

EKONOMICKÁ HISTORIE: ČÍM PŘÍSPÍVÁ HISTORICKÝ PŘÍKLAD K POCHOPENÍ EKONOMICKÝCH JEVŮ?

Tomáš OTÁHAL, PEF MENDELU v Brně*

Úvod

Ekonomická historie je relativně moderním metodologickým přístupem (např. North, 1981). Je ovšem také metodologickým přístupem, který je tradičně spojený s ekonomickou vědou samotnou. Například Joseph Alois Schumpeter ve svém pojednání *History of Economic Analysis* považuje ekonomickou historii za nejvýznamnější metodu ekonomické vědy vůbec, když tvrdí, že: „*Nikdo nemůže doufat, že pochopí význam jakýchkoliv ekonomických jevů jakékoliv doby, i té dnešní, pokud nemá dostatečný přehled o historických faktech a dostatečné množství historického vhledu, což můžeme také nazvat historickou zkušeností.*“ (Schumpeter, 1994, s. 12–13) Takovým historickým vhladem například je, že ekonomická věda už od dob Adama Smitha (2001) hojně využívá ekonomickou historii pro vysvětlení podstaty ekonomických jevů.

K tomuto Israel M. Kirzner dodává: „*Správné užití ekonomických tvrzení v určitých konkrétních situacích předpokládá, samozřejmě, adekvátní informovanost ohledně faktů, které se mění. Autoři, kteří čas od času kritizují práci teoretických ekonomů, zdůrazňují, že by se ekonomové měli více věnovat popisu a klasifikaci měnících se faktů, čímž zdůrazňují „relativitu“ ekonomických teorií. Uvažují tak o nutných limitech všech teoretických konstrukcí, které jsou způsobeny tím, že tyto teoretické konstrukce jsou platné jenom vzhledem k určitým programům, což slouží jako základ pro všeobecnou víru, že*

* Článek byl zpracován v rámci výzkumného záměru VZ MSM 6215648904 tematického okruhu 01 „Makroekonomická a mikroekonomická výkonnost české ekonomiky a hospodářsko-politická opatření vlády ČR v podmínkách evropského integrovaného trhu“. Uvedený záměr je řešen na Provozně ekonomické fakultě Mendelovy zemědělské a lesnické univerzity v Brně za finanční podpory ze státních prostředků prostřednictvím MŠMT.

Za inspiraci velice děkuji prof. Milanovi Sojkovi z Mendelovy University v Brně. Za podnětné připomínky k první verzi děkuji prof. Kamilovi Fuchsovi z Mendelovy University v Brně. Za diskusi také děkuji Robyn Harte-Buntingovi z Universidad Rey Juan Carlos a Svatoplukovi Kapounkovi z Mendelovy University v Brně. Za asistenci při tvorbě logické argumentace velice děkuji Ladce Grochové z Mendelovy University v Brně, prof. Peterovi Boettkemu z George Mason University a anonymním recenzentům PE. Za osobní podporu děkuji členům a kolegům z Ronald Coase Institutu. Podnětem pro napsání tohoto textu byla práce prof. Northa z Washington University v St. Louis a práce prof. Kohna z Dartmouth College.

ekonomická znalost může být nabyta jenom s odkazem na změnu v těchto programech. Ekonomická teorie tak může být elegantním zdrojem intelektuálního uspokojení, ale pouze za cenu toho, že je výrazně omezena na uplatnění pouze v akademické sféře.“ (Kirzner, 1976, s. 174–175)

Moderní metody využívané v mikroekonomické (např. Varian, 1995; Osbourne, 2004) a makroekonomické (např. Sims, 2010; Golosov a Lucas, 2007; Sargent a Surico, 2011) analýze jsou rozdílné. Lze ovšem vysledovat jistou náklonnost ekonomů k využívání metod, které jsou běžně uplatňovány v přírodních vědách. Těmito metodami jsou matematické modely s ekonometrickými důkazy založenými na statické významnosti. Ekonomická věda jako by se využíváním moderních matematických a statistických metod vzdalovala od klasického způsobu vysvětlování ekonomických jevů, čímž se stává nerealistickou. Jakým způsobem pak lze tento nedostatek moderních matematických a statistických metod odstranit?

Cílem tohoto textu je vysvětlení přínosu metody ekonomické historie nebo lépe metody historického příkladu jako důkazu nebo lépe ilustrace ekonomického teoretického modelu. V článku se snažím ukázat, že realističnost předpokladů ekonomické teorie je nejenom důležitá pro pochopení teorie samotné, ale je také důležitou vlastností ekonomického teoretického modelu, neboť umožňuje hodnocení vypovídací schopnosti tohoto modelu zdravým rozumem v kontextu měnících se historických faktů. Tímto se snažím poukázat na přínos metody historického příkladu jako metody realistické, která umožňuje vyzdvihnout všeobecně platné poznatky ekonomického modelování tím, že vkládá implikace ekonomického modelu do historických souvislostí, čímž částečně umožňuje rozpoznání měnících se historických faktů od všeobecně platných ekonomických poznatků.¹ Dále se snažím argumentovat tím, že statistické metody, které řeší problém kauzality ve společenských vědách, opomíjí omezení, která vyplývají z podstaty jednání jednotlivců, čímž opomíjí kvalitativní obsah dat společenských věd. Tímto se pak blíží matematickým a statistickým metodám užívaným v přírodních vědách, které nereflektují historickou zkušenost, což vede ke zmatení mezi tím, co je všeobecně platné a tím, co vyplývá z historické zkušenosti. Znovu se tak snažím argumentovat ve prospěch metody historického příkladu, který částečně ilustruje kvalitativní obsah kauzálních ekonomických vztahů, čímž znovu částečně umožňuje rozpoznání měnících se historických faktů od všeobecně platných ekonomických poznatků.

V dějinách ekonomických teorií lze vysledovat různá pojetí historických metod, například lze hovořit o historicismu, který vychází z hegelovské dialektiky a který byl reformulován Karlem Marxem (1818–1883) do materialistické podoby (Störig, 1996, díl šestý, kap. 2). Historicismus byl také velmi extenzivně uplatňován na poli německé starší a mladší historické školy (Sojka, 2010, kap. 5), která byla ovlivněna novokan-

1 Tímto rozdělením ekonomického poznání na obecně platné poznatky a empirickou zkušenost částečně navazují na metodologii Carla Mengera (1840–1921), (Loužek 2001) a také částečně na subjektivismus uplatněný v metodologii rakouské školy (Říkovský, 2001, 2004).

toviskou kauzalitou (Störig, 1996, díl šestý, kap. 4). Mladší historická škola se poté v rámci pozdější metodologické diskuse uvolila metodologickému individualismu a silně ovlivnila pozdější Rakouské ekonomy, kteří přijali známou logicko-historickou metodu někdy také v literatuře nazývanou stylizovanou historií.² Toto pojetí stylizované historie nelze ovšem spojovat s institucionalismem (Sojka, 2009, 2010, kap. 10, nebo Kouba, 2010). Tento text se proto spíše než o obhajobu holistických metod užívaných v ekonomii snaží upozornit na to, že se moderní matematické a kvantitativní metody vzdalují klasickému pojetí ekonomického výzkumu Adamem Smithem a tím myslím konkrétní způsob, jakým se Smith snaží o ilustraci svých teoretických závěrů.³ Z tohoto pohledu se naše vymezení metody historického příkladu více blíží logicko-historické metodě nebo alternativně stylizované historii založené na metodologickém individualismu, kdy je do tohoto metodického konceptu možno zapojit více konkrétních historických faktů. V moderní ekonomické literatuře tento přístup reprezentují např. North, Wallis a Weingast (2009), Boettke (1993), Wallis (2004), Otáhal (2009), Weingast (1995), Benson (1990) nebo Leeson (2009). Text lze tedy z tohoto pohledu považovat za přínos do diskuse z pozice teoretiků Rakouské školy, Nové institucionální ekonomie a Postkeynesiánsství (Sojka, 2000, 2010 kap. 4; Dow, 2007).

Z pohledu metodologie vědy podobnou argumentaci již prezentoval například Mark Blaug (1997) nebo Sheila C. Dow (1996). Proto není naše argumentace nová. Přínosem tohoto textu není ovšem prezentace nových metodologických argumentů, což z pohledu dějin ekonomických teorií lze velmi těžko realizovat, neboť některé významné metodologické diskuse se někdy opakují. Přínos tohoto textu je spíše ve vysvětlení konkrétních argumentů významných autorů Rakouské školy, Nové institucionální ekonomie a Postkeynesovství ve prospěch našeho pojetí ekonomické historie či lépe metody historického příkladu. Z tohoto pohledu se snažím o vyjasnění některých argumentů zástupců někdy vůči sobě kritických ekonomických škol a o uspořádání těchto argumentů do logické struktury. Některé argumenty jsou tedy v tomto textu nově reformulovány a podrobeny kritickému zhodnocení z pohledu zastánců matematických a kvantitativních metod. Tímto tento text otvírá prostor pro novou metodologickou diskusi v rámci nejmodernějších ekonomických výzkumných programů.

Struktura textu je následující. V první části je prezentován stručný přehled významných novodobých metodologických diskusí v ekonomii. Na tomto přehledu je pak demonstrováno, jaký význam může mít metoda historického příkladu v moderním ekonomickém výzkumu pro verifikaci. V druhé části jsou dále rozšířeny předložené

2 Tuto metodu použil již zmiňovaný Joseph Alois Schumpeter (2004). Velmi známý se díky ní stal také Carl Menger (2007). V české literatuře tuto metodu uplatňuje například kolega Petr Wawrosz, který pomocí ní vysvětluje dosahování a narušování institucionální rovnováhy (Wawrosz, 2011) nebo kolega Pavel Breinek, který takto vysvětluje procesy globalizace (Breinek, 2005).

3 Snad nejlepším příkladem je Smithova věhlasná kritika merkantilismu (Smith, 2001, kniha 5).

argumenty tak, abych vysvětlil druhý přínos metody historického příkladu v ekonomickém výzkumu. Ten spočívá v ilustraci kauzálních ekonomických vztahů. V závěru je celá argumentace rekapitulována.

Stručný moderní metodologický přehled: Realističnost

Přínosy metody historického příkladu pro vysvětlení ekonomických jevů se dají rozdělit do dvou základních kategorií. První kategorie přínosu historického příkladu je *realističnost*. Jinak také schopnost ilustrace implikací teoretického modelu na konkrétních historických, tedy reálných událostech a tím umožnění částečné rozeznání všeobecně platných ekonomických poznatků od vyvíjejících se historických faktů. Tento přínos nejenom, že osvětluje vypovídací schopnost modelu, ale také nastavuje kritické hranice abstraktnosti modelu. Druhou kategorií přínosu metody historického příkladu pro vysvětlení ekonomických jevů je schopnost demonstrovat *kauzální vztahy*, čehož statistická korelace není schopna.⁴

V této kapitole naznačím stručný přehled metodologických argumentů ve prospěch kriteria hodnocení realističnosti předpokladů v ekonomickém výzkumu. Jinak, budu se snažit shrnout argumenty, které vysvětlují, proč je kritérium realističnosti předpokladů v ekonomickém modelování důležité pro ekonomický výzkum, čímž se budu snažit nepřímou obhájit přínos metody historického příkladu jako metody realistické, tedy té, která nastavuje kritické hranice abstraktnosti modelu.

Rozdílnost ekonomických teorií významně vyplývá z použitých metod. Někteří ekonomové propagují nové metody, ačkoliv se jimi často neřídí. Kupříkladu Milton Friedman prosazuje názor, že hypotézy pramenící z teorií je možné ověřovat pouze na základě empirických důkazů. Jinak, implikace teorie je možné zamítat pouze na základě empirického potvrzení předpovědi „pravdivější“ teoretické implikace (Friedman, 1997, s. 6). K tomuto ale Ronald Coase namítá: Ekonomové si nevybírají teorii podle kritéria, jak „přesné“ dokáže teorií implikovaná hypotéza poskytovat předpovědi, ale podle toho, jak „vhodně“ teorie objasňuje fungování reálného světa. Jinak, jak teorie dokáže usnadnit ekonomům vhled do podstaty fungování pozorovaných jevů. (Coase, 1994, s. 16–17)

Jinými slovy, pozitivismus Milтона Friedmana zdůrazňuje schopnost teorie předpovídat budoucí události a to na základě statisticky ověřených hypotéz. Na druhou stranu Ronald Coase zdůrazňuje, že smyslem teoretického modelu je usnadnit chápání reality, což není možné bez realistických předpokladů. A právě historická zkušenost může být přesně tím měřítkem realističnosti předpokladů teoretického modelu.

4 Jak moderní ekonometrie řeší problém kauzality a jakými problémy toto řešení trpí, bude vysvětleno v další kapitole. Za navedení k tomuto tématu velice děkuji prof. Peterovi Boettkemu z George Mason University.

Milton Friedman ale odmítá hodnocení teorie z pozice napadání realističnosti předpokladů, neboť hypotézy pramenící z teorií jsou tím více smysluplné, čím více faktů dovedou vysvětlit. Z toho vyplývá, že jejich předpoklady musí být nutně zjednodušující a tím pádem nerealistické (Friedman, 1997, s. 9). Pro Ronalda Coase však rozhodujícím kritériem není to, zda teorie poskytuje ověřitelné empirické předpovědi, ale zda dokáže vysvětlit, proč reálné skutečnosti fungují tak, jak fungují. Taková otázka se bez smysluplných předpokladů zodpovědět nedá, neboť nesmyslné předpoklady nedělají z teorie pochopitelný návod pro chápání a vysvětlení reálného světa. Nakonec si ekonomové stejně vybírají ty konkurenční teorie, které jsou jejich uvažování o světě nejbližší.

Tato skutečnost se dá dokonce demonstrovat na způsobu vedení výzkumu samotným Miltonem Friedmanem. Milton Friedman spolu s Annou Schwartz napsali významnou knihu *A Monetary History of The United States* (1963), ve které přesto že využívají statistických metod, věnují vysvětlování historických souvislostí, tedy vysvětlování konkrétních historických zkušeností, značnou pozornost. (Friedman a Schwartz, 1993) Například se snaží obhájit tezi o tom, že dobová diskuse o zrušení oběhu stříbrného dolaru v USA byla politicky zmanipulovaná. (Friedman a Schwartz, 1993, s. 134) Na základě jakých předpokladů Milton Friedman a Anne Schwartz vysvětlovali tyto podle nich důležité historické skutečnosti? Podle Ronalda Coaseho to byly ty předpoklady, které jim usnadnily orientaci v historických událostech, tedy usnadnily jim chápání společenských vztahů, a proto musely být realistické.

Kdyby předpoklady, na základě kterých Milton Friedman a Anne Schwartz hovoří o dobové debatě o zrušení oběhu stříbrného dolaru v USA, byly nerealistické a zjednodušující, nemohli by uplatnit metodu, která se zaměřuje na vysvětlení způsobu, jakým jednotlivci (volici) vnímali fakta předložená jinými jednotlivci (politiky), neboť tato fakta, o kterých Milton Friedman s Anne Schwartz hovoří, jsou fakta, která lze zařadit do kategorie měnících se fakt, tedy těch, které podléhají změnám v místních a časových okolnostech. Z pohledu pozitivismu Milтона Friedmana se v tomto případě pak nejedná o hypotézu, která by byla verifikovatelná statistickým testem, neboť Milton Friedman a Anne Schwartz uplatnili předpoklad jednajících politiků, kteří záměrně prezentovali nepravdivé informace. Ty lze považovat za nepravdivé jenom díky znalosti vyvíjejících se místních a časových okolností, které musí být ale z verifikace hypotézy na základě statistického testu vynechány, aby potvrzení hypotézy bylo univerzálně platné, tedy toto tvrzení je z pohledu pozitivní metodologie Milтона Friedmana neverifikovatelné, protože je založeno na faktech, které ve zjednodušené formě modelu nemohou hrát žádnou roli. Tento příklad pak tímto prakticky demonstruje, že Milton Friedman a Anne Schwartz vysvětlují svoji implicitně přijatou ekonomickou teorii na historickém příkladu, tedy prakticky ověřují realističnost předpokladů vlastní ekonomické teorie v historickém kontextu.

Milton Friedman (1997, s. 3–4) se ovšem dále domnívá, že není rozdíl ve výzkumu vedeném v přírodních vědách a ve výzkumu vedeném ve vědách společenských a to především proto, že sběr a interpretace dat je stejně problematická jak pro přírod-

ní vědy, tak pro vědy společenské. Ani v přírodních vědách nelze nikdy úplně odloučit všechny nežádoucí vlivy, které narušují řízený experiment. Problém společenských věd tkví v tom, že společenské vědy nejsou schopny provádět řízené experimenty. To jim však nebrání v interpretacích experimentů neřízených (náhodných historických událostí). Interpretace neřízených experimentů je pro přírodní vědy (např. astronomii) stejně obtížná jako pro vědy společenské. S tímto názorem ale nesouhlasí Christopher E. Sims (2010), který argumentuje tím, že i když přirozené a quasi-experimenty v ekonomii existují a mohou být užitečné, není možné přeceňovat vypovídací schopnost zjednodušených ekonometrických analýz právě proto, že ekonomie není experimentální věda srovnatelná s přírodními vědami.⁵ Tuto kritiku je možné také uplatnit při hodnocení vypovídací schopnosti makroekonomických modelů, které vychází z předpokladu racionálně očekávajících jednotlivců (např. Golosov a Lucas, 2007).

Sheila C. Dow (2004) kritizuje makroekonomické modelování Nových keynesovských autorů z podobné pozice. Tvrdí, že nelze přesně zaznamenat strukturu ekonomiky s pomocí formalizace předpokládající racionální očekávání a testovat predikční schopnosti modelu bez uvažování vědcovy nejistoty, která brání v uplatnění pevných pravidel v monetární politice. Tak jako volba konkrétního modelu, stejně volba dat, která mají tento model potvrzovat, podléhá vědcově nejistotě, což vede k nefunkčnosti pevných monetárních pravidel, jejichž uplatnění v souladu s Lucasovou kritikou mění nastavení parametrů monetárního systému. Toto platí obecně i pro experimentování v ekonomii, neboť podle Dow (1996, s. 38–40) problém není s tím, jak vyloučit všechny nežádoucí vlivy, které narušují řízený experiment, ale s odlišnou vypovídací hodnotou dat, která nám experimentování ve společenských vědách poskytuje. Data společenských věd mají charakter výsledků procesů rozhodování, které jsou záměrem pozorovaných subjektů. Tato data navíc v sobě obsahují historickou zkušenost, která se vyvíjí spíše evolučně. Tato historická zkušenost pak neovlivňuje pouze rozhodování pozorovaných subjektů, tedy pouze nezkrsluje vypovídací hodnotu dat, ale také zkrsluje procesy hodnocení dat z pohledu samotného vědce. Ten není imunní vůči vývojovým historickým a kulturním souvislostem i v oblasti vývoje vědy samotné. Proto je třeba při společenskovědním uvažování a to nejen o monetární politice počítat s Postkeynesovskou nejistotou.

Mario Rizzo (1976) dále namítá, že ve společenských vědách ba dokonce i ve vědách přírodních není třeba provádět řízené nebo neřízené experimenty, abychom mohli o teoretických modelech říci, že mají vědeckou vypovídací hodnotu. Verifikace nebo falsifikace teoretického modelu nemusí být nutnou podmínkou, abychom mohli o modelu říci, že je vědecký, proto, že některé teoretické implikace mohou být jednoduše neverifikovatelné nebo nefalsifikovatelné. Rizzo na příkladu biologického Darwinismu ilustruje, že teoretický model, který neimplikuje verifikovatelné nebo falsifikovatelné hypotézy, vůbec nemusí být považovaný za nevědecký. Rizzo dále v souladu

5 Konkrétní argumentace bude detailněji vysvětlena v druhé části textu.

s Ludwigem von Misesem a Friedrichem Augustem von Hayekem znovu upozorňuje na omezení, kterým musí všechny teorie a z nich vyplývající hypotézy společenských věd vždy podléhat (White, 2003). Společenské jevy, jakými je kupříkladu v ceně zahrnutá užitečnost, nejistota nebo očekávání, vytváří z ceny datum, které je komplexním odrazem příliš mnoha pro člověka nepozorovatelných vlivů, což vede k praktické nemožnosti provedení jakéhokoliv empirického testování hypotéz bez pochopení podstaty těchto jevů z teorie (Hayek, 2001a; Mises, 2006, s. 36–39). Ta, aby byla srozumitelná, by podle Ronalda Coase měla znovu vycházet z realistických předpokladů.

V knize *The Counter-Revolution of Science* (Hayek, 1995) Friedrich August von Hayek dále vyargumentoval subjektivní povahu společenských věd. Argumentaci založil na skutečnosti, že všechna data užívaná ve společenských vědách, mají vždy subjektivní obsah, neboť reflektují vztah člověka k věci nebo vztah člověka k člověku.⁶ A přesně subjektivita ekonomických dat využívaných v ekonomickém výzkumu odděluje ekonomickou vědu od věd přírodních. Zatímco v přírodních vědách vztahy mezi neživými prvky determinují fyzikální zákonitosti neovlivnitelné člověkem, ve společenských vědách vztahy mezi lidmi determinuje jednání, které vychází z vnitřních zkušeností a z přesvědčení každého jednotlivce. Proto je třeba chápat jednání lidí v historickém kontextu, tedy s přihlédnutím ke konkrétním historickým skutečnostem, ve kterých se ekonomické jevy dějí. Tyto historické skutečnosti jsou pak determinovány tím, jak na ně konkrétní lidé reagují. Konkrétní historické události a konkrétní reakce lidí na tyto události pak vytváří *historickou zkušenost*.

Ludwig von Mises uzavírá tuto diskusi a tvrdí, že behavioristé a pozitivisté nemají důvod přistupovat ke společenským problémům odlišným způsobem než přírodovědci a upozorňuje, že matematika ve smyslu formální logiky užívaná v přírodních vědách (kupříkladu ve fyzice) nám sice umožňuje popsat vzájemné vztahy mezi definovanými prvky, ale nemůže vypovídat nic o počátečních silách, které tyto prvky uvádějí v pohyb. Jinak, převedeno na příklad ekonomie, není schopna odpovědět na otázku: Jak trhy fungují? Matematika proto není pro Misesa vhodným nástrojem pro vysvětlení hybných sil utvářejících tržní proces (Mises, 2006, část první) a to proto, že není schopna vysvětlit motivy jednání lidí v historickém kontextu. Tržní proces je tak pro Misesa sousledem mnoha rozhodnutí mnoha lidí na základě motivů, které je třeba vysvětlovat a které lze nejlépe ilustrovat na historickém příkladu (Mises, 2007).

Argumenty pro využití ekonomické historie v ekonomii: kauzální vztahy

I když jsem v předchozí kapitole vysvětlil, jakým způsobem si volí ekonomové teorie, jejichž implikované hypotézy chtějí potvrdit, ještě se mi nepodařilo smysluplně obhájit přínos metody historického příkladu ve smyslu vysvětlení kauzálních ekono-

6 K diskusi, společenské versus přírodní vědy, kterou započal Menger také zdůrazněním rozdílu v postavení pozorovatele vůči zkoumanému objektu, přispěl Hayek vysvětlením vlastní kompozitivní metody (compositive method). (Hayek, 2001a; White, 2003)

mických vztahů. Bylo naznačeno, že fakta společenských věd mají subjektivní obsah. Jak ale tento fakt souvisí s přínosem metody historického příkladu ve smyslu vysvětlování kauzality? Navíc, moderní ekonometrické metody znají způsob, jak vztah podobný kauzalitě simulovat. V čem je tedy kauzalita ekonomických vztahů vysvětlená na historickém příkladu přínosná? V této kapitole proto představím přehled metodologických argumentů ve prospěch demonstrace kauzálních ekonomických vztahů na historických událostech, čímž se budu snažit přímo obhájit přínos metody historického příkladu jako metody lépe ilustrující kauzální ekonomické vztahy.

Moderní ekonometrické metody pracují s instrumentálními proměnnými. Ty umožňují relativně konsistentní odhady modelů tím, že odstraňují problém vychýlenosti koeficientů při pozorované endogenitě. Ta může být způsobena (i) vynecháním proměnné v modelu, jež je korelována s nezávisle proměnou (Joshua a Krueger, 2001), (ii) chybou měření nezávisle proměnné (Hausman, 2001) anebo tím, že (iii) některá z nezávisle proměnných je determinovaná závislou proměnnou. (McFadden, 1999) V takových případech jsou pak výsledky klasické lineární regrese nekonzistentní. Instrumentální proměnné, které jsou korelovány s endogenními proměnnými, avšak nikoli s náhodnou chybou, pak ovlivňují závisle proměnné pouze prostřednictvím vlivu na endogenní proměnné. (Hill, Griffiths a Guay, 2008) Tímto je pak možné dokázat vztah směrem od endogenních proměnných k závisle proměnným.

Metodou instrumentálních proměnných je možné získat konzistentní odhady pouze tehdy, pokud nejsou instrumenty korelovány s náhodnou chybou, tedy pokud není porušena výše zmíněná podmínka. (Kane, Rouse a Staiger, 1999) A pak tehdy, pokud mezi instrumentem a endogenní proměnnou není velmi nízká závislost či nezávislost. Potom by se totiž jednalo o špatný výběr instrumentální proměnné a mohlo by to vést k zavádějícím výsledkům. (Staiger a Stock, 1997) Při dokazování kauzality pomocí instrumentálních proměnných nastávají ale jisté metodologické problémy. Vypovídací schopnost instrumentálních proměnných může podléhat změnám v místních i časových podmínkách. Jakmile se pak statistický test snaží dokázat vztah mezi endogenními proměnnými a závisle proměnnými, nemusí se jednat o vztah, který je univerzálně platný, tedy není jisté, jestli se tento vztah nemůže změnit. Tato výtka platí stejně pro známou Grangerovu kauzalitu, která je založena na předpovědi, kdy proměnná x obsahuje informaci, která pomáhá vysvětlit proměnnou y vzhledem k minulým hodnotám x . Lze proto tvrdit, že žádný model v ekonometrickém smyslu nedokáže dokázat kauzalitu, pouze ukazuje na korelace a lineární vazby, které nemusí nutně znamenat, že x způsobuje y . Ekonometrický model pak dokáže odhadovat, jak moc hodnoty x ovlivňují hodnoty y . Ludwig von Mises k tomuto dodává:

„V společenských vědách o lidském jednání představuje statistika metodu historického výzkumu. Jedná se o popisnou metodu, která v numerických jednotkách zaznamenává historické události, které se udály ve vymezeném časovém období v rámci vymezené skupiny lidí na vymezeném území. Její význam spočívá hlavně v tom, že popisuje změny, tedy nikoliv něco, co by bylo neměnné.“ (Mises, 2007, s. 89)

Druhý metodologický problém spojený s využitím instrumentálních proměnných při modelování vztahů mezi proměnnými spočívá v tom, že jejich úspěšné využití musí podléhat agregaci dat. Dokazování univerzální platnosti ekonomických zákonů na agregovaných datech pak spíš připomíná metody přírodních věd, které popisují vztahy mezi prvky pomocí matematických modelů (např. fyzika). Nejedná se pak o metody blízké vědám společenským, které uvažují o člověku jako o reálné bytosti, která má vlastní psychologii. Ludwig von Mises k tomuto dodává:

„V přírodních vědách představuje statistika metodu induktivního výzkumu. Její epistemologické opodstatnění a její význam spočívá ve všeobecné konvenci o pravidelnosti a dokonalém determinismu v přírodních vědách. Přírodní zákony jsou považovány za trvalé. Jsou vždy plně funkční. Co se stane jednou, musí se stát i v jiných případech. Proto informace sprostředkované statistickým testováním mají obecnou platnost vzhledem k třídám jevů, ke kterým se vztahují. To znamená, že nejsou pouze omezené na určitá časová období a území.“ (Mises, 2007, s. 89)

A přesně z důvodu zdůraznění toho, že ekonomické vztahy nejsou stejně deterministické jako je tomu u vztahů mezi veličinami pozorovanými přírodními vědci, mnozí ekonomové upozorňují na nedostatky matematických modelů s ekonometrickými důkazy založenými na statické významnosti. Tyto postulují lidské chování, čímž zachází s člověkem jako s determinovanou bytostí. (Buchanan, 1979) Tvrdí, že matematická ekonomie, která je vybavena obsáhlým matematickým aparátem, v sobě zahrnuje předpoklady, které vylučují nepredikovatelné situace a že samotné předpoklady nemohou vést k jiným než již předpoklady determinovaným výsledkům. Ty v sobě zahrnují informace, které jedna osoba nemůže nikdy znát. (Hayek, 1995; Hayek, 1980; Hayek, 2001bc) Matematická ekonomie navíc vylučuje konkurenční aktivitu, která je výsledkem reakce na neočekávané změny okolí a kreativního rozhodování jednotlivců. (Kirzner, 1973; Otáhal, 2008; Grochová a Otáhal, 2010) Tyto vlastnosti omezují vypočítací schopnost ekonomické teorie a vytváří nepřekonatelnou mezeru mezi matematickou teorií a realitou. Jak tedy změnit ekonomickou teorii, aby byla co nejbližší realitě a byla lépe uplatnitelná ve vysvětlování reálných ekonomických jevů? Je třeba teorii zasadit do reality, která probíhá v historickém čase s nejistotou budoucího vývoje.

Historický čas ovlivňuje každé lidské rozhodnutí, neboť člověk se rozhoduje proto, že od rozhodnutí a následné realizace tohoto rozhodnutí očekává, že povede k budoucí změně. Lidé v rámci vlastního rozhodování uvažují minulé události, které formují jejich zkušenosti, na jejichž základě tvoří očekávání událostí budoucích, o kterých zároveň sami rozhodují. (Shackle, 1990a). Teorie, která uvažuje o člověku jako o reálné bytosti, která má vlastní psychologii, neboť lidé nejsou stroje, a proto jejich rozhodování nemůže být přirovnáváno k rozhodování robotů, jejichž programy dokonale odpovídají prostředím, ve kterých operují (Simon, 1959), musí vysvětlovat realitu v historickém čase s nejistotou budoucího vývoje. Nejde ale o čas v matematickém slova smyslu jako technickou dimenzi popsanou matematickou řadou (Shackle,

1990b), ale jako historický vývoj, který má otevřený konec. Kdyby historický čas neplynul a budoucnost by nebyla nejistá, rozhodování reálného člověka by ztratilo význam, protože by se od něj nedalo očekávat, že s sebou přinese změnu.⁷

Nejistá budoucnost vyplývající z historického času předpokládá neočekávatelné události, chyby v rozhodování a proto omezenou racionalitu člověka (Simon, 1955). Omezená racionalita reálného člověka ale brání tomu, aby byla platnost teorie verifikovatelná pouze na základě agregovaných dat. Verifikovat teorie na základě agregovaných dat není možné nejenom proto, že nelze sesbírat dostatečné množství dat, neboť některá data ve společenských vědách jsou principiálně nepozorovatelná, ale hlavně to není možné proto, že pozorovaná data se v čase vyvíjí a to, co bylo statisticky významné v určitých časových a místních podmínkách, v budoucnu významné být nemusí. Důvodem je fakt, že lidé upravují svá rozhodnutí na základě zkušeností, které v čase nabyli a na základě kterých mění očekávání a rozhodování, přičemž se snaží napravovat chyby, které v minulosti udělali. Proces učení (Hayek, 1980; Kirzner, 1973) proto vede k nepředvídatelnému vývoji agregovaných dat a brání k úplné verifikaci teorie na základě statistických metod. Jak tedy můžeme teoretický závěr statisticky dokázat? Nijak, teoretický závěr může být ale vysvětlen na historickém příkladu a teprve tak smysluplně přiblížen realitě, čímž je také usnadněna verifikace zdravým rozumem, což také umožňuje částečné rozeznání obecných implikací od historických faktů.⁸

Protože se realita vyvíjí v historickém čase a její vývoj je nejistý, nemohou být teorie verifikované na agregovaných datech považovány za obecně platné, neboť statistické testy potvrzující platnost teorie mohou být podmíněny místními a časovými okolnostmi. Proto teoretické závěry každého ekonomického modelu nemohou být nikdy úplně dokázány na základě statistických testů, ale mohou být vysvětleny na reálných příkladech, které se v historii udály. Hlavní argument pro takovou volbu důkazu spočívá v tom, že uplatnění teorie na reálném historickém příkladu přibližuje teoretické závěry realitě, což přidává ekonomické teorii na důvěryhodnosti vzhledem k vysvětleným měnícím se faktům a zároveň poskytuje cenná poučení pro budoucí hospodářskou politiku. Ta pak má možnost stavět na minulých zkušenostech a hledat racionální řešení reálných hospodářsko-politických problémů pro budoucnost. I když tedy ekonomickou teorii nelze úplně verifikovat na základě statistických testů, historický příklad představuje reálnou ilustraci teoretických závěrů a přibližuje teorii realitě, čímž také ilustruje platnost hospodářsko-politických doporučení v reálných podmínkách.

7 Tato kritika matematizovaných ekonomických modelů je plně konzistentní s Postkeynesovskou kritikou neoklasické ekonomie. Za velmi vlivný přínos k tomuto myšlenkovému směru v českém ekonomickém myšlení je v tomto případě třeba poděkovat prof. Milanovi Sojkovi (2000, 2010, kap. 4), který s touto částí mojí kritiky souhlasil.

8 Tento závěr neznamená, že statistické testy nemají žádnou vypovídací schopnost. Statistické testy mohou být velmi přínosné ve smyslu prezentace faktů. Tato prezentace by ale měla být chápána spíše jako kvantifikace historického příkladu, ne jako důkaz univerzální platnosti teoretického závěru.

Hospodářsko-politická doporučení vyplývající z teorie nikoliv úplně potvrzené na agregovaných datech, ale spíše ilustrované na historickém příkladu navíc umožňují ekonomům vzít v úvahu reálné rozhodování reálného člověka a tím také ukázat, jak rozhodování reálného člověka může ovlivnit budoucí nejistý vývoj společenské reality. Tato vlastnost historického příkladu přibližuje ekonomii více společenským vědám a činí tak z ekonomie vědu o reálném člověku ve společnosti a nikoliv vědu o determinované bytosti v abstraktním matematickém nebo ekonometrickém modelu.

Závěr

Cílem tohoto textu bylo vysvětlení přínosu metody historického příkladu jako ilustrace ekonomického teoretického modelu. V článku jsem se snažil ukázat, že realističnost předpokladů ekonomické teorie je nejenom důležitá pro pochopení teorie samotné, ale je také důležitou vlastností ekonomického teoretického modelu, neboť umožňuje hodnocení vypovídací schopnosti tohoto modelu zdravým rozumem v kontextu měnících se historických faktů. Argumenty vznesené ve prospěch využití historického příkladu jako důkazu nebo lépe ilustrace teoretického modelu byly rozděleny do dvou kategorií. První kategorie výhod metody historického příkladu spočívala v přiblížení teoretického modelu realitě. Význam této vlastnosti historického příkladu jsem se pokusil dokázat na diskusi ohledně způsobu, jakým si ekonomové vybírají teoretické modely, které chtějí empiricky verifikovat. Upozornil jsem na fakt, že metoda samotného zastánce pozitivní ekonomie, Milтона Friedmana, se spíše blížila pojetí způsobu verifikace Ronalda Coase, který realističnost předpokladů jako měřítko verifikace nepodceňuje.

Druhá kategorie výhod metody historického příkladu spočívá ve schopnosti vysvětlení kauzálních ekonomických vztahů. Tuto výhodu jsem vysvětlil za pomoci metodologické kritiky statistického testu, který využívá instrumentálních proměnných k důkazu kauzálního vztahu a Grangerovy kauzality. Moje kritika spočívala v tom, že vypovídací schopnost instrumentálních proměnných může podléhat místním a časovým podmínkám, proto statistický test, který využívá instrumentální proměnné, nemůže být považován za důkaz univerzální platnosti teoretického závěru.

Hlavní metodologická výtka využití instrumentálních proměnných jako důkazu kauzálního vztahu spočívala v uplatnění důkazu pouze v případě využití agregovaných dat. Prezentace empirických důkazů na základě agregace dat se ale blíží metodám přírodních věd, jejichž logické vazby bývají popsány matematickými modely. Proto jsem dále vysvětlil, že matematické modely neuvažují o člověku jako o reálné bytosti rozhodující se v historickém čase plynoucím do nejisté budoucnosti, což odtrhuje matematické modely od společenské reality. Tuto mezeru metoda historického příkladu snadno vyplňuje, protože počítá s místními a časovými podmínkami. Historický příklad navíc v sobě zahrnuje rozhodování reálných živoucích osob a důsledky jejich rozhodování na vývoj nejisté budoucnosti. Tímto historický příklad lépe vysvětluje kvalitativní obsah kauzálních vztahů a umožňuje tak částečné rozpoznání obec-

ných implikací teoretického modelu od měnících se historických faktů. I když moje argumentace nebyla nová, snažil jsem se znovu reformulovat tyto argumenty vzhledem k moderním výzkumným programům, abych navázal na klasické pojetí ekonomické vědy. Přece jenom pravdou je, že již od dob Adama Smitha byli významní ekonomové také velmi váženými znalci historie. Možná by se ekonomie neměla příliš vzdalovat od této velmi podnětné tradice.

Literatura

- ANGRIST J.; KRUEGER, A. 2001. Instrumental Variables and the Search for Identification: From Supply and Demand to Natural Experiments. *Journal of Economic Perspectives*. 2001, Vol. 15, No. 4, pp. 69–85.
- BENSON, B. L. 1990. *The Enterprise of Law: Justice without the State*. San Francisco (CA): Pacific Research Institute for Public Policy, 1990.
- BLAUG, M. 1997. *The Methodology of Economics: Or how economists explain*. Cambridge (UK): Cambridge University Press, 1997.
- BOETTKE, P. 1993. *Why Perestroika Failed: The Politics and Economics of Socialist Transformation*. London and New York: Rutledge, 1993.
- BREINEK, P. 2005. Procesy globalizace ve světové ekonomice. *Politická ekonomie*. 2005, Vol. 53, No. 6, pp. 826–841.
- BUCHANAN, J. M. 1979. Is Economics the Science of Choice? In *What Should Economists Do?* Indianapolis (IN): Liberty Fund, 1979.
- COASE, R. 1994. How should economists choose? In *Essays on Economics and Economists*. Chicago (IL): The University of Chicago Press, 1994.
- DOW, S. C. 1996. *The Methodology of Macroeconomic Thought: A Conceptual Analysis of Schools of Thought in Economics*. Cheltenham (UK) and Northampton (MA): Edward Elgar Publishing Ltd, 1996.
- DOW, S. C. 2004. Uncertainty and Monetary Policy. *Oxford Economic Papers*. 2004, Vol. 56, pp. 539–561.
- DOW, S. C. 2007. Variety of Methodological Approach in Economics. *Journal of Economic Surveys*. 2007, Vol. 21, No. 3, pp. 447–465.
- FRIEDMAN, M. 1997. *Metodologie pozitivní ekonomie*. Praha: Liberální institut, 1997.
- FRIEDMAN, M.; SCHWARTZ, A. J. 1993. *A Monetary History of the United States, 1867–1960*. Princeton (NJ): National Bureau of Economic Research, 1993.
- GOLOSOV, M.; LUCAS, E. R. 2007. Menu Costs and Phillips Curves. *Journal of Political Economy*. 2007, Vol. 115, No. 2, pp. 171–199.
- GROCHOVÁ, L.; OTÁHAL T. 2010. Podnikání a ekonomický rozvoj: Jaký je rozdíl mezi neorakouskou a novou institucionální ekonomikou? *Politická ekonomie*. 2010, Vol. 58, No. 5, pp. 623–640.
- HAUSMAN, J. 2001. Mismeasured Variables in Econometric analysis: Problem from the Right and from the Left. *Journal of Economic Perspectives*. 2001, Vol. 15, No. 4, pp. 57–67.
- HAYEK, F. A. 1980. Economics and Knowledge. In *Individualism and Economic Order*. Chicago: University of Chicago Press, pp. 33–56.
- HAYEK, F. A. 1995. *Kontrarevoluce vědy*. Praha: Liberální institut, 1995.
- HAYEK, F. A. 2001a. Teorie složitých jevů. In JEŽEK, T. (ed.). *Zásady liberálního řádu*. Praha: Academia, 2001.

- HAYEK, F. A. 2001b. Stupeň vysvětlování. In JEŽEK, T. (ed.). *Zásady liberálního řádu*. Praha: Academia, 2001.
- HAYEK, F. A. 2001c. Využití znalostí ve společnosti. In JEŽEK, T. (ed.). *Zásady liberálního řádu*. Praha: Academia, 2001.
- HILL, R. C.; GRIFFITHS, W. E.; GUAY, C. L. 2008. *Principles of Econometrics*. Hoboken (NJ): Wiley and Sons, Inc., 2008.
- KANE, T. J.; ROUSE, C.; STAIGER, D. 1999. Estimating Returns to Schooling when Schooling is Mismeasured. [National Bureau of Economic Research Working Paper No. 7235]
- KIRZNER, I. M. 1973. *Competition and Entrepreneurship*. Chicago (IL) and London (UK): The University of Chicago Press, 1973.
- KIRZNER, I. M. 1976. *The Economic Point of View: An Essay in the History of Economic Thought*. Menlo Park (CA): The Institute for Human Studies, Inc., 1976.
- KOUBA, L. 2010. Selhání experimentální transformace bývalé NDR pohledem soudobých sociálně-ekonomických přístupů k teorii růstu. *Ekonomický časopis*. 2010, Vol. 58, No. 7, pp. 707–724.
- LEESON, T. P. 2009. *The Invisible Hook: The Hidden Economics of Pirates*. Princeton: Princeton University Press, 2009.
- LOUŽEK, M. 2001. Metodologie Carla Mengera a její interpretace. *Politická ekonomie*. 2001, Vol. 49, No. 5, pp. 699–714.
- MENGER, C. 2007. *Principles of Economics*. Auburn (AU): Ludwig von Mises Institute, 2007.
- MISES, L. v. 2006. *Lidské jednání: Pojednání o ekonomii*. Praha: Liberální institut, 2006.
- MISES, L. v. 2007. *Theory and History: An Interpretation of Social and Economic Evolution*. Auburn (AL): Ludwig von Mises Institute, 2007.
- NORTH, D. C. 1981. *Structure and Change in Economic History*. New York (NY) and London (UK): W.W. Norton & Company, 1981.
- NORTH, D. C.; WALLIS, J. J.; WEINGAST, B. R. 2009. *Violence and Social Order: A conceptual framework for interpretation recorded human history*. Cambridge, New York, Melbourne, Madrid, Cape Town, Singapore, São Paulo: Cambridge University Press, 2009.
- OSBORNE, J. 2004. *An Introduction to Game Theory*. New York (NY): Oxford University Press, 2004.
- OTÁHAL, T. 2009. Souvislosti vzniku Federálního rezervního systému: Přehled ekonomických zájmů. *Ekonomický časopis*. 2009, Vol. 57, No. 8, pp. 788–803.
- OTÁHAL, T. 2008. Teorie podnikatelského objevování. *Politická ekonomie*. 2008, Vol. 56, No. 6, pp. 669–683.
- RIZZO, M. 1976. Praxeology and Econometrics: A Critique of Positivists Economics. In *New Directions in Austrian Economics*. Kansas City (KA): Sheed Andrews and McMeel, Inc., 1976.
- ŘÍKOVSKÝ, M. 2004. Metodologie rakouské školy. *Politická ekonomie*. 2004, Vol. 52, No. 6, pp. 823–847.
- ŘÍKOVSKÝ, M. 2001. Rakouská škola a její kritika standardního matematického přístupu k ekonomii. *Politická ekonomie*. 2001, Vol. 49, No. 5, pp. 717–732.
- SARGENT, J. T.; SURICO, P. 2011. Two Illustrations of the Quantity Theory of Money: Breakdowns and Revivals. *American Economic Review*. 2011, Vol. 101, No. 1, pp. 109–128.
- SHACKLE, G. L. S. 1990a. The Complex Nature of Time as a Concept in Economics. In *Time, Expectations and Uncertainty in Economics*. Adershot (GB): Edward Elgar Publishing Ltd., 1990.
- SHACKLE, G. L. S. 1990b. Time and Thought. In *Time, Expectations and Uncertainty in Economics*. Adershot (GB): Edward Elgar Publishing Ltd., 1990.

- SCHUMPETER, J. A. 1994. *History of Economic Analysis*. New York: Oxford University Press, 1994.
- SCHUMPETER, J. A. 2004. *Kapitalismus, socialismus a demokracie*. Brno: Centrum pro studium demokracie a kultury, 2004.
- SMITH, A. 2001. *Pojednání o podstatě a původu bohatství národů*. Praha: Liberální institut, 2001.
- SIMON, H. A. 1955. A Behavioral Model of Rational Choice. *Quarterly Journal of Economics*. 1955, Vol. 69, No. 1, pp. 99–118.
- SIMON, H. A. 1959. Theories of Decision-Making in Economics and Behavioral Science. *American Economic Review*. 1959, Vol. 49, No. 3, pp. 253–283.
- SIMS, CH. A. 2010. But Economics Is Not An Experimental Science. *Journal of Economic Perspectives*. 2010, Vol. 24, No. 2, pp. 59–68.
- SOJKA, M. 2000. Postkeynesovská ekonomie. *Politická ekonomie*. 2000, Vol. 48, No. 5, pp. 703–722.
- SOJKA, M. 2009. Stane se institucionální ekonomie paradigmatickým 21. století? *Politická ekonomie*. 2009, Vol. 57, No. 3, pp. 297–304.
- SOJKA, M. 2010. *Dějiny ekonomických teorií*. Praha: Havlíček Brain Team, 2010.
- STAIGER, D.; STOCK, J. H. 1997. Instrumental Variables Regression with Weak Instruments. *Econometrica*. 1997, Vol. 65, No. 3, pp. 557–586.
- STOCK, J. H.; WRIGHT, J. H.; YOGO, M. 2002. A Survey of Weak Instruments and Weak Identification in Generalized Method of Moments. *Journal of Business and Economic Statistics*. 2002, Vol. 20, No. 4, pp. 518–29.
- STÖRIG, H. J. 1996. *Malé dějiny filosofie*. Praha: Zvon, české katolické nakladatelství, 1996.
- VARIAN, H. L. 1995. *Mikroekonomie: moderní přístup*. Praha: Victoria Publishing, 1995.
- WALLIS, J. J. 2004. The Concept of Systematic Corruption in American Political and Economic History. [NBER Working Paper 10952]
- WEINGAST, B. R. 1995. The Economic Role of Political Institutions: Market-Preserving Federalism and Economic Development. *Journal of Law, Economics, & Organization*. 1995, Vol. 11, No. 1, pp. 1–31.
- WAWROSZ, P. 2011. Dosahování a narušování institucionální rovnováhy v redistribučních systémech. *Politická ekonomie*. 2011, Vol. 59, No. 4, pp. 526–546.
- WHITE, L. 2003. *Methodology of Austrian School*. Online edition: The Ludwig von Mises Institute, 2003.

ECONOMIC HISTORY: WHAT ARE THE CONTRIBUTIONS OF HISTORICAL EXAMPLE TO UNDERSTANDING OF ECONOMIC PHENOMENA?

Tomáš Otáhal, Department of Economics, PEF MENDELU v Brně, Zemědělská 1, CZ – 613 00 Brno (otahal@mendelu.cz)

Abstract

What are the contributions of historical example to understanding of economic phenomena? Economists widely adopt methods of natural sciences. But economics is a social science and the observed economic phenomena are qualitatively different from phenomena observed by natural sciences. Thus the use of natural sciences methods makes implications of economic theoretical models unrealistic. In this paper, I argue that the evidence of historical example is a good method to illuminate the implications of economic theoretical models, because if implications of economic theoretical models are illustrated in historical perspective, they can be more easily verified by common sense thus particular historical circumstances may be partly revealed. Moreover, historical examples also serve to demonstrate the qualitative content of casual economic relations based on human historical experience, which is ignored by natural science methods. The historical example is thus not only more realistic but it better corresponds with the social nature of economic science.

Keywords

economic history, economics, methodology, historical example

JEL Classification

B41, N00, N01