

Recensione:

Francesco Guala, *Filosofia dell'Economia*, 2006

di

Alessio Moneta

moneta@econ.mpg.de



2R – Rivista di Recensioni Filosofiche – Volume 9, 2008

Sito Web Italiano per la Filosofia

www.swif.uniba.it/lei/2r

Francesco Guala, *Filosofia dell'economia. Modelli, causalità previsione*, Il Mulino, Bologna 2006, pp. 238, €18,00.

INTRODUZIONE

Da “hobby per anziani economisti in vena riflessiva”, la filosofia dell'economia si è trasformata negli ultimi anni “in un campo di ricerca interdisciplinare estremamente vivace e specializzato”. Quattro aree di ricerca sono in particolare sviluppo. La prima è l'indagine sulla *razionalità*, nozione che gli economisti utilizzano, con certa disinvoltura, per fondare la teoria della decisione e da qui la microeconomia. Vi è poi l'economia normativa, in cui, studiando il concetto di *welfare*, si toccano temi comuni alla filosofia morale. La terza area di ricerca è la metodologia dell'economia, campo di intersezione con la filosofia della scienza, in cui si analizzano i metodi coi quali le ipotesi economiche vengono formulate e giustificate. Infine, negli ultimi anni un'area particolarmente attiva è l'ontologia dell'economia, in cui ci si interroga su cosa sono gli oggetti (ad esempio mercato, impresa, moneta) dei quali l'economia parla.

Nonostante il titolo, il libro di Guala tratta quasi esclusivamente di metodologia dell'economia. Sia ben chiaro, l'area di ricerca è vasta abbastanza. E' anzi ammirevole come l'autore riesca in poco più di 200 pagine a dare una visione d'insieme dello stato attuale della ricerca. Questo libro presenta alcune importanti novità rispetto al panorama italiano. Negli ultimi decenni sono stati pubblicati validi studi in italiano su temi afferenti la filosofia dell'economia. Spesso però essi concernono le altre aree di ricerca menzionate sopra, oppure, se si riferiscono alla metodologia, lo fanno affrontando solo alcuni temi in particolare. In molti casi il quadro di riferimento è quello della storia del pensiero economico. Il libro di Guala, invece, offre una prospettiva nuova in quanto la metodologia dell'economia è presentata sia in uno sguardo globale sia nel suo stato attuale di ricerca.

Una “guida turistica”, viene definito nel capitolo introduttivo. Si tratta certamente di una guida turistica ricca di spunti. Particolarmente piacevole è anche lo stile: asciutto e qualche volta ironico, probabilmente di influenza anglosassone. La visita consigliata si svolge attorno a tre

concetti chiave, anticipati nel sottotitolo del libro: modelli, causalità e previsione. Qui la ripercorro soffermandomi più su alcuni temi e meno su altri. La scelta è dettata da interesse personale, ma permette anche di far notare alcune lacune e punti critici.

INDUZIONE E DEDUZIONE

Il punto di partenza è il problema dell'induzione (capitolo primo). La scelta è perfetta. Qualsiasi disciplina scientifica, se si riferisce a dati e fatti del mondo reale, se intende essere *empirica*, si scontra inevitabilmente col problema formulato da Hume: come possiamo giustificare ipotesi teoriche che parlano di fatti *non ancora* osservati? Il modo in cui questo problema viene affrontato, superato o evitato ha determinato il nucleo centrale delle varie branche della filosofia della scienza. Il problema è stato mitigato nella pratica scientifica grazie all'utilizzo del metodo sperimentale. In un esperimento si verifica un'ipotesi circa una relazione causa-effetto tra due fenomeni A e B controllando le cause "disturbanti". La relazione oggetto di studio viene isolata, per quanto possibile, da influenze esterne. Inoltre, avvalendosi del metodo della *randomization*, le unità sottoposte all'esperimento vengono ripartite in maniera casuale tra un gruppo di trattamento, messo sotto l'influenza di A, e un gruppo di controllo, su cui A non può agire. Se si osserva B *solo* nel primo dei due gruppi, l'ipotesi di una relazione causa-effetto tra A e B viene confermata. Ripetendo l'esperimento in diversi contesti, e assumendo una minimo di uniformità in natura, l'ipotesi teorica è ritenuta giustificata anche per fatti non ancora osservati. Benché questa giustificazione non sia sufficiente per lo scettico humeano, l'esperimento controllato fornisce ad una disciplina lo statuto di scienza empirica.

Nelle scienze sociali l'esperimento è problematico, nonostante la rapida ascesa dell'economia sperimentale. Gli importanti frutti di questa disciplina, sviluppatasi negli ultimi trent'anni, sono discussi da Guala nel dodicesimo capitolo del libro. Tuttavia, il campo di applicazione dell'economia sperimentale non è così esteso da poter rivoluzionare la disciplina: nella maggior parte dei casi l'economista deve fare affidamento all'osservazione "passiva" e non ad

esperimenti. Per Guala l'impossibilità (o estrema difficoltà) di condurre esperimenti controllati è strettamente connessa a quello che egli chiama il "problema pratico dell'induzione" (p. 15). Questo problema può essere distinto in due aspetti. In primo luogo è improponibile, per motivi etici prima che fisici, che individui o nazioni vengano costretti, nella loro vita reale, a sottoporsi ad un trattamento economico piuttosto che ad un altro in modo aleatorio. In secondo luogo, i meccanismi causali sottostanti i fenomeni economici si intrecciano tra loro in modo spesso così complesso che le nostre capacità cognitive sono troppo limitate per districarli tra loro.

La soluzione di John Stuart Mill a questo problema, analizzata nel secondo capitolo del libro, è importante perché è stata riproposta in tempi più recenti. I fondamenti del comportamento economico, secondo Mill, sono accessibili all'economista attraverso l'introspezione psicologica, per cui è possibile 'intuire' come si comporterà una persona in una situazione di affari. Questo metodo "è un surrogato dell'esperimento controllato, nel senso che è possibile immaginare il comportamento dell'uomo 'in isolamento', quando esso è determinato soltanto da una o poche motivazioni alla volta" (p. 29). Una volta formulate le basi del comportamento individuale, in cui il "desiderio di aumentare il proprio benessere individuale" assume un ruolo centrale, è possibile derivare, per via *deduttiva*, le relazioni causa-effetto che descrivono i fenomeni economici. Se, confrontando le relazioni causa-effetto con i fenomeni del mondo reale, osserviamo qualche discrepanza, per Mill "significa che abbiamo dimenticato di tenere in conto qualche 'causa minore' o 'disturbante'" (p. 32).

Un'importante assunzione della metodologia di Mill, evidenziata giustamente da Guala, è il fatto che nei fenomeni sociali le cause si compongono tra di loro in modo additivo. Diverse cause mantengono il modo in cui determinano i loro effetti anche quando esse interagiscono tra loro. In questo senso, per Mill, l'economia è più simile alla fisica che alla chimica. Nella prima, le forze si compongono tra loro per mezzo del "principio del parallelogramma". Nella seconda le sostanze assumono proprietà differenti a seconda del contesto. L'assunzione dell'additività o linearità delle relazioni economiche, fa notare Guala, è soltanto una soluzione di comodo. In realtà, è molto

difficile stabilire a priori come i diversi aspetti del comportamento umano si combinino l'uno con l'altro. Non sappiamo, per esempio, “combinare gli effetti della religiosità con la ricerca del profitto” (p. 36). Assumere che cause diverse si combinano tra di loro in modo lineare facilita, nel caso di Mill, la deduzione di nuove relazioni causa-effetto. In econometria, l'assunzione di linearità semplifica enormemente il modello statistico utilizzato per misurare come un gruppo di variabili dipendono l'una con l'altra, come avviene nell' “econometria da libro di testo”, descritta da Guala nel tredicesimo capitolo (invece l'estrema difficoltà a formulare *a priori* quale sia la forma funzionale di una relazione economica ha recentemente alimentato lo sviluppo dell'econometria nonparametrica).

Il problema della non linearità andrebbe qui collegato ad un'altra questione, in buona parte trascurata dal libro. In molti casi dell'economia, le ipotesi teoriche si riferiscono al comportamento individuale, mentre i fenomeni osservati riguardano variabili aggregate, come, ad esempio, il reddito o il consumo totale di una nazione (somma dei redditi e consumi individuali). Se gli individui nella realtà si comportano in modo eterogeneo e la teoria descrive il comportamento di un solo individuo idealizzato (*l'homo oeconomicus*), nasce una discrepanza tra la micro e macroeconomia, poiché le relazioni misurate tra variabili aggregate non sono facilmente riconducibili alla teoria del comportamento individuale. Vi possono cioè essere proprietà (misurate) tra variabili macroeconomiche che non riflettono necessariamente proprietà (teoriche) della microeconomia, ma che “emergono” attraverso il processo di aggregazione di proprietà individuali eterogenee. La complessità del rapporto micro-macro è una tema che ha attirato recentemente l'attenzione di studiosi della metodologia dell'economia (si veda Hoover [2001]) e che avrebbe meritato almeno una menzione per le difficoltà che essa pone ad un metodo “aprioristico” come quello di Mill in economia. E' stata invece rivalutata, a proposito dei problemi di non linearità e aggregazione in economia, la concezione che Mill aveva della chimica e della biologia, in cui la “giustapposizione delle parti” può avere proprietà non riducibili alle “sostanze componenti” (Mill [1843, Libro III, Cap. 6, § 1]; si veda Ioannides [2006]).

MODELLI

La tappa successiva è dedicata al ruolo dei modelli. Gli economisti sono “il popolo dei modelli”, come scrive James Heckman [2000]. La tendenza, negli scritti economici degli ultimi anni, è quella di prediligere il termine “modello” a quello di “teoria”. Il termine “teoria”, così come “teorico”, è ancora utilizzato, ma prevalentemente in senso astratto, per denotare le proposizioni che non sono state ancora confrontate coi dati. Non si parla quasi più, se non riferendosi alla storia del pensiero economico, di teoria keynesiana, monetarista, evolutiva, ecc., ma piuttosto di modello keynesiano, monetarista ed evolutivo. A mio parere, questo dipende in una certa misura dal fatto che la parola “modello” meglio incarna una certa precarietà che gli economisti associano con le loro rappresentazioni della realtà.

Tuttavia, i modelli svolgono un ruolo così cruciale in economia soprattutto perché essi vengono concepiti come mezzi per isolare e studiare relazioni causali. Poiché gli esperimenti controllati non sono possibili nella realtà, gli economisti si creano un mondo artificiale (col pensiero, con equazioni, con simulazioni al computer) che serve come “laboratorio” in cui tali esperimenti sono realizzabili (cfr. Lucas [1982], citato da Guala a p. 51). Guala si sofferma sul seguente problema: qual è il criterio per sapere se i meccanismi che i modelli studiano hanno qualche rilevanza per il mondo reale? I modelli devono “assomigliare” al mondo reale? O basta che risolvano problemi del mondo reale? “E’ difficile definire la nozione di ‘somiglianza’ fra un modello e un’entità del mondo reale a priori, in quanto diversi modelli possono assomigliare al mondo in modo diverso” (p. 54).

Guala ci descrive, in un capitolo a parte, la risposta che Milton Friedman fornisce a tali questioni. Per Friedman un modello è buono non in quanto “rispecchia” fenomeni del mondo reale, ma nella misura in cui prevede fenomeni. Guala ritiene che ci sia una certa tensione tra il Friedman degli scritti metodologici, in cui emerge un orientamento “strumentalista” (anche se la metodologia di Friedman non è sempre chiara) e Friedman economista. Da economista, Friedman si è trovato a

criticare modelli keynesiani sulla base delle loro assunzioni. Guala aggiunge che “se Friedman avesse seguito la metodologia in modo coerente, fino agli anni settanta avrebbe dovuto accettare la curva di Phillips come buono strumento predittivo” (p. 82). Non sono convinto che l’indovinare una singola correlazione in un intervallo temporale limitato fosse una previsione sufficiente per Friedman, ma sono d’accordo sul fatto che ci sia una tensione tra gli scritti metodologici ed economici di Friedman, riformulata nel seguente modo. Il vantaggio ad essere strumentalista, si è portati a pensare, è quello di poter utilizzare assunzioni teoriche con più disinvoltura, senza pensare al fatto che descrivano aspetti della realtà o meno, avendo come scopo principale la previsione. Un coerente strumentalista non avrebbe difficoltà a tentare assunzioni alternative, “giocando” in una certa misura coi modelli. Tutto ciò non sembra essere il caso di Friedman, il quale negli scritti economici è rimasto negli anni fedele alle sue assunzioni monetariste.

Per Guala lo strumentalismo è comunque indifendibile: perché mai dovremmo accontentarci della previsione e trattare un modello come una scatola nera, senza cioè guardare ai suoi meccanismi interni? Naturalmente occorre distinguere, e Guala lo fa con molta chiarezza, tra diversi tipi di previsione. Una previsione è in un certo senso relativa ad un insieme di “condizioni di sfondo”, al cambio delle quali la previsione può cessare di essere valida. Per esempio, un barometro (esempio di Guala a p. 78) prevede bene la pioggia nella misura in cui non interferiamo coi suoi meccanismi e lo calibriamo con l’altitudine. In questo senso esso è un modello di previsione poco “robusto”. Una relazione è invece “robusta se continua a essere valida anche quando mutano altre condizioni di sfondo, oppure quando il modello (...) può essere usato in un dominio diverso di applicazione” (p. 78).

La discussione sulla metodologia di Friedman si conclude con la seguente tesi: “il potere predittivo costituisce un obiettivo troppo limitato per la scienza economica. La scienza è volta non solo a prevedere, ma anche a intervenire sui fenomeni (naturali, sociali, ecc.)” (p. 83). Si noti però che l’intervento è in un certo senso una previsione, ma una previsione fondata su una relazione particolarmente “robusta”. Quando si interviene su A, avendo come fine il cambiamento di un certo

fenomeno B, si prevede un effetto su B e che la relazione (causale) tra A e B non venga meno quando manipoliamo A. Si consideri per esempio la curva di Phillips, la relazione tra disoccupazione e inflazione (descritta da Guala a pp. 80-82). Si pensi a tre diverse previsioni ottenute utilizzando tale relazione: (i) previsione della disoccupazione in un certo anno particolare, (ii) previsione della disoccupazione in diversi anni ed economie nazionali, (iii) previsione della disoccupazione quando si interviene influenzando politicamente l'inflazione. E' chiaro che per ottenere (i) può bastare una relazione poco robusta, per (ii) occorre una relazione piuttosto robusta, per (iii) è necessario che la relazione non si rompa con l'intervento. Semplificando, la curva di Phillips ha permesso previsioni di tipo (i) e in qualche misura di tipo (ii), ma non di tipo (iii).

CAUSALITÀ ED ECONOMETRIA

Il concetto di “intervento” o di “previsione stabile all'intervento” è strettamente connesso a quella di causa. Guala dedica alla causalità un capitolo centrale del libro. La discussione sul significato del termine “causa” e sul ruolo che esso svolge nel discorso scientifico ha una lunga tradizione filosofica. Si tende sempre più a riconoscere che il termine sia connesso a diverse nozioni (cfr. Cartwright 2007), non sempre riconducibili ad un comune denominatore e legate semmai tra loro da quella che Wittgenstein chiamava una “somiglianza di famiglia”. In economia assume un'importanza centrale la definizione per cui A causa B se e solo se manipolando A riusciamo a prevedere come sarà B. Ciò non stupisce, se si pensa al fatto che gli economisti mirano a dare consigli ai politici, spesso diventando loro consulenti. Altre nozioni chiave, con cui il concetto di causa è imparentato, sono quelle di “controfattuale” e “probabilità” (quest'ultima, nel senso che se A causa B, A rende più probabile il verificarsi di B).

La relazione causa-effetto, che rende possibile un intervento, è *asimmetrica*, mentre una semplice associazione statistica, che può essere sufficiente per qualche previsione, è una relazione *simmetrica*. Guala discute, utilizzando esempi molto calzanti, le difficoltà che ne conseguono quando vogliamo inferire relazioni causa-effetto da associazioni statistiche. Vi sono correlazioni

che sottintendono una relazione causale tra le variabili associate, altre che sottintendono semplicemente una causa comune. Il punto di arrivo di questa discussione è che “senza una buona conoscenza causale ‘di sfondo’ non è possibile scoprire ulteriori nessi causali” (p. 93). Ad esempio, nella progettazione di un esperimento, ripartiamo la popolazione in diverse categorie causali omogenee. Oppure, è possibile che si individui una “variabile strumentale” che, grazie alle sue particolari relazioni con le variabili di interesse, rende una situazione non sperimentale del tutto simile ad un esperimento. Per fare tutto ciò è necessario una conoscenza causale di sfondo. In altri casi, questa conoscenza ci permette di costruire un modello e di scoprire nuove relazioni causali all’interno di esso. Tutto ciò ovviamente non soddisfa l’empirista, anzi lo preoccupa abbastanza. Da dove deriva la “conoscenza causale di sfondo”? Se non dall’osservazione, come possiamo essere certi che la relazione causale inferta sia vera?

Questa importante questione è affrontata nel capitolo sull’econometria. Gran parte del capitolo è dedicata alla discussione sulla cosiddetta “econometria da libro di testo”, cioè i metodi econometrici che vengono comunemente trasmessi agli studenti in un corso universitario in econometria, e che hanno dominato la disciplina fino agli anni settanta, anche se mai nel modo così stilizzato come Guala li descrive. In questo paradigma, la conoscenza di sfondo viene utilizzata in modo tale che “il modello teorico sia sostanzialmente corretto e completo, e che il problema più pressante consista nella specificazione del modello econometrico, ovvero nella stima dei parametri liberi della teoria” (p. 192).

Forse è solo questione di gusto personale, ma avrei trovato più interessante una discussione più ampia sui tentativi fatti dall’econometria per superare questo paradigma. E’ solo nelle ultime due pagine del capitolo che Guala menziona, molto brevemente e non senza lacune (per esempio il paradigma di Rubin è del tutto trascurato; si veda su questo Sobel 2000), alcuni degli approcci econometrici che hanno reso certamente più “empirica” la disciplina economica. Infatti, come Guala giustamente sottolinea, il fatto che la scoperta delle cause richieda conoscenza di sfondo da cui partire non deve precludere la possibilità di una scienza empirica: “le cause ‘in entrata’” di cui

abbiamo bisogno per tracciare le inferenze causali a partire dai dati empirici non sono necessariamente quelle della teoria economica. Al contrario, è proprio combinando informazioni teoriche con altre informazioni causali e con i dati empirici che è possibile generare nuova conoscenza scientifica” (p. 197).

A conclusione del capitolo sull'econometria Guala afferma che “questa situazione di ‘felice anarchia’ fa dell'econometria uno dei campi di ricerca più vivi e interessanti del momento (...) il programma empirista in economia sembra essere vivo e vegeto” (p. 201). Uno dei meriti di questo libro, è sicuramente l'aver reso attrattiva dal punto di vista filosofica una disciplina che ancora molti interpretano (purtroppo) come semplice “tecnica di misurazione”.

CONCLUSIONE

Nonostante le lacune menzionate, la prospettiva generale che emerge sulla metodologia dell'economia è molto convincente perché è capace di rendere conto delle difficoltà che gli economisti incontrano nel concepire la loro disciplina come una scienza empirica, ma nello stesso tempo mette in guardia dal cercare le basi per il controllo e la scoperta delle teorie fuori dall'evidenza empirica. Il libro qui esaminato, quindi, è una lettura indispensabile per venire a conoscenza e discutere criticamente dei vari tentativi e possibilità del programma empirista in economia.

ALESSIO MONETA

BIBLIOGRAFIA

Cartwright, N. (2007), *Hunting Causes and Using Them. Approaches in Philosophy and Economics*, Cambridge University Press, Cambridge.

Ioannides, Y. M. (2006), “Emergence”, in Durlauf S., Blume L. (a cura di), *The New Palgrave of Economics*, Palgrave Macmillan, seconda edizione, in stampa.

- Heckman, J.J. (2000), "Causal Parameters and Policy Analysis in Economics: A Twentieth Century Retrospective", *Quarterly Journal of Economics*, 115(1), pp. 45-97.
- Hoover, K.D. (2001), *The Methodology of Empirical Macroeconomics*, Cambridge University Press, Cambridge.
- Lucas, R. (1982), *Studies in Business Cycle Theory*, MIT Press, Cambridge Massachusetts.
- Mill, J.S. (1843), *A System of Logic. Ratiocinative and Inductive*. London, Longman Green, 1949.
Tr. it. di G. Facchi (1968), *Sistema di Logica. Raziocinativa e Induttiva*, Ubaldini Editore, Roma.
- Sobel, M.E. (2000), "Causal Inference in the Social Sciences", *Journal of the American Statistical Association*, 95(450), 647-651.