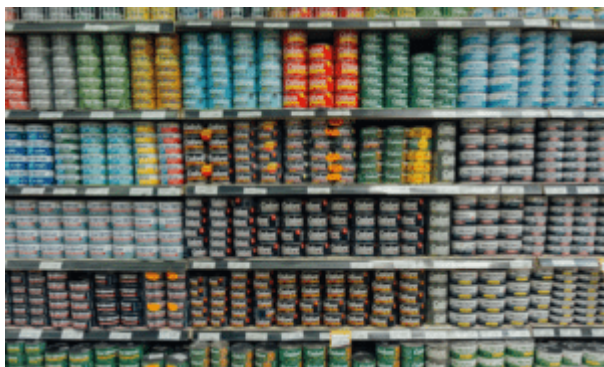


Evolução ou terapia de choque?



Por **MANFRED BACK***

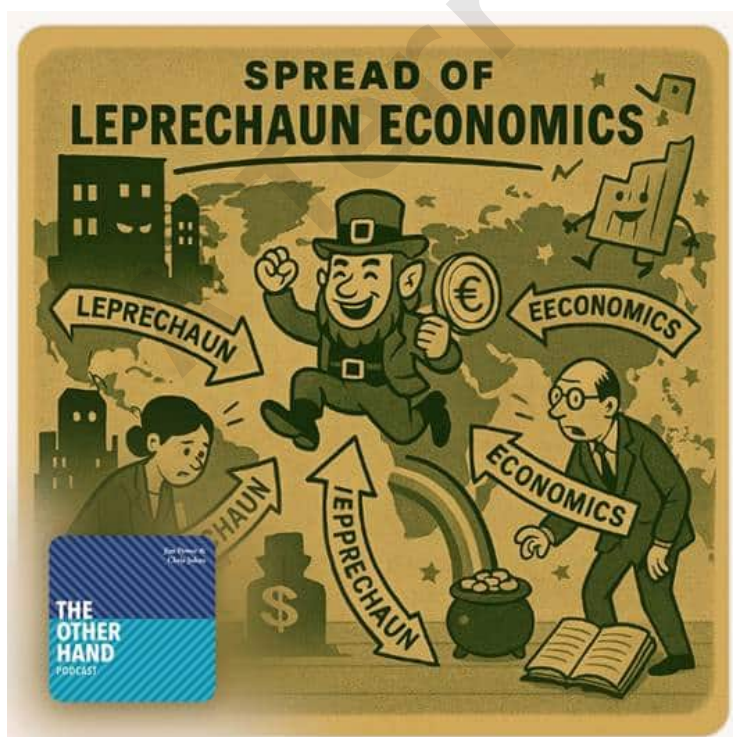
Formar economistas não pode ser produzir salsichas ideológicas; é ensinar a pensar, a questionar e, acima de tudo, a tolerar a incerteza que habita o coração de qualquer ciência que se preze

“É arrogância pensar que entendemos como a economia funciona, quando não entendemos”
(Mervyn King, ex-governador do Banco de Inglaterra).

“O que eu consigo definir é porque eu conheço” (Maria Pereda).

“Limitamo-nos a perguntar se há limites, e em caso afirmativo, quais são eles, para a arbitrariedade do economista teórico na seleção dos axiomas sobre os quais construir seus modelos interpretativos da realidade”
(Heinz D.Kurz e Neri Salvadori).

1.



Leprechaum é um duende do folclore irlandês. É um sapateiro que guarda um pote de ouro no final do arco-íris. Se você consegue capturá-lo, nosso duende concede três desejos em troca da liberdade. Efeito-substituição, desejo por liberdade. Nossos duendes da escola das expectativas racionais, adoram causa-efeito, no pote dos modelos estocásticos de equilíbrio geral, os desejos são reais, não imaginários: Taxa natural de desemprego, taxa neutra de juros e PIB (Produto Interno Bruto) potencial.

“Um fator-chave na organização da economia é o conjunto de crenças que cada pessoa tem sobre os outros. As pessoas mudam suas crenças por meio de pesquisas, cálculos e análises, e quando se analisa a questão adequadamente, isso dá origem a anomalias consideráveis em comparação com as teorias padrão que eu e muitos outros desenvolvemos. Portanto, em certo sentido, me sinto perdido em relação ao que fiz no passado”. (Kenneth Arrow)

Aqui cabe um comentário do craque Tostão, tricampeão mundial de 1970, gente que jogou dentro de campo: aí, os sábios explicam tudo, com várias teorias. Isso me faz lembrar da medicina. Muitos estudantes, perto da formatura, não têm dúvidas de nada e acham que sabem tudo. Após vários anos de trabalho e de estudo, percebem que a medicina é complexa e que há muitas incertezas. No esplendor técnico da carreira, descobrem, principalmente, os mais bem preparados, que sabem muito pouco.

“Resultados matemáticos sólidos devem, portanto, ser encarados pelo praticante com sentimentos um tanto contraditórios. Na melhor das hipóteses, representam uma revelação relevante sobre o seu problema; na pior, podem lançar dúvidas sobre a adequação de suas suposições”. (William Baumol)

Nossos Leprechaum econométricos transformam lendas em realidade. Usando convenções e conceitos como verdades, travestidas pelo véu da econometria. Nesse mundo do folclore científico, matemática virou estatística e vice-versa. Os números, os dados e os conceitos servem não a economia e a sociedade, mas como muleta de apoio para se justificarem a si mesmos. O importante não é entender as relações, mas sim, estar certo! Os modelos existem para si mesmos! E para os duendes economistas!

“Modelos macroeconômicos padrão postulam agentes maximizadores intertemporais e desenvolvem equações dinâmicas que vinculam variáveis econômicas como consumo, renda, investimento, taxas de juros e emprego. Em seguida, analisam propriedades dessas equações, como cointegração, causalidade de Granger e restrições de parâmetros. A suposição de agentes idênticos ou homogêneos leva os teóricos macroeconômicos a analisarem essas propriedades diretamente em dados agregados. Mas isso representa um enorme problema, como fica claro quando a suposição de homogeneidade é analisada em dados desagregados. O abandono da suposição de homogeneidade mostra que, exceto em casos aleatórios, a causalidade granular unidirecional da cointegração e as restrições de parâmetros entram em colapso”. (Heinz D.Kurz e Neri Salvadori)

2.

Modelos são importantes na tentativa de através de testes de hipóteses de explicar a realidade. Não negamos sua importância, muito menos dos dados e da matemática, desde que produzam algo de útil para a sociedade, e não apenas para satisfazer o ego do economista leprechaum! O poder de transformação depende do foco e a distração é a maneira de impedir esse poder. A informação que parece lógica demais é uma fuga para assumir suas responsabilidades. Entender as relações econômicas! E não apenas relações de causa-efeito!

Diria o grande Freud: e, finalmente, os grupos nunca ansiaram pela verdade, exigem ilusões e não podem passar sem elas.

Os economistas *mainstream*, vivem de ilusões que parecem verdades. Os grupos se defendem, onde a discussão permeia a casa decimal. Exemplo, não se discute o regime de meta de inflação e a regra de Taylor, mas a meta. Como acentua o pai

a terra é redonda

da psicanálise, as ilusões algébricas, distraem o foco, e parecem verdades. Incontestáveis! Contra números não há argumentos!

“As estatísticas são importantes, mas os números não podem ser tão prepotentes quantos os humanos”. (Tostão)

Nos modelos não são humanos, muito menos gente comum, somos agentes econômicos racionais. Alguém pode me dizer o que seria isso?

“A verdade é que os modelos econômicos são um pouco como crianças: em certo ponto, eles assumem uma personalidade própria, em muitos aspectos independente das aspirações de seus pais”. (Emiliano Brancaccio)

Permitam me aqui citar uma frase do grande técnico português de futebol José Mourinho, muito provavelmente, será desqualificado, por viver no mundo real e de não ter frequentado a academia, menos ainda, a de economia. Talvez por isso seu senso de observação não esteja preso a crenças, a números a conceitos.

Disse ele: “uma coisa é o conhecimento que está ao alcance de todos e outra coisa é a capacidade de produzires o próprio conhecimento”. O fato de o conhecimento estar ao alcance de todos é uma enorme contribuição para a preguiça mental. Nas nossas academias brasileiras de economia, qual conhecimento está ao alcance de todos? A linha dos leprechaum e seu pote de ouro de convenções? O dogma do equilíbrio? A ditadura da econometria? Visão única ou preguiça mental?

“Uma Universidade é um lugar em que o conhecimento é ensinado acima de todas as diferenças religiosas e nacionais, onde a investigação é realizada a fim de mostrar aos homens até que ponto compreendem o mundo ao seu redor e até que ponto podem controlá-lo”. (Freud)

Pelo menos deveria ser, não?

3.

“Se os agentes têm incentivos e preferências diferentes, e especialmente se enfrentam restrições diferentes nos diversos mercados em que operam, eles tipicamente se comportam de maneira diferente dependendo, entre outras coisas, da distribuição de renda e riqueza. Tudo isso é excluído na maioria dos modelos dominantes da macroeconomia moderna. Portanto, o agente em questão é erroneamente chamado de “representativo”: ele não representa uma variedade de agentes diferentes, mas um único”. (Heinz D.Kurz e Neri Salvadori)

“Mas o desenvolvimento dinâmico, em contraste com a fotografia instantânea, ficava incompleto e extremamente confuso”. (John Maynard Keynes, Prefácio da *Teoria Geral*)

“Em economia, são desenvolvidos modelos matemáticos que descrevem o sistema como se fosse linear, e o rigor matemático baseado em axiomas e linearidade é preferível à validade empírica. O individualismo metodológico e a hipótese da linearidade são considerados válidos. No entanto, um modelo matemático linear é uma função polinomial, cujos coeficientes são independentes uns dos outros ou tão fracamente dependentes que as interações podem ser negligenciadas”. (M. Gallegati)

O truque é como realçamos anteriormente nesse texto, é desviar o foco da discussão. Os economistas *mainstream* leprechaum, mudam o pote de ouro. Discutir conceitos e convenções como certezas algébricas, passa a percepção de ser científico, exato, como a química e a física. A retórica de usar a matemática, como um sonho de exatidão e uso de conexões de funções lineares, esconde a realidade dinâmica das relações econômicas para uma certeza aparente. Quem não conhece matemática, estatística e econometria, está fora do debate econômico, pois não tem conhecimento científico para debater com os *experts*. Assim, o mundo universal econômico dos modelos de equilíbrio geral reduz a vida econômica e um possível saber em: quanto acha que deve ser a taxa natural de desemprego, taxa neutra de juros, PIB Potencial? Uns acham 2%,

outros 2,2% e, assim vai. Ex ante siga a receita da bula e de índices, que assim, consertamos essa tal realidade, o equilíbrio. E ex post? Se a previsão errar, sempre tem uma explicação algébrica e gráficos!

“Suponha que alguém se sentasse ao meu lado e anunciasse que era Napoleão Bonaparte. A última coisa que quero é entrar em uma discussão técnica sobre táticas de cavalaria na Batalha de Austerlitz. Se eu fizer isso, tacitamente me deixarei levar para o jogo em que ele é Napoleão. Ora, Bob Lucas e Tom Sargent adoram discussões técnicas, porque aí você aceita tacitamente suas premissas básicas; sua atenção é desviada da fraqueza fundamental da história geral. Como acho a abordagem geral ridícula, respondo tratando-a como ridícula, rindo dela — para não cair na armadilha de tratá-la com seriedade e passar para questões técnicas”. (Bob Solow, em Klammer, 1984, p. 146).

“Nenhum cientista é mais fervoroso do que os economistas em apregoar seu rigor como um sinal de superioridade sobre outras ciências sociais, provavelmente equiparando o rigor à construção de um modelo matemático ou estatístico. Você nunca ouviu um físico ou matemático se gabar de ser “rigoroso”. E o que mais um cientista pode ser?” (Annalisa Rosselli)

4.

A discussão técnica é uma espécie de abracadabra para o economista encobrir o pote de ouro e os três desejos da discussão e debate. Tem que ter qualificação técnica para isso. Matemática, estatística, econometria e gráficos deveriam ser ferramentas, não muletas para satisfazer o ego de ter razão dos economistas. Arrogância e certeza têm grande correlação, quase perfeita.

“De fato, a macroeconomia nekeynesiana se assemelha à homeopatia: imperfeições e atritos mínimos são adicionados ao modelo padrão para mitigar seus resultados mais absurdos e alcançar algo que faça sentido econômico. Mas a homeopatia não derrotou a infecção que se transformou em sepse com a Nova Síntese Neoclássica baseada em modelos de Equilíbrio Geral Estocástico Dinâmico (EDGE)...”. (Giovanni Dosi e Andrea Roventini).

“Alguém voaria em um avião projetado por um economista de Chicago?” (Giovanni Dosi e Andrea Roventini). Você voaria? Num avião construído a base de taxas naturais e neutras? Será que se levantaria do chão? Nos modelos sim, na realidade só “Deus” sabe, se é que ele existe! Mas as pessoas acreditam em tantas coisas que os economistas criam!

“O escopo de investigação da economia e sua metodologia foram significativamente reduzidos. Investigações qualitativas foram substituídas (“Onde está o modelo?”, frequentemente se perguntam autores que estudam um fenômeno econômico complexo demais para ser formalizado), enquanto invasões em outras disciplinas das ciências sociais foram feitas, exceto para exportar seus próprios axiomas de escolha racional ou métodos de análise quantitativa (ouvir o próprio trabalho ser descrito como “sociológico” soa como uma condenação irremediável para um economista)”.

Segundo a economista Annalisa Rosselli: nos últimos vinte anos, disciplinas inteiras foram progressivamente marginalizadas. A história do pensamento econômico, na qual a Itália se destacou, quase abandonou o campo para encontrar refúgio nas humanidades. A história econômica sobrevive ao custo de se disfarçar como uma economia que utiliza dados “antigos”.

Os grandes pensadores econômicos tinham uma característica em comum, a autocrítica, o inconformismo, e a procura do conhecimento. Economistas como Keynes e Schumpeter, em suas grandes obras, a todo momento se questionavam, não tinham certezas, só incertezas. Mudaram de ideia! Lembrando que ambos eram exímios matemáticos e estatísticos, inclusive Schumpeter um dos pais da econometria!

“Humilde é uma pessoa grande que trata todas as outras como se fossem maiores”. (Isaías)

De vez o PIB Potencial deveríamos medir o ego potencial dos economistas mainstream, principalmente os leprechaun brasileiros, oráculos, deuses da certeza e do destino.

“Desde então, a física mecânica do século XVII tem governado a economia. Entre os possíveis caminhos alternativos tomados por todas as outras disciplinas, da biologia à sociologia e à física, a economia optou por adotar apenas a ferramenta matemática, desacompanhada de hipóteses verificáveis, o que deu origem à deriva axiomática e à infalsificabilidade dessas hipóteses. Assim, se no capítulo final de sua Teoria Geral, Keynes pôde argumentar que os políticos são escravos de teorias econômicas ultrapassadas, podemos dizer que, por sua vez, os economistas ainda são escravos da física newtoniana”. (M. Gallegati)

5.

Em 2017 na cidade de Milão foi realizado um simpósio entre Olivier Blanchard e Emiliano Brancaccio, que havia escrito o livro *O anti-Blanchard*. O simpósio destacava o potencial de uma comunicação renovada entre paradigmas concorrentes e de uma crítica construtiva da abordagem atualmente dominante com o propósito de um progresso renovado do conhecimento na área econômica.

Um simpósio inspirado em um diálogo entre Olivier Blanchard e Emiliano Brancaccio sobre crises e possíveis futuras “revoluções” na teoria e política econômica. Os debates entre eles e as observações dos economistas italianos convidados foram publicados na revista italiana *Moneta e Credito*. Esta edição especial da *Moneta e Credito* reúne os anais de um simpósio inspirado em um diálogo entre Olivier Blanchard e Emiliano Brancaccio, dedicado às crises e possíveis “revoluções” futuras da teoria e da política econômica. O simpósio destaca os benefícios da comunicação renovada entre paradigmas concorrentes e da crítica construtiva ao *mainstream* atual, com o objetivo de um progresso renovado do conhecimento econômico.

Esse texto se propõe a uma reflexão, sem querer respostas prontas e soberba, sobre qual o tipo de formação as escolas de economia brasileiras estão dando e ensinando aos alunos e futuros economistas. A imagem que me vem à mente é a do filme *The Wall*, um monte de estudantes com seus uniformes escolares entrando numa máquina de moer carne, e todos saindo rigorosamente iguais na forma de salsichas. O que teremos? Salsichas graduadas como agentes representativos racionais? Todos iguais, discutindo casa decimais? Mesmos conceitos e convenções?

Precisamos de simpósios como o de Milão. Precisamos de discussão e debate. Precisamos de economistas para debater. Temos?

Taxa é qualquer valor percentual em relação a dois números. Natural é o ar, a água, e a certeza que ao nascer, vamos morrer. Neutra é água não industrial ou gasosa, o que chamamos de PH igual a 7,00 ou a Suíça na segunda guerra que não foi para lado nenhum. Potencial refere-se a uma capacidade ou possibilidade de realizar, na física, temos a energia potencial. Atrás do pote de ouro do equilíbrio de variáveis no arco-íris, os economistas leprechaum criam seus três desejos ao duende, que gostariam que existissem, além dos modelos, a taxa natural de desemprego, que equilibra o mercado de trabalho sem inflação, a taxa neutra de juros que mantém constante os preços e a roda da economia, e o PIB potencial que diz o que a economia poderia produzir mas não produziu.

Essas variáveis universais poderiam ser a chave do comunismo, porque – segundo elas – todos somos iguais, empresas e famílias, e do mesmo tamanho e riqueza, otimizadores e alocadores eficientes de recursos. Somos todos racionais, somos *homo economicus*.

“O estilo que chamo de “matemática” permite que a política acadêmica se disfarce de ciência. Assim como a teoria matemática, a “matemática” utiliza uma mistura de palavras e símbolos, mas, em vez de estabelecer vínculos estreitos, deixa amplo espaço para deslizamentos entre afirmações em linguagem natural e formal, e entre afirmações com conteúdo teórico e não empírico”. (Paul Romer)

“Não há vestígios de debates e abordagens diferentes. Isso parece confirmar a máxima de Maffeo Pantaleoni de que existem apenas duas escolas de pensamento em economia: a dos que a conhecem e a dos outros”. (M. Gallegati)

***Manfred Back** é graduado em economia pela PUC-SP e mestre em administração pública pela FGV-SP.

a terra é redonda
existe graças aos nossos leitores e apoiadores
Ajude-nos a manter esta ideia.

CLIQUE AQUI  **CONTRIBUA**

A Terra é Redonda