

## ESEM '81

1981. augusztus 31-étől szeptember 4-ig Amszterdamban tartotta a Nemzetközi Ökonometriai Társaság (Econometric Society) évi európai tudományos tanácskozását, az ESEM '81 konferenciát.

A tanácskozáson 450-en vettek részt. Az évek sora óta megfigyelhető tendencia, hogy a szocialista országokból egyre kevesebben vesznek részt, ez évben is folytatódott; ezekből az országokból összesen 10-en, ebből Magyarországról 5-en jelentek meg.

A konferencia helye a „Vrije Egyetem” volt, egy modern, hatalmas területen fekvő egyetemi városrészben. A programbizottság elnöke az ökonometriai előadásokat illetően *Grayam E. Mizon* (Southampton), a közgazdasági előadásokat illetően pedig *Zean-Jacques Laffont* (Toulouse), a helyi szervező bizottság elnöke pedig az Egyetem egyik professzora *A. H. Q. M. Merkies* volt. A konferencia tiszteletbeli elnökségében helyet foglalt *Tinbergen* professzor is.

Az elnöki előadást *M. Nerlove* (Northwestern University, USA) tartotta „Várakozások, tervek, és realizációk: empirikus vizsgálatok” címmel.

Talán érdemes megemlítenünk, hogy a konferencia tematikai megosztása a két nagy témakör — ökonometria és közgazdasági szekciók — között nem fedi teljes mértékben a hazai szóhasználatot (fogalmi képet). Tévedés lenne ugyanis azt feltételezni, hogy az előbbiben valamennyi előadás modellezésről és módszertanról szól, az utóbbiban pedig a verbális, legfeljebb szerény matematikai apparátust alkalmazó előadások kaptak helyet.

A felosztás kritériuma az esetek zömében, a vizsgált közgazdasági problémától függetlenül — úgy tűnik — az volt, hogy idősoros vizsgálatokat alkalmazott-e a szerző, vagy egyéb matematikai apparátust. Természetesen kivételt nem nehéz e szabály alól sem találni; jól tudjuk, tapasztalatból, milyen nehéz egy-egy konferencián akárcsak egy közel konzekvens elrendezést adni az előadásoknak. Amit kiemelni itt, az elsősorban az, hogy az előadások zöme igen komoly matematikai apparátust vett igénybe a felvetett közgazdasági probléma vizsgálatában, akár egyik, akár másik területhez tartozott is.

A közgazdasági szekciók igen szerteágazók voltak. Főlegesen és hosszadalmas volna az összeset felsorolni, ehelyett a főbb közgazdasági kérdésköröket említjük meg:

- foglalkoztatás, munkanélküliség,
- ár, infláció,
- közületek gazdaságtana
- monetáris politika,

- disequilibrium, equilibrium,
- mikroökonomia,
- kelet-európai országok gazdasága.

A fenti kérdésköröknek az előadások számával mért súlya a nyugat-európai gazdaságok növekedését, fejlődését jelenleg is nagymértékben befolyásoló problémák szerint alakult. Kiemelt jelentőségűek voltak a munkanélküliség, az infláció, a disequilibrium és a közületek gazdaságtanával foglalkozó kérdések.

A „Disequilibrium és növekedés” szekcióban hangzott el például *P. Picard* (Paris) „Az infláció és növekedés egy nem-egyensúlyi makromodellben” c. előadása, ahol a szerző a disequilibrium problémát egy dinamikus modellben fogalmazta meg, amely az árak, a tőkeállomány, a pénz-egyenlegek és a munkaerőkínálat alkalmazkodási mechanizmusain alapul. Dinamikus modellje általános keretét illetően meglehetősen hasonló *Malinvaud* dinamikus modelljéhez. *Malinvaud* azonban speciális feltételezéseket tesz a bér-alkalmazkodásra, s így a stabil állapotot csak a Keynes-i munkanélküliség rendszerében jelenik meg. *P. Picard* modelljében a stabil állapotok különböző típusúak lehetnek, s fontos témája az exogén paraméterek és a stabil állapotok közötti viszony tanulmányozása.

Ugyanebben a szekcióban szerepelt e francia disequilibrium-iskola másik két tagjának előadása is. *P. Y. Henin*—*P. Michel* („Növekedésmélelet merev bérek és effektív keresleti korlátok feltételezésével: egy újrafogalmazás”).

Gyakorlatibb kérdések, valóságfeltáró törekvések jellemezték a „Makropolitika és disequilibrium” szekció előadásait, amelyek közül kiemeljük *J. Davidson* és *M. Keim* (London) előadását: „A pénzkínálat és a fizetési mérleg ökonometriai modellje az Egyesült Királyságban”. A szerzők a rendelkezésükre álló rövid idő alatt felvázolták az Egyesült Királyság monetáris szektorára egy dinamikus modellt, amelynek célja az, hogy a fizetési mérleg monetáris oldalról való közelítésének hipotézisét ellenőrizze, azt a szemléletet, hogy a fizetési mérleg deficitje a monetáris egyensúlytalanság eredménye. *P. Kooiman* és *T. Kloek* (Rotterdam) „A holland ipar empirikus egyensúlytalansági modellje” c. előadásukban a *Barro-Grossman*-féle disequilibrium-elmélet alapján kifejlesztett empirikus modellt mutattak be, amellyel — legalábbis a 70-es évek elejéig — jól képesek leírni a háború utáni holland konjunktúraciklusokat.

A kelet-európai szocialista országok gazdaságának problémái, úgy tűnik, nem divatosak az ökonóméterek, matematikai modelleket kidolgozó és felhasználó közgazdászok körében. Nyugat-európai ökonómétek sem foglalkoznak behatóan a disequilibrium és sajátos esetével. Azok a disequilibrium-elméletek, amelyek Nyugaton most egyre elterjedtebbek, s amelyek absztrakt szinten is kidolgozottak, foglalkoznak ugyan a „visszaszorított infláció” esetével, s emögé a fogalom mögé a kelet-európai szocialista országokat vetítik. Fel sem tesszik azonban maguknak a kérdést, hogy valóban úgy működnek-e ezek a gazdaságok, ahogy modelljeikben elképzelik. Ez vezet ahhoz, hogy modelljeikben nagyon leegyszerűsített, a valóságtól idegen képet adnak a kelet-európai disequilibriumról. E sajátos típusú disequilibrium ökonometriai vizsgálata elhanyagolásának több oka van. A legfontosabb mindenképpen az, hogy e gazdaságoknak a működése nincs még kifinomult matematikai apparátussal leírva és modellezve, s ismerve e rendszerek mechanizmusait, nem is biztos, hogy könnyen leírhatók.

Tizenhárom előadással a konferencia másik népes szekciója a „közületek gazdaságtanával” foglalkozott. Az itt tapasztalt nagy érdeklődés is igazolta: a költségvetés és nemzetgazdasági hatásainak elemzése a legdivatosabb téma napjainkban. A szekció szűkebb témáját ezen belül az adózási és támogatási rendszerek ösztönző, szabályozó hatásának vizsgálata képezte, ökonometriai modellek alkalmazásával. Jónéhány érintett kérdés a hazai gazdaságirányítás és szociálpolitika művelői és kutatói előtt sem ismeretlen.

A tőkés rendszer általános adózási elveit vizsgálta az amerikai *M. Osborne* (Columbia University) „Az adórendszer magyarázatáról: miért nagyobb egyes javak adóterhe, mint másoké?” c. előadása. Modelljében a különböző javakra eső adóteher az egyes gazdasági csoportosulások közötti megosztásként alakul ki, kifejezve ezek relatív erejét. Az elsődleges termelési tényezőket összehasonlítva megállapította, hogy a természeti tényezők (pl. föld) nagyobb adózási terhet viselnek mint az újratermelhető tényezők (pl. a munkaező), ami a munkatermelékenység növekedését fékezi.

Egy angol szerzőpáros, *J. P. Hutton* és *P. J. Lambert* (York) „Jövedelem-adó, inflációs adó és az adórugalmasság: modell az Egyesült Királyság esetére” c. előadása az adók és a jövedelmek kölcsönkapcsolatát vizsgálta, a 70-es évek Angliját modellezve. Végigkövették az adóalapot szolgáló jövedelmek aggregált alakulását, az adó-

besorolásokon történt változásokat, illetve az aggregált adóbevételeket. Számításaik végsősoron a jövedelmek nagyfokú adórugalmasságát mutatták ki.

Szintén az adózás hatásával foglalkozott *V. Kammiainen* és *J. Raatikainen* „Fiskális politika, pénzügyi közvetítés és inflációs-adó” c. előadása, de ők ezt az államkölesönakciókkal kapcsolatosan tárgyalták. Dinamikus vizsgálatuk során megmutatták, hogy a magas rátájú infláció körülményei között e finanszírozási forma — az inflációs adó, illetve támogatás-rendszerén keresztül — a gazdasági egyensúlyra destabilizálólag hat. Ugyanis az államkölesönökkel fedezett kiadások általában mindig „bővülékenyebbnék” mutatkoznak, mint az államkölesönök kihelyezése.

Egy svéd előadás, *P. Englund* és *M. Persson* (Stockholm) „Lakásárak és birtoklási választás aszimmetrikus adók és progresszívítás mellett” a ház-piacon kialakuló ár-színvonallal és ennek a fogyasztók lakásmegszerzési választására gyakorolt hatásával foglalkozik. Európa keleti felén sokszor értetlenül fogadjuk a jóléti társadalmakban is meglevő, és sokszor heves reakciókat kiváltó lakásproblémát; ez a dolgot a jelenséget és a kiváltó okokat is közelebb hozta. Modellszámításaik két fő tényezőt emelnek ki. Egyrészt a magas inflációs ráta — a kamatok reálértékének csökkentése folytán — magasra emeli az ingatlanok értékét. Másrészt — részben az előbbi tényezőből eredően — a jövedelemadózási rendszer az egyéb tőkejövedelmekhez képest fokozottabban sújtja a háztulajdonból eredőket. Mindezáltal a lakbérek igen magasra emelkednek. A bérházak piacán így túlkínálat van, ugyanakkor növekszik a saját házra törekvők aránya, és azok, akik az államtól várják lakásproblémájuk megoldását. Mindez viszonylagos kielégítetlenséghez, a költségvetésre nehezedő nyomás fokozódásához vezet.

Több előadás foglalkozott a társadalmi gondoskodás, a szociálpolitika hatékonyságának kérdéseivel. Így *A. Smith* (London) „Generációk közötti transferek mint a társadalmi biztosítás formái” című, valamint *R. Famulla* és *K. Spremann* (Ulm) „Generációk közötti megállapodások és kiterjedt költségvetési korlátok” című dolgozata a nyugdíjrendszereknek, mint társadalombiztosítási formáknak a hatékonyságáról szól. Az előbbi egy sztochasztikus elemeket is tartalmazó ún. népesség-generációs modell segítségével egy fix reálösszeget biztosító rendszert dolgozott ki, amely az előrejelezhető demográfiai változásokon (pl. a dolgozó korú népesség csökkenésén) kívül véletlenszerű elemeket is figyelembe vesz. A másik előadás az ún.

„tőkebiztosításos” (évjáradékos) rendszer és az ún. *pay as you go* rendszer tulajdonságait vetette össze.

Végül a szekció munkájából kiemeljük még *J. Hartog* „Az oktatás szubvencionálásának személyes előnyeiről” c. igen érdekes és nagy vitát kiváltó tanulmányát, melyben a szerző az oktatásra fordított állami kiadások hatékonyságát („hasznosulását”) kísérte meg felmérni. Fogyasztói viselkedési görbékre épített számításai azt mutatták, hogy a továbbtanulásban döntést hozó egyén által értékelt „hasznosság” — a különböző eseteket megvizsgálva — igen eltérő lehet a tényleges (a kormányzati költségvetésben jelentkező) kiadások összegétől.

Ez alkalommal is (miképpen Aix-en-Provence-ban, az Ökonometriai Társaság 4. Világkongresszusán) külön szekcióülést foglalkozott az exogenitás, valamint a kauzalitás kérdésével az ökonometriai modellezésben. Bár most nem került sor olyan heves vitákra, mint amilyent Aix-ben R. E. Kalmannak rövidesen e lapban is megjelenő előadása az ökonometriai modellezés elméleti megalapozottságával (illetve meg nem alapozottságával) kapcsolatban kiváltott, annyi azonban bizonyos, hogy a gyakorlati ökonometriai modellezésben eddig magától értetődő természetességgel használt olyan fogalmak, mint a kauzalitás vagy az exogenitás, nagyon sok tisztázandó és tudományos alapossággal fel nem tárt problémát hordoznak.

*J. P. Florens* (Aix-en-Provence) és *M. Mouchart* (Louvain) „Egy megjegyzés a nem-kauzalitásról” c. előadásukban a feltételes valószínűségi mezőkön definiált feltételes valószínűségi mértéken keresztül kívánják megvilágítani azt a kérdést, hogy egy sztochasztikus folyamat (például idősor) mely esetben tekinthető egy másik, esetleg több másik sztochasztikus folyamat „okának”; mikor állíthatjuk azt, hogy két (vagy több) sztochasztikus folyamat között kauzalitás áll fenn, illetve nem áll fenn (ez utóbbi esetben a szerzők „nem-kauzalitásról” beszélnek). A „nem-kauzalitás” definíciójával már korábban is foglalkoztak például *Granfer*, *Sims* és mások. Valamennyi szerző kitér arra a problémára is, hogy milyen kapcsolat áll fenn a „nem-kauzalitás” különböző definíciói és az exogenitás fogalma között. A vitában elhangzott olyan észrevétel is, hogy az újabb vizsgálatok, kutatások tükrében megállapítható, hogy az ökonometriai modellezők gyakran önkényesen tételezik fel változóik egy csoportjáról az exogenitást, következésképpen becsléseik s így verifikált modelleik sem lehetnek valósághűek. Hasonló észrevételek hangzottak el általában a szimulációval, különösen pedig gazdasági modellek (mégpedig nemcsak idősorokra épített modellek) ex-post és ex-ante szimulációjával kapcsolatban is.

FAUR TIVADAR—LACKÓ  
MÁRIA—ZIERMANN MARGIT