

DÜŞÜNGÜSELLİK VE LUCAS

Mine KARA

Özet:

Önde gelen sosyal bilim okulları ve neoklasik iktisat, 'yapıp, eyleyen' aktif birey anlayışından yoksundur. Eylem kavramı ile insanın düşüngüsellığı, yani, insanın kendisi ve başkaları üzerinde gözlem yapması, düşünmesi ve davranışlarını buna göre denetlemesi, yakından bağlantılıdır. İlginçtir ki, neoklasik okulun içinde yer alan Lucas, düşüngüsellığe önem veren bir iktisatçı olmuştur. Bu makale, neoklasik okulun bilgi teorisindeki bazı temel noktaları, Lucas'ın düşüngüsellik kavramı bağlamında irdelemekte ve Lucas'ın analizinin neden aktif birey anlayışından uzak kaldığını ele almaktadır.

Abstract:

Reflexivity and Lucas

Most of the leading schools in social sciences and neoclassical economics lack a concept of human action and active human. Reflexivity is an integral element of a human action. Although he is one of the famous names of neoclassic school, Lucas acknowledged the importance of reflexivity. In this paper it is argued and criticized the underlying ontology of neoclassic school in the context of Lucas's approach to reflexivity, which is fail to be related with active human.

Anahtar Sözcükler: Lucas'ın 'Eleştirisi', düşüngüsellik, indirgenmiş biçim modelleri ve yapısal modeller, Lucas'ın dönemsel dalgalanma modeli, rasyonel beklentiler, pozitivist bilgi teorisi, içsel ve dışsal kapatma.

Keywords: Lucas Critique, reflexivity, reduced form models and structural models, Lucas' business cycle theory, rational expectations, positivist theory, intrinsic and extrinsic closure.

GİRİŞ

Sosyal bilimler ve iktisat, insan eyleminden ya da ‘yapıp, eden’, kendisini ve çevresini değiştiren aktif insan kavramından yoksundur (Bu konuda bkz. Kara, 2001: 11-33). Öncelikle burada insan eylemi ve buna bağlı olarak düşüngüsellik üzerinde duracağız. İnsan eylemi, bir çok ortodoks sosyal bilim okulunun kabul ettiği gibi, insan hareketlerinin yanyana getirilmiş bir hali değildir. Onun yerine insan eyleminin tabakalaşma modeli (Giddens, 1999: 44-47), çok daha kapsamlı ve inandırıcı bir model ortaya koymaktadır. Bu model, insan eyleminin parçaları olan *eylemin güdülenmesini, ussallaştırılmasını ve düşüngüsel gözetimini*, benliğin içine gömülmüş süreçler kümesi olarak değerlendirmektedir. Bu söylediklerimizi biraz açıklayalım: İnsan eyleminin en altında bir *güdülenme* söz konusudur. Güdüler eylemi uyaran isteklerdir. Ancak güdüler bir çok ortodoks davranış yaklaşımında doğrudan eyleme dönüşüymüş gibi kabul görmektedir. Oysa insanlar toplumsal yaşamda isteklerini güdülerine bağlı olarak ortaya koymazlar. Güdüler büyük ölçüde içinde eylemin gerçekleştirileceği tasarılar ya da projeler sağlar. Dolayısıyla eylemin en temelinde bir güdülenme olabilir. Ancak insanlar bunu bu noktada eyleme dönüştürmeyip, önce usavururlar. *Eylemin ussallaştırılması*, günlük hayatta bireylerin davranışlarını belli gerekçelerle açıklayabilmeleridir. Bu açıklama, belli bir eylemi yerine getirenin sadece kendisinin ne yaptığını bilmesini değil, diğer insanlarla olan etkileşimini de kapsamaktadır. İşte bu noktada *eylemin düşüngüsel gözetimi* devreye girmektedir. Bu gözetimden kastedilen şudur: Etkinlikleri yapanlar sürekli olarak kendi etkinliklerini ve bu etkinliklere çeşitli toplumsal durumlar altında diğer bireylerin verdiği tepkileri gözetirler. Bu arada diğer bireylerin de aynı şeyi yapmasını beklerler. Etkinliğin düşüngüsel gözetimi günlük eylemin devamlı bir niteliği olup, toplumsal davranışı ele alması bakımından önemlidir. Lawson, düşüngüsel gözetimi, trafikte araba kullanan sürücülerin davranışlarına benzetmektedir (Lawson, 1997: 177). Burada sürücüler belli trafik kuralları altında ne yapacaklarını bilir ve diğer sürücülerini de devamlı olarak gözlerler. Yapacakları belli hareketler sonucunda diğer sürücülerin kendi hareketlerine ne şekilde cevap verebileceklerini de tahmin edebilir ve aynı şekilde diğer sürücüler tarafından gözlemlendiklerini bilip, buna göre davranırlar. Kısacası, düşüngüsellik, insan eyleminin önemli bir parçası olup, insanın, kendisinin ve başkalarının davranışı üzerinde gözlem yapması, düşünmesi ve davranışlarını buna göre ayarlaması ve değiştirmesi şeklinde tanımlanabilir.

İktisadı yakından ilgilendirmekle birlikte, düşüngüsellik, neoklasik iktisat tarafından davranışsal bir kabul olarak fazla üzerinde durulan bir kavram olmamıştır. İktisat yazınında düşüngüselliği ve toplumsal rasyonalite kavramını öne çıkartan bir iktisatçı J. M. Keynes'tir. Örneğin Keynes, hisse senetleri piyasasında bireylerin davranış biçimini düşüngüselliğe bağlı olarak açıklamaktadır. Nitekim, hisse senetleri piyasasında beklenti oluşumu

Keynes'te diğer bireylerin nasıl davranacaklarının tahmini ile ilişkilidir. Burada sermaye piyasasında hareket edenler için önemli olan, hisse senedinin gerçek değeri değil, kitle psikolojisi altında üç ay veya bir yıl içinde bir hisse senedine piyasa tarafından ne değer biçileceğidir. Keynes'e göre, bu şekilde oluşan beklentiler hisse senetlerinin fiyatlarını belirlemektedir. Zamanlararası piyasalarda da yatırım davranışını veren bu durum Keynes'te piyasa dengesizliklerinin ana nedenlerinden birisi olabilmektedir. Dikkat edilirse burada davranış, toplumsal bir temele dayanabilmekte ve rasyonalite başkalarının rasyonalitesine göre belirlenmektedir. Bu davranış şekli hisse senetleri piyasasında genel olarak kabul edilmekle birlikte, neoklasik iktisat tarafından bu biçimde ele alınmamaktadır. Neoklasik iktisatta hisse senetleri piyasasında bu şekilde oluşabilecek davranış biçimleri ve hisse senetlerinin fiyatlarında meydana gelebilecek aşırı yükselme veya düşüşler "Balon" (Bubbles) yaklaşımı ile değerlendirilmekte, ancak uzun dönemde bu tür eğilimlerin kendiliğinden ortadan kalkacağına inanılmaktadır (Blanchard ve Fischer, 1989: 233).

Ancak, düşüngüsellik, neoklasik iktisatta hiç ele alınmamış bir kavram değildir. Neoklasik iktisatta düşüngüsellikğin önemini vurgulayan bir iktisatçı, ünlü "Eleştiri"si ile R. E. Lucas (1983a: 257-285) olmuştur. Lucas "Eleştiri"sinde, iktisadi birimlerin davranışlarının uygulanan iktisadi politikalara göre değişeceğini, zira bireylerin piyasayı ve hükümetin uyguladığı politikaları gözlediğini ve iktisadi davranışlarını buna göre ayarladığını belirtmektedir. Bu bakımdan Lucas, devrinin ekonometrik uygulamalarını bireylerin bazı davranışlarının hiç değişmediğini varsayarak aynı davranışsal parametreleri farklı politika uygulamaları altında kullanmaya devam ettiklerine işaret ederek eleştirmektedir. Örneğin, Lucas bireylerin parasal yanılgılara kapılmayacaklarını ve buna bağlı olarak devamlı hale gelen bir enflasyon karşısında artık parasal değil, reel değerlere göre hareket edeceklerini belirtmektedir. Bu yazıda üzerinde duracağımız asıl nokta şudur: Acaba Lucas bu eleştirisine ve düşüngüsellikğe verdiği öneme rağmen, neoklasik iktisatta göremediğimiz aktif birey anlayışına ulaşabilmekte midir? Lucas'ın iktisadi bireyleri aktif bireyler midir? Bunun için önce Lucas'ın eleştirilerini daha yakından ele alıp, daha sonra da kendisinin bilgi teorisi üzerinde duracağız.

1. LUCAS'IN KEYNESÇİ MAKROEKONOMİK UYGULAMALARA YÖNELİK ELEŞTİRİSİ

Lucas 1976 yılında yayımladığı "Ekonometri Politikasının Değerlendirilmesi: Bir Eleştiri" adlı makalesinde, (Lucas, 1983a: 257-285) ve diğer çalışmalarında (Lucas, 1983b: 1-25; 1987a: 1-20), özellikle II. Dünya Savaşı sonrasında hız kazanmış olan Keynesçi makro-ekonometrik uygulamalardaki bazı problemlere değinmekte ve bunları eleştirmektedir.

Aşağıda daha ayrıntılı bir biçimde ele alınmış olan bu problemler, “indirgenmiş biçim” (reduced form) modellerinin ve “yapısal” (structural) modellerin etrafında toplanmaktadır. Lucas’ın eleştirisinin temel noktası şudur: Her iki modelde de hükümetler tarafından uygulanan iktisadi politikadaki değişiklikler sonucu, bireylerin tercihlerinde meydana gelebilecek değişiklikler hesaba katılmamaktadır. Lucas’a göre, bu modellerde, yapısal olarak istikrarlı ilişkiler aranmakta ve bu ilişkilerin, uygulanan ekonomik politikalar değişse de değişmeyeceği varsayılarak analizlere devam edilmektedir. Nitekim uygulamalarda, belli iktisat politikalarının uygulandığı dönemlerde elde edilen parametre tahminleri, farklı iktisat politikaları altında tekrar kullanılmakta ve bu farklı politikaların sonuçları değerlendirilmeye çalışılmaktadır. Böyle bir uygulama, söz konusu parametre tahminlerinin hiç değişmeyeceği varsayımı altında mümkündür. Lucas, durumu şöyle açıklamaktadır (Lucas, 1983a: 263):

“Ekonometrik ilişkilerin ardında aranan yapı, aslında ekonomideki bireylerin kararlarına bağlıdır ve bireylerin içinde bulunduğu şartlar altında, teorik olarak bu kararlar optimaldir. Optimal kararlar optimizasyonun yapıldığı zamandaki durum ve şartlara bağlıdır. Farklı ekonomik politikaların uygulandığı şartlarda ise bireylerin kararları ve dolayısıyla, değişmediği varsayılan bu yapı değişecektir.”

O zaman bu modellerin, farklı iktisat politikaları uygulandığı zamanlarda, bu alternatif politikaları değerlendirmek üzere kullanılmaları yanlış bir harekettir, zira daha önceden tahmin edilen parametrelerin değişikliğe uğrayacağı oldukça açıktır. Lucas’ın yorumuyla, “bu parametrelerin değişmeyeceği varsayımı altında hareket etmek ise, maksimize edilen fonksiyonu oluşturan unsurlardaki değişikliklerin, maksimizasyon probleminin sonucunu değiştirmeyeceğini varsaymaktır! ” (Lucas, 1987a: 11)¹

1.1. İndirgenmiş Biçim Modelleri

İndirgenmiş biçim modellerinde ekonomik sistemin durumu aşağıdaki fark denklemi ile tanımlanmaktadır (Lucas, 1987a: 7-9):

$$s_{t+1} = F(s_t, e_t). \quad (1)$$

Sistemin, $t+1$ döneminde nasıl değişeceği, sistemin t dönemindeki durumunun (S_t) ve $G(e)$ gibi sabit bir fonksiyondan doğan dışsal şokların (e_t) bir fonksiyonu şeklinde belirtilmektedir. Burada S_t , sistemdeki bireylerin t dönemindeki tüketimi, sermaye malları stoku, politika değişkenleri gibi bir çok parçadan oluşan bir vektördür. Benzer şekilde e_t de çok parçalı bir vektördür. Lucas’ın eleştirdiği uygulama ise şudur: Geçmişe dair ekonomik verilere bakılarak F ve G tahmin edilmektedir. Buradan durum vektörü adı verilen S_t saptanmaktadır. Bu yolla da S_t nin gelecekteki değerleri tahmin

edilebilmektedir. Ancak burada Lucas'ın altını çizdiği nokta şöyle özetlenebilir: Gelecekteki değerlerin tahminlerinin güvenilir olabilmesi için, söz konusu indirgenmiş biçim formunun içerdiği ilişkilerin zaman içinde değişmemesi gerekir. Oysa, makroekonomide amaç, ekonomi politikalarındaki değişimin, bireylerin iktisadi tercih ve refahlarını ne yönde değiştirdiğine bakmaktır. Ancak, yeni bir ekonomi politikası uygulandığında F , F' gibi yeni bir noktaya gelebilecektir. Zira, yeni bir ekonomi politikası uygulandığında, F de belirtilen ilişkileri değiştirecek ana unsurlardan birisi, bireylerin kararlarındaki değişimdir. Dolayısıyla böyle bir uygulama yanlış sonuçlar verebilecektir.

1.2. Yapısal Modeller

İndirgenmiş biçim modellerinin sakıncaları başka iktisatçılar tarafından da ele alınmıştır. Örneğin, Jacop Marschak, indirgenmiş biçim modelleri yerine, yapısal tahminleri kullanmanın daha yerinde olacağını belirten iktisatçılardan birisidir (Marschak, 1953: 1-26).

Yapısal modeller, indirgenmiş biçim modellerindeki F fonksiyonuna, bireyin hareketi (a_t) ve hükümetler tarafından izlenen politikalar (z_t) gibi unsurlar katılarak daha rafine bir hale getirilen modellerden oluşmaktadır. Bu durumda s_{t+1} , şöyle belirtilebilmektedir (Lucas, 1987a: 10-11):

$$s_{t+1} = H(z_t, a_t, s_t, e_t)$$

Burada, ekonominin durumu (t döneminde) s_t iken, uygulanan iktisadi politika, $z_t = z(s_t)$ ile, i bireyinin eylemi $a_{it} = a_i(s_t)$ ile, ve tüm bireyler tarafından alınacak kararlar ise, $a_t = a(s_t)$ ile belirtilmektedir. Bu yeni durumda F , şöyle yazılabilmektedir:

$$F(s_t, e_t) = H(z(s_t), a_i(s_t), s_t, e_t) \quad (2)$$

İndirgenmiş biçim modellerindeki benzer şekilde, dönemin yaygın uygulamalarından bir tanesi de şudur: Makro-ekonometrik modeller büyük çaplı denklem sistemlerinden oluşmaktadır ve bunların, tüketicilerin, firmaların ve hükümetlerin davranışlarını tanımladıkları kabul edilmektedir. Bu denklemlerin parametrelerinin "yapısal" olduğu, diğer bir deyişle, ekonomide istikrarlı bazı ilişkileri verdiği ve farklı politika uygulamaları altında da değişime uğramadıkları varsayılmaktadır. Bunu, yukarıdaki denklemler cinsinden ifade edersek, $z(\cdot)$ fonksiyonu değiştiğinde, $H(\cdot)$ ve $a(\cdot)$ fonksiyonlarının değişmediği varsayılmaktadır. Oysa, demektir Lucas, "durumun böyle olduğuna inanmamız için hiç bir neden yoktur" (Lucas, 1987a: 11). Lucas, tam tersine şöyle düşünmektedir: Makroekonomik modellerdeki denklemler, belli bir dönem için ekonominin durumu verilmişken, bireylerin ekonomik tercihlerini yansıtan kararların üzerine kurulmuştur. Bu kararlar ise, uygulanan iktisadi

politikalara bağılı olarak beliren, gelecekteki beklenti kavramını da içermektedir. Eđer, politikacılar yeni iktisadi politikalar benimserlerse, o zaman bireylerin geleceęe dair beklentileri deęiőeceęi için, verdikleri kararlar da deęiőecektir. O halde, belli bir döneme ait parametrelerle, deęişik iktisadi politikaların kullanıldığı başka bir dönemdeki iktisadi deęişkenlerin bu deęişikliklerden nasıl etkileneceğini kestirmeye çalışmak yanlıştır. Zira, bu parametreler bireylerin kararlarıyla doğrudan ilişkilidir ve yeni iktisadi politikalar bu parametreleri deęiştirecektir. Lucas sonuç olarak eleştirilerini, kendi belirttięi anlamda bir dinamik yaklaşımdan uzak olan Keynesyen modellere yöneltmekte ve bu modellerin Marshall'dan gelen statik ve kısmi yapısını eleştirerek, şöyle demektedir: (Lucas, 1987a: 2)

“Keynes ve bugünkü makroekonominin kurucuları, tamamen statik bir teoriden işe yarar dinamikler çıkartabilmek için Marshall'cı görüşlere mahkumdular. Oysa günümüz iktisatçıları istedikleri problemi belirlemek ve bunu çalışmak için çok daha iyi analiz aletlerine sahiptirler.”

2. LUCAS'IN BİLGİ TEORİSİ

Lucas, Keynesyen iktisadı sadece statik bulduęu için eleştirmemektedir. O'na göre Keynes, iki dünya savaşı arasında doğru yönde ilerleyen ekonomik çalışmaların gidişini deęiştirmiş ve dikkatleri, çok daha önemli olan dönemsel dalgalanma teorisinden (business cycle theory), tarihsel zaman verilmişken belli bir noktada üretimin belirlenmesi gibi, daha basit sorulara kaydırmıştır (Lucas, 1983: 1-4). Oysa Lucas, entellektüel öncüleri olarak bahsettięi Hayek ve dönemsel dalgalanma olgusunu inceleyen dięer iktisatçıların üstünde durdukları soruların çok daha kapsamlı ve modern makroekonomik problemlere ışık tutacak nitelikte olduğunu belirtmektedir (Lucas, 1983: 1-2). Lucas, dönemsel dalgalanmaların genel denge yaklaşımı çerçevesinde açıklanması konusunda Hayek ile aynı düşünce düzleminde olduğunu vurgulamakta ve buna örnek olarak, Hayek'ten şu alıntıyı yapmaktadır (Lucas, 1983: 1):

“Birbiriyle çelişki teşkil ediyormuş gibi görünen iktisadi denge teorisi ile dönemsel dalgalanma teorisinin bir arada açıklanabilmesi sorunu, dönemsel dalgalanma teorisinin en önemli sorunudur; Burada denge teorisi ile, Lozan okulu tarafından kusursuz bir biçimde açıklanan tüm ekonomik miktarların karşılıklı genel bağımlılığının modern teorisini kastetmekteyiz.”

Gerçekten de Lucas'a göre, en önemli makroekonomik sorunlardan birisi, rekabetçi piyasa mekanizmasında sıkça rastlanan dönemsel genişleme ve daralmaların nasıl açıklanacağı sorusuydu. Bulgulara göre, dönemsel genişlemelerde parasal toplamların büyüme oranı ortalamasının üzerinde, daralmalarda ise ortalamasının altında seyretmektedir. O halde Keynesçi

modellerin belirttiği gibi para politikası uygulamaları, enflasyon, üretim ve istihdam üzerinde etkili olabilir mi? ya da, para politikası araçları bu dalgalanmaları düzenlemek üzere kullanılabilirler mi? Oysa Lucas'a göre, Keynesçi yaklaşımın aksine, piyasa ekonomilerinde gözlenen dönemsel dalgalanmalar, bu sisteme özgü kaçınılmaz özellikler değildir; sadece açıklanması gereken normal dışı bir durumdur ve Keynesçi müdahalelerin temelindeki fikirler yanlıştır (Lucas, 1983b: 2-4).

Öte yandan Lucas için ikinci en önemli nokta, makroekonomik bir önermenin bilimsel olarak kabul edilebilir olabilmesi için, Walrasçı genel denge teorisi ile mikrotemellendirilmesi gereği idi. İşte bu ontolojik varsayımlara bağlı olarak Lucas, Keynesyen makroiktisadın temel kabulleri olan,

1. Piyasaların esnek olmayan fiyatlar nedeniyle temizlenmemesi
2. Ekonomideki bireylerin daima optimizasyon davranışı içinde olmaması

noktalarına karşı çıkmıştır. Gerçekten de Keynesyen görüşte, piyasaların temizlenmemesi, ekonomik bireyler arasında kârlı bir değişimin varlığını vurgulamakta, ancak böyle bir değişimin gerçekleşmemesi ise, üstü kapalı olarak bireylerin optimizasyon davranışı içinde olmadığını kabul etmektedir. Bu bakımdan Keynesyen görüş, bireylerin optimizasyon yapmaması ve piyasaların temizlenmemesi gibi birbirleriyle ilişkili iki varsayım üzerine kurulmuştur. Lucas ise, bu kabullerin tam aksi yönde yeniden inşası için uğraşmıştır. Bu çerçevede, Lucas'ın modellerinde:

1. Ekonomik bireyler optimizasyon davranışı içindedir,
2. Piyasalar temizlenmektedir,
3. Beklentiler rasyonel olarak oluşmaktadır,²
4. Toplam arz, Keynesyen modellerde olduğu gibi efektif talebe değil, nispi fiyatlara bağlıdır ki, bu da, Walrasçı genel denge modelleriyle uyum içindedir.

Bu noktada sorulması uygun olan bir soru şu olabilir: Acaba Lucas'ın çalışmalarının Keynes öncesi klasik makroiktisat teorisinden farkı nedir? Lucas, kendisi, yaptığı çalışmaların sadece bir teknik model kurma işlemi olduğunu belirtmekte ve bu yöntemi kullanan modellerin, Friedman'ın ve II. Dünya Savaşı sonrası parasalcı görüşlerin savunduğu politikaları kuvvetlendirdiğini, ancak bu görüşlere içerik yönünden pek bir şey ekmediğini de belirtmektedir (Vercelli, 1991: 361). Bu bakımdan Lucas, klasik makroiktisadın içeriği aynı, ancak, yöntemi farklı bir yorumunu ortaya koymaktadır. Bu farklı yöntem ise, dinamik genel denge yaklaşımıdır (Vercelli, 1991: 360-362; Chari, 1999: 2-12; Sargent, 1987: 40-41).

Lucas'ın dinamik genel denge yaklaşımı hakkında şunları söyleyebiliriz: Keynesyen görüşleri statik, ve bu görüşlere dayalı makroekonometrik modelleri de bu yüzden hatalı bularak eleştiren Lucas için, makroekonominin en önemli özelliklerinden birisi, bireylerin şimdiki ekonomik kararlarını verirken, geleceğe dair beklentilerini de oluşturmalarının gerekliliğidir. Örneğin, bireyin şimdi yapacağı harcamalar, gelecekteki tüketimi ile; veya firmaların yatırım kararları, gelecekte elde edeceği getirilerle yakından ilişkilidir. İşte tüm bu unsurlar nedeniyle geleceğe dair beklentilerin oluşumu gereklidir (Chari, 1999: 3). Geleceğe dair beklentilerin oluşumunda ise, mükemmel ve etkin bir biçimde işleyen piyasa mekanizması kilit konumundadır. Zira ancak bu tür bir piyasa varsayımı altında bireyler mevcut ekonomik göstergelere, özellikle de fiyatlara bakarak optimal planlarını yapar ve buna göre şimdiki kararlarını verirler. Bu yaklaşım, Lucas'ın dönemsel dalgalanma modelinin dinamik ayağını oluşturmaktadır. Lucas'ın, bu tür bir karar alma süreci için yaptığı modellemenin iki temel kabulü olduğu görülmektedir (Lucas, 1987a):

1. Bireyler iyi tanımlanmış amaç fonksiyonlarını maksimize etmektedirler.

2. Geleceğe dair beklentilerin oluşumunda diğer bireylerin beklentilerinin tahmini de önemli bir rol oynamaktadır. Çünkü ekonomide sonuç, tüm bireylerin aldığı karşılıklı kararlar dahilinde oluşmaktadır. Bu yaklaşım ise Lucas'ın modelinin genel denge ayağını oluşturmaktadır.

Geleneksel Walrasçı genel denge modellerinde dengeye geliş sürecini müzayedeci (auctioneer) sağlamaktadır. Bu şahıs dışında kimsenin fiyatları değiştirme gibi bir yetkisi yoktur. Müzayedeci, rastgele bir deneme fiyatı duyurmakta, bireyler de bu fiyattan ne kadar satmaya ve almaya niyetli olduklarını belirtmektedirler. Eğer deneme fiyatından arz ve talep edilen miktarlar birbirine eşit oluyorsa, bu fiyatlar geçerli hale gelip, değişim gerçekleşmektedir. Eğer piyasa temizlenmezse, tüm bu önceden belirtilen miktarlar silinip, müzayedeci yeni bir fiyat saptamaktadır. Dengeye gelinene kadar bu süreç böylece devam etmektedir.

1950'li yıllarda J. Nash (1950), K. Arrow (1951) ve G. Debreu (1959) gibi matematikçi ve iktisatçıların yaptığı çalışmalar doğrultusunda, Walrasçı genel denge yaklaşımında kullanıldığı gibi miktarlar cinsinden ulaşılan denge yerine, karar uzayında denge (equilibrium in the space of decision rules) kavramı geliştirilmeye başlanmıştır. Lucas'ın kullandığı denge kavramı da bu tür bir denge kavramına karşılık gelmektedir (Lucas 1987a: 15). Nitekim Lucas'ın dinamik optimizasyon modellerinde bireyler dinamik bir kurgu içinde, durumlarını zamanın çeşitli noktalarında gözden geçirip, buna göre yeni kararlar alabilmektedirler. Öte yandan bu modellerde başlangıç anından itibaren geleceğe yönelik olarak verilen kararlar daima optimaldir. Bu bakımdan, rasyonel beklentiler hipotezi, bu modellerin bir tür gereğidir ve bireylerin daima

optimal kararlar aldığı dikkate alınırsa, birer rasyonel seçim modelidir. Ayrıca, söz konusu modeller, zaman unsuru işin içine katılarak, belirli kısıtlar altında gerçekleştirilen optimizasyon problemi olup, dinamik programlama modeli olarak da anılmaktadır (Koo, 1977: 193-204).³ Aşağıda bu söylediklerimiz çerçevesinde Lucas'ın çalışmalarının en önemli kısmı olan dönemsel dalgalanma modeli ele alınmıştır (Lucas, 1987a: 2. bölüm).

3. LUCAS'IN DÖNEMSEL DALGALANMA MODELİ

Herhangi bir anda ekonomik sistem s durumunda olduğunda, uygulanan iktisadi politika z olsun ve her bir iktisadi birey i , fırsat grubu (opportunity set) olan $\Omega_i(a_{-i}, s, z)$ den, a_i eylemini seçmiş olsun. Bu grup, s ekonomik durumu, z ekonomi politikası ve a_i haricindeki diğer eylemleri seçen a_{-i} bireyleri tarafından belirlenmektedir. Bu eylemler sonucunda birey i nin fayda fonksiyonu şöyle ifade edilsin: $R_i(a, s, z)$. Şimdi varsayalım ki, bu birey, geleceğe dönük olarak, (gelecekteki bir t zamanı için) bu beklenen getirileri maksimize etmek istesin. Bu beklentileri ifade eden ve sübjektif bir iskonto haddi ile (β) şimdiki zamana indirgeyen beklenti fonksiyonu şöyle ifade edilebilir:

$$E\left\{\sum_{t=0}^{\infty} \beta^t R_i(a_t, s_t, z_t)\right\} \quad (3)$$

Şimdi, dinamik programlama açısından esas önemli olan, birey i nin karar problemini oluşturan değer fonksiyonunun $v_i(s)$ oluşturulmasıdır. Bu fonksiyon, (3) teki amaç fonksiyonunun değeri olarak yorumlanabilir. Peki, bu fonksiyon nasıl oluşturulacaktır? a_i eylemini seçmenin iki tür etkisi olacaktır: 1- kararın verildiği anda ortaya çıkan etki yani, $R_i(a, s, z)$ ve 2- uzun dönem sonucunda ortaya çıkan etkiler ise (3) ten $R_i(a, s, z)$ çıkartıldığında geri kalan terimler olup, $\beta E\{v_i(s')\}$ ile özetlenebilir. Geleceğe yönelik olarak, ekonominin durumunu s yerine s' göstermektedir, çünkü, zaman içinde ekonomik sistem değişime uğrayacaktır. s' , bireyin kendi eylemi a_i , diğer bireylerin eylemleri a_{-i} , sistemin durumu s , uygulanan iktisadi politikalar $z(s)$, ve dışsal şoklara göre belirlenmektedir. O halde s' şöyle yazılabilir: $s'=H(z(s), a, s, e)$. Optimal davranış ise, kısa ve uzun dönem getirilerin toplamının maksimizasyonu olup, $v_i(s)$ değerine karşılık gelir. Bu söylediklerimiz çerçevesinde değer fonksiyonu, ya da bireyin karar problemi aşağıdaki Bellman denklemi şeklinde belirtilebilmektedir:

$$v_i(s) = \max_{a_i \in \Omega_i(a_{-i}, s, z)} \{R_i(a, s, z) + \beta \int v_i(H(z(s), a, s, e)) dG(e)\} \quad (4)$$

Bu dinamik modelden hareketle Lucas, şunları söylemektedir: açıktır ki, böyle bir eşitliğin doğası, yukardaki (4 no'lu) denklemi belirleyen tüm unsurlara bağlı olacaktır. Getiri fonksiyonu R_i , fırsat kümesi Ω_i , iktisadi politikalar z , tüm sistemi etkileyen H ve G ; kısacası bütün bu değişkenler için içindedir. Bu şartlar altında iktisadi politikalarda bir değişiklik, sistemin durumuna göre tepki veren politika değişkenlerini gösteren fonksiyonu, yani $z(\cdot)$ yı değiştirecek, bu da dinamik optimizasyon gereği, karar değişkeni ya da kontrol değişkeni dediğimiz $a(\cdot)$ yı değiştirecek, ve giderek tüm bu etkenler indirgenmiş biçim fonksiyonunu değiştirecektir (bkz. 1 ve 2 no'lu denklemler). Şimdi, bu (4) no'lu denklemin bazı önemli özelliklerine değinelim:

Denklem aslında bize optimal davranışın ne olduğunu söylemektedir. Birey, optimal davranarak bu eşitliği elde edecektir. Eğer eşitlik elde edilemezse, birey optimal davranmamış demektir. İşte bu açıdan, rasyonel beklenti, ya da mükemmel öngörü (perfect foresight), bu modelin kaçınılmaz bir parçasıdır.⁴ Nitekim, bu denkleme göre birey, şimdiki ekonomik kararını belirleyebilmek için, geleceğe dair politikalar hakkında da fikir edinmek durumundadır. İşte bu yüzden hükümetler başta aldıkları kararları daha sonraları gelişigüzel bir biçimde değiştirirlerse, bireylerin optimal planları bozulacaktır. Lucas'a göre, denge dışı dalgalanmaların asıl nedeni budur. Bu nedenle hükümetler duruma göre (discretionary) müdahaleler yerine planlı programlı ve önceden duyurulmuş müdahaleleri (rules) tercih etmelidirler ki, bireyler optimal planlarını buna göre yapabilsinler.

Neoklasik iktisadın benimsediği pozitivist bilgi teorisine göre bilim, dış dünyada bulunan düzenlilikleri ifade eden genel önermelerden oluşan teoriler kurma girişimidir. Bu düzenlilikler için araştırılan olgularda kapalı sistemlerin oluşturulması gerekmektedir. Kapalı sistemler, a) incelenen nesnelere niteliksel bir değişme meydana gelmemesi için (içsel kapatma) ve b) dışarıdan gelen bazı etkiler varsa bu etkilerin her seferinde aynı olmasını sağlamak için (dışsal kapatma) gerekmektedir. Aksi takdirde düzenlilikler sağlanamayabilmektedir. Dikkat edilirse, Lucas'ın modelinde bireylere yüklenen mükemmel öngörü ya da rasyonel beklenti varsayımı kapalı bir sistem yaratmak için gerekli bir varsayımdır. Lucas'ın modelinde varsayımsal olarak bireyler kendi öznel amaç fonksiyonlarını oluşturabilmektedirler. Ancak rasyonel beklenti varsayımı ile bireylerin öznel amaç fonksiyonları zaten objektif amaç fonksiyonu haline dönüşmekte ve iki fonksiyon aynılaşmaktadır. Bu durum, tüm bireylerin tercih ve davranışlarını aynılaştırmaktadır. Yani rasyonel olan tüm bireyler aynı şekilde davranacaklardır ve yapılan optimal planların değişmesi için de bir neden yoktur. Böylece kapalı sistem oluşturmanın ilk şartı yani, içsel kapatma

sağlanmış olmaktadır. Dışsal kapatmaya gelecek olursak: Lucas'ın modelinde dışsal şoklar, ki, bunlar arasında vergi politikasında, para ve maliye politikalarında değişime gidilmesi sayılabilir, bireyler tarafından önceden bilindiği sürece bir sorun oluşturmamaktadırlar. Zira, bunlar önceden bilindikleri sürece bireylerin optimal planlarına dahil edilmektedirler. Böylece herkes optimal planını aynı şekilde değişikliğe uğratar. Lucas, bu tür bir sistemde düzenliliklerin süregideceğini ve ekonomiyi dengeden saptırıcı bir değişiklik meydana gelmeyeceğini ileri sürmektedir. Modelde dışsal kapatmaya engel olacak tek unsur, devletin önceden kestirilemeyen müdahaleleridir. Bireyler burada bilgi eksikliği içinde olduklarından optimal planlarını yapamayacaklar ve bu durumda dengeden sapmalar ya da dönemsel dalgalanmalar meydana gelecektir.

4. LUCAS'IN ELEŞTİRİSİ VE SONUÇ

Lucas, Hayek'i öncüsü kabul etmekle birlikte, bireylere ilişkin varsayımları tam aksi yöndedir. Hayek, bireylerle ilgili olarak yaptığı varsayımlarında bireylerin tüm piyasa genelinde bilgi sahibi olmadığını ileri sürmektedir. Hatta eksik bilgi Hayek'te en önemli kabullerden birisidir. Oysa Lucas'ın bireyleri iktisadi yönden mükemmel öngörüye sahiptirler. Lucas ekonomideki tüm katılımcılara bilgi açısından adeta insanüstü bir güç yüklemektedir. Bu bireyler geleceğe ait tüm piyasalardaki fiyatları bilmek durumundadırlar. Sözkonusu piyasaların henüz oluşmamış olması ise bireyin neredeyse tüm ekonominin modeline sahip olmasını gerektirmektedir. Gerçekten de Lucas'ın analizlerinde bireylerin, ekonometrisyenlerin kullandığı modelleri kullandığı kabul edilmektedir. Peki Lucas'ın bireyleri nasıl bireylerdir? Acaba baştan beri peşinde olduğumuz aktif birey anlayışını burada bulabilecek miyiz? Ancak, duruma daha yakından bakıldığında, Lucas'ın bireye ve birey davranışına dair bir analizi olmadığını görmekteyiz. Aslında Lucas'ın analizinde mükemmel öngörü ve bilgiyi rasyonel olarak kullanma gibi özellikler, asıl gücünü bireyden değil, Lucas'ın rekabetçi piyasa sisteminden ve bu sisteme dair yaptığı varsayımlardan almaktadır. Lucas'ın bireyi, rekabetçi piyasa sisteminin sahip olduğu özellikler nedeniyle mükemmel öngörüye sahiptir. Lucas, rekabetçi piyasa sisteminin bireye bilmesi gereken tüm bilgileri ilettiğini varsaymaktadır. Lucas, insan davranışına dair bu yüzeysel yaklaşımını olumsuz değil, aksine olumlu bir özellik olarak yorumlamakta ve şöyle demektedir (Lucas, 1987b: 241):

“Ekonominin bireysel ve toplumsal davranışta yüzeysel bir yaklaşıma dayanıyor olmasının eleştirilmesi, bana çok anlamlı gelmemektedir. Bana göre, esas bu yüzeysellik ekonomiye asıl gücünü vermektedir ki, o da, yaşamını ve davranışını neyin oluşturduğunu bilmeye gerek kalmaksızın insan davranışını tahmin edebilme kabiliyetidir.”

Nitekim, Lucas'ın modellerinin arkasında serbest piyasa koşullarının bireyleri rasyonel davranmaya itmesi anlayışı kilit konumundadır. Bunun temelinde yatan bir varsayım, rekabet ortamındaki geribeslenim (feedback) mekanizmasının bireyin davranışını etkin hale getirecek veya davranışı yapmasına engel olacak bir güç ya da kuvvet içermesidir. Bu mekanizmaya göre, sistematik hata yapan bireylerin hataları diğer bireyler tarafından kâr elde etmek için kullanılacağına göre, hata yapan bireyler bu ortamda yaşayamayacaklardır (Hogarth ve Reder, 1987: 6). Lucas'ın da dahil olduğu Chicago okulu iktisatçıları, ki, bunlar arasında Friedman ve Becker en önemli isimler olarak sayılabilir, bu mekanizmayı Darwin'ci "doğal seçim süreci"ne benzetmekte ve tüm piyasa sistemini bir evrim sürecinin sonucu olarak görmektedirler. Evrimci yaklaşımın bir özelliği şudur: Burada vurgu, bireyden ziyade, bireyin dışında olan unsurların üstündedir. Burada, eylemin optimalliğinden ziyade, optimalite kavramının kendisi esas anlamını, bireyin kendi karar alma sürecinde değil, bireyin yaşadığı ekonomik çevrenin, yani serbest piyasa mekanizmasının bireye bu şekilde empoze etmesinde bulmaktadır. Bu çerçevede giderek bireyin değil, çevrenin eylemi önem kazanmaktadır (Fedderke, 1997: 347-349).

Rasyonel beklentiler yaklaşımını eleştiren bir makalesinde Arrow, neoklasik ekonomide kullanılan rasyonellik varsayımının her ne kadar sadece bireyin bir özelliğiymiş gibi gösterilse de, asıl anlam ve gücünü ideal şartlar altında çalışan tam rekabet piyasası varsayımından aldığını belirtmekte ve şunları söylemektedir (Arrow, 1987: 203):

"Daha önce de belirttiğim gibi, uygulamadaki rasyonalite, sadece bireyin özelliği değildir. Bireysel rasyonalitenin kullanışlı ve kuvvetli sonuçlar vermesi için neoklasik teorinin diğer temel kavramlarıyla birlikte - denge, rekabet, piyasaların tamlığı (completeness of markets) gibi - kullanılması gereklidir. Ayrıca, rasyonalite hipotezinin tam gücünü elde edebilmesi için, sadece saf (pure) rekabet değil, tam (perfect) rekabet koşullarına ihtiyaç vardır. Bu varsayımlar ortadan kalktığında rasyonalite kavramının kendisi de tehdit edilebilir hale gelecektir, çünkü, bir kişinin kendi rasyonalitesi diğerlerini algılamayla ilgili olup, özellikle de diğerlerinin rasyonalitesinin bir parçasıdır."

Lucas'ın sonuçta ulaştığı açıklama tarzı şudur: Piyasa mekanizması etkin ve mükemmel bir şekilde çalışan bir sistemdir. Bu sistemin verdiği sinyallere bağlı olarak tüm bireyler rasyonel karar alabilmektedir ve geleceğe dair mükemmel öngörü de mümkün olabilmektedir. Dolayısıyla bu şartlar altında ekonominin dengeden sapması olası gözükmemektedir. Ancak, etkin bir biçimde çalışan piyasaya müdahale edilerek bu etkinliğin bozulması sonucu, bireyler rasyonel kararlar alamadığında, dengeden sapılması durumu görülebilir. Buna bağlı olarak, daha önce de belirttiğimiz gibi, piyasa ekonomisinin işleyişi ekonomik bireylerin davranış özelliklerinden yola çıkılarak açıklanacak yerde,

piyasa ekonomisinin işleyişinden yola çıkılarak ekonomik davranışların niteliği üzerinde yargıya varılmaktadır. İşlevselci açıklamanın, olguların açıklanmasında, bilinçli eylem özelliğini bireylerden alarak, toplumsal sistem ve kurumlara yükleyerek yapması ve dolayısıyla, bilinçli eylemi toplumsal oluşumlara atfetmesi özelliği göz önünde bulundurulursa (Giddens, 1999: 369), Lucas'ın yaklaşımının işlevselci açıklamaya denk düştüğü açıktır. Sonuç olarak Lucas, bireye ait özelliklere ağırlık vermek amacıyla yola çıkmasına rağmen, yaptığı ontolojik varsayımlarla esas vurguyu bireyden ziyade tam rekabet piyasası sistemine yapmakta ve böylece aktif birey anlayışından uzaklaşmaktadır.

NOTLAR

¹Burada belirtmeden geçemeyeceğimiz bir nokta, Tony Lawson'un Lucas'ın yukarıda ele aldığımız eleştirisi ile ilgili bazı değerlendirmeleridir (bkz. Lawson, 1995: 258-259; 1997: 73-75). Lawson, Lucas'ın Keynesyen modellere yönelik olan eleştirisini tüm ekonometrik çalışmalar için geçerliymiş gibi yorumlamaktadır. Öte yandan, Lawson, Lucas'ın eleştirdiği ekonometrik çalışmalardaki hataları düzeltmek yerine, hükümetin ekonomi politikasına yönelik önerilerde bulunmasını bir tür çelişki olarak değerlendirmektedir. Kanımızca, Lawson'un bu fikirleri, Lucas hakkında çok derinlikli olmayan bazı gözlemlere dayanmaktadır. Öncelikle belirtmek gerekir ki, Lucas'ın eleştirileri tüm ekonometrik çalışmalara değil, döneminin Keynesçi makro-ekonometrik çalışmalarına yöneliktir. İkincisi, Lucas'ın hükümetin ekonomi politikalarına dair olan önerileri zaten, eleştirdiği ekonometrik uygulamalar yerine öne sürdüğü makroekonomik ve makroekonometrik tekniklerin doğal birer uzantısıdır. Bu bakımdan ortada bir çelişki yoktur ve Lucas kendi içinde tutarlıdır.

²Rasyonel beklenti hipotezinin en önemli karakteristiği, bireyin tahmin hatasının sıfır olmasıdır. Bunu matematiksel olarak şöyle ifade edebiliriz: $[P_t - (EP_t | I_{t-1})] = 0$ Bu eşitliğin sol tarafındaki ilk terim, t zamanında gerçekleşen P değişkeninin (fiyat diyebiliriz) değerini, ikinci terim ise, bu değişkenin $t-1$ dönemindeki bilgilere bağlı olarak t dönemi için matematiksel olarak tahmin edilen optimum değerini ifade etmektedir. Buna göre, rasyonel beklenti durumunda, bireyin tahmin ettiği değişkenin değeri ile değişkenin gerçekleşen değeri aynı olmaktadır (Attfield, Demery ve Duck, 1985: 16; Kantor, 1979: 1425).

³Dinamik programlama, özellikle R. Bellman'ın mühendislik alanında kontrol sistemlerinin optimum tasarımına getirdiği farklı bir teknik ile ünlü bir yöntemdir. Bellman'ın yaklaşımında önemli bir yer tutan optimalite prensibi şöyle özetlenebilir: Çok aşamalı bir karar sürecinde herhangi bir verilmiş durum başlangıç noktası olarak kabul edildiğinde, bu başlangıç noktasından itibaren geleceğe dönük olarak verilen tüm kararlar optimaldir (Koo, 1977: 193-196).

⁴Lucas, işte bu nedenle F. Knight ve Keynes tarafından benimsenen belirsizlik (uncertainty) durumunu anlamsız olarak değerlendirmekte ve belirsizliği sadece risk kavramı ile ilişkilendirip, olasılık dağılımlarının bilinmediği türden durumları analizden dışlamaktadır (Kantor, 1979: 1427).

KAYNAKÇA

- Arrow, K.J. (1987), "Rationality of Self And Others in an Economic System", M. R. Hogarth ve M.W. Reder (der.), *Rational Choice, The Contrast Between Economics and Psychology* içinde, Chicago: Chicago University Press, 201-217
- Attfield, C.L.F., D. Demery ve N.W. Duck (1985), *Rational Expectations in Macroeconomics*, Oxford: Basil Blackwell.
- Blanchard O. J. ve Fischer S. (1989), *Lectures on Macroeconomics*, Massachusetts: The MIT Pres.
- Chari, V. V. (1999), "Nobel Laureate Robert E. Lucas, Jr.: Architect of Modern Macroeconomics", *Federal Reserve Bank of Minneapolis Quartely Review*, 23(2), 2-12.
- Fedderke, J. W. (1997), "The Source of Optimality in Action", *Cambridge Journal of Economics*, 21, 339-363.
- Giddens, A. (1999), *Toplumun Kuruluşu*, (1984) (Çev. Hüseyin Özel), Ankara: Bilim ve Sanat Yayınları.
- Hogarth R., M. ve M.W. Reder, (1987), "Introduction: Perspectives from Economics and Psychology", M.R. Hogarth ve M.W. Reder (der.), *Rational Choice, the Contrast Between Economics and Psychology* içinde, Chicago: Chicago University Press, 1-23.
- Kantor B. (1979), "Rational Expectations and Economic Thought." *Journal of Economic Literature*, XVII, Aralık, 1422-1441.
- Kara, M. (2001), *Sosyal Bilimlerde ve İktisatta Birey ve Birey – Toplumsal Yapı İlişkisi*, Yayınlanmamış Doktora Tezi, Hacettepe Üniversitesi.
- Koo, D. (1977), *Elements of Optimization with Applications in Economics and Business*, New York, Springer-Verlag.
- Lawson, T. (1995), "The "Lucas Critique", A Generalisation" *Cambridge Journal of Economics*, 19, 257-276.
- Lawson, T. (1997), *Economics And Reality*, London: Routledge.
- Lucas, R., E. Jr. (1972), "Expectations and the Neutrality of Money", *Journal of Economic Theory*, 4, Nisan, 103-124.

- Lucas, R., E. Jr. (1983a), "Econometric Policy Evaluation: A Critique", K. Brunner ve A. Meltzer (der.), *Theory, Policy, Institutions: Papers from the Carnegie-Rochester Conferences on Public Policy* içinde, Amsterdam: Elsevier, 257-285.
- Lucas, R.E. Jr. (1983b), "Understanding Business Cycles", K. Brunner ve A. Meltzer (der.), *Theory, Policy, Institutions: Papers from the Carnegie-Rochester Conferences on Public Policy* içinde, Amsterdam: Elsevier, 1-25.
- Lucas, R. E. Jr. (1987a), *Models of Business Cycles*, Oxford, Basil Blackwell.
- Lucas, R. E. Jr. (1987b), "Adaptive Behavior and Economic Theory", M. R. Hogarth ve M. W. Reder (der.), *Rational Choice, the Contrast Between Economics and Psychology* içinde, Chicago: The University of Chicago Press, 217-243.
- Sargent, T. J. (1987), *Dynamic Macroeconomic Theory*, Cambridge, Harvard University Press.
- Vercelli, A. (1991), "Comment on Maddock", N. De Marchi ve M. Blaug (der.), *Appraising Economic Theories*, England, Edward Elgar, 360-363.