

UM ESTUDO DOS MICROFUNDAMENTOS ECONÔMICOS PROPOSTOS POR SIMON E HAYEK

Adriana Sbicca
Departamento de Economia - UFPR

RESUMO

Nesse artigo são analisados os microfundamentos de Friedrich A. Hayek e Herbert A. Simon no que se refere às suas propostas epistemológicas, procurando desenvolver uma reflexão acerca da natureza e da forma do conhecimento condizente com uma abordagem institucionalista de caráter evolucionário. Isto é feito observando o modo como os autores descrevem a apreensão das informações e a percepção dos agentes econômicos, a maneira de inter-relacionar esses conhecimentos parciais e subjetivos dos indivíduos, os mecanismos gerados para lidar com a limitação de conhecimento num ambiente complexo com incertezas e a conseqüente origem e natureza de instituições.

Palavras-chave: Epistemologia, Hayek, Simon, Instituições

UM ESTUDO DOS MICROFUNDAMENTOS ECONÔMICOS PROPOSTOS POR SIMON E HAYEK

Adriana Sbicca¹

1. Introdução

Um caminho que nos parece promissor para o desenvolvimento da economia heterodoxa é o aprofundamento dos microfundamentos do comportamento econômico e, a partir deles, o desenvolvimento de novas proposições teóricas que salientem a dimensão psicológica do agente econômico, ou, mais precisamente, a racionalidade individual e os processos de aquisição do conhecimento. Esta consideração inicial nos levou à leitura de Friedrich von Hayek e Herbert Simon. Estes autores discordam do tratamento dos processos de tomada de decisão como uma simples convergência de opiniões que leva a um resultado maximizador. Hayek chama a atenção para o caráter subjetivo da percepção individual do mundo real e Simon destaca as distintas capacidades cognitivas dos agentes e a busca da satisfação pelo indivíduo. Do tratamento dado pelos autores ao comportamento individual emerge a necessidade do estudo da inter-relação humana. Seguindo a intuição de Hayek e Simon quanto ao conhecimento humano e à imprevisibilidade do comportamento, o foco na abordagem cognitiva parece ser um início bastante frutífero para se construir estruturas econômicas, envolvendo incerteza (de Knight) e informação imperfeita. Apesar de movidos por propostas diferentes - Simon procurando mostrar quanto o indivíduo se afasta do comportamento maximizador e Hayek focando o motivo de instituições funcionarem mesmo num ambiente que não apresenta uma ordenação centralizada - seus trabalhos apresentam semelhanças quanto à compreensão do comportamento individual. A ênfase de Hayek no surgimento de uma ordem espontânea, enquanto Simon foca os padrões de conduta (*rules of thumb*), idéia que utiliza principalmente no âmbito da firma, gera implicações destes microfundamentos nos âmbitos micro e macroeconômico. O fato dos dois autores serem conhecidos de maneira tão distinta - Simon como um representante da heterodoxia (no sentido de uma proposta diferenciada da ortodoxia econômica, o neoclassicismo) e Hayek como tendo feito uma defesa brilhante do liberalismo a partir de fortes críticas ao socialismo - torna ainda mais instigante a busca por uma reflexão sobre como proposições marcadas pela semelhança em

¹ Departamento de Economia – UFPR.

seus microfundamentos levaram a posições tão diversas nos seus trabalhos de economia. A aparente dificuldade que isso poderia sugerir foi enfrentada com o estudo da análise epistemológica de Hayek, considerando secundária sua proposta política (como em CALDWELL, 2003, p. 4).

Embora não seja uma idéia nova - de fato NENOVSKY (1999, p.7), KWÁSNIK (2004), RIZZELLO (2002) e LOASBY (2003) já traçaram paralelos entre as obras de Simon e Hayek quanto às suas contribuições para a reflexão sobre instituições - nesse artigo são analisados os microfundamentos de Hayek e Simon no que se refere às suas propostas epistemológicas, procurando desenvolver uma reflexão acerca da natureza e da forma do conhecimento condizente com uma abordagem evolucionária.

Este artigo está dividido em seis seções, incluindo a presente Introdução. A seção 2 trata de algumas críticas desenvolvidas por Hayek e Simon à tendência ao equilíbrio sustentada pela teoria ortodoxa. Nas seções 3 e 4 são apresentadas suas abordagens de caráter epistemológico. Na seção 5 são analisadas instituições e sua dinâmica a partir dos microfundamentos de Hayek e Simon, terminando com algumas contribuições dos autores no sentido de uma teoria do conhecimento que pode fundamentar uma abordagem heterodoxa de caráter evolucionário. Posteriormente, na seção 6, são apresentadas algumas considerações finais.

2. Críticas de Hayek e Simon à ortodoxia

Comumente são construídas críticas ao modelo tradicional (ou ortodoxia) que enfocam suas características de racionalidade maximizadora dos indivíduos e tendência ao equilíbrio. Sob este aspecto, as críticas de Hayek e Simon a estes supostos da ortodoxia vão gerar uma busca pela compreensão da inter-relação entre os agentes econômicos e das conseqüências que a ênfase nesta inter-relação traz ao modelo tradicional. A observação de como os autores se colocam diante destes supostos explicita seus pontos de vista sobre a dinâmica econômica e abre caminho para a identificação de seus pontos de continuidade e ruptura com a teoria ortodoxa.

Uma crítica importante de Hayek e Simon à teoria ortodoxa se refere às condições e pressupostos apresentados para a sustentação de tendência ao equilíbrio, o que os leva a abordar as limitações ou a impossibilidade da aplicação da teoria tradicional ao estudo econômico.

Simon aceita a teoria ortodoxa em determinadas situações, mais especificamente quando não estão envolvidos problemas centrais de conflito e dinâmica (SIMON, 1959, p. 254). Através de um exemplo do melaço sendo escorrido para um recipiente, explica que se o objetivo é apenas predizer o comportamento de equilíbrio (numa alusão ao equilíbrio neoclássico), é necessário saber pouco sobre o melaço. O comportamento de equilíbrio de um agente em perfeita adaptação é definido por suas metas e pelo seu ambiente, sendo completamente independente das propriedades internas do organismo. No entanto, se o recipiente é balançado ou se o objetivo é querer saber sobre o comportamento antes do equilíbrio ser alcançado, mais informação é requerida. Seria necessário saber do melaço, por exemplo, sua viscosidade, a rapidez com que ele se adapta ao recipiente e se move de forma a baixar o centro de gravidade. Assim, para predizer o comportamento no curto prazo de um organismo adaptativo ou seu comportamento numa alteração complexa e rápida do meio, não é o bastante conhecer suas metas (SIMON, 1980). Ao explicitar seu objeto de estudo, Simon afirma: “We must know also a great deal about its internal structure and particularly its mechanisms of adaptation.” (SIMON, 1959, p. 255). Se novas forças são colocadas, deve ser estudada a influência delas sobre o melaço e encontrada a nova posição de equilíbrio. Do mesmo modo, num organismo com múltiplas metas ou afligido por algum tipo de conflito interno quanto às metas, o comportamento só poderia ser predito a partir do conhecimento das forças relativas das diversas metas e as formas como os processos adaptativos respondem a elas.

Para Hayek, a análise de equilíbrio baseia-se em tautologias, ou seja, proposições que são necessariamente verdades por se tratarem de transformações das hipóteses originais. A análise de equilíbrio tem significado quando aplicada ao estudo de um indivíduo e não à interação entre as pessoas, ou seja, quando o objeto não envolve dinâmica econômica e é observado como atemporal (HAYEK, 1937, p. 36). Ela utiliza dados referentes a uma pessoa em questão (seus gostos e como as coisas são conhecidas) e adota-os como tendo um sentido objetivo. Deste modo, a análise de equilíbrio faz a descrição e adoção de um tipo ideal: as pessoas equalizarão os retornos marginais de algum fator em seus diferentes usos. É utilizada a hipótese de que as informações, na forma de estruturas de demanda (representando gostos individuais ou fatos técnicos), serão igualmente dadas para todos os indivíduos. Aqui os economistas ortodoxos utilizam-se de um tipo ideal cujo uso Hayek distingue daquele feito pelos sociólogos. Na sociologia sua adoção representa tipos ideais particulares, enquanto na economia há uma tentativa de generalizar o comportamento, o que é feito com aceitação de sua validade *a priori*

(HAYEK, 1937, p.37). Em seu artigo *Economics and Knowledge* (de 1937) Hayek afirma “... may main contention will be that the tautologies, of which formal equilibrium analysis in economics essentially consists, can be turned into propositions which tell us anything about causation in the real world only in so far as we are able to fill those formal propositions with definite statements about how knowledge is acquired and communicated.” (HAYEK, 1937, p. 1)

O questionamento hayekiano mostra-se rigoroso em relação à construção da análise agregada feita pela teoria ortodoxa. Refere-se ao suposto tradicional de que existe uma inter-relação entre os indivíduos de modo que as ações das pessoas não alteram a tendência ao equilíbrio porque um desvio eventual desta meta é sempre anulado por outro desvio, que ocorrerá de maneira oposta ao primeiro. Ou seja, a teoria ortodoxa admite que existem desvios do equilíbrio no âmbito microeconômico, mas afirma que a agregação, ou o nível macroeconômico, anula tais desvios e mantém a tendência ao equilíbrio. Hayek propõe uma análise econômica dinâmica e acrescenta à análise a instabilidade - o fato de que a agregação não representa um equilíbrio obrigatoriamente. O número de elementos com que se trabalha não é grande o bastante para produzir a estabilidade e o contínuo fluxo de bens e serviços da economia é mantido por contínuos ajustamentos e por disposições realizadas diariamente. Segundo Hayek, apenas admitindo a existência de um plano preconcebido, o qual seria seguido por todas as ações dos indivíduos, é que se sustentaria a existência de tendência ao equilíbrio. Dessa forma, poderíamos descartar eventos externos que alterassem o percurso da ação ou a geração de fatores endógenos relevantes (HAYEK, 1937, p. 37-38).

Hayek e Simon afirmam que estas limitações quanto à aplicação da teoria ortodoxa muitas vezes não são respeitadas e nem esclarecidas. A análise de equilíbrio, contrariando estas recomendações metodológicas, se propõe a incorporar a inter-relação pessoal. SIMON (1959, p. 254) afirma que a economia clássica é dedutiva e não requer quase nenhum contato com dados empíricos uma vez que suas hipóteses são aceitas. Esta racionalidade pode se referir a um tipo de ação humana, sem contudo poder ser generalizada. Assim, ela pode ser observada em testes empíricos simples como apostas em loteria com pouca quantidade de dinheiro. No entanto, se a situação se torna mais complexa a adoção da maximização não pode ser feita (SIMON, 1959, p. 258). A delimitação do campo de ação da suposição de racionalidade maximizadora não é bem construída e faz-se uma generalização do particular. A explicação do processo decisório é

conseguida e testada empiricamente, mas sem o esclarecimento de que apenas é válida para situações específicas com aplicações bastante limitadas.

Simon critica a dominância na literatura econômica do foco nas dimensões micro e macroeconômica e o fato de se dispensar a compreensão da teoria em suas intenções descritivas ou normativas. Usualmente a microeconomia é trabalhada de maneira mais normativa (como o homem deveria se comportar) sem considerar que o entendimento do comportamento humano através de uma microeconomia descritiva (como o homem se comporta) daria base para o âmbito macroeconômico (SIMON, 1959; 1965, p. XXV).

Para HAYEK (1937, p. 43) uma noção de “previsão correta” advinda da racionalidade humana é necessária para a aceitação do estado de equilíbrio (HAYEK, 1937, p. 43). A previsão correta, continua o autor, é possível apenas com a antecipação do que é relevante para as decisões dos indivíduos. Ao suporem uma tendência ao equilíbrio, os economistas cessam um exercício de lógica pura para iniciar um de ciência empírica. O empirismo é introduzido quando se admite que o conhecimento e as intenções dos diferentes membros da sociedade entram cada vez mais num acordo ou, em outras palavras, as expectativas tornam-se cada vez mais corretas. Dessa forma não há expectativas diferenciadas para os indivíduos como se esperaria ao aceitar a subjetividade.

Simon tem como elemento fundamental de seu argumento a capacidade explicativa, o caráter normativo da teoria ortodoxa. Sua observação do comportamento humano associado a informações de psicologia guiam seu trabalho. Hayek desenvolve sua crítica explicitando hipóteses aceitas pela ortodoxia que a enfraquecem do ponto de vista epistemológico e acabam por torná-la incapaz de envolver a dinâmica econômica. Poderíamos vislumbrar uma complementaridade nos trabalhos de Simon e Hayek quanto às dimensões micro e macroeconômica e aos caminhos utilizados para desenvolverem suas críticas à ortodoxia mas quanto a isso voltaremos mais tarde.

3. O enfoque na subjetividade de Hayek

Hayek argumenta que o agente econômico não é onisciente. Subjetividade e objetividade não são iguais. Ou seja, os princípios que norteiam o comportamento de um indivíduo não guiam as demais pessoas. Hayek aponta uma confusão quando o conhecimento do indivíduo é analisado, pois ele pode assumir dois significados. Por um lado, pode ser compreendido como todos e apenas os fatos que estiverem presentes na mente da pessoa que realiza a ação, a qual é um entendimento subjetivo. E por outro lado,

pode ser adotado significando os fatos reais objetivos, o que os economistas usualmente fazem. Tal distinção deve ser incorporada à análise do comportamento econômico, sendo fundamental, inclusive, um maior aprofundamento no sentido de se desvendar as relações entre a subjetividade e a objetividade. Quando a existência de subjetividade é assumida, as interpretações dos dados objetivos são diferenciadas e não se pode padronizar as preferências e as escolhas do ser humano. O sistema de preferências perde, então, sua sustentação e, como conseqüência, torna insustentável a generalização simplista de comportamento comumente utilizada pela economia ortodoxa. As ações individuais são analisadas sob parâmetros objetivos sem que as diferenças entre os sujeitos (suas diferentes experiências e histórias), isto é a subjetividade, seja relevante.

Hayek questiona a relação entre dados objetivos e subjetivos. Segundo ele, quando o estudo torna-se temporal, um processo iniciado e planejado para ser de determinada forma do início até seu fim só pode ser realizado de três maneiras: a) se houver um ditador onisciente; b) se as expectativas convergirem por uma aquisição de dados iguais para todos os indivíduos (o que significa ausência da subjetividade ou a admissão da existência de uma correspondência entre dados objetivos e subjetivos) ou; c) se a informação for de tal forma imperfeitamente igual a todos que não haja alterações de ações no decorrer do período devido a aquisição de novas informações.

O tratamento dado por Hayek ao processo de cognição humana se apresenta de maneira muito semelhante ao pensamento de Simon. Para Hayek, os indivíduos não possuem todas as informações referentes às suas ações, mas possuem parcelas do conhecimento que se inter-relacionam na sociedade de maneira relevante para a análise econômica. Nas palavras de HAYEK (1945, p.519):

The peculiar character of the problem of a rational economic order is determined precisely by the fact that the knowledge of the circumstances of which we must make use never exists in concentrated or integrated form but solely as the dispersed bits of incomplete and frequently contradictory knowledge which all the separate individuals possess.

Assim, não se pode tentar compreender as decisões econômicas como tomadas por uma mente simples, já que não é apenas uma questão de alocar recursos através de dados existentes e disponíveis.

Hayek teceu críticas ao método utilizado pela economia ortodoxa. Segundo ele, a observação das decisões humanas como um problema de alocação de recursos é um equívoco que tem sua origem na transferência errônea para os fenômenos sociais dos hábitos de pensamento que temos desenvolvido no tratamento dos fenômenos da natureza,

utilizando métodos das ciências físicas para as ciências sociais. A esta inobservância das características específicas da realidade social Hayek chamou de cientismo (*scientism*²). A partir desta sua constatação, criticou a busca da mensuração como elemento principal da ciência econômica e, neste sentido, atacou a teoria quantitativa da moeda chamando-a de uma primeira abordagem incipiente (UNB, 1981, p. 14).

4. O “satisfazimento” de Simon

A racionalidade é um tema central para Simon. Ele propõe uma maior abrangência na definição de comportamento racional assumindo que não apenas a maximização deva ser vista como um comportamento coerente. Devem ser incorporadas idéias de que as metas são ajustáveis ao desenrolar da realização da atividade. Dessa forma, o indivíduo pode não buscar a maximização, mas a satisfação (lucros e níveis de venda satisfatórios e não máximos). Isto envolve níveis de satisfação diferentes e flexíveis. Para a psicologia, o motivo de agir vem de metas e a ação termina quando as metas são satisfeitas. Contudo, as condições de satisfação de uma meta não são necessariamente fixas (como seriam se a maximização fosse utilizada), mas podem ser especificadas por um nível de aspiração que se ajusta para cima e para baixo com base na experiência. Utilizando esta teoria para os negócios pode-se dizer que as firmas talvez não busquem a maximização, mas a satisfação: uma fatia de mercado, um certo nível de lucros e vendas. Isto é importante para a teoria econômica na medida em que evidências psicológicas sobre o comportamento do indivíduo mostram que as aspirações tendem a ajustar-se ao atingido. Assim, no longo prazo, o nível de aspiração e o máximo atingido (e não o máximo atingível) estarão mais próximos.

Do ponto de vista de Simon, um comportamento pode ser analisado como consistente, mesmo quando não corresponde ao axioma de Neumann e Morgenstern (a busca da maximização do valor esperado da utilidade). Para ele, a única maneira de empregar o vocábulo "racional" de maneira não ambígua talvez seja com os advérbios apropriados. Nas palavras do autor:

Dessa maneira, uma decisão pode ser chamada "objetivamente" racional se representa *de fato* o comportamento correto para maximizar certos valores numa dada situação. É "subjetivamente" racional se maximiza a realização com referência ao conhecimento real do assunto. É "conscientemente" racional na medida em que o ajustamento dos meios aos fins visados constitui um processo consciente. É "deliberadamente" racional na medida em que a adequação dos meios aos fins tenha sido deliberadamente provocada (...). Uma decisão é "organizativamente" racional se for

² Hayek trata extensivamente deste cientismo na obra **Scientism and the Study of Society**, The Free Press, Illinois, 1952.

orientada no sentido dos objetivos da organização; é "pessoalmente" racional se visar os objetivos do indivíduo (SIMON, 1965, p. 90-1)- grifo do autor.

A importância do advérbio destrói a noção usualmente empregada na economia tradicional de racionalidade substantiva como única construção lógica aceitável, sendo qualquer outra alternativa ilógica e irracional.

Os modelos de satisfazimento (*satisficing*) de Simon são mais ricos que os modelos maximizadores porque envolvem não apenas o equilíbrio mas também como ele é alcançado. Dão informações quanto ao processo de tomada de decisões e não se sustentam apenas pela aceitação *a priori* de premissas. Estudos psicológicos sobre a formação e troca do nível de aspiração suportam proposições do tipo que segue: a) quando uma performance é um pouco inferior ao nível de aspiração do indivíduo, uma pesquisa de comportamento é induzida de modo a buscar novas alternativas de ação; b) ao mesmo tempo, o nível de aspiração começa a ajustar-se para baixo até as metas alcançarem níveis que são na prática atingíveis e não aqueles teoricamente desejados no início; c) se os dois mecanismos citados operam tão lentamente para adaptar aspirações às performances entra em cena o comportamento emocional e apatia ou agressão, por exemplo, terão um lugar no comportamento adaptativo racional (SIMON, 1959, p.263). Diferentemente da racionalidade substantiva, admite-se adaptação da ação e ajustamento de objetivos.

De modo semelhante a Hayek, Simon sustenta a subjetividade nas decisões econômicas. Segundo ele, o tomador de decisão apreende apenas parte de seu meio e processa uma fração do que é captado. O indivíduo que vai tomar decisão estrangula seu meio "real" através de seu aparato de percepção e apreende uma parcela pequena de informações. Simon argumenta que é um erro dizer que a percepção ocorre como um filtro pois isto implica que aquilo que é trazido para dentro do sistema nervoso central é realmente um pedaço igual ao que está lá fora. De fato, o filtro não é apenas uma seleção passiva de alguma parte do todo apresentado, mas um processo ativo envolvendo atenção a muitas partes pequenas do todo e exclusão, desde o início, de quase tudo que não é do escopo de atenção (SIMON, 1959, p.273). Até este momento, a idéia de Simon pode se referir a uma capacidade computacional limitada, no entanto, o cérebro realiza distorções e gera inferências, o que mostra que sua proposta é mais complexa. A cognição humana não ocorre como instruções que são passadas a um computador, do tipo estímulo-resposta, porque há uma complementação realizada pelo próprio indivíduo. Assim, o sistema nervoso central de cada indivíduo apreende e processa de maneira diferente uma mesma situação, colocação bastante similar à subjetividade proposta por Hayek.

Simon afirma que

...a teoria clássica é uma teoria de um homem escolhendo entre alternativas fixas e conhecidas, para cada uma delas são conhecidas suas conseqüências. Mas quando percepção e cognição intervêm entre o tomador de decisão e seu meio objetivo, este modelo está longe de se mostrar adequado. Nós precisamos de uma descrição do processo de escolha que reconheça que alternativas não são dadas, mas devem ser buscadas, e que envolva a tarefa árdua de determinar quais conseqüências se seguirão a cada alternativa. (SIMON, 1959, p.272).

Segundo SIMON (1959, p.269), o caminho clássico para incorporar expectativas à teoria econômica é assumir que os tomadores de decisão estimam a distribuição de probabilidade conjunta de eventos futuros. Eles podem então atuar maximizando os valores esperados de utilidade ou lucro. Mas este ponto de vista se torna incômodo quando perguntamos como os tomadores de decisão realmente estimam essa distribuição de probabilidade.

Pode ser notada a semelhança entre os dois autores através da observação do processo de escolha apresentado por Simon e a subjetividade tratada por Hayek. Ambos sustentam a necessidade de se compreender como o processo decisório ocorre.. Simon pretende ampliar a teoria ortodoxa ao admiti-la como normativa, servindo apenas a casos ideais, já Hayek propõe sua insustentabilidade ao criticar premissas essenciais à construção dessa teoria.

5. Os microfundamentos de Hayek e Simon e a compreensão da Interação humana

Assumindo que os princípios que guiam o comportamento do indivíduo não podem ser generalizados, que a incorporação da subjetividade e o estudo do processo cognitivo são fundamentais para a compreensão das decisões humanas, a interação, então, entre os agentes econômicos deve ser objeto de estudo. O conhecimento que cada pessoa tem é diferente e esta constatação torna importante a inter-relação destas parcelas de conhecimento na sociedade sendo primordial o estudo de como ocorre a transferência da informação. Hayek e Simon tratam deste assunto focando, no entanto, duas dimensões diferentes da atividade econômica. Herbert Simon parte da epistemologia fundamentada em bases psicológicas e observa a firma. Friedrich von Hayek nota o funcionamento de instituições macroeconômicas e questiona o que define seu bom desempenho já que não há uma ação consciente para isso.

5.1 Das Instituições à subjetividade

Hayek observa a existência de instituições (tais como a linguagem e o dinheiro) e questiona como elas alcançam resultados de maneira espontânea, no sentido de sua origem e dinâmica não estarem relacionadas a qualquer pensamento deliberador ou mesmo ao conhecimento de uma pessoa dirigente. Ele trata dessa “ordem espontânea”, instituições que resultam da ação humana mas não da criação humana consciente. Vai elegê-la como o objeto de estudo das ciências sociais e os aspectos metodológicos apresentados por Hayek advêm exatamente dessa percepção. Ao procurar compreender essa ordem espontânea, Hayek se aprofunda no estudo do conhecimento humano tornando-se elemento essencial do seu argumento a diferença entre o mundo objetivo e a percepção subjetiva dos indivíduos. Hayek, então, apresenta a questão de como a combinação de fragmentos de conhecimento existentes em diferentes mentes pode gerar resultados que, aparentemente, só ocorreriam se fossem consequência de decisões de um deliberador central, ou de um plano simples. O autor procura introduzir a idéia de como esta ordem só pode ser conseguida, de fato, com a descentralização da decisão.³ Apenas as ações espontâneas de indivíduos sob determinadas condições podem trazer uma distribuição de recursos adequada.

Hayek introduz sistemas criados pelos indivíduos que, segundo ele, são eficientes em transmitir informações importantes para certas decisões, como o sistema de preços. A existência destes mecanismos facilita a aproximação de expectativas, o que orienta a ação dos agentes econômicos como se estivessem sendo guiados por um plano preconcebido. Referindo-se ao sistema de preços afirma: “Fundamentally, in a system in which the knowledge of the relevant facts is dispersed among many people, prices can act to co-ordinate the separate actions of different people in the same way as subjective values help the individual to co-ordinate the parts of his plan” (HAYEK, 1945, p. 5). Ele é um sistema de difusão de informação que tem sucesso (sucesso definido por HAYEK (1937, p. 50) como a correspondência entre preço e custo), o qual só não é maior porque não é compreendido neste seu sentido verdadeiro. O sistema de preços opera uma economia de conhecimento, transferindo apenas o que os indivíduos querem saber para agir. Como os fatores a serem considerados são muito numerosos, é impossível aos indivíduos terem uma

³ Ao longo de seu trabalho vai fazer alusões diretas ao socialismo que criticou rigorosamente Principalmente em sua obra *O Caminho da Servidão* (HAYEK, 1944). Neste sentido, Hayek vai opor ao seu conceito de ordem espontânea a idéia de ordem construída.

visão de conjunto. A necessidade de descentralização de decisão, dessa forma, é estabelecida. Resta o problema da coordenação capaz de dar aos indivíduos (ou grupo de pessoas) uma autonomia para ajustar suas atividades a fatos que só eles podem conhecer. Ao mesmo tempo, entretanto, seus comportamentos devem promover um ajustamento mútuo dos seus respectivos planos. O meio complexo, devido à quantidade de informações e à incapacidade humana de apreendê-los totalmente (e de maneira objetiva), torna impossível um controle consciente do conjunto. Hayek advoga estruturas de coordenação impessoais que possibilitem aos indivíduos acesso às informações de que precisam. Neste sentido, Hayek afirma: “I am convinced that if it were the result of deliberate human design, and if the people guided by the price changes understood that their decisions have significance far beyond their immediate aim, this mechanism would have been acclaimed as one of the greatest triumphs of the human mind. Its misfortune is the double one that it is not the product of human design and that the people guided...” (HAYEK, 1945, p. 6).

Hayek observa que o sistema de preços funciona porque o mercado oferece um conjunto de sinais coordenados e que mutualmente se reforçam, e porque há um processo de tateamento de descoberta do mercado. Para ele, isto não está de acordo com as características de competição perfeita de mercado, mas sim com uma situação de desordem, um processo de agitação num mercado em movimento devido à completa liberdade competitiva dos empresários entrantes. A importância da transferência de informação é tamanha que a questão da estrutura de um sistema econômico eficiente torna esse assunto imprescindível.

Segundo KERSTENETZKI (1998, p.234), Hayek captura o aspecto dual das regras, objetivo e subjetivo. Assim, por um lado, existe a natureza *social* das regras, o fato de que elas têm sido socialmente produzidas no tempo. Por outro lado, estas regras são individualmente consumidas e existe sempre esta dimensão subjetiva. Isto traz um elemento inovativo na dinâmica do consumo (destruição) das regras. Dessa maneira, o consumo das regras também é a produção delas. Kerstenetzky chama a atenção para o fato de que este tratamento do consumo-produção de regras é importante para a compreensão dos fatos sociais em geral.

5.2 Da racionalidade procedural à compreensão das instituições

Na análise da firma, Simon sustenta que a efetividade da estrutura organizacional envolve um número tão grande de considerações que apenas poucas, das mais evidentes, cabem no círculo de consciência dos agentes num determinado momento. Os membros da firma enfrentam continuamente novas situações (produzidas por eventos internos e externos) que os impelem a um processo de “aprendizado”. Neste mundo onde estes tipos de ajustamentos são comuns as características de um agente racional devem incluir o enfrentamento de incerteza e a complexidade cognitiva. Deve ser levada em consideração não apenas a racionalidade substantiva mas também a racionalidade procedural. Procedimentos são usados para escolher ações (SIMON, 1978, p. 8) Segundo Simon, "...sequioso por alcançar a racionalidade e restringido pelo limite de seus conhecimentos, os seres humanos desenvolveram alguns processos de trabalho que superam parcialmente essa dificuldade. Esses processos baseiam-se no pressuposto de que é possível isolar da realidade um problema que contenha apenas número limitado de variáveis e uma série limitada de conseqüências" (SIMON, 1965, p.97).

Esta análise da firma tem como base o trabalho de caráter mais epistemológico de Simon. Ele afirma que as pessoas não tentam compreender o mundo como um sistema integral, mas têm modelos parciais tratáveis e identificam padrões recorrentes. As pessoas tendem a focar aquilo que as preocupa ao invés de enfrentarem objetivos conflitantes. As imagens de um “túnel mental” (*mental tunnel*) e de miopia usadas por Simon procuram mostrar que os observadores selecionam informações que podem ser relevantes e isto ajuda a reduzir a sobrecarga de informação (EARL, 1994, p. 285). Os indivíduos usam procedimentos simples (*rules of thumb*) para guiar suas ações. Dessa maneira, há economia porque os recursos são escassos, ou seja, a capacidade computacional é limitada. O indivíduo pode, então, usar expectativas adaptativas - uma simples extrapolação do passado no futuro - ao invés de coletar as informações que permitem a formação de expectativas racionais (HARGREAVES-HEAP, 1992, p. 18).

Estas regras de conduta ou procedimentos que são usados de maneira recorrente em um determinado período são instituições criadas pelos indivíduos devido às suas restrições cognitivas e ao ambiente complexo que têm de enfrentar.

Simon trata de "papel social" como um conceito trabalhado pela psicologia que se refere a aspectos sociais que influenciam a ação das pessoas. Isto é, uma prescrição social de algumas, mas não todas, premissas que estão relacionadas ao comportamento das

escolhas individuais. Em adição a estas ainda existirão premissas sobre o estado do meio baseadas diretamente na percepção pessoal, premissas representando crenças e conhecimentos e premissas idiossincráticas que caracterizam a personalidade. Com esta característica humana é possível acomodar elementos racionais na escolha (tanto enfatizados por economistas) e os elementos não racionais para os quais os psicólogos e sociólogos muitas vezes preferem chamar atenção (SIMON, 1959, p.274).

5.3 Instituições

As idéias de subjetividade de Hayek juntamente com os padrões de comportamento utilizados por Simon chamam a atenção para a importância da interação humana sob um parâmetro específico: o da compreensão do comportamento do indivíduo a partir da sua vida em sociedade.

Ao dar importância à interação humana o enfoque de Simon e Hayek deixa de ser individualista e passa a ser social. Isto é, admite-se que o ser humano não pode ser compreendido sem que se envolva a dimensão das suas inter-relações. Isto é mais forte em Hayek já que, no caso de Simon, há a admissão de que o foco no indivíduo e o uso da racionalidade maximizadora podem ser usados no estudo de situações simples. Na realidade, no entanto, essas situações se mostram raras. Então, para o uso descritivo da teoria, Simon dá importância a uma visão de homem econômico não individual, mas social, pois carrega uma bagagem que não é apenas dele mas de toda a sociedade da qual ele é integrante. Aqui seria inconcebível o início de trabalho a partir de uma história tipo Robinson Crusoe em que o indivíduo é isolado da sociedade e, através deste artifício, consegue-se encontrar elementos da natureza do ser humano cujas implicações se tornam fundamentais para uma análise mais empírica. Nos trabalhos de Hayek há uma ruptura em essência com a ortodoxia, já que ele ataca premissas adotadas que enfraquecem o poder explicativo da teoria como a inobservância da heterogeneidade dos agentes. Cabe aqui uma observação quanto ao individualismo metodológico presente nos trabalhos de Hayek. De acordo com KERSTENETZKY (1998), o individualismo de Hayek é um individualismo nominalista⁴, significando que o indivíduo por ele mesmo é uma construção intelectual que faz sentido apenas em conexão com a sociedade. Claramente há a rejeição do individualismo essencialístico, isto é, alguma idéia de indivíduo como ele próprio contendo

⁴ Nominalismo: doutrina segundo a qual as idéias gerais não existem, e os nomes que pretendem designá-las são meros sinais que se aplicam indistintamente a diversos indivíduos.

essências preexistentes. Assim, o homem em natureza e característica é determinado pela sua existência (ibid., p.234-5). Esta observação não cabe a Simon que assume uma natureza dual do indivíduo como animal social (o que poderia ser interpretado como semelhante à adoção do individualismo nominalista) e animal racional, natureza que se funda sobre dois mecanismos: influência e escolha (SIMON, 1957, p. vii). A natureza racional está relacionada à adoção por Simon de um modelo de racionalidade (comentado mais adiante) que não está presente no pensamento de Hayek.

Do ponto de vista de Hayek e Simon, o ser humano é um agente transformador, com sua subjetividade e capacidade decisória (aspirações e satisfazimento), mas também é caracterizado por uma bagagem de inércia que torna possível o estudo de relações causais devido à história passada. Assim, cada indivíduo tem características próprias que podem levar instabilidade a uma inércia já existente.

Há uma forte relevância da história da sociedade e do indivíduo em ambos autores numa antecipação do conceito de *path dependence*⁵, central para os evolucionários. Este conceito envolve a idéia de que “...every successive act in the development of an individual, an organisation, or an institution is strongly influenced by, and dependent from, the path (experience and evolution) previously covered.” (RIZZELLO, 1997, p. 100). Esta experiência, ou evolução, apresenta aspectos de continuidade mas também de transformação no comportamento, já que há de fato decisões sendo tomadas pelos indivíduos quer em suas vidas particulares ou dentro de organizações, além de comportamentos devido a padrões de conduta ou adequação à ordem já estabelecida. Em essência, esta idéia já está presente nos estudos de Hayek e Simon os quais, partindo do indivíduo, tratam da existência de uma certa regularidade no comportamento humano. Trata-se da incorporação de uma "inércia" que faz com que o indivíduo aja, em determinadas situações, de acordo com o que se espera dele, devido à influência social ou à adoção de um padrão de comportamento. Mesmo diante das dimensões diferentes estudadas por eles (Simon trata de firmas e Hayek de um nível macroeconômico) seus enfoques estão, neste ponto, de acordo com os trabalhos de uma gama de autores (muito diversa é verdade) que se intitulam institucionalistas. Como o conceito de instituição pode ser adotado de maneira bastante ampla, o enfoque micro e macroeconômico não limita a análise conjunta das contribuições. A instituição é evidenciada pelas regularidades das ações das pessoas e os motivos que elas expõem para a ação. Tais regularidades são vistas

⁵ O foco neste conceito surgirá mais claramente nos trabalhos de ARTHUR (1994).

como tendo objetivo instrumental em Simon e Hayek na medida em que diminuem a quantidade de decisões necessárias para as ações econômicas. Hayek acrescenta que, ao mesmo tempo, são informações importantes usadas por outros atores para decidirem e agirem. No dizer de HAYEK⁶ (1945, p. 6):

But those who clamor for “conscious direction” – and who cannot believe that anything which we should not be able to solve consciously—should remember this: The problem is precisely how to extend the span of our utilization of resources beyond the span of the control of any one mind; and therefore, how to dispense with the need of conscious control, and how to provide inducements which will make the individuals do the desirable things without anyone having to tell them what to do.

A compreensão da dinâmica institucional pelos institucionalistas está relacionada ao uso de *path dependence* que se sustenta na admissão de uma abordagem das decisões de indivíduos condizente com a epistemologia desenvolvida por Simon e Hayek. As decisões dos agentes são uma parte dessa história mas que não determinam, por si só, a existência e permanência de determinada instituição. Existem outros elementos envolvidos inclusive aleatórios que, para Hayek, participam e interferem na evolução da ordem espontânea. Há um jogo razão-instituição que define a dinâmica social. Essa gama de elementos envolvidos na dinâmica institucional não torna injustificável a análise e crítica a instituições existentes, o que se opõe, em alguma medida, aos escritos de Hayek. Ele identifica uma ignorância do indivíduo que muitas vezes erra o resultado alcançado a partir de suas decisões obtendo uma situação não-intencionada e, em outras vezes, atinge conseqüências não pretendidas (KERSTENETZKY⁷,1999). Essa ignorância acaba por gerar no pensamento de Hayek uma maior relevância à permanência de determinadas

⁶ Outro trecho esclarecedor está na citação que Hayek (1945, p.528) faz de Alfred Whitehead: "é um truísmo profundamente errado, repetido em livros e por eminentes pessoas quando falam, que nós devemos cultivar o hábito de pensar sobre o que nós estamos fazendo. Precisamente o oposto é verdadeiro. A civilização avança por estender um número importante de operações que nós podemos fazer sem pensar sobre elas".

⁷ Kerstenetzky se aprofunda no significado da ignorância radical dos agentes dizendo que,

...recebe diferentes interpretações ao longo da obra de Hayek, adquirindo por vezes a confusa conotação de ‘não-intencionalidade’ ou ainda o sentido mais forte de ‘não-desejabilidade’ associados àquelas conseqüências. Apenas para dar uma noção da ambigüidade relacionada à idéia de não-intencionalidade, tem-se que esta ora se liga à percepção de que as ações dos indivíduos erram o alvo (ou acertam outros alvos) - como na imagem smithiana da mão invisível - , ora à idéia de que as ações orientadas para certos objetivos produzem efeitos contrários aos desejados, como quando a busca por igualdade tem como desfecho a geração de mais desigualdade. Quanto à conotação de indesejabilidade associada às conseqüências não pretendidas, percebe-se um juízo implícito em relação à desejabilidade de estados sociais, e basta aqui recordar as críticas de Hayek à busca por justiça social por seus efeitos destrutivos sobre a desejável ordem espontânea. (KERSTENETZKY, 1999, p. 453)

instituições, como aquelas voltadas à manutenção da propriedade privada ou ao respeito aos contratos. Sua justificativa para essa postura está no fato destas instituições serem fruto da descentralização da decisão quando, portanto, foi respeitada a subjetividade individual. Hayek procura vincular sua análise epistemológica a suas propostas políticas.

E o mercado se tornou possível pela ação de pessoas que adotaram as normas relativas à propriedade privada, aos contratos e assim por diante, que elas não aceitam não por ter compreendido que seriam benéficas à humanidade, mas pela simples razão, de que aqueles grupos que de alguma forma se fixavam nesses princípios do individualismo, multiplicaram-se muito mais rapidamente do que outros, já que assim eles podiam manter uma população muito maior (UNB, 1981, p.2).

Ainda, afirma ao sustentar que o mercado possibilitou o crescimento populacional: “Eu [Hayek] até estou me convencendo de que – e acredito que isto seja realmente verdadeiro – o que nós chamamos de *avaliação econômica de mercado* é realmente uma avaliação em termos de vidas humanas.” (UNB, 1981, p.3)

Em Hayek, parecendo abandonar os elementos evolucionários tão presentes em seu trabalho, há uma justificativa funcional para determinadas instituições. A propriedade privada é funcional porque atinge determinada meta, no caso manter uma maior população. Neste momento o papel da decisão e muitos elementos de dinâmica institucional são diminuídos, senão excluídos. A lógica implícita é como padrões sociais maiores operam para manter a integração e manutenção de um determinado sistema. Essa funcionalidade não é manifesta, no sentido de existir uma consciência ou intenção na existência da instituição pois isso se oporia à forte crítica desenvolvida por Hayek à centralização de decisão. Trata-se de uma funcionalidade latente. Há um juízo de valor com relação a determinadas instituições, uma ambigüidade nos trabalhos de Hayek já apontada por KERSTENETSKY (1999). Esse argumento, no entanto, pode demonstrar quanto é suficiente (ou satisfatória) a existência de determinada instituição (ou mesmo um padrão de conduta) para atingir determinados fins, mas não a necessidade de sua existência e permanência. De fato pode-se pensar em alternativas, mesmo equivalentes funcionais, instituições ou padrões de comportamento que satisfariam a mesma necessidade.

Em Simon elementos epistemológicos implicam numa abordagem do processo de aprendizagem e tomada de decisão e não apenas no resultado da decisão. Seguindo este argumento, além de partir da cognição limitada e das inferências - uma representação simbólica da realidade- Simon propõe um processo dinâmico de alterações do nível de aspiração do agente. No entanto, RIZZELLO (2002) chama a atenção para o fato de que a metáfora da mente sendo o software e o cérebro como o hardware está de acordo com a

visão de Simon. Há ainda uma idéia de que há um processo de valoração e tomada de decisão a cada escolha do agente. De fato, a intenção de Simon é expandir o conceito de racionalidade adotado na teoria ortodoxa para além da substantiva⁸. A posição psicológica de Simon é reforçada pelo aspecto mecânico (e limitado) do tratamento da informação complexa. Já Hayek assume que o processo de aprendizagem seria ainda mais complexo e “traços genéticos e experiências pessoais continuamente recriam a condição neurobiológica”. Há uma característica criativa da decisão. Assim a racionalidade não é apenas limitada pela cognição e habilidades computacionais mas o acaso aparece na formação de nossa percepção.

6. Considerações finais

O desenvolvimento de trabalhos procurando construir uma proposta de compreensão do conhecimento humano tem sido um caminho escolhido pelas teorias que querem se diferenciar da abordagem ortodoxa. Este trabalho mostrou o caráter teórico e descritivo que assume Simon e o risco que se expõe Hayek ao apresentar elementos descritivos no âmbito do comportamento individual mas que vão se desenvolver numa proposta de caráter normativo no âmbito macroeconômico com fortes conseqüências e justificativas de atitudes políticas. Isto está relacionado à admiração por Simon por parte de importantes nomes da teoria institucionalista evolucionária e, no caso de Hayek, ao quase esquecimento do autor pela heterodoxia econômica devido às suas propostas políticas conservadoras. Ao focar o trabalho teórico de Hayek, no entanto, pudemos perceber como sua proposta epistemológica traz, como os trabalhos de Simon, contribuições à definição de microfundamentos a uma abordagem institucionalista. Há semelhanças na abordagem do conhecimento humano por parte desses autores com a sustentação da heterogeneidade dos agentes e da conseqüente importância de se compreender a interação humana (levando-se em consideração avanços da neuropsicologia) e a admissão de um ambiente complexo.

O paralelo traçado entre as idéias de caráter teórico dos dois autores estimulou o aprofundamento da reflexão sobre uma epistemologia consistente com uma abordagem institucionalista evolucionária através da explicitação de algumas diferenças entre os autores, tais como a presença de um modelo de racionalidade em Simon e a inexistência

⁸ “...I would like to expand on the theme that almost all human behavior has a large rational component, but only terms of the broader everyday sense of rationality, not the economists’ more specialized sense of maximization.” (SIMON, 1978, p. 2)

disso em Hayek, cuja proposta é mais condizente com a inclusão de elementos aleatórios nas decisões humanas.

A forma de apreensão das informações e a percepção dos agentes econômicos, a maneira de inter-relacionar esses conhecimentos parciais e subjetivos dos indivíduos, os mecanismos gerados para lidar com a limitação de conhecimento num ambiente complexo com incertezas e a conseqüente origem e natureza de instituições são elementos trabalhados por Simon e Hayek que dão embasamento à compreensão da dinâmica institucional.

Bibliografia

ARTHUR, B. Positive feedbacks in the economy. In: **Increasing returns and path dependence in the Economy**, Ann Arbor, Michigan University Press, 1994, p. 1-12.

CALDWELL, B. **Hayek: Right for the wrong reasons?** Presidential address History of Economics Society, 2 jul. 2002. Disponível em : “<http://www.uneg.edu/eco/caldwell/vita/presidential.doc>”. Acesso em: 15 jul. 2003

EARL, P. E. Simon, Herbert Alexander. In: HODGSON, G. et al. *The Elgar Companion to Institutional and Evolutionary economics*. Inglaterra: Edwards Elgar, 1994, p. 284-287.

GARRISON, R. W.; KIRSNER, I. M. Friedrich August von Hayek, *The New Palgrave: a dictionary economics*, Macmillan Press, Londres, 1987, p. 609-614.

HARGREAVES-HEAP, S. et al. Rationality. In: *The Theory of choice, a critical guide*. Oxford: Blackwell, p. 3-25, 1992.

HAYEK, F. A. von. Economics and Knowledge. **Economica**. p.33-54, fev.1937.

HAYEK, F. A. **O Caminho da servidão** Ed. Expressão e Cultura, 4ª edição, 1944.

HAYEK, F. A. The use of knowledge in society. **American Economic Review**. vol. XXXV, nº4, p.519-530, set. 1945.

KERSTENETZKY, Celia de Andrade Lessa. Hayek: the evolutionary and the evolutionist. In **Anais da XXVI Encontro Nacional de Economia**. vol. 1, p.231-242, 1998.

KERSTENETSKY, C. de A. L. Evolution and Design in Hayek **Dados**, 1999, vol. 42, n. 3, p. 453-470.

KWASNICKI, W. **Roots of evolutionary economics**. Disponível em: <<http://prawo.uni.wroc.pl/~kwasnicki/todownload/evolutionary%20economics.pdf>> Acesso em: 23 de outubro 2003.

LOASBY, B. J. **The innovative mind** Summer conference on creating, sharing and transferring knowledge. Copenhagen, jun. 2003.

NENOVSKY, N. **The economic philosophy of Friedrich Hayek** (The centenary his birth) Bulgarian National Bank, DP/8 discussion paper, 1999.

RIZZELLO, S. The Microfoundations of path dependency. In: **Evolutionary economics and path dependence**. MAGNUSSON, L. e OTTOSON, J. (org.) EUA: Edwards Elgar, 1997, p. 98-118.

RIZZELLO, S. **Mind and choice in economics** Working paper n. 6/2002 Departamento de economia S. Cognetti de Martins (CESMEP), 2002.

SIMON, H. A. **Models of man** Chapman and Hall, Londres, 1957.

SIMON, Herbert A. Theories of decision-making in economica and behavioral science. **The American Economic Review**. vol. XLIX, nº3, p. 253-280, jun. 1959.

SIMON, Herbert A. **Comportamento Administrativo**. Fundação Getúlio Vargas, RJ, 1965.

SIMON, Herbert A. Rationality as process and as product of thought **American Economic Association** vol. 68, n. 2, 1978.

SIMON, Herbert A. A racionalidade do processo decisório em empresas. **Edições Multiplic**, v.1, n. 1, 1980.

UNB. **HAYEK na UnB**: Conferências, comentários e debates de um Simpósio Internacional realizado de 11 a 12 de maio de 1981. Coleção Itinerários Editora da UnB. Brasília: 1981.