

Resenha bibliográfica 2

The theory of economic planning

Heal, G. M. *The Theory of Economic Planning* —
Nort-Holland Publ. Co., 1973. 409 pp.

JORGE VIANNA MONTEIRO *

1 — Introdução

A teoria econômica não tem, via de regra, dedicado especial atenção ao tema do planejamento, o que todavia não impede que discussões aparentemente desvinculadas desse tema contenham elementos em potencial de uma “teoria do planejamento”.¹ Assim, parece que um procedimento para a delimitação dessa teoria seria um esforço de unificação de diferentes áreas da teoria econômica numa classe de estudos mais geral — o que, de resto, tem sido um procedimento comum em Economia.

A “teoria” que Heal nos apresenta deve ser entendida nesse sentido, embora seja bastante discutível o sucesso alcançado em seu objetivo de abordar “temas teóricos gerais relativos ao funcionamento e às propriedades [de economias de comando] (...) em nível de abstração semelhante ao que a tradicional Economia do Bem-Estar tem discutido o comportamento da economia de competição”.

De fato, a ambientação institucional das economias de comando no livro de Heal é apenas incidental. A primeira parte do livro envolve apenas um tratamento bastante didático de certas “soluções”

* Da Pontifícia Universidade Católica.

¹ Ou, visto de outro ângulo, “a literatura sobre a teoria do planejamento econômico, embora primitiva sob muitos aspectos, ainda assim cobre grande variedade de temas”. Ver Roy Radner, *Notes on the Theory of Economic Planning* (Athens, 1963), p. 19.

para o problema da alocação de recursos, enquanto a segunda pode ser perfeitamente incluída numa coletânea sobre teoria do crescimento.

2 — A visão tradicional ou a teoria de Heal

As considerações teóricas sobre planejamento têm sido apresentadas no âmbito de resultados clássicos do equilíbrio geral — ou a visão do “helmsman”, de Koopmans.² Assim, os teoremas:

i) toda “alocação orientada pelo preço” implica uma “combinação de atividades eficiente”,

ii) dada uma “combinação de atividades eficiente”, x , existe um vetor, p , tal que (x,p) satisfaz a “alocação orientada pelo preço”,

são, respectivamente, os grandes suportes analíticos da economia liberal e da economia de comando, ou de planejamento centralizado (EPC). O Teorema ii sugere a possibilidade de se utilizarem os preços de eficiência em contextos institucionais bastante variados, entre os quais na situação em que as decisões de alocação são atribuídas a um agente econômico, em uma espécie de “jogo de alocação”.

Mais por contraposição às virtudes e aos vícios do equilíbrio competitivo do que propriamente por um tratamento direto da organização econômica centralizada, é possível, a partir de tais resultados, estabelecer diferentes mecanismos ou processos (como prefere o professor Hurwicz) de ajustamentos, que façam o que o mercado faz e, preferentemente, com mais virtudes e menos vícios.

Em verdade, essas contribuições baseiam-se em esquemas bastante distanciados de uma EPC do mundo real. Em geral, supõe-se um mundo walrasiano de $k + 1$ agentes: k empresas e 1 órgão central de planejamento (OCP). As empresas produzem n mercadorias, com o produto líquido da firma j representado por $y_{i,j}$, onde $i = 1, 2, \dots, n$.

² T. C. Koopmans, “Analysis of Production as an Efficient Combination of Activities”, in T. C. Koopmans (ed.), *Activity Analysis of Production and Allocation* (Wiley, 1951), pp. 33-97.

Se o consumo final é x_i , então

$$z_i = x_i - \sum_{j=1}^k y_{i,j}$$

é a demanda líquida pela mercadoria i .

Assim, um plano ou programa P , para a EPC, é definido por $\{x, y_i, z\}$. Além da restrição acima, os vetores x , y_i e z devem ainda atender a certas condições típicas dos modelos de alocação de recursos.

A tarefa do planejador será, então, determinar o plano ótimo, P^* , supondo a maximização da utilidade do consumo final $u(x)$ e obedecendo certas restrições. O *tâtonnement* walrasiano é a base dos vários algoritmos apresentados como solução do problema. Dentre outros, o de Lange, que Heal aborda na versão Arrow-Hurwicz³ e o de Malinvaud,⁴ também apresentado por Heal.

Assim, no algoritmo Lange-Arrow-Hurwicz, o OCP determina um vetor de consumo final, x , que maximiza $\{u(x) - p^s x\}$, o excesso de utilidade sobre o valor do consumo, avaliado aos preços da s -ésima iteração. E como seria fixado p^s ? Segundo Arrow-Hurwicz, pelo critério:

$$p_i^s = \max \{0, p_i^{s-1} + a(z_i^{s-1} - w_i)\},$$

em que a correção $a(z_i^{s-1} - w_i)$ a ser feita nos preços é proporcional ao *deficit* dos recursos iniciais face à demanda líquida.

Tanto a solução de Lange como a de Malinvaud são os espécimes mais famosos dos algoritmos de preços. Todavia, nem sempre tais procedimentos se enquadram nas idéias de que o OCP se ocupa, não tanto em fixar preços mas quantidades físicas de mercadorias,

3 O. Lange, "On the Economic Theory of Socialism", in *Review of Economic Studies*, n.ºs 1 e 2 (1936/7); K. Arrow e L. Hurwicz, "Decentralization and Computation in Resource Allocation", in R. Pfouts (ed.), *Essays in Economics and Econometrics in Honour of Harold Hotelling* (University of North Carolina Press, 1960).

4 E. Malinvaud, "Decentralized Procedures for Planning", in Malinvaud e Bacharach (eds.), *Activity Analysis in The Theory of Growth and Planning* (MacMillan, 1967).

ou talvez ambas as coisas ao mesmo tempo. Assim, Heal também apresenta um algoritmo da classe dos *non-price guided* — o de Kornai-Liptak,⁵ em que se dispensa o *tâtonnement* e se recorre à programação matemática. Nos algoritmos “mistos” tipo “preço e quantidade” Heal reproduz algumas de suas idéias já apresentadas na *Review of Economic Studies*, em 1969 e 1971.

Em todos esses exemplos, Heal discute metodicamente as propriedades matemáticas de cada algoritmo (a existência de equilíbrio, sua estabilidade e o processo de convergência).

3 — Uma visão não-tradicional

A insatisfação com esse tipo de tratamento não decorre apenas de suas limitações analíticas. Mesmo no caso das EPC — onde virtualmente a teoria de Heal estaria ambientada — tais “soluções” estão em posição muito precária no contexto das reformas econômicas que se processam desde meados da década de 60 na Europa Oriental e URSS. Como lembra Thomas Marschak: “Os economistas devem reconhecer um fato importante. Os dirigentes da reforma econômica nos países socialistas, na tentativa de descentralizar a economia de comando, rejeitaram qualquer idéia de adaptar, de algum modo prático, as proposições clássicas da literatura ocidental para a economia socialista (...). Isso causa um duplo embaraço aos teóricos econômicos ocidentais. Não apenas sua solução “aceita” para a questão da formação de preço é ignorada, como a solução proposta em seu lugar é justamente do tipo em que a teoria ocidental é de fato extremamente obscura”.⁶

⁵ J. Kornai e T. Liptak, “Two-Level Planning”, in *Econometrica*, vol. 33 (1963).

⁶ T. Marschak, “Decentralizing the Command Economy: The Study of a Pragmatic Strategy for Reformers”, in M. Bornstein (ed.), *Plan and Market: Economic Reform in Eastern Europe* (Yale University Press, 1973), pp. 23-63.

As reformas econômicas na indústria na URSS podem, em certo sentido, ser vistas como um “movimento de racionalização oligopolista” (Prybyla) na medida em que a transferência das decisões a nível microeconômico reforçou não tanto a empresa individual mas grupos de empresas, tomando vantagem das economias de escala, incorporação de novas tecnologias, etc.

De fato, é importante considerar em que medida se poderá desenvolver uma teoria do planejamento independentemente da análise dos sistemas econômicos. Nesse sentido, é inevitável que se mencione a contribuição de Kornai,⁷ que é, por certo, bastante mais atraente e promissora (para a própria teoria econômica) que a de Heal. Todavia, Kornai teve de percorrer um caminho novo, rompendo com a tradição das soluções tratadas por Heal: é a visão do “antiequilíbrio”.

A limitação imposta por Heal ao tema do planejamento implica certos vícios mais ou menos óbvios, entre outros:

i) não há qualquer tentativa de estabelecer uma ligação com as contribuições de Kornai e de outros autores que atuam na área de sistemas econômicos (T. Marschak, E. Neuberger, G. Grossman, entre outros) ou de organizações (*teams*) como J. Marschak, R. Radner, T. Groves, por exemplo. Em consequência, *The Theory of Economic Planning* é extremamente omissivo no plano teórico e metodológico;

ii) permanece a dissociação entre política econômica e planejamento (o que diferencia uma da outra?) que tem mantido em separado as análises do planejamento e as contribuições de Tinbergen, Frisch e outros;

iii) na boa tradição do equilíbrio geral, o aspecto da consistência no planejamento é virtualmente omitido. Não há referência aos modelos lineares, tipo insumo-produto, ou mesmo a receitas técnicas, como os balanços materiais.

Em suma: trata-se de um livro útil, menos pelo que seu título enganador possa sugerir do que por suas virtudes didáticas de reunir em um tratamento acessível certos temas do equilíbrio geral. A conclusão, reflexo das idiosincrasias de seu autor, é de que ainda está por ser apresentada uma teoria do planejamento econômico.

⁷ J. Kornai, *Anti-Equilibrium: On Economic Systems Theory and the Tasks of Research* (North-Holland, Amsterdam, 1971).

