



Εθνικόν και Καποδιστριακόν Πανεπιστήμιον Αθηνών
Τμήμα Οικονομικών Επιστημών
ΠΜΣ «Οικονομική Επιστήμη»

Η Πολιτική Οικονομία της Μεγέθυνσης και της Ανισότητας
Διδάσκων: Νίκος Στραβελάκης
Εαρινό εξάμηνο
Μάθημα 3

Νεοκλασική Θεωρία και Ανισότητα

.Η αντιμετώπιση της οικονομικής μεγέθυνσης της διανομής και της ανισότητας στα νεοκλασικά οικονομικά βασίσθηκε και εν πολλοίς βασίζεται στα στοιχεία που χαρακτήρισαν αυτή την αλλαγή επιστημονικού παραδείγματος.

.Με την επικράτηση των νεοκλασικών οικονομικών το ενδιαφέρον μεταφέρθηκε από τη μελέτη της οικονομικής μεγέθυνσης και της διανομής ανάμεσα στις κοινωνικές τάξεις στην άριστη κατανομή των παραγωγικών πόρων ανάμεσα σε αυτόνομες οικονομικές μονάδες (agents).

.Η μεταβολή βασίσθηκε στη θεωρία της χρησιμότητας που αντικατέστησε την εργασιακή θεωρία της αξίας.

.Στην υποκειμενική θεωρία της σπάνιδος και της χρησιμότητας βασίζεται και η “αντικειμενική” νεοκλασική θεωρία της διανομής. Σύμφωνα με τη τελευταία, τα κέρδη είναι το κόστος του κεφαλαίου και οι μισθοί το οριακό προϊόν της εργασίας.

.Είναι μια σχέση που χαρακτηρίζει το βασικό κριτήριο του ευημερίας του Edgeworth και του Pareto. Η αύξηση της χρησιμότητας ενός δεν οδηγεί σε μείωση της χρησιμότητας των υπόλοιπων.

Τα δύο “Θεωρήματα της Ευημερίας” (I & II)

• Αυτό που με δύο κουβέντες λέει το I και “θεώρημα” της ευημερίας είναι ότι σε συνθήκες ανταλλακτικής ισορροπίας οι εμπλεκόμενοι στην οικονομική ζωή δεν έχουν να κερδίσουν κάνοντας επιπλέον συναλλαγές στις τιμές ισορροπίας.

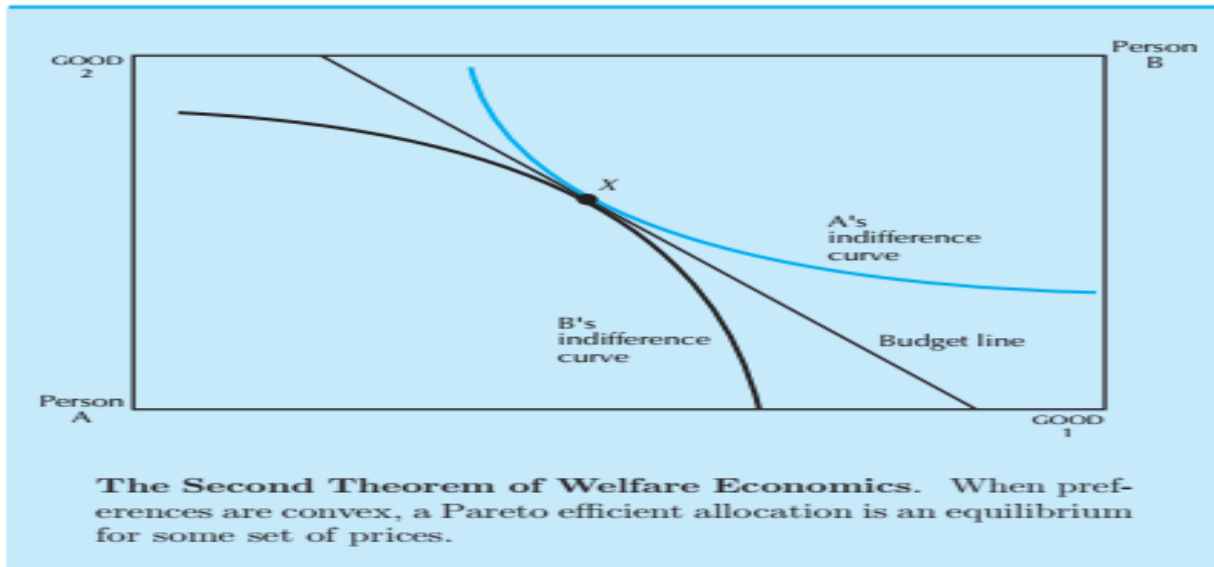
• Το πρώτο θεώρημα μας λέει ότι αν υπάρχουν δύο εφικτοί συνδυασμοί αγαθών από τους οποίους ο A είναι προτιμώμενος από όλους έναντι του B τότε σε συνθήκες ισορροπίας είναι σίγουρο ότι θα επικρατεί ο A συνδυασμός.

• Η απόδειξη είναι σχετική απλή αφού σε συνθήκες ανταλλακτικής ισορροπίας ο καθένας αποκτά το καλύτερο συνδυασμό που μπορεί να σηκώσει ο εισοδηματικός του περιορισμός.

• Με άλλα λόγια ισορροπεί στο σημείο που ο εισοδηματικός περιορισμός εφάπτεται στην υψηλότερη καμπύλη αδιαφορίας.

• Το δεύτερο θεώρημα θέτει το αντίστροφο ερώτημα. Υπάρχει ένα σύνολο τιμών ισορροπίας που να αντιστοιχίζεται σε “αποτελεσματική”, κατά Pareto, κατανομή των πόρων;

• Η απάντηση είναι το “κουτί του Edgeworth”. Η λογική της λύσης είναι ότι εάν οι προτιμήσεις είναι “κυρτές” (convex). Δηλαδή, ο χάρτης των καμπυλών αδιαφορίας των ατόμων A και B έχει τη συνήθη μορφή. Τότε υπάρχει μια εισοδηματική καμπύλη που διαχωρίζει τους δυο χάρτες στην υψηλότερη δυνατή καμπύλη αμοφτέρων. Η κλίση της καμπύλης δίνει τις σχετικές τιμές. Η λογική είναι ότι η χρησιμότητα του A δεν μπορεί να ανέβει πέραν του σημείου x χωρίς να περιορισθεί η χρησιμότητα του B.



Κάποιες Πρώτες Επισημάνσεις

• Παρόλο που δεν έχουμε μιλήσει ακόμη για παραγωγή μπορούν να γίνουν κάποιες πρώτες επισημάνσεις για την “κατά Pareto αποτελεσματικότητα”.

• Για να ισχύσει το “πρώτο θεώρημα” οι καταναλωτικές προτιμήσεις του A πρέπει να είναι εντελώς αυτόνομες από τις καταναλωτικές προτιμήσεις του B. Αν επηρεάζονται τότε υπάρχει “καταναλωτική εξωτερική οικονομία” και η ανταγωνιστική ισορροπία δεν είναι κατ’ ανάγκη “κατά Pareto αποτελεσματική”.

• Η προηγούμενη αναφορά είναι ένας τρόπος να πούμε ότι η όλη διαδικασία βασίζεται, ακόμη και χωρίς παραγωγή, στο ότι όλοι οι εμπλεκόμενοι στη διαδικασία της ανταλλαγής είναι “παραλήπτες τιμών” ή αν προτιμάτε θεωρούν δεδομένες τις επικρατούσες τιμές όπως και η νεοκλασική επιχείρηση.

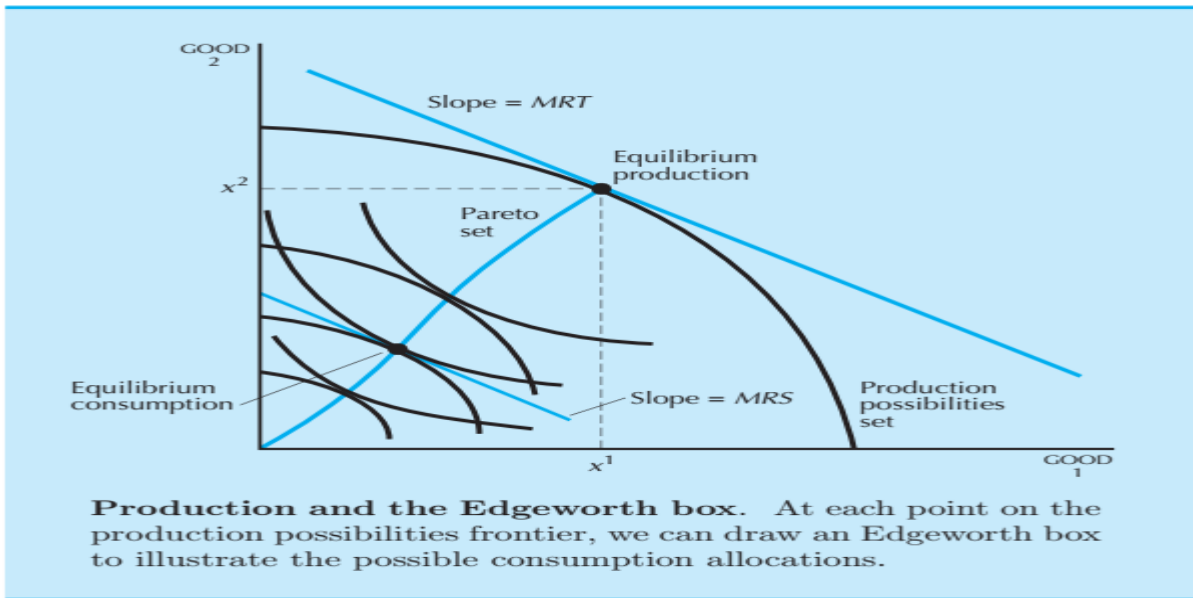
• Όμως ακόμη και σε αυτό το περιβάλλον σε συνθήκες εξωτερικής οικονομίας κατανάλωσης ο ένας καταναλωτής μπορεί να δωροδοκήσει τον άλλο να καταναλώσει μικρότερη ποσότητα από ένα αγαθό που επιθυμεί. Σε αυτές τις συνθήκες μπορεί να προκαλέσει μια επιθετική μεταβολή των τιμών.

• Τέλος το “θεώρημα II” διαχωρίζει τον κατανομητικό από διανεμητικό ρόλο των τιμών. Όμως οι τιμές κατανέμουν τους πόρους βάσει καταναλωτικών προτιμήσεων αλλά έχουν και διανεμητικό ρόλο στη δυνατότητα απόκτησης αγαθών. Αυτή η διαφοροποίηση οδηγεί σε μια σειρά από μεταβιβάσεις που μπορεί να μεταβάλλουν τη συνολική χρησιμότητα όπως θα δούμε σε λίγο.

.Τα παραπάνω αποκτούν μεγαλύτερη σημασία βάζοντας και την παραγωγή στο αναλυτικό σχήμα.

.Το γεγονός ότι μπορούμε κατά το δοκούν να εξαιρούμε και να εντάσσουμε κομβικά στοιχεία της οικονομικής δραστηριότητας από το αναλυτικό σχήμα οφείλεται στη δυνατότητα του homo economicus να αποφασίζει ανεπηρέαστος.

.Στη περίπτωση μας αυτό σημαίνει ότι υπάρχει μια δεδομένη καμπύλη παραγωγικών δυνατοτήτων που κάθε σημείο της αντιστοιχίζεται με ένα κουτί Edgeworth.



Συμπληρωματικές Επιστημάνσεις λόγω Παραγωγής

•Για το θεώρημα I “αποτελεσματική ισορροπία κατά Pareto” σημαίνει ότι όπως οι αποφάσεις των καταναλωτών είναι αυτόνομες μεταξύ τους το ίδιο συμβαίνει και με τις αποφάσεις των επιχειρήσεων.

•Στο προηγούμενο μάθημα είδαμε ότι στη κλασική πολιτική οικονομία και ιδιαίτερα στο Μάρξ ο ανταγωνισμός είναι “πόλεμος” με όπλο τις τιμές και αυτό οδηγεί στη πραγμάτωση του νόμου της πτωτικής τάσης του ποσοστού κέρδους με την αποδοχή τεχνικών με χαμηλότερο μεταβατικό ποσοστό κέρδους (βλ. θεώρημα του Okishio). Εδώ οι τιμές είναι δεδομένες για όλους.

•Αλλά υπάρχει και ένα ευρύτερο ζήτημα αναφορικά με τη συνολική συνάρτηση παραγωγής, την “τιμή του κεφαλαίου”, συνακόλουθα και της εργασίας, σε αυτή τη λογική. Είναι η γνωστή “αντιπαράθεση του κεφαλαίου” ή “αντιπαράθεση των δύο Cambridge”.

•Το πρώτο στοιχείο της αντιπαράθεσης ήταν η δυσκολία ορισμού ενός ομογενούς δείκτη κεφαλαίου από ετερογενές κεφάλαιο σε φυσικούς όρους.

•Το δεύτερο η πιθανότητα σε κάποιο χαμηλότερο ποσοστό κέρδους μια τεχνική ή δραστηριότητα να επανέλθει. Αυτό σημαίνει ότι η καθοδική καμπύλη της “οριακής αποδοτικότητας του κεφαλαίου” δεν είναι υποχρεωτικό να ισχύει.

•Τέλος, ακόμα και στο περιβάλλον της νεοκλασικής θεωρίας, το “θεώρημα II” προϋποθέτει ότι και τα παραγωγικά σετ των επιχειρήσεων θα είναι “κυρτά”. Δηλαδή δεν υπάρχουν αύξουσες αποδόσεις κλίμακας.

Κοινωνικές Καμπύλες Ευημερίας

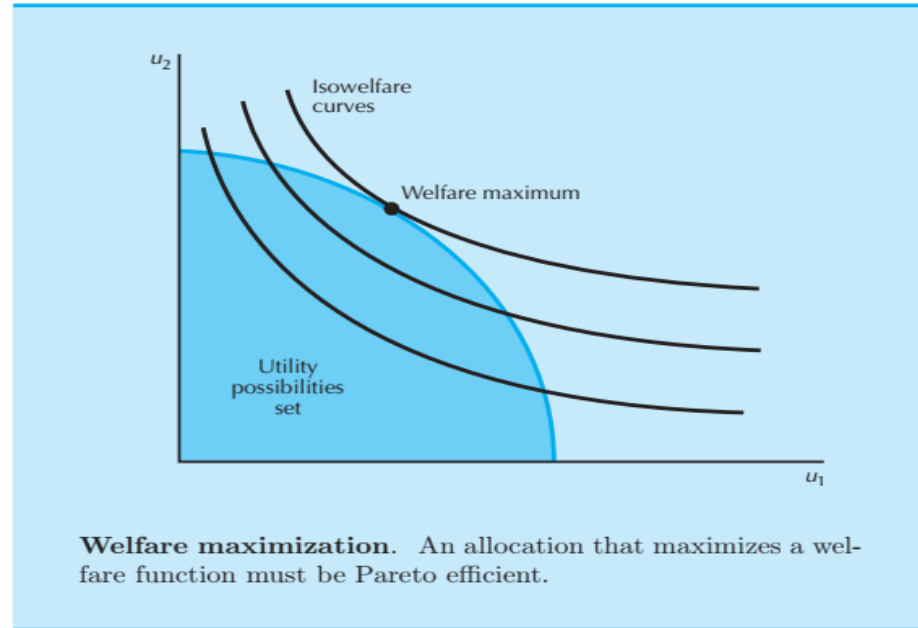
•Οι κοινωνικές καμπύλες ευημερίας προκύπτουν από την άθροιση ατομικών προτιμήσεων των μελών της κοινωνίας (των ατομικών εξισώσεων χρησιμότητας). Η άθροιση είναι εφικτή αν θεωρήσουμε ότι τα μέλη της κοινωνίας δεν επηρεάζονται από τις προτιμήσεις των υπόλοιπων μελών ή από τις προτιμήσεις του συνόλου (συνάρτηση Bergson - Samuelson).

•Όμως αυτή η διαδικασία έχει επιπλέον προβλήματα. Πώς μπορούμε να αθροίσουμε ένα σύνολο από ιεραρχημένες προτιμήσεις χρησιμότητας (ordinal utilities); Επίσης πώς μπορούμε να αθροίσουμε ή να προσδιορίσουμε τη χρησιμότητα και τις προτιμήσεις για “δημόσια αγαθά” όταν εμπλέκονται περισσότερα των δύο ατόμων;

•Η θεωρία συζητά αυτά τα προβλήματα για χρόνια. Όμως η μόνη παραδοχή που κάνει είναι ότι η κοινωνική καμπύλη ευημερίας είναι αύξουσα σε κάθε αύξηση της χρησιμότητας των μελών της κοινωνίας.

•Στη συνέχεια βάζει στην άκρη τα προβλήματα και προχωρά στην λύση της άσκησης μεγιστοποίησης της συνολικής χρησιμότητας. Δηλαδή, την εφικτή κατανομή των πόρων που μεγιστοποιεί τη συνολική “ευημερία” της κοινωνίας.

• Η πρώτη ιδιότητα της μεγιστοποίησης είναι ότι είναι “αποτελεσματική κατά Pareto”. Η απόδειξη προκύπτει από την υπόθεση η “κοινωνική καμπύλη ευημερίας” είναι αύξουσα συνάρτηση της ατομικής χρησιμότητας των μελών του συνόλου.



• Η προσέγγιση μπορεί να διατυπωθεί συνολικά ως ακολούθως. Αν το σύνολο των πιθανών κατανομών χρησιμότητας είναι “convex set” όπως παραπάνω τότε κάθε ακρότατο σημείο είναι “αποτελεσματικό κατά Pareto”. Η συνάρτηση ευημερίας εξασφαλίζει ότι κάθε μέγιστο ευημερίας είναι κατά Pareto αποτελεσματικό και κάθε αποτελεσματική κατά Pareto κατανομή είναι welfare maximum.

• Με τον ορισμό μιας γενικής καμπύλης κοινωνικής ευημερίας η συζήτηση αναφορικά με τη διανομή και την ανισότητα αποκτά μια άλλη διάσταση.

• Σύμφωνα με τη θεωρία η κοινωνία μπορεί να θέσει ηθικούς στόχους (fair allocations) αναφορικά με τη διανομή και εξετάζεται την επίδρασή τους πάνω στη συνολική ευημερία.

• Συνολικά η νεοκλασική θεωρία λέει ότι μια κατανομή είναι fair allocation όταν κανείς δεν ζηλεύει τον τρόπο ζωής (το συνδυασμό αγαθών) του άλλου και είναι και “αποτελεσματική κατά Pareto”.

• Το “κουτί του Edgeworth” μπορεί να θεωρηθεί fair allocation (γιατί;).

• Η όλη λογική σημαίνει ότι στη νεοκλασική θεωρία δεν αναμένονται τεράστιες διαφορές εισοδημάτων και πλούτου διαφορετικά το Pareto Efficiency δεν μπορεί να ισχύει και μπαίνουμε στη περιοχή της αποτυχίας αγοράς.

• Η διατύπωση του Dalton 1920 είναι χαρακτηριστική

- For the economist is primarily interested, not in the distribution of income as such, but in the effects of the distribution of income upon the distribution and total amount of economic welfare, which may be derived from income. We have to deal, therefore, not merely with one variable, but with two, or possibly more, between which certain functional relations may be presumed to exist.

Η Αρχή των Μεταβιβάσεων Dalton – Pigou

Όπως έχουμε αναφέρει ήδη οι πρώτες δεκαετίες του 20ου αιώνα ήταν εποχές έντονης ανισότητας. Παράλληλα ήταν εποχές κοσμοϊστορικών αλλαγών. Η νεοκλασική θεωρία δεν μπορούσε να συνεχίσει να μιλά για “ευημερία κατά Pareto” αγνοώντας τη διανομή.

Σε αυτό το πλαίσιο δίπλα στο διανεμητικό “νόμο του Pareto” βγήκε και η “αρχή των μεταβιβάσεων” προς και ανάμεσα στις εισοδηματικές ομάδες που συνδέεται με τον Βρετανό οικονομολόγο και πολιτικό Hugh Dalton και φυσικά τον οικονομολόγο του Cambridge A. C. Pigou. Οι αναλύσεις τους επηρέασαν αποφασιστικά το έργο του Atkinson (2015) του Piketty και του Saez στη σύγχρονη θεωρία της ανισότητας, ιδιαίτερα την πρόταση επιβολής ενός φόρου στην περιουσία που θα περιορίσει την ανισότητα.

Η βασική αρχή του σχήματος Dalton – Pigou είναι ότι “κάθε μεταβίβαση δε θα πρέπει να μειώνει τη κοινωνική ευημερία”. Με βάση αυτό το κριτήριο εισηγήθηκαν και αξιολόγησαν μια σειρά στατιστικά μέτρα της ανισότητας που θα δούμε στη συνέχεια.

Αυτά σε συνδυασμό με τη συνάρτηση παραγωγής Cobb – Douglas όπου το μερίδιο των κερδών είναι 20% και των μισθών 80% ήταν η “απάντηση” της νεοκλασικής θεωρίας στην ανισότητα των αρχών του αιώνα. Ας τα πάρουμε με τη σειρά ξεκινώντας από τα στατιστικά μέτρα .

Ο Νόμος του Pareto

• Παράλληλα με τη θεωρία της οικονομικής αποτελεσματικότητας ο Pareto παρουσίασε την περίφημη ομώνυμη κατανομή που έχει την ακόλουθη γενική μορφή.

•

$$y = \frac{A}{x^{\alpha}}$$

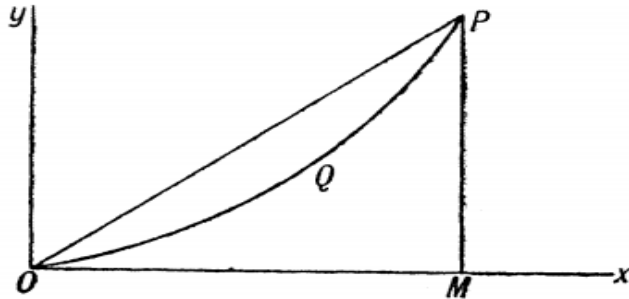
• Όπου x είναι ένα οποιοδήποτε εισόδημα, y ο αριθμός των εισοδημάτων που είναι μεγαλύτερα του x και, A, α είναι σταθερές για κάθε κατανομή εισοδημάτων αλλά μεταβλητές μεταξύ κατανομών.

• Όσο υψηλότερη είναι η παράμετρος α τόσο μεγαλύτερη είναι η ανισότητα.

• Η λογική πίσω από την κατανομή είναι ότι οποιαδήποτε μεταβολή των κατώτατων εισοδημάτων δεν πρόκειται να μειώσει την ανισότητα. Ο μόνος τρόπος περιοριστεί η ανισότητα είναι ο ρυθμός μεγέθυνσης του συνολικού εισοδήματος να είναι υψηλότερος του πληθυσμού (γιατί;).

Καμπύλες Lorenz

• Το μέτρο ανισότητας που ακολούθησε την κατανομή Pareto ήταν οι καμπύλες Lorenz (1905).

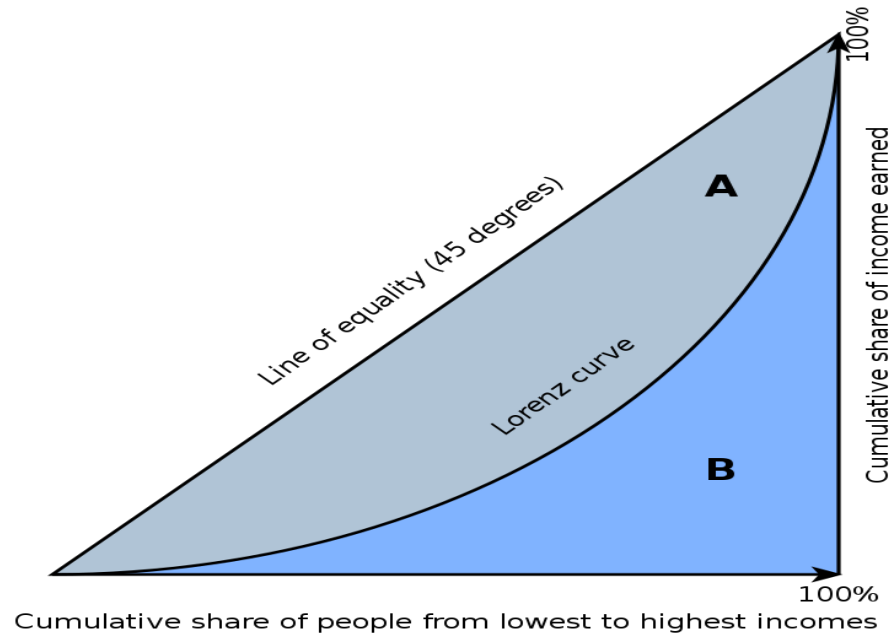


• Ο άξονας των τετμημένων (Ox) μετρά τα ποσοστά του πληθυσμού με ποσοστά εισοδήματος υψηλότερα από y . Αυτό σημαίνει ότι $OM=OP=100$. Η καμπύλη OQP μετρά τη σχέση των δύο μεγεθών. Παραδείγματος χάριν, αν το ανώτερο 10% των εισοδημάτων κατέχει το 75% του εισοδήματος αυτό θα κάνει τη καμπύλη να απομακρυνθεί από την ευθεία των 45 μοιρών (OP) που αντιπροσωπεύει συνθήκες απόλυτης ισότητας.

Μέτρα Υπολογισμού της Ανισότητας

•Τη συνεισφορά του Lorenz την ακολούθησε και επεξέτεινε μια σειρά στατιστικών μέτρων αρκετά από τα οποία είναι μέτρα περιγραφικής στατιστικής.

•Τα βασικά είναι η “τυπική απόκλιση” και η σταθερά Gini (Giorgi 1990). Η τελευταία είναι το δημοφιλέστερο μέτρο υπολογισμού της ανισότητας ακόμα και σήμερα. Προσδιορίζεται από την ακόλουθη γραφική επεξήγηση:



Μεταβιβάσεις και Μείωση της Ανισότητας

• Η βασική εργασία του Dalton (1920) και εν πολλοίς και του Pigou είναι η επίδραση μεταβιβάσεων εισοδήματος στη μείωση της ανισότητας με παράλληλη αύξηση της ευημερίας. Για το Dalton ειδικότερα, η έρευνα συνοδεύεται και από αξιολόγηση των μέτρων υπολογισμού της ανισότητας.

• Η καινοτομία της έρευνας έγκειται στο ότι συσχετίζει το εισόδημα με τη χρησιμότητα και την ευημερία. Όμως αυτή η συσχέτιση προϋποθέτει την άθροιση των ατομικών χρησιμοτήτων με τα προβλήματά της. Βασική της αδυναμία ότι δεν εμπλέκει καθόλου τον πλούτο στην ανάλυση και για αυτό δεν εκτιμά την επίδραση συγκεκριμένων κατηγοριών εισοδήματος στην ανισότητα στο σύνολό της.

• Είναι χαρακτηριστικό ότι το πρώτο κριτήριο που εξετάζει είναι η επίδραση στην ανισότητα αναλογικών αυξήσεων σε όλα τα εισοδήματα (x_a είναι ο αριθμητικός και x_g ο γεωμετρικός μέσος των εισοδημάτων) Εάν δ η ανισότητα (γιατί ο λόγος είναι μέτρο ανισότητας;) και $\theta > 1$ τότε:

$$\delta = \frac{\log x_a}{\log x_g}$$

$$\text{Then } \delta' = \frac{\log \theta + \log x_a}{\log \theta + \log x_g}, \text{ and, since } x_a > x_g, \text{ we have } \delta > \delta'$$

•Ανάλογη είναι η επίδραση ισόποσων αυξήσεων στα εισοδήματα.

•Όμως εάν οι μεταβιβάσεις αφορούν μια συγκεκριμένη κατηγορία εισοδημάτων τότε η συνολική δυνητική ευημερία (αριθμητικός μέσος) και πραγματική ευημερία (γεωμετρικός μέσος) παραμένουν αμετάβλητες και ο λόγος τους είναι ο ίδιος.

•Πως αντιδρά η παράμετρος Gini σε αυτές τις μεταβιβάσεις;

•Μισό αιώνα μετά το βιβλίου του Pigou και το άρθρο και κατόπιν βιβλίο του Dalton ο Atkinson, ο Stiglitz και άλλοι επέκτειναν τη λογική του νεοκλασικού υποδείγματος στα δεδομένα της εποχής του νεοφιλελευθερισμού.

•Στην πορεία αυτή αποδέχθηκαν ότι λόγω εξωτερικών οικονομιών η ανισότητα είναι εμπόδιο στην “κατά Pareto αποτελεσματικότητα”. Βέβαια σε όλη αυτή τη διαδικασία δεν μπορούν να ερμηνεύσουν το διάστημα μετά το πόλεμο που η ανισότητα ήταν περιορισμένη.

•Το ίδιο διάστημα οικονομολόγοι (Shaikh, Taylor) ξεκινώντας από τον απόλυτο ορισμό της ανισότητας της κλασικής πολιτικής οικονομίας και τη θεωρία των “δύο σταδίων” των econophysics μπορούν να ερμηνεύσουν τόσο τον περιορισμό όσο και την άνοδο της ανισότητας από το μερίδιο των κερδών και την αύξηση του βάρους των χρηματοπιστωτικών συναλλαγών στη παγκόσμια οικονομία.