

El presente dossier incluye tres notas acerca del pensamiento de Lawrence Boland. En principio, se trataba de plantear una serie de cuestiones para discutir con el prestigioso epistemólogo de la economía con motivo de su presencia en Buenos Aires en el marco de las Jornadas de Epistemología y Metodología de las Ciencias Económicas que se celebran anualmente en la Facultad de Ciencias Económicas de la Universidad de Buenos Aires. Por diversos motivos, el profesor Boland no pudo asistir al encuentro realizado en 2001, de manera que los interrogantes que pensábamos formular en aquella oportunidad se convirtieron en los trabajos que aparecen en este dossier. Esperamos contar con la respuesta del profesor Boland en nuestro próximo número de *Energeia*.

LA PROPUESTA DE BOLAND PARA “COMPLETAR” EL PIN

I. Introducción

Boland aplica al Programa de Investigación Neoclásico (PIN) la concepción de Russel-Popper, según la cual la epistemología tiene repercusiones teóricas: sostiene que el PIN contiene presupuestos filosóficos que resultan determinantes en su desarrollo teórico. Estos son: 1) aceptación de la necesidad de lidiar con el problema de la inducción (o su forma modificada: el problema de las convenciones); 2) aceptación del individualismo metodológico reduccionista (psicologista). Ambos conforman la Agenda Oculta Neoclásica (AON).

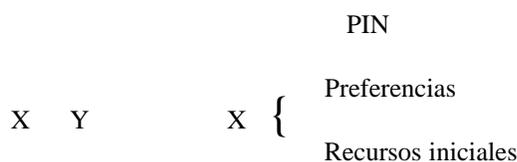
Boland sostiene que la aceptación de los dos ítems genera muchos de los problemas que los economistas neoclásicos consideran fascinantes, así como los obstáculos que bloquean su solución. El resultado de la utilización de AON es, pues, una combinación de (pseudo) problemas y soluciones inaceptables. En este trabajo nos ocuparemos principalmente de examinar las repercusiones de la agenda oculta de los neoclásicos sobre su teoría dinámica y la solución que propone Boland a los problemas suscitados.

II. El dilema del PIN

Todo modelo puede ser concebido en última instancia como estableciendo una conexión entre dos conjuntos de variables: las exógenas, que no son explicadas en el interior del modelo, y las endógenas, que se explican asumiendo las primeras. La AON impone al PIN severas restricciones al contenido de sus variables exógenas. El psicologismo, en la versión de Boland, sostiene que los únicos factores exógenos no naturales aceptables son los estados psicológicos (preferencias). En consecuencia, las variables exógenas pueden consistir sólo en estados psicológicos y re-

cursos inicialmente disponibles. Estos son los únicos “givens” admisibles.

El Cuadro siguiente ilustra esta idea. X es el vector de factores exógenos (los givens), e Y el de los factores endógenos. En el marco del PIN no se admite que X incluya instituciones, pero éstas pueden aparecer en Y (como resultado de la elección racional de todos los agentes).



En este esquema, todo lo que se obtenga en Y (por ejemplo, los precios de equilibrio) está ya implícito de alguna manera en las premisas del argumento incorporadas en X. Esto da lugar al siguiente problema:

Si uno supone inicialmente condiciones que garantizan el equilibrio, es imposible que el desequilibrio pueda obtenerse a partir de ellas. Pero el desequilibrio es un hecho (o, al menos, es un hecho concebible). Por otra parte, uno encuentra en la literatura económica “fábulas” destinadas a “explicar” cómo en un mercado competitivo, ante exceso de la oferta o de la demanda, el sistema tiende espontáneamente al equilibrio. La conceptualización rigurosa de estas fábulas es lo que ha dado origen al problema dinámico del ajuste.

Hay pues dos problemas centrales que debe abordar el PIN: a) explicar cómo puede producirse el desequilibrio; b) explicar cómo puede la economía converger nuevamente hacia el equilibrio. Estos problemas no pueden ser resueltos de cualquier manera. He aquí dos requisitos básicos para que las soluciones propuestas sean satisfactorias: a) no deben ser ad-hoc (deben ser coherentes con la AON); b) deben ser aceptables independientemente. El primero exige coherencia; el segundo legitimidad.

Según Boland, el PIN no ha logrado explicar satisfactoriamente ambas cuestiones. Efectivamente, la actitud ante el primer problema ha sido “eliminar” el desequilibrio. Para ello se han ensayado diferentes estrategias, siendo la introducción de la hipótesis de expectativas racionales (HER) la más conocida (y mejor considerada entre los miembros del PIN). Sin embargo, aunque HER es coherente con la AON, es inadecuada porque presupone la inducción o el convencionalismo, que son inaceptables. Respecto del problema del ajuste, pareciera (Arrow) que para su solución

se necesita admitir algún tipo de competencia imperfecta, pero ello, aunque fuera aceptable, es incompatible con el psicologismo. Su solución requiere entonces una movida ad-hoc que conduce fuera del PIN.

Puede concluirse entonces que toda solución neoclásica de cualquiera de los dos problemas enfrenta el siguiente dilema: Para evitar la ad-hocidad deben presuponer la AON, pero esto las vuelve inaceptables, porque parten de presupuestos insostenibles; pero entonces, para ser aceptable una solución, debe ser incompatible con AON; pero ello la convierte en ad-hoc. No hay, pues manera de resolver satisfactoriamente los dos problemas mencionados, si por ello se entiende ajustarse a ambos requisitos simultáneamente. Es aquí donde cobra cuerpo la propuesta central de Boland. Es necesario romper con la AON y sustituirla por otra “agenda” que resulte aceptable mediante razones independientes. Boland no afirma que es necesario romper con el PIN; afirma que es necesario “completarlo”. Independientemente de lo exitoso que resulte este recurso retórico, lo central es que considera que se necesitan modificaciones sustanciales, si ha de explicarse el desequilibrio (o su posibilidad) y el tránsito del desequilibrio al equilibrio. Examinaremos ahora esta propuesta.

III. Explicando la dinámica

Volvamos al esquema X → Y

Como ya señalamos, el psicologismo introduce una restricción acerca de los componentes admisibles en X: sólo puede haber preferencias y recursos iniciales. En la versión más avanzada (HER) también se permite una función de aprendizaje inductiva (se asume que las expectativas son adecuadas y han sido adquiridas por este medio). Esta modificación es importante, pero, de todos modos, no logra resolver el problema dinámico que Boland está considerando. Cualquiera sea la composición de X, si los cambios en Y se producen meramente a consecuencia de cambios en X, el movimiento de Y es exógeno (está exógenamente dado). Para ofrecer una verdadera explicación dinámica de los cambios en Y, el “principio de movimiento” debe ser endógeno. ¿Cómo se logra? La propuesta de Boland es introducir la metodología de los agentes -A(m)-, con lo que el esquema causal quedaría así:

X → A(m) → Y

Donde “A” denota al agente y “m” a su metodología. En este esquema se preserva la exogeneidad de algunos factores, sin lo cual el modelo sería circular. La exogeneidad es pues necesaria. ¿Cuáles serían los factores exógenos admisibles en este

programa neoclásico ampliado? Seguramente ha de haber instituciones y conjeturas (teorías), ya que en ambos casos se abandona el psicologismo. Pero lo más importante es que la función de aprendizaje que en el PIN es concebida como exógena (y alojada en el vector X) sería ahora endógena y “propiedad” de cada agente (desde luego, tampoco sería inductiva).

Aunque un modelo dinámico debe contener factores exógenos (X no puede ser vacío), el principio de animación debe ser endógeno. En este esquema, una misma configuración de X (y un mismo conjunto de cambios en X) no necesariamente conduce a los mismos valores de Y. Qué valores adquirirá Y dependerá de la metodología del agente (la cual determina su reacción ante consecuencias inesperadas).

¿Cómo desarrollar esta idea y, sobre todo, cómo implementarla para modelar el comportamiento económico? Hay que tener presente que la idea de Boland es proporcionar un modelo completo, capaz de explicar tanto el equilibrio como el desequilibrio. Su propuesta podría desarrollarse algo más explorando diversas posibilidades:

X $A_i(m_j)$ Y

Ahora “ $A_i(m_j)$ ” es un “vector” que incluye diversos tipos (agentes representativos) de agentes según la metodología que acepten o utilicen. Una alternativa menos operativa es exigir que se modele el comportamiento de todos los agentes del sistema. Como sea, se puede comenzar con un solo agente (quizás representativo) o con dos, y después ir progresivamente introduciendo complicaciones. “ A_i ” puede representar tipos de agentes o agentes individuales; “ m_j ” a diversas metodologías. Surgen algunos interrogantes acerca de semejante esquema.

Endogeneizar “m”

¿Permite este enfoque explicar el desequilibrio? Para responder esta pregunta hay que tomar en cuenta lo que Boland entiende por explicación de la dinámica. En el PIN los cambios en Y se explican por los cambios en X, pero estos últimos quedan inexplicados (si son explicados, lo son fuera del modelo). Si se pregunta por qué (se produjo un cambio en) Y, y se responde porque (se produjo un cambio en) X, “Y porque X” es una (genuina) explicación en tanto y en cuanto no me limito a derivar Y de X, sino que además hay razones para sostener X. En términos hempelianos: el explicans X explica el explicandum Y sólo si X está bien establecido.

La explicación dinámica añade al anterior, el requisito de que la causa del cambio

debe ser endógena. En un esquema como el que acabamos de presentar, X puede ser considerado fijo: dado X, es la metodología del agente lo que determina Y. ¿Por qué decir que “m” es endógena en esta perspectiva? ¿Qué quiere decir “endogeneizar” la metodología de los agentes? Ya en este punto conviene introducir una aclaración. Una cosa es criticar al PIN porque presupone una teoría del aprendizaje inadecuada y otra es criticarlo porque contiene una teoría del aprendizaje exógena. Boland le critica ambas cosas.

En cuanto a la exogeneidad, ¿por qué tendría el PIN (o cualquier otro programa) que explique la teoría del aprendizaje que describe el proceso de aprendizaje de los agentes? Una cosa es incorporar al Programa alguna teoría del aprendizaje (defendible fuera del programa), y otra muy diferente es explicarla dentro del Programa. ¿Cómo podría no ser exógena cualquier teoría que se incorpore? Creo que la confusión proviene de un uso ambiguo del término: en este caso, endogeneizar no significa derivar a partir de los “givens” (como es el caso cuando se afirma que las instituciones son endógenas). Endogeneizar la metodología puede significar simplemente introducir en el modelo una función de aprendizaje que cumpla las tres siguientes funciones: a) haga las veces de operador (transforme la información contenida en los “givens” en decisiones o acciones); b) sea aceptable mediante argumentos independientes; c) no sea simplemente asumida, en el sentido de dada de una vez y para siempre: los agentes pueden “aprender metodología” (es decir, ésta puede ser afectada por los resultados del vector Y, algo que no podría ocurrir con los elementos “realmente” exógenos de X). Lo que realmente se endogeneiza, en el sentido usual del término, son las decisiones (reacciones) de los agentes motivadas por la metodología que usan.

En cuanto a la adecuación, la función de aprendizaje de los agentes no puede ser inductiva, según Boland. Pueden alegarse dos argumentos para defender esta postura:

- 1) La inducción es imposible: no existen inferencias inductivas (válidas). La gente no hace en sus cabezas aquellas cosas que no pueden hacerse en el papel.
- 2) Se aprende sólo de los errores (Sócrates-Popper). No se aprende de la experiencia favorable.

La función de aprendizaje incorporada al PIN reúne ambos inconvenientes: es exógena (no cumple con los requisitos (b) y (c) mencionados arriba) e inductiva. Está claro que es inaceptable para Boland. En particular, como no se puede aprender inductivamente, tampoco es posible explicar este “hecho” (ni dentro ni fuera de mo-

delo alguno) y por ello sólo puede ser postulada. Pero, como Boland señala, debería haber límites a lo que uno puede postular. Y esos límites deberían impedir al neoclásico asumir un imposible.

Dimensiones Positiva y Normativa

Para dar una explicación dinámica del cambio es necesario introducir una función de aprendizaje que, además de endógena, sea adecuada. ¿Qué quiere decir “adecuada”? Hay dos sentidos básicos en que puede ser usado el término: defendible mediante argumentos (sentido normativo) y empíricamente correcta (sentido positivo). Esta es una distinción que a Boland no le gusta, pero es importante. Si la intención es construir una teoría positiva, de lo que se trata es de descubrir la metodología de los agentes (aquella que de hecho emplean).

Como la crítica dirigida inicialmente al PIN fue que no lograba explicar el desequilibrio, ni el pasaje del desequilibrio al equilibrio, cabe preguntarse si este enfoque alternativo logra estos objetivos. No es seguro que así sea. Pareciera que ello depende de cómo se comportan los agentes. Como ya indicamos, la teoría dinámica por construir, daría lugar a diversos escenarios, según se modele a los agentes y según se combinen las diferentes metodologías que pudieran emplear.

Si, por ejemplo, los agentes fueran “escépticos” (a la Popper) ello garantizaría que aprenden. En realidad, según Boland, el “escéptico” es el único que aprende, ya que aprender implica ser sensible a las falsaciones, sensibilidad de que carece por completo el a-priorista y que no posee en grado suficiente el convencionalista. Sin embargo, el comportamiento resultante podría (a decir verdad, debería) ser errático y nada aseguraría la convergencia hacia el equilibrio. En este caso, también se perdería predictibilidad, control y estabilidad. Podría ser el peor de los escenarios a los efectos de implementar políticas económicas.

Más manejable desde el punto de vista práctico es cualquier modelo en que los agentes no reaccionan (o reaccionan débilmente) ante las consecuencias inesperadas de sus acciones. Boland concede que los agentes pueden ser inductivistas. ¿No hay una contradicción entre afirmar que lo son y que la inducción es imposible? No, porque ser inductivista puede consistir meramente en creer que hace falta una prueba inductiva para conocer, y tener una teoría inductivista del aprendizaje en creer que uno aprende reuniendo mayor información. Se puede crear en ambas cosas, aunque no sean ciertas (aunque no sea posible hacer ni una cosa ni la otra y aunque no sea necesario la prueba inductiva para conocer).

Supongamos que se modela la economía mediante agentes inductivistas. Boland no dice mucho al respecto, pero al menos reconoce que este enfoque tiene alguna ventaja: el comportamiento de tales agentes es más uniforme (daría lugar a patrones más estables que si el agente fuera “escéptico”). De cualquier manera, cuál es de hecho la metodología de los agentes es algo que debe ser averiguado (su determinación ha de ser resultado de la investigación empírica).

Pero las discusiones metodológicas tienen también una dimensión normativa. Asumamos, siguiendo a Boland, que el convencionalismo, el apriorismo y el inductivismo son inaceptables. El papel del epistemólogo es denunciar sus falencias y convencer a quienes poseen esta metodología que la abandonen.

Paralelamente, el papel del educador es mostrar que para aprender es necesario comportarse como el Popper socrático. Supongamos que los agentes leen a Boland y aceptan sus argumentos.

Comienzan entonces a comportarse como “escépticos”. Ello está metodológicamente bien, pero desde el punto de vista económico puede estar muy mal, ya que la economía puede volverse caótica. La convergencia hacia una metodología única (y correcta) no garantiza la convergencia hacia el equilibrio. Asimismo, la idoneidad epistemológica de agentes bien educados no garantiza una economía más próspera y más sana.

Conclusiones

En la propuesta de Boland, la metodología de los agentes haría las veces de un operador que transforma estímulos (exógenos) en decisiones. Esto es lo que él denomina una explicación “endógena” del cambio. Asumiendo que tal programa sea técnicamente viable, algo que debe mostrarse construyendo modelos concretos, no es seguro que la metodología que de hecho prevalezca entre los agentes asegure o facilite la convergencia hacia el equilibrio. Menos seguro todavía es que este papel lo desempeñe la metodología recomendada por Boland, ya que los sistemas económicos conformados (o dominados, o al menos poblados de manera significativa) con agentes portadores de metodología “racionalista crítica” serían intrínsecamente inestables. Pareciera, en cambio, que este resultado sería más probable si los agentes fueran inductivistas (o convencionalistas).

Pero si esto es verdad, un proyecto a la Boland, que incorpore agentes racionalistas críticos, se desempeñaría de manera desigual respecto de los dos problemas básicos que el PIN no logra resolver y que motivan a Boland a proponer su programa am-

pliatorio. Permitiría explicar fácilmente el desequilibrio (es decir, el surgimiento del desequilibrio). Por ejemplo, aunque no existan oportunidades desaprovechadas, bastaría que los agentes creyeran que las hay para adoptar decisiones que al ser falsadas desencadenaran el desequilibrio. Pero sería ineficaz para resolver el problema del ajuste.

Por otra parte, aunque la batalla contra la inducción y el convencionalismo resulte claramente defendible desde el punto de vista epistemológico, si fuera ganada no es seguro que arroje resultados aceptables desde el horizonte más amplio del tipo de sociedad que deseamos construir. Agentes poco refinados epistemológicamente podrían adoptar comportamientos más útiles socialmente que agentes bien educados.

Pero quizás la metodología de los agentes, aunque importante, no sea tan decisiva como Boland pretende. Una manera de eludir estos inconvenientes es poner menos énfasis en la metodología de los agentes y otorgarle un papel más destacado a las instituciones (a la manera post Keynesiana), convirtiéndolas en un factor estabilizador privilegiado. Estas serían, como Boland desea, resultado de un proceso endógeno, ya que la formación de instituciones es en gran medida un acto deliberado y creativo de parte de los agentes (que no está determinado por los factores exógenos, sean estos cuales fueren). Sin embargo, sospecho que Boland no aceptaría esta solución, pues en su crítica al PIN lo único que reivindica para ellas es su derecho a figurar entre los “givens” de largo plazo.

Gustavo L. Marques (FCE-UBA)