

**А.В. Леонидов (ФИАН, Москва),  
А.В. Савватеев (ЛИСОМО РЭШ; ЦСА УДП, Москва),  
А.Ю. Филатов (ИГУ, Иркутск)  
Четвертая Школа междисциплинарного анализа  
социально-экономических процессов<sup>1</sup>**

Школа междисциплинарного анализа социально-экономических процессов была задумана как дискуссионное пространство, объединяющее экономистов, исследующих аспекты рационального поведения агентов, максимизирующих прибыли, полезности и иные целевые функции; социологов, предполагающих поведение людей в рамках некоторых норм и правил; географов, учитывающих пространственные аспекты; историков, имеющих представление о развитии общества из глубины веков; физиков, умеющих описывать усредненную эволюцию системы в целом, осуществлять ее классификацию на достаточно устойчивые фазы, разделенные фазовыми переходами и выявлять критические значения параметров, при которых такие переходы случаются даже при невозможности буквального решения системы уравнений, описывающих движение огромного числа составляющих систему частиц. Конечно, к данному проекту нельзя было не подключить математиков, предлагающих инструментарий решения возникающих сложных задач, и специалистов в области computer science, умеющих работать с большими данными и переводящих исследования из теоретической плоскости в область верифицируемых количественных результатов.

Четвертую Школу МАСЭП, приняв эстафету от Байкала, Валдая и Урала, приютил 25-29 июля гостевой дом «Загосье», находящийся в живописном уголке Псковской области под названием Пушкинские Горы. Школа собрала около 50 ведущих российских специалистов от Москвы до Иркутска. Три ее рабочих дня были посвящены взгляду на общество со стороны теории игр, теории сетевых взаимодействий и макроэкономики, а четвертый общекультурный день сюжетов имел условное название «Византия». Хотя, конечно, этим узким кругом тем программа Школы не исчерпывалась.

Открывший Школу **Даниил Мусатов (МФТИ)** в обзоре «Теория игр в лицах» коснулся ряда аспектов ее практического применения, в том числе ограничениям, накладываемым современной теорией сложности вычислений. Теория игр, являющаяся математической основой современной экономики, занимается поиском равновесий – ситуаций, в которых никому не выгодно в одностороннем порядке менять собственную стратегию поведения. Однако зачастую дело ограничивается доказательством существования равновесия. При этом вопросы того, сколько равновесий существуют, какими свойствами они обладают и, тем более, как привести сложную экономическую систему в «хорошее» равновесие, выносятся за рамки исследования.

В то же время минимальным предположением об ограниченной рациональности являются ограниченные вычислительные ресурсы, характерные как для игроков и разработчиков механизмов (например, аукционистов), так и для исследователей. Причем следует учитывать не только то, что вычисление оптимальной стратегии должно занимать не слишком много времени и памяти, но и то, что описание выбранной стратегии не должно быть слишком длинным, а при общении игроков нужно передавать не слиш-

---

<sup>1</sup> Организаторы: Центр социального анализа, Новая экономическая ассоциация, Университет Дмитрия Пожарского и Русский фонд содействия образованию и науке.

ком много данных. Особенно важными эти аспекты становятся сейчас при практической имплементации теоретико-игровых механизмов, например, в интернет-экономике или при реализации вычислимых моделей общего равновесия, речь о которых также заходила в рамках Четвёртой Школы МАСЭП.

В качестве возможного подхода, сужающего область взаимодействия, но позволяющего переходить от теории к практике, были предложены графические игры, в которых может быть огромное количество агентов, однако полезность каждого зависит исключительно от действий его соседей. Сложность решения в этом случае зависит от формы графа – для объединения цепочек и циклов существует полиномиальный алгоритм, для деревьев – приближенный полиномиальный алгоритм, для более сложной топологии также разрабатываются эвристические алгоритмы нахождения равновесий.

Часть доклада была посвящена играм маршрутизации (в которых, в отличие от графических игр, на каждого агента влияет огромное множество других, но незначительно), и обучению, при котором оптимизация на каждом шаге происходит с учетом накопленного опыта. Также Даниил Мусатов коснулся теории и практики комбинаторных аукционов, в которых множество разных товаров продается многим агентам, при этом ценности товаров зависимы (примерами являются аукционы по продаже лицензий на полосы электромагнитного спектра для связи и вещания, тендеры на обслуживание автобусных маршрутов, запросы на маршруты в сети и т.д.), задачи поиска плохих деривативов на финансовых рынках и связям криптографии с теорией игр.

**Александр Васин (МГУ)** посвятил свой первый доклад в рамках Школы эволюционной теории игр. Базовый вопрос, поставленный им, звучал следующим образом: «Откуда каждому участнику взаимодействия становятся известны функции выигрыша других игроков?» – Чаще всего это происходит на основе наблюдения в рамках повторяющегося взаимодействия. При этом игроков может быть огромное количество, даже континуум, но в результате многочисленных экспериментов можно с высокой точностью получить эмпирическое распределение игроков по стратегиям поведения и выявить траекторию эволюции системы.

В данном контексте Александр Алексеевич рассмотрел модель динамики репликаторов, в которой индивиды в популяции отличаются только неизменными в течение всей жизни и унаследованными от родителей стратегиями поведения. Рождаемость и смертность в системе зависят от реализовавшегося в системе распределения стратегий. Если в долгосрочной перспективе это распределение сходится к стационарному, то в системе остаются только индивидуально рациональные стратегии. Таким образом реализуется механизм естественного отбора. Также было замечено, что если потомок наследует стратегию не родителя, а случайного взрослого, то в качестве целевой функции индивидов начинает выступать не приспособленность, а выживаемость вида, рассматриваемого как единое целое.

В то же время на практике состояние, в котором находится социальная популяция, часто не совпадает ни с равновесием, ни с общественным оптимумом. Одним из объяснений этого факта является то, что человек представляет собой не одномерную систему, а вектор интересов, включающий, как минимум, максимизацию удовольствия, максимизацию выживаемости и максимизацию функции, связанной с социальными взаимодействиями.

Еще один доклад Александра Васина был посвящен теоретико-игровому анализу электроэнергетических рынков. Электроэнергетика является той отраслью, где особенно сильно проявляется эффект масштаба, не позволяющий дробить производителей. В то же время, особенно с учетом важной инфраструктурной роли отрасли, крайне желательной является разработка механизмов функционирования рынков, уменьшающих рыночную власть компаний.

В сделанном обзоре Александр Алексеевич перечислил основные подходы к моделированию электроэнергетических рынков: модель Курно, равновесие функций предложения, равновесие предполагаемых функций предложения. Было продемонстрировано, насколько велико в каждом из рассмотренных случаев отклонение от конкурентного равновесия. Отдельное внимание было уделено формированию форвардного рынка, снижающего монопольную силу генерирующих компаний.

Научный руководитель Центра социального анализа при Русском Фонде содействия образованию и науке **Алексей Савватеев (ЛИСОМО РЭШ, ИГУ)** продолжил теоретико-игровую тематику в докладе «Равновесие дискретного отклика». Начал он с фактов, выявленных экспериментальной экономикой: на практике равновесное состояние в дилемме заключенного, играх «Ультиматум» и «Сороконожка» реализуется далеко не всегда.

В хорошо известной дилемме заключенного (практическими приложениями которой являются и ценовая конкуренция компаний, и рекламные войны, и финансирование общественных благ) даже при однократной реализации равновесие реализуется всего в половине случаев, а около 10% случаев составляют общественный оптимум.

Идея второй, чуть менее известной, игры (в значительной степени моделирующей контрактные отношения) также проста. Один из участников должен разделить некоторую сумму между собой и партнером. Партнер, увидев переданную сумму, решает, взять ее или нет. Если он соглашается, то все счастливы и получают деньги. Если же он отказывается, оба участника игры остаются ни с чем. В равновесии нужно взять себе всю сумму, при этом партнеру нет резона отказываться, поскольку он в любом случае ничего не получает. В то же время на практике отказы зачастую происходят при любом неравном дележе, а среднее предложение первого участника, опасющегося такого исхода игры, составляет 80% суммы.

В третьей игре «Сороконожка», имитирующей процесс «развода» в растущей фирме, два игрока последовательно передают ход сопернику или завершают игру, забрав 80% выигрыша и отдав только 20% сопернику. При этом при передаче хода общая сумма выигрыша удваивается, соответственно, возможные выигрыши составляют по шагам (4; 1), (2; 8), (16; 4), (8; 32) и т.д. С точки зрения рационального поведения при любой длине цепочки нужно брать деньги сразу, однако эксперименты показывают, что около 70% игроков продолжают игру даже при длине цепочки всего 4, а если длина цепочки увеличивается до 6, таковых становится 97%. В то же время, падение вероятности продолжения игры при сокращении длины цепочки означает, что гипотеза альтруизма не выдерживает критики, а игроки ведут себя вовсе не случайно.

Алексей Савватеев в своем докладе рассказал про иное объяснение данных парадоксов – равновесие дискретного отклика. В данной теории предполагается, что выигрыш игрока состоит из материальной составляющей, описываемой функцией полезности или матрицей выигрышей, и дополнительного (например, морального) выигрыша от выбора соответствующей стратегии. Наиболее часто вторая компонента функции выигрыша моделируется распределением Гумбеля, параметр которого связан с тем, насколько в обществе вероятно случайное принятие решений или, напротив, всё однозначно просчитывается — в последнем случае может реализоваться исключительно классическое детерминистское равновесие.

День «сетевых взаимодействий» начался с доклада «Модели интернета и приложения». **Андрей Райгородский (МФТИ, Яндекс)** перечислил основные свойства, которым удовлетворяет веб-граф: разреженность, единственная гигантская компонента, малый диаметр, устойчивость к случайным атакам, неустойчивость к атакам на хабы (то есть вершины с высокой степенью либо занимающие важное «стратегическое» положение в графе), высокая степень кластеризации и степенной закон распределения

степеней вершин. Далее был осуществлен исторический экскурс в модели, описывающие формирование графа со схожими свойствами. Особое внимание было уделено модели предпочтительного присоединения Боллобаша-Риордана, идея которой заключается в том, что с большей вероятностью возникают линки на более популярные сайты. Также было представлено несколько модификаций модели Боллобаша-Риордана (в частности, Бакли-Остгус), устраняющих ее недостатки.

Поскольку построение «правильной» модели интернета представляет собой не чисто теоретическую проблему, а позволяет решать практические задачи улучшения контекстного поиска, выявления спамовых колец или, скажем, анализа динамики распространения новостей, Андрей Райгородский, являющийся руководителем исследовательской группы Яндекса, рассказал о некоторых достижениях в этой области.

Доклад **Дмитрия Новикова (ИПУ РАН)** «Управление сетевыми структурами» был в первую очередь посвящен моделированию возбуждения в сетях. Практических приложений здесь может быть очень много – распространение возбуждения в биологической сети (например, сети нейронов), диффузия инноваций, динамика эпидемий, формирование общественного мнения и т.д. При этом возникающие задачи можно разбить на несколько уровней: от статистического и структурного анализа (в котором важную роль уже играет топология связей) до анализа информационного взаимодействия, управления и даже информационного противоборства, когда игроки, имеющие определенное влияние на исходные мнения части пользователей сети, борются за формирование желаемого общественного мнения.

В настоящее время, в связи с широким распространением социальных сетей, возник отличный полигон, на котором можно эмпирически исследовать свойства реальных сетевых структур огромной размерности (чего стоит один Facebook с 1,5 миллиардами аккаунтов!), тестировать и калибровать модели. В связи с этим значительная часть доклада была посвящена большим данным – одному из самых перспективных направлений исследований ближайшего десятилетия, которое имеет практически неограниченную область приложения. Большие данные – это мир, подстраивающийся под вас: автобус подъезжает к остановке ровно в тот момент, когда вы допиваете утренний кофе, в магазинах не кончаются вещи нужного размера, а самые дешёвые авиабилеты приходятся в точности на дни вашего отпуска...

Вернувшись к тематике моделированию сетевых структур, Дмитрий Александрович чуть подробнее изложил так называемые модели конформного поведения, в частности пороговые модели, в которых поведение агентов в сети зависит не только от индивидуальной функции полезности, но и от того, как ведут себя соседи.

Соруководитель Центра социального анализа при Русском Фонде содействия образованию и науке **Андрей Леонидов (ФИАН)** посвятил свой доклад сетевым взаимодействиям в макроэкономике. Их роль действительно очень важна. Компании, даже если они работают в разных отраслях, не всегда являются полностью независимыми – разорение крупного банка может привести к каскадному дефолту, а бурный рост торговых партнеров инициирует экономический подъем в собственной стране. Все это накладывает очень серьезный отпечаток на то, какими должны быть прогнозы и рекомендации, в том числе, в финансовой политике. В частности, модели, оценивающие риски на основе нормального закона распределения доходности (поиск истины не там, где она находится, а «где светло»), оказываются неадекватными, а вероятности как очень хороших, так и очень плохих событий гораздо выше, чем предполагалось ранее.

Было озвучено три сюжета, связанных с моделированием многосекторной экономики на основе матрицы межотраслевого баланса, международной торговлей и финансовыми рынками, объединенных идеей важности учета сетевых взаимодействий. Было показано, что разная топология связей приводит к разным результатам, в том

числе при анализе воздействия флуктуаций, возникающих в системе. В частности, критически важно учитывать взаимодействие для узлов с высокой центральностью – риски генерирует именно плотное ядро. Другие свойства графа, в том числе, кластеризация, в данном контексте оказались неважны.

**Сергей Чернов (РЭШ)** вернул обсуждение к тематике социальных сетей, но представил это в несколько ином контексте, нежели Даниил Мусатов два года назад, связав это с социальными науками. Действительно, стремительный рост социальных сетей не только дал новые темы исследований для ученых-информатиков, но и привлек внимание специалистов из экономики, социологии, политологии. Огромный объем данных, как и относительная легкость их сбора, привлекли исследователей из областей, традиционно не углубляющихся в детали обработки терабайтов информации или проектирования сверхбыстрых алгоритмов ее обработки. Эти дисциплины концентрируются на вопросах, важных для понимания устройства современного общества. Социологи интересуются, как влияют социальные связи индивида на его личную жизнь, какова зависимость между вашим социальным кругом и географическим местоположением ваших друзей, как возникают, развиваются и исчезают сообщества людей. Политологи спрашивают, как появляются лидеры общественного мнения, можем ли мы прогнозировать каскадное распространение информации в соцсетях, как охарактеризовать поляризацию мнений по общественно-важным вопросам? Наконец, экономисты ищут способы применить теоретико-игровые методы для анализа социальных связей и строят модели поведения пользователей на основе онлайн-данных. Их интересует, влияет ли топология сетей на потребительское поведение, есть ли связь между активностью пользователей в онлайн и их поведением в оффлайн-экономике. В докладе прозвучали ответы на эти и другие вопросы, сопровождающиеся большим объемом фактического материала, представленного в наглядной форме.

А завершил день сетей доклад **Владимира Матвеевко (СПбГУ)**, посвященный сетевой модели межвременного выбора с экстерналиями знаний, в которой экономические агенты могут вкладываться в изменение среды. Приложений у такой постановки множество: жители дома или дачного поселка могут вкладываться в улучшение инфраструктуры, члены исследовательского сообщества в новую прогрессивную технологию, пользователи «Контакта» и «Фейсбука» – в контент, а политически активные группы – в «оранжевые революции». Были выделены пассивные, активные и гиперактивные агенты, на сетях различной конфигурации было показано, какое поведение агентов может быть равновесным.

Третий «макроэкономический» день начался с выступления физиков, представителей единственной науки, у которой есть опыт решения практических задач в «не усеченной моделями» реальности. При этом всеми докладчиками неоднократно отмечалась мысль, что у экономики и физики очень много параллелей. Так же как в физике нереальным выглядит точное решение системы с миллиардами уравнений, описывающих поведение отдельных частиц, так и в экономике очень трудно перейти от уровня отдельных людей на уровень функционирования экономики. В то же время представляется возможным описать усредненное поведение макросистемы в целом и исследовать возникающие при этом равновесия. Статистическая физика за десятилетия своего существования значительно продвинулась в этом направлении, и разработанные методы можно успешно применять при изучении общества.

В частности, **Андрей Семенов (ФИАН)** в докладе «Статистическая макроэкономика» провел параллели между моделью формирования общественного мнения и моделью спинового стекла, предложенной Изингом. Ее суть состоит в том, что все индивиды имеют по некоторому вопросу положительную или отрицательную позицию, однако мнения могут меняться в зависимости от взглядов окружающих людей. В моде-

ли можно учитывать инерцию при принятии решений, уровень доверия (или антидоверия) к мнению окружающих, неучет (в том числе рациональный) части информации. Поскольку система большую часть времени находится в неравновесном состоянии, особый интерес представляет динамика перехода к равновесию. В частности, система может застыть в метастабильном состоянии, зачастую далеко от общественного оптимума, и для ускорения перехода необходимо переключение состояния многих индивидов, для чего, например, могут использоваться инфоповоды, тиражируемые СМИ. С помощью подобной модели можно моделировать, как отдельные лидеры, оказавшиеся в нужное время в нужном месте, творят историю, или как фирмы-газели преобразуют экономику страны.

**Сергей Апенко (ФИАН)** в докладе «Новое в моделях обмена» коснулся тематики богатства и неоднородности. Был проанализирован стилизованный факт связи экономической успешности страны и дифференциации по корзине производимых продуктов. Также Сергей попытался ответить на вопрос, откуда берётся существующее достаточно неравномерное распределение людей по богатству, и почему малые деньги «аддитивны», в то время как большие (дающиеся в рост) – «мультипликативны».

Одним из способов моделирования сложных адаптивных систем являются агенто-ориентированные модели, в которых множество разнородных объектов взаимодействуют друг с другом и со средой. В частности, в экономике таким способом моделируют финансовые рынки и фондовые биржи, где агентами выступают инвесторы, представленные несколькими типами: фундаменталисты, следующие за трендом, случайные торговцы и т.д. Также существуют макроэкономические модели общего равновесия, где на основе простого взаимодействия большого числа неоднородных микроагентов (потребителей, фирм, банков и т.д.) выявляются свойства макросистемы. При этом поведенческие уравнения могут выводиться с помощью оптимизации или угадываться в предположении, что агенты используют простые правила. В то же время необязательным является нахождение системы в состоянии равновесия, хотя, справедливости ради, следует отметить, что часто агрегированные переменные проявляют тенденцию к стабильности и быстро входят в квазистационарные состояния.

После теоретического вступления **Владимир Нечитайло (ФИАН)** рассказал на Школе МАСЭП о некоторых практических разработках – разработке Bios Group для фондового рынка NASDAQ и масштабном проекте макроэкономического моделирования CRISIS (Complexity Research Initiative for Systemic Instabilities). В этапы реализации этого проекта входит наполнение базы данных макроэкономических индикаторов и данных по потребителям, производителям и финансовым институтам, разработка агенто-ориентированных моделей финансового рынка и макроэкономики в целом, создание экономического симулятора с дружественным интерфейсом и проведение на его основе экономических экспериментов, интеграция отдельных моделей в единое целое. С помощью симулятора может быть осуществлена калибровка моделей. Важным здесь будет воспроизвести на сгенерированных данных наблюдающиеся в экономике эффекты. Если это получилось, то можно на основе разработанного инструментария пытаться проводить сопоставление различных политик регулирования экономики на микро- и макроуровнях и доводить анализ до уровня количественных прогнозов. Впрочем, до этой стадии представленным проектам еще далеко.

**Сергей Дзюба (ИГУ, ИрГТУ)** докладом «Чудеса корпоративной отчетности» сдвинул тематику дискуссий с обсуждения теоретических конструкций на проблемы работы с данными. Как было отмечено, благодаря двум консервативным институтам – двойной записи, обеспечивающей закон сохранения денег (ничто ниоткуда не берётся и никуда не исчезает) и обязательному раскрытию финансовой отчётности всеми публичными (присутствующими на фондовом рынке) компаниями – при наличии диспро-

порций в отчётности очень трудно спрятать все концы: «где-нибудь, что-нибудь, но будет торчать». Оказалось, что концы еще более неприкрыты, чем можно себе представить.

На финансовых порталах и в специализированных поисковых системах Yahoo Finance, Google Finance и MSN Money, где финансовую отчетность отыскать проще всего, могут легко потерять амортизацию, дебиторскую задолженность или финансовые активы на десятки миллиардов долларов. Причем это касается даже таких компаний первого эшелона, как General Electric и Volkswagen, а в подводной части айсберга всё еще хуже. Некоторые значения могут быть случайно многократно занижены или завышены (в частности, капитализация одной из казахских нефтяных компаний не только превышает капитализацию Газпрома или ExxonMobil, но десятикратно превышает мировой ВВП). Заметим, что в оригинальной отчётности компаний полный порядок, так что все ляпы – целиком на совести упоминавшихся порталов.

Качество отчетности, представленной на официальных сайтах компаний, существенно лучше (помимо сложности ее добывания и периодического сокрытия данных прошлых лет). В то же время недостоверность может проявляться и в наступлении событий, не соответствующих картине, рисуемой отчётностью, и в корректировке отчётности задним числом, чему были приведены соответствующие примеры. При этом накопление качественной финансовой отчётности в базе данных позволяет систематически исследовать некоторые экономические сюжеты.

Первым из них была связь капитала и капитализации. Вопреки гипотезе Нобелевского лауреата по экономике 2013 года Юджина Фамы об эффективности рынков (вся информация о компании воплощается в её цене), динамика активов компании может очень слабо коррелировать с её стоимостью на фондовом рынке. Для других компаний корреляция присутствует, однако рыночная стоимость может многократно превосходить балансовую. Таким образом, капитализация является, по сути, фиктивным капиталом и крайне ненадёжным ориентиром. В то же время, и с капиталом не все в порядке – он потерял чёткую связь с генерированием прибыли. В частности, возможны внезапные крупные списания капитала из-за финансовых «навесов», к чему компании и рынки относятся довольно спокойно.

Второй сюжет был связан с анализом мирового экономического кризиса, в значительной степени связанного с неограниченным использованием кредита, допущением слишком рискованных операций на финансовых рынках, созданием институтов завышенных ожиданий и неполной ответственности на фоне размывания деловой этики, разрастанием фиктивного капитала, именуемого капитализацией и ориентированностью компаний на рост этого показателя. Ключевым механизмом современной экономики является финансовый рычаг, который провоцирует использование кредита не как вспомогательного экономического механизма, а как перманентного инструмента форсирования рентабельности. И если в растущей экономике рычаг ослабляется сам по себе и требует постоянной дополнительной поддержки из-за отрицательной обратной связи, то в ситуации кризиса рычаг оказывает дополнительное давление (обратная связь положительна). Данные свидетельствуют о том, что не просматривается никаких признаков восстановления после кризиса. Компании продолжают наращивать обязательства. Рентабельность компаний не восстановилась. Компании контролируют только текущую ликвидность. При этом обнаруженные закономерности имеют чётко выраженную отраслевую дифференциацию, но почти не имеют региональной.

Последний сюжет был связан с накоплением гудвила. Классическая точка зрения состоит в том, что деловая репутация создаёт положительный финансовый потенциал, который очень хочется выразить в виде актива. В то же время в текущей деятельности этот потенциал выразить тяжело, поскольку он изменчив. Единоновременно он вы-

ражается исключительно при покупке другой компании, т.е. в сделках по слиянию и поглощению, представляя собой разность между оценочной честной стоимостью компании и ее рыночной ценой. Фактически это переплата при покупке, то есть накопленный непризнанный убыток на балансе компании с благозвучным названием. В настоящее время в развитых странах он составляет около 30% капитала компаний, что уже является серьезной угрозой финансовой устойчивости компаний. Еще страшнее то, что каждая десятая из крупнейших мировых нефинансовых (!) компаний обладают гудвиллом, превышающим их капитал. Это усугубляется тем, что сделки по слиянию и поглощению в основном финансируются за счёт заёмных средств, что наносит двойной удар по финансовой устойчивости.

Руководитель **Центра RAMCOM** и один из главных в России специалистов по Северному Кавказу **Денис Соколов** сконцентрировался на анализе экономики Дагестана, которая в силу местных особенностей сильно отличается от экономики России и мира в целом. С одной стороны, этот регион является черной дырой для бюджетных денег. Причем очень малая их часть доходит до адресатов, а остальные оседают в структурах, банках и правоохранительных органах. С другой стороны, в Дагестане, в том числе, благодаря относительно дешевой рабочей силе, сформировался достаточно эффективный сектор мелкотоварного производства и торговли. Лишенные доступа к бюджетным деньгам, банковской системе и, тем более, международным инвестициям, лавочники и ремесленники сформировали систему взаимных беспроцентных кредитов внутри сетей доверия и через исламские банки (под залог недвижимости и автомобилей), внутренние схемы разрешения конфликтов на основе переговоров и исламских законов, внедрили систему бартера и взаимозачета. И в каком-то смысле, этот «традиционный» сектор работает лучше более современного сектора «банкиров» и «генералов», и может явиться катализатором экономического роста на Кавказе и превращения региона в «Российскую Турцию». Альтернативы пугают гораздо сильнее. Особенно если помнить, как штраф за торговлю без лицензии в 236 долларов спровоцировал восстание лавочников в Тунисе и в целом не очень позитивно продолжившуюся «Арабскую весну».

Завершил день макроэкономики **Сергей Афонцев (ИМЭМО РАН, МГИМО)**, коснувшийся в своем докладе тематики создания Евразийского экономического союза, который позиционируется как проект региональной экономической интеграции, ориентированный на воспроизведение в регионе СНГ успешного интеграционного опыта Евросоюза (ЕС). Следует отметить, что в современном мире гораздо больше успешных блоков базируется на системе «Зона свободной торговли плюс». Не организуется таможенных союзов, общего рынка, существует огромное количество исключений в правилах торговли, однако подобная практика, основанная на взаимном согласии и экономических выгодах, гораздо эффективнее искусственных политических союзов. Единственным успешным примером традиционной модели является Евросоюз. Тот проект интеграции, который Россия изначально создавала в формате таможенного союза, а планирует превратить в единое экономическое пространство (ТС/ЕЭП), должен стать вторым.

Сергей Афонцев привел ряд фактов в пользу потенциальной реализуемости проекта. Фактические и планируемые темпы движения по «лестнице интеграции» и создания наднациональных институтов в разы превышают все известные в мировой практике прецеденты, включая ЕС. Для стран-участниц ТС/ЕЭП характерны схожие уровни развития, обеспечивающие возможность нахождения широкого консенсуса по вопросам экономического регулирования, политики развития и взаимодействия с третьими сторонами. Одновременно позиция России как крупнейшей страны обеспечивает разность экономических потенциалов, связанную с привлекательностью российского рын-



ка для других членов союза, а также с их стремлением получить доступ к российским инвестициям и технологиям. Следует также отметить, что планы создания единых систем антимонопольного регулирования, общих правил в сфере транспорта и энергетики, гармонизации налоговых систем также не имеют аналогов за пределами ЕС. В частности это происходит благодаря ярко выраженному доминированию политических мотивов интеграции. Фактически проект ТС/ЕЭП выступает в роли «экономической опоры» более широкого проекта консолидации постсоветского пространства для совместного решения вопросов экономики, политики и безопасности.

В то же время ряд важных условий, присутствующих в ЕС, лишь в ограниченной мере присутствует на постсоветском пространстве. Уровни развития и взаимодополняемости экономик стран-членов ТС/ЕЭП недостаточны для возникновения существенных позитивных эффектов в торговле. Данные говорят о том же: наблюдается низкий уровень внутриблоковой торговли и преимущественная ориентация на торговлю с ЕС и Китаем у России и Казахстана. Также присутствуют существенные различия стран-членов с точки зрения торговых последствий интеграции: в торговле в рамках ТС/ЕЭП наблюдается значительный экономический выигрыш Беларуси и проигрыш Казахстана, в торговле с третьими странами имеется ярко выраженный конфликт интересов между Беларусью, с одной стороны, и Россией и Казахстаном, с другой. С точки зрения расширения проекта объединения, возникают конфликты интересов в сфере экономики (неудавшееся приглашение Украины и обязательства Кыргызстана перед ВТО), внутренней политики (Кыргызстан) и безопасности (угрозы политической дестабилизации, наркобизнеса и наркотрафика в Кыргызстане и Таджикистане). В случае Армении действуют негативные факторы географической удаленности и отсутствия общей границы.

В качестве рекомендаций были высказаны следующие предложения. Целесообразно последовательное прохождение этапов экономической интеграции, связанных с либерализацией торговли товарами и услугами; обеспечением свободного движения капитала и труда; сближением параметров экономического регулирования на отраслевом уровне и сближением параметров макроэкономической политики. Важно нахождение оптимального баланса между унификацией регуляторных правил и практикой страновых изъятий. При этом возможна многоскоростная интеграция с использованием форматов стран-членов, стран-кандидатов и стран-наблюдателей. Должна быть обеспечена конкурентоспособность объединения по сравнению с «проектами-соседями» (особенно с ЕС) с точки зрения выгод для стран-членов. И наконец, необходимо экспертное обеспечение интеграционных инициатив в соответствии с принципом «сначала расчеты, потом решения».

Последний день работы Школы начался с доклада **Юрия Полунина (МГИМО, «Эксперт»)** «Политический атлас современности». Среди 192 суверенных государств мира все обладают уникальными характеристиками, разными уровнями развития, специфическими национальными задачами и местом во взаимосвязанном мировом сообществе. Возникает вопрос, как и по каким критериям сравнивать государства и их политические системы, как учесть особенности истории и культуры, уровни и траектории развития. Также при определении реального места России в современном мире хотелось бы преодолеть распространенные стереотипы, такие как «Верхняя Вольта с ядерным оружием», «черная дыра в центре Евразии» или «духовный лидер человечества», и обеспечить научную строгость и сбалансированность. Однако большинство исследований используют одномерные шкалы («демократия – диктатура», «свобода – несвобода» и т.д.), субъективные экспертные оценки и соображения политической конъюнктуры, а значит, не являются непредвзятыми описаниями реальности.

В отличие от них проект, реализованный командой МГИМО и «Эксперта», работает в многомерном пространстве на основе обширных статистических данных ООН, ЮНЕСКО, МВФ и других организаций. Было выдвинуто предположение, что на положение государств в современном мире влияют качество и эффективность государственности, способность отвечать на внешние и внутренние вызовы, ресурс воздействия на окружающий мир, качество жизни населения, институциональный потенциал для демократического развития, включающий традиции конкуренции, представительства, участия и ограничения исполнительной власти. Каждый из пяти индексов был сформирован на основе множества статистических показателей, весовые коэффициенты которых были получены с помощью дискриминантного анализа на основе обучающей выборки из стран, находящихся на противоположных полюсах.

В результате развернутого анализа было получено немало интересных фактов. Юрий Полуниин продемонстрировал, что в современном мире степень государственности обратно пропорциональна уровню угроз и прямо пропорциональна качеству жизни. В то же время в зону низкого уровня угроз входят типологически разные страны – и успешные демократии, и безопасные автократии, а наличие и уровень угроз не всегда связаны с потенциалом международного влияния. Лидерами влияния является ядро «Большой восьмерки» (включая Россию) и Китай. Иногда к ним добавляют некоторых региональных лидеров. Международное влияние непосредственно связано с уровнем государственности, однако слабо соотносится с типом политического устройства и качеством жизни. Качество жизни, в свою очередь, во многом зависит от успешной и состоятельной государственности, хотя и не гарантируется ею. Самое серьезное препятствие на пути повышения качества жизни – внешние и внутренние угрозы. Укоренение же демократических практик, как правило, способствует повышению качества жизни. В то же время демократия возникает исторически, а не конструируется в произвольном институциональном дизайне. Она не приживается в ситуации высоких угроз и практически не связана с международным влиянием. В завершение доклада Юрий Полуниин продемонстрировал интереснейшие результаты классификации стран на основе кластерного анализа, а также показал место России на политической карте мира.

Помимо перечисленных докладов в рамках IV Школы МАСЭП было организовано несколько круглых столов, общеобразовательных докладов и дискуссий. На них был затронут широкий круг тем: от классической литературы (находясь в Пушкинских горах, не затронуть эту тему просто невозможно) до современной политики (без обсуждения Украинского вопроса – тоже никуда!). Слушатели переносились в пространстве из Восточной Римской Империи (Византии нет давным-давно, но ее наследие до сих пор сложно переоценить) на Дальний Восток (восточный вектор развития России усиливает важность экономических и политических связей с Востоком, который по многим показателям отличается от Запада).

На финальном заседании также было объявлено, что Юбилейная Пятая Школа МАСЭП пройдет в последнюю неделю июля 2015 года.