

Jak błąd w Excelu zmusił świat do zaciskania pasa

4 czerwca 2013

28-letni doktorant skompromitował dwoje profesorów Harvardu, których badawcze niechlujstwo stało się motorem globalnej polityki zaciskania pasa.

Świat ekonomii właśnie się zmienił, a ktoś musi się teraz gęsto tłumaczyć! Poznajcie niezwykłą historię o błędach w liczeniu, akademickim szaleństwie i pysze namaszczonych ekspertów.

Od 2010 r. w kręgach politycznych i gospodarczych znane są nazwiska Carmen Reinhart i Kennetha Rogoffa. Tych dwoje ekonomistów z Harvardu sporządziło opracowanie pt. „Wzrost w czasach zadłużenia”, używane przez wszystkich, od Paula Ryana po Olliego Rehna z Komisji Europejskiej, do usprawiedliwiania szkodliwej polityki cięć budżetowych. Twierdzą oni, że kiedy globalny dług jakiegoś kraju przekracza próg 90 proc. PKB, wówczas następuje dramatyczne zwolnienie tempa wzrostu gospodarczego. Innymi słowy, dług jest wybitnie niebezpieczny i niepożądany.

Przytoczone przez Reinhart i Rogoffa dane historyczne robiły wrażenie, podobnie jak referencje autorów. Politycy i dziennikarze cytowali ich opracowanie, by przekonać opinię publiczną, iż zamiast skupiać się na kryzysie miejsc pracy, który utrudnia powrót do równowagi, powinniśmy raczej skupić się na deficytach. „Jastrzębie” zaciskania pasa nie posiadali się z radości.

Coś tu jednak nie grało.

Znani mi progresywni ekonomiści byli zszokowani badawczym niechlujstwem i absurdalnością wyciąganych wniosków naukowców z Harvardu. W opracowaniu „Świat do góry nogami? Fantazje o

deficycie w czasie Wielkiej Recesji” Thomas Ferguson i Robert Johnson zauważyli, że Reinhart i Rogoff wyeliminowali dane brytyjskie, co w rezultacie skrzywiło ich wnioski: usunęli dane dotyczące ponad stuletniego okresu, podczas którego brytyjskie obciążenie długiem gwałtownie wzrosło, ale i wzrost gospodarczy bardzo przyspieszył (patrz s. 11–13). Zawsze rozumny Marshall Auerback na blogu na rzecz New Deal 2.0, który wówczas redagowałam, skrytykował dobór przypadków, które przywołali dla uzasadnienia swoich wniosków.

Wielu dyżurnych ekspertów przyjęło jednak ich podejrzaną argumentację jak ewangelię. Redakcja „Washington Post” stwierdziła, że „stosunek długu do PKB może nadal wzrastać – i niebezpiecznie zbliżyć się do 90 proc., który to wskaźnik ekonomiści uważają za groźny dla trwałego wzrostu gospodarczego”. Ekonomiści, o których mowa, to Reinhart i Rogoff, których traktuje się tu jako głos całego środowiska. Zrodził się nowy Konsensus Waszyngtoński: opinia publiczna jest bombardowana propagandą głoszącą, że cięcia w zatrudnieniu, redukujące ważne usługi publiczne i prowadzące do załamania się infrastruktury, to dobry sposób, aby gospodarka nadal działała. Większość zwykłych ludzi z ulicy prawdopodobnie czułaby intuicyjnie, że to bez sensu, ale to przecież Uczone Badania Bardzo Ważnych Osób, więc koniec dyskusji. I kropka.

Tu pojawiają się bohaterowie tej opowieści, Thomas Herndon, Michael Ash i Robert Pollin z Uniwersytetu Massachusetts w Amherst. Thomas Herndon, 28-letni doktorant, spróbował zreplikować w ramach zajęć wyniki Reinhart-Rogoffa i nie powiodło mu się to. Poprosił więc Reinharta i Rogoffa o przesłanie oryginalnej bazy danych, której autorzy nigdy wcześniej nie udostępnili. To pozwoliło sprawdzić, jak z danych wyprowadzono wyniki. Herndon nie mógł uwierzyć w to, co zobaczył. Wspólnie z profesorami Ashem i Pollinem odkryli, że w danych roi się od błędów – od wybiórczego wyłączenia konkretnych lat, w których poziom długu i wzrostu

gospodarczego był wysoki, aż po problematyczne metody ważenia konkretnych krajów w bazie danych. Herndonowi opadła szczęka, gdy zobaczył, że kodując dane w Excelu autorzy analiz wyłączyli kraje o wysokim długu publicznym i średnim wzroście gospodarczym!

Herndon, Ash i Pollin podsumowują: „Błędy kodowania w bazie danych Reinhart i Rogoffa całkowicie wykluczają z analizy dane z pięciu państw: Australii, Austrii, Belgii, Kanady i Danii. Autorzy uśrednili komórki w wierszach od 30 do 44 zamiast w 30 do 49 (...) Ten błąd arkusza danych (...) odpowiada za błąd równy -0,3 punktu procentowego w podanym przez nich przeciętnym wzroście realnego PKB w najwyższej kategorii proporcji długu publicznego do PKB”.

Błąd kodowania! Reinhart i Rogoff pracowali tak niechlujnie, że nawet nie zadali sobie trudu, by sprawdzić własny arkusz kalkulacyjny...

Jeśli skorygujemy ich wątpliwą metodologię i usuniemy błąd kodowania, otrzymujemy całkiem inny wynik, który – no, jak myślicie? – wcale nie uzasadnia polityki cięć, lecz pokazuje, że kraj może przekroczyć fałszywy próg zadłużenia w stosunku do PKB i rozwijać się gospodarczo.

W swoim świeżo opublikowanym artykule pt. „Czy wysoki dług publiczny nieuchronnie hamuje wzrost gospodarczy? Krytyka Reinhart i Rogoffa” Herndon, Ash i Pollin wskazują, że „jeśli policzyć właściwie, średnia stopa wzrostu realnego PKB dla krajów, gdzie proporcja długu publicznego do PKB przekracza 90 proc., wynosi tak naprawdę 2,2 procent, nie zaś jak piszą Reinhart i Rogoff, -0,1 procent. Oznacza to, iż – odwrotnie niż u Reinhart i Rogoffa – średni wzrost PKB w przypadku, gdy relacja długu do PKB przekracza 90 proc., nie odbiega dramatycznie od średniego wzrostu w przypadkach, gdy ten wskaźnik jest niższy”.

Herndon, Ash i Pollin wzniecili prawdziwą burzę: ci, którzy od

dawna podejrzewali, że praca Reinhart i Rogoffa to nonsens, wznoszą okrzyki triumfu, ich obrońcy zaś usiłują wynaleźć jakiś sposób na podtrzymanie hysterii deficytu, mimo że bezlitosne dane zdmuchnęły ich teorię jak domek z kart.

Ale co by nie mówić – faktem jest, że uzasadnienie całego globalnego zwrotu ku zaciskaniu pasa i redukcji długu publicznego, jaki obserwujemy w ciągu ostatnich paru lat, stanowi spaprany arkusz kalkulacyjny Excel i błędnie zanalizowane dane.

Reinhart i Rogoff są w defensywie. Jak stwierdził Mathew O'Brien w „The Atlantic”, „to akademicka wersja snu, w którym śniący stoi nago przed tłumem ludzi”. Autorzy zbłąźnili się totalnie, ale wyrządzili też wielką szkodę światu. Jak zauważył Paul Krugman, ich odpowiedź na krytykę tylko pogłębiła zamieszanie. Powinni uznać swój błąd, skończyć z gadką, że jest mało istotny, i uznać jego kolosalną skalę. A ludziom z Uniwersytetu Massachusetts w Amherst należą się wielkie brawa – za to, że dotarli do sedna tego idiotyzmu.

Autor: Lynn Parramore

Tłumaczenie: Irena Kołodziej

Źródło oryginalne: AlterNet

Źródło polskie: [Lewica](#) i Zielone Wiadomości