

Azar, economía y política en Milton Friedman

David Teira Serrano

He de comenzar necesariamente con un breve párrafo de agradecimientos. En primer lugar, a la SLFMCE por la concesión de este premio (aunque me hubiera parecido igualmente merecido por cualquiera de las otras Tesis que participaron en la final). También, desde luego, a la comunidad de economistas y filósofos en la que se gestó mi trabajo, y aquí debo mencionar a sus directores (José Francisco Álvarez y Juan Carlos García-Bermejo) así como a la Fundación Urrutia Elejalde, cuyas actividades contribuyeron a traer a España un debate ya internacional. Por supuesto, a mis departamentos en la UNED y la EHES, a los que tanto debe la investigación histórica de mi Tesis. Me disculparán que omita aquí muchos otros.

Quizá el mejor modo de presentar mi Tesis sea recordar la pregunta que me hacía cuando me decidí a iniciarla: ¿cómo podía contribuir la ciencia social a una organización racional de la sociedad? La respuesta que yo creí encontrar en la economía es tan poco original como la pregunta: *calculando*. Un economista de la tradición neoclásica sabe cómo matematizar la explicación más simple que podemos dar de la acción a partir de creencias y deseos. Aun cuando quepa objetar la simplicidad de semejante punto de partida, que muchos tienen por poco realista, es innegable que mediante la teoría de la utilidad pueden analizarse situaciones sociales extraordinariamente complejas, desde la fijación simultánea de los precios en distintos mercados a la victoria en una votación. Con independencia de su éxito empírico, a menudo cuestionado, cabe reconocer, con Alexander Rosenberg, que semejantes análisis captan algunas de nuestras intuiciones normativas más fundamentales sobre la organización social: elucidan, por ejemplo, qué hay de racional en que nos pongamos de acuerdo. Es decir, quizá a muchos la economía les resulte poco científica, pero de entrada poco cabrá reprocharle como *matemática moral*. Al menos, así lo evidencia su impacto en la filosofía política contemporánea.

No obstante, lo que a mí me preocupaba no era cómo resolviese la economía nuestros dilemas normativos, sino de qué modo esa respuesta adquiriría contenido empírico. Es decir, en qué sentido era una ciencia y qué consecuencias políticas efectivas cabía obtener de ello. Milton Friedman es un economista que a muchos les resultará antipático, por razones que aquí omitiremos. Aun así, probablemente la suya haya sido la mejor respuesta a mi pregunta que produjera un economista del XX. En 1953, a sus 41 años, Friedman publicó un breve ensayo titulado «La metodología de la economía

positiva». Su tesis es bien simple: cuanto mejores sean las predicciones que pueda ofrecer una teoría económica, más científica será. Pero sus consecuencias políticas no son menos interesantes: en una democracia, argumenta Friedman, los electores quieren saber qué pasará si se aplica una política económica para decidir su voto. Pues bien, en virtud del acierto de sus predicciones, la economía positiva contribuirá a generar un consenso informando a la ciudadanía sobre qué ocurrirá en cada caso. En otras palabras, Friedman supo ver la dimensión empírica de un problema normativo y justificó metodológicamente al economista decidido a resolverlo. No estamos ya, por tanto, en la matemática moral, sino en la vieja tradición de la *aritmética política*: el cálculo puesto al servicio de los asuntos de Estado.

La pertinencia de la solución propuesta por Friedman parecía estar asegurada por, al menos, estos tres datos: sus teorías económicas le valieron el Nobel de la disciplina; su argumentario político le convirtió en uno de los más influyentes neoliberales del siglo pasado; y su ensayo metodológico, articulando ambas vertientes, fue uno de los textos más populares entre los economistas del XX. Desde un punto de vista filosófico, tenía ante mí, por tanto, un problema de *epistemología social*: un economista justificaba metodológicamente sus teorías, antes sus colegas y ante sus conciudadanos, para que estas pudieran tener efectos políticos. La pregunta era, por tanto, en qué condiciones resultaba aceptable tal justificación.

Al responder, pretendí no solamente obtener un doctorado en filosofía, es decir, contentar a mi propio gremio. Quise también, en primer lugar, que mis conclusiones resultasen pertinentes para los propios economistas y ello me obligaba a plantearme el análisis de las tesis de Friedman no únicamente desde el punto de vista de su estructura argumental. Su ensayo metodológico no se planteaba como un ejercicio de análisis conceptual, sino como prefacio a una colección de trabajos de economía. Su pretensión era dar cuenta de una práctica científica real y la normatividad de sus conclusiones se derivaba en buena parte del éxito de tal práctica. De ahí que, en segundo lugar, pretendiera que mi reconstrucción de su práctica resultase lo suficientemente sólida como para resistir las objeciones provenientes de la Historia y la Sociología de la economía. Quién mejor que Friedman para levantar la sospecha de ocultar oscuros intereses bajo una pretendida objetividad positiva.

Así pues, dividí mi Tesis en tres partes que biográficamente podríamos enumerar así: una primera sobre la educación económica de Friedman, una segunda sobre su

educación estadística y una tercera sobre sus propios resultados. Comentaré brevemente qué obtuve en cada una.

La primera parte pretende ubicar los trabajos de Friedman en una tradición más amplia, la de la teoría de la demanda neoclásica, cuyos orígenes se remontan a los trabajos de Walras y Marshall en el último cuarto del siglo XIX. Metodológicamente, las explicaciones que esta tradición nos proporciona suelen considerarse canónicos en filosofía de las ciencias sociales. Por una parte, la acción de un agente en un mercado es explicada intencionalmente a partir de la matematización de creencias y deseos articulada sobre la teoría de la utilidad. Por otro lado, la suma de acciones individuales explica por agregación de sus efectos en los precios (por ejemplo, la consecución del equilibrio). La combinación de estos dos principios (intencional y suprainintencional) nos asegura, en principio, la corrección metodológica de una explicación. Sabemos que una teoría falsa probablemente genere explicaciones incorrectas, pero no está muy claro qué relación exista entre explicaciones correctas y teorías verdaderas. Mi tesis es que cabe reconstruir buena parte del debate en teoría de la demanda entre 1875 y 1939 a partir de la posición adoptada por cada autor a propósito de esta disyuntiva: cómo articular veracidad teórica y corrección explicativa.

Hablar de verdad a propósito de la economía puede parecer muy atrevido y más todavía el atribuirle posiciones epistemológicas propias a los economistas. Muchos filósofos lo considerarán exagerado por ser la verdad una de esas propiedades teóricas cuya explicitación debe ser reconstruida racionalmente a partir de los resultados científicos. A su vez, a los sociólogos de la *sospecha* probablemente no les sirva de mucho la posición filosófica que su propio autor pueda adoptar sobre sus resultados si se trata de explicar su negociación. Mi propia posición a este respecto es la siguiente: la estadística fue el aparato formal del que se sirvieron los teóricos de la demanda para articular tanto su posición respecto a la verdad como sus mismas explicaciones.

Por parte de los filósofos, un obstáculo evidente para aceptar esta tesis radica en que cuando pensamos en la reconstrucción racional de una teoría científica se suelen emplear técnicas distintas a las que usa el propio autor para obtener sus resultados (desde la teoría de modelos a los cálculos verosimilistas). Había que mostrar, por tanto, que la estadística vehiculaba propiedades epistémicas que no requerían una reconstrucción ulterior. Un primer ejemplo estudiado en mi Tesis es el del positivismo estadístico, la lectura de Mach desarrollada a principios del siglo XX por Karl Pearson y exportado a la econometría por Henry Ludwell Moore. Según estos positivistas, una ley

científica no era sino una *descripción* estadística de los datos que ponía de manifiesto un cierto grado de asociación entre ellos. Por más que Pearson sea filosóficamente mucho más ingenuo que Carnap, lo cierto es que su propuesta resultaba mucho más operativa para el científico deseoso de verificación empírica. Y este era precisamente el caso de los teóricos de la demanda. Ni Walras ni Marshall se plantearon la cuestión de cómo justificar empíricamente sus tesis sobre el comportamiento de los agentes económicos en el mercado. Para ellos la ley de la demanda constituía una evidencia racional cuya contrastación no requería un tratamiento sistemático de los datos. La originalidad de autores como Moore consistió en reformular los principios neoclásicos con arreglo a las técnicas de Pearson. Y obtuvieron resultados polémicos, donde se puede apreciar hasta qué punto a estas técnicas iba aparejada una posición epistemológica.

La ley de la demanda neoclásica no es sino una curva con pendiente negativa que representa la inclinación del agente a disponer de una unidad adicional de una mercancía. La demanda agregada se obtendría entonces sumando demandas individuales. La posición de Moore a este respecto no pudo ser más clara: puesto que se trata de una curva veamos si una regresión sobre los datos agregados confirma el signo de la pendiente. Moore se encontró con que esto no sucedía siempre y, como buen discípulo de Pearson, decidió que la ley de la demanda tendría que ser aquella que se obtuviese directamente desde los datos agregados, con independencia de cualquier hipótesis sobre el comportamiento individual en el mercado. En otras palabras: las técnicas disponibles para verificar una teoría se imponen sobre la corrección de las explicaciones que nos proporciona. Si podemos describir una regularidad en los datos macroscópicos, no necesitamos pronunciarnos sobre el mecanismo microscópico que la genere, aun cuando esto suponga subvertir el principio explicativo de la propia tradición neoclásica.

Obviamente, la posición de Moore fue contestada, pero para ello se requería reinterpretar sus técnicas desde una instancia epistemológica alternativa. Vilfredo Pareto se apoyó en Henri Poincaré para reconstruir empíricamente la teoría de la demanda, lo cual exigía reformular sus ecuaciones de modo tal que se vaciaran de contenido inobservable (por ejemplo, hipótesis psicológicas sobre la utilidad) y describieran estructuras presentes en los datos. En los años 1920 Henry Schultz, discípulo de Moore y maestro de Friedman, intentó verificar estadísticamente la propuesta de Pareto según un principio *adecuacionista*. Contestar la posición de Moore suponía especificar un procedimiento que mostrase cómo aparecían en los datos las estructuras previstas por la

tradición neoclásica. Schultz se sirvió de dos: diseño de experimentos sobre la conducta individual (de los que se infiriese su curva de demanda) e hipótesis sobre la corrección de errores en los datos agregados (con las que se extraerían curvas con una pendiente acorde a las previsiones de Walras y Marshall).

No cabe esperar de Schultz la sutileza conceptual que imprimió Tarski a la verdad como adecuación. Pero, de nuevo, la ventaja de la propuesta de Poincaré radica en desvelar en la propia práctica científica su dimensión epistemológica sin necesidad de una reconstrucción externa. De hecho, el debate que siguió a la propuesta de Schultz puso de manifiesto su incapacidad para resolver un problema que el positivismo lógico todavía tardaría en tematizar: la infradeterminación de la teoría por los datos. Las hipótesis sobre corrección de errores necesarias para verificar la existencia de curvas de demanda agregada no podían contrastarse separadamente y había que reconstruir, en realidad, múltiples curvas sin que la estadística pudiera discriminar cuál resultaba más adecuada.

A finales de los años 1930, los economistas de la generación de Friedman aceptaban que la ley de la demanda no constituía una *descripción* estadística de los datos ni una estructura algebraica que se *adecuase* a ellos: su aceptación no podía depender por tanto de la posibilidad de verificar una teoría completa, sino de que cumplierse ciertos criterios de confirmación necesariamente parciales. De ahí el instrumentalismo de Friedman: no nos importará el realismo de la ley de la demanda; puesto que la estadística es la técnica que vehicula las propiedades epistemológicamente interesantes para el economista empírico, tomemos el éxito predictivo como criterio de elección entre teorías.

En suma, contra la pretensión sociológica de que los problemas de los que se ocupa la filosofía de la ciencia son algo así como una invención gremial, en esta primera parte de mi tesis intento mostrar que, al menos en el caso de la economía, se derivan de la propia práctica científica y contribuyen a informarla. Pero, del mismo modo, diremos también que los economistas no necesitaron de los filósofos para resolver sus obstáculos. El caso de Friedman resulta particularmente ilustrativo a este respecto.

En esta misma década de los 1930, Popper daba forma a su falsacionismo con ayuda de la teoría de la probabilidad. Paralelamente Friedman daba forma a sus argumentos con ayuda de la inferencia estadística. En ambos casos, las predicciones constituían el eje central de la científicidad y muy a menudo se interpretó el ensayo metodológico de Friedman como la introducción de la metodología popperiana en economía. Pero si el de Friedman era, como anticipábamos, uno de epistemología social (¿por qué el público

debe confiar en las predicciones científicas al tomar decisiones políticas?), conviene que nos detengamos brevemente en la singularidad de su planteamiento.

Justificar nuestra elección entre teorías apelando a su éxito predictivo es un lugar común en filosofía de la ciencia. Sin embargo, durante muchos años no abundaron las respuestas sobre qué podía considerarse un éxito predictivo, es decir, cómo evaluar una predicción. No obstante, esta era una pregunta que conocía ya una amplia colección de respuestas entre los estadísticos de la primera mitad del XX. Si Popper partía de la insolubilidad del problema de la inducción para desarrollar su propio falsacionismo, Ronald Fisher, el padre de la inferencia estadística entendía que la práctica científica exigía más bien una técnica para decidir en qué condiciones estaban justificados cierto tipo de razonamientos inductivos, la estimación del valor de un parámetro poblacional a partir de una muestra. Establecidos ciertos criterios generales, como la suficiencia de un estadístico, los estimadores de máxima verosimilitud constituirían, para Fisher, la mejor aproximación a este valor, aquella que no podría ser cuestionada sin conmover los cimientos de la propia estadística. La universalidad de esta estimación, argumentaba Fisher, la volvía tan convincente como podía serlo cualquier cálculo deductivo.

En mi Tesis intento mostrar cómo Friedman creció en esta tradición junto a Harold Hotelling, uno de los padres de la estadística estadounidense, pero pronto pudo conocer también el desafío que Jerzy Neyman le planteó a Fisher al plantear su teoría de los intervalos de confianza. En ella, la estimación de un parámetro exigía asumir una probabilidad de error que variaba dependiendo de la aversión al riesgo de cada estadístico. Para Neyman, no había una justificación unívoca de nuestras inferencias, como pretendía Fisher, sino una racionalización de nuestro comportamiento inductivo, esto es, una sistematización consistente de los riesgos que un científico asumía en sus predicciones. Evaluar una predicción suponía establecer de antemano qué margen de error es aceptable y atenerse a él en lo sucesivo. Contra lo pretendido por Fisher, esta era una decisión convencional, pero eso no suponía que, una vez adoptada, la evaluación resultase arbitraria.

En los años 1940 Abraham Wald reinterpretó desde el enfoque de Neyman el conjunto de la estadística inferencial y Jimmie Savage le dio un nuevo giro epistemológico incorporándole una perspectiva bayesiana. Su tesis era sumamente seductora: puesto que evaluar una predicción supone revisar nuestras creencias, si nos ponemos de acuerdo en ciertos axiomas que establezcan cómo efectuar tal revisión, cabe asegurar que, en ciertas condiciones, nuestras creencias convergerán. Friedman colaboró con Savage en el

desarrollo de sus intuiciones estadísticas y cabría argumentar que su mérito consistió en saber exportarlas a la metodología económica.

Recordemos el problema de partida: no cabe verificar en sentido estricto la teoría de la demanda sino someterla a contrastación indirecta mediante predicciones. Pues bien, argumentaba Friedman, cabe racionalizar este proceso si acordamos cómo evaluar una predicción pues esto aseguraría la convergencia de nuestras opiniones sobre el valor de una teoría. La virtud de este procedimiento es que, del mismo modo que asegura la convergencia de las opiniones de los economistas sobre sus teorías, posibilitaría también la aparición de un consenso entre los ciudadanos. Es decir, los votantes confiarán en los economistas porque podrán verificar sus predicciones, y esta verificación les servirá a ellos mismos para revisar sus propias creencias sobre política económica, concediendo mayor crédito en sucesivas ocasiones a quien mejor prediga sus consecuencias. De esa manera, del mismo modo que en la comunidad científica, aparecerá el consenso en materia económica en una democracia.

Es decir, la estadística permite justificar las decisiones científicas sobre el valor que se concede a una teoría, incluso cuando ésta encuentra obstáculos epistemológicos tan desafiantes como la infradeterminación. Nótese que se trata de justificar una decisión práctica para salvarlo y seguir adelante en la investigación, y no resolverlo. La virtud de este procedimiento de justificación es que constituye una norma (sobre cómo evaluar el éxito predictivo) que puede aplicarse igualmente a decisiones mundanas si estas dependen de alguna predicción sobre sus consecuencias. En este sentido la estadística se nos presenta como una disciplina normativa, cuya normatividad se deriva de la propia necesidad de decidir. La justificación que se busca no es la del empirismo lógico que exige la resolución de cuestiones tales como la propia infradeterminación, sino la del propio avance en la investigación (y, si se trata de política económica, en el mundo).

¿Era entonces Friedman un epistemólogo social sin saberlo? Pese a todo, mi respuesta es *no*. Su autoproclamado positivismo es real, en la medida en la que entiende que tanto el científico como el ciudadano actúan desinteresadamente al evaluar sus predicciones. Es decir, Friedman cree en la ética científica glosada por Merton y como trato de mostrar en la tercera parte de mi tesis, ello frustra su solución en su propia práctica. Un análisis del uso de la predicción los trabajos económicos de Friedman sobre demanda y consumo muestra cómo su presunta epistemología social sería, en todo caso, la más ingenua: aquella que espera que el acuerdo entre científicos se produzca con independencia de sus intereses personales (por su propio reconocimiento o por su

ideología política). Aun sin detenernos en este análisis, diré simplemente que intento mostrar que la clave de su éxito académico y mundano radica en la solución metodológica de un dilema real. Aun sin estar seguros de la veracidad de sus teorías (principalmente por su ausencia de realismo), un economista puede justificar sus resultados sobre unas bases que son, además, socialmente relevantes: sus predicciones. De todo ello cabe extraer distintas moralejas filosóficas. Me detendré sólo en una: cabe plantearse una aproximación filosófica a la ciencia en la que intentásemos racionalizar el propio contexto de justificación científico antes que proponer uno exento. Hemos de suponer para ello que los dilemas teóricos que enfrentamos gremialmente se corresponden de algún modo con las dificultades que los propios científicos experimentan en su práctica. En este sentido, diríamos que en el descubrimiento hay también una justificación, y se trataría de explotar sus posibilidades filosóficas en vez de declararlo inane por no casar con nuestras expectativas epistemológicas más exigentes o por considerarlo socialmente viciado. La tarea es, por tanto, la de la justificación de tales normas y la intuición que cabe extraer de este relato de economistas es que se nos exige ante todo dar cuenta de un acuerdo sobre cómo evaluar nuestros resultados. Mi propia apuesta a este respecto (en discusión principalmente con Fernando Broncano y Jesús Zamora) es contractualista, pero eso sería motivo de otra tesis doctoral (y otro discurso).