



โรเบิร์ต อี ลูคัส จูเนียร์

Robert E. Lucas, Jr. ,1937 -

บิดาแห่งทฤษฎีเศรษฐศาสตร์มหภาคร่วมสมัย
เจ้าของรางวัลโนเบล ปี 1995

เรียบเรียงโดย... ดร.วิชุดา วาณิชเจริญธรรม
(Ph.D. - Economics, University of Chicago)

โรเบิร์ต อี ลูคัส จูเนียร์ เป็นนักเศรษฐศาสตร์ที่มีบทบาทสูงมากที่สุดคนหนึ่งในด้านการวิจัยเกี่ยวกับเศรษฐกิจมหภาคมาตั้งแต่ปี 1970 โดยเขาเน้นการศึกษาวิจัยในเรื่องภาวะผันผวนของการผลิต การจ้างงานและภาวะเงินเฟ้อ ผลการวิเคราะห์ของเขาในรูปแบบของแบบจำลอง General Equilibrium Model ทำให้เกิดความเข้าใจในพลวัตรของระบบเศรษฐกิจมหภาคและนโยบายเศรษฐกิจอย่างลึกซึ้งมากขึ้น นอกจากนี้ เขายังมีผลงานวิจัยหลากหลายที่เกี่ยวกับการเงิน นโยบายการคลัง เศรษฐศาสตร์การเงิน การค้าระหว่างประเทศ และทฤษฎีการเติบโตทางเศรษฐกิจ โดยเฉพาะการพัฒนาและการประยุกต์ใช้ทฤษฎี "การคาดคะเนอย่างสมเหตุสมผล" (Rational Expectations) ทำให้เขาได้รับรางวัลโนเบลสาขาเศรษฐศาสตร์ในปี ค.ศ.1995 และได้รับการยกย่องว่าเป็นบิดาแห่งทฤษฎีเศรษฐศาสตร์มหภาคร่วมสมัยที่มีอิทธิพลทางความคิดแก่นักเศรษฐศาสตร์รุ่นใหม่จนถึงปัจจุบัน

ประวัติชีวิตและการทำงาน

โรเบิร์ต อี ลูคัส จูเนียร์ เกิดเมื่อปี 1937 ที่ เมืองยาκιมา (Yakima) รัฐวอชิงตัน ในยุคสมัยนั้น เศรษฐกิจของประเทศสหรัฐฯ ยังไม่ฟื้นตัวนักจากภาวะเศรษฐกิจตกต่ำรุนแรง เรื่องของปัญหาเศรษฐกิจ จึงกลายเป็นหัวข้อสนทนาบนโต๊ะอาหารของครอบครัวอยู่เป็นนิตย์ และได้มีส่วนปลุกฝังความสนใจในวิชาเศรษฐศาสตร์ให้กับลูคัสในเวลาต่อมา

อย่างไรก็ดี ภายหลังจากจบการศึกษาในระดับไฮสคูลที่โรงเรียน Roosevelt เส้นทางการศึกษาต่อในระดับมหาวิทยาลัยของโรเบิร์ต ลูคัสกลับมีจุดเริ่มต้นที่คณะ

เศรษฐศาสตร์หากแต่เป็นคนะประวัติศาสตร์ของมหาวิทยาลัยชิคาโก

ภายหลังจากที่เขาสำเร็จการศึกษาในระดับปริญญาตรี ลูคัสได้รับทุน Woodrow Wilson Fellowship สำหรับการเรียนต่อในระดับดุษฎีบัณฑิต สาขาประวัติศาสตร์ ณ มหาวิทยาลัยแคลิฟอร์เนีย วิทยาเขตเบิร์คลีย์ ในเบื้องต้นนั้นเขามีความสนใจศึกษาในเรื่องประวัติศาสตร์ในยุคโบราณ และยุคกลาง แต่เนื่องจากการศึกษาในแขนงดังกล่าวจำเป็นต้องมีความชำนาญในภาษาต่างประเทศถึง 5 ภาษาด้วยกัน ทำให้ลูคัสตัดสินใจลงเรียนวิชาสัมมนาว่าด้วยประวัติศาสตร์ประเทศอังกฤษแทน โดยเขาสนใจศึกษาวิจัยเกี่ยวกับวัฏจักรธุรกิจของประเทศอังกฤษในทศวรรษที่ 19 ลูคัสได้พบว่า หากจะเข้าใจถึงประวัติศาสตร์เศรษฐกิจให้ถ่องแท้ นั้น จำเป็นต้องมีความรู้ด้านเศรษฐศาสตร์ในมิติที่ลุ่มลึกเกินกว่าที่เขาได้จากการเรียนในระดับปริญญาตรี โดยเฉพาะอย่างยิ่งความรู้ในด้านทฤษฎีขั้นสูง จุดนี้เองทำให้ลูคัสเบนเข็มการศึกษาตัดสินใจย้ายมาเข้าเรียนในโครงการปริญญาเอก สาขาเศรษฐศาสตร์ ที่มหาวิทยาลัยชิคาโกแทน

เขาได้รับปริญญาดุษฎีบัณฑิตจากมหาวิทยาลัยชิคาโกในปี 1964 และได้เริ่มต้นอาชีพนักวิชาการเศรษฐศาสตร์ในตำแหน่งผู้ช่วยศาสตราจารย์ ณ มหาวิทยาลัยคาร์เนกี เมลลอน (Carnegie - Mellon University) ลูคัสได้ทำงานในตำแหน่งรองศาสตราจารย์ และศาสตราจารย์ด้านเศรษฐศาสตร์ที่นี้จวบจนปี 1975 ที่เขาได้ย้ายมายังมหาวิทยาลัยชิคาโก สถาบันการศึกษาชั้นนำของโลกที่เขามีความผูกพันมาตลอดชีวิต

ผลงานเขียนที่สำคัญ

งานวิจัยที่สำคัญๆ ของศาสตราจารย์ลูคัส ได้แก่ “Expectations and the neutrality of money” (ตีพิมพ์ในวารสาร Journal of Economic Theory ปี 1972) “Econometric policy evaluation: A critique” (ตีพิมพ์ในหนังสือ The Phillips curve and labor markets ปี 1976) “Asset prices in an exchange economy” (ตีพิมพ์ในวารสาร Econometrica ปี 1978) “Interest rates and currency prices in a two-currency world” (ตีพิมพ์ในวารสาร Journal of Monetary Economics ปี 1982) “On the mechanics of economic development” (ตีพิมพ์ในวารสาร Journal of Monetary Economics ปี 1988) รวมทั้งงานวิจัยร่วมกับนักเศรษฐศาสตร์ท่านอื่นๆ อาทิ “Real wages, employment, and inflation” (ร่วมกับ ศาสตราจารย์ Leonard Rapping ตีพิมพ์ในวารสาร Journal of Political Economy ปี 1969) “Investment under uncertainty” (เขียนร่วมกับ ศาสตราจารย์ Edward Prescott ตีพิมพ์ในวารสาร Econometrica ปี 1971)

The Royal Swedish Academy of Science ได้ประกาศชื่อของศาสตราจารย์ลูคัส เป็นผู้ได้รับรางวัลโนเบลสาขาเศรษฐศาสตร์ในปี ค.ศ.1995 สำหรับผลงานทางวิชาการที่ท่านได้พัฒนาและประยุกต์สมมติฐานของ “การคาดคะเนอย่างสมเหตุสมผล” (Rational Expectation) ซึ่งส่งผลให้เกิดการเปลี่ยนแปลงแนววิเคราะห์ทางเศรษฐศาสตร์มหภาค และช่วยให้เรามีความเข้าใจที่ลึกซึ้งขึ้นเกี่ยวกับการดำเนินนโยบายเศรษฐกิจ

แนวคิดทางเศรษฐศาสตร์

เมื่อสามสิบปีก่อนหน้านี้ การวิเคราะห์เชิงทฤษฎีเศรษฐศาสตร์มหภาค มักสมมุติว่า หน่วยเศรษฐกิจสร้างการคาดคะเนโดยอิงกับอดีต และปรับเปลี่ยนไม่ทันกับข้อมูลข่าวสารใหม่ๆ การคาดคะเนลักษณะนี้มีชื่อเรียกว่า Adaptive expectation การใช้ข้อสมมุติดังกล่าวในเศรษฐศาสตร์มหภาคทำให้นักวิชาการในยุคนั้นเชื่อว่าแรงงานจะปรับเปลี่ยนการคาดคะเนเกี่ยวกับปัจจัยด้านเศรษฐกิจมหภาค (อาทิ อัตราเงินเฟ้อหรือนโยบายสาธารณะ) อย่างล่าช้า ดังนั้นการใช้นโยบายการเงินเพื่อกระตุ้นเศรษฐกิจ แม้จะทำให้เกิดเงินเฟ้อที่สูงขึ้น แต่ในเมื่อแรงงานยังไม่ปรับเปลี่ยนค่าคาดคะเนของอัตราเงินเฟ้อ แรงงานยังคงยินดีทำงาน ณ ระดับค่าจ้างเดิม และไม่เรียกร้อง

ค่าแรงที่สูงขึ้น การใช้นโยบายดังกล่าวจึงส่งผลให้เกิดการจ้างงานที่เพิ่มขึ้น และสามารถกระตุ้นเศรษฐกิจได้ นักเศรษฐศาสตร์ในยุคสมัยนั้นเชื่อว่าอัตราเงินเฟ้อกับการจ้างงานมีความสัมพันธ์ในทางตรงกันข้าม และมักใช้ความสัมพันธ์นี้ ในการกำหนดนโยบายเศรษฐกิจ

ลูคัสแสดงให้เห็นว่า หากแรงงานมีการคาดคะเนที่สมเหตุสมผลแล้ว การกระตุ้นเศรษฐกิจด้วยวิธีการดังกล่าวอาจไม่สัมฤทธิ์ผลดังที่ระบุไว้ในย่อหน้าก่อนได้ กล่าวคือเมื่อแรงงานใช้ข้อมูลที่ปรากฏในปัจจุบัน (ซึ่งรวมถึง สารสนเทศเกี่ยวกับการดำเนินนโยบายเศรษฐกิจของรัฐบาล) มาใช้ประมวลผลเพื่อสร้างค่าคาดคะเนเกี่ยวกับอัตราเงินเฟ้อ ทั้งในปัจจุบัน และอนาคตแล้ว แรงงานจะปรับการคาดคะเนได้ถูกต้องกว่าแบบ Adaptive expectation และจะเรียกร้องค่าแรงที่สูงขึ้นทันทีที่ได้รับข่าวสารว่า รัฐบาลใช้นโยบายการเงินเพื่อกระตุ้นเศรษฐกิจ การตอบสนองต่อข่าวสารในลักษณะดังกล่าว ทำให้การจ้างงานไม่เพิ่มขึ้นกว่าเดิม และนโยบายกระตุ้นเศรษฐกิจก็จะไม่บรรลุเป้าหมายตามที่ตั้งไว้ด้วย

ชุดคำอธิบายภายใต้ข้อสมมุติของการคาดคะเนที่สมเหตุสมผล สอดคล้องกับปรากฏการณ์ Stagflation ที่ประเทศสหรัฐฯ เผชิญกับปัญหาอัตราการว่างงานที่สูงขึ้นพร้อมๆ กับอัตราเงินเฟ้อในช่วงต้นทศวรรษที่ 70 เป็นอย่างดี งานวิจัยของลูคัสทำให้ทั้งธนาคารกลางและรัฐบาลปรับมุมมองของการใช้นโยบายการเงินใหม่ เพราะได้ตระหนักว่า การ Trade-off ระหว่างอัตราการว่างงานกับอัตราเงินเฟ้อนั้น มิได้มีให้ใช้ประโยชน์ในระยะยาว

ลูคัสแสดงผลการวิเคราะห์ของเขาในรูปแบบของแบบจำลอง (General Equilibrium Model) ที่เป็นเสมือนตัวแทนระบบเศรษฐกิจมหภาค โดยลูคัสแสดงให้เห็นพลวัตของระบบเศรษฐกิจ ภายใต้ข่าวสารข้อมูลที่ไม่สมบูรณ์ นวัตกรรมนี้ยังคงเป็นแนวทางที่นักเศรษฐศาสตร์มหภาคใช้วิเคราะห์ปัญหาที่จับจวนถึงทุกวันนี้ อิทธิพลของ ศาสตราจารย์ โรเบิร์ต ลูคัส ต่อนักเศรษฐศาสตร์มหภาคในยุคสมัยนี้ เทียบได้กับสิ่งที่เคยเกิดขึ้นมาแล้วในยุคสมัยของ จอห์น เมย์นาร์ด เคนส์ และ มิลตัน ฟรีดแมน คำยกย่องที่ลูคัสได้รับในฐานะของ “บิดาของทฤษฎีเศรษฐศาสตร์ร่วมสมัย” นั้นจึงมิใช่สิ่งที่เกินเลยจากความเป็นจริงแต่อย่างใด

