

Sobre supuestos irreales y su uso en modelos económicos

Daniel Herl

*Estudiante de Ingeniería Comercial
U. de Chile*

En el modelamiento económico se ha argumentado muchas veces en contra de los supuestos “irreales”, aquellos que se creen falsos o equívocos y que no tienen nada que ver con la realidad que nos muestran los datos empíricos. En la posición de estos críticos se observa una falta de atención a la intención de aquellos que esgriman este tipo de supuestos en los modelos que construyen. Para argumentar mi punto de vista y defender el uso de supuestos que se alejen de la realidad empezare con una pequeña definición de teoría y de “supuesto irreal”.

Entendiendo teoría, bajo las definiciones de Kanazawa (1998) y Nagel (1963), como una explicación causal para un fenómeno económico bajo un set de supuestos y postulados que tratan de acercarse a la fracción de la realidad o datos empíricos que se desea explicar.

Esto indica que el set de supuestos viene delimitar o a enmarcar el espacio en donde la teoría o modelo que se va a postular tiene efecto. Bajo esta definición podemos decir que los supuestos vienen a simplificar la realidad que se observa y disminuyendo la complejidad que se enfrenta.

Los supuestos vienen a ser los axiomas de los modelos, no son derivables de otros supuestos sino que son dados. No son ni corolarios ni hipótesis.

Así definiremos un supuesto irreal no como un supuesto falso o equívoco, sino como una aproximación incompleta a la realidad (Kanazawa, 1998), es decir, que deja de lado parte de la realidad para enfocarse en la realidad empírica delimitada que se desea explicar. O sea, se traza algo así como un

ceteris paribus con los supuestos. Musgrave (1981) diría que estamos incurriendo en un supuesto de dominio, o sea que definimos bajo que condiciones nuestro modelo es adecuado para explicar la realidad. Y justamente lo anteriormente explicado es lo que muchos investigadores y economistas buscan. Simplificar la realidad para el estudio particular de un fenómeno económico.

Friedman en su famoso ensayo “On the methodology of positive Economics” de 1953, llega a dos conclusiones bastante fuertes: 1) Que la relevancia y fortaleza de un modelo no recae en la veracidad o realismo de sus supuestos sino en lo acertado de sus predicciones; y 2) Que a mayor sea la irrealidad de los supuestos hechos más significativa será la teoría que recae en ellos.

Este último punto es apoyado fervientemente por Kanazawa (1998) quien dice que ceteris paribus, entre más irreales sean los supuestos hechos más parsimonioso y fructífero (o provechoso) será el modelo especificado.

Dado esto, entonces es importante darse cuenta de que los supuestos en cierta manera siempre serán empíricamente inexactos, esto no es algo malo per se, sino refleja que los supuestos son necesariamente simplificaciones de la realidad y ayudan a describirla de forma menos compleja, es decir, dejando ciertas partes del modelo fijo.

Lo fructífero de un modelo, o que tan provechoso, el definido tanto por Friedman (1953) como por Kanazawa (1998) como un ratio entre la cantidad de hipótesis desarrolladas y el número de supuestos usados para generarlas. Así entre mayor sea la cantidad de hipótesis y menor sea la cantidad de supuestos usados, más provechoso (y parsimonioso) será el modelo. De esta forma explica mucho con poco, extrayendo los puntos esenciales de una serie de circunstancias complejas que rodean un fenómeno económico que se desea explicar (Friedman, 1953). Un

ejemplo de un supuesto altamente cuestionado pero que es muy provechoso es el supuesto de racionalidad de los agentes económicos. Este supuesto por muy incorrecto y hasta irreal que sea permite desarrollar un sinfín de modelos de equilibrio parcial en donde se describe el comportamiento de estos agentes frente a diversas circunstancias y shocks que podrían enfrentar.

A su vez podemos ver que este supuesto delimita el campo de acción de la teoría y relaja la complejidad que esta enfrenta, pudiendo así enfocarse en otros aspectos del comportamiento económico de los individuos estudiados. Hemos visto en el punto anterior que la intención del autor es importante a la hora de juzgar si un supuesto es relevante, útil o inútil en la realización del modelo.

Para entender la intención de un autor en el uso de ciertos supuestos que pueden ser irreales o no. En esto Musgrave (1981) nos dice que hay tres tipos de supuestos:

Supuestos de Despreciabilidad, en donde se desprecia el efecto o la existencia de algún factor.

Supuestos de Dominio, que delimitan el marco en donde se puede aplicar la teoría armada.

Supuestos de Heurística, que provienen del desarrollo lógico de las bases de la teoría.

El uso de estos tres tipos de supuestos entregan la intención del autor y revelan pistas sobre que desea lograr con cada uno de los supuestos hechos, directamente dice que parte o subconjunto desea explicar del fenómeno económico que enfrenta. Es importante poner atención a la gramática usada al desarrollar los supuestos. Para reflejar esto usaremos un ejemplo sobre un supuesto bastante restrictivo hecho por Musgrave (1981). En primera instancia dice “Si es que entrega o no una diferencia detectable el poseer un presupuesto fiscal balanceado, se asumirá como que

balanceado esta” acá se entrega un supuesto de despreciabilidad, si dice “Si el presupuesto fiscal esta balanceado, entonces...” se entrega un supuesto de dominio y si dice “Asuma por el momento que le presupuesto fiscal esta balanceado (posteriormente relajaremos este supuesto)” se entrega un supuesto de heurística. Es así como el no redactar bien o el no entender bien lo que se lee puede llevar a malinterpretar la intención del autor a usar supuestos que se presumen “irreales”. El mismo ejemplo se puede hacer sobre el supuesto de la existencia de un gobierno en un modelo dado.

Un punto interesante entregado por Kanazawa (1998), hecho con una de las definiciones de Nagel (1963), es que como los supuestos “irreales” son definidos como supuestos que describen de forma “incompleta” la realidad de un fenómeno, puede entonces existir una suposición o declaración en donde se describa fielmente la realidad empírica que se desea representar, con toda su complejidad comprendida en ella. Sin embargo hasta que esta suposición no sea desarrollada y expresada, toda teoría será por tanto parcial e incompleta. Lo que no quiere decir que sea errada, sino simplemente se enfocan en un parte esta compleja y amplia realidad.

En conclusión, el hecho de hacer supuestos que otros tildan de “falsos” o “equivocos” no es más que una simplificación de la realidad, una medida de mitigación de la complejidad retenida en la realidad empírica. El uso de estos supuestos, mas que irreales son incompletos, además provee de un mejor aprovechamiento de las bases del modelo permitiendo tener una mayor cantidad de hipótesis a testear con una menor cantidad de supuestos. Así se obtiene un modelo más parsimonioso y simple para entender el efecto o la implicancia de diversas características de los datos empíricos.

No es menor dejar de recalcar que es importante entender con que fin se hacen estos supuestos y el comprenderlos es una parte

relevante a la hora de examinar su relevancia, ya que (como concluyó Friedman (1953) en su ensayo) los modelos debe ser juzgados no por cuan irreales sean los supuestos empleados, sino por lo acertado de las predicciones hechas.

Bibliografía:

Friedman, Milton. 1953. *Essays in positive Economics*. Chicago: University Of Chicago Press.

Kanazawa, Satoshi. 1998. "In Defense of Unrealistic Assumptions." *Sociological Theory*. 16: 193-204.

Musgrave, A.: 1981, "'Unreal assumptions' in economic theory: the F-Twist Untwisted", *Kyklos*, vol. 34, 377 - 387.

Nagel, Ernest. *The American Economic Review*, Vol. 53, No. 2, *Papers and Proceedings of the Seventy-Fifth. Annual Meeting of the American Economic Association*. (May, 1963), pp. 211-219.