

Krzysztof Jajuga

Uniwersytet Ekonomiczny we Wrocławiu

NAUKI EKONOMICZNE – DYLEMATY KLASYFIKACJI DYSCYPLIN. TENDENCJE ZMIAN

Tezy

1. Nauki ekonomiczne – czy zasłużona krytyka?

Ostatnie lata, a przede wszystkim ostatnie miesiące charakteryzują się ożywioną dyskusją w polskim środowisku nauk ekonomicznych na temat klasyfikacji dyscyplin. Są co najmniej dwa powody tej dyskusji.

Pierwszy powód dyskusji jest prozaiczny, mianowicie: trwają cały czas prace nad nową ustawą Prawo o szkolnictwie wyższym, w którym klasyfikacja dziedzin i dyscyplin naukowych jest delegowana do powstającego rozporządzenia ministra. Rozporządzenie to zmieni zdecydowanie listę dziedzin i dyscyplin poprzez radykalne zmniejszenie.

Drugi powód dyskusji jest bardziej fundamentalny. W ostatnich dziesięciu (około) latach zmieniło się postrzeganie nauk ekonomicznych. W dużym stopniu wpływ na to miał kryzys ekonomiczny, zapoczątkowany kryzysem na rynku finansowym w latach 2007-2008. Wzmogła się krytyka nauk ekonomicznych i samych ekonomistów, którzy byli oskarżani o to, iż nie podjęli działań zapobiegających kryzysowi, jak również o to, że nie przewidzieli tego kryzysu. Krytyka ta tylko częściowo jest słuszna. Często słowa krytyki padały ze strony przedstawicieli innych nauk, którzy nie rozumieli, jak skomplikowana jest materia zjawisk ekonomicznych, gdzie nie ma stuprocentowo sprawdzających się praw (jak np. w fizyce), lecz jest nieprzewidywalne działanie człowieka. Nie zmienia to jednak faktu, iż kryzys ekonomiczny uzewnętrzniał słabości wielu teorii ekonomicznych, traktowanych jako „prawdy objawione”.

Moim zdaniem, główne słabości nauk ekonomicznych, przede wszystkim nurtu normatywnego, wynikają przede wszystkim z następujących faktów:

1. Modele ekonomiczne mają często u podstaw założenia, które z punktu widzenia analizy świata rzeczywistego, nie mogą być zaakceptowane. Przedstawiciele nauk ekonomicznych przyjmowali takie założenia, gdyż łatwiejsze było doprowadzenie do końcowej postaci modelu przy tych założeniach. Wielokrotnie przytaczany fakt wyceny kredytowych instrumentów pochodnych na rynku amerykańskim przy zastosowaniu funkcji kopuli gaussowskiej (w roku 2007) to jeden z wielu przykładów.

Jak wiemy, największa krytyka dotyczy założenia racjonalnego człowieka (ogólnie: podmiotu) działającego na rynku (*homo oeconomicus*). Laureat nagrody pamięci Nobla z nauk ekonomicznych z 2017, Richard Thaler, nazywa takie podmioty „ekonkami” (*econs*), uzasadniając, że człowiek jest normalny, a nie jest „ekonkiem”.

Modele ekonomiczne są mało odporne na zmiany w gospodarce, a zmiany te są coraz bardziej dynamiczne. Niektóre modele nie są nawet weryfikowane empirycznie, pozostają w sferze teoretycznej (dotyczy to niestety klasycznej ekonomii matematycznej). Inne modele są weryfikowane, ale na podstawie danych historycznych. Brak odporności modelu, który dobrze sprawdzał się w przeszłości, na zmiany warunków w gospodarce, powoduje jego nieprzydatność.

Do tej pory raczej rzadko modele poddawano analizie typu „what if”. W finansach, a także w statystyce i ekonometrii, takie badanie jest jednym z elementów analizy ryzyka modelu.

2. Teorie ekonomiczne są rzadko tworzone w celu ich wykorzystania do rozwiązywania problemów praktycznych. W niedawnej przeszłości było nawet tak, iż artykuły teoretyczne były oceniane wyżej niż artykuły empiryczne, dotyczące konkretnych problemów praktycznych.

Moim zdaniem, nie jest to właściwa droga do rozwoju nauki. Dziedzina nauk ekonomicznych dotyczy działalności człowieka, powinna zatem szukać odpowiedzi na problemy, które człowiek napotyka w tej działalności. Jeśli tak nie będzie, ekonomiści będą w dalszym ciągu krytykowani.

3. W latach poprzedzających kryzys ekonomiczny, w naukach ekonomicznych, ale również w dydaktyce ekonomii, dominował główny nurt (*mainstream*) rozważań, a w niewielkim stopniu próbowano uwzględniać różne nieklasyczne nurty teoretyczne (do jakich zalicza się choćby ekonomia behawioralna).

Warto też dodać, iż obecnie nierzadko zdarza się, że osoby działające w praktyce, dysponują większą wiedzą, niż niektórzy naukowcy. Dotyczy to przede wszystkim takich obszarów, które bardzo szybko się rozwijają, gdzie być może za wcześnie jest jeszcze na pogłębione badania naukowe. Widoczne jest to na przykład w obszarze rynków finansowych, które charakteryzują się dużą innowacyjnością produktową i procesową.

2. Ewolucja nauk ekonomicznych – kierunki

Pewien pogląd na przemiany w naukach ekonomicznych daje analiza cytowań artykułów z różnych subdyscyplin w naukach ekonomicznych. Opracowanie autorstwa Kima, Morse'a i Zingalesa (2006), pt. "What mattered to economics since 1970", w którym analizowane są liczby cytowań z poszczególnych obszarów nauk ekonomicznych w 41 najbardziej znanych czasopiśmie ekonomicznych, w opublikowanych 209 artykułach, w latach 1970-2005 (a więc przed kryzysu) wskazuje na kilka faktów:

- trzy obszary zawierające artykuły o największej liczbie cytowań, to:

w latach 1970-1974: Mikroekonomia (26,7%), Finanse (20%), Ekonometria (10%);

w latach 1994-1999: Finanse (31,4%), Ekonometria (22,9%), Wzrost/rozwój (17,1%);

- udział poszczególnych trzech kluczowych rodzajów artykułów jest następujący:

w latach 1970-1974: Teoretyczne (76,7%), Empiryczne (13,3%), Metodyczne (6,7%);

w latach 1994-1999: Empiryczne (60,0%), Metodyczne (22,9%), Teoretyczne (11,4%).

Wskazuje to na wyraźny wzrost badań w zakresie finansów oraz ekonometrii, a ponadto rosnące znaczenie artykułów empirycznych.

Inny pogląd na kierunki ewolucji nauk ekonomicznych wynika z analizy przyznanych nagród pamięci Alfreda Nobla z nauk ekonomicznych (potocznie zwanego ekonomicznym Noblem). Jak wiadomo, od 1969 roku przyznano 49 nagród, które otrzymało 79 uczonych. Analiza osiągnięć, za które przyznano nagrodę, pozwala na wyróżnienie głównych obszarów ramach nauk ekonomicznych. Trzeba jednak pamiętać, że nagroda przyznawana jest za osiągnięcia, które powstały nawet kilkadziesiąt lat wcześniej, jest to zatem w dużym stopniu analiza retrospektywna.

Poniżej przedstawiam klasyfikację obszarów nauk ekonomicznych, która jest rozszerzoną wersją klasyfikacji zaproponowanej przez Assara Lindbecka (Lindbeck (2008), który przeprowadził tę analizę dla nagród przyznanych w latach 1969 – 2007. Po zastosowaniu podobnej idei rozszerzyłem tę klasyfikację do roku 2017. W celu utrzymania przejrzystości klasyfikacji pozostawiam wersję w języku angielskim. Oto ona – podane są obszary oraz nazwiska przyporządkowanych im noblistów:

Econometrics (Frisch, Tinbergen, Haavelmo, Heckman, McFadden, Engle, Granger)

Macroeconometrics (Klein, Sargent, Sims)

Macroeconomics (Tobin, Modigliani, Lucas, Friedman, Phelps, Kydland, Prescott)

Macroeconomics and Institutional Economics (Myrdal, von Hayek)

Microeconomics and Economic Sociology (Becker)

Microeconomics (Hurwicz, Maskin, Myerson)

International Economics (Ohlin, Meade)

International Macroeconomics (Mundell)

International and Regional Economics (Krugman)

Development Economics (Schultz, Lewis)

Labor Economics (Diamond, Pissarides, Mortensen)

Welfare Economics (Sen, Deaton)

Financial Economics (Markowitz, Sharpe, Miller, Merton, Scholes, Fama, Shiller, Hansen)

Economic History (Fogel, North)

Administrative (Management) Science (Simon)

Economic Psychology and Experimental Economics (Kahneman, Smith, Thaler)

Economics of Information (Mirrlees, Vickrey, Akerlof, Stiglitz, Spence)

Public Finance (Buchanan)

Industrial Organization (Stigler, Tirole)

Game Theory (Harsanyi, Nash, Selten, Aumann, Schelling, Roth, Shapley)

National Income Accounting (Stone)

General Equilibrium Theory (Hicks, Arrow, Debreu)

Partial and General Equilibrium Theory (Samuelson, Allais)

Economic Growth Theory (Solow)

Economic Growth and Economic History (Kuznets)

Input-Output Analysis (Leontief)

Theory of Optimal Allocation of Resources (Koopmans, Kantorowicz)

Theory of Institutions (Coase)

Economic Governance (Ostrom, Williamson)

Contract Theory (Hart, Holmstrom)

Częściowo potwierdza to poprzedni wniosek o dużym znaczeniu badań w zakresie finansów, ekonometrii oraz makroekonomii. Ponadto widać coraz więcej uznania dla badań niekoniecznie „mainstreamowych”, co znamionuje jednak rosnącą interdyscyplinarność badań. Do takich obszarów należą m.in: ekonomia behawioralna, ekonomia eksperymentalna, socjologia ekonomiczna.

3. Nauki ekonomiczne – klasyfikacja dyscyplin

Najbardziej znaną (i uznaną) klasyfikacją dyscyplin (czy raczej subdyscyplin) w ramach nauk ekonomicznych, jest klasyfikacja JEL (Journal of Economic Literature). Zawiera ona następujące ogólne grupy:

- General Economics and Teaching
- History of Economic Thought, Methodology and Heterodox Approaches
- Mathematical and Quantitative Methods
- Microeconomics
- Macroeconomics and Monetary Economics
- International Economics
- Financial Economics
- Public Economics
- Health, Education and Welfare
- Labor and Demographic Economics
- Law and Economics
- Industrial Organization

- Business Administration and Business Economics. Marketing. Accounting. Personnel Economics
- Economic History
- Economic Development, innovation, Technological Change and Growth
- Economic Systems
- Agricultural and Natural Resource Economics. Environmental and Ecological Economics
- Urban, Rural, Regional, Real Estate and Transportation Economics
- Miscellaneous Categories
- Other Special Topics

Oczywiście ta klasyfikacja (w której każda z grup jest dzielona na wiele podgrup) nie jest rozłączna. Jak wiemy przeważająca część artykułów, w których po słowach kluczowych zamieszcza się kody JEL, zawiera kilka takich kodów, co oznacza kwalifikację do różnych obszarów (subdyscyplin).

4. Tendencje rozwojowe

Ostatnia dekada pokazała, że następuje istotna ewolucja nauk ekonomicznych. Sądzę, że procesy zmian w następnych latach będą coraz bardziej dynamiczne. Są dwa czynniki tych zmian. Pierwszy czynnik wynika z dylematów nauk ekonomicznych, które ujawniły się w ostatniej dekadzie. Podstawowe problemy, które się pojawiają, są następujące:

1. Czy nauki ekonomiczne będą miały głównie wymiar normatywny czy wymiar deskryptywny?
2. Czy nauki ekonomiczne będą miały charakter bardzo formalny czy w dużym stopniu taki, jak nauki społeczne?
3. Czy badania empiryczne będą zajmować się przede wszystkim weryfikacją znanych (lub tworzonych) teorii czy raczej eksploracją danych (zwłaszcza Big Data) w poszukiwaniu nowych prawidłowości?
4. Czy będzie rosło znaczenie innych dziedzin w wyjaśnianiu zjawisk ekonomicznych, takimi dziedzinami są np. biologia, psychologia, socjologia, neurofizjologia?

5. Czy klasyczne podejścia stosowane w naukach ekonomicznych znajdują miejsce w wyjaśnianiu innych zjawisk, np. społecznych?

Drugi czynnik wynika z przemian, które zachodzą na świecie, a które – moim zdaniem – będą musiały znaleźć odzwierciedlenie w badaniach naukowych. Są to przede wszystkim:

- Przemiany technologiczne:

Automatyzacja zawodów, w tym robodoradztwo;

Automatyzacja transakcji, w tym transakcji finansowych;

Zastosowanie Big Data we wnioskowaniu;

Włączenie technologii łańcucha bloków do raportowania operacji ekonomicznych.

- Przemiany społeczne:

Rozwój gospodarki dostępu;

Rozwój sieci społecznych i sieci biznesowych;

Zmiany na rynku pracy (wzrost znaczenia niezależnych kontraktorów, odłączenie aktywności od konkretnej przestrzeni geograficznej).

Literatura:

1. E. Han Kim, Adair Morse, Luigi Zingales (2006), What has mattered to economics since 1970, Working Paper 12526, National Bureau of Economic Research.
2. Assar Lindbeck (2008), The Sveriges Riksbank Prize in Economic Sciences in Memory of Alfred Nobel 1969-2007, www.nobelprize.org.