

Гипотеза гистерезиса: теоретические и эмпирические подтверждения

Выполнила: Тадей Валерия, э-202

Научный руководитель: Туманова Елена Алексеевна

11.03.2021

Актуальность

- Оценка естественного уровня безработицы – статистически сложная задача
- Определение естественного уровня безработицы и выявление факторов, на него влияющих, необходимо для проведения экономической политики
- Пандемия COVID-19 вызвала рост уровня безработицы по всему миру
- Спад в экономике в 2020 году может иметь долгосрочные последствия

Цели и задачи

Цели:

- Критический обзор литературы, посвященной гипотезе гистерезиса, выявление проблем для дальнейших исследований

Задачи:

- Подобрать литературу
- Проанализировать теоретические работы и эмпирические данные по разным странам
- Оформить выводы

Гипотеза естественного уровня безработицы и ее недостатки

- Классический подход к факторам естественного уровня безработицы
 - Структурная безработица
 - Фрикционная безработица
- Гипотеза NAIRU не могла объяснить стабильный продолжительный рост безработицы в Европе в 70х-80х годах

Гипотеза гистерезиса

- Гипотеза впервые появилась в статье Blanchard and Summers 1986г.
- Предполагается, что на NAIRU оказывает влияние уровень безработицы в прошлом
- Согласно гипотезе, временные шоки изменяют долгосрочный равновесный уровень безработицы в будущем, т.е. не происходит полного возврата к начальному равновесию
- На равновесный уровень безработицы влияют только недоминируемые шоки

Причины эффекта гистерезиса

- Теория продолжительности - потеря навыков работниками в результате высокой безработицы
- Эффект стигматизации
- Теория инсайдеров-аутсайдеров
- Потери в физическом капитале

Эмпирические подтверждения

- Данные по разным странам (Чехия, Хорватия, Нидерланды, США, Новые индустриальные страны)
- Анализ безработицы в разные периоды: с послевоенного до наших дней
- Применение различных моделей и тестов на единичный корень

Методы и модели

- Тесты на единичный корень
 - Обычные
 - Продвинутое (учет структурных разрывов)
 - С использованием FFF (Flexible Fourier Form)
- Модель входа на рынок и выхода с него
- Модель храповика

Критика гипотезы

- Анализируя данные по Британии, автор отрицает падение способности трудоустройства и указывает на рост структурной безработицы
- При изучении безработицы отдельно в каждой из стран ОЭСР наблюдается эффект гистерезиса. Но с учетом взаимозависимости уровней безработицы в этих странах, гипотеза гистерезиса опровергается

Возможные направления макроэкономической политики

- Снижение процентной ставки во время спада позволяет в будущем уменьшить эффект гистерезиса
- Фискальная консолидация в период рецессии оказывает долгосрочное влияние на уровень безработицы

Литература

- 1) Olivier J. Blanchard, Lawrence H. Summers. “Hysteresis and the European Unemployment Problem”. NBER Macroeconomics Annual, Vol. 1, 1986, pp. 15-78
- 2) Rod Cross, Julia Darby, Jonathan Ireland, Laura Piscitelli. “Hysteresis and unemployment: a preliminary investigation”. The Science of Hysteresis (Volume 1), 2005, pp. 667-699.
- 3) David J. Smyth, Joshy Z. Easaw. “Unemployment hysteresis and the NAIRU: a ratchet model”. Applied Economics Letters, vol. 8, no. 6, June 2001, pp. 359–362
- 4) Assar Lindbeck, Dennis J. Snower. “Wage Setting, Unemployment, and Insider-Outsider Relations.” American Economic Review, vol. 76, no. 2, May 1986, p. 235
- 5) Johan J. Graafland. “On the causes of hysteresis in long-term unemployment in the Netherlands”. Oxford Bulletin of Economics & Statistics, vol. 53, no. 2, May 1991, pp. 155–170.
- 6) Fumitaka Furuoka. “Does Hysteresis Exist in Unemployment? New Findings from Fourteen Regions of the Czech Republic”. Finance a Uver: Czech Journal of Economics & Finance, vol. 64, no. 1, Jan. 2014, pp. 59–78
- 7) Dieu Nsenga, Mirada Nach , Hlalefang Khobai, Clement Moyo, Andrew Phiri. “Is It the Natural Rate Hypothesis or the Hysteresis Hypothesis for Unemployment Rates in Newly Industrialized Economies?”. Comparative Economic Research, vol. 22, no. 4, Dec. 2019, pp. 39–55

Литература

- 8) Fabio Gomes, Cleomar Gomes da Silva (2008) “Hysteresis vs. natural rate of unemployment in Brazil and Chile”. *Applied Economics Letters*, vol. 15, no. 1, Jan. 2008, pp. 53–56
- 9) David Webster. “Long-term unemployment, the invention of ‘hysteresis’ and the misdiagnosis of structural unemployment in the UK”. *Cambridge Journal of Economics*, vol. 29, no. 6, Nov. 2005, pp. 975–995
- 10) Simon Sturn. “Macroeconomic Policy in Recessions and Unemployment Hysteresis.” *Applied Economics Letters*, vol. 21, no. 13, Sept. 2014, pp. 914–917
- 11) Engelbert Stockhammer, Simon Sturn. “The impact of monetary policy on unemployment hysteresis”. *Applied Economics*. 2012, vol. 44, no. 21, pp. 2743-2756
- 12) J.J. Graafland, F. Huizinga. “Age-related minimum wages and hysteresis in unemployment, *Economics Letters*”. vol 32, no. 3, 1990, pp. 289-294