

EKONOMETRIK SIYOSAT BAHOLASHNING NAZARIY INQIROZI: LUCAS TANQIDI

Iskandarov Davlatbek Xursandbekovich

Toshkent Davlat Iqtisodiyot Universiteti Andijon fakulteti

“Mutaxassislik, ijtimoiy-gumanitar va aniq fanlar”

kafedrasi katta o'qituvchisi.

Raxmataliyeva Gulasal Xamidullo qizi

Toshkent Davlat Iqtisodiyot Universiteti Andijon

fakulteti «Iqtisodiyot» ta'lim yo'nalishi 2-bosqich talabasi.

Annotatsiya: Ushbu maqola Robert Lukasning 1976-yildagi "Ekonometrik siyosat baholash: tanqid" asarini keng tahlil qiladi. Lucas tanqidasi makroekonometrik modellarning iqtisodiy siyosatni baholashda qo'llanilishiga qarshi chiqib, ratsional kutilishlar sharoitida siyosat o'zgarganda ekonometrik modellarning parametrlari o'zgarishini va ularning prognoz qobiliyatining pasayishini nazariy asoslaydi. Maqolada Lucas tanqidasi metodologik asoslari, uning makroiqtisodiy tahlilga qilgan revolyutsion ta'siri, shuningdek, zamonaviy ekonometrik metodlarga bo'lgan ta'siri chuqur o'rganilgan. Tadqiqot Lucas tanqidasi hozirgi kundagi dolzarbligini va makroiqtisodiy siyosatni baholashda qo'llaniladigan zamonaviy usullarning rivojlanishidagi o'rnini yoritadi.

Kalit so'zlar: Lucas tanqidasi, ekonometrik siyosat baholash, ratsional kutilishlar, makroekonometrik modellar, parametr barqarorligi, struktur parametrlar, siyosat o'zgarishi, prognoz qobiliyati, makroiqtisodiy siyosat.

Abstract: This article provides a comprehensive analysis of Robert Lucas's 1976 paper "Econometric Policy Evaluation: A Critique." The Lucas Critique challenges the use of macroeconomic models for policy evaluation, theoretically demonstrating that under rational expectations, econometric model parameters change when policies change, leading to reduced predictive ability. The article examines the methodological foundations of the Lucas Critique, its revolutionary impact on macroeconomic analysis, and its influence on modern econometric methods. The research highlights the continued relevance of the Lucas Critique and its role in the development of contemporary methods for evaluating macroeconomic policy.

Keywords: Lucas Critique, econometric policy evaluation, rational expectations, macroeconomic models, parameter stability, structural parameters, policy change, predictive ability, macroeconomic policy.

Lucas Tanqidasi Tarixiy Konteksti va Ahamiyati .Robert Lucasning 1976-yilda "Carnegie-Rochester Conference Series on Public Policy" da e'lon qilgan

"Econometric policy evaluation: A critique" maqolasi makroiqtisodiy tahlilda fundamental o'zgarishlarni boshlab berdi. 1970-yillarda yuz bergan stagflyatsiya (ishsizlik va inflyatsiyaning bir vaqtning o'zida yuqori darajada bo'lishi) an'anaviy Keyncha modellarning samaradorligiga shubha uyg'otgan edi. Lucasning asosiy da'vosi shundan iborat ediki, keyncha makroekonometrik modellarning o'zgaruvchilar o'rtasidagi munosabatlari asosan tarixiy ma'lumotlarga asoslangan bo'lib, ular iqtisodiy siyosat o'zgarganda o'zgarishga moyildir. Lucas tanqidasiining markazida "ratsional kutilishlar" tushunchasi turibdi. Uning ta'kidlashicha, iqtisodiy agentlar mavjud barcha ma'lumotlardan foydalanib, tizimli xatolarga yo'l qo'ymaydilar. Shuning uchun hukumat siyosatini o'zgartirganda, agentlarning xatti-harakatlari ham o'zgaradi, bu esa makroekonometrik modellarning parametrlarining o'zgarishiga olib keladi. Lucas Tanqidasiining Nazariy Asoslari va Metodologik Innovatsiyalari Ratsional Kutilishlar Gipotezining Qo'llanilishi Ratsional kutilishlar gipotezi (John Muth, 1961) bo'yicha iqtisodiy agentlar kelajakdagi iqtisodiy o'zgaruvchilar qiymatlarini bashorat qilishda mavjud barcha ma'lumotlardan samarali foydalanadilar. Lucas bu gipotezni makroiqtisodiy siyosat tahliliga birinchi marta keng qamrovli qo'lladi.

lucas parametrlarni ikkiga ajratadi:

- Struktur parametrlar - iqtisodiy agentlarning afzalliklari va texnologik cheklovlari kabi asosiy xususiyatlarni ifodalovchi parametrlar
- Kamchilik parametrlar - faqat ma'lum bir siyosat rejimida amal qiluvchi sirtqi munosabatlar

Misol: Phillips egri chizig'ida ishsizlik va inflyatsiya o'rtasidagi munosabat siyosatga qarab o'zgaradi. Agar markaziy bank inflyatsiya kutilishlarini o'zgartirsa, ishchilar va firmalar o'z xatti-harakatlarini yangi siyosatga moslashtiradi, natijada Phillips egri chizig'i siljiydi.

Lucas Tanqidasiining Amaliy Oqibatlari va Makroiqtisodga Ta'siri
Makroekonometrik Modellashtirishdagi Inqilobiy O'zgarishlar

Lucas tanqidasiidan keyin makroekonometrik modellashtirish sohasida tub o'zgarishlar yuz berdi:

- An'anaviy Keyncha modellarning tanqidi
- Dinamik stoxastik umumiy muvozanat (DSGE) modellarining paydo bo'lishi
- VAR (Vector Autoregression) modellarining keng qo'llanilishi
- Mikro-asoslangan makroiqtisodiy modellarning rivojlanishi
- Siyosat Baholashda Yangi Yondashuvlarning Shakllanishi

Lucas tanqidasi siyosat baholashda quyidagi yangi yondashuvlarni shakllantirdi:

1. Mikro-asoslangan modellar - makroiqtisodiy hodisalarni individual agentlarning optimallashtiruvchi xatti-harakatlari orqali tushuntirish
2. Kutilishlarni bevosita o'lchash - so'rovlar va bozor indikatorlari orqali

3. Tabiiy eksperimentlar - tasodifiy ta'sirlarni o'rganish

4. Struktur identifikatsiya - iqtisodiy nazariyaga asoslangan parametr identifikatsiyasi

DSGE Modellarining Evolutsiyasi

Dinamik stoxastik umumiy muvozanat (DSGE) modellari Lucas tanqidasi javoban rivojlantirildi. Ular mikroekonomik asosga ega bo'lib, ratsional agentlarning optimallashtiruvchi xatti-harakatlarini aks ettiradi. Zamonaviy DSGE modellari:

- Yangi Keyncha elementlarni o'z ichiga oladi
- Moliyaviy sektorni hisobga oladi
- Heterogen agentlarni modellashtiradi
- Kausal Identifikatsiya Usullarining Takomillashishi

Zamonaviy ekonometrikada Lucas tanqidasi javoban kausal identifikatsiya usullari rivojlandi:

- Difference-in-differences (Farqlar farqi)
- Regression discontinuity design (Regressiya uzilish dizayni)
- Instrumental variables (Instrumental o'zgaruvchilar)
- Structural VAR modellari
- Makroiqtisodiy Prognozlashdagi Paradigma O'zgarishi

Lucas tanqidasi so'ng makroiqtisodiy prognozlash quyidagi yo'nalishlarda rivojlandi:

- Ko'p modeli yondashuv - turli model spektrlari
- Bayes ekonometrikasi - noaniqlikni hisobga oluvchi usullar
- Machine learning usullari - an'anaviy parametrik cheklavlardan qochish
- Real vaqtli prognozlash - doimiy yangilanuvchi baholash

Lucas tanqidasi qarshi quyidagi fikrlar bildirilgan:

• Amaliy ahamiyati cheklangan - ko'p hollarda parametr o'zgarishi sezilarli emas

- Ratsionallik darajasi - agentlar haqiqatan ham to'liq ratsionalmi?
- Amaliy siyosatda qo'llanilishi - alternativ metodologiyalarning yo'qligi

Lucas tanqidasi ekonometrik siyosat baholash sohasida fundamental o'zgarishlarni amalga oshirdi. U makroekonometrik modellarning chegaralarini ochib berdi va yangi, mikroekonomik asosga ega bo'lgan modellarning rivojlanishiga turtki bo'ldi. Bugungi kunda Lucas tanqidasi ahamiyati quyidagi jihatlarida saqlanmoqda:

1. Makroiqtisodiy siyosatni loyihalashda struktural modellarning ahamiyati
2. Iqtisodiy prognozlashda model barqarorligini baholash
3. Siyosat o'zgarishlarini tahlil qilishda kutilishlar dinamikasini hisobga olish
4. Makroiqtisodiy risklarni boshqarishda struktural o'zgarishlarni hisobga olish

Lucas tanqidasi nafaqat tarixiy ahamiyatga ega, balki hozirgi kunda ham makroiqtisodiy siyosat va ekonometrik modellashtirishda muhim nazariy asos bo'lib xizmat qilmoqda. Kelajakda makroiqtisodiy modellashtirishda Lucas tanqidasi asosiy g'oyalari - struktural parametrlar, ratsional kutilishlar va siyosatning endogen xarakteri - dolzarb bo'lib qoladi.

Foydalanilgan Adabiyotlar:

1. Lucas, R. E. (1976). "Econometric policy evaluation: A critique." Carnegie-Rochester Conference Series on Public Policy.
2. Muth, J. F. (1961). "Rational expectations and the theory of price movements." *Econometrica*.
3. Sargent, T. J. (1981). "Interpreting economic time series." *Journal of Political Economy*.
4. Sims, C. A. (1980). "Macroeconomics and reality." *Econometrica*.
5. Fernandez-Villaverde, J. (2010). "The econometrics of DSGE models." *SERIEs*.
6. Woodford, M. (2003). "Interest and prices: Foundations of a theory of monetary policy." Princeton University Press.
7. Christiano, L. J., Eichenbaum, M. S., & Evans, C. L. (2005). "Nominal rigidities and the dynamic effects of a shock to monetary policy." *Journal of Political Economy*.