

Il problema della conoscenza in Hayek

di Carlo Zappia

1. Introduzione

La tradizione austriaca del soggettivismo radicale si fonda in modo peculiare sullo studio delle decisioni individuali in contesti incerti. Anche nelle sue riproposizioni più recenti [ad esempio Vaughn 1994], si suggerisce l'idea che tale tradizione non possa essere considerata semplicemente una variazione sul tema neoclassico della razionalità degli agenti economici. L'attenzione verso il ruolo della conoscenza e del tempo nell'agire economico, da sempre tratto distintivo della tradizione austriaca, è associata all'incertezza nell'attività intertemporale degli agenti economici, in particolare dell'imprenditore, ed alla possibilità che le aspettative degli agenti vengano disattese. Di conseguenza, l'argomento critico principale usato nei confronti della teoria economica dominante è costituito dall'accusa di incapacità di tenere conto in modo convincente dell'incertezza propria dell'ambiente nel quale gli agenti operano. Si tratterebbe in sostanza del fatto che la teoria dominante, anche quando si sofferma sulle implicazioni della scelta in contesti incerti, assume una sorta di «ignoranza razionale», cioè ipotizza che l'ignoranza degli agenti nel momento delle scelte intertemporali sia ristretta alla realizzazione di uno fra un insieme di mondi possibili che, invece, nel suo complesso viene dato per conosciuto¹. In contrasto, la tradizione austriaca si caratterizza per il fatto di porre come oggetto di analisi quegli aspetti incerti dell'ambiente economico che vengono generati endogenamente durante il processo di mercato e quindi non sono generalmente conoscibili a priori.

La somiglianza di tali argomenti con quelli affrontati nei recenti sviluppi di teoria delle decisioni, di cui si dà conto in questo volume,

¹ Esemplare in tal senso la letteratura sull'apprendimento razionale [ad esempio, Bray e Kreps 1987].

giustifica uno studio delle «radici» austriache². In questo lavoro ci soffermeremo in particolare sulla teoria della conoscenza di Hayek, e su quegli aspetti ripresi e approfonditi da una serie di studiosi ispirati da Hayek che vanno sotto l'etichetta di «problema hayekiano della conoscenza» [in particolare Kirzner 1992]. È comunque utile precisare, in via preliminare, che il contributo di Hayek a questi temi è strettamente connesso all'obiettivo principale che egli si è posto come studioso, ossia la spiegazione del funzionamento del sistema di mercato inteso come luogo nel quale trovano realizzazione le scelte individuali degli agenti economici. Non è quindi possibile fare riferimento a lavori specificamente pensati per delineare un particolare modello decisionale, diversamente da ciò che accade, ad esempio, per Keynes (si vedano i riferimenti fatti in questo volume da Carabelli al *Treatise on Probability*). Peraltro, si vedrà oltre che esistono evidenti assonanze fra l'interpretazione di Hayek del processo di mercato e i suoi studi sull'ordine sensoriale che stanno alla base della moderna scienza cognitiva [Hayek 1952].

2. La nozione di conoscenza personale

Sebbene ad Hayek venga solitamente attribuita più di una fase di pensiero (tale tesi è sostenuta, fra gli altri, da Caldwell [1988] e Donzelli [1988]), è possibile individuare una serie di riferimenti testuali che mostrano come l'interesse che egli mostra per il ruolo svolto dal concetto di conoscenza nella scienza economica sia costante, sin dai primi anni '30, cioè dagli anni dell'Hayek teorico neoclassico puro. In primo luogo, la teoria del ciclo economico di Hayek può essere interpretata come un'analisi dei problemi di coordinazione intertemporale fra investimenti e risparmi che sorgono ogniqualvolta esistono differenze informative sulla tecnologia fra il settore degli investitori e quello del credito che non siano segnalate correttamente dai prezzi [O'Driscoll 1977]. È lo stesso Hayek [1935a] a suggerire questa interpretazione, in risposta alle critiche di Myrdal circa la mancanza di un ruolo per le aspettative nel modello di *Prices and Production* (si veda la ricostruzione di Foss [1995]). In secondo luogo, e contrariamente a quanto solitamente affermato nella letteratura secondaria, già i primi commenti critici nei confronti dei sostenitori di un meccanismo centralizzato di gestione del sistema economico muovono dall'esplicita

² Come si vedrà in seguito, su questi aspetti il contributo di origine austriaca tende a confondersi con quello di autori di diversa impostazione, in particolare Shackle.

consapevolezza che i dati oggettivi presi a fondamento dell'analisi walrasiana di equilibrio, dati «pronti» per essere comunicati ad un eventuale pianificatore nella visione dei sostenitori della pianificazione, non esistono in quanto tali poiché «molte delle conoscenze che vengono effettivamente utilizzate, tuttavia, non “esistono” affatto in questa forma preconfezionata. Esse consistono fondamentalmente in una tecnica di pensiero che permette al singolo ingegnere di trovare rapidamente nuove soluzioni non appena si trova di fronte a nuove costellazioni di circostanze» [Hayek 1935a, trad. it. 1988, 365]³. Infine, anche in quello che probabilmente è il primo dei suoi lavori di stampo metodologico, Hayek [1933, 31] sottolinea che una delle ragioni che devono indurre a cautela circa azioni di politica economica intese a modificare il funzionamento dei sistemi economici decentralizzati è la «natura incompleta della nostra conoscenza», con il riferimento, questa volta, non soltanto all'attività degli agenti economici, ma anche all'economista in qualità di osservatore dei fenomeni economici.

Naturalmente quegli aspetti della conoscenza che rendono peculiare il lavoro di Hayek sul coordinamento delle azioni individuali vengono precisati solo in seguito, a partire da *Economics and Knowledge* e *The Use of Knowledge in Society*. In questi lavori Hayek chiarisce che «le aspettative di prezzo e persino la conoscenza dei prezzi costituiscono solamente una porzione molto piccola del problema della conoscenza così come lo intendo io. L'aspetto di più ampio respiro del problema della conoscenza, che mi interessa, concerne la conoscenza del fatto basilare: il modo in cui le differenti merci possono essere ottenute ed utilizzate, nonché le condizioni in base alle quali esse sono effettivamente ottenute ed utilizzate» [Hayek 1937, trad. it. 1988, 247]. Si riferisce poi alle «conoscenze delle circostanze particolari di tempo e di luogo. Proprio rispetto a questo tipo di conoscenze praticamente ogni individuo si trova in vantaggio rispetto a tutti gli altri, dal momento che egli possiede informazioni uniche che possono essere utilizzate con profitto, ma solo se le decisioni che dipendono da questo vengono lasciate a lui o sono prese con la sua attiva collaborazione» [Hayek 1945, trad. it. 1988, 280]. Non solo conoscenza delle tecnologie disponibili, quindi, ma anche capacità di loro utilizzo,

³ L'interpretazione più accreditata sulla controversia sul socialismo afferma che, dopo aver riconosciuto la possibilità logica del socialismo di mercato alla Lange, Hayek si sarebbe concentrato a dimostrarne l'impossibilità di pratica realizzazione. Che le obiezioni di Hayek siano fondate su di un argomento di natura sostanzialmente teorica viene riconosciuto solo negli anni '80 [Lavoie 1985].

o conoscenza «del fare». È in questi lavori, inoltre, che Hayek matura la piena consapevolezza dell'impossibilità di considerare l'equilibrio intertemporale come uno stato normale di funzionamento del sistema. Infatti, poiché la conoscenza rilevante è non solo dispersa fra gli agenti ma anche, per la maggior parte, frammentata e tacita (cioè non sempre descrivibile a terzi mediante linguaggio comune) ⁴, la corrispondenza fra conoscenza soggettiva dei dati del sistema e dati «oggettivi» ha probabilità nulla di verificarsi, ed allora la compatibilità dei piani di azione decentralizzati non può essere considerata altro che un punto di riferimento dell'analisi. La stessa proprietà di ottimalità dell'equilibrio concorrenziale viene esclusa [1937, trad. it. 1988, 249], perché non è possibile definire l'insieme delle conoscenze rispetto alle quali uno stato di equilibrio possa essere considerato ottimo (vincolato) o meno. Su questa strada, infine, Hayek arriva a concludere che l'equilibrio generale walrasiano non può essere considerato uno strumento di analisi delle fasi del processo concorrenziale di mercato. La nozione di equilibrio deve essere ridefinita in modo tale da evidenziare l'emergere di un appropriato contesto istituzionale che, originato dal comportamento individuale, sia in grado di rappresentare la struttura non intenzionale che favorisce il processo di scambio: da qui la nozione di ordine spontaneo, come approdo della concezione austriaca del funzionamento del mercato che origina in Menger [Hayek 1978, trad. it. 1988].

L'elemento analitico che contraddistingue l'analisi hayekiana del funzionamento del mercato è quindi quella che potremmo chiamare la conoscenza personale degli agenti (su questo punto si veda anche Dardi [1990]). Non si tratta semplicemente di attribuire ai soggetti differenze informative definibili *ex ante* entro insiemi tecnologici o di preferenze prefissati. Bensì di evidenziare differenze conoscitive circa la capacità di applicare determinate tecnologie, e di immaginare nuove tecnologie, o circa l'interrelazione fra preferenze e contesto istituzionale all'interno del quale tali preferenze si manifestano in scelte ⁵.

Due punti occorre qui sottolineare. La letteratura moderna che si

⁴ Che la conoscenza personale sia in gran parte tacita viene chiarito meglio da Hayek nei lavori successivi. «La combinazione, per alcuni aspetti sempre unica, di conoscenze e capacità individuali, che il mercato consente di utilizzare, non è semplicemente, e nemmeno prevalentemente, una conoscenza di fatti che gli individui potrebbero elencare e comunicare su richiesta di una qualsiasi autorità» [Hayek 1968, trad. it. 1988, 312].

⁵ Per una critica relativa all'eccessivo peso dato da Hayek alla conoscenza personale rispetto alla conoscenza tecnologica, si veda Arrow [1994].

occupa delle questioni informative ha fatto continuo riferimento alle posizioni di Hayek. Mentre l'incompatibilità di metodo con l'approccio delle aspettative razionali risulta evidente, in quanto è differente il ruolo attribuito al concetto di equilibrio (su questo tema si veda Zappia [1988]), è interessante notare che il saggio del 1945 ha generato un'interpretazione della teoria di Hayek fortemente condivisa dalla professione. In quel saggio, si sostiene usualmente, si può trovare la prima compiuta enunciazione della capacità del sistema di mercato di diffondere l'informazione dispersa nel sistema. In particolare, Hayek avrebbe individuato il ruolo dei prezzi di equilibrio di aggregare e trasmettere l'informazione privatamente posseduta dagli agenti, ruolo trascurato sia nella trattazione walrasiana che nelle sue successive riformulazioni assiomatizzate. Questo aspetto interpretativo è alla base dell'analisi di equilibrio generale con agenti dotati di aspettative razionali e informazioni asimmetriche [in particolare Grossman 1989], ma ricorre frequentemente in molta parte dei contributi legati alla cosiddetta economia dell'informazione, tanto da essere diventato un riferimento obbligatorio nella manualistica recente [ad esempio Milgrom e Roberts 1992, cap. 3; Hirshleifer e Riley 1992, cap. 6]. In effetti, nel modello originario di Arrow e Debreu, anche ove i soggetti siano dotati di informazione differenziata sugli aspetti incerti dell'ambiente, i prezzi sono solo dei vincoli all'operare dei soggetti, utili a segnalare la disponibilità relativa delle risorse, ma non le differenze informative che hanno generato i piani di attività individuali [Radner 1982]. Al contrario, la possibilità di indicare il mercato concorrenziale come meccanismo di allocazione relativamente più efficiente rispetto ad una gestione centralizzata del sistema è legata alla proprietà di statistica efficiente propria dei prezzi di mercato di equilibrio. Secondo l'interpretazione ormai consolidata questo è il contributo fondamentale della teoria del mercato di Hayek (per una lettura di Hayek convergente su questo aspetto, sebbene diversamente motivata, si veda Eatwell e Milgate [1994]). È chiaro che, in questo caso, gioca un ruolo importante la lettura isolata del saggio di Hayek. Effettivamente Hayek lascia in più punti supporre che il mercato possa essere considerato un meccanismo «informativamente» efficiente. Tuttavia una riconsiderazione più ampia del percorso intellettuale seguito da Hayek, che vede il saggio del 1945 come un elemento del passaggio dal primo saggio sulla conoscenza a *The Meaning of Competition* [Hayek 1948, trad. it. 1988] e ai saggi più strettamente metodologici che lo seguono [in particolare Hayek 1967; 1978, trad. it. 1988], non può che condurre ad una conclusione diversa. La coordinazione dei piani di azione individuali richiede certamente l'utilizzazione del sistema dei prezzi, in

quanto i prezzi consentono una più economica distribuzione delle informazioni rilevanti nel sistema. Ma questa è solo una delle componenti che caratterizzano il contesto istituzionale all'interno del quale si svolge il processo di scambio. I prezzi, in sostanza, diffondono certamente la conoscenza tecnica che Hayek chiama *statistica*, cioè descrivibile a terzi, ma non garantiscono la diffusione della conoscenza personale, ovvero delle capacità di applicazione della conoscenza tecnica. La cosa ha anche un'implicazione di tipo formale: Hayek fa esplicito riferimento ad un tipo di conoscenza che tipicamente non si riferisce alla possibile realizzazione di eventi esogeni incerti, bensì a quegli aspetti della conoscenza che definiscono gli agenti ed i ruoli che essi svolgono, i cosiddetti *skills*, che non trovano spazio nei modelli di Grossman (questo punto è approfondito in Zappia [1996]).

Il secondo aspetto da sottolineare è quello che ci riporta più vicini alla tradizione austriaca di studio delle decisioni in condizioni di incertezza, e alle distinzioni all'interno di essa. È stato più volte ricordato che Hayek [1955] ha giudicato l'applicazione coerente di una impostazione soggettivista come la via da seguire per l'emancipazione della teoria economica dalle scienze naturali e dal metodo costruttivista loro tipico. Non vi è dubbio che le sue considerazioni sul ruolo della conoscenza sono un passo rilevante in tal senso. Il problema che si pone a chi voglia muoversi in tale prospettiva è quello di una teoria delle aspettative che si fondi sui principi del soggettivismo. Secondo alcuni interpreti [in particolare, Lachman 1990] si tratta di portare a termine la rivoluzione cominciata con l'introduzione di una teoria soggettiva del valore (il soggettivismo delle preferenze) ed incompiuta fino a quando non sia stata elaborata una teoria soggettiva delle aspettative. È in questa linea che si è mossa gran parte dei seguaci della tradizione austriaca sottolineando, da un lato, l'incapacità di Hayek di procedere sulla strada che aveva aperto e, dall'altro, l'incapacità della teoria economica delle decisioni in condizioni di incertezza di cogliere gli aspetti cruciali della questione. Nel paragrafo che segue intendiamo illustrare, attraverso l'esame del cosiddetto problema della conoscenza di Hayek, le differenti implicazioni derivate dai teorici della tradizione austriaca. Nel paragrafo finale si accennerà poi brevemente a come possa essere spiegato il mancato approfondimento della teoria delle decisioni individuali da parte di Hayek.

3. Il problema della conoscenza

Dopo aver individuato nella conoscenza personale il tratto distintivo che caratterizza l'attività degli agenti economici nei sistemi con-

correnziali, Hayek si propone due obiettivi. In primo luogo, ridefinire la nozione di equilibrio in termini più spiccatamente soggettivisti. L'equilibrio diviene, secondo l'accezione ancora attualmente più diffusa in economia, uno stato nel quale i piani di attività intertemporale degli individui risultano mutualmente compatibili, e quindi coordinati⁶. In secondo luogo, Hayek si propone di affiancare alla «pura logica della scelta» lo studio del processo attraverso il quale viene utilizzata la conoscenza. Nella visione di Hayek, unicamente l'analisi del processo di mercato può consentire di spiegare in che modo la conoscenza personale venga utilizzata e resa disponibile⁷; e questo non solo perché, come è ovvio, lo stato di equilibrio del sistema può essere spiegato come il risultato di un processo di aggiustamento, ma anche perché una componente cruciale della conoscenza personale è di natura tacita, e quindi soggetta ad essere utilizzata unicamente durante la specifica attività svolta dagli individui sul mercato. In quest'ottica, inoltre, la conoscenza personale è legata ad essere generata endogenamente durante il processo di mercato⁸.

⁶ Per Hayek l'equilibrio è riferito ad un contesto intertemporale nel quale le aspettative dei soggetti sono corrette nel senso che «il piano di ciascun soggetto si basa sull'aspettativa che si verifichino proprio quelle azioni da parte degli altri soggetti che questi ultimi intendono eseguire, e che tutti questi piani siano basati sull'aspettativa del medesimo insieme di fatti esterni, di modo che nessuno avrà ragione di cambiare sotto determinate condizioni il proprio piano» [Hayek 1937, trad. it. 1988, 237]. La nozione di equilibrio di Hahn [1984] presenta evidenti affinità, come riconosciuto implicitamente dallo stesso Hahn [1990].

⁷ Hayek [1937, trad. it. 1988, 246] definisce la natura del problema della conoscenza, considerato come «il problema veramente centrale dell'economia come scienza sociale», in questo modo: «in che modo la spontanea interdipendenza di un certo numero di persone, ciascuna delle quali in possesso di un certo ammontare di informazioni, sia in grado di determinare uno stato di cose in cui i prezzi corrispondono ai costi, ecc., e che potrebbe essere realizzato attraverso una coordinazione consapevole solamente da qualcuno che disponesse della conoscenza complessiva di tutti questi individui». E ancora, «Il problema economico della società, perciò, non è meramente un problema di come allocare risorse "date" [...] Si tratta piuttosto del problema relativo a come assicurare il miglior uso di risorse note a ciascuno dei membri della società, per i fini la cui importanza relativa è nota solo a questi individui. O, in breve, si tratta del problema di come utilizzare la conoscenza che non appartiene a nessuno nella sua totalità» [Hayek 1945, trad. it. 1988, 278].

⁸ Anche se si vuole analizzare la conoscenza unicamente in funzione dell'equilibrio che «genera», sottolinea Hayek [1937, trad. it. 1988, 249], la conoscenza rilevante ai fini della realizzazione dell'equilibrio è «quella che egli [l'individuo] è costretto ad acquisire in vista della posizione in cui inizialmente si trova e dei piani che poi formula (e che) è in grado di acquisire nel corso della realizzazione del suo piano iniziale e delle sue successive modificazioni».

Questo secondo aspetto chiama in causa la questione dell'impersonalità delle attività svolte sul mercato concorrenziale nell'accezione tradizionale. Contrariamente a quanto si è soliti pensare, sia la «ricostruzione razionale» della teoria di Hayek (secondo le linee che qui proponiamo) sia il riferimento testuale inducono a ritenere che Hayek abbia ben chiaro che il mercato non può essere considerato come un ambiente nel quale il coordinamento delle azioni individuali richiede unicamente un sistema dei prezzi in grado di segnalare correttamente la realizzazione degli eventi per come essa diviene nota ai singoli. In particolare, nel saggio sul significato della concorrenza Hayek critica «l'esplicita e completa esclusione dalla teoria della concorrenza perfetta di tutte le relazioni personali esistenti fra le varie parti in causa [in una transazione]» come l'esempio più evidente della mancanza di interesse verso «quale tipo di ordinamento istituzionale è necessario al fine di attrarre verso una determinata mansione quelle persone sconosciute che dispongono delle conoscenze specificatamente adatte allo svolgimento di quella particolare mansione» [Hayek 1948, trad. it. 1988, 297-298]. Il risultato di transazioni fra individui dotati ognuno di conoscenza personale dell'oggetto dello scambio (sia esso la vendita di un bene di consumo o di un fattore produttivo quale il lavoro) dipende dal contesto istituzionale entro il quale la transazione si svolge. Gli accordi di scambio vengono conclusi o seguendo procedure definite convenzionalmente o secondo accordi contrattuali intesi a risolvere la complessità informativa implicita nello scambio. L'ordine del sistema economico deve essere perciò ridefinito in modo da tenere conto delle caratteristiche della struttura istituzionale.

Hayek si ferma davanti alla necessità di un approfondimento di queste tematiche. Gli ultimi studi di Hayek, principalmente il monumentale *Law, Legislation and Liberty*, sviluppano la questione dell'ordine in più direzioni – con l'obiettivo principale di rielaborare la filosofia sociale del liberalismo economico – ma non aggiungono nulla quanto ai fondamenti. In particolare, per rimanere al tema di questo volume, Hayek non fornisce una teoria delle decisioni individuali costruita sul concetto di conoscenza personale (ma neppure è possibile ritrovare un'analisi specifica delle strutture contrattuali che favoriscono il processo di scambio)⁹.

⁹ È interessante comunque notare che, da un lato, Hayek [1967, 91-92] pone l'intuizione del saggio del 1937 alla base dei suoi studi di filosofia sociale; dall'altro, la questione della diffusione della conoscenza suggerisce ad Hayek una analogia fra il funzionamento dell'ordine spontaneo e quello delle organizzazioni presenti nel sistema di mercato: «to some extent every organization must rely also on rules and not only on

Una parte degli studiosi ispirati da Hayek, segnatamente quella parte che si rifà a Kirzner, non ha ritenuto che questo mancato approfondimento costituisse un problema tale da dover affrontare esplicitamente la questione della teoria della scelta. Il contributo alla soluzione del problema della conoscenza di Hayek, secondo questa impostazione, può derivare solo dall'analisi del processo di mercato, inteso, appunto, come il processo competitivo attraverso il quale la conoscenza personale viene utilizzata e resa disponibile.

Naturalmente la nozione di *alert entrepreneur* elaborata da Kirzner si muove nell'ottica di precisare il contesto decisionale dei soggetti economici. L'imprenditore è un individuo che nota opportunità di investimento, potenzialmente profittevoli, che altri non hanno notato. Ma il suo ruolo è fondamentalmente quello di un arbitraggista che scopre opportunità già esistenti sul mercato. Sebbene Kirzner riconosca che le questioni più interessanti nell'ottica della scelta non sono tanto quelle di opportunità percepite non correttamente dagli agenti, quanto quella di opportunità non percepite, egli continua ad assumere che sia definibile *ex ante* una posizione di equilibrio rispetto alla quale è possibile classificare le azioni di alcuni agenti (quelle degli imprenditori, appunto) come equilibratrici.

Altri studiosi ispirati da Hayek, i cosiddetti soggettivisti radicali (il cui punto di vista è sintetizzato in O'Driscoll e Rizzo [1985]), hanno invece più volte sottolineato che senza una teoria delle decisioni alternativa a quella proposta dalla teoria dominante il ragionamento di Hayek deve essere considerato incompiuto. L'imprenditore kirzneriano non crea nulla di nuovo, bensì scopre ciò che esisteva e poteva essere scoperto. L'idea che emerge dal processo di mercato di Hayek è invece quella di un processo di aggiustamento continuo, nel quale l'utilizzazione della conoscenza personale e l'emergere di nuova conoscenza implicano una continua revisione dei piani di attività degli individui. Lachman, in particolare, specifica la tradizionale enfasi austriaca sulla conoscenza eterogenea ed incompleta nella considerazione che per spiegare i comportamenti individuali occorre contemplare gli effetti sulle scelte di cambiamenti endogeni e non prevedibili. In quest'ottica, infine, la percezione di un mercato concorrenziale tendenzialmente equilibrantesi perde significato¹⁰.

specific command [because] by guiding the actions of individuals by rules rather than specific commands it is possible to make use of knowledge which nobody possesses as a whole» [1973, 48-49].

¹⁰ Naturalmente, l'interpretazione dei soggettivisti radicali pone il problema di cosa ne sia dell'ordine di mercato hayekiano, sia esso inteso come equilibrio generale o

Il teorico che più di ogni altro ha contribuito a questo tentativo di riforma radicale della teoria delle decisioni, Shackle, non è propriamente collocabile nella tradizione austriaca [ma si veda Lachman 1976]. Tuttavia la sua proposta teorica si sviluppa all'interno di un contesto compatibile con quello austriaco, se questo è inteso come l'estensione del progetto soggettivista ad una teoria soggettiva delle aspettative. Partendo dal presupposto che il futuro non è conoscibile, non solo perché possono manifestarsi eventi esogeni non prevedibili, ma perché l'azione dei soggetti economici crea necessariamente nuovi scenari ambientali, ed è quindi fonte continua di «sorpresa», Shackle si propone di attaccare direttamente i cardini della teoria bayesiana delle decisioni¹¹. Shackle è probabilmente il primo economista ad andare oltre l'osservazione, spesso condivisa, che l'applicazione della teoria bayesiana non può condurre ad una spiegazione delle decisioni prese in contesti incerti e non di rischio (secondo la definizione data da Vercelli nell'introduzione di questo volume, in contesti di incertezza forte invece che di incertezza debole). Egli propone una vera e propria struttura formale alternativa alla teoria bayesiana fondata sui concetti di *potential surprise* e di *focus gains / losses*.

Pur senza procedere ad illustrare tale teoria (oltre al classico Shackle [1952], si veda il riesame critico di Ford [1983]) è utile notare un presupposto da cui muove Shackle. La nozione di *potential surprise* viene rappresentata mediante una variabile dicotomica, in quanto Shackle ritiene che sia impossibile utilizzare una funzione di probabilità additiva che esaurisca l'aspettativa di realizzazione degli eventi futuri incerti. Né intende assumere che l'emergere di un evento precedentemente non immaginato induca semplicemente il soggetto a ridurre il livello di probabilità associato precedentemente agli altri eventi, così da avere comunque pari ad uno la somma delle probabilità attribuite agli stati. Il tentativo di Shackle procede quindi con l'ab-

ordine spontaneo. La questione non può essere affrontata qui, ma la possibilità di definire comunque stati di ordine del sistema può essere argomentata nei termini di un approccio organicista all'equilibrio, come proposto da Dardi [1990]. Che la tradizione austriaca rientri a pieno diritto in questo approccio è argomentato in modo convincente da De Vecchi [1990].

¹¹ La posizione di Shackle su questo punto è chiaramente espressa dal passo seguente: «Economic choice does not consist in comparing the items in a list, known to be complete, of given fully specified and certainly attainable results. It consists in first creating, by conjecture and reasoned imagination on the basis of mere suggestion offered by visible or recorded circumstance, the things on which hope can be fixed. These things, at the time when they are available for choice, are thoughts and even figments» [Shackle 1972, 96].

bandono dell'uso di funzioni di probabilità. Tuttavia non si può non notare che tale abbandono è motivato dalla stessa insoddisfazione che ha indotto la letteratura recente all'uso di funzioni di probabilità non additive (si veda Schmeidler [1989], e il commento sulla teoria bayesiana nel contributo di Rustichini a questo volume).

4. Ordine sociale e decisioni individuali

Come abbiamo visto brevemente nei paragrafi precedenti, la tradizione di studi sul problema della conoscenza originata da Hayek presenta alcuni spunti che sono ripresi nella letteratura recente sulle decisioni in condizioni di incertezza. È però evidente che, diversamente da alcuni studiosi che ad Hayek si sono ispirati, l'economista austriaco non ha ritenuto di dover approfondire le sue intuizioni in termini di una teoria delle decisioni individuali. Prima di concludere ci proponiamo di suggerire una possibile interpretazione di ciò.

L'intero percorso intellettuale di Hayek è segnato dall'attenzione nei confronti del concetto di equilibrio. Inizialmente l'equilibrio è la nozione precisa, e non posta in discussione nella formulazione della teoria del ciclo economico, fornita dalla scuola di Losanna, sebbene una sua rielaborazione in termini intertemporali sia considerata necessaria [Hayek 1928]. Quindi diviene lo stato di coordinazione dei piani di attività degli individui, in un contesto nel quale l'interpretazione soggettiva dei dati del sistema può uniformarsi solo mediante un processo di scambio sul mercato [Hayek 1937, trad. it. 1988]. Infine perde ogni connotato di nozione precisa in termini quantitativi, e si caratterizza come quella struttura istituzionale che consente l'ordine sociale dei sistemi economici decentralizzati [Hayek 1978, trad. it. 1988]. Pur nella sua continua evoluzione, l'oggetto teorico dell'analisi hayekiana rimane la realizzazione, non intenzionalmente perseguita dagli individui, di stati di ordine del sistema economico. Ed in varie forme il problema che la scienza economica deve affrontare è, per l'appunto, il problema della conoscenza inteso come problema di composizione, a livello aggregato, di comportamenti individuali basati su conoscenza personale di aspetti specifici del funzionamento del sistema. Non si tratta, quindi, di un problema che può essere risolto unicamente mediante l'analisi dei comportamenti individuali.

L'idea di Hayek è quella di un sistema di interrelazioni nel quale l'aggiustamento delle teorie soggettive formulate dagli individui circa

ciò che accade sul mercato – il processo di formazione delle aspettative – non può essere esaminato come un processo nel quale l'agente individuale è considerato un'entità a sé stante. Non si può cioè supporre semplicemente che egli confronti la propria teoria del funzionamento del sistema con l'effettiva realizzazione delle variabili del sistema che lo interessano e, se necessario, la modifichi (come implicito nell'impostazione di Hahn [1990]). Occorre invece valutare come l'evoluzione del sistema in cui opera induce gli individui ad apprendere, e quindi a formulare nuove teorie. In particolare, non si tratta di comprendere come gli agenti scelgono la teoria più consona entro un insieme di possibilità predefinito, ma di analizzare il modo in cui le nuove teorie vengono generate endogenamente.

Nella letteratura recente che si rifà all'approccio delle reti neurali si dà una rappresentazione formale di aspetti della teoria del comportamento individuale che sembrano mostrare una consonanza con l'impostazione di Hayek. Agenti individuali collocati in un ambiente caratterizzato da incertezza forte non si propongono di individuare il modello «vero» che spiega il funzionamento del sistema. Essi formulano le proprie aspettative attraverso un processo adattivo che origina una rappresentazione «endogenizzata» del sistema [come in Salmon 1995]. Si può notare qui che i tratti della teoria del funzionamento del mercato di Hayek risentono, sia pure in forma non esplicita, né chiarita dallo stesso Hayek [Birner 1996], degli studi sul modo in cui la mente umana razionalizza le sensazioni derivanti dal contatto col mondo esterno, studi che pongono Hayek [1952] come precursore della moderna scienza cognitiva (su questo aspetto si veda anche il saggio di Rampa in questo volume).

In conclusione, per Hayek la soluzione del problema della conoscenza non dipende da quale sia la teoria delle decisioni più adeguata a cogliere l'incertezza ambientale nella quale si muovono gli agenti. Ciò non vuol dire, naturalmente, che una teoria delle decisioni che sia in grado di cogliere quegli aspetti incerti endogeni al processo di mercato non sia preferibile. Ma la questione centrale rimane comunque, in un'ottica hayekiana, quella del metodo mediante il quale si compongono i comportamenti individuali. Per essere più espliciti, modelli di equilibrio generale costruiti in modo tale da tenere conto delle scelte degli agenti quando essi sono posti davanti alla possibilità di eventi non prevedibili, ma che non siano in grado di esplicitare il contesto istituzionale entro il quale si svolgono gli scambi, non rappresentano ancora una risposta convincente al problema hayekiano della conoscenza.

Riferimenti bibliografici

- Arrow, K.J. (1994), *Methodological individualism and social knowledge*, in «American Economic Review», 84, pp. 1-11.
- Birner, J. (1996), *Mind, market and society. Network structures in the work of F.A. Hayek*, Trento, CEEL Working Paper, Università di Trento.
- Bray, M. e Kreps, D.M. (1987), *Rational learning and rational expectations*, in G.R. Feiwel (a cura di), *Arrow and the Ascent of Modern Economic Theory*, London, Macmillan.
- Caldwell, B. (1988), *Hayek's transformation*, in «History of Political Economy», 20, pp. 513-542.
- Dardi, M. (1990), *Il mercato nell'analisi economica contemporanea*, in G. Becattini (a cura di), *Il pensiero economico. Temi, problemi e scuole*, Torino, UTET.
- De Vecchi, N. (1990), *La scuola viennese di economia*, in G. Becattini (a cura di), *Il pensiero economico. Temi, problemi e scuole*, Torino, UTET.
- Donzelli, F. (1988), *Introduzione*, in Hayek [1988].
- Eatwell, J. e Milgate, M. (1994), *The problem of price determination and Hayek's theory of competition*, in M. Colonna, H. Hagemann e O. Hamouda (a cura di), *Capitalism, socialism and knowledge*, Aldershot, Edward Elgar.
- Ford, J.L. (1983), *Choice, Expectation and Uncertainty: an Appraisal of G.L.S Shackle's Theory*, Oxford, Martin Robertson.
- Foss, N.J. (1995), *More on «Hayek's transformation»*, in «History of Political Economy», 27, pp. 345-364.
- Grossman, S. (1989), *The Informational Role of Prices*, Cambridge (Mass.), The MIT Press.
- Hahn, F.H. (1984) [1973], *On the notion of equilibrium in economics*, in *Equilibrium and Macroeconomics*, Oxford, Blackwell.
- (1990), *Expectations*, in J. Hey e D. Winch (a cura di), *A Century of Economics*, Oxford, Blackwell.
- Hayek, F.A. (1928), *Intertemporal price equilibrium and movements in the value of money*, in *Money, Capital and Fluctuations. Early Essays*, London, Routledge.
- (1933), *The trend of economic thinking*, in «Economica», 13, pp. 121-137.
- (1935a), *Price expectations, monetary disturbances and malinvestment*, in *Profit, Interest and Investment*, London, Routledge, trad. it. in Hayek [1988].
- (1935b), *Socialist calculation II: the state of the debate*, in Hayek [1976, trad. it. in Hayek 1988].
- (1937), *Economics and knowledge*, in Hayek [1976, trad. it. in Hayek 1988].
- (1945), *The use of knowledge in society*, in Hayek [1976, trad. it. in Hayek 1988].
- (1948), *The meaning of competition*, in Hayek [1976, trad. it. in Hayek 1988].

- (1952), *The Sensory Order. An Inquiry into the Foundations of Theoretical Psychology*, London, Routledge.
- (1955), *Scientism and the study of society*, in Id. *The Counter-Revolution of Science: Studies on the Abuse of Reason*, Chicago, The Free Press; trad. it. *L'abuso della ragione. Studi sulla controrivoluzione della scienza*, Firenze, Vallecchi, 1967.
- (1967), *Studies in Philosophy, Politics and Economics*, Chicago, The University of Chicago Press.
- (1973), *Law, Legislation and Liberty*, Chicago, The University of Chicago Press, vol. I.
- (1976), *Individualism and Economic Order*, London, Routledge.
- (1978) [1968], *Competition as a discovery procedure*, in Id. *New Studies in Philosophy, Politics and Economics*, Chicago, The University of Chicago Press, trad. it. in Hayek [1988].
- (1988), *Conoscenza, mercato, pianificazione*, Bologna, Il Mulino.
- Hirshleifer, J. e Riley, J.C. (1992), *The Analytics of Uncertainty and Information*, Cambridge, Cambridge University Press.
- Kirzner, I.M. (1992), *The Meaning of Market Process. Essays in the Development of Modern Austrian Economics*, London, Routledge.
- Lachmann, L.M. (1976), *From Mises to Shackle. An essay on Austrian economics and the kaleidic society*, in «Journal of Economic Literature», 14, pp. 54-62.
- (1990), *G.L.S. Shackle's place in the history of subjectivist thought*, in S. Frohen (a cura di), *Unknowledge and Choice in Economics*, London, Macmillan.
- Langlois, R.N. (1985), *Knowledge and rationality in the Austrian school, an analytical survey*, in «Eastern Economic Journal», 9, pp. 309-330.
- Lavoie, D. (1985), *Rivalry and Central Planning. The Socialist Calculation Debate Reconsidered*, Cambridge, Cambridge University Press.
- Milgrom, P. e Roberts, J. (1994), *Economia, organizzazione e management*, Bologna, Il Mulino.
- O'Driscoll, G.P. (1977), *Economics as a Co-ordination Problem*, Kansas City, Sheed and Ward.
- O'Driscoll, G.P. e Rizzo, M.J. (1985), *The Economics of Time and Ignorance*, Oxford, Blackwell.
- Salmon, M. (1995), *Bounded rationality and learning: procedural learning*, in A. Kirman e M. Salmon (a cura di), *Learning and Rationality in Economics*, Oxford, Blackwell.
- Schmeidler, D. (1989), *Subjective probability and expected utility without additivity*, in «Econometrica», 57, pp. 571-587.
- Shackle, G.L.S. (1955), *Uncertainty in Economics and Other Reflections*, Cambridge, Cambridge University Press.
- (1972), *Epistemic and Economics*, Cambridge, Cambridge University Press.
- Vaughn, K. (1994), *Austrian Economics in America. The Migration of a Tradition*, New York, Cambridge University Press.

- Zappia, C. (1988), *Hayek, Lucas e la teoria dell'informazione*, in «Note Economiche», pp. 1-31.
- (1996), *The notion of private information in a modern perspective: a reappraisal of Hayek's contribution*, in «European Journal of the History of Economic Thought», 3, pp. 107-131.