



АНАЛИТИЧЕСКИЙ ЦЕНТР
ПРИ ПРАВИТЕЛЬСТВЕ
РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ

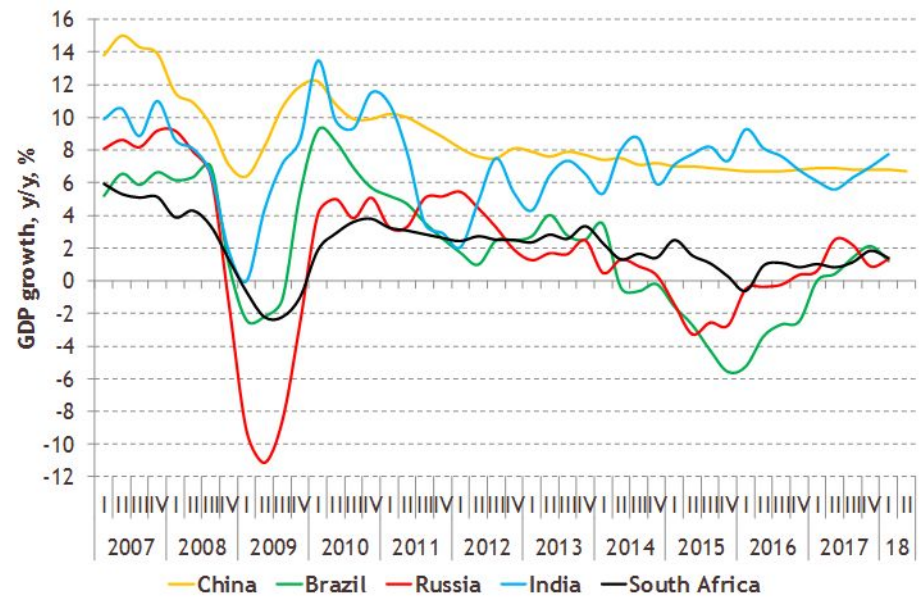
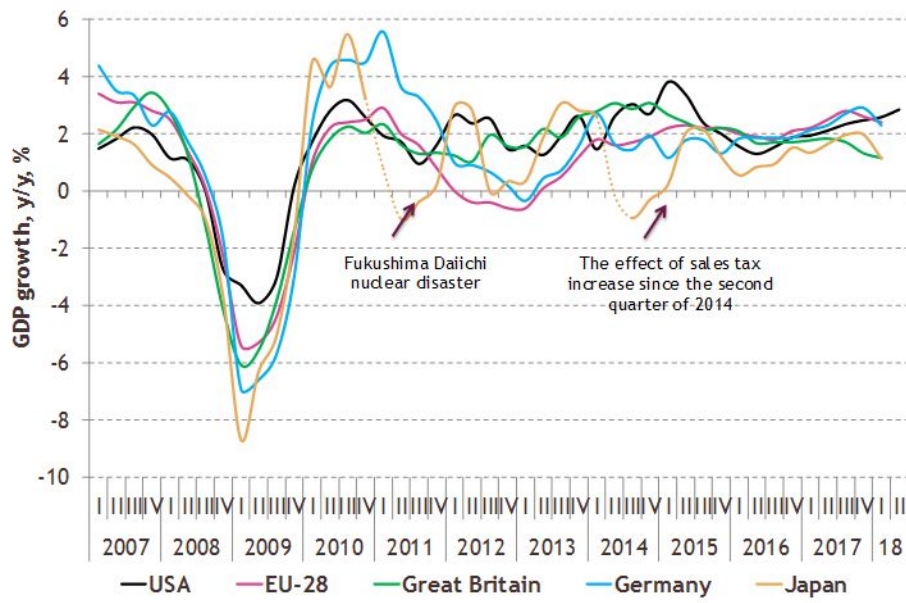
История экономики: от фактов к концепциям

Леонид Маркович Григорьев

www.leonidgrigoryev.com

Ординарный профессор
Главный советник руководителя
Аналитического центра при Правительстве РФ
26.09.2018

GDP Growth rates, quarterly, y/y, 2007–2018



Средние и средневзвешенные значения ВВП на душу населения по ППС и в текущих долларах (тыс. межд. долл. и тыс. долл. США), 174 страны, 1992 и 2016.

Кластер	Число стран	Население, млрд чел.	Среднее		Средневзвешенное	
			ППС	текущ.	ППС	текущ.
<i>1992</i>						
1	26	1,06	41,7	24,1	34,6	25,2
2	16	0,23	19,7	9,6	18,7	6,6
3	22	0,45	12,1	4	11,7	3,8
4	37	0,60	7,1	1,8	6,8	1,3
5	31	0,46	3,2	0,8	3,3	0,6
6	24	2,40	1,7	0,4	1,8	0,3
7	18	0,19	0,9	0,2	0,8	0,2
Всего	174	5,39	x	x	x	x
<i>2016</i>						
1	28	1,23	53,9	48,8	48,7	49,8
2	28	0,53	26,7	16,6	26,8	15,1
3	22	2,00	16,9	9,7	14,9	8
4	35	0,75	10,2	4,8	9,9	3,8
5	29	2,27	4,7	2,2	5,5	1,7
6	15	0,21	2,3	1,1	2,3	0,8
7	17	0,35	1,3	0,5	1,3	0,5
Всего	174	x	x	x	x	x

Источник: расчеты авторов по данным Всемирного банка.

Темы лекции:

- Экономический рост и демография за последние тысячелетия: войны, эпидемии, катастрофы. Темпы роста ВВП, разбросы – тенденции, коридоры, периоды, режимы.
- Рост у историков, рост у статистиков, макроэкономистов и институционалистов. Рост и колебания, тренды и кризисы.
- Правительства, Банки, инвесторы, ученые сначала меряют, потом прогнозируют, а СМИ и «любители новостей» сразу...
- Длинные ряды в истории и встряски на границах периодов: Великая Депрессия 1929-1933, Мировой Кризис 1975, Великая Модерация 1990х и Великая Рецессия 2008-2009.
- Горизонт планирования, инвестирования, займа (%% - история той же длины), встроенные циклы, контракты.
- Конвенции: стилизованные факты, повторяемость кризисов, «что есть кризис», потоки и запасы, зависимости по периодам...

Источники и объекты

- История и экономика сосуществуют вполне комфортно, но до появления статистической информации (контракты в церквях) и статистической обработки данных экономическая «наука» анализировала отдельные данные: бюджеты, торговля, налоги, долги, контракты – с 18 века.
- С 18 века: отчеты фабричных инспекторов (К.Маркс), таможенная статистика 18 века и т.п. Что есть факты, которые мы анализируем – как отбросить случайные колебания – шум. Интерпретация фактов стоит на конвенции экономистов или на работе «доверенных лиц» (НБЕР – цикл).
- Меняются эпохи, удлиняются статистические ряды – необходимо время от времени обсуждать факты, обсуждать их статистическую форму (очистка данных, реконструкция).
- Изоляция объекта исследования от смешения:
А) однородность; Б) институциональное описание (будем развивать по ходу курса); В) накопление информации; Г) переломы в статистике – разрыв рядов (войны и пр.).

Несколько важных идей

СТИЛИЗОВАННЫЕ ФАКТЫ

(Stylized facts - theorems are based on them)

Допущения относительно реальной действительности, считающиеся – по крайней мере приблизительно – верными. Примером является утверждение, что постоянная доля национального дохода приходится на труд. Хотя все агрегированные статистические показатели являются сверхупрощенными, а многие и неточными, они, по крайней мере, базируются на попытках измерить реальность; "стилизованные факты", напротив, вместо оценок используют догмы.

*Экономика. Толковый словарь. — М.: "ИНФРА-М", Издательство "Весь Мир".
Дж. Блэк. Общая редакция: д.э.н. Осадчая И.М.. 2000.*

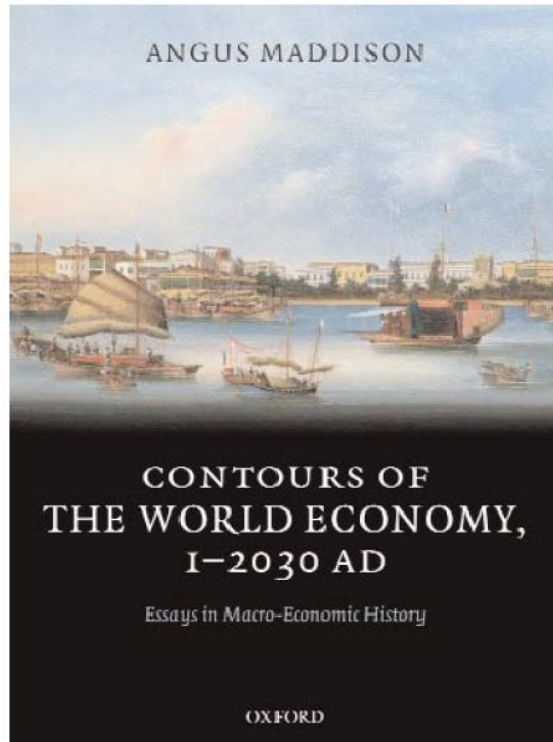
*Изменения в экономике постоянно меняют статистическое отражение деятельности людей, коэффициенты уравнений меняются. При резких Переменах возникает необходимость вновь обсуждать стилизованные факты
Доля личного потребления в мире 50-55%; в США – около 70% ВВП,
А в Китае меньше 40%*

Десятилетия и годовая статистика

- Длинные тренды, переломы в развитии
- Колебания = несколько типов циклов
- Потоки и запасы (Инвестиции и ОК)
- Госдолг Венеции, Контракты артелей в Англии
- ВВП и Личное Потребление
- Irreversibility of fixed assets
- Технологии и смены эпох – инвестиции
- Колебания и кризисы + войны и «чума»
- Чума 14 века как поворотный пункт истории Европы: крепостное право, Каталония,
- Квартальные, сезонка, индексы

Попытка реконструкции динамики мировой экономики

8



Contours of the World Economy 1-2030 AD

Essays in Macro-Economic History

Angus Maddison, Emeritus Professor of Economic Growth and Development, University of Groningen

Разные скорости развития стран

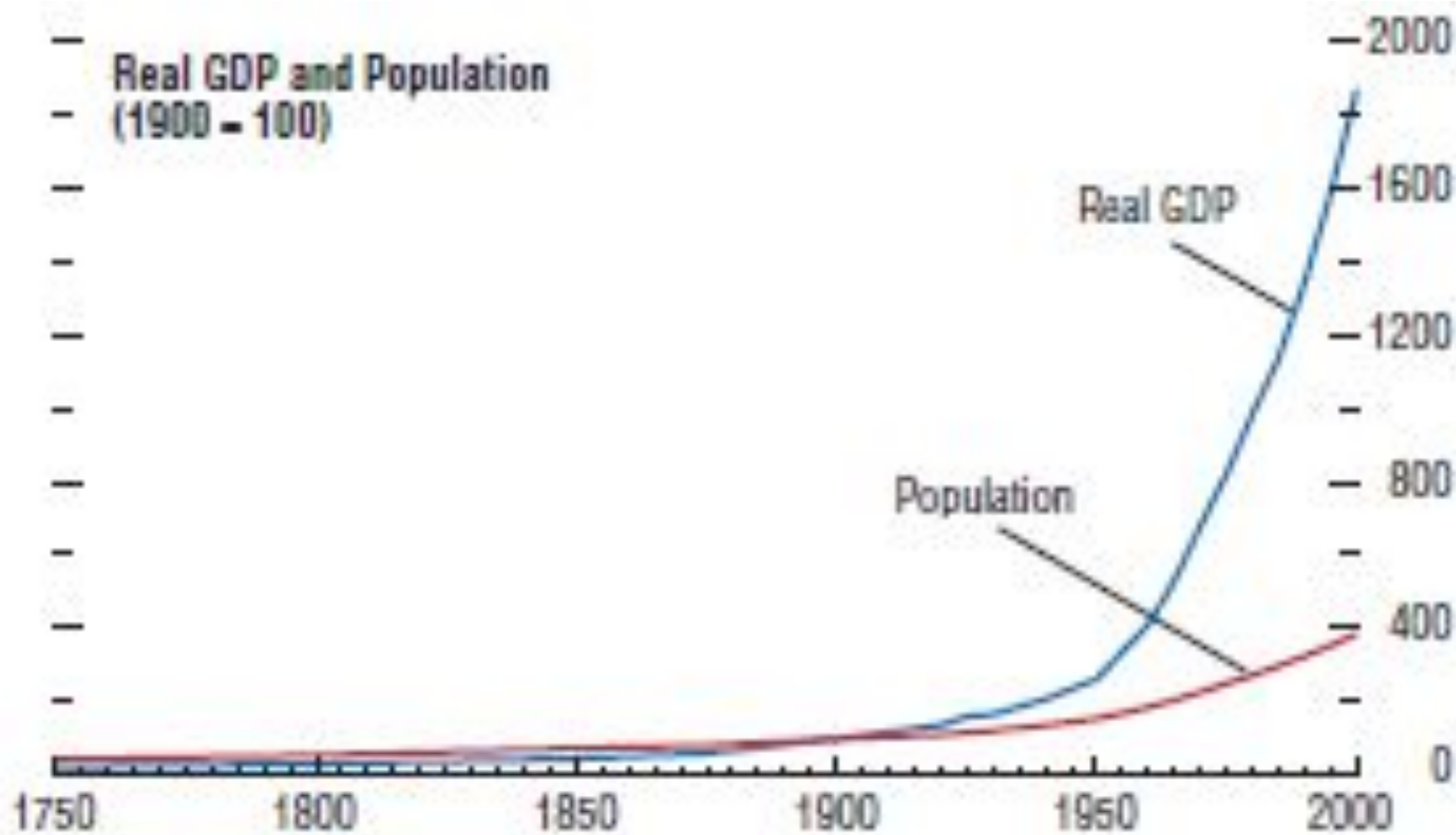
9

- Природные условия: Тропики, средняя полоса, холодный Север, Азиатская Степь, острова и удаленные континенты
- Первые государства и концентрация ренты
- Бродель о важности прибрежной полосы
- Технический прогресс от нужды и давки
- Месопотамия – Египет – Китай = движение НТП от Китая к Европе (и обратно) в полосе 30-53 Широты в Евразии!!!

Владивосток – Астрахань: 6300 км: 132 и 48 Вост. Долготы

- Эффекты Чингизхана и Чжэн Хе
- Скученная конкурентная христианская Европа
- Русь – в лесу между Степью и Европой

ВВП и численность населения мира

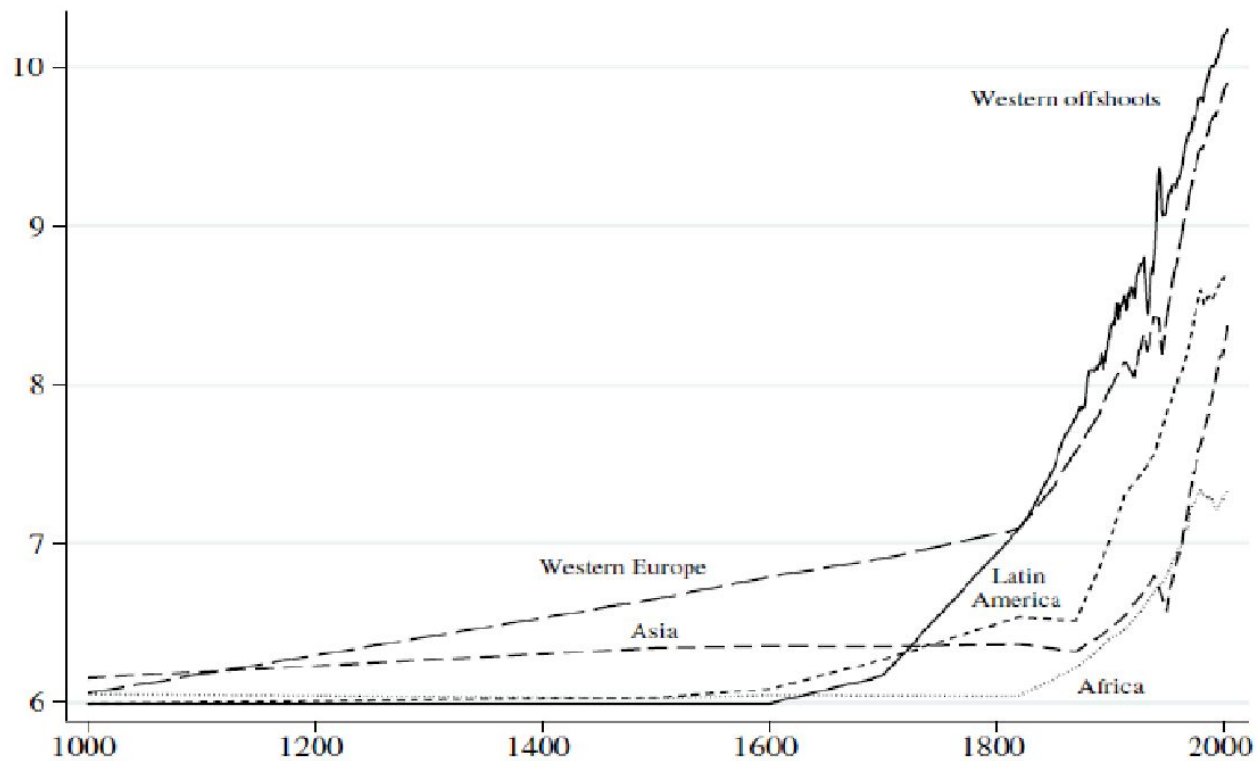


ВВП на душу населения

1000 – 2000, международные доллары, логарифм.
шкала

11

Log GDP per capita



Источник: Angus Maddison, 2001, <http://www.ggdc.net/MADDISON/oriindex.htm>

Социально-экономические параметры ряда стран мира, 2000 и 2014 годы

Показатель	Год	Россия	США	Германия	Бразилия	Испания	Польша
Рождаемость (на 1000 чел.)	2000	8,7	14,4	9,3	20,9	9,9	9,9
	2014	13,3	12,5	8,6	14,7	9,2	9,9
Смертность (на 1000 чел.)	2000	15,3	8,5	10,2	6	9	9,6
	2014	13,1	8,1	10,8	6,1	8,5	9,9
Расходы домохозяйств (% ВВП)	2000	46,2	66	57,1	64,6	59,7	63,6
	2015	51,9	68,4	54	63,4	57,6	58,7
Пользователи Интернета (из 100 чел.)	2000	2	43,1	30,2	2,9	13,6	7,3
	2014	70,5	87,4	86,2	57,6	76,2	66,6
Рабочая сила с третичным образованием (% от общего числа)	2000	24,8 (2002)	34,8	23,5	-	26,7	12,3
	2014	56,3 (2013)	33,8	27	13,4 (2013)	37,2	31
Продолжительность жизни (лет)	2000	65,3	76,6	77,9	70	79	73,7
	2014	70,4	78,9	80,8	74,4	83,1	77,3
Расходы на НИОКР (% ВВП)	2000	1	2,6	2,4	1	0,9	0,6
	2014	1,1 (2013)	2,8 (2012)	2,9 (2013)	1,2 (2012)	1,2 (2013)	0,9 (2013)

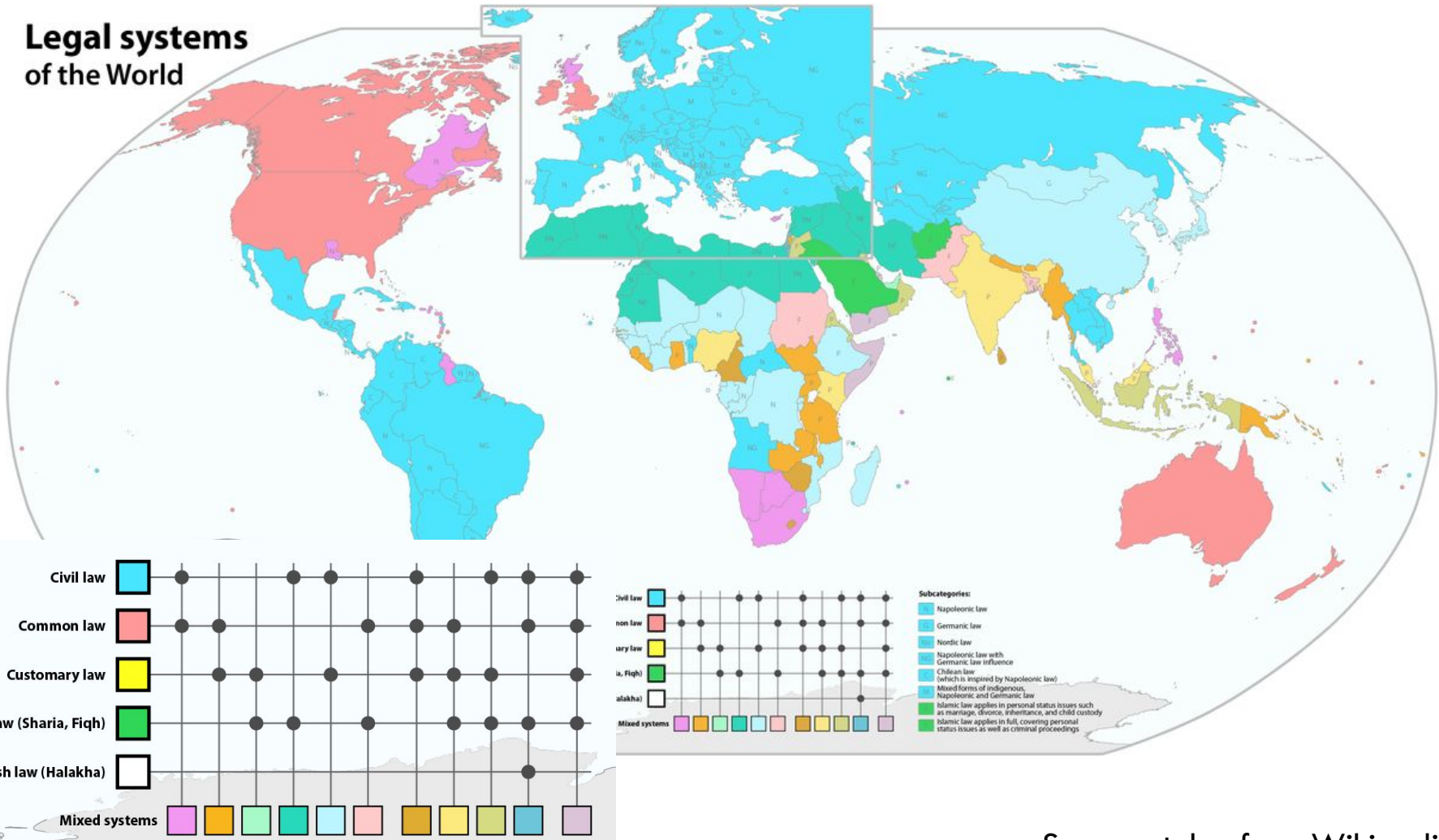
The Great Divergence

- Китай, Индия, Япония, Арабы оказались беззащитными против Европы и Турции в 15-16 века. Почему?
- Города и финансы 16-17 века (%%) – Koot (2013).
- Институты конкуренции и реинвестирования дозодов!?
- Pomerantz “The Great Divergence” (2000) – проблемы разрыва и отставания Азия в 1700-1870 годах – Азия отстала во времена Промышленной революции.
- Америка до Колумба и Африка – прерванное развитие. Что есть колониализм: уничтожение элит и институтов, вывод ренты, ресурсы.
- Что разное: говернанс, богатство и социальное распределение.
- Технологический прогресс в Европе в 14 - 20 вв.
- Застой в Китае, раздробленность в Азии
- Россия между Востоком и Западом: большие военные расходы

Legal Systems of the World

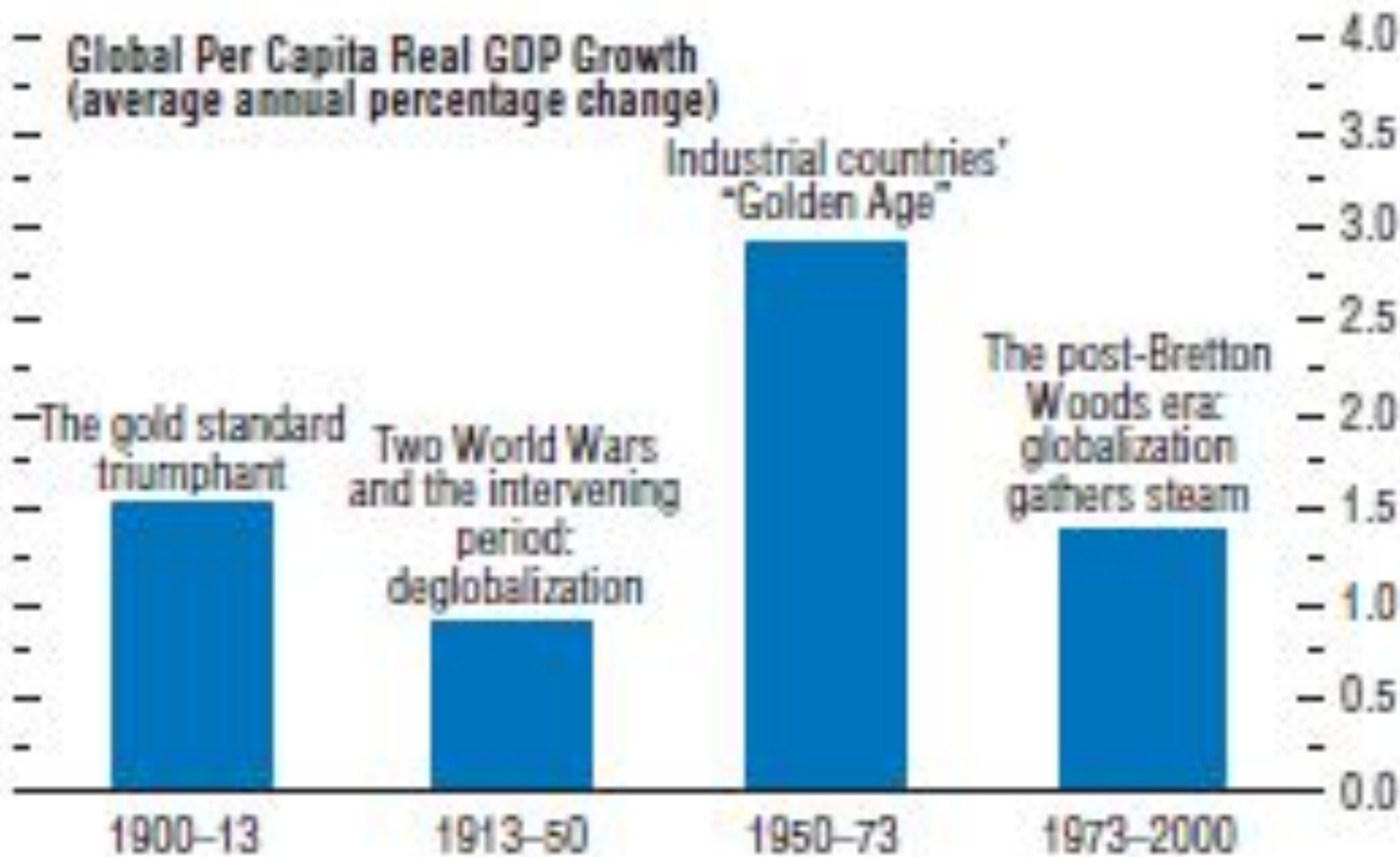
14

Legal systems of the World

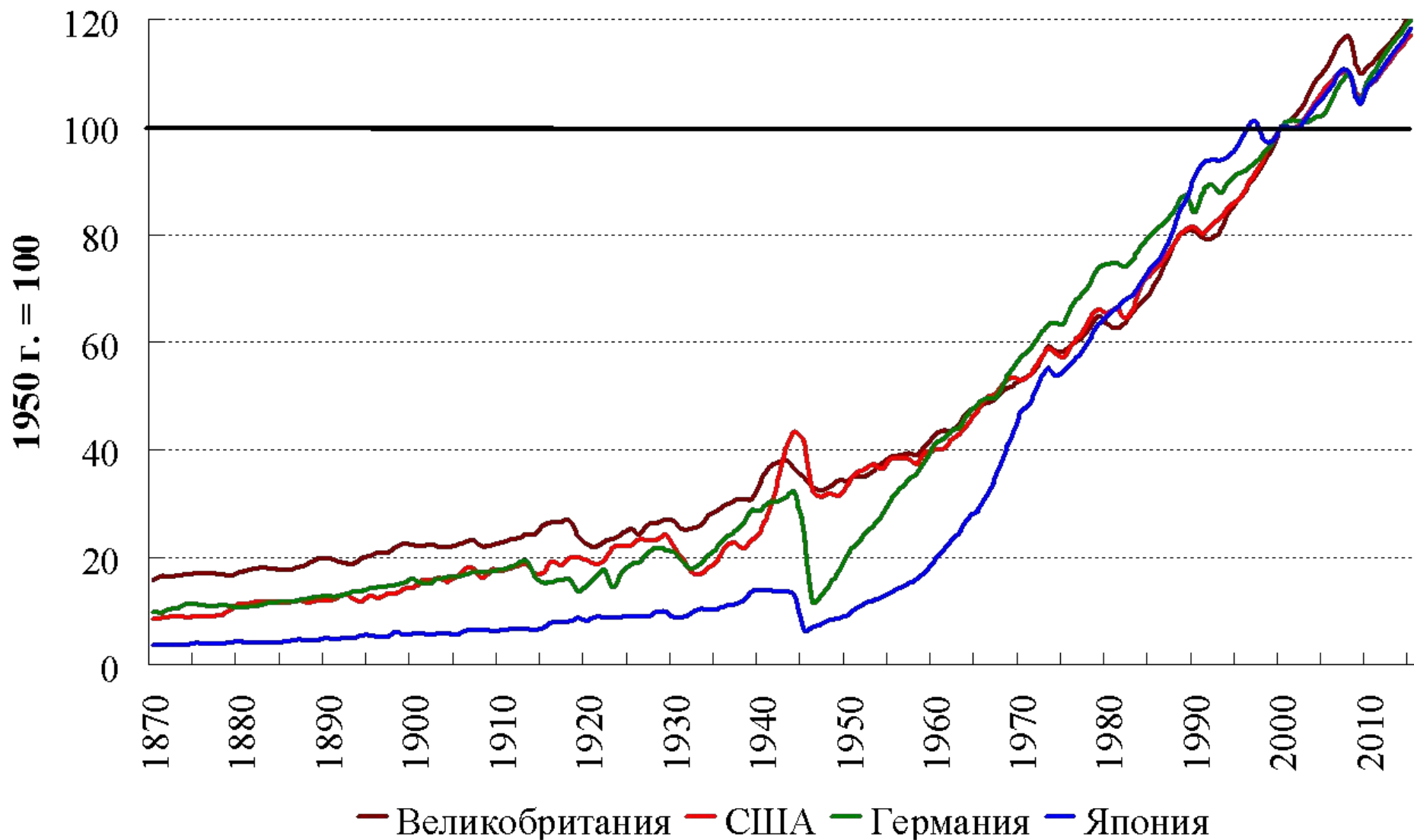


Source: stolen from Wikipedia

Прирост ВВП в 20 веке



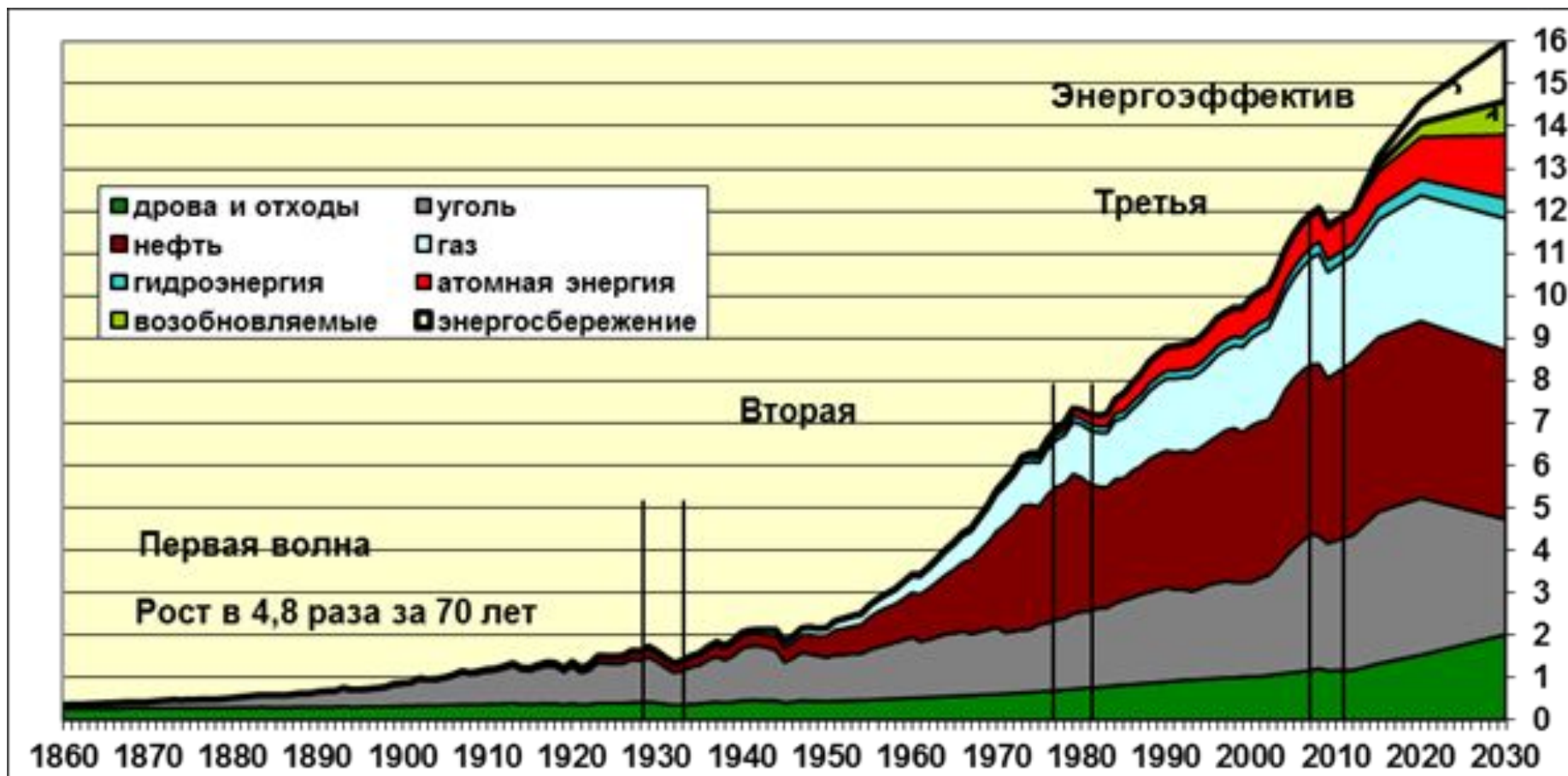
Динамика душевого ВВП развитых стран, 2000 г. = 100,
1870-2015п



Источник: ОЭСР, Всемирный Банк, оценки ИЭФ

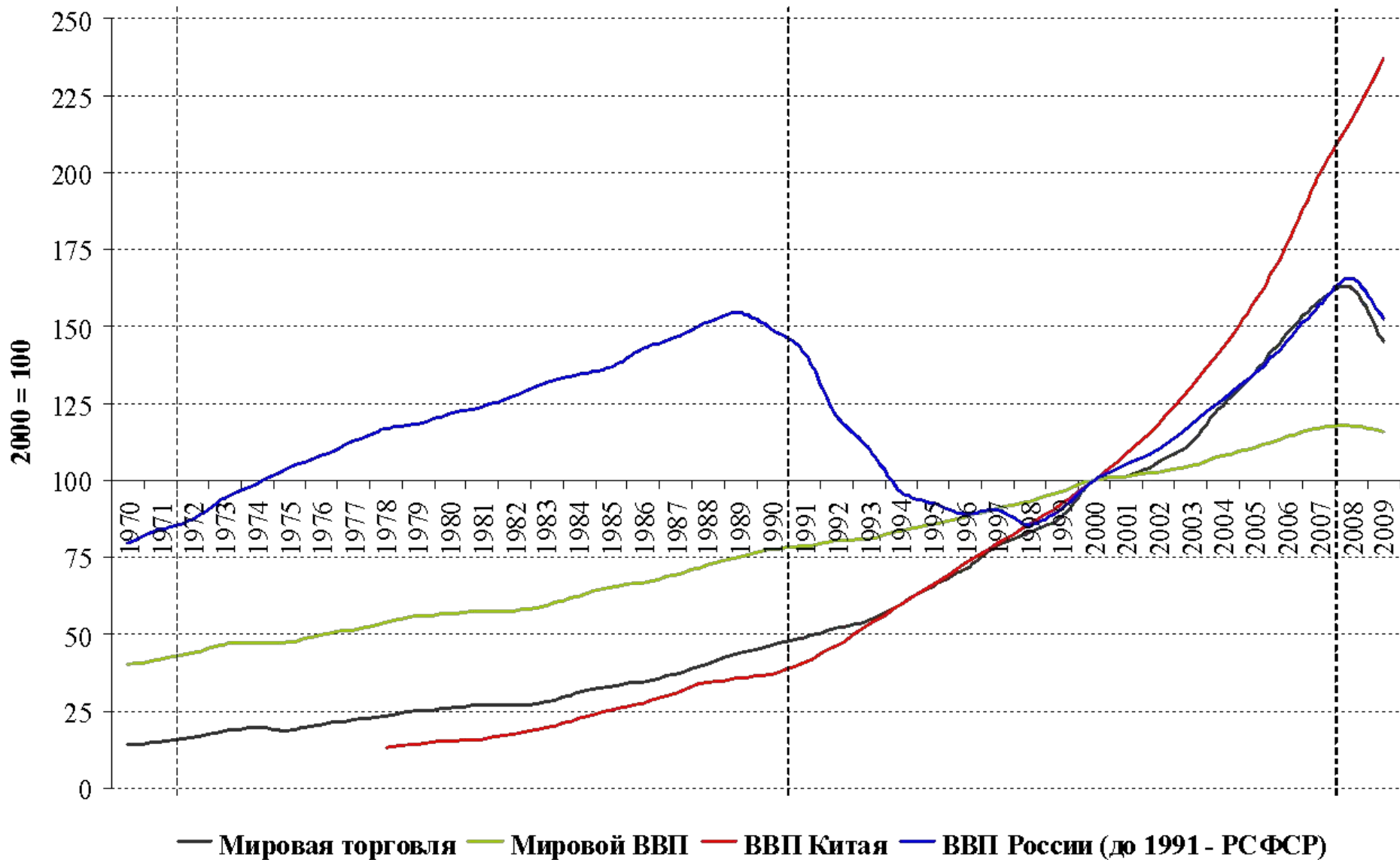
Энергетика: история

17



Источник: А. Макаров, А. Макаров. Laws of Power Industry Development: Elusory Essence. Thermal Engineering, Vol. 57, No 13, 2010

ВВП мира, России и Китая, мировая торговля: 1970 – 2010



Экономическая активность - СЕМЬИ

- Семьи: хозяйство, воспитание, медицина, обучение
- Доходы, расходы текущие, инвестиции и сбережения.
- «Полный ВВП» – уровень жизни, типы
- ВВП по паритетам – расчет и применимость
- Измерения:
 - Доходы – средние доходы
 - Цены и инфляция – региональные индексы
 - Реальные доходы, душевые – сравнения – регионы
 - Дома, цены на дома – капитал семей
 - Сбережения и инвестиции – вклад в финансы, норма
 - Активность и занятость, безработица

Экономическая активность - фирмы

- Малая фирма: собственник - менеджер, средства производства, рабочие, прибыли, кредит – инвестиции
- Большая фирма: компания – корпорация, много предприятий, разные продукты, рынки – инвестиции
- ТНК: оптимизация продуктов, издержек рабочей силы, налогов, кредита и прочее
- Все производят продукцию, нанимают рабочих и инвестируют, сдают статистику в ГосСтаты, плюс отчетность по налогам, и банкам и еще акционерам
- Индексы промышленного производства, продажи
- Инвестиции – план- решение, средства, финал
- Оборудование - FIFO-LIFO, сроки службы
- Измерения доходности, успешность менеджеров, акции – биржа, Q-ratio James Tobin

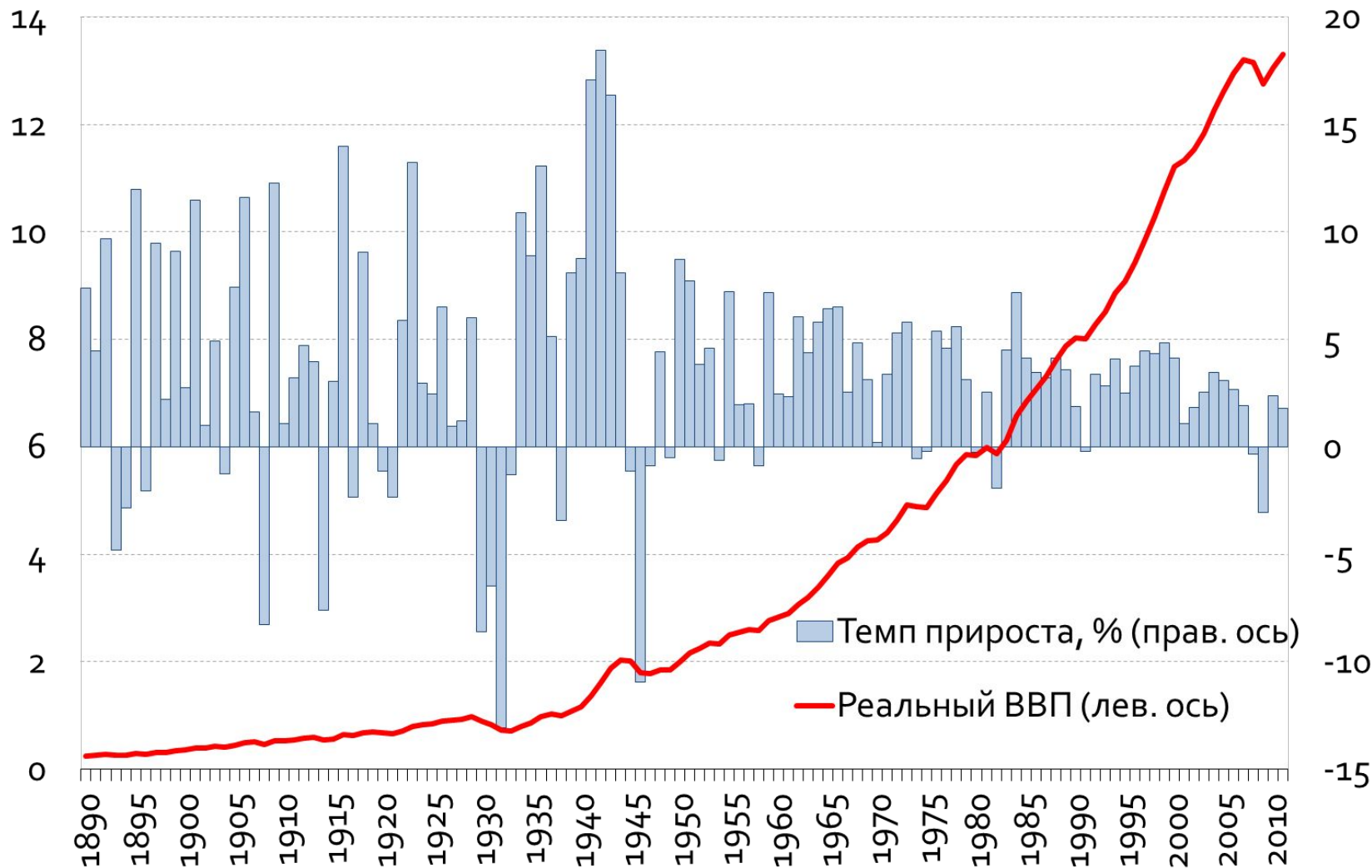
Экономическая активность – “регионы”

- Регионы страны (большие и малые, разное развитие) – страны и группы стран, ЕС против БРИКС
- Собственная деятельность региона: занятость, инвестиции, инфраструктура, бюджет
- Государство: бюджет и активность – вклад в рост
- Антикризисная активность
- Поддержка НТП и развития
- Государство и долги, %% - финансирование
- Государство и менеджмент проектов
- Коррупция и активность – у кого активность?
- Измерение вклада в ВВП

США: реальный ВВП (трлн. долл. 2005

г.)

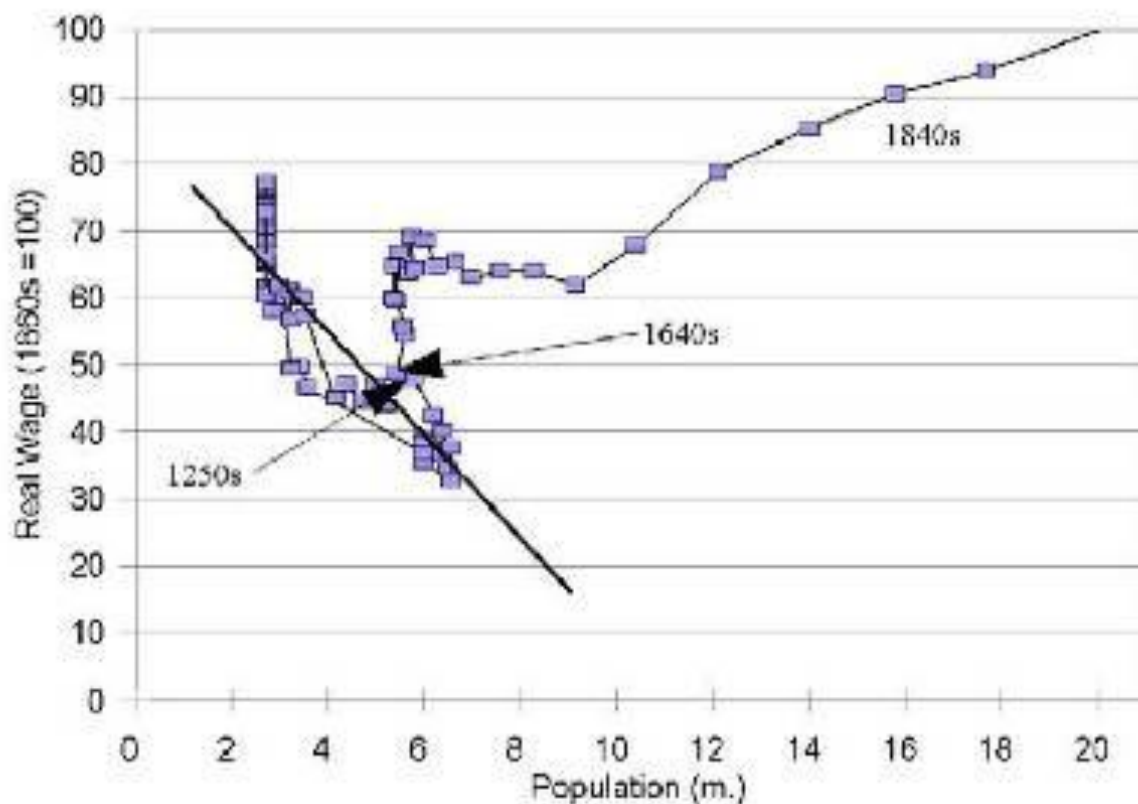
С 1890 по 2011 гг. было **27 лет**, характеризовавшихся падением ВВП



Economic history quest: Malthusian trap

23

Figure 1: Real Wages Versus Population, England, 1250-1869



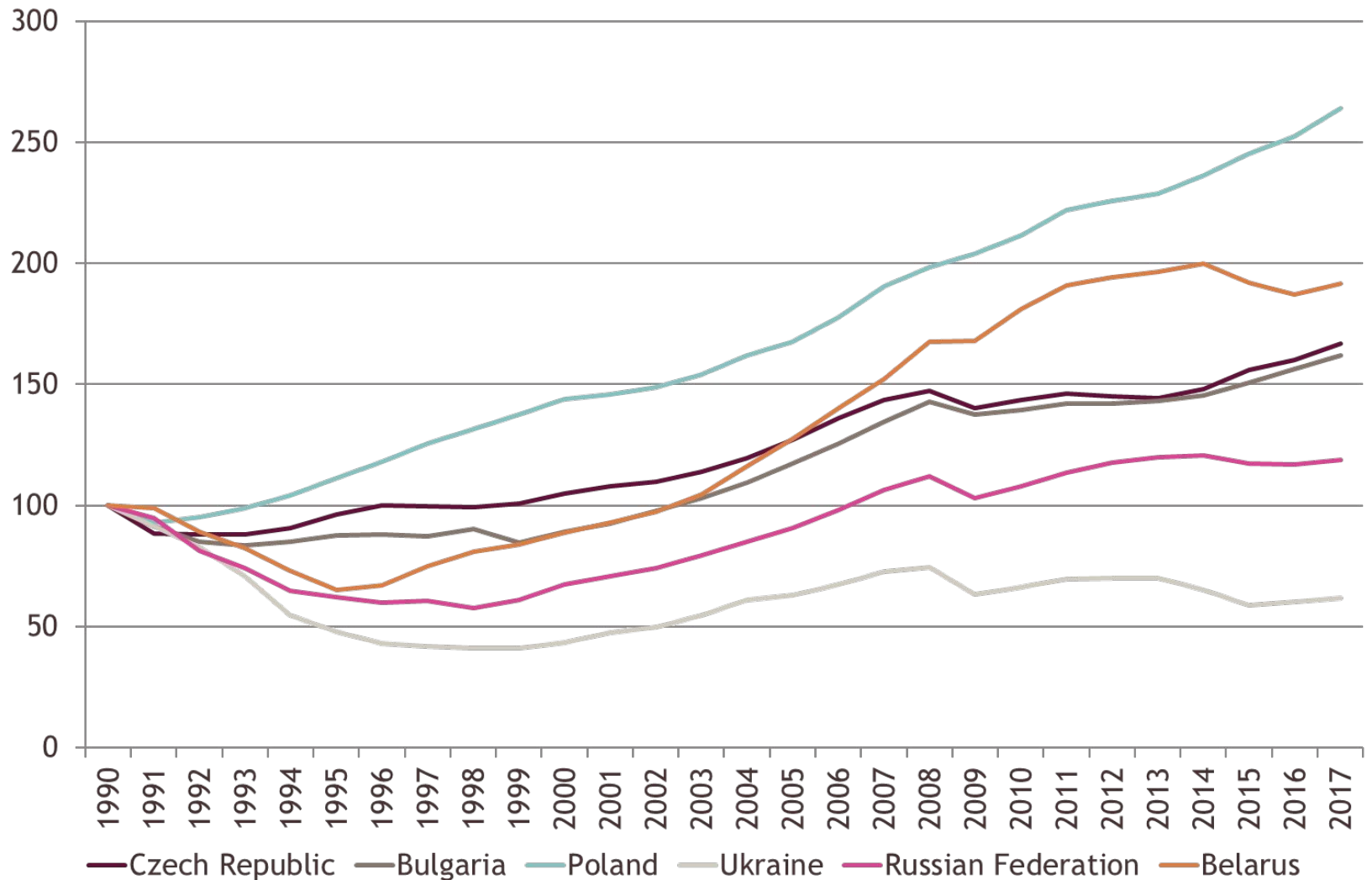
Source:

http://krugman.blogs.nytimes.com/2009/07/01/the-malthusian-insult/comment-page-4/?_r

Economic history quest: Growth of transition economies

1990 – 2017, GDP PPP per capita, 1990 = 100

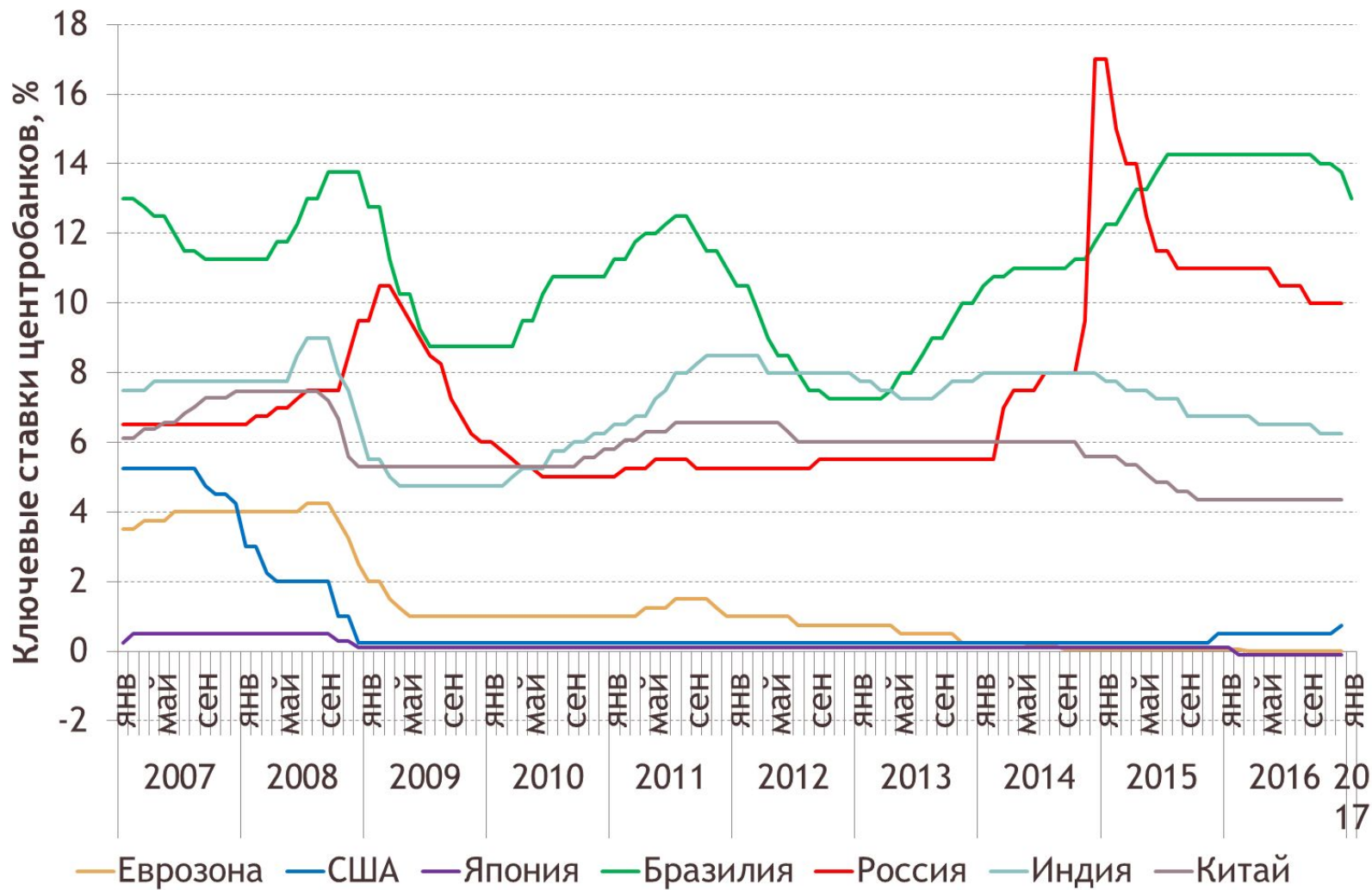
24



Source: World Bank

Ключевые ставки

2007 – 2017



Цены и производные колебания

- Колебания выпуска в 19-20 веке и ВВП теперь
- Цены в обрабатывающей промышленности и конкуренция, фактор Китая = (-0,5% глобал)
- Цены на сырьевые товары - другой размах
- Акции - еще более волатильны!
- Исторически девальвации давали шоки
- Инвестиции - сырье - производство - волатильность меняется по периодам
- Волатильность и восприятие эконом. агентами

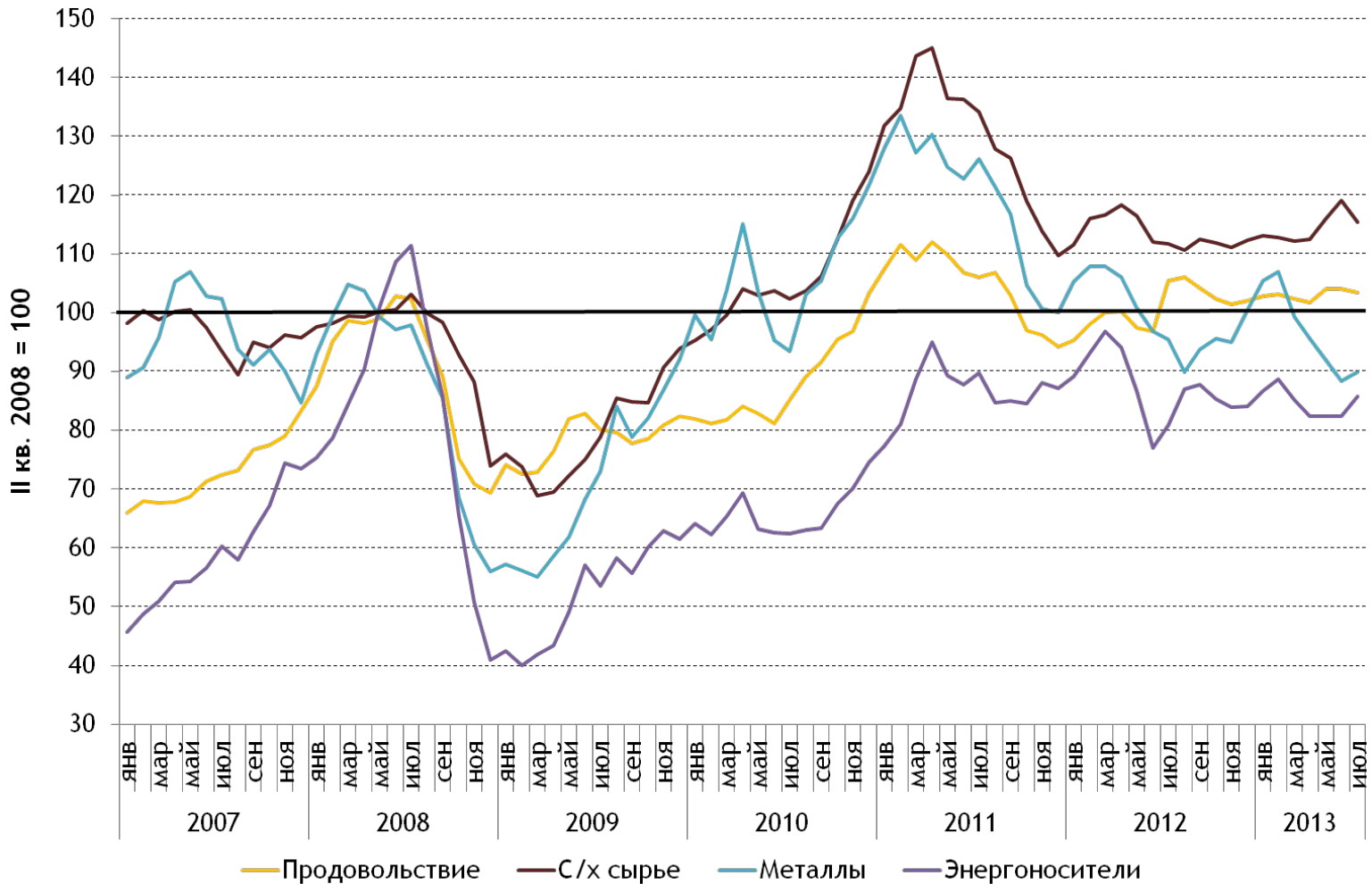
Ведущие биржевые индексы мира

2014 - 2017



Индексы цен на группы сырьевых товаров

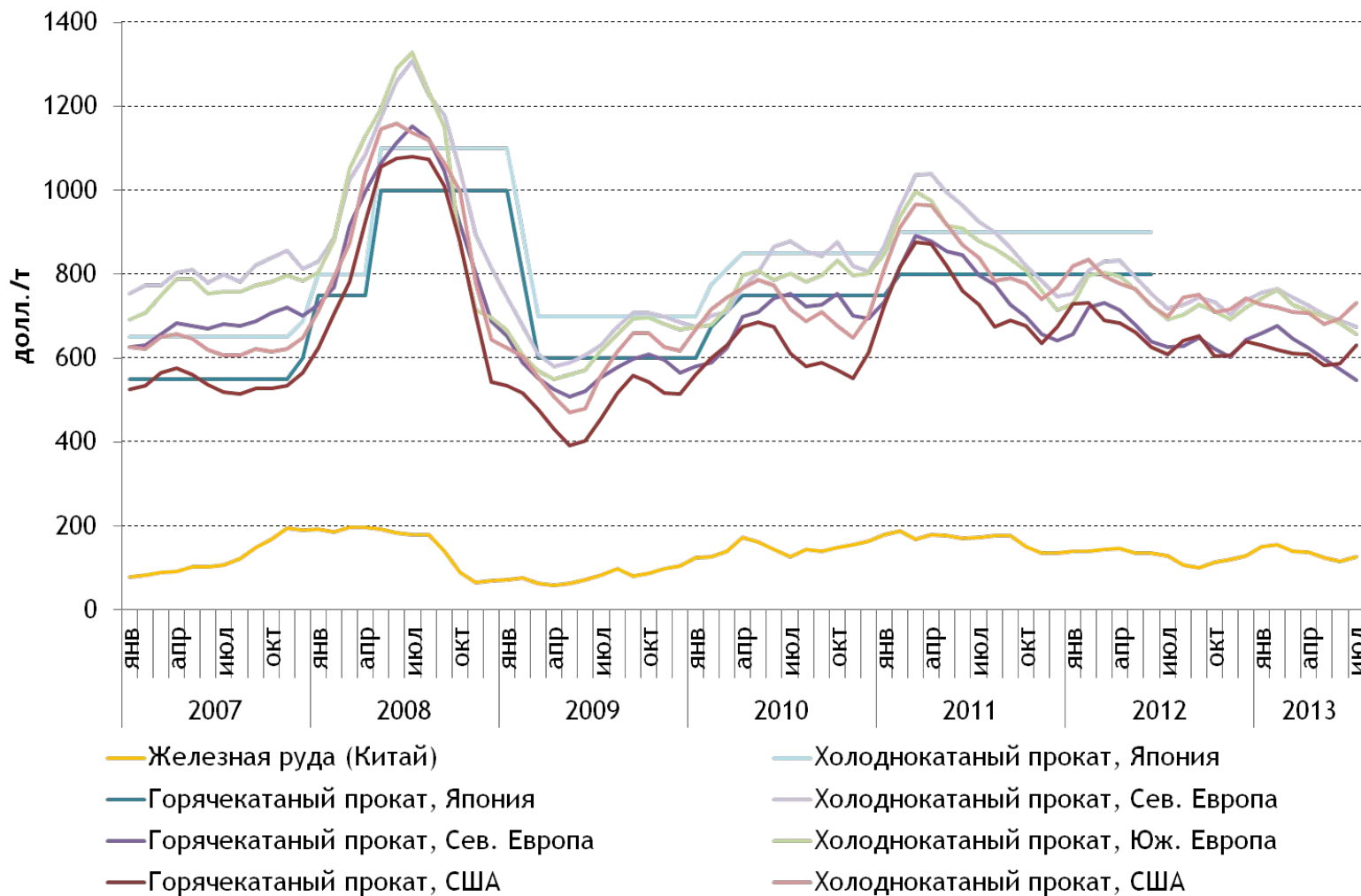
2007 - 2013, II кв. 2008 г. = 100



Источник: МВФ


Цены на стальной прокат и железную руду

2007 - 2013, долл./т



Источник: Всемирный Банк, Thomson Reuters

Для семинаров

- Историческая динамика роста - все недавно!
 - Огромное разнообразие мира.
 - Семья - фирма - большая фирма - государство - у всех бюджеты должны балансироваться.
 - Решения семей (индивидов) о покупках, фирм об инвестициях, государств о налогах и войнах
 - Как человечество прошло историю - давно ли собственно живет как «современные люди»?
 - Устойчивый рост - как давно и что это такое?
 - Перерывы в росте (кризисы, войны, чума) - игнорировать или анализировать?
- 

Читать по Истории и вообще

- «Мировая экономика в начале 21 века» под научным руководством Л.М.Григорьева, М., «Директ-Медиа», 2013.
 - Бродель Ф. Материальная цивилизация, экономика и капитализм, XV-XVIII вв. – М.: Весь мир, 2006.
 - Мэддисон А. Контуры мировой экономики 1-2030. М.: Издательство Института Гайдара, 2012. Стр. 9-22 и 111-120.
 - Charles P. Kindleberger and R. Z. Aliber “Manias, Panics, and Crashes A History of Financial Crises. 2005
 - Цели устойчивого развития ООН и Россия. Под ред. С.Н. Бобылева и Л.М.Григорьева, Москва, сайт АЦ, 2016.
 - Григорьев Л.М. и В.А.Павлюшина «Межстрановое неравенство и проблема стадий развития», «Вопросы экономики», №7, 2018, стр.5-29.
- 