

PREFACIO

Amparo Urbano

ERI-CES y Universitat de València

La economía experimental y la economía

Según Vernon Smith, premio Nobel de Economía 2002, “*La economía experimental aplica métodos de laboratorio para estudiar las interacciones de los seres humanos en los contextos sociales gobernados por reglas explícitas o implícitas*”. Las reglas explícitas pueden definirse por secuencias controladas por el experimentador y por la información sobre los sucesos que ocurren en la situación estratégica bajo análisis, entre n personas con pagos definidos (en el Capítulo 1 estas reglas se presentarán con todo detalle). Las reglas implícitas son normas, tradiciones y hábitos que las personas traen consigo al laboratorio como parte de su herencia evolutiva, cultural y biológica y, por tanto, no son controladas por el experimentador.

La economía experimental ha realizado su transición de “asunto” practicado por un grupo de especialistas a herramienta del análisis económico, lo bastante familiar para usarla sin comentario adicional, al igual que lo hicieron en su día la teoría de juegos, la economía matemática y la econometría. Aunque en sus inicios muchos economistas los veían con bastante escepticismo, los experimentos son, hoy en día, un lugar común. Esta transición ha dado lugar a cambios, tanto en la manera en que los economistas ven los métodos experimentales como en los propios métodos experimentales.

A pesar de los logros obtenidos por la economía experimental, a ésta aún le queda, al menos, un reto por resolver al que no es ajena la teoría económica. Así, aunque la integración de la economía experimental en la economía es un hecho, una de las cuestiones que aún no se han resuelto es cómo combinar la investigación en teoría económica y en economía experimental; es decir, cómo llevar a cabo una contribución mutua tal que ambas investigaciones salgan reforzadas. Algunos economistas proponen ir pensando en posibles experimentos cuando se desarrolla la teoría económica y pensar en la teoría cuando se llevan a cabo experimentos.

A este respecto, en lugar de preguntarse si la teoría económica describe el comportamiento humano de manera acertada, y debatir sobre cómo medir e interpretar las posibles discrepancias entre los resultados experimentales y los teóricos, resultaría de mayor utilidad investigar si la teoría recoge los elementos importantes que modelan el comportamiento humano (véase el Capítulo 6 sobre las preferencias sociales). Desde este punto de vista, el énfasis se desplaza desde la predicción teórica a la estática comparativa. Por ejemplo, un comportamiento experimental que consistentemente respondiera a cambios en las tasas de descuento, como predice la teoría de la negociación, nos convencería de que la teoría ha identificado el papel relevante que desempeña la impaciencia en el comportamiento humano, incluso si la teoría no es suficientemente completa para recoger cada aspecto de dicho comportamiento. Sin embargo, y dado que el grueso de la evidencia experimental sugiere que las sencillas teorías de la negociación dejan algunos aspectos del comportamiento humano sin explicar (véase el Capítulo 8 sobre la negociación), sería de gran utilidad que los experimentos también sugirieran cómo construir un método más preciso de evaluación del comportamiento humano.

Cuando los resultados experimentales no corroboran las teorías subyacentes, una reacción común, desde la vertiente teórica, es afirmar que la sencillez de los modelos teóricos no puede recoger todos los aspectos del complejo comportamiento humano. Pero estas afirmaciones olvidan una cuestión fundamental: uno de los propósitos de cualquier teoría es elegir, con criterio, qué consideraciones dejar fuera del modelo. El que existan circunstancias en las que la teoría no predice correctamente el comportamiento humano no es una razón para rechazarla. Un ejemplo de ello son los modelos que se desarrollaron para incorporar las consideraciones de “justicia” observadas en los experimentos sobre negociación (véase el Capítulo 6). Estos modelos, aunque incompletos, tienen la virtud de que sus predicciones son claras y pueden extenderse fácilmente a situaciones nuevas, confirmando que, en una amplia variedad de circunstancias, predicen el comportamiento mejor que los modelos estándar. Esta metodología conjunta es la que se necesita para progresar, y es la que debería potenciarse para combinar de manera efectiva la teoría y los experimentos. ¿Cómo lograrlo?

La teoría económica construye modelos del “mundo real” representados mediante funciones que proporcionan información sobre la situación que analizar. El entorno genera situaciones que dichas funciones transforman en resultados. La teoría es una herramienta para entender estas funciones transformadoras. Desafortunadamente, dichas funciones son demasiado complicadas para trabajar directamente con ellas. De la misma manera, un experimento asocia un resultado con un input: es un modelo de una situación, exactamente igual que una teoría.

El resultado de un experimento es, asimismo, un modelo. Por tanto, la combinación de teoría y trabajo experimental podría producir herramientas fáciles de utilizar, pero con la suficiente información sobre la función transformadora para que ésta resulte de utilidad.

Una manera de juzgar dicha utilidad podría basarse en la habilidad de predecir. Sin embargo, supóngase que se tiene tanto una teoría como un experimento sobre un determinado comportamiento económico, con diferentes predicciones. Las preguntas relevantes son: ¿Cómo combinar ambos para dar lugar a una predicción conjunta más precisa? ¿Cómo usar los experimentos para diseñar una nueva teoría económica?

Los experimentos pueden llenar el vacío que deja la teoría cuando no es informativa o es demasiado complicada para ser útil. Por ejemplo, el papel ejercido por los economistas en el diseño de las subastas de la *Federal Communications Commission* (FCC) de Estados Unidos evidenció la utilidad de la teoría económica. Sin embargo, antes de llevarse a cabo las subastas, la FCC financió varios experimentos para explorar sus propiedades (véase el Capítulo 12 para el análisis de los sistemas económicos). Estos experimentos tuvieron un papel importante en el perfeccionamiento del procedimiento de subastas concebido a partir de argumentos teóricos.

Hay que constatar que una parte del trabajo experimental se ha centrado en identificar las imprecisiones de la teoría económica. Por ejemplo, el modelo económico estándar de comportamiento individual es el que supone que los individuos maximizan su utilidad esperada. Sin embargo, amplia evidencia experimental sugiere que la gente no siempre se comporta de esta manera (el Capítulo 2 ofrece una panorámica sobre la toma de decisiones individuales). No obstante, uno de los obstáculos para una completa integración de la teoría económica y los experimentos es que no se tiene una idea clara de lo que hace “buena” una teoría. Existe una amplia evidencia de las “deficiencias” de la teoría de la utilidad esperada, así como una amplia colección de modelos alternativos (véase nuevamente el Capítulo 2) que tampoco salen siempre airoso en las comprobaciones experimentales. Si el objetivo de una teoría no es su realismo, sino su utilidad, entonces una de las dificultades de la teoría económica es que hay poco consenso sobre lo que hace que una teoría sea útil, aparte de su uso continuado. Lo anterior representa un reto al menos en dos aspectos: los teóricos necesitan ser más explícitos en sus teorías y en sus respuestas a los experimentos, y los experimentalistas, cuando interpretan resultados que corroboran teorías existentes, necesitan evaluar no sólo el incremento potencial de precisión de la teoría, sino también la creciente complejidad de la misma.

¿Cómo puede contribuir la teoría económica a la economía experimental? Primero, puede llenar el vacío resultante cuando los experimentos no son suficientemente informativos (a un coste razonable) para ser útiles. Segundo, la teoría económica puede ser útil para evaluar la validez de los experimentos. Los modelos teóricos del comportamiento pueden proporcionar una mayor comprensión de las relaciones entre los resultados experimentales y los aspectos no controlados de la situación experimental (validez externa), así como de la relación entre el entorno experimental y el comportamiento observado (validez interna).

En definitiva, la teoría económica y los experimentos económicos pueden combinarse para progresar fructíferamente en el conocimiento del mundo real y, de esta manera, evitar comentarios cruzados del tipo: *“Los resultados experimentales parecen contradecir la teoría, pero no se dispone de un método que mida la discrepancia entre ellos...”*, *“... sin embargo, sospecho que los sujetos experimentales perciben realmente un protocolo experimental diferente bajo el que su comportamiento sería consistente con la teoría”*, *“pero la teoría es una aproximación que no se puede esperar que se cumpla en cada situación, y el descubrimiento de esta excepción no nos dice nada sobre la teoría en otras aplicaciones”*.

Muy al contrario, sólo cuando la teoría económica y la economía experimental vayan de la mano se progresará realmente en nuestro conocimiento del mundo real. Este es un reto apasionante en el que tanto teóricos como experimentalistas debemos involucrarnos.

A modo de conclusión

El éxito de la economía experimental es un hecho incuestionable. Los experimentos son, hoy en día, un lugar común en economía y pueden protegernos de intuiciones erróneas. No obstante, sería conveniente replicarlos en distintos contextos y lugares para evitar conclusiones precipitadas, por más que nuestra profesión no valore la replicación, sino los experimentos originales.

La investigación en economía experimental está firmemente asentada en el mundo académico y en continua expansión. En particular, esto es así en España, como puede observarse en la Figura 1. A este respecto, es importante destacar que la investigación en economía experimental se ha desarrollado con una clara vocación internacional, multidisciplinar, y con una capacidad extraordinaria de atracción. Esta atracción ha sido especialmente importante para los teóricos de juegos, que han encontrado en la economía experimental un campo natural para poner a prueba sus hipótesis y/o conjeturas. Dicha interacción ha sido importan-

te para progresar en nuestro conocimiento del mundo real y debería continuar reforzándose en el futuro.

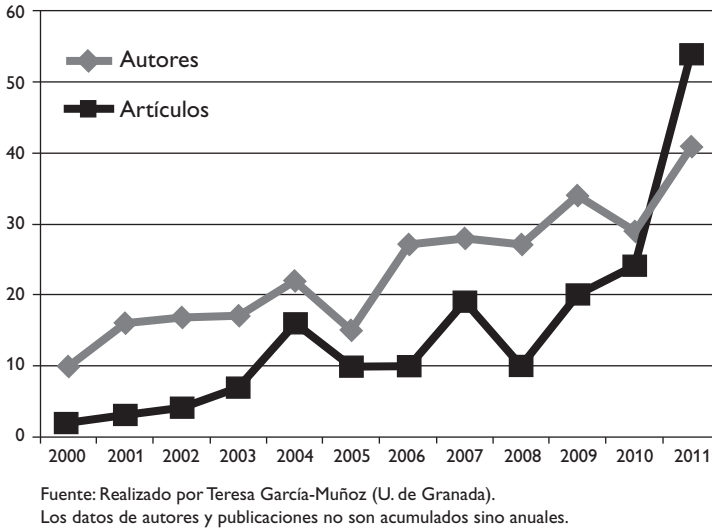


Figura 1. Investigadores y publicaciones en España.

El presente libro nace con la ilusión de iniciar al lector en la metodología experimental y en su aplicación al estudio económico del comportamiento, de los mercados y, más en general, de las instituciones y, así, potenciar vocaciones futuras que nos permitirán seguir avanzando en nuestra comprensión de la realidad.