

ECONOMETRIA BIBLICA

«En un principio había la nada. Y como la nada era muy poca cosa, Dios decidió hacer algo. Tomando barro con sus manos modeló a Gauss, y por medio de un soplo le infundió vida. Aprovechando un sueño le extrajo una costilla y con ella creó a Markov.

Y una vez los hubo creado se les apareció con todo su esplendor y se dirigió a ellos con estas palabras: *En verdad, en verdad os digo que las relaciones económicas son de tipo estocástico y que la parte aleatoria es normal y homoscedástica. Id, pues, por el mundo y predicad la buena nueva.*

Gauss-Markov, junto con Fisher, otro hijo predilecto del Creador, cumplieron el mandato que les había sido encomendado, maximizando cuantas funciones de verosimilitud encontraron en su camino.

Y el Señor contempló la obra de su Creación y viendo que era útil se decidió a completarla. Para ello eligió a Keynes, el mayor de los profetas, y por medio de un sueño se dirigió a él con estas palabras: *En verdad, en verdad te digo que el consumo depende de la renta y que la propensión marginal a consumir está situada entre cero y la unidad. Ve, pues, por el mundo y predica la buena nueva.*

Y Keynes cumplió el mandato que le había sido encomendado, agrupando a su alrededor un conjunto de discípulos predilectos que se denominaron keynesianos. Ello, empero, no era suficiente. Y Dios se valió de Haavelmo para que éste, a su vez, prestara su colaboración a los keynesianos y juntos completasen la obra de la Creación.

Pero el corazón de los hombres es orgulloso y Klein, en otro tiempo uno de los discípulos predilectos del Señor, no reconociendo sus limitaciones, quiso asemejarse a Dios. Para ello, contando con la colaboración de un conjunto de fieles seguidores, construyó modelos que tratasen de explicar la totalidad de la Creación, desoyendo cuantas advertencias la Providencia le enviaba en forma de fracasos predictivos.

Y el Señor, viendo la soberbia de su discípulo, se decidió a castigarlo. Para ello se valió de Box, un ángel malvado, que junto con Jenkins, se confabularon e introdujeron una gran cantidad de ruido en la obra de la Creación.

A partir de entonces los hombres se expresaron en distintas lenguas. Mientras que unos hablaban de variables endógenas y exógenas, de perturbaciones aleatorias, de independencia y de estadísticos de Durbin-Watson, los otros hablaban de outputs e inputs, de ruidos, de ruidos blancos, de correlogramas, de estadísticos de Box-Pierce y de espectros.

Pero Dios, al comprobar la confusión y desolación producida se apiadó de los hombres. Y valiéndose de Zellner y Palm, hombres justos y discípulos predilectos, les encomendó el siguiente mandato: *Construid modelos SEMTSA y en ellos dad cabida a todo lo que haya de bueno en la creación, siendo en todo momento respetuosos con el principio de la parametrización escueta y sin atreveros a transgredir más este nuevo precepto que yo os impongo. Abrandad, pues, vuestros corazones, reconoced vuestra ignorancia e id por el mundo y predicad la buena nueva.*

Zeller y Palm cumplieron el mandato que les había sido encomendado. Y de esta forma los hombres comprendieron sus limitaciones y supieron apreciar la grandeza del Señor y la complejidad de la Creación, al ser conscientes de que los designios de la Providencia son en parte inescrutables y que la mente de los hombres jamás podrá aspirar conocerlos en toda su extensión.»