

## Μια περίεργη «σχέση»

*Είναι γνωστό εδώ και δύο αιώνες ότι η Κρίση δημιουργεί τέτοια απόγνωση που ο κόσμος στρέφεται σε εμάς τους οικονομολόγους για μια αχτίδα ελπίδας, για να καταλάβει τι είναι αυτό που του συνέβη. Το ότι όμως υπάρχει ένας σχεδόν απόλυτος συσχετισμός αυτής της τάσης με τα spreads της Ισπανίας δεν το περίμενα!*

Πριν μερικές μέρες εταιρεία λογισμικού μου δώρησε ένα νέο στατιστικό πακέτο, από εκείνα που πολύ θα ήθελα να είχα όταν ήμουν νεαρός φοιτητής και πάσχιζα να γράφω εκ του μηδενός δικά μου προγράμματα (μιας και δεν υπήρχαν «έτοιμα»). Όταν βρέθηκα την επομένη «εγκλωβισμένος» δεκατέσσερις ώρες σε ένα αεροπλάνο (Los Angeles-Sydney) σκέφτηκα να «παίξω» με το δώρο μου. Καθώς δεν είχα στον υπολογιστή μου πρόχειρα πληθώρα στοιχείων, αναγκάστηκα να χρησιμοποιήσω ό,τι βρήκα για να δω πόσο φιλικό προς τον χρήστη ήταν το λογισμικό που μου χάρησαν. Τότε θυμήθηκα το σπουδαίο ρητό του Wittgenstein: οι περιορισμοί απελευθερώνουν!

Πράγματι, τα μόνα στοιχεία που βρήκα καταχωνιασμένα στον υπολογιστή μου μου επέβαλαν να παρατηρήσω έναν ενδιαφέροντα συσχετισμό που διαφορετικά θα μου διέφευγε. Καθώς οι μόνες χρονοσειρές που είχα αφορούσαν (α) τα spreads των ομολόγων των διάφορων κρατών-μελών της ευρωζώνης και (β) τον αριθμό επισκεπτών στην προσωπική μου ιστοσελίδα, αναγκάστηκα να τρέξω απλές στατιστικές ελέγχου του βαθμού που το (α) συσχετίζεται με το (β). Και τι νομίζετε ότι βρήκα; Ότι το 98% των διακυμάνσεων στον αριθμό επισκέψεων στην ιστοσελίδα μου «εξηγείται» από τις διακυμάνσεις των spreads της Ισπανίας!

Προσέξτε τα εισαγωγικά στο ρήμα «εξηγείται». Οφείλονται στο ότι πρέπει να είμαστε ιδιαίτερα προσεκτικοί όταν ερμηνεύουμε τα αποτελέσματα της οποιασδήποτε στατιστικής μεθόδου. Έστω, για παράδειγμα, ότι η μεταβλητή X αλλάζει πριν την Y, και οι αλλαγές της Y είναι ανάλογες των μεταβολών της X. Είναι πολύ εύκολο να συμπεράνουμε ότι η μεταβλητή X **εξηγεί** τις μεταβολές της Y. Κάτι τέτοιο ισχύει στην περίπτωση που X είναι το πόσο πατά ο οδηγός το γκάζι του αυτοκινήτου και το Y η ταχύτητα του τελευταίου. Όμως, αν κάνουμε το λάθος να θεωρήσουμε κάτι τέτοιο Γενικό Κανόνα, μπορεί να την πατήσουμε άσχημα. Π.χ. να πιστέψουμε ότι η αύξηση στην ζήτηση των παιχνιδιών προκαλεί... τα Χριστούγεννα.

Στην δική μου όμως περίπτωση τα πράγματα είναι ξεκάθαρα. Είναι αδύνατον να φανταστώ ότι το αυξημένο ενδιαφέρον στα κείμενά μου προκαλεί αυξήσεις των ισπανικών spreads (αν και, κρίνοντας από κάποια σχόλια στα άρθρα μου, κάποιοι δεν θα δίσταζαν να σκεφτούν ακόμα και κάτι τέτοιο). Προφανώς η «κατεύθυνση» της σχέσης αίτιου-αιτιατού ξεκινά από τα ισπανικά spreads και οδηγεί στην επισκεψιμότητα της ιστοσελίδας μου. Δεν θέλει πολλή σκέψη: Το ενδιαφέρον του πολύ κόσμου για τα λεγόμενα ημών των οικονομολόγων αντανακλά το πόσο βαθειά είναι η Κρίση. Σε νορμάλ εποχές, ο κόσμος έβλεπε οικονομολόγο στο γυαλί και έκανε (πολύ σωστά) κατ' ευθείαν ζαπ σε άλλη εκπομπή.

Το 1991 είχα την τύχη να γνωριστώ και να συνομιλήσω με τον Paul Sweezy, τον «πατριάρχη», κατά ένα τρόπο, των αμερικανών ριζοσπαστών οικονομολόγων, ιδίως της Νέας Υόρκης. Μου αφηγήθηκε την εξής ιστορία: Κάθε χρόνο προσέφερε ένα μάθημα Πολιτικής Οικονομίας στο πανεπιστήμιο. Επειδή δεν υπήρχε διαθέσιμη αίθουσα σεμιναρίου, του είχαν δώσει ένα τεράστιο αμφιθέατρο, χωρητικότητας χιλίων ατόμων, για μια τάξη είκοσι φοιτητών. Μαζεύονταν όλοι σε μια γωνιά, και έκαναν μάθημα στην κατά τα άλλα άδεια, αχανή αίθουσα. Μια χρονιά, μου είπε ο Sweezy, ανάβαινε τις σκάλες για να παραδώσει το πρώτο μάθημα του εξαμήνου. Οι σκάλες ήταν φίσκα από φοιτητές που συνωστίζονταν για να μπουν στο αμφιθέατρο. Στην αίθουσα ήταν στιβαγμένοι σαν τις σαρδέλες. «Αναρωτήθηκα», συνέχισε ο Sweezy να μου λέει, «ποιος σταρ θα ερχόταν, σε ποιον είχαν δώσει το αμφιθέατρο ξεχνώντας να με ειδοποιήσουν. Ρωτώ μια φοιτήτρια τι περιμένουν και έμεινα εμβρόντητος όταν μου απάντησε: Τον καθηγητή Sweezy.» Τι είχε γίνει; Απλό. Είχε αρχίσει η βίαιη στρατολόγηση φοιτητών για να σταλούν στα πεδία του πολέμου του Βιετνάμ. Η Αμερική έμπαινε σε μια βαθιά πολιτική και οικονομική Κρίση που, τελικά, άλλαξε τα πάντα. Μέσα στην σκοτοδίνη, στην ανασφάλεια που δημιουργεί μια Κρίση, το ενδιαφέρον για την Πολιτική Οικονομία ξάφνου εκτινάσσεται στον αέρα. Κι όταν αργότερα τα πράγματα ηρεμούν και η κοινωνία γαληνεύει, επιστρέφουμε στα άδεια αμφιθέατρα.

Όταν λοιπόν ξέσπασε το 2008 το Μεγάλο Κραχ των ημερών μας, το οποίο το 2009/10 κατέφθασε στα μέρη μας με συντριπτικά αποτελέσματα, ήμουν προετοιμασμένος (λόγω Sweezy) για το αυξημένο ενδιαφέρον που περιέβαλε την δουλειά μας. Όμως αυτό το νέο στοιχείο που ανακάλυψα στο αεροπλάνο δεν το περίμενα. Με ξάφνιασε. Σκεφτείτε το: Πόσοι από τους επισκέπτες στην ιστοσελίδα μου παρακολουθούν τα spreads της Ισπανίας; Σχεδόν κανείς. Κι όμως, οι επισκέψεις τους είναι σχεδόν απόλυτα εναρμονισμένες με τα σκαμπνεβάσματα αυτών των συγκεκριμένων spreads. Πως γίνεται αυτό;

Όσο το σκέφτομαι, το μυστήριο εξαφανίζεται. Η Ισπανία βρίσκεται στο επίκεντρο του δράματος του ευρώ. Την Ελλάδα μπορεί να την σώσουν, αν θέλουν, ή και να την αγνοήσουν. Την Ισπανία ούτε να την σώσουν ούτε να την αγνοήσουν μπορούν, με τα ισχύοντα εργαλεία της ΕΕ. Η κατάρρευσή της θα σφραγίσει το τέλος του ευρώ, το οποίο (με την σειρά του) μας απειλεί με μια μεταμοντέρνα δεκαετία του '30. Μπορεί το πλατύ κοινό να μην παρακολουθεί αυτά καθ' εαυτά τα spreads της Ισπανίας. Όμως ο κόσμος αφουγκράζεται, πασχίζει να καταλάβει τι συμβαίνει, οι αντένες του είναι προτεταμένες και «πιάνουν» μηνύματα αρνητικά τα οποία, πολύ πιθανόν, συσχετίζονται στατιστικά με τα ισπανικά spreads. Και τότε έχουν μεγαλύτερο κίνητρο να μπουν στην ιστοσελίδα ενός περιέργου οικονομολόγου να δουν τι λέει για τα τεκταινόμενα.

Οπότε, κλείνω με μια διπλή ευχή: η επισκεψιμότητα στην ιστοσελίδα μου να τείνει προς το μηδέν και ο στατιστικός συσχετισμός της με τα επιτόκια δανεισμού της Ισπανίας να εξαφανιστεί. Τότε θα ξέρουμε πως η Κρίση τελείωσε...