

Bernhard Felderer • Stefan Homburg

Makro İktisat ve Yeni Makro İktisat

Gözden Geçirilmiş 2. Baskı

Çeviren:

Prof. Dr. Osman Aydoğuş
Ege Üniversitesi, İktisat Bölümü



EFİL YAYINEVİ

MAKRO İKTİSAT VE YENİ MAKRO İKTİSAT

Yazarlar: Bernhard Felderer • Stefan Homburg

Çeviren: Osman Aydođuş

Genel Yayın Nu.: 48

ISBN: 978-605-4334-07-0

1. Basım, Şubat 2010

2. Basım, Ekim 2017

EFLATUN Basım Dağıtım Yayıncılık Danışmanlık
Yatırım ve Tic. Ltd. Şti.©2017

Efil©2017

Bu kitabın tüm hakları saklıdır.
Herhangi bir şekil ya da yöntemle çoğaltılamaz.

Translation from the German language edition:
Makroökonomik und Neue Makroökonomik by Bernhard Felderer and
Stefan Homburg
Copyright © Springer Berlin Heidelberg 1984, 1985, 1987, 1989, 1991,
1994, 1999, 2003, 2005 Springer-Verlag GmbH is a part of Springer
Science + Business Media. All Rights Reserved.




Sertifika Nu.: 12131

Kapak ve Sayfa Tasarımı: Sıla Koçođlu

Baskı ve Cilt: Sözkese Matbaacılık Tic. Ltd. Şti.
İVOGSAN 1518. Sokak MAT-SİT İş Merkezi No: 2/40 Yenimahalle-ANKARA
Tel: (+90) 312 395 21 10 - 395 59 07 • Sertifika Nu.: 13268



E F İ L Y A Y I N E V İ

 www.efilyayinevi.com
 www.facebook.com/efilyayinevi
 twitter.com/efilyayinevi
 instagram.com/efilyayinevi

EFLATUN Basım Dağıtım Yayıncılık Danışmanlık Yatırım ve Tic. Ltd. Şti.
Bağcılar Mahallesi Şemsettin Günaltay Caddesi 283. Sokak
Ata Apt. No: 9/7 06670 Çankaya/Ankara, Türkiye
Tel : (+90) 312 442 52 10
GSM : (+90) 530 108 99 76
Faks : (+90) 312 442 52 12

Dokuzuncu Baskıya Önsöz

Felderer/Homburg tarafından yazılan ders kitabının yeni baskımını yapmak bir kez daha gerekli olmuştur. Buna ilişkin olarak, kitabın sekizinci baskısı gözden geçirilerek kapsamlı yenilikler yapılmış ve yazım hataları ile yanlışlıkları giderilmiştir. Katkı koyan meslektaşlarımıza ve özellikle çok sayıda öğrencimize bu nedenlerle teşekkürler.

Köln, Şubat 2005

Bernhard Felderer

Sekizinci Baskıya Önsöz

Felderer/Homburg ders kitabı otuz altı başarılı yılı geride bırakmıştır. Geçmiş yedi baskıda çok küçük düzeltme ve eklemeler yapılmış olmasına karşılık, bu kez, sadece “ Makro İktisat”’a değil “Yeni Makro İktisat”’a ilişkin açıklamalara da geniş yer verilerek önemli bir bölüm yenilenmiş ve genişletilmiştir.

Geçen uzun sürede, yazarların mesleki ve diğer çalışmalarının yanı sıra doktrinel gelişmeler dikkate alınırken, ders kitabının iyileştirilmesi ve geliştirilmesi yönünde de sürekli eleştiriler alınmıştır. Bu noktada uluslararası iktisat ve büyüme teorilerine ilişkin eklemeler hedeflenmiştir.

Kitapta değişiklik yapma ihtiyacı son yıllarda iki açıdan artmıştır: Kitabın ilk baskısının yapıldığı dönemde henüz oluşum aşamasında olan, örneğin reel iktisadi devreler teorisi gibi önemli ve yeni gelişmelere yer verilmesi ve kitabın mevcut içeriğinin geliştirilmesi.

Bu kez kesinlikle bir uzlaşma gerekiyordu ve optimum çözüme farklı amaçlara veri kısıtlar altında ulaşılabilirdi. Kitabın eski tasarımındaki ilk ana çizgisi öğrencilere yönelik bir ders kitabı özelliğini taşımasıdır. Bu kısıt, öğrencinin ansiklopedik tanımları öğrenebilmelerine ve makro iktisat bilgilerini geliştirmelerine hizmet etmenin yanısıra, öğrenimi boyunca elde ettiği bilgilerin etkisini sürdürmesidir. Bu temelden hareketle modellerdeki matematiksel formülasyonların güçlük dereceleri dikkate alınmış ve dinamik formülasyonlardan mümkün olduğunca kaçınılmıştır.

Temel nitelik olarak doktriner bir yaklaşım benimseyen bu basımda, İkinci Kitap’ta çok iyi biçimde ele alınmış olan Klasik ve Keynesyen teoriler hiç bir değişiklik yapılmaksızın aynen korunmuştur. Buna karşılık, yeni basımda kitaba Açık Ekonomi Bölümü eklenmiştir. Ancak bu bölümde, bir uluslararası iktisat kitabından farklı olarak, sadece açık ekonomi kapsamında teorilerin karşılaştırılmasına yer verilmiştir.

Yeni Makro İktisat konusunu içeren Üçüncü Kitap aşağıdaki gibi değiştirilmiştir: Reel balans etkisi ve portföy teorisinin incelendiği kısımların yanısıra, monetaristlere ilişkin bölüm de çıkarılmıştır. Buna karşılık, Yeni Klasik İktisat konusu kitaba dâhil edilmiştir. İçerik olarak bu bölüm, reel iktisadi devreler teorisi gibi konuları kapsamaktadır. Neo-keynesyen teori (= miktar kısıtlaması altında dönemlerarası genel denge) büyük ölçüde eskisi gibi kalmıştır. Üçüncü Kitap'ın sonuna Yeni Keynesyen İktisat başlıklı yeni bir bölüm eklenmiştir. Bu bölümde, konuyla ilgili son yirmi yılın tartışmalarının örneklerinden de görülebileceği gibi, piyasa temizleyici eksik-denge fiyatındaki dalgalanmalar da içsel olarak açıklanmaktadır.

Bu kavram aracılığıyla, doktrin ve yönetime ilişkin tanımsal biçimler, ki bunlar bir ders kitabının temel karakteristik unsurlarıdır, kitapta muhafaza edilmiştir. Bu kavramın fırsat maliyeti ise, diğer bazı yakın alanların -büyüme teorisi gibi- dikkate alınmaması olmuştur.

Çok sayıda kişiye bu çalışmaya ilişkin önerileri ve eleştirileri için teşekkür etmek zorunluluğu vardır. Bunlar arasında özellikle Dr. Andre Drost, Prof. Dr. Wilhelm Kohler, Dr. Ludger Linnemann ve Dr. Andreas Schabert zikredilmelidir. Bu kitabın güncelleştirilmesi, mevcut niteliğinin korunmasında olumlu ve içten katkılarda bulunan meslektaşlar ve öğrenciler sayesinde mümkün olmuştur.

Köln,

Ekim 2002



Çevirenin Önsözü

İkinci baskıda, kitabın ilk baskısındaki çeviriyi tümüyle gözden geçirip eksiklik ve hataları olabildiğince gidermeye çalıştım. Ayrıca, ilk baskıda Prof. Dr. Oğuzhan Altay tarafından çevrilen açık ekonomi ile ilgili bölüm ve diğer bazı kısımları gözden geçirerek kitabın geri kalan kısmıyla bütünleştirme olanağı da buldum. İlk baskıdaki değerli katkıları için sevgili Oğuzhan'a teşekkürlerimi sunuyorum. Efil Yayınevi ikinci baskının daha iyi olması için kitabın yeniden dizilmesini sağladı. Sevgili arkadaşım Fethiye Çolak'a teşekkür ediyorum. Umuyorum pırıl pırıl dizgisi ve baskısıyla, gözden geçirilmiş ikinci baskıyı okuyucu da daha çok sevecek.

Osman Aydoğuş
Ağustos 2017 İZMİR



İÇİNDEKİLER

DOKUZUNCU BASKIYA ÖNSÖZ.....	iii
SEKİZİNCİ BASKIYA ÖNSÖZ	iv
ÇEVİRENİN ÖNSÖZÜ	vii
DEĞİŞKENLERİN TANIMI	xvii
ENDEKSLER.....	xix

BİRİNCİ KİTAP: TEMELLER

Bölüm I. Yöntem Üzerine Bir İrdeleme 1

§1 İKTİSADİ TEORİLER.....	1
§2 İKTİSADİ MODELLER.....	4
§3 YÖNTEMLER.....	5
§4 DENGE VE DENGESİZLİK, İSTİKRAR.....	5
§5 DURAĞANLIK, KARŞILAŞTIRMALI DURAĞANLIK VE DİNAMİKLİK.....	7
§6 EX POST VE EX ANTE ANALİZ.....	8
§7 KİSMİ VE TOPLAM ANALİZ, CETERIS PARİBUS VARSAYIMI ..	9
§8 MİKRO İKTİSAT VE MAKRO İKTİSAT	10
OKUMA LİSTESİ	13

Bölüm II. Tarihsel Bir Tarama..... 14

§9 ÖNCÜLER.....	14
§10 KLASİK İKTİSATÇILAR	16
§11 NEOKLASİK İKTİSATÇILAR.....	18
§12 KEYNES'TEN GÜNÜMÜZE	20
OKUMA LİSTESİ.....	22

Bölüm III. Milli Gelir Muhasebesi.....	23
§13 ÇEMBERSEL AKIM OLARAK EKONOMİ	23
§14 FRANÇOİS QUESNAY’NİN ÇEMBERSEL AKIM ŞEMASI	25
§15 GELİR HESAPLARI SİSTEMİ.....	27
§16 GELİR HESAPLARI SİSTEMİNDEKİ ÇEŞİTLİ GELİR KAVRAMLARI.....	31

İKİNCİ KİTAP: MAKRO İKTİSAT

§17 İKİNCİ KİTABA GİRİŞ	40
-------------------------------	----

Bölüm IV. Klasik-Neoklasik Teori

§18 KLASİK-NEOKLASİK VİZYON: BÖLÜMÜN PLANI	42
§19 ÜRETİM FONKSİYONLARI	45
§20. FİRMALAR.....	51
§21 HANE HALKLARI.....	59
§22 İŞGÜCÜ PİYASASI	65
§23 SERMAYE PİYASASI	67
§24 MAL PİYASASI	70
§25 PARANIN MİKTAR TEORİSİ.....	73
§26 SAY KANUNU.....	81
§27 KLASİK-NEOKLASİK MODEL.....	83
§28 WALRAS MODELİ	86
§29. SONUÇ VE DEĞERLENDİRME	93
OKUMA LİSTESİ	95

Bölüm V. Keynesyen Teori

§30 BUNALIM.....	96
§31 “GENEL TEORİ” VE YORUMCULARI	98
§32 EFEKTİF TALEP.....	102

§33 TÜKETİM TALEBİ.....	104
§34 YATIRIM TALEBİ.....	111
§35 GELİR-HARCAMA MODELİ	114
§36 BASİT ÇOĞALTAN	119
§37 PARA VE TAHVİL PİYASALARI. LM EĞRİSİ	123
§38 SERMAYE PİYASASI. IS EĞRİSİ.....	133
§39 IS/LM MODELİ.....	135
§40 TAM KEYNESYEN MODEL	139
§41 BİRİNCİ SENARYO: YATIRIM TUZAĞI.....	147
§42 İKİNCİ SENARYO: LİKİDİTE TUZAĞI	152
§43 ESNEK REEL ÜCRETLER ALTINDA EKSİK İSTİHDAM DENGESİ?.....	156
§44 ÜÇÜNCÜ SENARYO: YAPIŞKAN ÜCRETLER	158
§45 SONUÇ VE DEĞERLENDİRME	163
OKUMA LİSTESİ.....	164

Bölüm VI. Politika Uzantıları:

Bir Karşılaştırma.....165

§46 DEVLETİN ROLÜ. İKTİSAT POLİTİKASININ AMAÇLARI VE ARAÇLARI.....	166
§47 MALİYE POLİTİKASI	169
§48 KLASİK-NEOKLASİK DURUMDA MALİYE POLİTİKASI.....	171
I. BORÇLANMAYLA FİNANSMAN.....	172
II. VERGİYLE FİNANSMAN.....	174
§49 TAM KEYNESYEN DURUMDA MALİ POLİTİKA	175
I. BORÇLANMAYLA FİNANSMAN.....	175
II. VERGİYLE FİNANSMAN.....	178
§50 YATIRIM YA DA LİKİDİTE TUZAĞI ALTINDA MALİYE POLİTİKASI	182
I. Borçlanmayla Finansman.....	182

II. Vergiyle Finansman.....	185
§51 YAPIŞKAN ÜCRETLER ALTINDA MALİYE POLİTİKASI.....	188
§52 DEVRE-KARŞITI MALİYE POLİTİKASI KAVRAMI	190
§53 PARA POLİTİKASI.....	194
§54 KLASİK-NEOKLASİK MODELDE PARA POLİTİKASI	195
§55 TAM KEYNESYEN MODELDE PARA POLİTİKASI.....	196
§56 YATIRIM YA DA LİKİDİTE TUZAĞI ALTINDA PARA POLİTİKASI.....	198
§57 YAPIŞKAN ÜCRETLER ALTINDA PARA POLİTİKASI	201
§58 SONUÇ VE DEĞERLENDİRME	201
OKUMA LİSTESİ	203

Bölüm VII. Açık Ekonomi Makro İktisadı204

§59 MİLLİ MUHASEBE SİSTEMİNDE DIŞ DÜNYA	205
I. Dolaşım ve Hesapların Oluşumu.....	205
II. Ödemeler Bilançosu.....	209
§60 NEOKLASİK MODEL: KÜÇÜK AÇIK EKONOMİ.....	211
I. Faiz Paritesi	212
II. Satın Alma Gücü Paritesi.....	214
III. Sermaye Piyasası.....	216
IV. Neoklasik Model	218
§61 KEYNESYEN MODEL: KÜÇÜK AÇIK EKONOMİ.....	221
I. Reel Döviz Kuru ve Dış Fazla	222
II. Mundell-Fleming Modeli	224
III. İşgücü Piyasası	228
IV. Keynesyen Model.....	230
§62 İKTİSAT POLİTİKASI UZANTILARI: TEORİK KARŞILAŞTIRMA	233

I. Döviz Kuru Sistemi	234
II. Neo-Klasik Modelde İktisat Politikaları.....	235
a) Para Politikası	235
b) Maliye Politikası.....	235
i) Vergi ile Finansman	236
ii) Açık Finansman.....	237
III. Keynesyen Modelde İktisat Politikaları	237
a) Para Politikası	237
b) Maliye Politikası.....	239
i) Vergi ile Finansman.....	240
ii) Açık finansman.....	244
OKUMA LİSTESİ	246

ÜÇÜNCÜ KİTAP: YENİ MAKRO İKTİSAT

§63 ÜÇÜNCÜ KİTABA GİRİŞ.....	248
OKUMA LİSTESİ	250

Bölüm VIII. Yeni Klasik Teori251

§64 BEKLENTİLER VE RASYONEL BEKLENTİLER	252
Uyarlanmış Beklentiler	255
Rasyonel Beklentiler	259
§65 PHİLLİPS EĞRİSİ. STAGFLASYON	262
§66 YENİ KLASİK VİZYON.....	269
§67 YENİ KLASİK MODEL.....	272
§68 İKTİSAT POLİTİKASI ÇIKARIMLARI	277
§69 REEL İKTİSADİ DEVRE MODELİ	283
I. Ampirik Motivasyon Hakkında	285
II. Reel İktisadi Devre Modeli.....	287

III. Çözüm ve Değerlendirme.....	291
IV. Döngü.....	294
OKUMA LİSTESİ.....	296
§70 SONUÇ VE DEĞERLENDİRME.....	297
OKUMA LİSTESİ.....	302
Bölüm IX. Neokeynesyen Teori.....	303
§71 NEOKEYNESYEN TEORİNİN KÖKENİ.....	304
§72 İKİLİ KARAR HİPOTEZİ.....	307
§73 SABİT-FİYAT YÖNTEMİNİN MANTIĞI.....	318
§74 TÜKETİM FONKSİYONUNUN YENİDEN İNCELENMESİ... ..	328
§75 NEOKEYNESYEN MODEL.....	336
§76 POLİTİKA ÇIKARIMLARI.....	353
§77 MİKTAR KISITLAMALARI ALTINDA WALRAS YASASI.....	362
§78 SONUÇ VE DEĞERLENDİRME.....	365
OKUMA LİSTESİ.....	368
Bölüm X. Yeni Keynesyen Teori.....	369
§79 GİRİŞ.....	369
§80 ÜCRET YAPIŞKANLIĞI I: ETKİN ÜCRETLER.....	370
a) Basit Etkin Ücret Modeli.....	372
b) Etkin Ücret Modelinde Vergiler.....	375
§81 YAPIŞKAN ÜCRETLER II: ÜCRET SÖZLEŞMESİ.....	378
a) Tekelci İşçi Sendikası.....	378
b) Ücret Görüşmeleri.....	382
c) Bir Örnek.....	385
§82 YAPIŞKAN FAİZLER.....	389
§83 MAL FİYATLARINDA YAPIŞKANLIK.....	394

a) Katalog Maliyetsiz Model.....	395
b) Katalog Maliyetine Giriş	396
OKUMA LİSTESİ	401

MATEMATİKSEL EK

GİRİŞ.....	404
1. TEK DEĞİŞKENLİ FONKSİYONLAR KALKÜLÜSÜ	405
1.1. Tek Değişkenli Fonksiyonlar.....	405
1.2. Türevler.....	406
1.3. Taylor Teoremi.....	410
1.4. Türevseller.....	413
1.5. İçbükeylik ve Dışbükeylik.....	415
1.6. Maksimum ve Minimumlar	417
*1.7. Kâr Maksimizasyonu.....	421
2. DOĞRUSAL CEBİR.....	422
2.1. Vektörler.....	422
2.2. Matrisler ve Determinantlar.....	424
2.3. Eşanlı Doğrusal Denklemler.....	428
2.4. Karakteristik Değer Problemleri	431
2.5. Karesel Biçimler.....	434
3. ÇOK DEĞİŞKENLİ FONKSİYONLAR KALKÜLÜSÜ	436
3.1. Çok Değişkenli Fonksiyonlar	437
3.2. Kısmi Türevler. Gradyanlar.....	437
3.3. Zincir Kuralı	440
3.4. Taylor Teoremi.....	443
3.5. Kısmi Türevseller.....	445
3.6. İçbükeylik ve Dışbükeylik.....	446

3.7. Maksimum ve Minimumlar	448
3.8. Kısıtlamalar Altında Maksimum ve Minimumlar.....	451
*3.9. Kâr Maksimizasyonu.....	455
4. ÖRTÜK FONKSİYONLAR.....	457
4.1. Açık ve Örtülü Fonksiyonlar.....	457
4.2. İki Değişkenli Örtük Türevler	458
4.3. Örtük Fonksiyon Teoremi.....	459
*4.4. Denge Noktalarının Geometrik Yerinin Eğimi.....	462
*4.5. Talep Fonksiyonlarının Özellikleri	468
*4.6. Keynesyen Modelde Maliye Politikası	471
*4.7. Küçük Açık Ekonomide İktisat Politikaları	475
A. Neo-Klasik Modelde Para ve Maliye Politikaları... 475	
B. Mundell-Fleming Modelinde Para ve Maliye Politikası	477
C. Genel Keynesyen Modelde Para ve Maliye Politikası.....	479
5. BAYAĞI TÜREVSEL DENKLEMLER.....	481
5.1. Fonksiyon Denklemleri ve Fonksiyonel Denklemler.....	482
5.2. Doğrusal Bir Türevsel Denklemin Çözümü.....	483
*5.3. Piyasa İstikrarı	485
5.4. Eşanlı Doğrusal Denklemlerin Çözümü	489
*5.5. IS/LM Modelinin İstikrarı	496
*5.6. Neokeynesyen Modelin İstikrarı.....	498
OKUMA LİSTESİ	502
KAYNAKLAR	503
DİZİN	517

Değişkenlerin Tanımı

Saf fonksiyon veya katsayılar dışındaki tüm simgeler okuyucuya kolaylık sağlamak amacıyla burada tanımlanmaktadır. Simgelerin büyüklükleri, başka şeylerin yanı sıra, stok değişkeni mi yoksa akım değişkeni mi olduklarını da göstermektedir.

- A* – a) para birimleri cinsinden dönem başına ödemeler
 b) mal birimleri cinsinden dönem başına otonom talep
- α – dışsal değişkenler vektörü; $\alpha := (P, w, \pi_0, M_0, T)$ veya $\alpha := (P, w, \pi)$
- B* – parasal nominal tahvil stoku
- C* – mal birimleri cinsinden dönem başına reel tüketim
- c* – tüketim eğilimi, mutlak büyüklük
- C'* – reel marjinal tüketim eğilimi
- c'* – nominal marjinal tüketim eğilimi (mutlak büyüklük)
- D* – a) mal birimleri cinsinden dönem başına reel bütçe açığı
 b) mal birimleri cinsinden dönem başına piyasa talebi
- DB* – döviz bilançosu
- E* – a) para cinsinden dönem başına harcama
 b) para cinsinden dönem başına piyasa fazla talebi
 c) bir değişkenin beklenen değeri
- ε – reel döviz kuru
- e* – a) nominal döviz kuru
 b) etkin ücret modelinde işçinin çaba (efor) verimliliği
- EX* – reel ihracat
- G* – mal birimleri cinsinden dönem başına kamu harcaması
- I* – mal birimleri cinsinden dönem başına reel yatırım talebi
- IM* – reel ithalat

- i – dönem başına nominal faiz oranı, 1'in payı olarak
 K – mal birimleri cinsinden reel sermaye stoku
 KB – sermaye bilançosu
 k – a) nakit denge katsayısı (yani, $1/v$)
 b) rastgele bir katsayı
 L – mal birimleri cinsinden dönem başına reel para talebi
 LB – hizmet bilançosu
 M – para cinsinden nominal para arzı
 m – a) çoğaltan, mutlak büyüklük
 b) M 'nin doğal logaritması
 N – dönem başına çalışılan saat sayısı (istihdam)
 NX – (net ihracat), dış fazla
 n' – marjinal çalışma eğilimi, mutlak büyüklük
 π – para cinsinden dönem başına nominal kar
 P – para cinsinden birim mal başına fiyat düzeyi
 p – P 'nin doğal logaritması
 Q – para cinsinden dönem başına net hasılat
 R – sermayenin marjinal etkenliği (yüzde olarak, dönem başına)
 r – getiri oranı, faiz oranı (i ile aynı anlamda)
 S – a) reel tasarruf (mal birimleri cinsinden dönem başına)
 b) piyasa arzı (mal birimleri cinsinden dönem başına)
 c) bir değişkenin standart sapması
 T – vergi geliri (mal birimleri cinsinden dönem başına)
 τ – işgücü birimi cinsinden nominal ücret maliyetleri
 U – işsizlik oranı
 u_t – stokastik değişken
 v – paranın dolaşım hızı (1'in payı olarak)
 v_t – stokastik değişken

- W – servet, reel varlıklar (mal birimleri cinsinden)
 w – ücret oranı, nominal ücret (işgücü çalışma saati başına para birimi cinsinden)
 ω – reel ücret
 x – mal birimi (mal birimleri cinsinden dönem başına) değişken
 Y – reel gelir, bir ekonominin mal üretimi ile aynı anlamda (mal birimleri cinsinden dönem başına)

Endeksler

- x^A – dış dünyaya ait
 x^d – talep
 x^e – beklenti, beklenen büyüklük
 x_f – firmalar
 x_g – mallar
 x^g – sendika üyeliği endeksi
 x_h – hane halkları
 x^n – nominal büyüklük
 x^s – arz
 x_t – zaman
 x_0 – çıktı büyüklüğü veya denge büyüklüğü (yöntemsel açıdan)
 x^* – denge büyüklüğü (teorik açıdan)
 \bar{x} – tayınlama, miktar kısıtlaması
 \tilde{x} – Clower efektif talebi
 \hat{x} – Dreze efektif talebi
 \dot{x} – zamana göre bir büyüklüğün türevi ($\equiv dx/dt$)



Birinci Kitap: Temeller



Bölüm 1. Yöntem Üzerine Bir İrdeleme

Bu kitap makro iktisat üzerinedir. Ancak, makro iktisatın hakkıyla ele alınabilmesi için bazı temel yönetsel konuların üzerinde durulması kaçınılmazdır; dolayısıyla bu bölümü yöntem konusuna ayıracağız. Bununla birlikte, mümkün olduğu ölçüde özlü olmaya çalışacağız, böylece okuyucu yalnızca, gerçek yaşam için değilse bile, bu kitap açısından önemli olan bazı temel hususlarla tanışmakla yetinecek.

§1 İKTİSADİ TEORİLER

Bir bilim olarak iktisat, kıt malların üretim ve tüketimine katıldıkları kadarıyla, bireylerin, toplumun ve devletin faaliyetleri ile uğraşır. Arzu edilen ama serbestçe elde edilemeyen mallar kıt mallar olarak adlandırılırlar. İlk zamanlardan bu yana insanoglu üç temel nedenden dolayı bu konularla ilgilenmiştir: Birincisi, iktisadi olayları *açıklamak*; ikincisi gelecekteki olayları *öngörmek*, ve üçüncüsü, iktisadi düzeni anlamak ve toplumun gereksinimlerine en iyi karşılık gelen özel politikaları belirlemek, yani ekonomiyi¹ *örgütlemek*. Daha açık bir deyişle açıklama, öngörü ve örgütleme iktisat biliminin üç temel amacını oluşturur.

Bu amaçlara kanıtama ve teori yoluyla ulaşılabilir. *Teori* ile tanımlar, öncüller ve hipotezlerden oluşan bir sistemi kastediyoruz. Çok çeşitli teoriler vardır. Bunlardan bazıları yalnızca bir *sınıflama* verirler: bunlar gerçekliğin önemli bazı yönlerini bir ta-

1 Kavramların kullanımına ilişkin bir açıklama: İngilizcedeki “economy” kavramı olan iktisat, Almandaca “ökonomie” olarak adlandırılır. “Economics” ise ekonomi öğretisi-bilimi olup “ökonmik” kavramı ile adlandırılır. Kavramların kökenlerine bakıldığında Grekçe “oikos (hane halkı)” kavramından türemiştir. “Ökonmik” kavramı da hane halkı öğretisidir.

nımlar sistemine oturturlar. Böyle bir teori “akıl cihazı” hizmetini görür ve gerçekliği katı bir biçimde tasvir etmek için kullanılabilir. Milli Hesaplar Sistemi bu tür teorilerin güzel bir örneğidir.

Bazan *nomolojik* olarak da adlandırılan başka bazı teoriler ise iktisadi olayları yöneten yasaları ortaya koymaya çalışırlar. Bunlar, örneğin, para miktarı ile fiyat düzeyi arasındaki ilişkiyi ifade ederler.

Teoriler, önermeler yapmak amacıyla, değer yargılarına dayandırılabilirler; bu tür teoriler *normatif* olarak adlandırılırken, herhangi bir değer yargısı taşımayan teoriler *pozitif* teoriler olarak adlandırılır. Bu iki tür teorinin birbirinden ayırılması kavramsal olarak kolay olmakla birlikte, uygulamada oldukça zordur. Kısa bir süre sonra göreceğimiz gibi, iktisat teorilerinin çoğu hem normatif hem de pozitif unsurlar içerirler.

Yukarda belirtilen amaçlara ulaşmak için teorilerin gerçekliği karşılık gelmeleri zorunludur. Örneğin, fizikteki

“Ağırlığı olan tüm cisimler yere düşerler”

önermesi ampirik olgulara tam olarak karşılık gelir görünmektedir. Bu gibi yasalar *tümevarım* yoluyla keşfedilebilirler. Tümevarımda, çok sayıda ayrı gözlemden hareketle olasılıkla evrensel olarak geçerli olan bir önermeye ulaşılır. Buradaki sorun, ideal koşullar altında dahi, bu tür önermelerin geçerliliklerinin sadece sonlu sayıda durum için gösterilebilmesidir.² Buna *tümevarım sorunu* adı verilir: Uygulanabilecekleri tüm durumlar için geçerliliklerini göstermemiz olanaksız olduğundan, ampirik önermelerin evrensel geçerlilikleri kanıtlanamaz. Dolayısıyla, birçok bilim için çok önemli olmasına karşın, tümevarım mantıksal anlamda kesin olmaktan uzak sonuçlar verir.³

2 Reel bilimlerde ampirik verilerden oluşur. Örneğin doğa bilimleri ve sosyal bilimlerde. İktisat da bir sosyal bilim olarak bu gruba dahildir. Buna karşılık mantık ve matematik gibi formel bilimlerde maddelere karşılık nesnel tasarımlar.

3 Matematikte, “tam tümevarım yöntemi” ile temelde bir tümdengelim yöntemi tanımlanır ki, bunun aracılığıyla bütün doğal sayılar için yaklaşık bir matematiksel kural kanıtlanabilir.

Böyle olduğundan dolayı ampirik bir yasanın *doğrulanması*, yani evrensel geçerliliğinin gösterilmesi olanaksızdır; ancak, böyle bir yasa, yasayla çelişen en az bir örnek gösterilerek *yanlışlanabilir*. Yere *düşmeyen* bir cisimle karşılaşılsaydı, yukarıda sözü edilen çekim yasası yanlışlanmış olurdu.

Teorisyenler tümevarıma ek olarak *tümdengelimi* de kullanırlar, yani genel bir önermenin geçerliliğinden özel bir önermenin geçerliliğini türetirler. Örneğin, ağırlığı olan tüm cisimlerin yere düştüklerini bildiğimizi varsayalım. Bu durumda aşağıdaki önermeyi kolayca türetebiliriz:

“Bu cisim de yere düşecektir.”

Tümevarım sorunundan başlayarak, bilimin aşağıdaki gibi geliştiği düşünülmüştür:⁴ Teoriler en az bir çelişkili örnek tarafından yanlışlanana kadar kullanılırlar; daha sonra da yerlerini olgulara uygun düşen ve bu anlamda “eski” teorilerden daha genel olan yeni teorilere bırakırlar. *Eleştirel akılcılığın* yaklaşımı böyledir. Dolayısıyla, Karl R. Popper tarafından elli küsur yıl önce geliştirilmiş olan eleştirel akılcılığa göre ampirik yanlışlama bilimde “ilerlemenin ana motoru”dur. Bu yaklaşımın değerli yanları olmakla birlikte, iktisat bilimi açısından eleştirilmesi gereken bazı yönleri de vardır.

Her şeyden önce, iktisatta kontrollü deneyler yapma olanakları son derece sınırlıdır; bu nedenle bir teorinin ampirik gerekçelerle reddedilmesi olağanüstü zordur. İktisadi önermelerin genellikle kesin geçerli yasalar olarak değil de olasılıklı yasalar olarak görülmeleri bu zorluğu daha da pekiştirir. Dolayısıyla, kendileri de hataya tabi olan ampirik gözlemlerin yerleşik teorilerin reddine yol açmaları son derece ender olup, tam aksine yerleşik teoriler oldukça büyük ataletle sahiptirler ve ancak daha üstün yeni teorilerin ortaya çıkmaları halinde gözden düşerler.⁵ İktisatta asla bir “teori-boşluğu” yoktur.

4 POPPER, K. R. (1973) *Forschung*. Logik der Forschung; Tübingen: Mohr

5 KUHN, Th. S. (1981) *The Struktur Wissenschaftlicher Revolutionen*; Frankfurt a. M.: Suhrkamp

Ş2 İKTİSADİ MODELLER

Bir bütün olarak iktisadi olaylar ilk bakışta neredeyse kaotik ve nüfuz edilemez gibi görünür. Neredeyse her iktisatçının ilk izlenimi böyledir. Dolayısıyla, iktisatçı, belli bir olayı analiz etmeye başlamadan önce, bir süre için, gerçekliğin çok basitleştirilmiş bir görüntüsünü geliştirir, yani bir *model* kurar.

Bir model, gerçekliğin, incelenen sorunla ilgili olduğu düşünülen kısımlarını ortaya koymalıdır. Modellerde soyutlama yapılması yerinde olmakla kalmayıp aynı zamanda zorunludur. Soyutlama ve basitleştirme modelin vazgeçilmez işlevleridir. “İyi” bir modelin ekonomiye derin bir bakış sağlaması, varsayımlarının gerçeğe ne ölçüde uyduğundan daha önemlidir.

Bu yaklaşımı yerinde bulmayan okuyucular şu örneğe bakabilirler: Astronomlar ayın dünya etrafındaki hareketini tanımlarlarken hem ayı hem de dünyayı matematiksel anlamda birer küre olarak ele alırlar. Dünyanın ve ayın dağlar ve vadilerle kaplı oldukları göz önüne alınırsa, bu yersiz bir basitleştirme değil midir? Değildir, zira herkesin bildiği gibi, bu model son derece doğru ve sağlıklı sonuçlar vermiştir. Buna rağmen, astronomlar daha da iyi sonuçlar elde etmek için, ilk modelden elde ettikleri bilgileri kullanarak, ikinci adımda modeli daha da geliştirebilirler. İktisatta da aynı şey geçerlidir.

İktisadi bir model tipik olarak aşağıdaki unsurları içerir. İlk olarak, iktisadi kurumlar ile dışsal ve içsel değişkenlere ilişkin *tanımlar* vardır. *Dışsal* değişkenler modelde veri olarak ele alınan, *içsel* değişkenler ise modelde incelenecek olan değişkenlerdir. İkinci olarak *öncüller* (veya *aksiyomlar*), yani modelde doğru oldukları varsayılan ve açıklanmamış ya da kanıtlanmamış önermeler yer alır. Son olarak, olasılıkla bazı sistemli gözlemlerden çıkartılmış olan *ampirik yasalar* vardır.

Daha sonra modelden sonuçlar çıkarılır. Bunlara *teorem*, *sonuç* ya da *çıkarım* adı verilir. Okuyucu model ile teori arasındaki ben-

zerliğe dikkat etmelidir. Modeller teorileri oluşturma araçlarıdır ve bu ikisinin birbirinden kesin olarak ayrılması olanaklı değildir.

§3 YÖNTEMLER

Yöntem ile bilimsel sonuçlar elde etmek için kullanılan özel bir yordamı kastediyoruz. Dolayısıyla yöntem bir analiz tekniği ya da şeylere bir bakış yoludur, örneğin, hem tümevarım hem de tümdengelim birer yöntemdirler; ancak, iktisadi model inşası için, özel olarak tasarlanmış daha özgül yöntemler de vardır. Bunları izleyen paragraflarda ele alacağız.

§4 DENGE VE DENGESİZLİK, İSTİKRAR

İktisatın doğuşundan bu yana, denge kavramı iktisadi düşünce için vazgeçilmez bir kavram olmuştur. Ne yazık ki, böylesine önemli bir kavram bir tek anlamda, hatta en azından baskın bir anlamda bile kullanılmamakta ve bu nedenle de sık sık kafaların karışmasına yol açmaktadır. Her şeye karşın, dengenin önde gelen üç anlamını ayırdedebiliriz.⁶

Yöntemsel anlamdaki denge düşüncesi doğal bilimlerden gelir. Denge bir durgunluk durumu olarak görülür. Parametreleri veri olan bir iktisadi modelin içsel değişkenleri zamanla değişmiyorsa, bu model dengededir. Yöntemsel anlamdaki bu denge düşüncesi iktisada uygun düşer, zira oldukça geneldir ve planların gerçekleştirilmesi gibi özel bazı durumlara atıfta bulunmaz. Bu nedenle hemen hemen evrensel olarak -örneğin tek bir piyasaya, ödemeler dengesine veya iktisadi büyümeye- uygulanabilir.⁷

Teorik anlamda dengeyi mikro iktisat derslerinde görürüz. Bu, ancak ve ancak arzın talebe eşit olması halinde bir ya da daha fazla sayıda piyasanın dengede olacağını öne süren bir denge an-

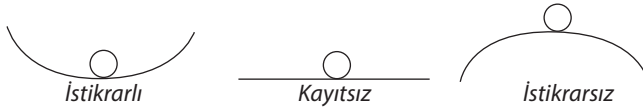
6 Bkz. MEYER, U. (1983) *Neue Makroökonomik*; Berlin: Springer.

7 Büyümedeki denge *dinamiktir* dengedir, zira büyüklükler sürekli bir değişikliğe tabidirler. Yine de, değişim *hızı* sabit kaldığı için, bu bir "hareketsizlik durumudur"

layışdır ve çok daha dar kapsamlıdır; zira arzla talep eşit olmasalar bile bir piyasa durağan durumda olabilir. Bunu daha sonra göstereceğiz. Bu nedenle, arzın talebe eşit olması halini *piyasanın temizlenmesi* olarak adlandırmayı yeğliyoruz. Böyle bir durum ancak yönetsel anlamda “denge” olarak nitelenebilir.

Son olarak, *normatif anlamda denge* kavramı da diğer iki denge yorumu kadar önemli olmuştur. Belli bir anlamda optimal olduğu düşünülen bir durum, genellikle denge olarak adlandırılır; ve okuyucunun deneyimlerinden kolayca çıkarabileceği gibi, politikada “denge” terimi genellikle bu anlamıyla kullanılır. Peki ama bu durumda optimal olmadığı besbelli olan eksik istihdam dengesi için ne diyeceğiz? Görüldüğü gibi, “denge”nin farklı anlamlarının aynı anda kullanılması karışıklığa yol açmaktadır; bu nedenle, “denge” terimini normatif anlamda hiçbir zaman kullanmayacağız.

Dengeler istikrarlı, isikrarsız ya da “kayıtsız” olabilirler. *İstikrarlı* bir dengede, dengenin bozulmasını takiben yeniden dengeye dönülür ve dengeye geri dönüşü sistemin kendi içsel güçleri sağlar. *Kayıtsız bir* dengede bu tür içsel güçler mevcut değildir, ilk dengeye tekrar ulaşılamaz. *İstikrarsız* bir dengede ise içsel güçler denge durumundan giderek artan bir sapmaya yol açarlar.



Şekil 1

Öyleyse, bir dengenin iktisadi olarak anlamlı olabilmesi için *istikrarlı* olması gerektiği sonucunu çıkarabiliriz. İstikrarsız bir dengenin gerçekleşmesi, dengesizliğin gerçekleşmesi kadar olasılık dışıdır (Samuelson’un “yumurtası”nı hatırlayalım).⁸ Yalnızca, iktisadi sistemin zamanla yakınsayacağı ya da ulaştığı istikrarlı bir denge kalıcı bir durum oluşturur.

8 “Sivri ucu üzerinde duran bir yumurtayı kaç kere gördünüz?” SAMUELSON, P. A. (1947). Foundations of Economic Analysis: Cambridge: Harvard University Press.

İstikrarlı dengeler iktisadi analiz için büyük bir öneme sahiptir. Eğer ekonominin “çekim merkezi” olarak istikrarlı bir denge bulamıyorduk iktisadi yasalar ya da gelecekteki gelişmeler hakkında hiçbir şey söyleyemezdik. “Denge analizi”nin, normatif olmayan bir yorumla, uygun gerekçesi budur.

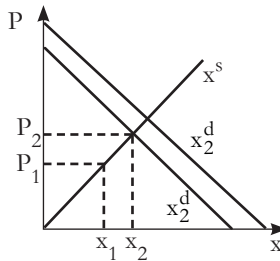
§5 DURAĞANLIK, KARŞILAŞTIRMALI-DURAĞANLIK VE DİNAMİKLİK

Şimdi de iktisat teorisi için büyük önem taşıyan üç analiz tekniği üzerinde duracağız. Bir teori, *zamanın* nasıl ele aldığını bağlı olarak durağan, karşılaştırmalı-durağan ya da dinamik olarak adlandırılabilir.

Durağan analizde tüm değişkenler aynı zaman döneminde- dir. Bunun bir örneği aşağıda, Şekil 2’deki başlangıç eğrilerinde görülmektedir. Arz ve talep eğrilerinin kesişim noktası hem fiyatı hem de miktarı belirlemektedir; sadece tek bir an göz önüne alındığından, açıktır ki, değişkenlere tarih verilmesi gereksizdir.

Karşılaştırmalı durağanlık “eğrilerin kayması” ile ya da daha açık bir deyişle, farklı zamanlarda yer alan değişkenler ile ilgilidir. Yukarıda sözü edilen şekilde, arz eğrisi sabit kalırken talep eğrisi dışa doğru kaymaktadır. Bu durumda fiyat ve miktardaki değişimler analiz edilebilir. Açıktır ki, her ikisi de artmıştır.

Bu tür bir analiz bir uyumlanma süreci olup olmadığı ya da varsa nasıl olduğu gibi sorularla ilgili değildir. Tam tersine, eğrinin kaymasından önce ve sonra piyasanın dengede olduğu



Şekil 2

varsayılır. Dolayısıyla, karşılaştırmalı durağan analiz, teorisyenler için çok büyük değer taşımakla birlikte, bu açıdan eksiktir ve uyumlanma süreci açıklanmak suretiyle desteklenmelidir.

Bu *dinamik analizin* görevidir. Dinamik analizde fiyat p ve miktar x zamanın birer fonksiyonu, $p(t)$ ve $x(t)$, olarak ele alınırlar ve belli bir dönemle sınırlandırılmazlar. Bu durumda basit bir hipotez öne sürülebilir: Fiyat, talep fazlası olduğunda yükselir, arz fazlası olduğunda ise düşer. Bu tür hipotezler, ister sözel ister matematiksel olarak formüle edilmiş olsunlar, uyumlanma sürecinin bir tasvirini verirler. Bunlar sistemin istikrar özelliklerinin analizi için de kullanılabilirler. Dahası, genellikle bir sistemin karşılaştırmalı durağanlık ve dinamik özellikleri arasında sıkı ilişkiler vardır. Samuelson buna *karşılık gelme ilkesi* adını verir.⁹

Bazı okuyucular dinamik analizin karşılaştırmalı-durağan analizden, bunun da durağan analizden daha üstün olduğunu düşünebilirler. Bu doğru değildir. Tam tersine, durağan ve karşılaştırmalı-durağan analizler daha basit olma gibi bir üstünlüğe sahiptirler ve insanlığın düşünme kapasitesinin sınırlı olduğu göz önüne alınırsa sık sık daha verimli sonuçlar verirler. Kısacası her üç tekniğin yeri ayrıdır.¹⁰

Ş6 EX POST VE EX ANTE ANALİZ

İktisatta, özellikle makro iktisatta, birbirinden çok iyi ayrırıldığına rağmen iki yöntem kullanılır. Bunları çok iyi bildiğimiz aşağıdaki denklem aracılığıyla açıklamaya çalışalım:

$$x^s = x^d \quad (1)$$

Belli bir düzeyde, bu “arz eşittir talep” denklemi, “ex post”ün sadece “sonrasında” anlamını taşıdığı bir *ex post* denklem olarak

9 SAMUELSON, P. A. (1947), *Foundations of Economic Analysis*. Second edition, 1983. Cambridge vd.: Harvard University Press.

10 BOULDİNG, K. E. (1971), “Zur Verteidigung der Statik”: in JOCHIMSEN, R. und H. KNOBEL (Hrsg): *Gegenstand und Methoden der Nationalökonomie*; Köln: Kiepenheuer und Witsch.

düşünülebilir. Bu haliyle denklem geçmişte *alışlar* ile *satışların* aynı olduğunu ifade etmektedir ki, bu kaçınılmaz bir olgudur, örneğin, belli bir sürede demir piyasasında bin ton demir satılmış ise bu bin ton demir aynı zamanda kaçınılmaz olarak satın alınmıştır.

Ex ante analiz ise tam tersine, denklem (1)'deki miktarları *planlanmış* alış ve satışlar, yani *talep* ve *arz* olarak görür; dolayısıyla bu ikisinin kesişmesi şart değildir ve yukarıdaki denklem bir *denge koşulu* olarak ele alınmalıdır.

Öyleyse, bir yanda alış ve satış ile öte yanda arz ve talebi birbirinden ayırdetmek zorundayız. İlk ikisi tanım gereği eşitken, son ikisi değildir; dolayısıyla eşitlik koşullarının teorisyen tarafından ortaya konulması gerekir.

Daha genel olarak, *ex post* analiz, nasıl yaratıldıklarını hiç açıklamaksızın, *gözlenen* iktisadi büyüklükler ile ilgilenirken, *ex ante* analiz, gözlenen olayları nihai olarak yaratan iktisadi güçleri üreten *planlanmış* büyüklükler ile ilgilenir. Makro iktisat için her iki yöntem de gereklidir ve okuyucu bu ikisini birbirinden kesin olarak ayırdetmeye çalışmalıdır. Bu hiç de kolay değildir, zira denklem (1)'den de görülebileceği gibi, matematiksel formülasyonlar değişkenlerin *ex post* mu yoksa *ex ante* mi olduklarını göstermezler, dolayısıyla içeriğe bakılması gerekecektir.

§7 KİSMİ VE TOPLAM ANALİZ. CETERIS PARİBUS VARSAYIMI

Piyasa ekonomisinin iktisadi analizi ya bütün piyasaları ya da bir kaç piyasayı kapsayabilir ve buna göre *toplam* ya da *kısmi analiz* olarak adlandırılır. Hemen belirtelim ki, bu ayrım “ilgili etmenlerin hepsinin” mi yoksa bir kısmının mı içerildiği ile ilgili değildir. Böyle yorumlandığında, insan kavrayışı tüm unsurları eşanlı olarak dikkate almaya muktedir olmadığından, bütün teorilerin “kısmi” olarak düşünülmeleri gerekecek ve kısmi-toplam ayrımı ortadan kalkacaktır.

Hem toplam hem de kısmi analizlerde kullanılan, genellikle ünlü “başka her şey aynıyken” deyimini ifade edilen, *ceteris paribus varsayımıdır*. Bu varsayım, teorisyenin bir kısım etmeni sabit tutup diğer bir kısmını değiştirmesine ve böylece bunların etkilerini incelemesine olanak sağlar.

Örneğin, tüketici davranışları teorisinde, tercihler ve fiyatlar sabit tutularak, talebin sadece gelirdeki değişimlerden nasıl etkilendiği araştırılabilir. Daha sonra, fiyatlar da değiştirilerek bunların etkileri de analiz edilebileceğinden, varsayımın “sınırlayıcı” olduğu söylenemez. Hatta en sonunda bu değişik etkiler birleştirilerek, gelir ve fiyatlardaki eşanlı bir değişikliğin sonucu da elde edilebilir.

Bu şekilde düşünüldüğünde, *ceteris paribus* varsayımı iktisatçıların bir “numarası” değil bilimsel keşfin doğal bir aracıdır. Bununla birlikte, şeyleri sabit tutmanın daima meşru olduğunu önerdiğimiz düşünülmesin -çoğu zaman değildir! *Ceteris paribus* sun bazan hatalara neden olan bir yanlış kullanımı vardır. Buna, gerçekte birbirlerinden bağımsız olmadıkları halde, A gibi bir etmenin sabit tutulurken aynı anda B gibi bir etmenin değiştirilmesi yol açar (örneğin, “başka her şey”, yani motorun devir hızı ve momentumu, “aynı kalırken” otomobilin hızının artırılması!). Öyleyse, *ceteris paribus* varsayımı, ancak ilgili etmenler birbirinden bağımsız olarak ele alınabiliyorsa meşru olacaktır.¹¹

§8 MİKRO İKTİSAT VE MAKRO İKTİSAT

Halen geçerli olan görüşe (!) göre, mikro iktisat ve makro iktisat birbirinden aşağıdaki gibi ayrılabilir.

Mikro iktisat bireysel iktisadi faaliyet biriminden yola çıkar. Bu tür birimlerin tümü de çeşitli kararlar vermek zorundadırlar;

11 Matematikte, *ceteris paribus* varsayımı ile kısmi türevlerin hesaplanmasında karşılaşırız. Buradaki olası kötü kullanım açıktır: $z = f(x, y)$ fonksiyonunda $\partial z(x, y) / \partial x$ kısmi türevi, ancak x ve y 'nin birbirlerinden bağımsız olmaları koşulu altında, x 'teki değişikliğin z 'de yol açtığı değişikliği verir.