності та життєвих стандартів у різних державах. Існує два популярних варіанти визначення добробуту і бідності. Розрахунок середніх доходів – простий, однак досить неточний спосіб, адже офіційна статистика не враховує тіньових заробітків

¹ Ще має назву "питальна концепція Фріша". Вона названа в честь нобелівського лауреата Рагнара Фріша.

та їхніх сезонних коливань. Другий метод визначення відсотка бідного населення – через підрахунок обсягу споживання на індивідуальному рівні – технічно більш складний, однак краще відображає дійсність.

Замість сукупних статистичних даних про доходи громадян учений пропонує власні методики аналізу більшої кількості мікроданих про реальні споживчі витрати на рівні домогосподарств та їхніх груп. Такий підхід у дослідженні, незважаючи на високу вартість збирання інформації, має велике практичне значення в діяльності міжнародних фінансових організацій – донорів країн, що розвиваються. Знаючи, на купівлю яких товарів домогосподарства спрямовують додаткові доходи, отримані від закордонних донорів, можна краще організувати процес надання допомоги, максимально покращуючи ефект і забезпечуючи цільове використання виділених коштів.

Оцінка споживання людей у кілокалоріях та інших показниках реального обсягу отриманих благ у країнах, що розвиваються, дозволяє надати точніше визначення бідності. На основі дослідження мікроданих Е.Дітон зумів довести, що межа бідності не може бути однаковою для всіх держав і виражатися цифрою мінімального доходу. Розрахунок середнього доходу на людину не здатний відобразити реальну ситуацію, тому що діти споживають значно менше продуктів, ніж дорослі. При цьому в країнах з високим рівнем народжуваності діти становлять більшу частину населення, занижуючи середньостатистичну суму доходу на громадянина, яку в науковому співтоваристві порівнювали з потребами дорослої людини і некоректно оцінювали рівень бідності.

У 1997 році Е.Дітон опублікував комплексну працю (*Deaton, 1997*), в якій розглянув низку питань, пов'язаних з оцінкою моделей щодо кластеризованих даних опитувань про стандарти життя (*Living Standards Surveys*), котрі проводилися Світовим банком у країнах, що розвиваються. З його легкої руки мікроекономічні дослідження бідності і добробуту на основі даних домогосподарств стали популярними в роботі Світового банку, інших міжнародних організацій і активно використовуються фінансово-економічними блоками урядів багатьох держав світу.

У спільному з іншим нобелівським лауреатом Д.Канеманом дослідженні "Високі доходи покращують оцінку життя, але не емоційний добробут" Е.Дітон на основі аналізу опитувань 450 тис. американців дійшов висновку, що зростання рівня доходів і освіти підвищують самооцінку якості власного життя респондентами, але лише частково покращують їхній емоційний стан. Чому не сповна? Співавтори доводять: після досягнення суми річного доходу в 75 тис. дол. США попередній зв'язок між зростанням доходів і відчуттям щастя пропадає. Високі доходи приносять задоволення життям, але не дарують щастя; тоді як низькі доходи асоціюються з низькою оцінкою життя і з пригніченим емоційним станом. Так підсумовують нобелівські лауреати.

Неочікуваним для самого вченого відкриттям, яким він ділиться у статті "Фінансова криза і добробут Америки", став прямиий зв'язок між відчуттям добробуту американців і динамікою індексу акцій S&P500, хоча більшість жителів США не володіють портфелями відповідних цінних паперів. Е.Дітон пояснює виявлену залежність тим, що індекс S&P500 був найбільш яскравим індикатором стану колективної свідомості під впливом новинного фону, нагнітався засобами масової інформації. Для нас, українців, аналогічним тригером економічного добробуту до цих пір служить курс долара.

Ще одна наукова публікація нобеліанта "Дві головоломки про щастя" є щедрою на парадоксальні результати. Зокрема, чим вища релігійність штату, тим вищим є відчуття добробуту в його жителів, а також... рівень соціальних патологій: злочинності, паління, розводів, венеричних захворю-

вань і підліткової вагітності. Е.Дітон пояснює цей парадокс тим, що висока релігійність у неблагополучних регіонах США є скоріш не причиною, а наслідком, своєрідною реакцією на вороже середовище. Або ще один його цікавий висновок полягає в тому, що все вища гендерна автономія жінок асоціюється зі зниженням їхньої оцінки власного добробуту; причому якщо запитання сформулювати: чи приносить ваша свобода щастя? – більшість жінок декларують вищий рівень задоволеності життям, ніж у випадку запитання без фокусування на гендерній рівності. Не менш парадоксальним є його узагальнення про те, що сімейні пари, які мають дітей, демонструють нижче задоволення життям, ніж їхні бездітні колеги, хоча завжди запевняють дослідників, що діти приносять їм щастя і радість.

Своєрідним етапним підсумком його дослідницької діяльності є книжка "Велика втеча: здоров'я, багатство і походження нерівності" (Deaton, 2013). Оскільки ще не здійснений переклад українською мовою, то зупинюся на її основних положеннях. У ній викладена широка історія покращення здоров'я і матеріального добробуту людей в Америці і світі в цілому з давніх часів до наших днів. Під великою втечею автор розуміє втечу від бідності і хвороб. Цю втечу вже успішно здійснили деякі народи, більшість країн світу перебувають у процесі, а невеликій кількості менш вдалих – лише належить її почати.

Викладаючи історію і масштаб світового прогресу, а також його основні причини, Е.Дітон стверджує, що рятування від високої смертності було лише поверхово пов'язане з порятунком від бідності. На Заході основною причиною покращення здоров'я було не зростання особистого добробуту. Безпосередніми причинами цього було в більшій мірі покращення комунальних послуг, таких як водопостачання і каналізація. Стосовно країн, що розвиваються за останні 50 років на питання "Чи характеризуються країни, що швидко розвиваються, вищими темпами зниження дитячої смертності?" досить чітко звучала відповідь: "Ні". На шляху до прогресу, відмічає автор, в ім'я міжнародного контролю над зростанням населення організовувалися зовсім не обов'язкові вадливі дії. Це говорить ще про одну велику втечу: всі країни вибралися з мальтузіанської пастки доіндустріальної епохи, коли зростання населення зазвичай пов'язувалося з меншими доходами та гіршим здоров'ям.

У книжці докладно описуються рекомендації щодо політики допомоги найбіднішим верствам світового населення: скоротити бюджети в наданні допомоги. Е.Дітон стверджує, що фінансова допомога не сприяє зростанню. Насправді, щедра допомога стає перешкодою на шляху розвитку, який розбещує інституційні системи, дозволяючи керівникам держав правити без підтримки населення, оскільки немає необхідності стягувати з населення податки. При цьому автор підтримує деякі види допомоги і способи її надання – зокрема, фінансування розвитку нових технологій, включаючи, наприклад, ліки. Він також відмічає, що зовнішня допомога врятувала мільйони життів у найбідніших країнах, особливо завдячуючи зниженню рівня дитячої смертності від інфекційних захворювань. Але навіть роль допомоги в розвитку охорони здоров'я є обмеженою, оскільки вона не сприяє створенню базових систем охорони здоров'я.

Справді, складно довести, що в середньому допомога приносила користь економічному зростанню бідних країн. На думку Е.Дітона, інші, більш потужні інструменти світової політики, наприклад, ті, що стосуються міграції, лібералізації торгівлі і реформ субсидій, значно краще сприяють такому зростанню. Багато і, мабуть, більшість засобів, що виділялися в минулому для надання допомоги, було витрачено марно. Однак негативний вплив допомоги також не настільки є очевидним. Недавній аналіз, що проведений співробітниками МВФ, показує, що в бідних країнах з нерозвинутими інсти-

тутами допомога замінює податки приблизно один до одного, але в середньому для країн-отримувачів кожний долар отриманої допомоги знижує податки, що збирає уряд, усього на дев'ять центів. Також є свідчення того, що навіть у країнах, які залежать від фінансової допомоги з існуючою слабкою системою управління, допомога інколи сприяє створенню елементарної системи охорони здоров'я. За період з 2004 року по 2010 рік середня очікувана тривалість життя в Афганістані збільшилася з 42 до 62 років, у чималій мірі завдяки програмі, що фінансується Агентством США щодо міжнародного розвитку і проводиться міністерством охорони здоров'я. Завдяки цій програмі 90% населення отримало базові медичні послуги.

Заради мільйонів людей, котрим вдалося врятувати життя завдяки наданій допомозі та успішним проектам у багатьох секторах економіки різних країн, незважаючи на численні невдачі, систему надання допомоги необхідно реформувати, а не скорочувати. Такі реформи, разом з лібералізацією міграційної політики та посиленням рівності у торгівлі, могли б допомогти ще мільйонам людей здійснити свою велику втечу від злиднів і хвороб, про які так добре говорить тепер уже нобелівський лауреат Е.Дітон у своїй книжці і дослідженнях.

Література

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

Надійшла до редакції 06.04.2016 р.

A PROMINENT INVESTIGATOR OF ECONOMIC INEQUALITY

Mykhailo Dovbenko

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

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

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

JEL: N200.