

Kovács János Mátyás

Örökség–utánzás–felfedezés

Közgazdasági gondolkodás Magyarországon 1989 után

Töprengés leltár közben

„Mindent eláraszt a fősodor és éppen divatos mellékágai, jönnek haza az első nyugati »kandidátusok« és neofita göggel indítják új kurzusaikat a harmadrangú amerikai állami egyetemek színvonalán. Egyre inkább ők fölözik le a nemzetközi kutatási projektumokat, s miközben a világtudomány csúcsán érzik magukat, voltaképp bémunkát végeznek példaképeiknek, és plagizálják őket. Teszik ezt standard neoklasszikus, friedmanita vagy újinstitucionalista hitvallással, »mikróban« vagy »makróban« utazva – egyre megy: a lényeg a néhány változós steril matematikai modell. A módszer nagy *M*-mel. A leszerepelt politikai gazdaságtan helyett itt a *mainstream* közgazdaságtan. A megismerni vágyott valóság magára vethet, a tudományos képzelet mindössze a modell határáig szárnyal. Általánosítson, vonjon le normatív következtetést, aki mer. Parvenü elitizmus.”

„Még mindig az exreformerek uralják a közgazdasági kultúrát. Mint egykoron, természetesen szoros szimbiózisban a politikával: ott székelnek a különféle tanácsadó, szerkesztő, akadémiai, egyetemi bizottságokban, ahol állami pénzeket és hivatali címeket osztogatnak. Reformerekből transzformerekké nevezték ki magukat valamely szociál-liberális zászló (leginkább a »szociális piacgazdaság«) oltalmában, de új gondolatok már nem bántják őket. Továbbra is imádják a Nagy Programokat, az általános kijelentéseket, a nagy ívű kísérleteket (mások bőrére). Eszményképük, a verbális politökonómia örvén a hajdani polgazd spekulatív érvelésmódját tartják életben. Intézményi ötleteik pontatlannak és ellenőrizhetetlenek. Maszatolnak, már régóta nem művelik magukat. Pragmatizmusba oltott provincializmus.”

Íme a „nagy kesergők”. Szinte szóról szóra idéztem barátaimat, akikkel tavaly ősszel alkalmam nyílt hosszan társalogni a közgazdasági tudományok hazai állapotáról. Konferenciára készültünk,¹ úgy tűnt, szándékosan sarkítanak beszélgetőpartnereim, hogy segítsenek megvonni a típusalkotás határait. Első benyomásom az volt, hogy talán nem is olyan kellemetlen, ha manapság a honi közgazdászok többségének e két szélsőség között kell elhelyeznie magát. Mi több, ha korábbi választási lehetőségeinkre gondolunk, amikor kifakult tanszéki marxizmusok és kváziradikális piaci szocializmusok jelölték ki el-

¹ A konferencia egyszersmind a *Reformgondolkodás után, a liberalizmus előtt. A transzformáció közgazdaságtanáról* című, T 4908. számú OTKA-program zárómegbeszélése volt. 1995 november 28–29-én került rá sor az MTA Közgazdaságtudományi Intézetében.

A konferenciára a következő szerzők hozták el írásaikat: Bodó Péter, Csaba Iván, Csekő Imre, Csillag István, Csontos László, Greskovits Béla, Köbli József, Kőrösi Gábor, Laki Mihály, Lányi Kamilla, Lengyel György, Major Iván, Mihályi Péter, Pete Péter, Simonovits András, Szakadát László, Tardos Márton, Voszka Éva. Meghallgattuk még Halpern László és Oblath Gábor előadásait. A konferencia után a következő szerzők küldték el eddig dolgozataikat: Nagy András, Semjén András, Sik Endre, Vincze János.

A tanulmányok jó része, némi átdolgozás után, a *Közgazdasági Szemle*n kívül ez év áprilisától a 2000 és az *Esély* hasábjain jelenik meg. A konferenciára benyújtott írásokat (a hozzájuk készült kommentárokkal együtt) külön kötetben is kiadjuk.

méleti mozgásterünk végeit, még az sem lenne tragédia, ha ne adj' isten igazak lennének a fenti sirámok, és ez a bizonyos többség a szélső pontokon tömörülne.

Ha egyetlen mondatba kellene sűríteni, a beszélgetések során – ki némi félelemmel, ki alig titkolt büszkeséggel – voltaképp azt kérdeztük magunktól: „normális”-e már a magyar közgazdasági gondolat? Azt ugyanis nehéz lenne tagadni, hogy évtizedeken át abnormális volt, sokáig a szó „félkegyelmű” értelmében is, később inkább csak azért, mert finoman szólva, meglehetősen szabadon értelmezte a tudomány bevett nyugati mintáit. Elkanyarodott, tartós kitérőt tett, időnként visszasettenkedett a fősodor közelébe – vajon visszatér-e most oda, s ha igen, a folyó melyik szakaszát, esetleg oldalágát célozza meg? Közelít-e már a magyar átlagközgazdász elméleti nyelve, szakmai alakultsága amerikai vagy német (de legalább portugál vagy osztrák) kollégáiéhoz? Hát publikációs szokásai, társadalmi szerepei vajon emlékeztetnek-e az övéikre?

Miként lehet, lehet-e egyáltalán elkerülni, hogy a későn jövőnek mindkettőből a rossz jusson osztályrészül, s az abnormitás összes selejtje a normalitás „másodlagos frissességű” áruival keveredjék? A műveletlenség a félműveltséggel, az egyik fajta valóságidegenség a másikkal, a túlpolitizált nyelv a túltechnicizálttal, a verbális terror a matematikaival. Melyek azok a közgazdasági kultúrjavak az elmúlt évtizedekből – vannak-e egyáltalán ilyenek –, amelyek nyugodt szívvel megőrzendők, s nem csupán a budaörsi szoborpark elméleti tárlóinak mélyén?

A nyugatosodás vágya már a hatvanas évek eleje óta ott munkál a magyar elméleti közgazdászok szívében. A „miként nyugatosodjunk?” kérdésre – mint ismeretes – először Kornai János próbál komolyan felelni az *Anti-Equilibriumban*. Meglehetősen ambivalens módon, egyszerre ünnepeve és porba taszítva az akkori célállomást. A hetvenes és nyolcvanas évek reformközgazdászai nemigen távolodtak el Kornai eszményképétől, valamifajta általános (összehasonlító) közgazdasági rendszerelmélettől, amely az általános egyensúlyelmélet romjain épült volna fel a Kelet és a Nyugat tapasztalati és módszertani tégláiból. Először, még a konvergencia szellemében, úgy tűnt: a keleti építőkövek száma nem lesz lényegesen kisebb. A hetvenes évek neoliberális fordulata azonban világossá tette (a nyugati közgazdászok számára legalábbis), hogy a nagy találkozásra ezúttal nem az Elbánál fog sor kerülni.

Kelet-Európáról kiderült, hogy a legnagyobb jóindulattal sem (lehet) képes másra, mint egyfajta középfaú „határeset-gazdaságtan”² felvázolására, amely – ha a tervgazdaságok megértésében nem is akad versenytársa – a kapitalista vegyes gazdaságokban legfeljebb az atipikus (átmeneti, periférikus, nem aktuális) jelenségeket magyarázza, ezeket sem mindig tagoltan, a „fehér ember” nyelvén. A Nyugat ugyanis – számos reformközgazdász legnagyobb sajnálatára – nem lett állam- és beavatkozáspártibb, sőt. Ezért érthetően egyre lankadt a figyelme, amikor Keletről folyton csak hiányról, beruházási válság-ciklusokról, második gazdaságról, tervalkuról, hadigazdaságról, illetve ezek elméleteiről értesült. Közös közgazdaságtudomány? Ugyan kérem – hallottuk egyre többször oda-átról. Ha a nyugati ökonómus nem óhajt keletiesedni (s nem érdeklik már annyira mondjuk az optimális tervezési modellek), kelet-európai társának nemigen marad egyéb, mint az „okosan nyugatosodni” merész ideája. Méltósággal utánozni, bepótolni a lemaradást, közben nem válni gyökértelenné és túlbuzgóvá, bátran (kisebbségi érzések nélkül) és tehetséggel újítani a kölcsönvett kultúrában, miközben felzárkózunk és asszimilálódunk – „vitézek, mi lehet e széles föld felett, szebb dolog az végeknél?”

Nem hinném, hogy ahhoz, hogy nekiveselkedjünk a magyar közgazdasági gondolkodás 1996-os leltára elkészítésének, a népi-urbánus vita illetően lírai magasságaiba kellene

² Lásd Kovács János Mátyás: *Compassionate Doubts about Reform Economics* (Science, Ideology, Politics). Megjelent: J.M. Kovács–M. Tardos (szerk.): *Reform and Transformation. Eastern European Economics on the Threshold of Change*. Routledge, London, 1992.

emelkednünk. Bősséggel akadnak ennél prózaibb okaink is. 1989-ben történt egy s más a régiókban, s mindössze két dolog nem világos azóta sem a közgazdasági esztortörténet szempontjából: az, hogy milyen állapotban találta a politikai földcsuszamlás a magyar gazdasági tudományokat, és az, hogy milyen állapotba hozta őket. Más szóval, milyen hagyományokat konzervált, és milyen hatással volt magára a tudományos felzárkózásra, ezen belül is a mintakövetés és újítás arányára. Örökség–utánzás (import)–felfedezés: hármójuk nem csupán elméleti-módszertani, de tudományszociológiai összefüggései is tisztázásra várnak. A posztkommunista átmenet nyolcadik évében járunk...

Napi aranyigazságokkal persze könnyű szolgálni. Rendszerint *nincs*-cel kezdődnek, és néha, akkor is inkább ironikusan, szépítgetik a közelmúltat. Nincs már tudományos közélet, nincsenek heves elméleti viták, iránymutató könyvek, megbecsült mesterek. Erdős Péter, Hoch Róbert, Liska Tibor, Nagy Tamás elmentek, számos idősebb reformer elhallgatott. Dúl az interjúirodalom, a teoretikusok a napilapok vasárnapi mellékleteibe írnak, és tévévitákra járnak. Mármint ha nem bizonytalanodtak el szellemileg, és ha még nem szívta el őket a politika vagy az üzlet. (Az MTA Közgazdaságtudományi Intézetében például nem kellene túl nagy fantázia egy olyan értekezlet témájának kiagyaltásához, amelyen hivatalból több mint egy tucatnak kellene részt vennie az egykori és jelenlegi munkatársak közül pártügyvivőként, államtitkárként, magas rangú parlamenti és önkormányzati funkcionáriusként vagy vezető privatizációs, banki és kamarai tisztviselőként, illetve ezek tanácsadóiként. Bauer, Nyers, Soós, Tardos, soroljam tovább?) A kutatóintézetek, kezdve az ágazatiakkal, lassan kihalnak vagy átfazonírozzák magukat előrejelzőkké és tanácsadókká; az egyetemek szegények maradtak, amennyiben egy *business school* még egyetemnek lehet nevezni; a tehetséges fiatalok külföldre menekülnek. Az alapkutatások halódnak, az OTKA alaposan lefogyott, a kiadók, ha nem mellékel súlyos százezreket a könyvéhez, szóba sem állnak a szerzővel. A *Gazdaság* kimúlt, illetve tallózásba fogott, a *Közgazdasági Szemle* karcsúbb lett, külföldi cikkeket – fordítási pénz hiányában – alig közöl már. A tudósok a rejtély kulcsa helyett a pénzt keresik; nem tanulmányokat, hanem projektumokat írnak, s ha egyáltalán publikálnak, azt inkább külföldön teszik. Ámbátor, olvasni sem könnyű: a könyvtárak agonizálnak, nincs pénz a külföldi könyvekre, folyóiratokra. A statisztikai adatok, ha még léteznek, megfizethetetlenek.

E borúlátó portré szerint balga, aki azt hiszi, átmeneti a hallgatás, s a nagy csend pusztán a tisztító elméleti vihar előhírnöke. A meg nem írt könyvek benn ragadtak szerzőikben, a véreszettség óriási, a közgazdaságtudomány részben lefejeződött, részben felére apadt, bármely jellemzőjét vizsgáljuk is. Az új tudósnemzedékek szükségképp lassan érnek majd be, iskolákat, könyveket, mestereket ne nyolc, hanem inkább huszonnyolc év elteltével reméljük tőlük. Addig pedig – jobb híján – bízunk a már 1989 előtt is jócskán nyugatiasodott középgeneráció azon tagjaiban, akik kitartottak.

Tegyük fel egy pillanatra, hogy e pesszimista kép már-már realista. Félek kimondani, de panasza szerintem ez esetben sincs túl sok ok, hacsak nem a mindenséggel óhajtuk mérni magunkat, vagy a reformközgazdászok némely értelmiségi előjogát sírjuk vissza a múltból. Amennyiben nem Cambridge és Chicago a mérce, hanem Athén és Helsinki, de mondhatnék Limát és Kairót is, úgy érzem, bármint fáj is, közelgünk a normálishoz. Legalábbis, ami a szakma méreteit, intézményi szerkezetét és fizikai teljesítményét illeti. Relatív anyagi megbecsülését tekintve viszont sajnos nőhet a lemaradás. Ennek ellenére egyelőre alig tapasztalni az elméleti közgazdászok között nosztalgiát az óriásintézetek, a központilag támogatott folyóiratok és könyvek, a politikailag gerjesztett/felügyelt viták langyos világa iránt. Vissza a kritikai értelmiség csiklandós szerepeihez? Közepesen megfizetve, közepesen bíráltni? Egy kis profécia, egy kis öncenzúra, egy kis botrány?

Am oly nagy-e a csönd valóban? A temetői némaságot talán tényleg nem kívánná egyikünk sem, annál még az is vidítóbb volt, amikor az ember arról perelt, szabad-e a

téesz-melléküzemágakat szeretni vagy „reform reformját” mondani. Igaz, csökken a hivatásszerűen alapkutatók száma, de nem biztos, hogy ez az alapkutatót célzó projektmokra is áll. Új interdiszciplináris intézmények születnek (Budapesti Kollégium, CEU stb), korszerűsödnek a könyvtárak, megindult a posztgraduális oktatás a közgazdasági tudományokban is, sokszorosára bővült a magyar teoretikusok nemzetközi kapcsolathálója. Külföldi professzorok érkeznek (nemcsak konferenciákra, nemcsak tanácsadni, hanem tanítani is), diákok és ifjú magyar tudósok mennek. De már jövőgetnek is. Közben időnként találkoznak, alkotnak, esetleg közösen, esetleg még nem publikálták kutatási eredményeiket.

Talán fogyóban az intézetek elméleti produkciója, de számos új tankönyv készül. Meglehet, kevesebb az „írott malaszt”, de több az oktatott. Ritkább a mélyfúrás, de sűrűbb a konjunktúrakutatás. Ha nem fizet az OTKA, megszánhat a Soros, a TEMPUS vagy az ACE. A Közgazdasági és Jogi Könyvkiadó áttérhetett a Nobel-díjasok sorozatáról a menedzserképző brosúrák forgalmazására, de új kiadók (Osiris, Aula, T-Twins stb.) léptek a helyébe. Új folyóiratok (BUKSZ, Holmi, 2000 stb.) közölnek közgazdasági tanulmányokat és bírálatokat, de a *Sigma*, a *Külgazdaság*, a *Statisztikai Szemle* és az *Acta Oeconomica* is tartja még magát. Honosodnak vagy megújulnak olyan cikkműfajok, mint a szemletanulmány és az elemző kritika. Hogy kevés a hazai szerző? Lehet, hogy több a külföldi vagy ideiglenesen külföldön állomásozó-publikáló hazai. Egyetlen – lenini – mondatba sűrítve: talán minden kevesebb, de jobb, esetleg egyszerűen más. Talán a spontán szelekció nem volt mindig kontra-... Könnyen lehet, akik elhallgattak, most éppen erőt gyűjtenek, hogy ismét megszólaljanak, s már van olyan ifjú tehetség is, akinek korszakos ötlete ott lappang tegnap megkezdett doktori disszertációja első oldalán, akkor is, ha iskolateremtő művet valóban csak húsz év múlva ír majd belőle.

Nem is szólva arról, hogy az új tranzitológiai irodalom a közgazdaságtanban már pusztán mennyiségét tekintve is felér a korábbi reformológiaival. Kétségkívül befellegzett a régi vágású „kapitalizmus- és szocializmuskutatásnak”, de a posztkommunista átmenet logikája új, talán kevésbé esetleges és provinciális összehasonlításokat hív elő. Ma már valóban fontos lehet tudni Budapesten, hogy miként szabályozzák a társadalombiztosítást Belgiumban, vagy támogatják az ipart Tajvanon. Ám azt is, miben különbözik a cseh fiskális politika a lengyeltől. Európa a következő kihívás – előtanulmányok máris készülnek. Hasonlóképp, a transzformáció egyes feladatai új kutatási felségterületek (privatizálás, stabilizálás stb.) meghódítására ösztönöznek, mely hadjáratokban már nem véd a helyi tapasztalattal erősített tudományos intuíciónak a reformista páncélja. Lehet az új tranzitológiai műfajok és megközelítések burjánzását a reform-közgazdaságtan egyfajta átmentéseként kórosnak tekinteni, de a burjánzás ténye maga bajosan tagadható.

Szintúgy folyamatos a termelés annak a diszciplínának néhány ágában, amelyet még ma is jó néhányan a fura régi műszóval „matematikai közgazdaságtanként” tisztelnek, s amely már megenszületése pillanatában definíciószerűen nyugatosnak számított. Nincs év, hogy Kornai János ne rukkoljon ki új könyvvel vagy hosszabb tanulmánnyal (tanulmányokkal). A volt „második gazdasági”-munkagazdaságtani specialisták majd mindegyike, s számosan a régi vállalatkutató „esettanulmányosok” közül is rendületlenül publikálnak. (Az előzőek már a nyolcvanas években úttörő módon kísérleteztek mikroökonómiai modellekkel.) Beérett a pénzügykutatás, továbbra is szolid a külgazdasági szaktudás, a reform-közgazdaságtan egykori – ismét csak természetsszerűen nyugatos – büszkeségei ezek, de megállok itt, mielőtt kihagynék valakit a felsorolásból, mert nem skatulyázható be munkássága.

A végkövetkeztetés ezennel fordított. Lehet, hogy nem is csökken a tudományos kibocsátás, csak módosul a szerkezete? Nemegyszer maga az átmenet „piaca” dönt, mit is tart fontosnak. Jó példa erre a privatizáció, amely szempillantás alatt létrehozta saját

kutatási kínálatát. Most sem a minőségről beszélek, hanem arról, hogy kevés mértékadó/törekvő elméleti közgazdász tehetne, hogy ne nyilatkozzék meg a magántulajdonról, legalább ideiglenesen szüneteltetve más irányú tudományos elfoglaltságait. Amint bealkonyul a privatizációnak, feljő majd a *public policy* csillaga: a szociálpolitika például már javában teszi fel a közgazdasági kérdéseket. A kapitalizmust – úgy hírlík – nehéz lesz átvészelní a nyugati (esetleg távol-keleti, dél-amerikai) irodalom böngészése, értelmezése, alkalmasint megújítása nélkül.

A kérdés éppenséggel ez: naponta hány órát üzemel ma ez a böngészde; mit is keresünk benne; nem tévedünk-e el tekervényes folyosóin; jól választunk-e a keresgélés során; mi döntünk-e vagy ránk sózzák a portékát; vajon amit találunk, képesek vagyunk-e használni; össze tudjuk-e illeszteni meglévő ismereteinkkel; ha nem, melyiket vetjük el; s jutunk-e váratlan felfedezésekre eközben?

Minden eddigi következtetésem nem több – remélem, nem túl botor – hipotézisnél. Mindössze arra szolgálnak, hogy meggyőzzem az olvasót: az írás elején idézett kesergők, illetve a később felsorolt pesszimista aranyigazságok alapos ellenőrzésre szorulnak. Kevesen vették azonban eddig a fáradságot, hogy unalmas egyetemi tankönyveket hasonlítsanak össze, öntelt külföldi tanácsadókat faggassanak, vagy megnézzék, hova rajzanak ki a doktorandusok, és mit hoznak vissza a fejükben, miként soványodtak le a kutatóintézetek, milyen műveket dobnak piacra az új kiadók, és mi játszódik le a politikába katapultált elméleti közgazdászok gondolatvilágában. Sajnos jóval hagyományosabb eszmétörténeti vizsgálatok is váratnak magukra. Még mindig óriási lyukak tátonganak a magyar közgazdasági gondolkodás 1989 előtti történetének ábrázolásában, így nehéz a „kályhát” azonosítani, ahonnan elindulhatna az összehasonlító elemzés. A hajdani mesterek ritkán vallanak magukról. Az utóbbi évek terjedelmes párt- és kormányprogramjait is inkább napilapok szedik ízekre, mint tudós dolgozatok. A tudományos verseny valóban gyér: a majdani vitapartnerek még nem azzal foglalkoznak, hogy elhelyezzék egymást az elméleti térben. Nem kizárt, hogy a negyven éve folyamatosan építkező Kornai János életművének átfogó kritikai méltatása is előbb fog elkészülni a tengerentúl, mint itthon.

*

Konferencia után, kutatás közben vagyunk. A projektum nyílt, máris csatlakoztak hozzá néhányan. A cél a magyar közgazdasági gondolkodás aktuális leltárának felvázolása, legalább körvonalalaiban. S ha mód van rá, kelet-európai összehasonlításban is.

A konferencia előtt azt ajánlottam a résztvevőknek, hogy a „mi újság a közgazdaságtudományban ezen a tájon?” alapkérdésre első nekifutásra mindannyian az örökség–utánzás (import)–felfedezés hármasságában gondoljuk végig a választ saját kutatási területünkön, természetesen figyelemmel a kevert megoldásokra (például a továbbfejlesztésre) is. Magyarán, nézzük meg, hogy mondjuk a privatizáció kurrens hazai elméletéhez (elméletlétőredékeihez) mit adtak a hajdani reformközgazdászok, mi jött be Nyugatról (esetleg Keletről), és vajon születtek-e jelentős ötletek az elmúlt fél évtizedben Magyarországon. Mindeközben próbáljuk megállni, hogy a triász bármelyik elemét eleve szebbnek tartsuk a többinél. Ne szépítsük, a modell már-már közhelyes: amit nem tanultunk meg a mamától, azt vagy a szomszéd gyerektől lestük el, vagy magunk jöttünk rá, esetleg olyan dolgokra is, amit egyikőjük sem tudott.

Elfogadtuk, hogy a kényes kérdést, „mit is értsünk közgazdaságtudományon?”, eleinte nem bolygatjuk. Okulva közös tapasztalatainkból, a mércét önkritikusan nem helyeztük túl magasra, és nem zavart bennünket, ha egy elméleti ötlet egy pártprogramban, egy minisztériumi munkaanyagban vagy egy egyetemi jegyzetben rejtőzködött, nem pedig egy (egyébként nem létező) hatkötetes munkában a posztkommunista transzformáció el-

méletéről. Hasonlóképp, már az eredeti kérdéseket is szívesen lajstromba vettük, ha nem is követte őket hasonlóan eredeti kutatási program még. Nem azt firtattuk, hol késik a transzformáció Nagy Elmélete, hanem inkább azt, hogy a „kis elméletek” vajon megbízhatóak-e már. Töredékek-e vagy építőkockák? A sirámokat fájó szívvel félretelve, az elmúlt öt-tíz év magyar közgazdasági gondolkodásának feltérképezésébe vágtunk. Mégpedig a következő témák szerint:

- nyugati kínálat (elméleti menü, átmenet-analógiák, külföldi tanácsadók stb.);
- transzformációs elméletek (stabilizáció, privatizálás, külgazdasági nyitás, piacositás/dereguláció, iparpolitika/modernizáció, kormányzati reformok, informális gazdaság, szociális partnerek, szociálpolitika stb.);
- nagy átmenet-víziók (tudományos forgatókönyvek, párt- és kormányprogramok);
- az elméleti közgazdász „sorsa” (tudomány – politika – üzlet, egyetemi reform, közgazdasági tankönyvek/könyv- és folyóirat-kiadás stb.).

A fenti tárgykörök természetesen részben átfedik egymást. A kutatási program végső szerkezetét – rendszerint így van ez – jórészt maguk a résztvevők határozzák meg, s egyelőre néhány téma keresi szerzőjét. Ha sikerült megtalálniuk, frappáns-polémikus dolgozatokat csaltak ki belőlük, amint ezt az alábbi írások is tanúsítják. A tanulmányok viszonylag rövidek, ám igen sűrűek és forrásértékük is tetemes, mivel részletes irodalmi utalásaik jól rögzítik az egyes közgazdasági diszciplínák fejlődését/stagnálását az elmúlt évtized Magyarországon. Ha hiányzott is néhol a történelmi távlat, pótolta azt a „résztvevő megfigyelők” személyes hitele.

Még nincs kész a leltár...

Csontos László

Túl jön és rosszon: a racionális döntések elméletének recepciója Magyarországon*

Bevezetés

A racionális döntések elmélete kifejezés gyűjtőfogalom, amely egyfelől különféle szubsztantív és formális modelleket, másfelől pedig egy metodológiai paradigmát foglal magában.¹ Az említett szubsztantív és formális modellek közé az individuális döntések elméletének típusváltozatai, a játékelmélet, a közösségi döntések elmélete, továbbá általában a társadalomtudományok (politikatudomány, szociológia, pszichológia, jogtudomány, történettudomány stb.) ökonómiai ihletésű modelljei tartoznak. A racionális döntések elmélete néven számon tartott metodológiai paradigma viszont nem más, mint az a közös módszertani platform, amely az előbbi formális és szubsztantív modellek társadalomtudományi alkalmazásait egyéb társadalomtudományi kutatási programoktól és elméleti rendszerektől elválasztja és megkülönbözteti. Az alábbiakban elsősorban a racionális döntések elméletének nevezett módszertani paradigma hazai recepciójának problémájá-

* Köszönettel tartozom a konferencia résztvevőinek értékes megjegyzéseikért, valamint Szántó Zoltánnak és Takács Károlynak az anyaggyűjtés során nyújtott segítségükért.

¹ A racionális döntések elméletéről kiváló áttekintést nyújt Abell [1991], valamint Elster [1986].

val foglalkozom, és csupán érintőlegesen tárgyalom a döntéselmélet, a játékelmélet, a közösségi döntések elméletét vagy az ökonómiai ihletésű társadalomtudományi modellek magyarországi meghonosításával összefüggő kérdéseket.

Az örökség

A hetvenes évek vége táján alapvetően három irányzat nyomta rá bélyegét a hazai társadalomkutatásra. Először: változatlanul jelen volt, méghozzá domináns pozícióban volt jelen az egyszerre normatív társadalomfilozófiai elméletként, kutatási programként és módszertani ajánlások gyűjteményeként felfogott – kritikai és ortodox – marxizmus. Másodszor: a „normál” tudomány részévé és intézményesen is elfogadottá vált a kemény, matematikai-statisztikai vagy puha, kvalitatív módszerekkel (kérdőíves fölmérések az első esetben, esettanulmányok, mélyinterjúk a másodikban) operáló empirikus társadalomkutatás. Harmadszor: egyfajta módszertani és szervezeti autonómiára tett szert a gazdaság- és társadalompolitikai, valamint szociotechnikai ajánlások megfogalmazására törekvő, úgynevezett reformközgazdaságtan és reformszociológia.

A társadalomtudományi oktatás állapota az egyetemek falain belül – ha a tervgazdaság igényeit kiszolgálni hivatott szervezeti megoldásokat és a szakhivatalnoki apparátusokban felhalmozódott szolgálati tudás közvetítésére hivatott tantárgyakat figyelmen kívül hagyjuk – pontos tükörképe volt ennek a helyzetnek. Mindez persze azt jelentette, hogy a létező felsőoktatási intézményekben nem csupán a nemkívánatos politikai nézetek, értékelő vagy filozófiai álláspontok maradtak képviselő nélkül, hanem valójában nem jutott hely a tisztán szaktudományos képzés számára sem.

Az utóbbi állításmat a közgazdaságtanra vonatkozóan némileg pontosítanom kell. Noha visszatekintve úgy látom, hogy Magyarországon egészen a nyolcvanas évek közepéig (sőt talán tovább is) nem lehetett például szervezett formában, alapos és megbízható mikroökonómiai tréninget kapni – ugyanúgy, ahogyan az egyetemi tanrendekből száműzve voltak általában a neoklasszikus közgazdaságtan, a standard makroökonómia, a tiszta szociológiai elmélet vagy a makroszociológia alapelveit taglaló kurzusok –, és a kortárs társadalomtudományos elméletekről csupán elméletörténeti előadásokon, ám többnyire ott is csak meghatározott szűrőn át lehetett információhoz jutni, „tisztá” matematikának vagy „alkalmazott gazdaságmatematikának” álcázott tárgyak formájában mégiscsak egész jó MIT típusú közgazdaságtani műveltséget lehetett (volna) szerezni.

Néhány egyszerű példával szeretném érzékeltetni, mire gondolok. Optimumszámítás vagy lineáris programozás címszó alatt a Marx Károly Közgazdaságtudományi Egyetemen is meg lehetett (volna) tanulni a korlátok melletti optimalizálás elemi technikáit, mondjuk a Lagrange-módszert vagy a Kuhn–Tucker-feltételeket. A marxi újratermelési sémák örvén néhányan általános egyensúlyelméletről beszéltek, sőt számítástechnika előadásokon – ki tudja, miért éppen ott – bánatmátrixokról és egyéb döntéselméleti ínycségekről lehetett hallani. A játékelméletet – az egyetlen létező magyar nyelvű összefoglaló munka nyomán (*Szép–Forgó* [1972]) – abszolút formális elméletként, a modern matematika egyik érdekes, de átlagos közgazdászhallgatók számára felfoghatatlan kuriózumaként tartotta számon mindenki.

A baj csak az volt, hogy a szóban forgó tárgyak oktatói elfelejtették közölni – nem tudom persze, hogy ők maguk tisztában voltak-e vele –, hogy ezek a tárgyak mégiscsak valóságos emberekről és valóságos gazdaságokról szólnak, és olyan analitikus apparátust bocsátanak a rendelkezésünkre, amelyet erre, vagyis valóságos gazdasági problémák tisztázására, árnyaltabb leírására és jobb megértésére lehet fölhasználni. Megkockáztatom, hogy a konferencia hozzám hasonló korú résztvevőinek túlnyomó többsége ezt

akkoriban ugyanígy érezte. Ráadásul: noha ebben a torz formában képviselve volt ugyan az MIT típusú közgazdaságtan a hazai felsőoktatásban, habár senki sem tudta, hogy mi az efféle képzésnek az értelme, ám semmilyen formában nem létezett chicagói stílusú közgazdaságtani képzés. Egész közgazdászgenerációk nőttek fel anélkül, hogy valaki – az állítás minden következményével együtt – elmagyarázta volna nekik, hogy nincsenek ingyenebédék.

Ennek az áldatlan állapotnak a kialakulásához és fennmaradásához, úgy vélem, igen nagy mértékben hozzájárult az a körülmény, hogy az előbb említett társadalomtudományi irányzatok módszertani önértelmezése körül komoly bajok voltak. Az empirikus társadalomkutatás tekintélyes része az idő tájt megítélésem szerint boldog metodológiai öntudatlanságban leledzett. A marxista társadalomfilozófia és a reformtudományok között pedig – paradox módon – létezett egy meglehetősen szoros tudományelméleti kapcsolat: mindkét iskola képviselői úgy vélték, hogy diszciplínáik különleges ismeretelméleti és metodológiai státusra, a hagyományos szaktudományos elméletekétől eltérő érvényességi kritériumokra tarthatnak igényt. Ez az álláspont azt sugallta, hogy a standard ökonomiai elmélet nem csupán érdektelen, hanem szubsztantív értelemben tökéletesen irreleváns is a magyar gazdaság, a szocialista gazdasági rendszer vagy általában a gazdasági viselkedés adekvát leírása, magyarázata vagy megértése szempontjából.

Változás: külső és belső hatások

Az előbbieken vázolt helyzet a nyolcvanas évek közepére fokozatosan megváltozott. Azt hiszem, félrevezető és szimplifikáló lenne azonban ezt a változást a konferencia tematikája által sugallt módon csupán valamiféle külső hatásra vagy arra visszavezetni, hogy a kelet-európai tudósok szeretik majmolni a metodológiai egyedfejlődés magasabb fokán álló nyugati kollégáikat. Annál is inkább, mivel – talán a közgazdaságtan főáramlatát leszámítva, ahol a nagy tudományfilozófiai viták ekkorra már, úgy tűnik, nagyjából eldőlték – a gyakorló társadalomkutatók többsége más világtájakon is meglehetősen tanácstalannak mutatkozott, amikor a marxizmus vagy a reformtudományok tudományelméleti pretenziói kerültek szóba.

A szóban forgó pretenziók elutasításához Magyarországon, úgy gondolom, elsősorban a következő két fejlemény készítette elő a terepet. Léteztek egyfelől olyan szuverén szaktudományos teljesítmények – itt elsősorban a hiány közgazdaságtanának megteremtésére gondolok –, amelyek különösebb módszertani önreflexió nélkül ugyan, de nyilvánvaló módon a standard közgazdasági elemzés módszertani és tartalmi alapfőltevéseire építve mondtak valami fontosat és érvényeset a magyar gazdaságról. Másfelől pedig – kiváltképp a kritikai racionalizmus érvei hatására – egyre többen fogalmaztak meg egyre határozottabb kéteyleket a marxizmus (idesorolva most már a frankfurti iskola marxizmusát és az úgynevezett kritikai politikai gazdaságtant is) és a reformtudomány privilegizált ismeretelméleti státusával kapcsolatban. Az érdekesség kedvéért megemlítem, hogy 1977-ben Karl Popperről lehetett már eszmét cserélni legalább egy vezető reformközgazdással (hol máshol, mint a 2-es villamoson), és hamarosan előkerültek olyan – a reformalkuk sűrű erdejében bolyongó – ifjabb titánok, akik újabb keletű közgazdasági elméletek segítségével próbálták leírni és értelmezni saját helyzetüket és a reformtudomány pozícióit az éppen aktuális intézményi és politikai erőterben (Kovács [1984]).

A kritikai racionalizmus programjának az elméleti és empirikus szaktudományok emancipációjához való hozzájárulását nehéz lenne túlbecsülni, jöllehet a program maga mindössze néhány – végtelenül egyszerű – metodológiai alapelvre hívja föl a figyelmet. A kritikai racionalizmus szószólói lényegében azt hangsúlyozzák, hogy a tudományos el-

méletek nem csupán formális struktúrák, kutatói közösségek egyetértésén nyugvó konvenciók vagy használható előrejelzések megfogalmazására szolgáló instrumentumok, hanem olyan konstrukciók, amelyeknek igazságtartalma van. A szaktudományos elméletek – formális szerkezetüket tekintve – állításokból épülnek föl, amelyek igazságértékéről logikai vagy empirikus elemzés révén győződhetünk meg. Egyetlen állítás igazságértékét sem lehet azonban empirikusan felülvizsgálni, ha a benne szereplő fogalmak homályosak, pontatlanok vagy elnagyoltak. Éppen ezért a felülvizsgálhatóság érdekében a létező elméletek explikációjára vagy racionális rekonstrukciójára van szükség. A racionális rekonstrukció során meg kell próbálni különbséget tenni tényállítások és értékelő állítások között, mivel faktuális állításokból nem következtethetünk normatív összefüggésekre, és a normatív állítások logikai-módszertani státusa más, mint a tényállításoké. Azokat az elméleteket, amelyek nem állják ki az empirikus és logikai elemzés próbáját, el kell vetni.

Ebben a megváltozott módszertani közegben jelent meg a racionális döntések elmélete (RDE) mint módszertani paradigma a nyolcvanas évek végén Magyarországon. A paradigma kezdetben – Karl Popper néhány elszórt, a társadalomtudományok módszertani sajátosságaira vonatkozó megjegyzése nyomán – a szituációs logika megjelölést viselte, és tartalmi szempontból a döntés- és játékelmélet elemi modelljeinek társadalomtudományi alkalmazhatósága melletti érveket, módszertani szempontból viszont néhány explicit metodológiai alapelvet foglalt magában.

Az RDE-paradigma legfontosabb metodológiai nívója, úgy vélem, a módszertani individualizmus alapposztulátumainak következetes érvényesítése volt. A módszertani individualizmus képviselői az individuumot és az individuális cselekvést helyezik a társadalomtudományi elemzés centrumába, elutasítják a holizmus mindenféle változatát, és úgy vélik, hogy egy társadalomtudományi magyarázat csak akkor lehet módszertanilag kifogástalan, ha a vizsgált jelenséget sikerül visszavezetni egyéni szándékokra, vágyakra, célokra, motívumokra és preferenciákra.

Az RDE-paradigma egy másik összetevője az az elemi racionalitásposztulátum, amelynek értelmében a társadalomtudományok által vizsgált emberi cselekvések magyarázata során célszerű és termékeny azzal a segédhipotézissel élnünk, hogy a kérdéses cselekvések hiánytalanul beilleszthetők egy cél-tapasztalati szabály-eszköz sémába. Magyarán: tanácsos azt föltételeznünk, hogy az egyének cselekedeteik során meghatározott célok elérésére törekcszenek, és információik és tapasztalataik alapján döntenek el, hogy mely eszközök a legalkalmasabbak a szóban forgó célok elérésére. A racionalitásposztulátum mögött nyilvánvaló módon az a föltevés húzódik meg, hogy az egyének nem báruk módjára, mítikus társadalmi „erők” hatására, hanem saját szándékaikat követve, intencionálisan cselekszenek.

Az RDE-paradigma által ajánlott magyarázó séma logikai struktúrája lényegében meg egyezik a mikroökonómiai elmélet alapmodelljeinek szerkezetével. Mindkét esetben arról van szó, hogy föltételezzük: az egyének preferenciáik, információik, vágyaik és meggyőződéseik alapján, bizonyos korlátozó feltételek – ökonómiai, erkölcsi, pszichológiai, fizikai korlátok – figyelembevételével választanak az előttük nyitva álló alternatívák között. Mivel mindkét esetben föltesszük, hogy a korlátozó feltételek nem szűkítik le egyetlen elemre az egyén előtt nyitva álló alternatívák halmazát, mind az RDE-paradigma, mind a mikroökonómiai elmélet elutasítja a társadalmi és ökonómiai determinizmust hangsúlyozó strukturalizmust. Mivel mindkét álláspont hívei fölteszik, hogy a szocializációhoz hasonló mechanizmusok – az egyéni preferenciarendezések rögzítése révén – nem programozzák az egyéni döntéseket, mind az RDE-paradigma, mind a mikroökonómiai elmélet képviselői elvetik a szerepelmélet által sugallt pszichológiai vagy szociálpszichológiai determinizmust.

Az RDE módszertani paradigmájának térhódítása tehát a mikroökonómiai modellek jelentőségének újrafelfedezését jelentette, mind általában a társadalomtudományokban, mind pedig a szűken vett közgazdaságtanban. Azt hiszem, nem túlzás azt mondani, hogy a nyolcvanas-kilencvenes évek fordulóján sokan az RDE kerülő útján jutottak el vagy vissza a közgazdaságtanhoz, és értették meg, hogy az ökonómiai elmélet, vagyis a közgazdaságtan mint szaktudomány nem csak mint elemzési módszerek vagy absztrakt modellek gyűjteménye fontos, hanem egészében véve releváns lehet az emberi cselekvés és a valóságos világ megértése szempontjából. Elegendő itt a korrupció vagy a hálapénz közgazdaságtanával összefüggő munkákra utalni (*Galasi-Kertesi* [1987], [1988], [1991]). A közgazdaságtan és az RDE-paradigma közti szoros kapcsolatot ebben az időszakban az is mutatja, hogy egy 1991-ben készült bibliográfia, amely a magyar nyelven megjelent idevágó publikációkat sorolja föl, az első magyar mikroökonómia tankönyv, valamint Varian munkájának bizonyos fejezeit szintén az RDE körébe sorolja (*Helmich-Szántó-Tóth* [1991]).

Recepció

A kilencvenes évek közepére nyilvánvalóvá váltak az RDE-paradigma hazai recepcióját meghatározó törésvonalak. A közgazdaságtudomány meglehetősen nehézkes professzionalizálódásával párhuzamosan lassan, de biztosan zajlik a szubsztantív RDE-modellek – döntés- és játékelmélet, lényegesen nehezebben a közösségi döntések elméletének – beépülése a hazai társadalomtudományi gondolkodásba. Másfelől viszont posztmodern káosz uralkodik azokban a puhább társadalomtudományokban, amelyekben a nagy metodológiai viták hullámai mindmáig nem ültek el, jóllehet korábban ezek egy része is hajlandóságot mutatott az RDE-paradigma befogadására. A metodológiai szörnyszülötteket bemutató nemzetközi show minden szereplője jelen van a hazai tudományos színtéren. Ennek megfelelően – és erre vonatkozik előadásom címében a „túl jón és rosszon” – a magyar társadalomkutatók értesülhettek már az RDE-paradigma emocionalista és feminista kritikájáról, sőt – korábbi recepciós beidegződésekkel összhangban – az RDE-paradigma tudásszociológiai értékelésére is komoly kísérlet történt (*Hadas* [1993]).

Egy elméleti álláspont tudásszociológiai értékelése lényegében azt jelenti, hogy nem vizsgáljuk érdemben – vagy azért, mert érdektelennek tartjuk, vagy pedig azért, mert nem vagyunk abban a helyzetben, hogy szakmailag hitelt érdemlően megtehetnénk – az adott kutatási program tartalmi összetevőit vagy esetleges eredményeit, hanem ehelyett az álláspont képviselőinek hátsó szándékaira, mögöttes motívumaira összpontosítunk. A tudásszociológiai elemzés az RDE-paradigma magyarországi és nemzetközi szószólóit leplezett és leplezetlen hatalmi ambíciókkal vádolja, és sejtetni engedi, hogy a szóban forgó tudomány megközelítésmód követése valamiképpen az érintett kutatók torz személyiség szerkezetének következménye (*Hadas* [1993] 190–191.o.). Itt tartunk most, kíváncsian várom a folytatást.

Hivatkozások

- ABELL, P. [1991]: *Rational Choice Theory*. Elgar, Aldeshot – Brookfield.
 ELSTER, J. [1986]: *Rational Choice*. University Press, New York.
 GALASI PÉTER–KERTESI GÁBOR [1987]: A korrupció terjedése. *Közgazdasági Szemle*, 9. sz.

- GALASI PÉTER–KERTESI GÁBOR [1988]: Patkányverseny a korrupciós piacon. Közgazdasági Szemle, 7–8. sz.
- GALASI PÉTER – KERTESI GÁBOR [1991]: A hálapénz ökonómiája. Közgazdasági Szemle, 3. sz.
- HADAS MIKLÓS. [1993]: Racionális döntések elmélete és újmessianizmus. BUKSZ, nyári szám.
- HELMICH, D. – SZÁNTÓ Z. – TÓTH M. [1991]: A racionális döntések és játékok elmélete (Magyar nyelvű irodalom). Replika, 4. sz..
- KOVÁCS JÁNOS MÁTYÁS. [1984]: A reformalku sűrűjében. Valóság, 3. sz.
- SZÉP JENŐ – FORGÓ FERENC [1972]: Bevezetés a játékelméletbe. Közgazdasági és Jogi Könyvkiadó, Budapest.

Vincze János

Van-e magyar út az elméleti közgazdaságtanban?

Kiindulási pontom az a megfigyelés, hogy számos magyar közgazdász – köztük ezen írás szerzője is – úgy érzi, hogy van különbség a jelenlegi magyar és a „nyugati” közgazdaságtan között, és az a feltevés, hogy nem csupán érzékszalódról van szó. Ez azonban nem jelenti feltétlenül azt, hogy pontosan meg tudjuk fogalmazni ennek a különbségnek a mibenlétét. Jóllehet kételyeim vannak a vállalkozás realizálhatóságát illetően, az alábbiakban mégis kísérletet teszek arra, hogy megfogalmazzam azt, hogy miben látom a különbség „lényegét”. Egy ilyen összehasonlítás során szükségképpen elsikkadnak az összehasonlítandó „aggregátumokon” belüli finom különbségek. A műfaj korlátain belül legfeljebb azt remélhetem, hogy észrevételeim inspirálóan hatnak az olvasókra; magukra, illetve másokra ismernek azokból, de semmilyen olyan bizonyítékkal nem tudok szolgálni, amely alapján el kellene fogadniuk megállapításaimat.

Véleményem szerint az igazi különbséget a stílusban, a kérdésfeltevések, a közgazdasági problémák megközelítési módjában kell keresnünk. A „nyugati” közgazdaságtan akkor fogja meghódítani a magyart, ha a magyar közgazdászok többsége elsajátítja az arra jellemző általános stílust, és nem akkor, amikor a magyar közgazdászok valamennyien híveiül szegődnek kurrens, bizonyos szubsztantív módon leírható nézetrendszereknek. A ma forgalomban levő elméletek (netán paradigmák) ugyanis nem általánosan elfogadottak a világ egyetlen részén sem, mégis azt tapasztaljuk, hogy új klasszikusok és új keynesiánusok, valamint a tökéletes és korlátozott racionalisták között igenis van – mégpedig gyümölcsözőnek tekinthető – kommunikáció. Sőt mi több, figyelmes szemlélő azt is észreveheti, hogy egyes kutatók gyakran csak nehezen illeszthetők be ezekbe a nagy iskolákba vagy általános paradigmákba, s tevékenységük bizonyos részeiben egymással szigorúan véve nem összeegyeztethető gondolatkörökkel is kísérleteznek. Ennek oka lehet persze az egyszerű következtelenség vagy a személyes gondolati „fejlődés”, de – érzésem szerint – jórészt a tudományos gondolkodásnak abból az alapvetően agnosztikus szemléletéből származtatható, amely a modern tudományokat általában, valamint a „nyugati” modern közgazdaságtudományt is jellemzi.

A továbbiakban először azt szeretném összefoglalni, hogy véleményem szerint mi jellemzi a modern nyugati közgazdaságtan stílusát. Úgy gondolom, hogy amit leírok, számos ponton jellemzi a mai empirikus tudományos gondolkodást általában is, és meglehetősen bizonyos vagyok abban, hogy leírásom tűrhetően pontos képe a *mainstream* közgazdasági gondolkodásnak, amely kialakított bizonyos olyan stílusjegyeket, amelyek pél-

dául a természettudományokra nem jellemzőek. Ezután megvizsgálom azt a kérdést, hogy mi okozta a magyar közgazdaságtan különütasságát, és mik ennek a főbb jellemzői. Legvégül pedig némi tudománytörténeti előrejelzést kísérek meg a témához illően „puha” formában.

A modern közgazdaságtan stílusa

Három kérdéskört emelek ki: 1. az empiriával kapcsolatos attitűdöt, 2. az elmélet és a modellek szerepének értékelését, végül pedig 3. a vizsgálható problémáknak és a tudományon belüli munkamegosztásnak a kapcsolatát.

1. A közgazdaságtan empirikus tudomány, amelynek végső célja a predikció, jóllehet gyakran ennél kevesebbrel is be kell érnie. Ez a kevesebb néha egyszerűen a tények magyarázata vagy akár csupán érdekes jelenségek felfedezése is lehet. Mivel az ellenőrzött kísérletezés lehetőségei nagyon korlátozottak – bár az úgynevezett kísérleti közgazdaságtan (*experimental economics*) fejlődésével egyre kevésbé azok – az empirikus közgazdaságtannak matematikai statisztikai (értsd ökonometriai) eszközöket kell használnia. Az egyedi jelenségek vizsgálata szükségképpen kevésbé megbízható eredményeket szolgáltat, mint azok az eljárások, amelyekben nagyszámú adatot vagyunk képesek valószínűségi számításokon alapuló eszközökkel feldolgozni. Sztorik, esettanulmányok érdekesek ugyan, de leginkább elméletek generálására alkalmasak (heurisztikus funkció), ám egyedi történetekkel semmilyen elmélet nem igazolható, illetve egy-egy sikeres vagy sikertelen egyedi predikció nem vehető igazán komolyan. (Az „igazolható” kifejezést csupán az egyszerűség kedvéért használtam, ma már jól beépültek a közgazdasági gondolkodásba az igazolhatóság korlátaival kapcsolatos tudományfilozófiai megfontolások.)

2. Mivel a tapasztalattal való összevetés eleve nem valósulhat meg egy elméleti keret feltételezése nélkül, ezért szükséges absztrakt teóriákhoz folyamodni, amelyekben a pontosság és interszubjektivitás miatt a matematikai forma elengedhetetlen. A leghagyományosabb közgazdasági problémák egyébként is szinte kínálják magukat a matematikai kifejezésmódnak, hiszen mennyiségekkel, csökkenéssel, növekedéssel foglalkoznak. Gondolataink nemcsak egyértelművé és világosabbá, hanem pontosabban kommunikálhatóvá is válnak, ha – legalább részlegesen – matematikai nyelven fogalmazzuk meg őket. (Egyébként semmilyen, még tisztán matematikai kommunikáció sem tudja nélkülözni a természetes nyelvek használatát.) A matematika azonban nemcsak kifejezésmód (nyelv), hanem a felfedezés eszköze is. Bizonyos következtetésekre valószínűleg képtelenek lennénk eljutni, ha nem matematikai formában fogalmaznánk meg elméleteinket. Sőt egy ennél erősebb állítás is igaz: a matematika és a természetes nyelvek közötti fordítás nem valószínűleg meg tökéletesen, vannak olyan gondolatok, amelyek egyetlen megfelelő kifejezési formája matematikai.

3. A tudomány művelői között létezik egy bizonyos munkamegosztás. Az elméleti kutatók, empirikus közgazdászok, gyakorlati közgazdászok, statisztikusok, matematikusok gyakran csak részproblémákkal foglalkoznak, és kevesen vannak, akik energiájukat minden egyes részterületen kifejtik. A felmerülő kérdéseket igyekeznek kimerítően, tulajdonképpen „öncélúan” elemezni, függetlenül attól, hogy várnak-e valamilyen „externális” hatást. (Az analitikus képességek kiemelkedő helyet foglalnak el azok között az adottságok között, amelyeket az egyetemeken lényegesnek tartanak ahhoz, hogy valaki magasabb tudományos fokozatot szerezhessen.) A fontos azonban az, hogy a részterületek között van kommunikáció, illetve vannak olyanok, akik több részterülethez értenek, és képesek közvetíteni a specialisták között.

A magyar „különút”

Fő állításom az, hogy ami a hazai közgazdaságtudományt alapvetően megkülönbözteti a „nyugatitól”, az a fentebb leírt, a modern tudományokra jellemző általános stílusnak a hiánya, illetve beépületlensége. Ennek a hiánynak a magyarázatához vissza kell nyúlunk a múltba, az 1990 előtti évtizedek sajátosságaiban, történeteiben kell keresnünk azt. Vélhetőleg egy ilyen „különutas” fejlődés feltétele volt egy viszonylagos elszigeteltség, vagyis az, hogy a magyar közgazdászoknak nem kellett a világpiacon versenyezniük. Azonban a különút sajátosságainak megértéséhez találnunk kell konkrét tényezőket is. A teljesség igénye nélkül három fontos momentumra szeretném felhívni a figyelmet.

1. A legnyilvánvalóbb talán a marxizmus szerepe, a hivatalosan marxistának nevezett közgazdaságtan befolyása az oktatásban, s ennek következtében nem elhanyagolható hatása a közgazdászok gondolkodására. Nem érdemes itt avval foglalkoznunk, hogy a szocializmus vagy a kapitalizmus közgazdaságtana című tankönyvek mindenkor mennyire voltak igazi vagy jó marxisták, mennyire tükrözték hűen Marx elméletét vagy intencióit. Akármit is gondol valaki ezekről a kérdésekről, vélhetően egyet kell értsen abban, hogy – megint csak a stílus tekintetében – a marxi elmélet és ezek a tankönyvek hasonlóak voltak egymáshoz. (Egy másik kérdés, amire megfelelő ismeretek hiányában nem tudok választ adni az, hogy ennek a közös stílusnak a gyökerei pontosan hova vezethetők vissza.) Közös jellemzőjük volt, hogy nem voltak apró, megfogható céljaik, analitikus problémáik, hanem inkább nagy, átfogó, mindent megmagyarázó elméletek kialakítására törekedtek. Ez alapvetően ellentétes a modern közgazdaságtudomány nézőpontjával, amely képes sok erőfeszítést áldozni olyan „kisszerű” problémák vizsgálatára is, mint például az hogy a keresleti függvényekből alkotott Slutsky-mátrix valóban szimmetrikus és negatív szemidefinit-e, és kevésbé tart vizsgálatra méltónak olyan kérdéseket, mint a munkásosztály relatív és abszolút elnyomódásának történelmi törvénye. Az igazi különbség véleményem szerint az, hogy egy marxista stílusú közgazdász valószínűleg sohasem tartaná érdekesnek az előző problémát, míg egy modern „nyugati” közgazdász lehet hogy érdekesnek tartaná az utóbbit, amennyiben valaki pontosan meg tudná fogalmazni azt, hogy mit is jelent a relatív és abszolút elnyomódás, és megfelelő elméleti és empirikus formát tudna adni a hipotézisnek. Ezenkívül a marxista típusú gondolkodók elméleti problémái között gyakran nagy szerepet kapnak a definíciós, a helyes elnevezésre koncentráló kérdések. A modern tudomány nominalista szelleme számára az ilyen kérdések nem lényegesek, a „jó” elnevezés legfeljebb az áru csomagolásának tekinthető, amely a marketing szempontjából lehet fontos, de nem lehet szerepe az elméletek megítélésében. Sőt a túlságosan hangzatos terminusok inkább gyanút válthatnak ki a kifejezendő gondolatok mélységét illetően. Tipikusnak mondható továbbá az is, hogy számos hazai közgazdász a modern közgazdaságtan által elméletinek tartott problémákat pusztán technikai, módszertani jellegűnek tekinti. (Ezzel nem azt állítom, hogy nem léteznek pusztán technikai problémák, csak azt, hogy a jelző használata között jelentősek a különbségek.)

2. Egy másik, talán kevésbé nyilvánvaló tényező volt a szocializmus gazdaságának nehezen elemezhető volta. A magyar közgazdászok jelentős része ugyanis elfordult attól, hogy csak nagy elméletekkel foglalkozzon, és jobban érdekelték azok a megfoghatóbbnak tűnő problémák, hogy valójában hogyan is működik a gazdaság, amelyben élnek. Ugyanakkor ezek a problémák „nehezek” voltak, ugyanabban az értelemben, ahogyan például a szociológiai problémák általában nehezebbek, mint a közgazdaságiak. Nehézségen itt azt értem, hogy nem egykönnyen engedik meg az absztrakt elemzést, és a statisztikai megközelítésmód is erős korlátokba ütközik. Nem véletlen, hogy ma a közgazdaságtan egyik legfejlettebb részterülete a pénzügytan (*financial economics*), ami egyezzersmind az egyik legegyszerűbb is. A pénzügyi követelések piacán ugyanis viszonylag

homogén, jól definiálható jószágokkal van dolgunk, a fejlett pénzpiaccal rendelkező gazdaságokban nagyszámú professzionális szereplő tevékenykedik ezeken a piacokon, akiknek motívumai eléggé kézenfekvőek, valamint nagy tömegű, jól megfigyelhető, publikus adat teszi lehetővé a statisztikai elemzést. Azt is mondhatnánk, hogy ez a terület majdnem olyan egyszerű, mint mondjuk a kémia, ahol egy jól felkészült, szorgalmas kutatónak nagyon jó esélye van arra, hogy időről időre empirikusan releváns és új – ha nem is feltétlenül világrengető – eredményeket kapjon. A szocialista gazdaságok azonban sokkal nehezebben kezelhető képződmények voltak, a fenti egyszerűségi kritériumok egyike sem teljesült rájuk, s így nem csoda, hogy elemzésükkor a szokásos közgazdasági fogalmakkal nem lehetett nagyon messzire jutni. Az már csak személyes vélemény, hogy nem létezett olyan elmélet sem, amellyel messzibbre lehetett volna jutni. Így tehát sok szempontból érthető a magyar közgazdászok húzódozása a „nyugati” elméletek és stílus követésétől. Ugyanakkor valamely megközelítés alkalmazhatatlansága bizonyos problémákra, nem kell, hogy annak a megközelítésnek a teljes elvetéséhez vezessen. Sokak esetében azonban éppen ez történt. (Egyébként a nyolcvanas évekre kialakultak olyan elemzési eszközök, amelyek reményt adtak arra, hogy a szocializmus problémáit „közgazdasági” eszközökkel lehessen elemezni.)

3. Míg az első két ok jellemezhetette az összes volt szocialista ország közgazdaságtudományát, addig ezekhez Magyarország esetében hozzáadódott egy speciálisan helyi körülmény is, az hogy a „tradicionális” közgazdaságtan egyik nemzetközileg legnevesebb kritikusa a hatvanas évek végén magyar közgazdász, Kornai János volt. Jóllehet cseh és lengyel közgazdászok is jól ismerték az Anti-Equilibriumot, tapasztalatom szerint ők jóval kritikusabban álltak annak mondanivalójához, mint magyar kollégáik. Számos magyar közgazdász – érzésem szerint – Kornai János művével mintegy igazolni látta legrosszabb sejtéseit a nyugati közgazdaságtant illetően, és elégedetten vette tudomásul, hogy nem kell sokat törődnie vele. Ez egyébként Kornai ajánlásaival is ellentétes, hiszen ő könyvében hangsúlyozta az általa bírált elméletek jelentőségét, és azok megismerésének fontosságát minden közgazdász számára. A könyv interpretálása során elkövették azt a csúsztatást, hogy az általános egyensúlyelmélet kritikáját az absztrakt, matematikai modellek kritikájaként fogták fel, megint csak a szerző vélhető intencióival ellentétesen, hiszen Kornai később is tanulmányozott matematikai modelleket. Ugyanakkor az általános egyensúlyelmélet hatása a gyakorlati közgazdaságtanra, a makroökonómiaira vagy éppenséggel a pénzügytanra a hetvenes évektől bontakozott ki igazán, vagyis egy, a hatvanas évek végén írott könyv nem tudott teljes képet adni annak helyéről a tudományon belüli munkamegosztásban. Érzésem szerint mindmáig a „felnőtt” magyar közgazdászok többsége felszínes ismeretekkel rendelkezik a nyugati közgazdaságtanról, még annak tankönyvi anyagait sem ismeri jól, nemhogy a tankönyvekben nehezen leírható stílust, filozófiát.

A közös jövő

Lesz-e stílusváltás? Válaszom azt hiszem nem meglepő, és levezethető közgazdasági alapelvekből. Hosszú távon lesz stílusváltás, mivel a piac kinyílt, és a szereplők anyagi érdeke is ezt kívánja. A közgazdaságtan hasonlóan áll e tekintetben, mint a legtöbb szakma Magyarországon. A szakembereknek egyre inkább „világpiaci” követelményeknek kell megfelelniük – bár a munkaerő szabad áramlása korlátozott, s így komoly súrlódások lehetnek –, és csekély annak az esélye, hogy a világ többi része alkalmazkodjon hozzánk. Az oktatás és a kutatás hazai forrásainak csökkenésével egyre nagyobb részben külföldi pénzek finanszírozzák ezeket a tevékenységeket (lásd például TEMPUS, ACE

stb.), és nyugati kritériumok alapján bírálják el őket. Az újabb generációkon könnyen lemérhető az igazodási tendencia, hiszen az elméleti közgazdaságtannal foglalkozni kívánó tehetséges diákok szinte mindegyikének az a célja, hogy amerikai vagy amerikai stílusú nyugat-európai egyetemeken folytassa tanulmányait, s ott szerezzen tudományos fokozatot. (Tapasztalatom szerint tisztán intellektuális megfontolások is fontos szerepet játszanak.)

Ugyanakkor még hosszú ideig a szakma nem csupán ezekből a fiatalabb közgazdászokból fog állni, annál is inkább, mivel más fejlődő országokhoz hasonlóan ezek jelentős része a *brain drain* (szerencsés?) áldozatává fog válni. Másfelől az „átmenet közgazdaságtana” szintén elég nehéz téma, ha nem is olyan nehéz, mint a szocializmus közgazdaságtana volt. Ezért még jó ideig relatíve nagy fontossága lesz a jó helyismeretnek, annak, hogy valaki sok „történetet” ismerjen, a nyugati egyetemeken lényegesnek tartott analitikus és kvantitatív képességekhez viszonyítva. Ehhez járul még az a tényező is, hogy a stílus átvételének egy teljes kulturális tradíció átvételét kell jelentenie. Egy tradíció viszont sohasem kommunikálható tökéletesen írásban, és nagyon nehezen kommunikálható egyáltalán. Az átvétel legjobban személyesen, a tradíció birtokosainak példamutatásán keresztül valósulhat meg, ami viszont lassú és elhúzódó folyamat. Ezért azt jósolhatjuk, hogy az itthon hiányzó tradíció okán a szakma átmenete – s nem feltétlenül az egyes embereké – lassú lesz.

Nagy András

A *déjà vu*-tól a *what is new?*-ig

Mivel lassan a kihalóban lévő bölények azon ritka példányaihoz tartozom, akik a hatvanas évek elején kezdtek megismerkedni nálunk a modern közgazdasági elméletekkel, úgy vélem, érdemes néhány gondolatot hozzáfűzni ahhoz, amit az utánunk jövő generáció e téren nemrégiben tapasztalt. Nem tudom megítélni, hogy hozzájárultunk-e az örökséghez, vagy éppenséggel az ellenkezőjéhez, ahhoz hogy szellemi tékozlásaink miatt kevés használható maradt utánunk örökbe, ezt alighanem majd később lehet eldönteni.

Ahogy a mostani „középgeneráció” beszámolt a Marx Károly Egyetemen szerzett ismereteiről és arról a konfliktusról, ami a korszerű közgazdasági elméletekkel való találkozásuk során keletkezett, *déjà vu* érzés keletkezett bennem, eszembe juttatta azt, ami velünk történt e téren a hatvanas években.

Az MTA Közgazdaságtudományi Intézetében 1955-ben megindult kutatások nagy része már a dogmatikus, sztálinista közgazdasági elmélettől való eltávolodás vagy szembefordulás jegyében indult. Sokan egyetértettünk abban, hogy a marxi elmélet érvényes lehet ugyan a kapitalizmus kritikájaként, de kevés, vagy szinte semmi használhatót nem mond sem arról, hogy a szocialista gazdaságot hogyan kell irányítani, sem arról, hogy a vállalatoknak hogyan kell gazdálkodniuk, sem pedig arról, hogy mi illeti meg a munkavállalókat és a fogyasztókat. Az akkor induló „revizionistának” bélyegzett reformista gondolkodók számára egyre nyilvánvalóbbá vált, hogy az, amit e téren a sztálini korszak alkotott, közgazdaságilag is súlyosan hibás, az erőforrások nagyfokú pazarlásával, téves allokációjával, a fogyasztók kiszolgáltatottságával, a termelés minőségromlásával és technikai elmaradásával jár. Ebben a szellemi légkörben születtek meg a hatékonyság javítá-

sát célzó első tanulmányok, *Máriás és Liska* [1954] cikke az export gazdaságosságának méréséről, *Turánszky* [1955] cikke a beruházások gazdaságosságáról és *Péter György* [1954] tanulmánya a gazdaságosság jelentőségéről, amelyeket már erősen befolyásoltak a Sztálin által kiátkozott jugoszlávok „piaci szocializmusának” gondolatai. Ezeknek a témáknak a kutatása és vitái alakították ki az akkori fiataloknak és középkorúaknak azt a csoportját, amely egyfelől élesen szembekerült a dogmatikus sztálinistákkal, másfelől létrehozott egy új megoldásokon és reformokon együttgondolkodó közösséget.

Az 1956-os forradalom, majd annak szovjet eltiprása és az azt követő terrorhullám fordulópontot jelentett mindannyiunk számára. Vízválasztónak bizonyult közöttünk, hogy elismerjük-e az újabb szovjet megszállás szükségességét, vagy gyalázatos agresszióknak ítéljük azt. Nagy Imre és a forradalmárok tömeges kivégzését helyeseljük-e, hallgatunk-e róla, vagy a Kádár-féle pártvezetés felháborító árulásának tartjuk-e? A választás nem csupán politikai, elméleti és morális kérdés volt, mert miatta sokan börtönbe kerültek, vagy az állásukat veszítették. Mindez többünket arra vezetett, hogy kritikailag felülvizsgáljuk korábbi nézeteinket, életutunkat. Politikai tevékenységet nem folytathattunk, sokszor nem is akartunk, a marxizmus tételeit nagyrészt elvetettük, és a szovjet típusú tervgazdaság koncepciójával határozottan szembefordultunk.

Felismerve, hogy mennyire félrevezető volt mindaz, amit nekünk elméletitörténet címen a modern közgazdaságtudományról tanítottak, szinte rávetettük magunkat a nyugati szerzők eredetiben való olvasására, mármint arra, amihez akkor hozzájuthattunk. Így olvastuk Walrast, Pigout, Paretót, Schumpetert, Marshallt és néhány 56-os emigráns barátunk által hazaküldött nyugati egyetemi tankönyvet. Ezek ugyan korábbi tanulmányainkhoz képest nagyon üdítőek és izgalmasak voltak, igényességük, világos logikájuk és okfejtésük magával ragadott, ugyanakkor némileg tanácstalanul hagyott bennünket, hogy ugyan mit kezdhettünk mindezzel az ismeretanyaggal akkor, amikor az 1953–1957 között előtört reformgondolatokat szinte mind elvetették, és tartani lehetett attól, hogy visszaállítják a merev szovjet típusú tervgazdasági rendszert.

Alighanem ez a légkör magyarázza nagyrészt, hogy a klasszikus elméleteknél nagyobb hatással volt ránk, amikor megismerkedhettünk a lineáris programozással, a mátrixinverzióval és az input-output elemzéssel. Ekkor jelentek meg nálunk az első elektronikus számítógépek, akkor hihetetlennek tűnő számítási lehetőségeikkel. Úgy tűnt, hogy ezek már valóban olyan tudományos eszközöket (egyszerre hardvert és szoftvert) adnak a kezünkbe, melyekkel kimutathatóak a ténylegesen működő gazdasági rendszerek belső összefüggései, torzulásai és pazarlásai, valamint a javítás lehetőségei és irányai is. Ekkor születtek első tanulmányaink, amelyekben a megvalósítható tevékenységek halmazán különböző célfüggvénytípusokat optimalizáltunk és hasonlítottunk össze, a duális árakkal való optimalizálással kísérleteztünk, és ekkor készülték az első input-output elemzések is.¹ Már 1963-ban a Cambridge-ben szervezett *Activity Analysis* konferencián jelentős nemzetközi sikert aratott Kornai János és Lipták Tamás kétszintű tervezési modellje, ami a tervezésnek látszólag jobban megfelelt, mint a Kuhn–Thucker-eljárás.²

Ilyen körülmények között került sor a hatvanas évek közepén az első nagyszabású kollektív modellezési kísérletre, a Kornai által vezetett kétszintű tervezésimodell-család kialakítására, amelyben elég nagy számú ágazati optimalizálási modellt szerettünk volna a kétszintű eljárással összekapcsolni, és egymással összefüggésben, közösen optimalizálni. Nem véletlen, hogy ennek a nemzetközileg is úttörő vállalkozásnak az eredményeit nem publikáltuk. Menetközben rá kellett ugyanis ébrednünk arra, hogy formailag megoldhatók ugyan a modellek, és össze is kapcsolhatók, azonban olyan erős megszorítások-

¹ Lásd például: *Bródy* [1964] és *Nagy* [1965].

² Lásd: *Kornai* [1965].

kal és feltételezésekkel kell éljünk, hogy magunk se hihettük, hogy reálisan megvalósítható tervvariánsokat állítunk elő velük, és különösen azt nem, hogy azok egyértelműen jobbak lesznek, mint a tervezők hagyományos eszközökkel előállított tervei.

Ez a sokszor magunknak se bevallott felismerés egybeesett azzal, hogy megindult a gazdasági mechanizmus reformjának kidolgozása, többen aktívan részt is vettünk benne. Ez lényeges váltás volt: annak belátása, hogy a központilag kötelezően előírt tervezés a legkorszerűbb eszközökkel sem javítható meg igazán, pláne nem optimalizálható – a fogalom nem matematikai-formai, hanem tartalmi értelmében. Ha a szocialista gazdálkodást hatékonyabbá tenni, javítani szeretnénk, akkor nincs más út, mint a piaci eszközök alkalmazása és kiterjesztése, a központi irányítás és utasítás erős korlátozása, a vállalati önállóság növelése, a nyereségérdekeltség bevezetése és a világgazdaság felé való nyitás.³

Ez a váltás egyben annak a felismerése is volt, hogy bizonyos elméleti levezetések és tételek, a korszerű modellezési eszközök a gyakorlatban csak igen korlátozottan vagy sehogyan se használhatók. Intellektuálisan rendkívül izgalmasak, sokszor „szépek”, az oktatásban nagy sikerrel alkalmazhatók, sőt nélkülözhetetlenek, mert tisztázzák a fogalmakat és összefüggéseket, de a gyakorlati alkalmazhatóságukba vetett reményeinkben nagy-részt csalódnunk kellett.

Úgy tűnik a neofita lelkesedésnek és a valósággal való szembesülésnek ez a ciklikus mozgása ismétlődik most meg az utánunk jövő közgazdászgeneráció esetében, ez keltette bennem a *déjà vu* érzését az utóbbi idők számos vitája nyomán. Vannak, akik még a neofita lelkesedésnél tartanak, és vannak, akiket már elért a kiábrándulás hangulata vagy – ha jobban tetszik – a reális lehetőségek felismerése. És vannak persze, ahogy a mi időnkben is bőven voltak, akik tudatlan konzervativizmusukban vagy cinikusan eleve szemben állnak minden újjal és minden elmélettel.⁴

A *déjà vu*-nek van még egy momentuma: „pálfordulásunkkal” a kibiceknek is csalódást okoztunk – akkor is, ma is. Ma már kevesen emlékeznek (vagy akarnak emlékezni) arra, hogy a népgazdasági modellezési lehetőségeink miatt számos vezető nyugati közgazdász irigyelt minket, érdeklődéssel követte és lelkesen biztatta erőfeszítéseinket, majd csalódtak, amikor felhagytunk vele. A 68-as reform idején közülük többen elítélték piacpárti fordulatunkat, és egy ideig még a reformokat ellenző szovjet optimális tervezési modellek iránt érdeklődtek. Ma is bőven akadnak Nyugaton is, Keleten is, akik csalódot-tak a „szocialista vívmányok” feladása miatt, akik a közgazdasági elmélet terén is kudarcnak élik meg, hogy lemondunk nemcsak a tervgazdálkodás „fölényéről”, de még a lehetőségéről is.

Van azonban e téren a közgazdasági és alighanem az ismeretelméleti gondolkodásnak egy lényeges adóssága. (Talán mondanom se kell, hogy ez az adósság is része az örökségnek.) Ezt már a hatvanas évek végén – magunkban – úgy fogalmaztuk meg, hogy hol van a határa a bonyolult nagy rendszerek áttekinthetőségének és irányíthatóságának? Mit lehet központilag átlátni, kézben tartani, és mit kell decentralizálni? Az információk felfelé és lefelé való áramlása hol és milyen mértékben deformálódik annyira, hogy a döntéseket is tévútra viszi? Mi az, amit e téren a modellek leküzdhető tökéletlenségei és

³ Lásd például: Nagy [1967].

⁴ Egy zárójeles megjegyzés: a közgazdasági elmélet és a gazdaságpolitikai gyakorlat szembeállítására gyakran elhangzik az a jóformán közhellyé váló megállapítás, hogy „a gazdaságpolitika nem tudomány, hanem művészet”. Ilyesmit csak az mondhat, akinek nem sok fogalma van a művészetről. Lehet ugyan azt állítani, hogy például nincs olyan modell vagy számítógép, amely egy autót jól el tudna vezetni a Király utcából a Dob utcába, de ettől még a taxisoőr tevékenységét nem szabad összetéveszteni azzal, ami a Zeneakadémián folyik. A művészet legalább annyira elvonatkoztat a mindennapi gyakorlattól, mint a tudományos elmélet – a különbség egész másutt van.

a számítástechnikai lehetőségek korlátoznak, és mi az, amit az e téren végbement és ezután várható rohamos fejlődés ellenére sem lehet átlépni?

Annak, hogy az 1956-os forradalom az egyetemisták tüntetésével kezdődött, volt még egy fontos következménye a közgazdasági gondolkodás, elmélet és főleg az oktatás és a kutatás szétválása terén. A hatalom számára a forradalom egyik fontos tanulsága az volt, hogy különös gondot kell arra fordítani, hogy a „helytelen”, „revizionista” vagy pláne az „ellenséges” nézetek be ne férkőzhessenek még egyszer az egyetemekre, mert megtapasztalták, hogy a „megfertőzött” hallgatók mennyire veszélyesek lehetnek. És ahogy 1947–1949 között a nem marxistákat száműzték az egyetemokról, úgy 1957 után már a nem elég megbízható oktatók között is nagy tisztogatást hajtottak végre, a kritikus szellemű kutatókat pedig be se engedték oda. Akiket hagytak oktatni, azok a megfélemlített-ségnek olyan légkörében éltek, hogy nagyon vigyázniuk kellett, nehogy valami „helytelen”, vagy revizionistának minősíthetőt mondjanak.⁵

A kutatóhelyeken, így a Közgazdaságtudományi Intézetben is, sokkal kevésbé volt megfélemlített a légkör. Leginkább arra vigyáztak, hogy a publikációkban ne jelenhesse- nek meg antimarxista nézetek, mert azok az éber doktrinerek veszélyes támadásainak tették ki nemcsak a szerzőket, de az intézményeket és a szerkesztőségeket is. A kutatás légköre, a viták azonban szabadabbak voltak, a kutatók inkább hozzájuthattak a nyugati irodalomhoz, elméletekhez és kutatási módszerekhez, és így felkészültebbekké is válhat- tak. Alighanem ez is hozzájárult ahhoz a – máig tartó – ellenérzéshez, ami az egyetemi oktatókat elválasztja a kutatásban dolgozóktól. És ez lehetett az oka annak is, hogy a tanszékek nagy része nemcsak hogy nem igényelte, de határozottan ellenállt annak, hogy a náluk képzetebb, elismert kutatók tanítsanak az egyetemen, és ez még akkor is tartott, amikor már politikailag nem kellett félni tőlük.

Paradox módon azonban a kutatóknak kevesebb lehetőségük volt elméleti kérdésekkel foglalkozni, mert rendszeresen azt igényelték tőlük, hogy témaválasztásaik gyakorlatilag minél hasznosíthatóbbak legyenek. Az egyetemen viszont közgazdasági elméletet, elmé- lettörténetet kellett (vagy kellett volna) oktatni olyanoknak, akik nagyrészt nem ismer- ték, vagy ha ismerték, nem merték ismertetni a korszerűbb közgazdasági gondolatokat és elemzési módszereket. Alighanem ez az eltorzult „munkamegosztás” vagy szerepvállalás él tovább napjainkban is. Az egyetemi oktatás elzártságából és öncenzúrájából nagyobb felszabadulást jelentett a dogmákat ledöntő rendszerváltás, mint amit a kutatók tapasztal- hattak. Ez magyarázhatja, hogy a tananyag korszerűsítése és megújulása több neofita lelkesedést, „utánzást” váltott ki a korábban elméletileg elmaradottabb oktatás területén, míg a kutatók között kisebb volt a fordulat, több a kétség a Nyugatról beáramló elméle- tekkel szemben, amelyek számukra nem is annyira újak.

Áttérnék ezek után a *what is new?* kérdésére. Itt már – e hozzászólás szűk korlátai között – inkább csak valamiféle témavázlatot adhatok, aminek kidolgozása még hátra van.

1. Az egyik újdonságnak számító felismerésünk még a hatvanas években az volt, hogy sokkal nehezebb, ha éppen nem lehetetlen a szocialista gazdálkodásban valami célfügg- vényt definiálni, mint a piaci gazdálkodásban. E téren – úgy véltük – nemcsak a külön- ségek nagyobbak, de a megismerés lehetőségei is kisebbek, mint a változók vagy a kor- látozó feltételek meghatározásakor. Többek között ezeknek a kérdéseknek a vitatása is vezetett egyrészt a *comparative economic systems* kutatási irány kialakulására, másrészt a sokváltozós célfüggvények vizsgálatára, melyek valószínűleg nem, vagy nem így fej- lődtek volna, ha nem lettek volna szocialista tervgazdaságok.

2. A népgazdasági modellezés és a mechanizmusreformok sikereinek és kudarcainak

⁵ Jellemző, hogy a Közgazdasági Egyetemen az oktatók nagy része „önként” munkásőr lett ebben az időben. Erről született akkor a mondás, hogy: „ők voltak a legjobb közgazdászok a munkásőrök között és a legjobb munkásőrök a közgazdászok között”.

tapasztalatai vezettek a közgazdasági racionalitással kapcsolatos számos illúziónk elvesztéséhez. A fentiekben „neofita lelkesedési periódusnak” nevezett korszakban ugyanis az a feltételezés dominált, hogy elég felismerni, mi a helyes: a népgazdasági érdek, az egyensúlyi ár vagy árfolyam, a helyes ösztönzési kritérium, az optimális terv, az optimális vállalatnagyság vagy termelési sorozatnagyság stb., és ha erre rájöttünk, akkor már csak meg kell valósítani, ami részletkérdés és nem a kutatókra, hanem a végrehajtó apparátusokra tartozik. Mikor sorozatosan kiderült, hogy az, amit helyesnek vagy pláne optimálisnak tartottunk, rendre nem valósult meg, akkor fordult a figyelmünk az intézmények működése felé, és fedeztük fel nagy lelkesedéssel a *collective choice* és *social choice* elméletekben ezeknek nemcsak a magyarázatát, hanem a tudományos kezelés lehetőségeit is. De az *utánzás* itt sem működött zökkenőmentesen, mert a sok hasonlóság mellett kiderült, hogy nagyon sokban különböznek azok az intézmények, amelyeket a párt, az állam és a monopolizáltság olyan mértékben dominál, mint a szovjet típusú gazdaságokban.⁶ Úgy gondolom, tudunk e téren is némi újakat mondani, de talán több itt is az adósságunk, mint az eredeti gondolat, amire rátaláltunk.

3. A külkereskedelmi kapcsolatok terén a rendszerváltozás és a KGST összeomlása véleményem szerint két lényeges új jelenséggel párosult, aminek az elemzését és az elméleti tanulságok levonását még csak nagyon hézagosan, vagy sehogy sem végeztük el. Az egyik a forgalom reorientációja, vagyis a KGST közismerten túlméretezett egymás közti forgalmának a normális vagy az alatti szintre való csökkentése, valamint a fejlett, elsősorban nyugat-európai országokkal való kereskedelem rendkívül gyors megnövekedése. A másik az import liberalizálásának – más országok korábbi, hasonló tapasztalataihoz mérve – rendkívül gyors és viszonylag ellenállás nélküli végrehajtása. Sajátos külső és belső körülmények segítették elő, hogy ezeken a területeken korábban elképzelhetetlen mértékű és gyors, alapvetően jó irányú változások mentek végbe. Csak a sikertörténeteknek elkönyvelt változások lezajlása után merültek fel kételyek, hogy talán túlzott mértékű volt a keleti piacokról való kivonulás, és talán az import liberalizálásának a belföldi termelést kiszorító hatása is túl erős és hirtelen volt. Más megfontolások viszont amellett szóltak, hogy éppen ez a két folyamat volt az, ami leginkább kényszerítette a belföldi vállalatokat a hatékonyabb és versenyképesebb termelésre, ellentétben például a privatizációval, amelynek az ilyen irányú hatása a vártnál sokkal lassabban érvényesül.⁷

4. A külkereskedelemben elért eredmények és kudarcok elemzése szorosan összefüggött a devizaárfolyam színvonalának megállapításáról és értékeléséről folytatott vitával. Mivel a teljes körű konvertibilitást és jól működő devizapiacot sehol sem lehetett egy csapásra bevezetni, a jegybankok árfolyam-politikája nagymértékben befolyásolta a külkereskedelmi forgalom mértékét és egyenlegét. Nagyon eltérő, de még kellően nem elemzett eredményekre vezetett az, hogy a liberalizálást erős (esetleg túlzott mértékű) leértékeléssel kapcsolták-e egybe, vagy enélkül, az infláció mértékéhez igazított (esetleg attól elmaradó, vagyis reálfelértékelődésre vezető) fokozatos leértékelést hajtottak-e végre. Ebben a kérdésben az elméletileg új szerintem az, hogy az árfolyam-megállapítás nemcsak a forgalom mértékére és az egyenlegére van hatással, hanem – és ez a piaccgazdaságra való átmenet sikere tekintetében legalább olyan fontos – arra a hatékonyságszorításra is, amit az exporttermelés és az importhelyettesítés terén az árfolyam kifejt. A nagymértékű leértékelés ugyanis viszonylag könnyű helyzetbe hozza az exportőröket is, az importot helyettesítő belföldi termelőket is, kevésbé érzik azt, hogy kiszorulhatnak a piacról, ha nem csökkentik a költségeiket, javítják a minőséget és a marketingmunkájukat. A

⁶ Lásd: Nagy [1990].

⁷ Lásd például: Köves-Oblath [1991], Gács [1993], Nagy [1995].

reálfelértékelés viszont, éppen azzal, hogy erős hatékonyságszorítást alkalmaz, nem csak a külkereskedelmi mérleget ronthatja, hanem esetleg túl nagy csődökhöz, vállalatfelszámolásokhoz és a piacokról való kiszoruláshoz vezethet. Az árfolyam-megállapításnak ezért nem csak a külgazdasági egyensúly kialakítását kell céloznia, és nem is csak arra van hatással, hanem arra is, hogy milyen gyors vagy lassú lesz a hatékonyságjavulás a versenyszektorokban.⁸

5. A szocialista rendszerek összeomlása történelmileg teljesen új jelenség, és ezért sok váratlan meglepetéssel szolgált. Ezek közül közgazdaságilag az egyik leginkább figyelemre méltó, hogy az egyszerre túlszabályozott és a törvényeket kényük-kedvük szerint változtató és alkalmazó despotikus rendszerekből nem lehet simán átlépni a mennyiségi-kevesbé, de jogilag jól és következetesen szabályozott piacgazdaságba és politikai demokráciába. Az összeomlást sokkal természetesebben követi az anarchikus, szabályozatlan, jogilag bizonytalan és következtelen helyzet. Ebből a szempontból különösen tanulságos az állami vagyon nyílt vagy burkolt kifosztása, a spontánnak nevezett privatizáció, a helyismeret tőkévé alakítása, a külföldi befektetőknek tanácsokat adó, jól fizetett „komprádor” szakértők felbukkanása, az állami, politikai és civil szervezeteknek a gazdasági korrupcióval, óriásira nőtt adócsalással és monopolprofitokkal való összefonódása, a maffiák kialakulása.

Ezen a téren régen is, most is óriási a különbség a „fent” és a „lent” lévő között. A korábbi hatalom privilegizált birtokosai megszokták, hogy ők a törvények fölött állnak, azok rájuk nem, vagy nem úgy vonatkoznak, mint az „egyszerű emberekre”. Ez kiváltképp alkalmassá tette őket arra, hogy az összeomlást követően kihasználják a lehetőségeket, még kevésbé tartsanak be szabályokat vagy etikai normákat, mint korábban. Akik – ezzel szemben – korábban a rendőrségtől, a párttagoktól és a besúgóktól félve, az „állami tulajdon szigorú védelme” légkörében csak kis stikliket mertek elkövetni, csak lassan ocsúdtak fel és a szabályozatlanságok, „joghézagok” között nehezebben igazodtak el. Mindez természetesen erősen rányomja a bélyegét az új tulajdonviszonyok kialakulására, a vállalkozók, menedzserek és munkavállalók kapcsolataira, a szocialista időkben a tőkés piaci munkaerőkölcsöktől egyébként is nagyon különböző szokásokra. Ma még csak illúzióinkból felocsúdva bámuljuk ezeket a jelenségeket, elemzésükhöz se nagyon kezdtünk hozzá, és távolról sem tisztázott, hogy hova vezet ez a folyamat. De hogy sok benne az új, az biztos.

6. Nem számítottunk arra, hogy a demokratikus parlamenti és önkormányzati rendszerbe való átmenet egyik legnagyobb nehézsége az állami bevételek és kiadások (beleértve a társadalombiztosítás) rendszerének átalakítása lesz. Ennek az egyik, még kevésbé elemzett oka feltehetően az, hogy a szovjet típusú társadalmak tagjait évtizedeken keresztül nemcsak attól szoktatták el, hogy adót és biztosítási járulékot fizessenek, hanem attól is, hogy lássák az összefüggést befizetéseik és az állam kiadásai között. Ez olyan magatartást és mentalitást alakított ki, amely gyökeresen különbözik a demokratikus rendszerek polgárainak szemléletétől, akik jól tudják, hogy az állam és a biztosítótársaságok pénze tőlük származik, és azok felhasználásába beleszólhatnak. A szovjet típusú gazdaságokban a lakosságnak látszólag nem kellett adót fizetnie: nem volt jövedelemadó, nem lehetett látni a fogyasztási adót sem, a társadalombiztosítási és nyugdíjárulékot a vállalatok úgy fizették, hogy arról a munkavállalók nemigen szereztek tudomást. Ez a pénzügyi rendszer tökéletesen megfelelt a diktatórikus rendszernek, amely egyfelől „láthatatlanul” annyi adót és jövedelmet vont el, amennyit akart, másrészt a „nem létező” adófizetés nem kapcsolódhatott össze az állami juttatásokkal. A lakosság látszólag semmit sem adott az államnak, csak kapott tőle: iskolát, egészségbiztosítást, nyugdíjat, hadsereget, bírósá-

⁸ Lásd: Oblath [1993], Nagy [1995].

gokat, rendőrséget, valamint a kultúra és számos szolgáltatás támogatását. Ez volt az igazi gondoskodó állam, amelyik csak ad, és semmit sem kér, ezért aztán mindenhez joga van, és mindenki csak hálával tartozik neki.

Hosszú évtizedek beidegződése ezen a téren alapvetően meghatározta az emberek pénzügyi viszonyát az államhoz, ez a magyarázata nagyrészt annak az értetlenségnek, amivel a költségvetés kiegyensúlyozására irányuló törekvéseket fogadják, senki sem tudja, hogy az államnak honnan és mennyi pénze van, és ezért sem lehet érteni, hogy miért kellene a kiadásokat csökkenteni, vagy az adókat növelni. Ehhez járul a polgárok „megszerzett jogainak” védelme, amit az Alkotmánybíróság is megerősít, függetlenül attól, hogy befizetésekkel miféle szolgáltatásokra kívántak jogot szerezni. Elméletileg tisztázatlan és gyakorlatilag megoldatlan, hogy hogyan lehet az „atyailag mindenről gondoskodó” állam képzetéből társadalmakat átvezetni egy olyan állapotba, ahol a lakosság maga dönti el, hogy mennyit és mire akar költeni, mit akar támogatni és mit biztosítani a maga és utódai számára.⁹

Még hosszasan lehetne sorolni azokat a különbségeket, amelyek hosszabb időn keresztül meghatározzák a rendszerváltás után ki- és átalakuló intézmények működését. Az a tény, hogy a piacgazdaságra való áttérés a közép- és kelet-európai országokban igen különböző előzmények után és sok tekintetben eltérő módon ment végbe, jó lehetőségeket ad arra, hogy a következményekből új elméleti megállapításokra is jussunk. Ismeretes, hogy a társadalomtudományi kutatások egyik nagy nehézsége, hogy a „kísérleteket” nem lehet megismételni. Itt most azzal a ritka esettel van dolgunk, hogy a hasonló „betegségekben” szenvedő gazdaságokon különböző gyógy módokat próbálnak ki, és azok eredményeit össze lehet hasonlítani. Ez tudományos szempontból még akkor is nagyon érdekes, ha – remélhetőleg – hasonló „betegség” nem fog többet előfordulni.

Hivatkozások

- BRÓDY ANDRÁS [1964]: Az ágazati kapcsolatok modellje. Akadémiai Kiadó, Budapest.
- FERGE ZSUZSA [1994]: Szabadság és biztonság. *Esély*, 5. sz.
- GÁCS JÁNOS [1993]: A külkereskedelem liberalizálása Kelet-Európában: gyors reformok és újraértékelés. *Külgazdaság*, 12. sz.
- KORNAI JÁNOS [1965]: Mathematical programming as a tool in drawing up the five year economic plan. *Economics of Planning*, Oslo. No. 3.
- KORNAI JÁNOS [1996]: Az állampolgár és az állam: a jóléti rendszer reformja. *Mozgó Világ*, 2. sz.
- KÖVES ANDRÁS–OBLATH GÁBOR [1991]: Stabilizáció és külgazdasági politika. *Külgazdaság*, 7.sz.
- KÖVES ANDRÁS–LÁNYI KAMILLA–OBLATH GÁBOR [1993]: Az exportorientált gazdaságpolitika feltételei és eszközei 1993-ban. *Külgazdaság*, 5. sz.
- LISKA TIBOR–MÁRIÁS ANTAL [1954]: A gazdaságosság és a nemzetközi munkamegosztás. *Közigazdasági Szemle*, 1. sz.
- NAGY ANDRÁS [1965]: Devizagazdálkodásunk reformja elé, *Valóság*, 10. sz.
- NAGY ANDRÁS [1967]: Facteurs de freinage dans le développement de l'économie socialiste et la réforme du système économique. *Revue Tiers-Monde*, Tome VIII. No. 29.
- NAGY ANDRÁS [1990]: Részérdekek az összeomlásban és a felemelkedésben. *Közigazdasági Szemle*, 9. sz.
- NAGY ANDRÁS [1995]: A behozatal liberalizálása Magyarországon. *Közigazdasági Szemle*, 5. sz.
- NAGY ANDRÁS–STAHL JÁNOS [1966]: The Optimal Volume of Foreign Trade and the Exchange Rate. *Econometrica*, No. 4.

⁹ Lásd: *Ferge* [1994] és *Kornai* [1996] vitáját.

- OBLATH GÁBOR [1993]: Economic transition, exchange rate policy and real exchange rate changes in Central-Eastern Europe, Megjelent: *Gács, J.-G. Winckler* (szerk.): International trade and Restructuring Eastern Europe. IIASA, Wien.
- PÉTER GYÖRGY [1954]: A gazdaságosság jelentőségéről és szerepéről a népgazdaság tervszerű irányításában. *Közgazdasági Szemle*, 3. sz.
- TURÁNSZKY MIKLÓS [1955]: A beruházások gazdaságosságának fogalma és számszerű értékelése. *Közgazdasági Szemle*, 4. sz.

Bodó Péter

Az ügynökprobléma néhány aspektusa az átmeneti gazdaságban*

Tíz, nyugati szerzők által írt, angolul megjelent cikket tekintek át. Ezek az írások az átmeneti gazdaság ügynökproblémáit tárgyalják formális modell keretében. Az ügynökproblémának hatalmas nyugati irodalma van. Azt szeretném bemutatni, hogy az ügynökirodalmon „felnőtt”, azt jól ismerő közgazdászok a probléma különböző megközelítései közül melyeket tartották alkalmazhatónak az átmeneti gazdaságra. Először összefoglalom, mit mond az elméleti közgazdaságtan az ügynökproblémáról. Ezután azzal foglalkozom, hogy miért fontos az ügynökproblémát az átmenettel kapcsolatban vizsgálni. Ezt követően – néhány általános megjegyzés után – kitérek az egyes modellek érdekesebb részleteire.

Az ügynökprobléma a mikroökonómiában

Az ügynökprobléma a mikroökonómia egyik alapvető kérdése, a vállalatelmélet egyik legfontosabb területe, ugyanis lényegét tekintve a gazdasági érdekelttség témakörébe tartozik. A kifejezés voltaképpen piaci hibát, negatív externalitást jelöl. Az ügynökkérdést információs problémaként is fel lehet fogni.

A következőkben a kérdéskör egyik alaptípusát, a járadékszerzéssel kapcsolatos ügynökproblémát fogom ismertetni. A történet úgy kezdődik, hogy a megbízó felveszi az ügynököt, és megbízza valamivel. Az ügynök elvégzi a feladatot; a felek előzetes megállapodásuk értelmében felosztják a jövedelemtöbbséget egymás között. A vállalkozás jövedelmezősége nemcsak az ügynök szorgalmától, hanem egyéb, az ügynök által befolyásolhatatlan tényezőktől is függ. Az ügynök megfigyelése azonban vagy lehetetlen, vagy túl költséges, vagy a megbízó nem ért ahhoz, amivel megbízza az ügynököt. A megbízó olyan ösztönzési rendszert (szerződést) akar kidolgozni, ami az ügynököt maximális erőbedobásra készteti, még akkor is, ha tudvalévő, hogy később az ügynök esetleges sikertelenségét az általa nem befolyásolható, külső tényezőkre háríthatja, és lehetetlen pontosan kideríteni, hogy mi az igazság.

A bizonytalanság és az információs probléma ellenére sem nehéz ilyen szerződést

* Szeretném megköszönni *Szakadát László* (Budapesti Közgazdaságtudományi Egyetem) értékes opponensi véleményét.

kidolgozni, ha az ügynök kevésbé óvatos, mint a megbízó, vagy mindkét szereplő egyformán viszonyul a kockázathoz. Ebben az esetben a leghatékonyabb megoldás az, ha a megbízó egy fix összeget kap az ügynöktől. Amennyiben az ügynöké a reziduum, az akkor is keményen fog dolgozni, ha nincs senki a nyomában. A dolog azonban nem mindig ilyen egyszerű. Az ügynökök jó része sokkal óvatosabb, mint a megbízó. Ilyenkor a megbízó – legalábbis elvileg – úgy maximalizálhatná várható profitját, ha ő vállal minden kockázatot, és az ügynöknek fix fizetést ad. Tekintettel azonban az információs problémára, ha az ügynök fix fizetést kap, minden bizonnyal lógni fog, ami viszont lehetetlenné teszi a profitmaximalizálást. Látható, hogy ebben az esetben a profitmaximalizálás/hatékonyság összeütközésbe kerül az optimális ösztönzéssel. Az információs problémát figyelembe vevő, a körülményekhez képest leghatékonyabb (*second best*) szerződésben, a megfelelő ösztönzés érdekében, a kockázat egy részét az ügynökre hárítják. Azonban az ügynök, alacsony kockázatvállalási hajlandósága miatt, nem viselheti az összes kockázatot. A szerződésnek tartalmaznia kell egy, az ügynöknek viszonylagos biztonságot nyújtó részt, ami viszont azt eredményezi, hogy a lógást nem lehet teljesen elkerülni. A legjobban, a legracionálisabb szereplőkkel működő piacgazdaságban is van teljesítmény-visszatartás. A leghatékonyabb ösztönzési rendszer mellett sem felelős az ügynök teljes mértékben tevékenységéért.

Az ügynökproblémával kapcsolatban a közgazdaságtan három alapvető kérdést vizsgál:

1. Melyek az ügynökmodellek megoldását jelentő optimális szerződések jellemzői?

Az optimális szerződések elméletének három jelentősebb végkövetkeztetése van:

a) a megfelelő ösztönzéshez feltétlenül szükséges kockázatmegosztás a potenciálisnál alacsonyabb hatékonyságot és profitot eredményez; b) a második legjobb szerződéshez ellenőrzés is kell, pusztán az anyagi érdekelttség nem elég, sőt: minél nagyobb hangsúly van az anyagi érdekeltségen, annál többet kell a megbízónak ellenőriznie az ügynököt; c) a szerződés hatékonysága függ a felek abszolút és egymáshoz viszonyított kockázatvállalási hajlandóságától.

2. Melyek azok a szerződésen kívüli piaci és nem piaci intézmények, amelyek felerősítik, illetve gyengítik a teljesítmény-visszatartást?

Az elmélet kiemeli a jól működő tőke- és munkaerőpiac szerepét, ami például megakadályozhatja az ügynököt abban, hogy a megbízót becsapva, egyszerűen tovább álljon, és hasonló fizetésért újabb megbízásokat szerezzen. Ugyancsak fontos a jogrendszer és a bíróságok hatékonysága. Az engedélyek kibocsátásának, a hitelezők kollektív, adókat nyilvántartó adatbankjának és hasonló intézményeknek szintén az a funkciója, hogy csökkentsék a bizonytalanságot, és javítsák a szerződések hatékonyságát.

3. Melyek az ügynökprobléma általános egyensúlyi és jóléti következményei?

A nem teljesen optimális szerződések, illetve a keretintézmények hiánya negatív externalitást hoz létre, ami jelentős hatással lehet a társadalmi jólétre. Ez szükségessé teheti az állami beavatkozást, ami viszont negatívan hathat vissza az ösztönzési rendszerre, és újabb ügynökproblémákhoz vezethet.¹

Az ügynökprobléma jelentősége az átmeneti gazdaságban

Az átmeneti gazdaságban az ügynökprobléma következményei sokkal súlyosabbak lehetnek, mint a fejlett piacgazdaságban, többek között a következő okok miatt.

A múlt öröksége. A szocialista gazdaságban az ügynökprobléma nagyon jelentős mére-

¹ Az elméleti problémáknak jó leírása található *Kreps* [1990], valamint *Milgrom–Roberts* [1992] könyveiben. A megfelelő fejezetekben kiterjedt irodalomjegyzék is van.

teket öltött. Az állam képtelen volt ügynökeivel olyan szerződést kötni, ami maximális szorgalomra ösztönözte volna az állami alkalmazottakat. Lehetséges, hogy az átmeneti gazdaság ügynökei, függetlenül a környezet megváltozásától, pusztán a korábbi beidegződéseik miatt is visszatartják teljesítményüket.

Átmenetspecifikus ügynökproblémák. Az átmenet olyan speciális ügynökproblémákat is felvethet, amelyek a jól működő piacgazdaságból hiányoznak – tömeges privatizációra, átfogó bankreformra, adóreformra, a tőkepiac beindítására, a politikai folyamatok átstrukturálására, a jóléti intézmények átfarmálására a fejlett piacgazdaságokban nem egyszerre és másképp került sor. Miközben ezek a tevékenységek régi ügynökproblémákat megszüntetnek, újakat is generálnak.

A keretintézmények fejletlensége. Azok az intézmények, amelyek meglétét az optimális szerződések implicite feltételezik, nem, vagy csak részlegesen működnek az átmeneti gazdaságban. Rosszul működik a tőkepiac, az ügynökpiac, fejletlen a biztosítási piac, kialakulatlan a jogrendszer, a bíróságok működése nem hatékony, a minőségellenőrzés sok tekintetben gyerekcipőben jár stb. Ezért a legsimplább ügynökproblémák is hatványozottan jelentkehetnek. *Frydman–Rapaczynski* [1993] jó leírást ad arról, hogyan súlyosbíthatja az intézmények fejletlensége az ügynökproblémát az átmeneti gazdaságban.

Az ügynökproblémát tárgyaló formális modellek

Általános benyomások

Nyugati szerzők megegyeznek abban, hogy a nyugati tranzitológia kezdetben túlhangsúlyozta a makroegyensúly jelentőségét, ami azzal a következménnyel járt, hogy az irodalom elhanyagolta az átalakulás néhány alapvető mikroökonómiai kérdését (*Ellman* [1994], *Gomulka* [1995], *Portes* [1994], *Rodlauer* [1995]). Ráadásul a mikroproblémákkal foglalkozó írások csak igen kis hányada tartalmaz formális modellt. Meglepő, hogy az ügynökprobléma élő klasszikusai részben közömbösek maradtak a kelet-európai transzformáció iránt (*Wilson*, *Ross*, *Stiglitz*, *Mirlees*, *Kreps*), vagy nem publikálták az erről a témáról írt kézírataikat (*Holmström*, *Milgrom* és *Roberts*). Jobb hír viszont, hogy amíg – ahogy azt *Portes* [1994] megjegyzi – a tranzitológiai irodalom kis hányada jelent meg vezető elméleti folyóiratokban, az ügynökmodelleket tartalmazó írásokat nagyon színvonalas lapok publikálták.

Sok, az átmeneti gazdaságban jelentős ügynökproblémára egyáltalán nem találtam modellt. Az általam ismert irodalomból hiányzik a fontosabb jóléti hatások általános egyensúlyelméleti keretben történő analízise, az adóztatással kapcsolatos ügynökproblémák vizsgálata, a biztosítással, központi banki tevékenységgel, a beruházó–résztvényki-bocsátó kapcsolattal összefüggő ügynökproblémák formális bemutatása. A témát más megközelítésben ugyanakkor többen is modellezik, például azt, hogyan hat a privatizáció módja a vevő privatizáció utáni szerkezetátalakító tevékenységére.

A modellekben az ügynökproblémán kívül analizált, átmenettel kapcsolatos kérdésekről elmondható, hogy ezek nagy részét már az itt bemutatott cikkek publikálása előtt is többen vizsgálták. Például az optimális privatizáció, a kockázatmegosztás jól működő tőkepiac hiányában, a vállalati szerkezetváltás elhúzódó privatizáció esetén, a korrupció gazdasági hatásai stb. már a kilencvenes évek legelejétől napirenden lévő, vitatott problémák a keleti és nyugati tranzitológiában.

Az itt tárgyalt modellek legnagyobb érdeme az, hogy a mikroökonómia bevett fogalmait és módszereit használják az átmenet gazdasági kérdéseinek vizsgálatára. Ezáltal az átmenet problémái már ismert és analizált gazdasági jelenségeknek válnak a leleteivé;

nem kell teljesen új elméletet kitalálni, hanem egységes fogalmi keret alkalmazható régi és új jelenségek megmagyarázására. A modellek végkövetkeztetéseinek érvényessége már pusztán azáltal is javul, ha tudjuk, hogy a szerző betartotta a mikroökonómia hagyományos alapfeltevéseit. Nem is beszélve arról, hogy formális modellekben a szerzők explicitté teszik a környezetre és a szereplők viselkedésére vonatkozó feltevéseiket – ez jelentősen javítja a cikkek megvitathatóságát.

Másik nagy érdeme az itt tárgyalt modelleknek, hogy többségük megpróbálja az átmeneti gazdaságokból hiányzó vagy nem tökéletesen működő, de az ügynökprobléma szempontjából fontos keretintézmények hatását figyelembe venni. Ez még akkor is jelentős dolog, ha a kritikus olvasó kapásból több olyan intézményt is fel tudna sorolni, amelyek fontosak lehetnek, de hiányoznak az analízisből. A rosszul működő tőkepiac, az állami tulajdon értékelésének problémája, a megfelelő politikai intézmények hiánya vagy azok torz működése több modellben expliciten megjelenik, és befolyásolja a vizsgált ügynökprobléma mértékét és a modell megoldását. A nem tökéletesen működő keretintézmények hatásának figyelembevétele jelentős újítás, ugyanis ezeknek az intézményeknek a megfelelő működését a legtöbb hagyományos ügynökmodell adottságként kezeli.

Erdekes az is, hogy néhány szerző mennyire pozitív szerepet szán az államnak az ügynökproblémák megoldásában. Ezeknek a közgazdászoknak, úgy tűnik, sokkal kevésbé van „államaverziója”, mint kelet-európai kollégáiknak. Kevésbé meglepő ez a megközelítés akkor, ha figyelembe vesszük, hogy az ügynökproblémát nyugati közgazdász végső soron negatív externalitásnak tekinti, amelynek felszámolásában, a gazdaságelmélet szerint, az állam pozitív szerepet játszhat.

A modellek rövid bemutatása

A klasszikus ügynökmodell érdekes alkalmazása található Katz–Owen [1995] írásában. A szerzők végkövetkeztetése az, hogy jól működő tőke- és pénzpiacok hiányában, a tőkeszegénység és az állami tulajdon értékelési problémái miatt, az államnak meg kellene tartania a privatizálandó cégek részvényeinek egy részét. A modellben az állam közvetlen megbízóvá, a vevő pedig ügynökké válik, míg az adásvételi szerződés részletei függenek a vevő és az eladó kockázatvállalási hajlandóságától, valamint a potenciális ügynökök szorgalmának varianciájától. A modell megoldása nemcsak az optimális ár – ami adott esetben negatív is lehet – és az állam tulajdonosi részaránya, hanem az ipar szerkezete is, amely szintén függ az eladó és vevők kockázati preferenciáitól. Egy példa a modell érdekes következtetéseire: kevert tulajdon esetén az állam optimális részesedése a következőképpen függ a szereplők kockázati preferenciáitól. Ahogy a privatizáló állam kockázatvállalási hajlandósága nő, úgy nő először az állami tulajdonrész aránya is. Aztán ez a növekedés megáll, és az ügynök-vevőnek nyújtott támogatás nő. A kockázatvállalási hajlandóság további növekedése esetén már csak a támogatás nő, és az állami tulajdonrész aránya csökken. A modell megengedi a teljes magánkézbe adást is, de bemutatja, hogy az bizonyos preferenciák és külső körülmények mellett nem optimális.

Számos közgazdász szerint a privatizálás leghatékonyabb módja az, ha készpénzért kompetens vállalkozóknak adják el az állami vállalatokat, mert az azonnal érdekeltséget teremt a társadalmilag optimális vállalati szerkezetváltásra. Hasonlóan az előző modellhez, Demougin–Sinn [1994] is azt vizsgálja, hogy mi történik akkor, ha az állam megtarthat bizonyos tulajdonrészt a privatizálandó vállalatban. A modell egyik legfontosabb alapfeltevése az, hogy a privatizálás kompetitív aukciók keretében történik, ahol a résztvevők ajánlata lehet készpénzben fizetendő összeg, de lehet olyan konstrukció is, amely az állami tulajdon javasolt arányát és a leendő vevő által a vállalatba fektetendő összeget

tartalmazza. Ezáltal ebben a modellben a különböző privatizációs megoldások hatékonysága közvetlenül összehasonlíthatóvá válik. A szerzők kimutatják, hogy jól működő biztosítási és tőkepiacok megléte esetén valóban a készpénzért történő eladás a leghatékonyabb. Ha azonban ezek a piacok fejletlenek, és a vevő-beruházó kockázatvállalási hajlandósága kisebb az eladó államénál, akkor, a korábban említett ügynökmodell végkövetkeztetésével összhangban, a vevő és az eladó közötti kockázatmegosztás fogja a legnagyobb várható diszkontált állami bevételt eredményezni. A szerzők által analizált participációs megoldás (rizikó megosztás) enyhíti a hiányzó tőkepiacból adódó problémákat, mert a beruházó később is fizethet, és enyhíti a hiányzó biztosítási piacból adódó problémákat is, mert csak akkor kell fizetnie a vevőnek, ha van felosztható profit. A kockázat megosztása több beruházást eredményez, és hosszabb távon nagyobb állami bevételt produkál. A modell méri a vevő kockázati preferenciájának konkrét hatását a privatizált cégbe való befektetésekre. Egy jellemző megállapítás a következő: csökkenő abszolút kockázatelutasítás esetén a készpénzért történő eladás kevesebb utólagos beruházást terem, mint a participációs privatizáció. Rendkívül érdekes az is, hogy a modellben a privatizációs aukciók szerkezete miatt a participációs mechanizmus hatékonyságára nem hat az, hogy belsők, vagy külsők-e a vevők.

Az átmeneti gazdaságok egy részében a privatizáció előkészítése és lebonyolítása céljából privatizációs ügynökségeket hoznak létre. *Schmidt-Schnitzer* [1993] írásában azt fejt ki, hogy az állami ügynökség fennhatósága alatt működő vállalatvezetőket nehezebb meggyőzni a költségvetési korlát keménységéről, ezért ők kevésbé érdekeltek a privatizáció előtti szerkezetátalakításban, mint a már privatizált cégek vezetői. Ebben a modellben a privatizáció tulajdonképpen a vállalati vezetők meggyőzésének eszköze arra vonatkozóan, hogy nem lesz több állami mentőakció. A szerzők jóléti hatásokkal is számolnak. Azt állítják, hogy a gyors privatizációnak nagyobb a társadalmi költsége, mert az sok esetben csődökhöz és nagymértékű elbocsátásokhoz vezet, míg az állami vállalatok privatizációs ügynökségeknek való átadása kereszt támogatásokkal csökkentheti a csődök számát és a foglalkoztatás ingadozásait. A cikk arra is kitér, hogy az átmenet időszakában a vállalatvezetők érdekeltté tételének hagyományos eszközei nem feltétlenül működnek. Különböző jutalmak például elvehetik a kedvet a szerkezetváltástól, ha az átmenetileg csökkenti a profitot. Egy másik hagyományos, de az átmeneti gazdaságban óvatosan alkalmazandó eszköz a részvényopció. Bár ez a vállalat tulajdonosainak hosszú távú céljaival összhangban van, használata problémás, mert az átmeneti gazdaságban a vállalati környezet gyors és állandó változása sokkal nagyobb hatással van a részvények árfolyamának alakulására, mint a vezetők teljesítménye.

Aghion-Blanchard-Burgess [1994] modelljének elméleti elődje a bérleti szerződések ügynökproblémáit tárgyaló alapmodell. Nevezetesen az, hogy a föld vagy tartós fogyasztási eszköz bérbeadásakor a nem tökéletesen megfigyelhető ügynök nemcsak úgy tud kárt okozni, ha nem fizet, hanem úgy is, ha rossz állapotban adja vissza a jószágot. A szerzők rámutatnak arra, hogy a privatizáció előtt álló állami vállalatok vezetőinek nem érdeke a szerkezetváltás gyors megkezdése, különösen akkor, ha a privatizációval állásukat is elveszthetik. Modelljük amellett érvel, hogy ha a vezetők részesedést kapnak a privatizált vállalatból, miközben a költségvetési korlát megkeményedik, és kialakul valamiféle menedzserpiac, az állami vállalatok vezetői rávehetők a vállalati szerkezet hatékony átalakítására még a privatizáció előtt. Ebből következően a hatékonyság azonnali javítása lehetséges még a privatizáció elhúzódása esetén is. Érdekes sajátossága a modellnek az úgynevezett befolyásolási függvény bevezetése. Ha egy menedzser a szerkezetváltást választja, érdekei szembekerülhetnek a munkások érdekeivel, akik sokszor saját állásukat féltik az átstrukturálástól. A vállalaton belül különböző koalíciók keletkezhetnek a szerkezetváltás támogatására, illetve megakadályozására. Ezeknek a koalícióknak az ered-

ményessége függ a szerkezetváltás veszteségeinek és győzteseinek megoszlásától, amit a befolyásolási függvény mér. A koalíciók befolyásolási függvénnyel történő vizsgálata arra enged következtetni, hogy a struktúraváltás széles körű támogatása sem feltétlenül semlegesíti néhány, viszonylag kis csoport szerkezetváltással szembeni erős ellenállásának hatását.

Egy vállalati szerkezetváltással kapcsolatos problémát tárgyal cikkében *Roland* [1993]. Az állam a dolgozóknak végkielégítést ígérve, próbálja csökkenteni a túlfoglalkoztatást. Ennek az uniformizált összegnek azonban nem kívánt hatásai is lehetnek. A jó és hatékony munkásokat kilépésre ösztönözheti, mert ezeknek általában több lehetőségük van arra, hogy munkát találjanak a vállalaton kívül, míg a rosszabbak maradnak. Roland modellje azt a korábban már említett tételt illusztrálja, amely szerint az optimális szerződés függ a konkrét megbízó, illetve ügynök preferenciáitól, ennél fogva a mindenki számára egységes megoldás nem lehet optimális, mi több, erősen kontraszelektív hatása is lehet.

A munkások bizonytalansága a privatizáció előtt, különösen akkor, ha az jelentős szakszervezeti hatalommal párosul, a cég tőkéjének felélését eredményezheti. *Coricelli–Milesi–Ferretti* [1993] kétperiódusú modelljében minél nagyobb a valószínűsége annak, hogy a munkások státusa változik a második periódusban, annál nagyobb a tőke felélésének aránya az első periódusban. A modell azt sugallja, hogy a gyors reform, illetve privatizáció eredményességének egyik előfeltétele az, hogy az állam tulajdonosi jogait érvényesíteni tudja a privatizálás időszakában.

A nem Pareto-optimális szerződések javításának egyik lehetőségére hívja fel a figyelmet *Zou* [1992] cikke. Alkalmazotti tulajdon esetén a szerződés Pareto-optimális lehet, mert ez a tulajdonforma a szerző szerint teljesen eltüntetheti az ügynökproblémát. Nagyon hasonló ez a részesműveléssel foglalkozó közgazdászok érveléséhez: a legjobb, ha eladjuk a földet a részesművelőknek, mert akkor nem fognak rablógazdálkodást folytatni. Tegyük az ügynököket tulajdonossá, s akkor megszűnik az ügynökprobléma, mint ahogy az ügynök is megszűnik. A modell azonban ennél sokkal finomabb. A szerző tisztában van a szövetkezeti tulajdon ellen felhozott hagyományos érvekkel. Mindössze azt bizonyítja matematikailag, hogy a vezetők ellenőrzéskényszerének eltűnése jelentős megtakarításokhoz vezethet.

A hitelezéssel kapcsolatos ügynökprobléma lényege az, hogy az adós tevékenysége a hitel felvétele után (amiről a hitelezőnek nincs tökéletes információja) meghatározza a hitel visszafizetésének kockázatát. A piacgazdaságban a bankok egyik fő célkitűzése a rossz adósok, a túl kockázatos hitelek kiszűrése. Az átmeneti gazdaságban előadódó perverz gazdasági viselkedések egyikére hívja fel a figyelmet *Perotti* [1993]. E szerint, ezekben a gazdaságokban a bankoknak érdeke fűződik a rossz adósok további hitelekkel való ellátásához. Erre azért kerülhet sor, mert a még állami kézben lévő bankok futnak a pénzült után, és a további hitelektől a korábban folyósított hitelek egy részének visszafizetését remélik. Ez kiszorítja a dinamikus magánvállalkozókat a hitelpiacról, csökkenti a beruházások hatékonyságát, és lelassítja az átmenetet. Egy egyszerű kétperiódusú modellről van szó, ahol az első periódusban az összes elérhető hitelt a már eladósodott állami vállalatok kapják, míg az új magánvállalatoknak várniuk kell a második periódusig.

Coase-i hagyományokat követ *Schleifer–Vishny* [1994]. Cikkükben azt hangsúlyozzák, hogy attól, hogy a vállalat magánkézbe kerül, még lehet politikai, illetve politikusi presszió alatt. Például politikusok nagyobb mértékű foglalkoztatás fejében állami támogatást ígérhetnek. A szerzők kimutatják, hogy egy olyan rendszerben, ahol a politikusok és a vállalkozók szabadon fogadhatnak el, illetve ajánlhatnak fel csúszópénzeket, a privatizáció/kommerzializáció nem feltétlenül javítja a gazdaság hatékonyságát. A vállalkozók és a politikusok közötti alku elosztási hatékonyságot eredményez a két fél között, ami nem azonos az általános gazdasági hatékonysággal (például fenntarthatja a túlfoglal-

koztatást). Ez a következtetés összhangban van a *coase-i* elmélet legfontosabb végkövetkeztetésével, nevezetesen azzal, hogy a kontroll jogának elosztása nem befolyásolja a javak allokációját (ha tranzakciós költségektől és a jövedelemhatástól eltekintünk). Egy másik érdekes végkövetkeztetés az, hogy ha a privatizáció erős szabályozással párosul, a korrupció javíthatja a gazdaság hatékonyságát, ugyanis sokkal komolyabb erőforrás-allokációs gondok jelentkezhetnek, ha a politikai szabályozás révén magasabb foglalkoztatást érhet el, de nem kell politikailag kockázatos állami támogatással fizetnie ezért. A szerzők szerint ebben az esetben a formális politikusi igazgatás és felelősség alatt működő állami vállalat hatékonyabb lehet a magánvállalatnál. Mindazonáltal, ha az ipar nem erősen szabályozott, és a korrupció limitált, a privatizálás növeli a hatékony vállalati szerkezetváltás valószínűségét.

Nalbatian-Schotter [1994] laboratóriumi kísérleteket végeztek a teljesítmény-visszatartás tanulhatóságával kapcsolatban. A kísérleti alanyok egy csoportja először szocialista típusú, majd később kapitalista ösztönzési rendszert imitáló kísérletben vett részt. Más csoportok számára azonnal kapitalista jellegű ösztönzési rendszert vezettek be. Az ösztönzési rendszerek tervezésekor a szerzők figyelembe vették a kísérleti alanyok preferenciáit, és konkrét haszonfüggvényeket használva számolták ki az optimális ajánlatokat. A kísérletek eredményei azt mutatták, hogy a szocialista javadalmazáshoz szokott és ott szisztematikusan alacsony erő kifejtést választó csoport továbbvitte ezt a normát, és határozottan alacsonyabb teljesítményt mutatott, mint a kontrollcsoport. *Schotter* [1993] ebből azt a következtetést vonta le, hogy az egyébként optimális ösztönzési rendszerek sem feltétlenül hatékonyak, ha nem létezik a szorgalmas munkára vonatkozó csoportnorma, és ha nem lehet bízni abban, hogy mások is tartják magukat ehhez a normához. A csoport története számít, ezért – *Schotter* szerint – a nyugati ösztönzési mechanizmusok kevésbé lesznek hatékonyak a volt szocialista országokban.

*

Előadásomban tíz, az átmeneti gazdaság ügynökproblémáival foglalkozó modellt tekintettem át. A cikkek matematikailag jól definiált környezetben és szereplőkkel írnak le privatizálással, hitelezéssel, szakszervezeti és politikusi befolyással, szövetkezeti tulajdonnal és régi beidegződések továbbélésével kapcsolatos ügynökproblémákat. Amint az a korábbi ismertetésből kitűnt, a szerzők a gazdaságelméletnek a piacgazdaság, illetve az általános ügynökprobléma leírására kifejlesztett és ott jól bevált fogalmait és megközelítését használják az átmeneti gazdaság ügynökproblémáinak elemzésére. Az európai volt szocialista országok gazdasága kétségkívül a piacgazdaság felé halad. Nagyon valószínű, hogy a transzformáció utáni gazdaságot leíró elmélet többnyire formális, az általános gazdaságelmélettel összhangban lévő modellek segítségével fogja analizálni az itt felmerülő kérdéseket. Az itt bemutatott írások eredményei azt igazolják, hogy a modellszerű megközelítés már az átmeneti gazdaság elemzésekor is jól alkalmazható.

A modellszerű megközelítésnek vannak bizonyos korlátai. A formális modellek voltaképpen tantörténetek, melyekben a tanulság az előfeltevésekből matematikailag levezethető. A modellek előfeltevései viszont szükségszerűen leegyszerűsítőek, és sokszor hiányosak, ami a eredmények általánosíthatóságát korlátozza. Ráadásul a előadás parciális egyensúlyi modelleket tárgyalt, amelyek nem vizsgálják a megbízó, illetve az ügynök akcióinak többszörösen tovaggyűrűző hatását. Már az itt felsorolt okok miatt is sokszor kétségesnek tűnik a modellek következtetéseinek gazdaságpolitikai alkalmazhatósága.

Mégis, minden fogyatékosságuk ellenére, nagyon fontos lenne, hogy minél több formális modell szülessen az átmeneti gazdaságról. A jó formális modell tömör, áttetsző, és tudományos rangra emelheti még a legismertebb, legközhelyszerűbb állítást is, mert egy

átlátható helyzet logikus következményeként ábrázolva kézzelfoghatóvá, ellenőrizhetővé teszi, és pontosítja azt. Ezt tették az itt említett cikkek szerzői is, amikor modelljeik segítségével pontos és ellenőrizhető megállapításokkal éltek az átmeneti gazdaság egy fontos problémájával, az ügynökproblémával kapcsolatban. Teljesítményük azonban nemcsak ezért jelentős, hanem azért is, mert modelljeik építőelemeivé válhatnak az átmeneti gazdaság átfogóbb, valóságosabb, és ezért még hasznosabb modelljeinek.

Hivatkozások

- AGHION, PH.–BLANCHARD, O.–BURGESS, R. [1994]: The behaviour of state firms in eastern Europe pre-privatisation. *European Economic Review*, 38, 6, június, 1327–1349. o.
- CORICELLI, F.–MILESI-FERRETTI, G. M. [1993]: On the credibility of 'big bang' programs: A note on wage claims and soft budget constraints in economies of transition. *European Economic Review*, 37, 387–395. o.
- DEMOUGIN, D.–SINN, H.-W. [1994]: Privatization, risk taking, and the communist firm. *Journal of Public Economics*, 55, 2, október, 203–231. o.
- ELLMAN, M. [1994]: Transformation, Depression, and Economics: Some Lessons. *Journal of Comparative Economics*, 19, augusztus, 1–21. o.
- FRYDMAN, R.–RAPACZYNSKI, A. [1993]: Insiders and the state: overview of responses to agency problems in East European privatizations. *Economics of Transition*, Vol. 1, No. 1, január, 39–59. o.
- GOMULKA, S. [1995]: The IMF-Supported Programs of Poland and Russia, 1990–1994: Principles, Errors, and Results. *Journal of Comparative Economics*, 20, 3, 316–346. o.
- KATZ, B.–OWEN, J. [1995]: Designing an Optimal privatization Plan for Restructuring Firms and Industries in Transition. *Journal of Comparative Economics*, 21, augusztus, 1–28. o.
- KREPS, D. M. [1990]: *A Course in Microeconomic Theory*. Princeton University Press.
- MILGROM, P. – ROBERTS, J. [1992]: *Economics, Organization, and Management*. Prentice Hall.
- [1994]: Productivity Under Group Incentives: An Experimental Study. *Economic Research Reports*, RR#94-04, C. V. Starr Center for Applied Economics, New York University, február.
- PEROTTI, E.C. [1993]: Bank lending in transition economies. *Journal of Banking and Finance*, 17, 5, szeptember, 1021–1032. o.
- PORTES, R. [1994]: Transformation traps. *The Economic Journal*, 104, 426, szeptember, 1178–1189. o.
- RODLAUER, M. [1995]: The Experience with IMF-Supported Reform Programs in Central and Eastern Europe. *Journal of Comparative Economics*, 20, 1, február, 95–115. o.
- ROLAND, G. [1993]: The political economy of restructuring and privatization in eastern Europe. *European Economic Review*, 37, 2–3, április, 533–540. o.
- SCHLEIFER, A.–VISHNY, R. W. [1994]: Politicians and Firms. *The Quarterly Journal of Economics*, 109, 4, november, 995–1025. o.
- SCHMIDT, K. M.–SCHNITZER, M. [1993]: Privatization and Management Incentives in the Transition Period in Eastern Europe. *Journal of Comparative Economics*, 17, 2, június, 264–287. o.
- SCHOTTER, A. [1993]: The Transition from Socialism to Capitalism Can Be Complicated in the Laboratory. *C. V. Starr Newsletter*, Vol. 11., 18–20. o.
- ZOU, L. [1992]: Ownership Structure and Efficiency: An Incentive Mechanism Approach. *Journal of Comparative Economics*, 16, 3, szeptember, 399–431. o.

Simonovits András

A magyar matematikai közgazdaságtan múltja, jelene és jövője

Ebben a rövid cikkben a magyar matematikai közgazdaságtan fejlődésével foglalkozom az ún. átmeneti időszakban, a múltból indulva és a jövőbe tekintve. Az áttekintés szükségképpen hiányos, igyekszem csak olyan művekre utalni, amelyeknek külföldön is volt visszhangja. Saját élményeimet lábjegyzetekbe szorítom. A teljesség igénye nélkül kiemelek néhány kutatási területet (és zárójelben ábécérendben egy-két kutatót), amelyeken (akik) nemzetközi mértékkel mérve is sikeresen szerepeltünk(ek), illetve siker várható a jövőben. Távirati stílusban igyekszem a teljesítményre is utalni. A cikk végén válogatott irodalomjegyzék szerepel. (Az ökonometriától és az operációkutatástól eltekintek, az ökonometria elemzésével Kőrösi Gábor – e rovatban is szereplő – cikke foglalkozik.)

A múlt

Az SZKP XX. kongresszusa után a többi szocialista ország közgazdászaihoz képest a magyar (s időnként a cseh és lengyel) közgazdászok viszonylag könnyű helyzetben voltak: többé-kevésbé szabadon olvashattak, beszélhettek, írhattak, publikálhattak. (Természetesen e szabadság viszonylagos volt, de mégis szabadság volt.) Ez a szabadság előnyösen hatott a magyar matematikai közgazdászokra is. Nem kellett értelmetlen, adatokkal kitölthetetlen „alkalmazásokkal” bajlódniuk, és nem kellett feleslegesen absztrakt modellekbe bújniuk. Nem véletlen, hogy a magyar matematikai közgazdaságtan a hatvanas évek elejétől kezdve mindvégig kitüntetett figyelmet kapott a szocialista és a többi ország kutatói részéről.

Röviden a sikertörténetekről.

a) *Tervezési modellek* (Augusztinovics Mária, Bod Péter, Gács János, Kondor György, Kornai János, Lackó Mária, Lipták Tamás, Simon György). Sokáig úgy tűnt, hogy a szocialista országokban folyó tervezést gyorsabbá és hatékonyabbá lehet tenni, ha a központi tervezésben matematikai modelleket alkalmazunk. A hatvanas évek elején világméretben is kiemelkedett Kornai János és Lipták Tamás kétszintű tervezési módszere, amely a központ és az ágazatok közti párbeszédet próbálta modellbe önteni. (Érdekes, hogy ez a megközelítés a ma is uralkodó neoklasszikus elméletbe tökéletesen illeszkedett, de maga az átfogó tervezés korszerűtlenné vált.) A hetvenes években a hosszú távú tervezés problémáit modellezte Augusztinovics Mária és csoportja. Nem ők tehetnek róla, hogy magát a feltételezett rendszert elsodorta az idő. Gács János és Lackó Mária pedig magát a tervezők munkáját foglalta modellbe.

b) *Input-output elemzés* (Augusztinovics Mária, Bródy András, Halpern László, Molnár György, Simonovits András és Zalai Ernő). Az ágazati kapcsolatok mérlege (ÁKM) ideális eszköznek bizonyult a központi tervgazdálkodást folytató országok számára (Augusztinovics Mária). Én a sztochasztikus Leontief-inverz alábecslését tanulmányoztam. Érdekes módon a marxi elmélet matematizálásában is alapvető szerepet játszott az ÁKM (Bródy András és Zalai Ernő). De még a tervgazdaság hanyatlásakor és bukásakor is érdekes elemzési keretnek bizonyult Halpern László és Molnár György kezében. Itt említtem meg Medvegyev Péter Neumann-gazdaságról szóló eredményét is.

c) *Szabályozási modellek* (Bródy András, Kornai János, Martos Béla, Simonovits András, Tarján Tamás és Tényi György). A hetvenes évek elején világszerte feléledt az érdeklődés a matematikai szabályozásmélet közgazdasági felhasználhatósága iránt. Míg a legtöbb nyugati közgazdász az optimális szabályozás elméletét alkalmazta, mi a hagyományos stabilitásmélettel próbálkoztunk. (Az egyetlen kivétel a már akkor optimalizáló Virág Ildikó és az ehhez kapcsolódó kutatás volt.) Kornai János *Anti-Equilibrium*a kéréstében igazoltuk, hogy az ár- és tervezési mechanizmus mellett az ún. vegetatív szabályozási mechanizmus is hozzájárult a gazdasági rendszer működtetéséhez. A nyolcvanas években a kutatás kiterjedt a nemlineáris szabályozásokra is (ciklus és káosz).

d) *A hiány makroökonómiaja* (Kornai János, Lackó Mária és Simon András). Ismert, hogy a szocialista gazdaság egyik alapvető gondja a hiány volt. Kornai alapvető munkássága mellett Lackó Mária és Simon András több elméleti és gyakorlati modellt szerkesztett a hiány és a gazdaság egészének kapcsolatáról.

e) *Játékelmélet* (Forgó Ferenc, Szép Jenő, Szidarovszky Ferenc). A szóban forgó kutatók egyrészt a kooperatív játékelmélet általánosítására, másrészt az ún. oligopóliumelmélet speciális kérdéseinek tisztázására törekedtek.

f) *Készletezési modellek* (Chikán Attila és munkatársai). A hagyományos operációkutatási témától Chikán Attila gyorsan eljutott a közgazdasági témához. Külön említésre méltó, hogy a Nemzetközi Készletgazdálkodási Társaság létrehozásával és a kétévenkénti budapesti konferenciák megszervezésével Magyarország ezen a területen is Kelet és Nyugat találkozási pontjává vált.¹

A felsorolt területeken nemcsak fölzárkóztunk a nemzetközi szinthez, hanem adottságainkat kihasználva sikerült az élvonalba kerülni.

Teljesítményünk értékeléséhez figyelembe kell venni, hogy bármely kis ország bármely tudományága szükségképpen egyoldalú, hiszen csak így tudja elérni a sikerhez elengedhetetlen koncentrációt. (Például a jelenkori magyar matematika egyik sikerterülete a kombinatorika, ugyanakkor vannak a matematikának fontos területei, ahol a magyar matematikusok egyáltalán nincsenek jelen. Hasonlóan a nemzetközileg ismert izraeli közgazdászok zöme játékelmélettel foglalkozik.)

Mindezt elfogadva, kritikusan rá kell mutatnunk, hogy alapvető területek maradtak ki a magyar kutatók tevékenységéből (a tankönyvírást nem számítom kutatásnak). Ez az – ún. főáramtól való – távolmaradás annak idején több szempontból is érthető volt. Egyrészt nehéz lett volna hozzászólnunk a munkanélküliség és az infláció kérdéseihöz egy olyan világban élve, ahol teljes foglalkoztatottság és árstabilitás uralkodott. Másrészt intézményesen is el voltunk vágva a művelt Nyugattól. Ugyanakkor a saját utak erőltetése azzal járt, hogy egyre inkább elszakadtunk a dolgok alakulásától és bizonyos fokig képtelenné váltunk a megújulásra.

A jelen

A szocializmus 1989-es összeomlása legtöbbünket váratlanul ért.² Nem csoda, hogy a „szocializmuspecifikus” kutatók szinte légüres térbe kerültek(ünk). Legtöbbünknek azonban sikerült néhány év alatt lezárnia tárgyát vesztett kutatását, és időszerű témákat választani.

Szerencsére a nyolcvanas évektől kezdve az egyetemi oktatás is megújult. Diákjaink

¹ Én is számos ismeretséget, barátságot és meghívást köszönhetek ennek a ma is élő intézménynek.

² Saját példámnál maradva: éppen ekkor kezdtem el a szocialista gazdaság növekedési és ciklusproblémáiról publikálni.

tanrendje egyre jobban hasonlít a nyugati egyetemekére, bár az oktatóknak még nem minden esetben sikerült ilyen gyorsan váltani. Az egyetemről kikerült diákok legjobbjai vezető európai és főként amerikai egyetemekre mentek és mennek doktori fokozatot szerezni. Megindult a hazai doktori képzés is, ahol szintén jó képességű diákokkal találkozhatunk. Öröndetes módon megjelentek az első fecskék, akik a közgazdaságtani főáramlat nyelvét anyanyelvi szinten beszélik.

A rendszerváltással egy időben Magyarország elvesztette azt az előnyét, amelyet korábban a „testvérorságokhoz” képest élvezett kutatási és publikálási szabadság jelentett. A nemzetközi verseny szempontjából külön ki kell emelni, hogy Csehország két új nemzetközi közgazdasági központot hozott létre, a CEU közgazdasági tanszékét és a CERGET. A Collegium Budapest létrehozása sem lebecsülendő esemény, s a CEU közgazdasági tanszékének Prágából való eltávolítása talán Magyarország felé billenti a mérleg nyelvét. Fájdalmas lemaradás, hogy az átalakuláskutatás nemzetközileg jegyzett eseményein alig vagyunk jelen. Érdekes kontrasztot ad az orosz matematikai közgazdászok egyre sikerebb szereplése. Ők többnyire annyira absztrakt témákkal foglalkoznak, amelyeket még a rendszerváltás sem érintett, viszont megnyílt előttük a nemzetközi közlési és utazási piac.

A megújuló hazai kutatások közül a következő területeket emelném ki.

a) *Játékelmélet* (Vincze János és tanítványai: Bárczy Péter, Eső Péter, Lóránth Gyöngyi, Rátfai Attila, Váradi Balázs stb). Vincze János a Budapesti Közgazdaságtudományi Egyetemen évek óta a hallgatók legjobbjaival sajátíttatja el a főáramba bekerülő nem-kooperatív játékelmélet elemeit. A legjobb nyugati egyetemeken tanuló, lassan hazatérő vagy hazalátogató hallgatók is publikációkkal tanúsítják érettségüket.

b) *Nyugdíjrendszerek makroökonómiája* (Augusztinovics Mária, Bod Péter, Martos Béla, Réti János és Simonovits András). A lakosság világszerte tapasztalható öregedése és a téma elméleti érdekessége miatt ma az egyik legkutatottabb terület az együttélő nemzedékek modellezése. Ezzel a témával már a régi rendszerben is foglalkozhattunk volna, azonban mindnyájan elaludtunk. Több mint tíz éve, hogy Augusztinovics Mária „bedolgozta” magát e témakörbe, és másokat is megfertőzött a téma szeretetével. Az elméleti és gyakorlati eredmények itt példás összhangban állnak egymással.

c) *Modern makroökonómia* (Valentinyi Ákos). A Kopint–Datorghban folyó, a kamara hasznával foglalkozó hagyományos modellektől Valentinyi Ákos nagyon hamar jutott el az endogén növekedésmélet és a kollektív cselekvési modellek elemzéséhez. Igaz, ehhez a firenzei Európa Egyetemre kellett mennie.

Az utóbbi időben a verbális és a matematikai közgazdaságtan közeledése itthon is új lendületet kapott. Munkatudományi tanulmányok (Galasi Péter, Kertesi Gábor, Köllő János és mások) egyre inkább fölhasználják a matematikai közgazdaságtan és az ökonometria eredményeit.

Mielőtt bárki azt hinné, hogy elégedett vagyok a jelenlegi helyzettel, hadd adjak hangot véleményemnek: mind a konferenciák, mind a nemzetközi publikációk tekintetében rosszabb a helyzet, mint tíz-húsz évvel korábban volt.³ Talán az alkalmazott kutatások terén nem állnak olyan rosszul a dolgok, mint az elméleti kutatásoknál. Lehet, hogy kevésbé rangos konferenciákon jelentősebb a hazai és a szomszédos országokból való részvétel.

³ Itt számolok be egy frissen szerzett szomorú tapasztalatomról. Nemrég tértem vissza a Nemzetközi Ökonometriai Társaság 7. tokiói világkonferenciájáról. Az 1200 résztvevőből négy orosz, négy lengyel és egy magyar képviselte a hajdani szocialista országok matematikai közgazdászait. A meghívott előadók közül egy sem volt „átmeneti” ország állampolgára. Ki emlékszik már azokra a boldog időkre, amikor tucatnyi magyar matematikai közgazdász volt (többé-kevésbé) jelen az ilyen találkozókön? Csupán a Kínai Népköztársaság Nyugatra szakadt polgárai jelentettek üde színfoltot.

A jövő

A múltat (1956-tól számítva) mintegy 35 évnek vettük, az átmenet eddig megtett szakasza öt évet tett ki. Meddig tart ez az átmenet, és mi lesz a jövő? Első közelítésként azt mondhatjuk, hogy akkor zárul le az átmenet, ha „nyugati szintre” kerül a magyar matematikai közgazdaságtan.

Paradox módon nincs egységes nyugati szint. Más Amerika, és más Nyugat-Európa. A nyugat-európai egyetemek kutatói régi életmódjuktól elszakadva, tartanak az amerikai stílus felé. E folyamat jó oldala az, hogy gyöngül a provincializmus, erősödik az kutatók ösztönzése, megkezdődik az oktatáshoz kapcsolódó Ph.D. képzés. De nem szabad megelégedezni az amerikanizálódás árnyoldaláról sem: túlzott teret nyer az öncélú kutatás, az absztrakt elmélet, ahol a modell az elsődleges, a valóság a másodlagos.⁴

Mivel az amerikai közgazdaságtan hamarosan uralkodóvá válik hazánkban is, talán nem árt néhány figyelmeztető megjegyzés.

a) Háttérbe szorul a tudomány és a valóság viszonya. *Debreu* [1991] nyíltan kimondta: a közgazdaságtudományban a hiányzó tapasztalatot a logikai szigorunk kell pótolnia. Jellemző, hogy a legtöbb elméleti közgazdász – fizikustársaiktól eltérően – inkább a „boríték hátán számol”, mintsem bekapcsoljon egy számítógépet.

b) Való igaz, hogy a neoklasszikus főáram újra fénykorát éli. Sokak szerint ma már minden „magára valamit adó közgazdásznak” (*Azariades* [1993] 4. o.) egyéni optimalizálásból kell levezetni a társadalmi gazdaság modelljeit. Szinte védekező állásba szorulanak azok az amerikai közgazdászok, akik – jobb híján – mernek nem optimalizálni (*Blanchard–Fischer* [1989] 28. o.).⁵

c) Az utóbbi évtizedek egyik legnagyobb vívmányának a makroökonómia mikroökonómiai megalapozását tekintik. Furcsa módon általában egyetlen egy optimalizáló reprezentatív fogyasztóval vagy termelővel írják le az egész gazdaság működését. *Kirman* [1992] szellemesen mutat rá, hogy a „reprezentatív fogyasztó” gyakran senkit sem képvisel. *Hildenbrand* [1983] meggyőzően bizonyítja, hogy a társadalmi keresleti ár függvényének csökkenő volta nem annyira az egyes fogyasztók agyafúrt optimalizálásából, mint inkább a fogyasztók inhomogenitásából fakad.

d) Az optimalizálás mellett egyenrangú társként megjelent a racionális várakozások hipotézise. (Az első magyar nyelvű ismertetését *Király* [1985] adta.) Ma már ott tartunk, hogy egy világhírű kutató négy szemközt bevallja, hogy muszáj a racionális várakozás hipotézisét alkalmaznia, ha publikálni akar. Még szerencse, hogy időnként megjelenhetnek írások, amelyek rámutatnak e feltevés empirikus és elméleti gyöngéire (*Lovell* [1986]).

Szerencsére a legjobb neoklasszikus elmék maguk is tiltakoznak az uniformizálás ellen. Arrow nemcsak Kornai Anti-Equilibriuma elé írt előszót, de döntő szerepet játszott a komplexitással foglalkozó Santa Fé-i intézet megalapításánál is. Másokkal együtt *Debreu* [1974] maga mutatott rá, hogy az egyéni optimalizálás egyáltalán nem szűkíti le a társadalmi túlkeresleti függvények tartományát.

Ne legyünk igénytelenek! A vulgármarxizmus helyére ne telepítsünk vulgáris egyenúlyelméletet! Egy dolgozat elbírálásakor ne aszerint ítéljünk, hogy optimalizáláson és

⁴ Megint saját új kutatási területemről hozok példát. A nyugdíjrendszerek elemzésénél úgy-ahogy bevált együttélő nemzedékek modelljét olyan területekre is alkalmazzák, ahol garantáltan alkalmazhatatlan. (Például egy neves francia szerző a bérindexálás alapidőszakát ugyanúgy 25-30 évre teszi, mint egy nemzedék megöregedését.)

⁵ Amikor nemzetközi hírű holland társszerzőimmel beadtuk a szocialista gazdaság beruházási ciklusaival és kaotikus viselkedésével foglalkozó cikkünket, a lektor és a bírálók egyetlen lényegi aggálya az volt: hol az optimalizáló ügynök?

racionális várakozáson alapul-e! Végül is még tudományosan nem bizonyított, hogy más út nem lehetséges.

Világszerte meg kellene változnia a matematikai közgazdaságtan és a többi terület viszonyának is. Egyrészt a matematikai közgazdaságtannak az eddiginél sokkal jobban figyelembe kellene vennie a verbális közgazdaságtan és az ökonometria eredményeit. Másrészt a verbális közgazdászoknak is el kell sajátítaniuk a legfontosabb matematikai módszereket. Hadd említsem meg a következő esetet! Valamikor nagyon régen megkérdezték Samuelson-t, hogy miért *matematikai* közgazdaságtannal foglalkozik. „Mert a *verbális* közgazdaságtan túl nehéz volt nekem.” De ez már meghaladja az előadás kereteit.

A hazai felzárkózásnak sok akadálya van, itt csak néhány, fontosabbat említek. *a)* Nincs pénz, hogy neves külföldi professzorokat hívjunk meg rövidebb vagy hosszabb időre tanítani. *b)* Nyelvi elszigeteltségünk taszítóan hat. *c)* Nincs kutatási hagyomány a főáram területén. *d)* Nincs intézményesen megoldva, hogy az ilyen-olyan okból, friss Ph.D. oklevéllel hazatérő, kiemelkedő képességű és képzettségű hallgatókat a közgazdasági egyetemeken vezető állással várják. Ezek az akadályok különösen szembetűnővé válnak, ha más felzárkózó országgal, például Ausztriával vetjük össze a helyzetünket.

Van egy álmom. Tíz-húsz év múlva a „hazai és külföldi” magyar matematikai közgazdászok a sokáig utánunk kullogó osztrákokhoz hasonló számban vesznek részt a nemzetközi találkozókön, és hasonló mennyiségű-minőségű rangos publikációval szerepelnek a nemzetközi folyóiratok hasábjain. – De szép is lenne!

Válogatott irodalom

- ANDERSON, P. W., ARROW, K. J. és PINES, D. (szerk.) [1988]: The Economy as an Evolving Complex System. Redwood City, CA, Addison-Wesley.
- AUGUSZTINOVICS MÁRIA (szerk.) [1979]: Népgazdasági modellek a távlati tervezésben. Közgazdasági és Jogi Könyvkiadó, Budapest.
- AUGUSZTINOVICS MÁRIA [1983]: Emberek és gazdaságok. Közgazdasági Szemle, 385–402. o.
- AZARIADIS, C. [1993]: Intertemporal Macroeconomics. Blackwell, Oxford.
- ÁBEL, I. [1979]: Érték és gazdasági dinamika. Szigma, 1–13. o.
- BLANCHARD, O. J.–FISCHER, S. [1989]: Lectures on Macroeconomics, MTI Press, Cambridge, MA.
- BOD PÉTER [1992]: Mennyibe kerül egy társadalombiztosítási nyugdíjrendszer működtetése? I. Biztosítástechnikai alapfogalmak, II. A finanszírozási típusokról. Közgazdasági Szemle, 123–145. és 244–261. o.
- BRÓDY, A. [1964]: Az ágazati kapcsolatok modelljei. Közgazdasági és Jogi Könyvkiadó, Budapest.
- BRÓDY, A. [1969]: Érték és újratermelés. Közgazdasági és Jogi Könyvkiadó, Budapest.
- CHIKÁN ATTILA–FÁBRI ERNŐ–NAGY MÁRTA [1978]: Készletek a gazdaságban. Közgazdasági és Jogi Könyvkiadó, Budapest.
- DEBREU, G. [1974]: Excess Demand Functions. Journal of Mathematical Economics, 1, 15–22. o.
- DEBREU, G. [1991]: Mathematization of Economic Theory American Economic Review, 81, 1–7. o.
- ESŐ PÉTER [1996]: Optimal Trading Mechanism in Procurement. Discussion Paper, CENTER, Tilburg.
- HILDENBRAND, W. [1983]: On the Law of Demand. Econometrica, 51, 997–1019. o.
- GÁCS JÁNOS–LACKÓ MÁRIA [1974]: A népgazdasági szintű tervezési magatartás vizsgálata. Közgazdasági Szemle, 257–274. o.
- HALPERN LÁSZLÓ–MOLNÁR GYÖRGY [1994]: Egyensúly és egyensúlytalanság egy dezaggregált klasszikus modellben. Megjelent: Miért hagytuk, hogy így legyen? Tanulmányok Bródy Andrásnak (szerk.: Madarász Aladár–Szabó Judit). Közgazdasági és Jogi Könyvkiadó, Budapest, 53–65. o.

- HOMMES, C. H.–NUSSE, H. E.–SIMONOVITS A. [1995]: Cycles and Chaos in a Socialist Economy. *Journal of Economic Dynamics and Control*, 19, 155–179. o.
- KIRÁLY JÚLIA [1985]: Racionális várakozások és az új klasszikus makroökonómia. *Közgazdasági Szemle*, 257–267. o.
- KIRMAN, A. [1992]: Whom or What Does the Representative Individual Represent? *Journal of Economic Perspectives*, 6, 117–136. o.
- KOOPMANS, T. [1957]: *Three Essays on the Present State of Economic Science*. McGraw-Hill. New York.
- KORNAI JÁNOS [1966]: *Strukturális döntések matematikai tervezése*. Akadémiai Kiadó, Budapest (2. kiadás :1973).
- KORNAI JÁNOS [1971]: *Anti-Equilibrium*. Akadémiai Kiadó, Budapest.
- KORNAI JÁNOS [1980]: *A hiány*. Közgazdasági és Jogi Könyvkiadó, Budapest.
- KORNAI JÁNOS [1982]: *Növekedés, hiány és hatékonyság*. Közgazdasági és Jogi Könyvkiadó, Budapest.
- KORNAI JÁNOS–MARTOS BÉLA (szerk.) [1981]: *Szabályozás árjelzések nélkül*. Akadémiai Kiadó, Budapest.
- LACKÓ MÁRIA [1980]: Feszültségek felhalmozása és leépítése. *Közgazdasági Szemle*, 24–40. o.
- LOVELL, M. C. [1986]: Tests of Rational Expectations Hypotheses. *American Economic Review*, 76, 110–124. o.
- MARTOS BÉLA [1990]: *Economic Control Structures*. North Holland, Amszterdam.
- MEDVEGYEV PÉTER [1982]: A Neumann-modell Morishima féle általánosításáról. *Sigma*, 261–272. o.
- SIMON ANDRÁS [1981]: A magyarországi beruházások ciklikusságának egy modellje. *Közgazdasági Szemle*, 293–302. o.
- SIMON GYÖRGY–KONDOR GYÖRGY [1965]: Gazdasági hatékonyság, árnyékárak. *Közgazdasági és Jogi Könyvkiadó*, Budapest.
- SIMONOVITS ANDRÁS [1973]: A Leontief-inverz alá- és fölébecslésének egyik okáról. *Sigma*, 309–315. o.
- SIMONOVITS ANDRÁS [1983]: Ütközőkészletek és naiv várakozások egy nem-walrasi dinamikus makromodellben: stabilitás, ciklus és káosz. *Sigma*, 15–30. o.
- SZIDAROVSKY FERENC [1977]: A nem-differenciálható oligopol probléma. *Sigma*, 69–74. o.
- SZÉP JENŐ–FORGÓ FERENC [1973]: *Bevezetés a játékelméletbe*. Közgazdasági és Jogi Könyvkiadó, Budapest.
- TARJÁN TAMÁS–TÉNYI GYÖRGY [1977]: Kísérlet a beruházási folyamat modellezésére. *Sigma*, 11–24. o.
- VALENTINYI ÁKOS [1995]: Pénzügyi növekedés, infláció és gazdasági növekedés. *Közgazdasági Szemle*, 838–859. o.
- VINCZE JÁNOS [1991]: Fejezetek az információ közgazdaságtanából: I. A morális kockázat, II. A kontraszelekció, III. Morális kockázat és kontraszelekció az időben. *Közgazdasági Szemle*, 134–152. o., 289–306. o. és 435–445. o.
- VIRÁG ILDIKÓ [1969]: *Optimális felhalmozási pályák, Gazdasági fejlődés és tervezés*. Közgazdasági és Jogi Könyvkiadó, Budapest, 108–136. o.
- ZALAI ERNŐ [1989]: *Bevezetés a matematikai közgazdaságtanba*. Közgazdasági és Jogi Könyvkiadó, Budapest.

Kőrösi Gábor

Az átalakulás ökonometriája, avagy az ökonometria átalakulása

Ha egy mondatban kellene válaszolni arra, mi is történt a magyar ökonometriai kutatással a rendszerváltás következtében, akkor a válasz: lényegében megszűnt, most kezd valamennyire újrászerveződni. Adódik triviális magyarázat is: a strukturális stabilitás hiánya és a statisztikai információs rendszer szétesése lehetetlenné tette az (alkalmazott) ökonometriai kutatást, a hagyományos megrendelők (például az Országos Tervhivatal) megszűnése pedig a piacát szüntette meg. A helyzet azonban ennél egy kicsit bonyolultabb.

Két szocialista országban folyt viszonylag komoly ökonometriai kutatás: Lengyelországban és Magyarországon. Nyilván nem véletlen, hogy pont ezekben; összefügg a gazdasági reformkísérletekkel, a többenél nyitottabb társadalommal és tudományos közélettel. Fontos különbségek voltak és vannak azonban a két ország ökonometriai kutatásában. Úgy gondolom, ezek a különbségek segíthetnek megérteni, mi is történt, történik Magyarországon. Nem szándékozom ugyanolyan mélységben elemezni a lengyel helyzetet, mint a magyart – azt lényegesen kevésbé ismerem –, de utalok olyan különbségekre, amelyek segítenek megérteni a magyar helyzet sajátosságait. Az egyik fontos különbség: Annak ellenére, hogy Lengyelországban is fennálltak a fenti okok, az ökonometriai kutatás mégsem került olyan súlyos válságba, mint Magyarországon.

Az ökonometriai kutatással történtek nem lennének érthetőek az előzmények ismerete nélkül. Magyarországon az ökonometriai kutatás mindig is viszonylag szűk bázisra épült, és súlyos visszaesésekkel terhes ciklikus pályán fejlődött. Ennek több oka is volt.

A viszonylag szűk bázis első fontos oka az ökonometria oktatásában található. Ökonometriát hagyományosan két egyetem oktat: a Budapesti Közgazdaságtudományi Egyetem (az egykori MKKE) és a Pécsi Tudományegyetem. Különböző okokból, de mindkét egyetem csak nagyon kevés olyan szakembert képzett, aki többé-kevésbé jól ismeri és használni is képes az ökonometriai módszereket.

A budapesti egyetemen lényegében minden makrogazdász hallgató tanult ökonometriát, ami önmagában egyáltalán nem elhanyagolható kör: a kutató vagy gazdaságpolitikát alakító közgazdászok többségét jelenti. Sajnos azonban egy elhibázott koncepció alapján¹ egy, a hetvenes évek végére lényegében elavult tananyagot tanítottak a nyolcvanas évek végéig. Az egyetemi oktatás a hallgatók túlnyomó része számára riasztóan bonyolult, érthetetlen misztikumká tette az ökonometriát, amitől többnyire később is igyekeztek távoltartani magukat. Rendszeresen volt néhány diák, akit lekötött a teljesen módszertani megközelítésű oktatás, de ők voltak a kivételek. Az empirikus ökonometriával foglalkozók jelentős része annak ellenére autodidaktának volt tekinthető, hogy tanult ökonometriát az egyetemen.

¹ Az ökonometriát tiszta módszertanként, a lehető legáltalánosabb statisztikai modellből kiindulva, a gyakorlati alkalmazásoktól teljesen elszakítva oktatták. Az ökonometriaelmélet az absztrakció olyan magas szintjén mozgott, hogy nem épülhetett fel a híd az alkalmazások és az elmélet között. Csak a tisztán módszertani érdeklődésű diákok profitáltak belőle, az oktatás érdemben nem kapcsolódott az empirikus közgazdaságtanhoz.

A kilencvenes évek hoztak változást: az egyetemi reformok következtében a korábbinál sokkal szűkebb kör tanul megváltozott, modernebb és az alkalmazáshoz közelebbi ökonometriát. A problémák ma inkább abból adódnak, hogy az egyetemen az ökonometriával valamilyen szinten foglalkozók négy-öt tanszékén szétszórva, jórészt egymástól elszigetelve dolgoznak, oktatnak, és mindössze egyikük oktat ökonometriát „főállásban”. A budapesti egyetemen nem tudott (és most sem tud) kialakulni egy ökonometriai műhely. Az egyetemi oktatás jelenleg sem képi sem az ökonometriát legalább olvasni, értelmezni tudó közgazdászok szélesebb, sem az azt eszközként is megbízhatóan használók szűkebb, de nem elhanyagolható körét.

Pécsett a helyzet merőben más volt. Az eleve sokkal kisebb hallgatói kört szükségszerűen sokkal inkább a vállalatgazdaságtan felé irányították. Az ökonometria csak egy nagyon szűk kört érintett. A tananyaggal voltak ugyan szakmai problémák, de korszerűbb, és főleg sokkal alkalmazásorientáltabb volt, mint a budapesti egyetemen. Ennek következtében rendszeresen voltak hallgatóik, akik az ökonometria használóivá váltak. Bizonyos értelemben sokkal inkább volt (és van) élő ökonometriai műhely Pécsen, mint a budapesti egyetemen, de az alacsony létszám, a sajátos magyar viszonyok (Budapest-központúság) és bizonyos szakmai problémák miatt hatása mindvégig marginális maradt.

Magyarországon az ökonometriai kutatás zöme nem az egyetemeken zajlott. Érdemes ezt a helyzetet egybevetni a lengyelországgal. Varsóban ugyan lényegében a budapestihez hasonló volt az ökonometria oktatásának és egyetemi kutatásának a jelentősége. De a kiemelkedően legfontosabb, nemzetközileg is (el)ismert lengyel kutatási központ a łódzi egyetem ökonometriai tanszéke, és több más egyetemen is folyt ökonometriai kutatás (megemlítendő még Gdansk). Lengyelországban kevés kivétellel az egyetemek az ökonometriai kutatás bázisai.

Annak, hogy Magyarországon nem az egyetemek váltak az ökonometriai kutatás központjaivá, a szakember-utánpótláson messze túlmutató következményei vannak. Az első, hogy az egyetem stabil intézményi háttérrel adhatott volna. Magyarországon az ökonometriai kutatás jelentős részben azért nyújtott hullámzó teljesítményt, mert a kutatók nem érezték magukat egzisztenciális biztonságban. Amikor a KSH elnöke úgy gondolta, hogy egy statisztikai hivatalnak a modern gazdaságelemzési módszerekkel foglalkozó részlegre is szüksége van, létrejött a hatvanas években egy prosperáló ökonometriai műhely. Amikor a következő elnök ezt feleslegesnek nyilvánította, megszűnt a KSH Ökonometriai Laboratóriuma. Hasonló ciklusokhoz vezettek a Tervhivatal vagy a Tervgazdasági Intézet élén bekövetkezett személyi változások is. Az (alkalmazott) ökonometria pedig társas műfaj, és különösen az volt a számítástechnika nyolcvanas évek végén bekövetkezett robbanásszerű fejlődése előtt. Hiába maradhatott pár ember az ökonometriai laboratórium felszámolása után is a KSH-ban, elszigetelve képtelenek voltak érdemi teljesítményre. És amikor egy-egy műhelyt szétverték, a csalódott kutatók egy része az ökonometriának is hátat fordított. Ez is jelentősen szűkítette az ökonometriai kutatás szakemberbázisát.

Az egyetemi oktatástól való elszigeteltség másik fontos következménye, hogy az ökonometriai kutatás jórészt alkalmazott volt. Az egyetemi oktatók nehezen kerülhetik el a módszertannal való folyamatos foglalkozást, de az empirikus modellezőket a zárt magyar piacon semmi sem ösztönözte erre. Az ökonometriai elméletnek (módszertannak) viszonylag kisebb jelentősége volt, és az alkalmazott kutatás gyakran módszertanilag igénytelen volt. A hatvanas évek KSH ökonometriai laborja volt az utolsó olyan műhely, ahol – jórészt ugyan tanuló-feldolgozó jelleggel – rendszeres és széles körű, komoly módszertani kutatás folyt. Utána is voltak ugyan kutatók, akik „magánszorgalomból” módszertannal is foglalkoztak, de ezek csak két esetben hoztak nemzetközi mércével is viszonylag jelentősnek mondható eredményt. Az egyik Ziermann Margit és Bánkóvi György dinamikusfaktor-modellje, ami ugyan statisztikailag nem volt teljesen tisztázva,

de egy korai érdekes megoldási kísérletnek tekinthető a kointegráció problémájára. A másik jelentős módszertani eredményeket elért magyar kutató Melbourne-ben folytatja munkáját a panelmodellezésről immár hatodik éve.

A nemzetközi gyakorlatban kétféle alkalmazott ökonometriai modellezést különböztethetünk meg. Az ökonometria lehet egyrészt a gazdaságelmélet empirikus eszköze, ahol egy-egy konkrét gazdasági hipotézis verifikációjára használják. Másrészt lehet az ökonometriai modellezés célja gazdaságpolitikai elemzés, előrejelzés: a megfogalmazott gazdaságpolitika következményeinek – egy egységes elvek alapján felépített makromodellel történő – előrejelzése.

Magyarországon a hetvenes évek eleje óta ez a második fajta empirikus modellezés uralta az ökonometriai kutatást. A gazdaságelméleti kérdésekhez kapcsolódó kutatás mindig sokkal elszórtabb, ritkább volt. Ennek részben a magyar közgazdaságtan sajátos fejlődése az oka: az elméleti kutatók túlnyomó többsége irtózott a verifikálást lehetővé tevő formalizálástól, és ennek következtében az empirikus kutatást azonosították a szociológiai módszerek alkalmazásával. Ez a tradíció mindmáig jelentős korlátja az ilyen jellegű vizsgálatoknak, noha van némi elmozdulás – elsősorban a fiatalok körében – a standard közgazdasági gondolkodás és az ehhez tartozó eszközök irányában. A másik fontos ok, hogy a nemzetközi irodalomban szereplő, gazdaságelméletileg megalapozott ökonometriai modellek többsége a hazai viszonyokra aligha volt közvetlenül alkalmazható. Így azoknak, akik ilyen jellegű munkát akartak végezni, alig volt mire építeniük. Születtek azért ilyen tanulmányok is, de kevés és nagyon vegyes minőségben. A kutatók elszigetelten dolgoztak, a hazai piacon nem alakult ki a gazdaságelméletileg és módszertanilag egyaránt igényes cikkek, tanulmányok iránti igény, kereslet, ezért az ilyen jellegű magyar cikkek ritkán tudtak bejutni a nemzetközi publikációk piacára, többnyire legfeljebb az *Acta Oeconomica*-ig jutottak el.

Ez megint szembeállítható a lengyel helyzettel: ott rendszeresen születtek és születnek nemzetközi piacon is értékesíthető empirikus ökonometriai munkák. Többnyire olyan egyetemi oktatók írják ezeket, akik a módszertani újdonságokat is nyomon követik és a gazdaságelmélet fejlődését is, esetleg mindkettőt, mert tanítják. Nemzetközi konferenciákon és ennek következtében nemzetközi szakmai szervezetekben is sokkal erősebb volt és maradt a lengyelek szereplése. Magyarok manapság már csak egészen kivételes esetben vesznek részt az Ökonometriai Társaság konferenciáin; alig születik oda benyújtható munka.²

Gyakorlatilag megszűnt a magyar ökonometriai kutatás (korábban is elég halvány) szereplése a nemzetközi szakmai közéletben.

Az alkalmazott ökonometriai kutatás zöme gazdaságpolitikai modellezés volt. Magyarországon a nagy szimultán makromodellek kidolgozását nagyjából akkor kezdték el, amikor ezek Nyugaton válságba kerültek. Ezek a modellek a gazdaság működésének egészét vagy legalábbis túlnyomó részét kísérelték meg leírni. A hatvanas években és a hetvenes évek első felében rendkívül népszerűek voltak, és esetenként a gazdaságpolitikai döntéshozásban is jelentős szerepet játszottak. Az 1973–1974-es olajsokkot követően azonban rendszeresen hibásnak, kimondottan félrevezetőnek bizonyultak. Természetesen sokan próbálták tisztázni a nagy fejreállítás okait, és ezt részben a modellek tartalmi (gazdaságtani), részben módszertani hiányosságaira vezették vissza. A modellekben szereplő egyenletek egy része ugyan valamilyen gazdaságelmélethez kapcsolódott, azonban távolról sem minden egyenlet volt egyformán gondosan meghatározva. A teljesség igénye miatt nagyon sok esetlegességet tartalmaztak a modellek (*Sims* [1980]). A modellezők legin-

² Ez egyben a matematikai közgazdaságtani kutatások gyengeségét is jelzi, hiszen ezek a konferenciák a két terület közös szakmai fórumai.

kább csak arra vigyáztak, hogy az egyenletek jól illeszkedjenek, vagyis magas legyen az R^2 , de a magas korrelációnak a modell gazdasági tartalmától független okai is lehettek, ez még semmi biztosítékot sem jelentett arra, hogy a modell valóban elfogadható leírását adjon a gazdaság működésének (Granger–Newbold [1974] vagy Hendry [1980]). A helyes modellezési stratégia és a modellépítés során használandó statisztikai eszközök kérdésében élénk vita bontakozott ki, ami az ökonometriai modellezési gyakorlat, felhasznált módszertan gyökeres változásához vezetett (például Leamer [1983], McAleer–Pagan–Volker [1985], Cooley–LeRoy [1986], Pagan [1987]). Emellett a makroökonometriai modellezést alátámasztó elvi feltevéseket is heves és sok modellező által is jelentős részben elfogadott bírálatok érték (Lucas [1976]). Mindezek hatására Nyugaton a nyolcvanas évek elejére megfogyatkoztak a szimultán makroökonometriai modellek, és ezek eredményeit erős szkepszis fogadta. Sok gazdaságpolitikai intézmény (pénzügyminisztérium, központi bank) rutinszerűen végez vagy végeztet ilyen munkát, de ezek használata többnyire annak ellenére is sokkal korlátozottabb a húsz évvel ezelőttinél, hogy maguk a modellek természetesen sokkal jobbak.

Magyarországon ezzel szemben a hetvenes évek második felében és a nyolcvanas években az ökonometriai modellezés zöme ilyen makromodellek építése volt. Ekkorra jöttek létre ennek személyi és technikai (adatbázisok, számítástechnika) feltételei és az igény a főhatóságok (terv hivatal, gazdasági minisztériumok, árhivatal stb.) részéről. Ezekről a modellekről azonban mindaz a rossz elmondható, amit a hasonló nyugati modellek bírálataként elmondtak. Semmivel sem voltak kevésbé megalapozottak ugyan, mint a szocialista tervezés egyéb módszerei, a főhatóságnak legtöbbször csak alibiül szolgáltak: ők a tudomány modern eszközeinek eredményeit is felhasználják.

Ezzel nem az a baj, hogy készültek ilyen modellek Magyarországon. Ez egy lényegében szükséges lépcsőfoka volt az ökonometriai modellezés fejlődésének. A baj sokkal inkább az volt, hogy a hazai ökonometria alig tudott túllépni ezen. Mondhatnánk, hogy ez a gazdaságpolitikai makromodellezés eltartott olyan műhelyeket, ahol aztán ennél komolyabb szakmai munka is folyhatott – és ez részben igaz is. Sajnos azonban a makromodellezés alacsony gazdaságelméleti és módszertani színvonala gyakran kihatott az igényesebbnek szánt munkákra is. Voltak ugyan kivételek, de általában az empirikus ökonometriában sem nagyon sikerült elérni a minőségi nyugati színvonalat a hazai tömegtermelésre alapozva. A hagyományos makromodellek iránti főhatósági kereslet lényegében a rendszerváltással megszűnt. Az ezt kiszolgáló legnagyobb alkalmazott ökonometriai műhely már ezt megelőzően szétesett. Ehhez kétségkívül hozzájárult az egzisztenciális bizonytalanság és bizonyos személyi ellentétek is, de a szakmai okok is jelentős szerepet játszottak benne. Az 1989–1990-es politikai fordulat következtében a többi ökonometriai kutatóközösség is megrendelés nélkül maradt, és jórészt szétszóródott, tagjai közül sokan pályát változtattak, néhányan külföldre távoztak. Tulajdonképpen egyedül a pécsi egyetemen kialakult csoport maradt fenn. Idővel az MNB új modellezési osztálya is színvonalas ökonometriai műhellyé válhat, ha nem esik áldozatul valamilyen átszervezésnek, ez az osztály azonban még alig több, mint egy éve jött csak létre.

Az ökonometriai modellezés magyarországi fejlődésének azonban nemcsak az az akadálya, hogy az ezzel foglalkozók jelentős része abbahagyta ezt a munkát. Az ökonometriai modellezés feltételei is megváltoztak.

A magyar statisztikai rendszer ökonometrikus szemmel a nyolcvanas években is siralmasan szegényes volt, de 1989 után évekig alig volt használható statisztikai adat. Az ökonometriai modellezésnek viszonylag nagy az adatigénye, a statisztikai információs rendszer pedig a folyamatos átalakulás állapotában képtelen volt konzisztens adatokat szolgáltatni. Ennek voltak ugyan elkerülhetetlen elemei is, és még a statisztikai rendszer bizonyos modernizálódása sem tagadható, az ökonometriai modellek szempontjából azon-

ban az adatbázis egységessége is döntő, a KSH pedig mindeddig szinte semmit sem tett a statisztikai rendszer változásainak a korábbi adatokon való átvezetéséért.

A rendszerváltás azonban távolról sem csak ilyen közvetlen információhiánnyal járt. Az ökonometria modell mindig valami állandóságot tár fel, ír le. Csak akkor van esély a gazdasági folyamatok sikeres ökonometriairelemzésére, ha a gazdaság szereplőinek vizsgált viselkedése bizonyos állandó jellemzőkkel leírható. 1989–1990-ben nyilvánvaló volt, hogy vannak alapvető változások, de még senki sem tudta, miben is változik a gazdasági szereplők viselkedése. Lehetett volna ezt ugyan ökonometriairelemző eszközökkel is vizsgálni, például ha lett volna az egyes részpiacokon a nyolcvanas évek gazdasági folyamatainak valamilyen kielégítő ökonometriaireléírása, és lett volna megfelelő minőségű és gyorsaságú statisztikai adatszolgáltatás. Egyik feltétel sem teljesült. Így el kellett telnie néhány évnek, amíg valamennyire láthatóvá vált, mit is érdemes modellezni.

Világos, hogy a makrogazdasági idősorok alapuló modellek szerepe csak nagyon korlátozott lehet ma Magyarországon. Egyrészt, mert alig vannak ehhez használható idősorok, másrészt – és ez a fontosabb – alig van olyan makroelmélet, amin ez alapulhatna. Ezzel nem akarom azt mondani, hogy nincs olyan részpiac, ahol ne lehetne megkísérteni a nemzetgazdasági idősorok ökonometriairelemzését, de ettől csak nagyon korlátozott eredmény várható.

A magyar ökonometriairelemzés az átalakulás előtt túlnyomó részben idősorokon alapult. Ráadásul ebben az időszakban az ökonometriairelmélet újdonságai elsősorban az idősorelemzést érintették: a gazdasági idősorok trendjének kezelésében bekövetkezett módszertani áttörés valóságos publikációs robbanáshoz vezetett, amiből a magyar kutatók többsége a fentebb vázolt okok következtében annak ellenére kimaradt, hogy sokan szívesen alkalmazták volna ezeket az új módszereket. Magyar adatokon ez nem kecsegtetett sok sikerrel. Az idősoros vizsgálatokhoz felhalmozott készségek, eszközök erősen leértékelődtek a rendszerváltás és az ezzel többé-kevésbé párhuzamosan zajló módszertani forradalom következtében.

Elvileg többet tudhatunk arról, mi történik mikroszinten. Egyrészt a gazdaságelmélet nagyon gyakran a gazdaság egyes szereplőinek viselkedését próbálja meg leírni, és gyakran a makrogazdasági folyamatokat is ebből próbáljuk meg származtatni; másrészt ez az a szint, amire viszonylag gazdag adatforrások állnak vagy legalábbis állhatnának rendelkezésre. Sajnos időnként a statisztikai törvény lehetetlenné teszi, hogy a kutatók hozzáférjenek a meglévő adatokhoz. Más esetekben az adatgazdák kényelmi okokból korlátozzák az adatokhoz való hozzáférést, vagy kutatási pénzekből megfizethetetlen árat kérnek értük. Mindezeknek az információs problémáknak az ellenére a mikrogazdasági folyamatok ökonometriairelemzése az egyik olyan terület, ahol többen elkezdtek dolgozni. Különösen a munkaerőpiac elemzésében látszik egy olyan kutatási vonulat születése, amelyben rendszeresen használnak ökonometriairelemző eszközöket.

A másik terület, ahol érdemi munka kezdődött, a pénzügyi szféra folyamatainak modellezése. Ennek egyik oka, hogy itt ökonometriairelemzésre alkalmasabb idősorokkal lehet dolgozni, a másik pedig a terület iránt megnőtt hazai és nemzetközi érdeklődés.

Azt gondolom, Magyarországon a közeljövőben valamelyest nőni fog az ökonometriairelemzés jelentősége. Érzésem szerint már most is nagyobb, mint néhány éve volt. Ennek azonban nem lesz sok köze a korábban rendszeresen gyártott makromodellekhez. Sokkal inkább a gazdaságelmélethez kapcsolódó modellezés erősödhet meg. Ilyen munka a nyolcvanas években is kevés született, most sincs kevesebb, mint akkor. Ahogy a magyar gazdaságtan az eddiginél jobban integrálódik a nemzetközi hagyományokhoz, nő az igény az elméletek ökonometriairelemzési verifikálására, az összefüggések ökonometriairelemzési feltárására. Több területen (pénzügyek, munkaerőpiac, vállalatok viselkedése) folyik ilyen jellegű kutatás, születnek empirikus ökonometriairelemzési tanulmányok. A nyolcvanas évekkel

szemben fontos különbség, hogy akkor alkalmazott ökonometriai kutatással többnyire „ökonometrikusok” foglalkoztak, míg ma már nagyobb számban vannak olyan közgazdászok (például a munkaerőpiacot elemzők közt), akik, miközben az ökonometriai módszertan nem érdekli őket, az ökonometriai módszereket is szívesen és hozzáértéssel használják elemzéseikben. Ennek egyik oka, hogy mára az ökonometria standard eszköztára „gombnyomásra” elérhetővé, felhasználhatóvá vált. A másik oka a nyugati kutatókkal kialakult viszonylag intenzív szakmai kapcsolatokban tapasztalt minta.

A megindult kutatás gyakori gyengéje a korábbi időszakból továbbélő módszertani igénytelenség. A szakmai folyóiratokban – például a Közgazdasági Szemlében is – megjelent alkalmazott ökonometriai elemzések szakmai színvonala a hozzáértő lektorálás teljes hiányát vagy irrelevanciáját valószínűsíti. De példa erre a matematikai közgazdaságtanra és ökonometriára specializált Szigmában tavaly közölt egyetlen empirikus ökonometriai cikk is (*Darvas-Zöld* [1994]), amely nem felel meg az ilyen cikkekkal szemben támasztott (formai) követelményeknek.³ Így értékelhetetlené vált egy érdekes kérdést vizsgáló empirikus tanulmány, amely elméletileg is, gazdaságpolitikai következményeit tekintve is fontos problémát vizsgált. Csak akkor születhetnek hasznos, értékes munkák, ha azok elméletileg és módszertanilag egyaránt megalapozottak. Az empirikus munka szabályait meg kell(ene) tanítani az egyetemen az ökonometriát tanuló diákoknak. És teljesítését a folyóiratok szerkesztőinek meg kell követelniük a kutatóktól. Különben a magyar empirikus ökonometriai kutatás ugyanolyan kevésbé lesz piacképes, mint volt korábban.

A piacképesség hiánya számos esetben közvetlenül is megfigyelhető. Az átalakulás iránt megnőtt nemzetközi érdeklődés következtében a korábbinál több nyugati kutató foglalkozik magyar gazdasági folyamatok elemzésével. Sokan közülük természetesen ökonometriai módszereket (is) használnak tanulmányaikban. Így a nemzetközi folyóiratokban a korábbinál sokkal több empirikus ökonometriai munka jelenik meg a magyar gazdaságról, de ezek szerzői csak ritkán magyarok. (És ha azok, akkor gyakran külföldön tanuló, dolgozó magyar közgazdászok, akik környezetük normáihoz alkalmazkodnak.) Ami gyakran azt is jelenti, hogy a magyar gazdaság érdemi ismerete nélkül húznak rá standard ökonometriai modelleket a magyar adatokra.⁴ Ezen vizsgálatok viszonylag jelentős része módszertanilag ugyan korrekt, esetleg kimondottan igényes munka, de tartalmilag kétes értékű. A kutatásfinanszírozás jelenlegi helyzete magában rejti azt a lehetőséget is, hogy e tanulmányok országismerete a nyugati kutatók keze alá dolgozó magyarok révén fog javulni.

Azt gondolom, Magyarországon az ökonometria a néhány pozitív változás ellenére jó eséllyel összességében továbbra is marginális jelentőségű és alacsony minőségű marad. Ebben négy, egymással összefüggő ok játszik döntő szerepet.

A magyar ökonometriai kutatás jövője jelentős mértékben az egyetemi oktatáson múlik: az onnan kikerülő fiatalok mennyire ismerik az ökonometriai módszerek használatát, mennyire idegenkednek azoktól, tudják-e alkalmazni az eredményeket. Sajnos a jelenlegi helyzet nem túl sok jóval biztat: nagyon kevesen tanulnak ökonometriát a budapesti

³ Azt gondolom, ha a Szigma a publikációkkal szembeni követelményeket egyébként nagyon jól ismerő ökonometrikus szerkesztője azt mondta volna az akkor még egyetemista szerzőknek, hogy a publikálás feltétele TDK-dolgozatuk bizonyos, technikailag könnyen teljesíthető szempontok alapján történő kiegészítése, átdolgozása, akkor ezt (esetleg némi külső segítséggel) feltehetőleg megtették volna. A cikk egyébként a makrogazdasági idősorokon alapuló ökonometriai modellezést szinte lehetetlenné tevő alapvető információhiányt is jól példázza.

⁴ Sajátos, hogy nyugat-európai kutatók Brüsszelen keresztül ingyen hozzájutnak olyan adatbázisokhoz, amelyeket a KSH magyar kutatóknak csak jelentős összegért lenne hajlandó átadni, és így esetenként az adatokért kért árat a hazai kutatási költségvetésből megfizetni képtelen kutató versenyhátrányba kerül.

egyetemen, és az alkalmazott kutatásban jártasságot a jelenlegi oktatási feltételek mellett a diákok legfeljebb a normál egyetemi oktatáson kívül szereznek.⁵

Az egyetemi oktatástól távolról sem független az ökonometriai kutatás jövőjét meghatározó második tényező sem: mennyire alakul át a magyar gazdaságtudományi kutatás szemlélete, hogyan alakul viszonya az empirikus kutatáshoz. Ebben van ugyan némi változás, de a meghatározó mindmáig a kutatók többségének ökonometriát kerülő magatartása.

A harmadik tényező az ökonometriai műhelyek lényegi hiánya. Tartósan színvonalas ökonometriai kutatásra csak akkor lehet esély, ha kialakulnak olyan szakmai csoportok, ahol a kutatók egymást segítve, ösztönözve dolgoznak, és ahol létrejöhetnek az ökonometriai kutatás technikai feltételei. Ez ma jórészt hiányzik. Mint említettem, a Janus Pannonius Egyetemen és az MNB-ben vannak kisebb műhelyek, de ezek hatása nagyon korlátozott.

A negyedik tényező, hogy a kutatóhelyeken (nem csak az ökonometria terén) nagyon gyenge a nyomás a nemzetközi publikációkra, a hazai kutatás jórészt autark, a hazai szakmai folyóiratok érdemben nem szűrik a publikációkat, és így nem ösztönzik a szerzőket a színvonalas munkára. Ez konzerválja az empirikus ökonometriai kutatás alacsony versenyképességét a nemzetközi piacon, és e tudományágat ismétlődően hiteltelenné teszi a hazai közgazdasági kutatók szemében.

Hivatkozások

- COOLEY, T. F.–LEROY, S. F. [1986]: What Will Take the Con out of Econometrics? A Reply. *American Economic Review*, Vol. 76, No. 3, 504-507. o.
- DARVAS ZSOLT–ZÖLD ESZTER [1994]: Ökonometriai eljárások a kiszorítási hatás elemzésére II. *Magyarország 1989–92. Szigma*, 3. sz., 115-134. o.
- GRANGER, C. W. J.–NEWBOLD, P. [1974]: Spurious Regressions in Econometrics. *Journal of Econometrics*, Vol. 2, 111–120. o.
- HENDRY, D. F. [1980]: Econometrics – Alchemy or Science? *Economica*, Vol. 47, 387-406. o.
- LEAMER, E. E. [1983]: Let's Take the Con out of Econometrics; *American Economic Review*, Vol. 73, No. 1, 31-43. o.
- LUCAS, R. E. JR. [1976]: *Econometric Policy Evaluation: A Critique*. Megjelent: *The Phillips Curve and Labor Markets*, Vol. 1, Carnegie-Rochester Conference Series (szerk.: *Brunner, K.–Meltzer, A. H.*), North Holland, 19–46. o.
- MCALFEE, M.–PAGAN, A. R.–VOLKER, P. A. [1985]: What Will Take the Con out of Econometrics? *AER*, Vol. 75, No. 3, 293–307. o.
- PAGAN, A. R. [1987]: Three Econometric Methodologies: A Critical Appraisal. *Journal of Economic Surveys*, Vol. 1, No. 1, 3-24. o.
- SIMS, C. A. [1980]: *Macroeconomics and Reality*; *Econometrica*, Vol. 48, No. 1, 1–48. o.

⁵ Nincs érdemi információ arról, hogy Pécsen most milyen az ökonometriaoktatás helyzete.