

LA CRÍTICA Y LA AUTOCRÍTICA IMPLÍCITA DEL
PENSAMIENTO NEOCLÁSICO: UN DEBATE
TRASCENDENTE

The implicit critic and auto critic of neoclassical thinking: a
transcendent debate

Dr. Lázaro Peña Castellanos
Centro de Investigaciones de Economía Internacional UH – Cuba

lazaro@rect.uh.cu

.....
Recibido: Mayo, 2016
Aceptado: Junio, 2016

Resumen

El artículo trata asuntos metodológicos de la Economía como Ciencia y su impacto en el debate crítico de la teoría económica neoclásica y de sus recomendaciones de política económica.

Palabras clave: teoría económica, metodología, filosofía de la ciencia, nueva síntesis neoclásica.

Abstract

The article deals with methodological matters of the Economics as a Science and its impact in the critical debate of the economic neoclassical theory and its recommendations of economic policy.

Keywords: economic theory, methodology, philosophy of the science, new neoclassical synthesis.

Introducción

Un asunto que no ha acaparado la suficiente atención en la Academia Cubana, al menos a juzgar por los muy escasos trabajos e investigaciones que lo abordan, es el de la crítica actual al pensamiento teórico neoclásico. Con el objetivo de mostrar los derroteros principales del debate presente se ha elaborado el presente artículo. Su estructura es bien sencilla, se subdivide en tres capítulos: el primero aborda cuestiones epistemológicas, solo con el objetivo de hacer más comprensible al lector el capítulo segundo, que se extiende, propiamente, en la crítica y la autocrítica de los neoclásicos. En el tercer capítulo, "Epílogo", se retoman los asuntos metodológicos esenciales abordados y se realiza una breve incursión al tratamiento que el denominado marxismo crítico ha dado al asunto.

1. El problema epistemológico: ¿Es la economía una ciencia empírica?

Un aspecto esencial del debate que nos ocupa es la caracterización de la metodología y el paradigma epistemológico de lo que mayoritariamente se identifica como "ciencia económica", esto es el sistema teórico neoclásico, y sus disciplinas prácticas, la microeconomía y la macroeconomía. Empecemos entonces por este escabroso asunto.

1.1 Cuestiones de lógica y método: mi interpretación del marxismo.

Solo a manera de situar los ejes metodológicos del expositor permítaseme dos licencias: a) denominar postulados a contenidos de la lógica dialéctica que por definición son anti-axiomas; b) extraer tales postulados de uno de esos, a mi entender, buenos, aunque limitados manuales, que se encontraban en cualquier biblioteca de Cuba y que hoy se rechazan bajo los influjos de la demoledora crítica de los seguidores del denominado marxismo crítico. Para los objetivos de este artículo bastan las páginas de un viejo manual.

Materia: La materia es una categoría filosófica para designar la realidad objetiva, reflejada por nuestras sensaciones y existente independientemente de ellas, con frecuencia se identifica simplistamente materia con sustancia y se reduce la materia a su base sustancial, "corporal". Existen formas y tipos de materias que no son, en modo alguno, sustancia, por ejemplo, un campo electromagnético, en igual sentido, las relaciones sociales y económicas son, también, materia, o sea, realidad objetiva.

Verdad Objetiva: Conocimiento relativamente veraz de la realidad objetiva y sus formas, por lo que su contenido no depende del sujeto. La verdad siempre es relativa y limitada, y aunque su contenido no depende del sujeto, no existe ningún conocimiento y por tanto, verdad, que sea independiente de la actividad práctica del hombre. De una parte la verdad es subjetiva por cuanto es un resultado de la actividad humana, por otra parte es objetiva, pues su contenido no depende del sujeto.

Lázaro Peña Castellanos

Criterio de la veracidad del conocimiento: El problema de si al pensamiento humano se le puede atribuir una verdad objetiva, o el de su capacidad de reflejar la realidad objetiva, no es un problema teórico, sino un problema de la praxis. Es en la praxis, proceso que trasciende tanto a la teoría como a la mera observación, donde el hombre tiene que demostrar la verdad, es decir, la veracidad de su pensamiento (Konstantinov et. al., 1975).

1.2 Cuestiones de lógica y método: El debate en la Filosofía de la Ciencia

La filosofía neopositivista mucho ha tenido que conceder ante el avance de la ciencia. A comienzos del siglo XX, desde la postura filosófica del positivismo lógico, a la ciencia se le negaba una capacidad cognoscitiva de la realidad objetiva, y se le concebía como un mero instrumento de lógica lingüística: “Hoy nadie cree que la ciencia explica nada todos la miramos como una descripción en taquigrafía como una economía del pensamiento”, decía Pearson (Pearson, K., 1911).

Se trataba, a todas luces, de una posición filosófica bastante endeble respecto a la función de la ciencia, solo explicable por prejuicios epistemológicos, no por la constatación de los hechos, de todas maneras, la profunda penetración de la ciencia en todos los ámbitos de la realidad y sus ingentes resultados ofrecían mucho más que una taquigrafía lógica descriptiva, y acallado por la evidencia, para finales de siglo el positivismo lógico tuvo que ceder su lugar al empirismo lógico: “El primero está muerto, el segundo tiene fuerza vital en la Filosofía de la Ciencia” (Salmon W., 1999), era ya, para ese entonces, el consenso que primaba.

Existe una diferencia metodológica fundamental entre el positivismo lógico y el empirismo lógico. El positivismo lógico tiene por metodología el denominado *phenomenalistic approach*, (Stern, D., 2006) que proclama que la labor teórica de la ciencia se reduce a la construcción de modelos, proposiciones básicas, o conjuntos de supuestos que no tienen por función explicar la realidad externa (*objetiva*), sino únicamente suministrar un instrumental para la medición y el control de las relaciones que la caracterizan.

En cambio, el empirismo lógico utiliza por metodología, alguna de las disímiles variantes del *physicalistic approach*, (Stern, D., 2006) que identifica la ciencia como sistemas de conocimiento probabilístico del mundo basados en observaciones corregibles acorde a dos criterios: a) el realismo científico o al decir de Salmon, la existencia real como una probabilidad que bordea la certeza (Salmon W., 1999); b) la teoría científica como explicación, que según señala Hempel, tiene como propósito la sistematización del conocimiento lo cual incluye la explicación y la predicción (Salmon W., 1999).

Lázaro Peña Castellanos

La explicación científica teórica como posibilidad es uno de los progresos más significativos de la Filosofía de la Ciencia¹ del siglo XX, es una demanda a la ciencia no solo expresar “el qué” y elaborar un modelo instrumental, sino también indagar “el por qué”, y proponer un sistema de conocimiento que bordee la certeza. No obstante, señala Salmon, no se está diciendo que se podrá tener una explicación científica de todo, y que se podrá enfrentar y resolver cualquier problema, pero tampoco ello quiere decir que la ciencia sea solo un instrumento de medición y control² (Salmon W., 1999).

En los marcos de la Filosofía de la Ciencia, sin embargo, la mayoría de los autores, siguiendo a Carnap consideran que la explicación científica que le es propia a las ciencias empíricas, no refiere a asuntos existenciales, dado que tal explicación carece de importancia ontológica (Carnap, R., 1950), lo cual, obviamente, extiende un manto de ambigüedad respecto a la connotación de la explicación científica y, también, sobre la realidad existencial de la oveja Dolly, un engendro de la Ciencia, pero ya estos son temas que desbordan los objetivos del presente artículo.

Lo que ahora se quiere precisar, es el hecho que a la altura de 1960 la Filosofía de la Ciencia había concedido licencia a la ciencia para conocer y explicar la realidad objetiva, obvio, la ciencia desde mucho antes se había tomado tal licencia sin que al parecer le importara mucho las consideraciones positivista y neopositivistas. En base al empirismo lógico se consideran ciencias empíricas aquellas que siguen su metodología: o sea, en el presente, todas las denominadas ciencias naturales, la física, la química, la biología, etc. La pregunta que ya finalmente nos pone en tema sería: ¿Es la economía una ciencia empírica? Tal pregunta también se puede formular de la siguiente manera: ¿A la ciencia económica le es propio el *phenomenalistic approach*, o asume el realismo científico y la explicación científica como su entorno y objetivos?

La respuesta a tal pregunta es el eje de todo lo que se expone, pero por ahora, y rindiendo tributo a Héctor Castaño³, me viene a la mente una observación que me lanzó al rostro, sin conmiseración alguna, en un pasillo de la Facultad de Economía de

¹ Fórum académico para el debate de las investigaciones y asuntos referidos a la naturaleza general de la práctica científica y la capacidad cognoscitiva de la ciencia. “Philosophy of Science Journal”, revista oficial de “Philosophy of Science Association”, publica cinco números al año.

² Para estudios epistemológicos rigurosos de este asunto alertamos que existen autores que tratan como uno solo positivismo lógico y empirismo lógico, y la categoría que utilizan es empirismo lógico. En general tales autores consideran que el positivismo/empirismo lógico hizo crisis en los 70s bajo las críticas de Quine y otros autores.

³ Profesor de Pensamiento Económico de La Universidad de La Habana, que falleciera muy joven, y cuya ausencia todos los días sentimos.

Lázaro Peña Castellanos

la Universidad de La Habana: “economics”, es un tipo de “ciencia” que se nombra diferente a la de la realidad objetiva, que se supone indaga y le da sentido, “economy”.

2. La crítica y la autocrítica implícita del pensamiento neoclásico

El Varian, un excelente texto de nivel intermedio para el estudio de la microeconomía inicia: “Para explicar la conducta de seres humanos se necesita un modelo de análisis. En economía se usa casi siempre un modelo basado en optimización y equilibrio” (Varian H., 1999). Es precisamente por este tema transversal a toda la teoría neoclásica por donde inicia la crítica actual a dicha teoría.

2.1 La crítica a la veracidad de los preceptos neoclásicos.

Los modelos de optimización (sea en un instante t_0 o en una senda temporal), como explicación de la conducta de los seres humanos son una generalidad metodológica de la teoría neoclásica, cuyos sustratos, históricos, socioeconómicos y psicológicos han resultado, sin embargo, muy difíciles de encontrar. En otras palabras, no existe evidencia factual histórica ni de ninguna ciencia empírica, que sostenga que la conducta de los colectivos humanos se rija por criterios de optimización (Frydman, R., and Michael D. Goldberg, 2013).

Lo anterior no es necesariamente un valladar, bajo los preceptos del “*phenomenalistic approach*”, los defensores de los modelos de equilibrio óptimo, en cualquiera de sus versiones, pueden presentarlos simplemente como modelos instrumentales, esto es modelos buenos para la medición, control y predicción, aunque carentes de pretensiones de explicar la realidad. Pero éste, tampoco, ha sido el caso, los modelos de optimización no han logrado ni medir, ni pronosticar adecuadamente, la realidad socioeconómica, de hecho la invalidez empírica, como se verá más adelante, es uno de los problemas principales de la modelación neoclásica.

La invalidez empírica, sin embargo, no ha sido un criterio suficiente para el rechazo; la autoestima que burbujea en torno a un sistema de equilibrio óptimo obvio que embelesa, tanto teórica como ideológicamente. En efecto, a pesar de sus inmensos fallos, los modelos de optimización, paradójicamente, han sido siempre la base para la elaboración de las políticas económicas en casi todo el mundo. Por ejemplo, la versión última y más sofisticada de un modelo de optimización, el denominado Dynamic Stochastic General Equilibrium (DSGE), altamente criticado por su ineffectividad e incongruencias empíricas (McCombie, J.S.L. and M. Pike, 2012), fundamenta las políticas económicas de los gobiernos de la mayoría de los países industrializados que se inscriben en la Organización para la Cooperación Económica y el Desarrollo, OECD, y de muchos países de América Latina y Asia.

De todas maneras, los fallos reiterados de los modelos neoclásicos atrajeron la crítica, y la constatación de la veracidad de sus preceptos se convirtió en una tarea casi obligada, y es esto, precisamente, el origen de un debate que he denominado la crítica

Lázaro Peña Castellanos

y la autocrítica implícita del pensamiento neoclásico. Veamos primero algunos criterios críticos que circundan el “*phenomenalistic approach*”, para luego avanzar a la crítica de la veracidad de los preceptos neoclásicos.

El sistema metodológico de los estudios neoclásicos, en general, “economics”, tiene tres características básicas: a) Apriorismo axiomático, o sea un sistema de referencia axiomático centrado en modelos de equilibrio óptimo, b) una construcción del cuerpo teórico deductiva, lo que significa que la “elaboración” del conocimiento se logra en lo fundamental, aplicando un sistema lógico a un conjunto de axiomas que se asumen verdaderos a priori, c) y un criterio de verificación “objetivista”, esto es, confiere estatus de veracidad a la teoría acorde a su consistencia lógica con el sistema axiomático de referencia (Gerrard, 2002). En palabras de Hausman, “la justificación de una teoría económica deriva de sus fundamentos axiomáticos, no de su comprobación empírica” (Hausman, J. A. 1978).

En un trabajo muy citado de Katarina Juselius, “On the role of theore and evidence in macroeconomic”, con relación a la metodología subyacente de los modelos macroeconómicos se señala: “Comienzan con una formulación matemática de un modelo teórico, y expanden el modelo adicionando componentes estocásticos. El objetivo es estimar los parámetros de un modelo económico estilizado, mientras se ignoran las condiciones bajo las cuales se generaron los datos (...). Esta metodología está fuertemente influenciada por el legado de la preeminencia de la teoría, la cual supone que el mecanismo económico básico puede ser pre-especificado, que se conocen cuales variables son exógenas, como se ajusta el sistema hacia el estado de equilibrio de largo plazo, “steady state”, como las intervenciones afectan al sistema, etc. (...)” (Juselius, K., 2010).

Parecería que el “*phenomenalistic approach*” es la metodología intrínseca de la teoría neoclásica, lo cual explica, al decir de Spanos, el poco éxito que ha tenido “economics” en establecerse como una ciencia empírica (Spanos. A., 2009). Pero el asunto no termina ahí, la pregunta que ahora inaugura lo que se ha dado en llamar “El Gran Debate” conduce la crítica y la autocrítica neoclásica por otros derroteros: ¿son válidos los preceptos originales neoclásicos?, o sea, ¿es válido el cuerpo axiomático inicial neoclásico?

En el Gran Debate participan economistas de muy alto prestigio como es el caso de Paul Krugman, laureado con el Premio Nobel, Steeve Moore, Robert Murphy, Marc Faber, Nick Rowe, Scott Fullwiler, pero el rol inquisidor se lo ha ganado Steve Keen, con su trabajo “Desenmascarando la teoría de la empresa, una cronología” (Keen, Steve and Russell Standish, 2010), y con su libro “Debunking Economics” (Keen, S. 2011).

Steve Keen en sus trabajos pone a relieve las fallas lógicas del modelo Marshalliano, y del modelo de competencia de Cournot-Nash, en tal sentido, los desmentidos de la teoría neoclásica de la empresa son muchos: la imposibilidad lógica, que la curva de

Lázaro Peña Castellanos

demanda de mercado de las empresas tenga pendiente negativa, que la maximización de ganancias ocurra al igualar el costo marginal al ingreso marginal, que la racionalidad del tomador de precios pase por alto el número de empresas de la industria, que se constate una agregación de las curvas individuales de demanda, que los criterios de maximización de la utilidad del consumidor y de la ganancia empresarial sean válidos, que la competencia empresarial conduzca a un equilibrio de Cournot-Nash de largo plazo, etc. Como se trata de problemas esenciales del cuerpo teórico originario neoclásico, y que se extienden a la denominada organización industrial, Keen acuñó una frase que al parecer cada vez gana más adeptos al interior de la escuela neoclásica, al menos a juzgar por la carencia de réplicas: “la microeconomía neoclásica carece de buenas bases microeconómicas” (Keen, Steve and Russell Standish, 2010).

Tales son los fallos lógicos de la microeconomía neoclásica, que algunos economistas clásicos han llegado a afirmar que las leyes de las matemáticas no aplican a la economía (Keen, Steve and Russell Standish, 2010), lo cual, de alcanzar el consenso, haría inconsistente a todo el cuerpo teórico neoclásico, dado que precisamente ha sido la aplicación de la lógica matemática la fundamentación de los modelos de equilibrio óptimo. Se trata, entonces, de una muy profunda autocrítica implícita de los neoclásicos.

En su trabajo Keen construye su crítica a los neoclásicos utilizando el propio instrumental neoclásico, muestra la inconsistencia del cuerpo axiomático inicial neoclásico y reelabora las ecuaciones y los axiomas neoclásicos, pero el resultado es contraproducente no solo a los supuestos de competencia perfecta en condiciones de atomización empresarial, sino a la existencia de un equilibrio óptimo, y a la validez de la aplicación de técnicas de maximización. Las conclusiones de Keen son extremas: “La teoría neoclásica de competencia es un obstáculo al entendimiento de los mercados reales y la competencia real, y debería ser abandonada”. (Keen, Steve and Russell Standish, 2010).

Abordar pormenorizadamente cada una de las críticas de Keen al pensamiento neoclásico, para aceptar o disentir, no es el objetivo del presente trabajo, lo que se quiere es presentar la connotación del debate, y dejar claro lo que significa, metodológicamente, la utilización de sus preceptos, dado que no se trata tan solo, acorde a Keen, de las irrealidades de los supuestos neoclásicos, sino que también se trata de las fallas lógicas de su basamento teórico axiomático.

Del trabajo de Keen solo queremos agregar una breve referencia a lo que él denominó “la realidad empírica de la competencia” (Keen, Steve and Russell Standish, 2010).

2.2 La pretensión de construir una Ciencia Económica Empírica.

Las evidencias empíricas proyectan que para el caso de la economía norteamericana entre el 89% y el 95% de la producción se genera bajo condiciones de costos

Lázaro Peña Castellanos

marginales decrecientes o constantes y economías de escala crecientes, lo que significa que no hay nivel maximizado de ganancias para la empresa individual. El supuesto clave del modelo neoclásico -que hay un nivel de ventas maximizado de ganancias- por lo tanto, no se cumple en el mundo real (Keen, Steve and Russell Standish, 2010).

Los estudios prueban que cerca del 85% de todos los bienes y servicios del sector de negocios no agrícolas de E.U.A. es vendido a “clientes regulares” con quienes los vendedores tienen una relación contractual y que cerca del 70% de las ventas son negocios a negocios más que de negocios a consumidores. Y continúa Keen, “las empresas típicamente reportan costos fijos que son muy altos relativos a los costos variables, y raramente reportan las curvas de costos marginales con pendientes positivas que son omnipresentes en la teoría económica. De hecho, las curvas de costos marginales con pendiente negativa son lo común” (Keen, Steve and Russell Standish, 2010). Esto significa entonces que una parte importante de la microeconomía no tiene sustrato real, y que sus propuestas de modelación son lógicamente inviables, por ejemplo, el precio no puede aproximarse al costo marginal en un mercado competitivo, y los criterios de optimización no son válidos.

Es un hecho que las empresas que clasifican como pequeñas y medianas empresas son la inmensa mayoría de la población empresarial, pero Keen advierte, que en el caso de la economía norteamericana en el 2002, apenas el 0.3% del total de las empresas clasificaban como empresas grandes, pero éstas, sin embargo, eran responsables de más del 60% de las ventas (Keen, Steve and Russell Standish, 2010).

Lo anterior no significa que las empresas pequeñas y medianas tengan un rol menor, dos problemas a aprehender por una ciencia económica empírica serían, precisamente, las relaciones y funciones de las diversas empresas en el proceso de producción y circulación territorial-global, (incluida la connotación tecnológica laboral que ello tiene), y los vínculos inter empresariales que subyacen como aspectos esenciales, de la caracterización y las transformaciones históricas de esa peculiar forma de socialización que se denomina “mercado”.

La necesidad de abandonar criterios meramente instrumentales de modelación y procurar modelos y teorías que reflejen las problemáticas reales económicas, son el eje central de una relativamente nueva escuela macroeconómica que se ha auto denominado “Imperfect Knowledge Economics”, IKE. Dos de sus más importantes

Lázaro Peña Castellanos

autores, Roman Frydman and Michael D. Goldberg, regresan a la semilla y redescubren a su modo lo que evidentemente se había olvidado: la economía es una ciencia social, y solo es la práctica social la que puede otorgar veracidad a sus modelos y teorías; no la coherencia con una formulación axiomática apriorística, o lo que los autores denominan, “the pre-eminence of theory” (Frydman, R., and Michael D. Goldberg, 2012).

El término IKE, en general, a lo que alude es a la incapacidad de los modelos neoclásicos para poder captar la complejidad de los comportamientos sociales, a los fallos empíricos de los modelos que requieren de supuestos apriorísticos sobre el comportamiento del individuo que se extrapolan al comportamiento de los colectivos humanos, y a la necesidad de tener en cuenta los hallazgos del resto de las ciencias sociales, en el estudio del comportamiento económico de la sociedad. (Frydman, R., and Michael D. Goldberg, 2012).

Roman Frydman and Michael D. Goldberg en un trabajo conjunto que titularon, “Beyond Mechanical Markets”, cuyos aportes también se recogen en una compilación sumamente interesante, “Rethinking Expectations: The Way Forward for Macroeconomics”(Frydman, R., and Edmund S. Phelps, 2013), a la cual en breve nos referiremos, se preguntan: ¿Cómo puede el análisis económico rechazar las representaciones mecánicas de los problemas económicos, estar abierto a los cambios no rutinarios, y aceptar la imperfección del conocimiento, mientras continúa captando agregados individuales bajo términos matemáticos?, y ¿cómo IKE podría proveer a los economistas de un cuerpo teórico donde el rol autónomo competitivo de los agentes económicos esté presente sin que necesariamente ello implique un criterio sistémico de maximización de ganancia? (Frydman, R., and Michael D. Goldberg, 2013)

Las preguntas no son festinadas porque expresan, a su manera, las dos vertientes enfrentadas de un muy antiguo debate epistemológico, teoría versus praxis. IKE, en tal sentido asume una posición intermedia: rechaza cualquier teoría que no tenga comprobación empírica, pero a la vez reconoce que la modelación empírica del comportamiento económico no puede reducirse a un manejo artificioso de datos, sino que debe proyectar alguna regularidad que pudiera ser formalizada teóricamente (Frydman, R., and Michael D. Goldberg, 2013).

El tema del manejo artificioso de datos de los problemas económicos, a lo que alude es a la denominada “minería de datos”, la cual tiene su ámbito de existencia, sobre todo, en la modelación econométrica. La minería de datos, en realidad, es rechazada por casi todas las escuelas de pensamiento y de modelación económica, pero, aún así, ha sido un argumento de riposta utilizado por muchos neoclásicos frente a las críticas que sus modelos han recibido por invalidez empírica, sobre esto se regresará más adelante, ahora se quisiera hacer algunos breves comentarios respecto al libro

Lázaro Peña Castellanos

“Rethinking Expectations: The Way Forward for Macroeconomics” (Frydman, R., and Edmund S. Phelps, 2013) y a la trayectoria de sus compiladores.

El libro recoge trabajos de autores de renombre, tales como: Philippe Aghion, Sheila Dow, George W. Evans, Roger E. A. Farmer, Roman Frydman, Michael D. Goldberg, Roger Guesnerie, Seppo Honkapohja, Katarina Juselius, Enisse Kharroubi, Blake LeBaron, Edmund S. Phelps, John B. Taylor, Michael Woodford, y Gylfi Zoega, que desde los preceptos de IKE, abordan temas que van desde la propuestas de alternativas a las “expectativas racionales”, la incorporación de factores sociales a los modelos financieros, los límites del conocimiento económico, los problemas de la estabilidad de los modelos económicos en el largo plazo, los asuntos de la inflación y el desempleo, hasta las fricciones de los ciclos de negocios.

Los compiladores del libro mencionado son Roman Frydman and Edmund S. Phelps, el primero como ya vimos, es uno de los pilares de IKE, el segundo es un economista sumamente reconocido, sobre todo a partir de su trabajo “The New Microeconomics in Inflation and Employment Theory,” (Phelps, E., 1969), que presentara en 1969 en un fórum del gremio, “Eighty-first Annual Meeting of the American Economic Association”, y que se reconoce como el trabajo pionero del denominado “New approach to macroeconomic analysis based on explicit microfoundations”, o más brevemente y en honor a su progenitor “The Phelps microfoundations”. El profesor Phelps, fue galardonado con el Premio Nobel en Economía en el año 2006.

Como es sabido “The Phelps microfoundations” presupone la existencia de un mecanismo competitivo de participación de los agentes en el mercado “market participants’ expectations”, y que a comienzos de los setenta fue identificado por casi todos los economistas, sin distinción de escuelas, con “las expectativas racionales”, y que desde entonces pulula en prácticamente todos los modelos y explicaciones neoclásicas, el ejemplo más connotado el DSGE.

En el otoño del 2010, en conmemoración del cuarenta aniversario de la Conferencia de Filadelfia, se organizó por el Centro sobre Capitalismo y Sociedad de la Universidad de Columbia, otra Conferencia del gremio, pero esta vez el panorama y los objetivos a debatir eran muy diferentes. Se convocaba a los economistas a proponer alternativas al mecanismo fallido de las expectativas racionales. La crisis iniciada en el 2008, era, sin dudas, la pandemia expandida, que todos se esforzaban por contener y explicar, pero frente a la cual la teoría económica se mostraba insulsa e inocua.

La experiencia del “Phelps microfoundations” luego de más de cuatro décadas de su aplicación, era constatable, más allá de que el comportamiento de la economía no fuera achacable del todo al “new approach”. Frente a la evidencia no es de extrañar los nuevos cánones valorativos de Phelps: “solo los modelos que generan acertadas predicciones deben ser considerados teoría económica relevante, tal como Roman Frydman y Michael Goldberg arguyen”, (Frydman, R., and Edmund S. Phelps, 2013)

Lázaro Peña Castellanos

adhiriéndose de esta forma, a los preceptos de IKE. Parecería, entonces, que al menos en el caso de Phelps, la autocrítica de los neoclásicos no es implícita, sino que es, atronadoramente explícita.

2.3 La modelación econométrica: la econometría empírica.

Como se ha visto, un tema álgido del debate académico, lo constituye la participación de los agentes económicos y su accionar coherente, o incoherente, con las regularidades del sistema, el mecanismo de las expectativas racionales explica que los agentes racionales reaccionan, de manera inmediata o en tendencia, acorde a los preceptos del equilibrio óptimo que describe la teoría neoclásica. Tal expectativa racional, según sus críticos, de hecho impregna un dudable objetivismo a las acciones subjetivas de los agentes económicos, trastocado dichas acciones en variables endógenas predeterminadas del sistema.

Los autores que se adhieren a los preceptos de IKE, en cambio, consideran, en general, el denominado “market participants’ expectations” como un conjunto de variables exógenas, culpables de trayectorias históricas y futuras impredecibles que le son propias a la realidad económica.

Las discusiones metodológicas, incluido el tema de la “exogeneidad”, han tenido una forma muy peculiar de manifestarse en la arena de la econometría. En efecto, bajo los criterios distintos que fundamentan asumir las relaciones entre variables económicas como distribuciones conjuntas o como distribuciones condicionadas, los paradigmas epistemológicos pugnan fuertemente uno con otro.

Esfuerzo y talento costó a la econometría saldar su deuda con uno de sus grandes maestros, Haavelmo, quien había dejado como legado la formalización de la distribución conjunta de probabilidades de variables estocásticas (Haavelmo, T., 1944). Una vez cumplida la tarea, las relaciones de las variables económicas pueden ser econométricamente tratadas como relaciones entre variables endógenas y los asuntos referidos a la “exogeneidad” adquieren, entonces, perspectivas y enfoques diferentes que refieren, no a las relaciones entre variables, sino a las relaciones de las variables con los parámetros de interés en modelos econométricos específicos (Hendry, D., 1995).

Entonces, si el sistema económico puede ser aprehendido como el conjunto de relaciones entre variables estocásticas, todas endógenas, una teoría económica que sea relativamente veraz en el marco de sus restricciones debe ser coherente al comportamiento de una distribución conjunta de variables estocásticas seleccionadas, (modelo), donde la marginalización del resto de las variables se justifique econométricamente. Pero esto es, precisamente, lo contrario de lo que ha sido el paradigma metodológico de la tradición econométrica, que construye relaciones

Lázaro Peña Castellanos

condicionadas entre variables económicas, presuponiendo las cualidades de la “exogeneidad” y “endogeneidad”, asiéndose a una teoría económica apriorística, “economics”, la misma que luego se utiliza como criterio de validación del modelo econométrico propuesto.

La crítica más fundamentada a la econometría tradicional y la propuesta alternativa de econometría empírica más relevante lo es, sin dudas, la Metodología Econométrica del London School of Economics, LSE, conocida también como Metodología Econométrica de David Hendry en honor a su creador más importante.

La paradoja, entonces, golpea los ojos, sabido es que el LSE es un pilar de la tradición neoclásica, por lo que cada crítica que de sus predios emana remueve, profundamente, los arraigos de los defensores de este cuerpo teórico. Y por si fuera poco, las críticas de Hendry al cuerpo teórico neoclásico y a la metodología de la econometría tradicional que le es afín, son, sin dudas, devastadoras.

En un interesante trabajo de David Hendry y Grayham Mizon, otro importante autor de la Metodología LSE, cuyo título es, “¿Qué necesita ser repensado en macroeconomía?”, los autores sostienen que los modelos económicos predominantes son inadecuados y que el método que subyace, mayoritariamente el análisis económico, es errado, que los estudios económicos hacen numerosos supuestos irrealistas, que los modelos de comprobación siguen una falsa metodología de confirmación, que se utiliza una econometría inadecuada que no presta suficiente atención a la evidencia empírica y que son necesarios cambios fundamentales en el análisis económico y en la modelación. (Hendry, David and Grayham Mizon, 2011).

Hendry es particularmente crítico de los modelos DSGE y de sus recomendaciones de política económica; según explica, las modernas economías son sistemas muy complicados con muchos factores interrelacionados que no son captados por los modelos DSGE, por lo cual su recetario es inocuo o contraproducente, por ejemplo, es poco probable que la reducción de los seguros al desempleo reduzca el desempleo en cualquier estado de la economía, igualmente pretender controlar la tasa agregada de inflación manipulando la tasa de interés es poco probable que funcione excepto en estados particulares de la economía.

Hendry considera que los modelos de maximización inter-temporal no tienen asideros empíricos, y que la supuesta racionalidad de las expectativas racionales, es evidentemente irracional. Y ante la comparsa que marcha al precipicio, Hendry

Lázaro Peña Castellanos

explícitamente se lamenta de que los modelos DSGE sean los cánones de las políticas económicas de múltiples gobiernos y que el objetivo inflación sea el objetivo básico de la mayoría de los bancos centrales de los países industrializados y de otros que les siguen la rima (Hendry, David and Grayham Mizon, 2011).

Las críticas de Hendry vienen todas acompañadas de alternativas de modelación. La denominada Metodología Econométrica del LSE, es un riguroso sistema econométrico, coherente con una perspectiva epistemológica que se apega a la realidad como fuente y comprobación del conocimiento; lo cual es una ruptura profunda con las bases de la tradición econométrica y con una gran parte del cuerpo conceptual econométrico, pero no con su instrumental técnico, al que le da un uso diferente.

Sin pretender una explicación ni rigurosa ni cabal de la Metodología Econométrica de Hendry se quisiera señalar tres cuestiones que se consideran básicas. En primer lugar la exigencia de la Metodología LSE de asumir la conformación de modelos como una parcialización de la realidad, (o del proceso de generación de datos, DGP, en el que ésta se evidencia desde la perspectiva econométrica), para el estudio de cuestiones que sean de interés del investigador y no como engendros contruidos a partir de supuestos teóricos de escasos o inexistentes asideros empíricos.

En tal sentido los criterios de la Metodología LSE respecto a la “no-estacionariedad” como la forma más común de existencia de las datos que expresan el comportamiento de los fenómenos económicos a estudiar, refutan la estilización de los datos y las técnicas de “estacionarización” a que inicialmente obliga la econometría tradicional. Además para Hendry las rupturas y desvíos de los datos proveen de información sumamente valiosa para el estudio de los fenómenos económicos a investigar, por lo que prescindir de ellos, tal como propone la econometría tradicional, limita grandemente la validez empírica de la modelación.

El segundo aspecto es la exigencia de la Metodología de Hendry de justificar econométricamente la parcialización de la realidad, (lo que es en sí mismo el proceso de construcción de un modelo), de manera tal de asegurar que el modelo construido nunca sea incongruente a la realidad empírica del que surge. Este segundo aspecto, la denominada Teoría de la Reducción, es para muchos el aspecto fundamental de la Metodología Econométrica del LSE (Hendry, D., 1995). La teoría de la reducción genera un arduo trabajo de mediciones y pruebas, imposible de realizar si no es echando mano a un sistema automático computacional. Tal sistema existe y está

Lázaro Peña Castellanos

integrado al OxMetrics, que es el sistema computacional de modelación empírica construido a partir de la Metodología Econométrica del LSE.

El tercer aspecto que pensamos relevante son los criterios de validación del modelo que propone la Metodología LSE, y aquí se consideran tres asuntos: a) la existencia de una batería de test de validación econométrica y de un proceso de simulación empírica que crean un marco de seguridad a la veracidad del modelo (Castle, J.L. et., al., 2013), b) las exigencias respecto a la comprobación empírica de los resultados que genera el modelo, en base al criterio epistemológico de que ningún modelo que carezca de comprobación empírica es aceptable, aún si tal modelo fuera validado por los test de comprobación de veracidad y c) las consideraciones de validación de los modelos econométricos desde un cuerpo teórico económico.

Este último aspecto merece un breve comentario, es poco sostenible que a la Metodología LSE se le pueda tildar de ser una técnica para la minería de datos. Es cierto que Hendry en diversos trabajos refuta la elaboración de modelos desde una teoría apriorística que no ha mostrado su evidencia empírica, de ahí su crítica al cuerpo teórico neoclásico, “economics”, ya señalada; pero de ello no se puede concluir una postura anti teórica del autor.

La econometría no es capaz, ni la tradicional ni la empírica, de brindar criterios suficientes respecto a la causalidad de los fenómenos (Hendry, D., 1995), la validación de un modelo econométrico no es fundamento de una relación causal entre variables, de hecho estos son asuntos a dilucidar por la constatación de una propuesta teórica, y, sobre todo, por la práctica. Ahora bien, un modelo construido a partir de criterios teóricos, que no tenga comprobación empírica la econometría empírica LSE, lo rechaza; no así, necesariamente, la econometría tradicional, lo cual obedece, como ya se señaló, a las diferencias epistemológicas y metodológicas de una y otra.

El modelo empírico aprehende parcialmente la realidad, y estos son asuntos que el pensamiento teórico no debería pasar por alto, en tal sentido, Hendry entiende que la modelación empírica puede y debe contribuir a la elaboración de un pensamiento teórico generalizador. Las propuestas de Hendry son muy precisas al respecto: avanzar en la construcción de modelos congruentes a la realidad y permitir que la evidencia empírica transforme los criterios teóricos, lo cual, en su opinión, son las vías que nos llevará a descubrir las regularidades de los procesos, o en sus propias palabras: “it will let us build what is really crucial – a progressive research strategy that

Lázaro Peña Castellanos

is looking for regularities that turn out to persist for long periods” (Hsiang-Ke Chao, 2002).

La aspiración de Hendry de construir una nueva teoría económica, apegada a la realidad económica, no puede ser más claramente expresada, sería tal teoría la que estaría en la capacidad de contribuir, junto con los test econométricos y la comprobación empírica, a la validación de los modelos econométricos empíricos. Abogar por tal teoría, no solo desinfla cualquier epíteto de manejo artificioso de datos (minería de datos), que a la metodología econométrica del LSE se le quiera atribuir, sino más que eso, desborda, propiamente, la observación y el empirismo como validación del conocimiento.

3. Epílogo

Parecería entonces que son muchas las razones que pugnan, por lo menos, por una ciencia económica empírica, lo cual implicaría un salto relevante del conocimiento económico y una solidificación de las bases sobre las cuales sustentar las políticas económicas, y esto sin trascender los estrechos marcos de la Filosofía de la Ciencia, o en palabras de Hsiang-Ke Chao referidas a Hendry, “his acceptance of the existence of the unknown DGP should not be regarded as an ontological realism (...)” (Hsiang-Ke Chao, 2002). Porque desbordar tales marcos es una osadía para la cual, al parecer, no existe todavía ni consenso ni disposición en ninguna de las escuelas de pensamiento económico, sin excluir la actual escuela marxista.

Quizás lo más destacado del presente debate metodológico en la econometría no sea la revelación del vínculo práctica-teoría, sino la constatación de la necesidad que le impone a la econometría su propia praxis de dotarse de una sustentación epistemológica congruente, para poder lidiar con los retos de la realidad económica-social. En efecto, desde la lógica- metodológica se define:

Conocimiento: Consiste en el conjunto de “creencias justificadas” sobre la naturaleza del mundo.

Metodología: Estudio de los métodos por medio de los cuales el conocimiento es logrado, acorde a dos perspectivas: una descriptiva de los métodos de investigación

Lázaro Peña Castellanos

utilizados y otra “prescriptiva”, cuyo término en este contexto significa que debe determinar y discriminar los métodos cuya aplicación son aceptables para que una teoría se justifique como conocimiento (Bill Gerrard , 2002) .

Entonces la aceptación o no de la teoría que se esgrima, y de la veracidad que se le confiera al pronóstico elaborado, va a depender mucho de los métodos por los cuales se obtuvieron tales “creencias justificadas”, y en este asunto la lógica formal, aún en su variante más sofisticada de lógica matemática, o semántica-simbólica, aunque útil y necesaria, ha probado ser insuficiente en todas las ciencias, incluidas las ciencias sociales y económicas.

Tampoco el empirismo lógico pareciera que pueda orientar adecuadamente la faena (Quine, W.V.O. ,1996); por ejemplo, en el campo de las ciencias sociales y económicas, en un contexto de escenarios económicos sociales cambiantes, el empirismo lógico bien sea en su variante de sociología empírica descriptiva o en la más sofisticada de paradigmas comunicacionales multiculturales, no logra abarcar toda la realidad de la evidencia, que incluye, también, regularidades objetivas no siempre observables.

El asunto obliga a que la dilucidación lógica-ontología no pueda ser más pasada por alto, como lo pretendió el ya agotado positivismo lógico, o como lo escamoteo el subjetivismo-pragmático.

En este trascendental problema referido al agotamiento de la teoría neoclásica y de sus fundamentos metodológicos, poco de novedoso se encuentra desde una perspectiva marxista o desde una lógica dialéctica; más bien se halla mucho de contraproducente.

El marxismo analítico, por ejemplo, que es una de las escuelas más controvertidas del denominado marxismo crítico, comparte con aquel, la crítica de la dialéctica como método, o como algunos lo presentan, la crítica de la interpretación de la dialéctica como método (Roemer, J., 1989). Al marxismo analítico lo distingue la negación de que exista una metodología específica marxista, dialéctica u otra; y su lógica metodológica propone entonces las siguientes pautas:

Ajustarse a normas convencionales científicas para la elaboración de teorías y la conducción de la investigación; procurar una especificación relativamente perfecta en

Lázaro Peña Castellanos

los conceptos que se vinculan en la argumentación teórica; enfatizar en la conceptualización sistémica, entendida por tal, definiciones y conceptos y coherencia lógica en la interconexión de los conceptos; conceder importancia a la acción intencionada de los individuos. El marxismo analítico en general se declara seguidor de la denominada filosofía del lenguaje o lógica del lenguaje o lógica simbólica e investiga, a mi entender, trasnochadamente, temas tales como: el marxismo de la elección racional “Rational Choice Marxism” (Roemer, J., 1989).

No deja de resultar curioso que mientras la econometría obligada por su praxis, se acerca a la lógica dialéctica, abandonando el neopositivismo lógico; el marxismo crítico abandona la lógica dialéctica y se obnubila con la lógica neopositivista:

“Yo puedo pensar que el símbolo es un disfraz una máscara que oculta la cosa en sí. En este caso la interpretación consistirá en retirar el velo para develar el objeto, la Verdad se impondrá y nada podrá cuestionarla. A este estilo se le denomina hermenéutica bíblica o interpretación pasiva ya que ella conduce no a la producción de un nuevo conocimiento sino a la restauración de una realidad que en verdad siempre estuvo allí sólo que deformada por la máscara simbólica. O yo puedo pensar como lo hacen Marx, Freud o Nietzsche que no hay tal verdad eterna y originaria sino que lo que aparece como un objeto natural es el producto de un proceso de producción de una construcción simbólica e histórico concreta. Detrás del símbolo por lo tanto no encontraré el objeto puro sino otro símbolo y otro, y así indefinidamente (...). A esto llamaremos interpretación activa ya que en ella no se trata de restaurar un objeto que preexistía a la interpretación, sino de producirlo como objeto de la praxis del conocimiento/transformación (...) el marxismo produce el objeto, modo de producción capitalista mediante el mismo movimiento que pugna por transfórmalo (...)” (Amadeo, J., 2006).

Por eso quizás, algunos pensaban que la crítica activa y masiva de la especulación financiera que como construcción simbólica y temporal, suponían sustentaba la acumulación de última data del sistema capitalista, en la presente crisis “produciría” una nueva construcción simbólica más racional, altruista, sustentable y humana. Pero nada, no se atisba la esperanzadora transformación sino, más bien, otra vuelta a la tuerca de la frustración y, por supuesto, mucho agobio, porque pareciera que la Materia no es solo símbolo categorial, sino ante todo es, realidad objetiva.

Creo, entonces, que en los recintos de la Academia Cubana es necesario hablar de la crítica actual a la teoría neoclásica, al menos, porque existe una profunda autocrítica implícita de los propios neoclásicos. Pero más que eso, creo en esos libres recintos ya es tiempo de volver a hablar, desde la lógica dialéctica, de lo mucho que en teoría económica todavía falta por construir.

Referencias

1. Amadeo, J. (2006), "Mapeando el Marxismo" en Atilio A. Boron et., al, *La teoría Marxista Hoy: Problemas y Perspectivas*. Publicado por Consejo Económico Latinoamericana (CLACSO), Buenos Aires., pp. 53-:101.
2. Carnap, R. (1950), *Logical Foundations of Probability*, Published by University of Chicago Press, Chicago.
3. Castle, J.L., Jurgen A. Doornik and David F. Hendry. (2013). "Evaluating Automatic Model Selection". <http://www.nuffield.ox.ac.uk/users/hendry/Papers/EvaluatingAutomaticModelSelectionJan2013.pdf>. (10/08/2015).
4. Frydman, R., and E. S. Phelps (2013), *Which Way Forward for Macroeconomics and Policy Analysis?* Published by Princeton University Press. New Jersey.
5. Frydman, R., and M. D. Goldberg (2011), "Beyond Mechanical Markets". http://www.econ.nyu.edu/user/frydmanr/BeyondMechanicalMarkets_HuffingtonPost%2025_2011.pdf. (10/08/2015).
6. Gerrard, B. (2002) "The role of econometrics in a radical methodology", en Sheila Dow and John Hillard, *Post Keynesian Econometrics, Microeconomics and the Theory of the Firm Beyond Keynes*, Published by Edward Elgar Publishing Limited Glensanda House Montpellier Parade, Cheltenham, UK., pp. 110-132
7. Haavelmo, T. (1944) "The Probability Approach in Econometrics", *Econometrica*, 12, Supplement, pp. 1-118.
8. Hausman, J. A. (1978) "Specification Tests in Econometrics", *Econometrica*, 46, 6, pp. 1251-1271
9. Hendry, D. (1995), *Dynamic Econometrics*. Published by Oxford University Press, Oxford.
10. Hendry, D. and G. Mizon (2011). *What Needs Rethinking in Macroeconomics?* Published by London School of Economics and Political Science and John Wiley & Sons Ltd., London
11. Hsiang-Ke Chao, (2002), "Professor Hendry's Econometric Methodology Reconsidered: Congruence and Structural Empiricism". http://www.lse.ac.uk/CPNSS/pdf/DP_withCover_Measurement/Meas-DP%2020%2002.pdf. (10/08/2015).
12. Juselius, K. (2010) "On the Role of Theory and Evidence in Macroeconomics". <http://www.econ.ku.dk/okoki/papers/INET.pdf>. (10/08/2015)
13. Keen, S. (2011) *Debunking Economics: The Naked Emperor Dethroned?*. Published by Zed Books Ltd. London.

Lázaro Peña Castellanos

14. Keen, S. and R. Standish (2010) "Debunking the theory of the firm chronology", *Real World Economics Review*, issue no. 53, 26 June, pp. 56-94
15. Konstantinov et., al. (1975), *Fundamentos de Filosofía Marxista Leninista*. Publicado por Editorial Progreso, Moscú
16. North, D. (1990) "La Nueva Economía Institucional" http://www.eseade.edu.ar/files/Libertas/33_5_North.pdf. (10/08/2015)
17. McCombie, J.S.L. and M. Pike (2012) "The end of the consensus in macroeconomic Theory? A methodological inquiry". http://www.landecon.cam.ac.uk/research/real-estate-and-urban-analysis/centres/ccepp/copy_of_ccepp-publications/wp02-12.pdf. (10/08/2015)
18. Pearson, K. (1911). *The Grammar of Science*. Published by A and C. Black, London
19. Quine, W.V.O. (1996). *On What There Is. From A Logical Point of View*. Published by Harvard University Press, Cambridge, Massachusetts.
20. Salmon W. (1999), "The Spirit of Logical Empiricism: Carl G. Hempel's Role in Twentieth Century", *Philosophy of Science* Vol. 66 No.3 (Sept), pp. 330-350
21. Spanos. A., (2009), "Philosophy of Econometrics". <http://citeseerx.ist.psu.edu/viewdoc/download?doi=10.1.1.126.8707&rep=rep1&type=pdf>. (10/08/2015)
22. Stern, D., (2006), "Wittgenstein versus Carnap on physicalism: a reassessment". http://philsci-archive.pitt.edu/2860/1/Stern_on_Wittgenstein_versus_Carnap.pdf. (10/08/2015)
23. Varian H. (1999), *Microeconomía Intermedia*. Publicado por Antony Boch, Barcelona.