

НОБЕЛІВСЬКІ ЛАУРЕАТИ В СФЕРІ ЕКОНОМІКИ



Оксана ШИМАНСЬКА

ФЕНОМЕН МОРИСА АЛЛЕ



Моріс Фелікс Шарль Алле народився 31 травня 1911 року в Парижі у сім'ї комерсанта. На початку Першої світової війни він втратив батька, який потрапив у німецький полон, де й помер у березні 1915 року. Дитячі роки Моріса пройшли у важких умовах, однак хлопець блискуче закінчив середню школу. У 1928 році Моріс Алле отримав диплом бакалавра з латини та природничих наук, а через рік – з математики та філософії. Окрім цього, юнак відчував неабиякий інтерес до історії і хотів продовжити навчання за спеціальністю історика, однак за настійливими наполяганнями вчителя математики впродовж ще одного року навчався у

спеціалізованому математичному класі з метою подальшого вступу у 1931 році до Політехнічної школи. Закінчивши її успішно у 1933 році, Алле, як один із найкращих випускників, отримав роботу в Національній гірничій службі, де перед ним відкривались широкі можливості для професійного зростання. Це була одна з найвагоміших державних служб, яка займалася управлінням у добувній сфері та галузі енергетики, а також здійснювала вплив на формування промислової політики Франції. Після перебування на воєнній службі упродовж 1934–1936 рр. Моріс Алле вступив до Паризької Вищої національної гірничої школи, після закінчення якої

© Оксана Шиманська, 2008.

працював інженером муніципальної гірничої служби. У 26-річному віці Алле очолив службу гірничодобувної промисловості і контролю над залізницею в м. Нант. У вересні 1939 року, після початку Другої світової війни, Моріс Алле вдруге опинився на військовій службі і у червні 1940 року уже як лейтенант артилерійської батареї, став учасником воєнних дій проти Італії. Після капітуляції Франції в липні 1940 року Алле повернувся на попереднє місце роботи в м. Нант, опинившись у зоні німецької окупації.

З жовтня 1943 до квітня 1948 року Моріс Алле виконував обов'язки директора Бюро документації і статистики копалень у Парижі. Згодом він залишає адміністративну службу і повністю присвячує себе викладацькій і науковій діяльності. У 1944 році Алле став професором економічного аналізу у Паризькій Вищій національній гірничій школі, а також керівником групи з економічних і соціальних досліджень, яка проіснувала до 1970 року. У 1946 році Моріс Алле очолив дослідницьку роботу в Національному центрі наукових досліджень, залишаючись на цій посаді до 1980 року. Упродовж 1947–1968 років Моріс Алле обіймав посаду професора теоретичної економіки Інституту статистики Паризького університету. У цьому ж університеті він отримав ступінь доктора за спеціальністю інженера. У наступні роки вчений плідно працював у якості професора в Центрі ім. Томаса Джефферсона Університету штату Вірджинія (1958–1959рр.), Інституті міжнародних досліджень у Женеві (1967–1970рр.), керував постійно діючим семінаром з монетарного аналізу в Паризькому університеті (1970–1985рр.). У 1980 році Моріс Алле, вийшовши на пенсію, залишався професором економічного аналізу у Паризькій Вищій національній гірничій школі та співпрацював з Національним центром наукових досліджень. Моріс Алле виховав плеяду знаних економістів, серед яких – М. Бото, Дж. Дебре, Е. Малінво та ін [5].

Інтерес до економічного аналізу Алле виявив у 30-х роках ХХ ст. У 1933 році він відвідав США, де мав змогу вочевидь спостерігати за Великою депресією і, за його словами, “вперше замислився над проблемою досягнення максимальної економічної ефективності та одночасного забезпечення такого розподілу доходу, який виявився б прийнятним для усіх членів суспільства” [3]. Таким чином покликання вченого-економіста було визначене для Моріса Алле не школою, а обставинами. Предметом наукового пошуку стало виявлення того підґрунтя, на якому могла б належно будуватися економічна та соціальна політика. Влітку 1940 року Алле вдався до самостійного вивчення економічної літератури, керуючись принципом норвежського математика ХІХ ст. М. Х. Абеля: “Читати лише великих майстрів і лише мовою оригіналу”.

Особливо великий вплив на Алле мали праці Л. Вальраса, В. Парето та І. Фішера. Відчуваючи нагальну потребу у розумінні конкретної економічної дійсності та обґрунтуванні відповідей на питання, які з точки зору вченого ще не розроблені чи недостатньо мірою висвітлені в існуючій літературі, Моріс Алле у січні 1941 року вдався до написання своєї першої економічної праці “Дослідження економічної науки. Частина перша: Чиста економічна теорія” (“A la Recherche d'une Discipline Economique. Premiere Partie: L'Economie Pure”). Ця монументальна праця обсягом до 900 сторінок, яка написана фактично не фахівцем всього за 2,5 року (Алле

завершив роботу над рукописом у липні 1943 року), навіть упродовж десятиліть вражає своєю змістовністю та глибиною. У 1952 році вона була перевидана Морісом Алле в п'яти томах під назвою "Трактат з чистої економічної теорії" ("Traite d'Economie Pure"). За науковою значимістю цей твір Алле прирівнюють до таких відомих праць, як "Вартість і капітал" Дж. Хікса та "Основи економічного аналізу" П. Самуельсона. Саме ця праця Моріса Алле значною мірою вплинула на рішення Нобелівського комітету про присудження її автору Премії з економіки за 1988 рік.

Науковий внесок Алле в сучасну економічну теорію пов'язаний з розробкою чотирьох її розділів:

- 1) загальної теорії рівноваги та оптимального розподілу ресурсів;
- 2) теорії капіталу та економічного зростання;
- 3) теорії грошей і циклу;
- 4) теорії вибору за умов ринку.

У своїй найпершій економічній праці Алле зосередив увагу на обґрунтуванні двох фундаментальних положень:

- у ринковій економіці кожен стан рівноваги є водночас станом оптимуму (максимальної ефективності), і навпаки;
- кожен стан максимальної ефективності є станом рівноваги (так звана "теорема еквівалентності").

Продовжуючи традиції Л. Вальраса та В. Парето, Моріс Алле здійснив чітке математичне формулювання ринкової рівноваги та соціального оптимуму, а також визначив загальні умови ринкової рівноваги. Вчений, використавши "множник Лагранжа", який був введений в економічний аналіз практично того ж часу П. Самуельсоном у його "Основах економічного аналізу" ("Foundations of the Economic Analysis"), вдався до диференціального обчислення. Моріс Алле, незалежно від інших економістів, довів першу та другу теореми теорії добробуту, на яких ґрунтується сучасна теорія добробуту. Він виявив, що економічна ситуація за наявності рівноваги цін є соціально ефективною у тому сенсі, що ніхто не може стати багатшим, щоб інший не став біднішим. Окрім цього, такий ефективний стан (у соціальному сенсі) може бути кожного разу досягнутий через систему рівноваги цін і шляхом перерозподілу ресурсів. Дослідник був достатньо обережним у висновках і не припускав, щоб останні ставили під сумнів принципи свободи конкуренції. Однак вчений також доводив, що ринкова економіка є неефективною саме внаслідок тієї ж конкуренції, яка є далекою від досконалості. Він чітко усвідомлював, що рівноважний розподіл доходу з метою досягнення максимальної соціальної ефективності може з різних міркувань виявитись неприйнятним для приватного сектора. Алле відстоював тезу про те, що питання розподілу повинні чітко відокремлюватись від розгляду ефективності, стверджуючи при цьому, що у випадку якщо суспільство потребує змін у розподілі доходу, то останній варто здійснювати через систему оподаткування і цінову політику, не торкаючись механізму конкуренції. Він вважав, що соціалістичне планове господарство, обґрунтовуючи ефективність своєї економіки, обов'язково зіштовхнеться з тими ж проблемами, що й капіталістична економіка, і що для досягнення ефективності інститути планування повинні будуть у тій чи іншій формі використовувати механізм ціноутворення. Висновки Алле, не дивлячись на високий рівень їх абстракції, все

ж знайшли застосування у практиці індикативного планування у Франції, зокрема у заміні в державному секторі економіки методів прямого регулювання методами цінової політики. Аналізуючи проблеми ринкової рівноваги та соціальної ефективності Алле заклав основи для формування у Франції у післявоєнний період так званої маржиналістської школи.

В іншій праці "Економіка і відсоток" ("Economic et Interet"), яка вийшла в світ у 1947 році, Моріс Алле здійснив систематизований аналіз міжчасового розподілу інвестицій і грошей у закритій конкурентній економіці. Поряд з багатьма важливими положеннями відносно механізму функціонування динамічної (як монетарної, так і немонетарної) економіки за умов конкуренції нова праця Алле містила низку оригінальних ідей. За оцінкою самого автора, головний науковий результат цієї роботи полягав у чіткому доведенні того факту, що у немонетарній економіці за незмінної чисельності населення стан, за якого досягається максимум добробуту (максимум реального доходу – Алле назвав такий стан "капіталістичним оптимумом" або "максимумом соціальної ефективності") характеризується нульовою ставкою відсотка. Це було перше у сучасній неокласичній теорії зростання визначення "золотого правила нагромадження", відкриття якого зазвичай пов'язують з іменами Т. Свана або Е. Фелпса. Моріс Алле у 1961 році в ході лекції, яка була репрезентована ним у Економетричному товаристві, аргументував положення своєї книги стосовно економіки, котра знаходиться на стадії зростання, і обґрунтував тезу про те, що оптимальність в даному випадку досягається за умови, коли норма відсотка дорівнює нормі зростання. У такий спосіб вчений доповнив власну теорію оптимального розподілу ресурсів теорією капіталістичного оптимуму. Аналізуючи оптимальність у довготривалому періоді, Алле стверджував, що кожен економічний агент має переваги стосовно теперішнього і майбутнього споживання, які відрізняються у різні періоди його життя. Такий підхід до аналізу психологічної еволюції індивіда упродовж його життя відрізняється від існуючого розуміння цієї проблеми в економічній літературі. Алле виявляв обережність у ході емпіричної перевірки своєї теорії оптимуму, співставляючи процеси економічного зростання в різних країнах, а також пояснюючи кожен випадок розбіжності між станом оптимуму і реальним процесом нагромадження.

Вчений зробив свій оригінальний внесок у розробку інших розділів економічної науки. Зокрема, займаючись вивченням, як в теоретичній, так і у практичній площині, чинників, що визначають обсяг грошової маси, Алле ініціював проведення монетарного макроекономічного аналізу. Він вважав, що знання без теорії є хаотичним нагромадженням безлічі фактів, а, з іншого боку, теорія, яка не співвідноситься з фактами реальної дійсності і не може бути кількісно підтвердженою даними спостереження, позбавлена будь-якої наукової цінності. Окрім цього стосовно математичних методів і моделей дослідження Алле висловлював думку про те, що математичний апарат не повинен бути самоціллю, а є лише засобом доведення певних теоретичних постулатів і емпіричних фактів.

Моріс Алле вважається одним із найактивніших прихильників кількісної теорії грошей. Створена ним модель, що описує динаміку грошових витрат країни, підкріплена посиланнями на психологічний закон сприйняття часу. Дані інтегрально-диференціальних рівнянь, які описують зміни доходу, свідчать про існування трьох

обмежених циклів, що залежать від попередніх умов. Згадана модель створила можливість для пояснення локальної стабільності постійного стану рівноваги, а також економічної циклічності та гіперінфляції.

Алле також відомий своїми працями з теорії ризику, в яких доводить, що загальновизнана теорія максимізації очікуваної корисності є неприйнятною у багатьох випадках прийняття емпіричних рішень за умов ризику та невизначеності. Грунтуючись на власному переконанні, що теорія повинна співвідноситись з реальними фактами, вчений провів у 1952 році низку психологічних експериментів, результати яких виклав у статті "Раціональна поведінка людини за умов ризику: Критика постулатів і аксіом Американської школи" ("Le Comportement de l'Homme Rationnel devant le Risque. Critique des Postulats et Axiomes de l'Ecole Americaine"), яка була опублікована в журналі "Економетрика" у жовтні 1953 року. Проведені дослідження довели, що реально діючий економічний агент постійно порушує гіпотезу очікуваної корисності. Цей факт відомий економічній науці як "парадокс Алле", суть якого зводиться до наступного: індивідам пропонують вибір двох ризикованих рішень. У першому випадку в ситуації А є впевненість в отриманні виграшу у розмірі 1 млн. франків, а в ситуації В існує 10-відсоткова вірогідність виграшу в розмірі 5 млн. франків, 89% – у розмірі 1 млн. франків і 1% – не виграти нічого. В іншому випадку тим же індивідам пропонується зробити вибір між ситуаціями С і Д. У ситуації С є 10% вірогідності виграшу у розмірі 5 млн. франків і 90% – не виграти нічого, а в ситуації Д – 11% становить вірогідність виграшу у розмірі 1 млн. франків і 89% – не виграти нічого. Алле виявив, що переважна більшість індивідів за таких умов надає перевагу вибору ситуації А в першій парі та ситуації С у другій. Такий результат сприймався як парадоксальний. Виходячи з існуючої гіпотези, індивід, котрий надав перевагу вибору А в першій парі, повинен зупинити свій вибір на ситуації Д у другій парі, а індивід, котрий обрав в першій парі варіант В, у другій парі повинен віддати перевагу вибору С. Алле мовою математики достеменно пояснив цей парадокс [1]. Вчений констатував, що раціонально діючий агент надає перевагу абсолютній надійності.

Моріс Алле вирізняється надзвичайною широтою наукових інтересів. За період 1943-1987 рр. він опублікував понад 200 праць з різної тематики. Окрім вищезазначених проблем Алле займався також питаннями історії економічної думки, статистичним аналізом, міжнародними економічними та валютними відносинами, аналізом економічного становища різних країн, у тому числі оцінками ефективності економіки СРСР у післявоєнний період. Його праці у сфері прикладної економіки – менеджменту, розподілу доходу і оподаткування, монетарної політики, економіки енергетики, транспорту і добувної промисловості виконані у 50-70-х роках і його рекомендації стосовно підвищення ефективності сталеплавильної та вугільної промисловості мали практичний вплив на економічну політику французького уряду в 60-70-х роках.

У післявоєнні роки і до формування у 1958 році ЄЕС Алле брав активну участь у роботі багатьох міжнародних конференцій, які були присвячені створенню Спільного ринку, а у період 1959–1962 років вчений був одним із засновників ліберальної політичної організації "Рух до вільного суспільства". У 1964 році Алле

виступив з доповіддю у Центрі стратегічних досліджень університету Джорджтауна на тему "НАТО в пошуках об'єднання".

Моріс Алле – прихильник вільної торгівлі і конкуренції між країнами (як засобу зростання добробуту нації), однак вважає, що ефективна організація вільного ринку повинна забезпечуватись відповідною економічною та соціальною організацією. Його ідеалом є так зване конкурентне планування, яке передбачає поєднання державного планування економіки з конкуренцією підприємств приватного бізнесу. В якості протидії монополії вчений пропонує широко застосовувати методи фіскальної і грошової політики, в тому числі запровадження податків на "невиправдані прибутки" і капітал [2]. Зокрема, у сфері грошової політики Алле пропонує не лише встановлювати контроль над темпами зростання грошової маси з метою забезпечення цінової стабільності, але й проводити індексацію усіх цінних паперів задля уникнення невиправданого зрушення у розподілі багатства між позичальником і кредитором.

Моріс Алле підтримував ідею федеративного устрою Європи та прийняття єдиної європейської валюти.

Нобелівська премія з економіки за 1988 рік була присуджена Морісу Алле "за його новаторський внесок в теорію ринку та ефективного використання ресурсів". Окрім Премії пам'яті Альфреда Нобеля вчений нагороджений ще 14 науковими та урядовими нагородами, у тому числі орденом Почесного легіону (1977 р.) та найпрестижнішою нагородою французької науки – Золотою медаллю Національного центру наукових досліджень (1978 р.). Алле – єдиний економіст, котрий удостоєний такої нагороди.

Упродовж багатьох років Моріс Алле був членом Національного комітету Національного центру наукових досліджень (1947–1980 рр.), а також членом Комісії з питань енергетики Економічної і соціальної ради Франції (1960–1961 рр.), головою експертної Комісії з вивчення тарифної політики на транспорті в рамках ЄЕС (1963–1964 рр.), членом редколегії журналів "Огляд політичної економії" (1952–1984 рр.) та "Економетрика" (1959–1964 рр.). Моріс Фелікс Шарль Алле – почесний член Американської економічної асоціації, член Національної академії наук, Почесний доктор Гронінгемського університету [4, 127].

Література

1. Алле М. Поведение рационального человека в условиях риска: критика постулатов и аксиом американской школы // *THESIS*. – 1994. – Вып. 5.
2. Алле М. Современная экономическая наука и факты // *THESIS*. – 1994. – Т. 2. – Вып. 4.
3. Алле М. Экономика как наука. – М.: Наука для общества, 1995.
4. Довбенко М. В. Сучасна економічна теорія (Економічна нобелелогія): Навчальний посібник. – К.: Видавничий центр "Академія", 2005. – С. 125–130.
5. Лауреаты Нобелевской премии: Энциклопедия: Пер с англ. – М.: Прогресс, 1992.

Редакція отримала матеріал 12 вересня 2008 р.