

Kivétel vagy általános paradigma?

John Sutton: Marshall tendenciái, avagy mit tudhatnak a közgazdászok?

Fordította: Cseres-Gergely Zsombor. Nemzeti Tankönyvkiadó,
Közgazdasági Kiskönyvtár, 2005, 134 oldal

Közelmúltban magyarul megjelent könyvében John Sutton alapvető paradigmának nevezi az alkalmazott közgazdaságtannak a matematikai formába öntött modellek és a tapasztalati adatok közötti kapcsolat megteremtésére szolgáló, az adatokat szisztematikus és zavaró összetevőkre bontó megközelítését. A kötet fő erénye, hogy felhívja a figyelmet az elemzési módszerek alkalmazásának vizsgálatára, és jogosan kérdőjelezi meg az alapvető paradigma általános érvényét. Érvelése olykor azonban nem mentes az ellentmondásoktól, végkövetkeztetésében is kétértelműség figyelhető meg.

Két kérdés a (neoklasszikus) közgazdaságtan kiindulópontjával kapcsolatban. Sutton szerint közgazdasági tanulmányaik kezdetén a diákok két kérdést minden bizonnyal feltesznek: „Az egyik a közgazdászoknak ama feltételezését érinti, hogy az emberek és a vállalatok »racionális maximalizálóknak« tekinthetők, tehát olyan döntést hoznak, amely valamiféle egyszerű hasznosság- vagy profitfüggvényt maximalizál.” (15. o.) A másik kérdés a matematikai modellek hasznosságára vonatkozik.

Egyetértek Suttonnal abban, hogy ezek nagyon fontos, a tudomány lényegébe vágó kérdések, a pályafutás későbbi szakaszaiban történő elfeledésük a szelekcióval és a szocializálódással magyarázható, vagyis a kétkedők többsége vagy nem az elméleti közgazdász pályát választja, vagy elfogadja tanáraik és munkahelyi vezetőik megközelítését. A kérdés általános formában történő feltevését azonban indokolatlannak tartom, hiszen Sutton így már a kérdésfelvetéssel is kizárja a közgazdaságtanból a nem neoklasszikus irányzatokat. Megfogalmazása azért is megtévesztő, mert a „racionális maximalizáló” feltételezése nem egyenlő az „egyszerű hasznosság- vagy profitfüggvény” létezésével és maximalizálásával, és mindazokkal az implicit feltevésekkel, amelyek az ilyen függvények használatával együtt járnak. Így a tagmondat második felének megkérdőjelezése – vagyis annak bírálata, hogy az emberek döntéseinek sorozatát függvényekkel le lehet írni – sem egyenlő a racionalitás kétségbe vonásával.

Az alapvető paradigma kialakulása. Az első fejezet az alapvető paradigma kialakulását vázolja. A formális modellek és az empirikus adatok közötti kapcsolat megteremtésének egységes paradigmája az 1940-es évek végére alakult ki. A paradigma gyökerei Sutton szerint Marshallig nyúlnak vissza, aki a közgazdasági törvényeket tendenciaszerűen érvényesülőknak tartotta, mivel összetett és zavaros környezetben fejtik ki hatásukat. Marshall hasonlata szerint az égitestek mozgása nagy pontossággal meghatározható, ezzel szemben az árapály alakulását nehéz előre jelezni, mivel azt a gravitációs erőn kívül az időjárási viszonyok is befolyásolják. A gazdasági törvények az árapály jelenségéhez hasonlíthatók Marshall szerint. Sutton kétségbe vonja a hasonlat helytálló voltát, amely különleges helyzetektől eltekintve nem alkalmas a tényleges világ jellemzésére, viszont jól bemutatja azt a helyzetet, amelyben az alapvető paradigma működik. A marshalli hasonlat érvényessége esetén a közgazdaságtan sohasem látott mértékű fejlődését kellett volna tapasztalnunk az elmúlt ötven évben.

Az 1920-as és 1930-as években a közgazdászok többnyire determinisztikus modelleket

alkottak, és elvetették a közgazdasági adatok valószínűségszámításon alapuló modellekkel történő magyarázatát. A szerző szerint az ilyen munkák jelentősége azért nem volt egyértelmű, mert a feltárt összefüggések általánosíthatósága nem volt ismert. Ezután hivatkozik Robbinsnak a heringek keresletéről szóló példájára, amely szerint a kereslet múltbeli megfigyelése semmilyen alapot nem teremt a jövőbeli kereslet előrejelzésére. Robbinsnak az előrejelezhetőséggel és a paraméterek stabilitásával kapcsolatos „szélsőséges” kétkedése szerintem magyarázható lenne a tapasztalattal, Sutton szerint viszont az elméleti alapfeltevések jellegéről vallott meggyőződésből fakadt. Ezek a feltevések nyilvánvalóan igazak és elfogadhatók, és mint a szerző írja, megegyeznek a mikroökonómia mindenki számára ismert feltevéseivel, például azzal, hogy az egyének képesek preferenciáikat rendezni, vagy hogy egynél több termelési tényező létezik. Ez a megjegyzés ugyanakkor kiegészítésre szorul, mivel Robbins egyáltalán nem beszél a mikroökonómiából szintén ismert egyéb, valóságidegen feltevésekről (mint a tökéletes informáltság, homogenitás, idő és tér hiánya, illetve korlátozott volta, preferenciák állandósága) és a matematikai modellezésben rejlő, a közgazdaságtan tárgyától idegen implicit feltevésekről (mint a függvény formában történő kifejezhetőség, folytonosság, tökéletes oszthatóság). Robbinsnak az elmélet állításairól vallott nézeteit Sutton *a priori*-nak nevezi. Ezt is lehet pontosítani: Robbins elméletalkotása a gazdaságstatisztikákhoz, adatokhoz képest *a priori*, az általános emberi tapasztalatokon alapuló alapelvekhez képest *a posteriori*, szigorúan a tapasztalatokon alapuló. A neoklasszikus gazdaságmodellezés ezzel szemben ebben az értelemben valóban *a priori*, hiszen elméleteinek alapállításai között számos tapasztalattal ellentéteset találunk.

Sutton az alapvető paradigma megalkotói közül Samuelson-t és Haavelmót említi név szerint. Sutton szerint Haavelmo sztochasztikus megközelítése, amellyel a gazdasági megfigyeléseket szisztematikus és „zaj” összetevőkre osztotta fel, Marshall tendenciáival és az árapály típusú jelenségekkel állíthatók párhuzamba. Nem gondolom azonban azt, amit Sutton ezzel a – könyv címében is megjelenő – párhuzammal sugall, vagyis hogy Marshall hasonlata egyben azt jelenti, hogy a gazdasági folyamatok valószínűségelméleti megközelítését szorgalmazta volna. Marshallnál erre semmilyen utalást nem találunk. Ártatlan hasonlata azt fejezi ki, hogy a közgazdaságtan tárgya nem teszi lehetővé az állandó, számszerűsíthető függvénykapcsolatokkal történő magyarázatot és előrejelzést, mint ami lehetséges egyes természeti jelenségek esetében.

Az alapvető paradigma korai bírálói közül Sutton Keynes-t és Hayekot említi. Meg kívánja győzni olvasóit, hogy a bírálatuk talán túlzó, de semmiképpen sem hibás. A bírálatokkal azonban érdemben nem foglalkozik, így azt sem fejt ki, milyen értelemben túlzók, csupán azt az ellentétést említi meg: nem szabad, hogy az adatok válasszanak modellt. Hayek elvi alapon teljes mértékben elvetette az alapvető paradigmát, ezért különösen ellentmondásos, hogy Sutton védelmébe veszi bírálatát. Hayekre 1974. évi, a Nobel díj átvételekor tartott beszédére 1989-ben kifejtett nézetekként hivatkozik, miközben Hayek itt a statisztikai adatok és az elmélet közötti kapcsolatról a húszas évek végétől hangoztatott álláspontját ismételte meg.

A fontos szisztematikus hatásokat jellemzően nem lehetséges éles határvonallal elválasztani a zavaró hatásoktól. Ha az alapvető paradigma keretében próbáljuk elméleteinket ellenőrizni, alapvető problémákkal kerülünk szembe, a modellválasztásra próbáink esetleg nem adnak határozott vagy meggyőző választ – írja a szerző a 47. oldalon, összhangban korábbi fejtegetéseivel. Ezzel szemben a 48. oldalon már úgy vélekedik, hogy a legtöbb helyzetben az alapvető paradigma a leghasznosabb vizsgálódási módszer. Ez az ellentmondás az utolsó fejezetben is megismétlődik.

Működő modellek. A 2. fejezet két olyan modellel foglalkozik, amelyek esetében az alapvető paradigma működik. Az első példa az opcióárzás területéről való. Sutton a varianciaparaméter becslése kapcsán fellépő problémákat az elmélet finomhangolási ne-

hézségeinek tartja. A másik működő modell a játékelmélet területéről való kétszemélyes aukciós játék. Ebben az egyik résztvevő ismeri a licit tárgyának értékét, a másik résztvevőnek azonban csak egy „valószínűségi eloszlása” van. Mint Sutton írja, a szakirodalom az ezen a feltevésen alapuló modellt a játékelmélet egyik legszebb alkalmazásának tartja. Később azonban megjegyzi, hogy a gyakorlati életben igen ritkán teljesülnek a modell feltételei.

Úgy érzem, lehetőség lett volna Sutton példáinál szerencsésebbeket is választani az alapvető paradigma működésének illusztrálására, bár kétségtelenül nem a makroökómia területéről. A vállalati készletgazdálkodás, banki pénzforgalom vagy az életbiztosítások terén például a szisztematikus és zajhatás elkülönítésére jól működő, tapasztalat által igazolt modellek szolgálnak, a valószínűségelméleti megközelítést pedig indokolja a jelenségek tömegszerűsége és homogenitása. Az opcióárazás elméleteiben kulcskérdés a részvényárfolyamok volatilitásának meghatározása. Ez azonban több nehézségbe ütközik, mert annak az időtartamnak, amelynek alapján a volatilitást kiszámítják, nincs természetes egysége, hossza. Önmagában egy modell használata nem bizonyítja a modell jó működésére; Sutton is írja, hogy a Black–Scholes-modell túlárazza a nagy szórású, és alulárzza a kis szórású részvényeket. A licitálás példájának csak akkor van gyakorlati jelentősége, ha a licitálás azonos körülmények között nagyon sokszor megismétlődhet.

Lazítás az alapvető paradigmán. A 3. fejezetben Sutton korábbi kutatási témájával, az ipari piacszerkezetekkel, piaci koncentrációval foglalkozik. A piac méretének növekedésével új vállalatok léphetnek be a piacra, így csökkenhet a koncentráció mértéke. (A koncentrációt a legnagyobb vállalat piaci részesedésének arányában méri.) A modell gyakorlati adatokra történő alkalmazása azért nehéz, mert számos részletkérdéstől függ a koncentráció alakulása: a vállalatok változtathatják stratégiájukat, eltérő földrajzi helyzetűek, eltérő termékeket árulnak ugyanazon termékcsaládon belül, a termékek különböznek egymástól a reklámozhatóság, a K+F-kiadás aránya szempontjából, az új belépések történhetnek időben egyszerre vagy egymást követően. Nem határozható meg tehát a koncentráció alakulására vonatkozóan egyetlen egyensúlyi pont, hanem csak egy minimális szint, amely alá a koncentráció egyensúlyi helyzetekben nem csökkenhet.

Sutton példájának a lényege abban foglalható össze, hogy nincs egyetlen általános modell, ami képes lenne jól leírni a piaci koncentráció alakulását, hanem egy modelleszám létezik, amely a kiinduló körülményektől függően eltérő eredményekre vezet. Ezt a megközelítést Sutton az alapvető paradigma lazításának nevezi, és bírálja azokat a megközelítéseket, amelyek egyszerű regressziós kapcsolatot feltételezve vizsgálták a koncentrációra hatással lévő tényezőket. Egy homogén javakat termelő és egy erőteljesen reklámozott javakat termelő ágazatcsoportot együttesen tartalmazó adatbázisra lefuttatott regresszió például bizonytalan vagy megtévesztő eredményekre vezethet.

Sutton a modelleszám-megközelítést ugyanakkor csak ritkán, speciális helyzetekben tartja alkalmazhatónak, amely így az alapvető paradigma kiegészítőjéül, nem pedig alternatívájául szolgálhat. A piacszerkezet problémáját sajátosnak tartja, mivel a nem mérhető és ellenőrizhető elemek megváltozása csak az eredmények alsó határára (a koncentráció minimális mértékére) van hatással. A legtöbb esetben a nem megfigyelhető tényezők kezelése ennél jóval nehezebb, ami megnehezíti a modelleszám-megközelítés alkalmazását. Úgy gondolom azonban, hogy pontosan az ilyen bonyolultabb esetekben lenne nagyobb jelentősége annak, hogy megszabadítsuk gondolkodásunkat az alapvető paradigma azon feltevésétől, miszerint „létezik egy elméleti modell, amely rögzíti az adatokban tapasztalható »átlagos viselkedést«” (96–97. o.).

Az alapvető paradigma mégsem marshalli eredetű, de mégis hasznos? A több kisebb témakört tárgyaló 4. fejezetben a könyv addigi okfejtéseire képest két meglepő fordulattal is találkozhatunk. A 104. oldalon Marshall az alapvető paradigmával szemben álló

Robbins előfutárává válik: „Már az első előadásban láttuk, hogy az az elméleti program, amelynek ösvényét Marshall és Edgeworth taposta ki, és Robbins tökéletesített, az empirikus iskola kutatásaira válaszként jött létre.” (104 o.) Az első előadásban Marshall még az alapvető paradigma és Haavelmo előfutára volt. Robbins és Haavelmo közgazdaságtanról vallott felfogása egymással összeegyeztethetetlen. Ez mindenesetre vagy következetlenség Sutton részéről, vagy tudatos elgondolás, miszerint mindketten Marshall köpenyéből bújtak ki. Az utóbbi megoldást kicsit erőltetettnek tartanám, hiszen Marshall mindkét irányzattól eltérő nézeteket képviselt.

A 112. oldalon Sutton megkülönbözteti az alapvető paradigma gyenge és erős interpretációját. A gyenge interpretáció szerint a paradigma segítségével felfedezhetjük az adatokban rejlő szisztematikus összefüggést, de nyitva marad az a kérdés, hogy a piac leírható-e teljes modellel. Az erős interpretáció szerint létezik egy ilyen teljes, valódi modell, amit minden kutató be tud azonosítani. Véleménye szerint a paradigma erős változata csak rendkívüli esetekben alkalmazható, például a 2. fejezetben tárgyalt aukciók és opciók esetében. A makrogazdaság összetettebb szintjén nincs egyetértés a kutatók között abban, hogy mi lenne az igazi modell.

A fejezet végén a szerző így összegzi véleményét az alapvető paradigmáról: „Mégis azt mondhatjuk, nem vesztve szem elől a módszertani nehézségeket, hogy az alapvető paradigma megalapozóinak célja tekinthető a közgazdasági kutatás igazi, helyes céljának. Az alapvető paradigma születése hozta el a közgazdaság-tudományba azt az új szemléletet, amely ragaszkodik ahhoz, hogy a versengő nézeteket határozottan körülírt elméletek formájában fogalmazzák meg, amelyeket így világos empirikus próbák segítségével lehet összevetni.” (117–118. o.)

Ellentmondásosnak érzem kijelenteni, hogy egyrészt a kritikusok problémái jelentősek, ugyanakkor mégis az alapvető paradigma szolgáltatja az igazi, helyes módszert. Miután a könyv korábbi részében Sutton több helyen kifejtette, hogy az alapvető paradigma a világ komplexitása miatt valóságos gazdasági problémák során a „különleges helyzetektől eltekintve” nem alkalmazható, végkövetkeztetése különösen hangzik. A korábbi bírálatában az itt megjelenő „világos empirikus próbák” lehetőségét is nagyon egyszerű esetekre korlátozta, és inkább ezek hiányát bizonygatta: „még a klasszikus paradigma keretein belül sem egyértelmű tehát, hogy melyek is pontosan a jó viselkedés ismérvei” (38. o.); „fontos megjegyzés volt, hogy nincs a jó tulajdonságoknak olyan meghatározása, amellyel minden kutató egyetértene. ...a szubjektív elem még hangsúlyosabb lett” (106. o.). Talán a kötet előszavában említett szocializáció akadályozta meg abban, hogy a számos kritikai észrevételt követően a végszóban is elvesse az alapvető paradigmát. Azt is jelentené mindez, hogy a paradigma bírálói, az említett Hayek és Keynes vagy a korábban alkotó, eltérő alapállású Adam Smith, Carl Menger és mások határozatlan elméleteket alkottak, hibásan érveltek, és hibásan ragadták meg a közgazdaságtan „igazi, helyes célját”, csak mert nem az alapvető paradigma korlátai szerint jártak el? Egy ilyen következtetés számomra nem fogadható el.

Összefoglalásként: Sutton könyve érdekes, a hétköznapi elemzési rutin számára ritkán felvetődő, elmélettörténettel és modellalkotással kapcsolatos kérdéseket tárgyal. A könyv erősségét ugyanakkor nem a következetes ismeretelméleti megállapítások, hanem a világosan bemutatott, esettanulmányyszerű konkrét gazdaságelméleti problémák jelentik.

Dusek Tamás