

Een wetteloze markt?

De stand van zaken in de arbeidseconomie lijkt soms op die in de sterrenkunde voordat het inzicht doorbrak dat de aarde om de zon draait. Wanneer komt de grote doorbraak?

De gouden jaren

Er was een tijd dat de Nederlandse arbeidsmarkt even opwindend was als een doorsnee commando-economie in Oost-Europa. Dat was de tijd dat de jaarlijkse loonstijging bepaald werd in de achtertuin van de Tilburgse hoogleraar D.B.J. Schouten in Oisterwijk¹. In de toen zeer invloedrijke overlegorganen als de Sociaal-Economische Raad en de Stichting van de Arbeid kwam er wel eens iets achter de komma bij, maar de consensus over de werking van de economie en de gewenste richting van de economische ontwikkeling zorgden ervoor, dat de uitkomst nooit veel afweek van het uitgangspunt. In die tijd was empirisch onderzoek naar de arbeidsmarkt eenvoudig. Het was voldoende de huiselijke omstandigheden van de kleine groep deelnemers aan het georganiseerde overleg te bestuderen. Natuurlijk er was af en toe wat werkloosheid of de vraag naar arbeid leek soms het aanbod te overtreffen, maar dat waren slechts signalen dat de macro-economische finafstemming even haperde.

Op de universiteit kregen de studenten het vak micro-economie. Daarin werd hun verteld, dat het loon gelijk was aan de bijdrage van de laatste werknemer aan de opbrengst. In de wereld van de micro-economie verschildte de arbeidsmarkt in niets van de markt voor snijbloemen. Vraag en aanbod ontmoetten elkaar op een markt, waar deze grootheden op mysterieuze wijze in overeenstemming gebracht werden. Werkloosheid en vacatures hoorden natuurlijk niet thuis in die wereld en werden dan ook bij een ander vak bestudeerd: de macro-economie. Macro-economen beschikten over een superieur inzicht in de diepste roerselen van de werknemer en verklaarden na introspectie de werkloosheid uit gebrekkige rekenvaardigheid. Dergelijke diepe in-

zichten nodigden niet uit tot empirisch onderzoek en zo kon het gebeuren, dat de kennis van de 'reëel bestaande' arbeidsmarkt nauwelijks groeide.

De verwarring

'Als iemand kennis vermeerdert, vermeerdert hij smart'². De Joodse notabel die onder de naam Prediker de ijdelheid van het menselijk bestaan verkondigde, was een goede observator van de arbeidsmarkt. Zo beschrijft hij de schaalvoordelen van een gezamenlijk gevoerde huishouding³ en kan derhalve aangemerkt worden als de geestelijke vader van de voordeurdelersregeling. Hij had ook een diep inzicht in het optimale gedrag onder onzekerheid⁴. Maar zijn belangrijkste bijdrage is toch het inzicht, dat de werkelijkheid zich zelden naar de theorie gedraagt. Hij zou daarom niet verbaasd zijn geweest, dat de theorieën van de micro- en macro-economen niet in overeenstemming waren met een aantal elementaire observaties.

Het begon met de werkloosheid. Achter het werkloosheidspercentage bleek een fascinerende werkelijkheid schuil te gaan. Anders dan de in de predestinatieleer doorknede Nederlanders veronderstelden, bleek dat niet steeds dezelfde personen werkloos waren⁵. Na 1 jaar was 80% van de nieuwe werklozen weer aan het werk. Deze observatie leidde tot een Copernicaanse omwenteling in de manier waarop economen naar de arbeidsmarkt kijken: in plaats van een Aalsmeerse veiling waar vraag en aanbod elkaar 'rustig' kunnen bekijken, kwam het beeld van een drukke oosterse markt, waarop het niet zo eenvoudig is de gewenste waar te vinden en de prijsvorming onduidelijk is. Op zo'n oosterse markt waar ook nog onderhandeld moet worden over de prijs, hoeft een van de heilige wet-

ten van de economie, de wet van gelijke prijs voor identieke waar, niet op te gaan. En inderdaad zijn er op de arbeidsmarkt vele afwijkingen gevonden. Ook de lezers van *ESB* zijn hiervan op de hoogte gebracht. Onderzoek van Van Praag en Oosterbeek en van Hartog, Van Opstal en Teulings repliceert afwijkingen die ook in andere landen gevonden zijn: hogere beloning van vergelijkbare werknemers in grote bedrijven en verschillende beloning van vergelijkbare werknemers in verschillende bedrijfstakken⁶. Bij de verklaring van deze anomalieën tonen economen een grote creativiteit. Een probleem is, dat iedere anomalie zijn eigen verklaring krijgt en dat het idee ontstaat dat de arbeidseconomie een vak is van ontoetsbare ad hoc theorieën. Het ontbreken van een theorie is een teken van verwarring. De stand van zaken in de arbeidseconomie lijkt soms op die in de sterrenkunde voordat het inzicht doorbrak dat de aarde om de zon draait. De toenmalige sterrenkundigen waren meesters in het verzinnen van ad hoc verklaringen voor afwijkingen in planeetbanen.

De wet van één prijs wordt nog onhoudbaar door de observatie dat, zelfs als we met de genoemde anomalieën rekening houden, het loon van vergelijkbare werknemers sterk varieert. In het jargon van de regressierekening: de R^2 is ongeveer .7 als we de werknemers op een groot aantal kenmerken vergelijkbaar maken. Beeldender is de observatie, dat 1 standaarddeviatie van de onverklaar-

1. Ik weet dat van mijn vader die bijna zijn gehele werkzame leven aan de SER verbonden was en vele genoeglijke uren in die tuin doorgebracht heeft. Zie *Het Advies Dat Nooit Werd Gepubliceerd*, SER, 1983.

2. Prediker 1:18

3. Prediker 4:7-12

4. Prediker 11:1-6

5. De sterke doorstroming in het werklozenbestand werd het eerst opgemerkt in de VS, zie bij voorbeeld K. Clark en L. Summers, *Labor Market Dynamics and Unemployment: a reconsideration*, Brookings Papers on Economic Activity, 1979, blz. 13-60. De oratie van J.C. van Ours, *Werkloosheid tussen moedwil en misverstand*, geeft een overzicht voor Nederland.

6. J. Hartog, R. van Opstal en C.N. Teulings, *Loonvorming in Nederland en de Verenigde Staten*, *ESB*, 1994, blz. 528-533 en C.M. van Praag en H. Oosterbeek, *Anomalie: grotere bedrijven betalen hogere lonen*, *ESB*, 1993, blz. 764-768.

de variatie in het loon correspondeert met een verschil van 20%⁷. Het loon is dus allerm minst gepredestineerd door de kenmerken van de werknemer.

Omvattende theorieën die de anomalieën kunnen verklaren zijn er nog niet. Er zijn aanzetten tot theorieën en die hebben dezelfde ingrediënten. Deze zijn: de deelnemers op de arbeidsmarkt hebben beperkte en vaak verschillende informatie, als gevolg van die beperkte kennis zijn de deelnemers onzeker over de uitkomst van hun acties, de uitkomst wordt mede bepaald door de interactie van de deelnemers, bij voorbeeld door onderhandeling. In deze theorieën zijn banen contracten tussen werknemers en werkgevers. Arbeid is dus geheel andere waar dan snijbloemen.

Niet alleen achter de geaggregeerde werkloosheid maar ook achter de geaggregeerde werkgelegenheid gaat veel beweging schuil. De aggregaten suggereren een trage aanpassing aan langzaam veranderende omstandigheden. Onderzoek naar individuele ondernemingen laat een geheel ander beeld zien. Individuele bedrijven kennen een grillig verloop van de werkgelegenheid⁸. Nog opmerkelijker is dat in de VS binnen bedrijfstakken per jaar ongeveer 10% van de banen verdwijnt en eenzelfde percentage banen gecreëerd wordt⁹. Dus in vergelijkbare bedrijven worden in hetzelfde jaar banen gecreëerd en vernietigd. Opmerkelijk is dat de resultaten in Europese landen niet veel afwijken. Het idee dat er nooit een baan vrijkomt is dus in strijd met de werkelijkheid. De traditionele theorie van de arbeidsvraag door ondernemingen heeft geen verklaring voor dit verschijnsel.

De conclusie is duidelijk: beter meten heeft geleid tot minder weten. Gegevens over het gedrag van individuele deelnemers hebben de arbeidseconomen in verwarring gebracht. En er is een nieuwe golf van verwarrende feiten op komst. Gegevens over bedrijven worden gekoppeld aan gegevens over werknemers. Dit stelt economen in staat de loopbaan van individuele werknemers te bekijken in samenhang met de lotgevallen van de onderneming.

Wat zijn wetten?

Het begrip anomalie veronderstelt dat er wetten zijn. Het voorgaande

heeft duidelijk gemaakt, dat in de arbeidseconomie de theorievorming achter de feiten aanholt. Dat maakt de omgekeerde weg, uit de feiten wetten afleiden, aantrekkelijk. Macro-econometrist(en) schatten al een halve eeuw macro-modellen die gezien kunnen worden als een verzameling uit gegevens afgeleide wetten. De oude vraag of de geschatte relaties wel echte causale wetten zijn of slechts correlaties wordt daarbij snel onder het tapijt geveegd.

De arbeidseconomen en hun methodici, de micro-econometristen, volgden dit spoor. Zij stuitten echter al snel op het probleem dat met de gegevens waarover zij beschikten, verschillende schattingen van dezelfde grootte gemaakt konden worden met sterk verschillende uitkomsten¹⁰. Hoe te kiezen tussen deze verschillende uitkomsten?

Een aantal onderzoekers kwam tot de conclusie dat het probleem de verwarring van correlatie met causaliteit was en dat de gangbare econometrische aanpak om correlatie en causaliteit te onderscheiden vaak niet werkte. Om een voorbeeld te geven: een econoom kan de prijsgevoeligheid van de vraag naar een goed niet direct afleiden uit de correlatie tussen de prijs en de verhandelde hoeveelheid. Het aanbod en de prijsgevoeligheid daarvan speelt ook een rol. Een verwant probleem doet zich voor bij het onderzoek naar de invloed van immigratie op de lokale arbeidsmarkt. Een eenvoudige correlatie tussen het lokale werkloosheidspercentage en de instroom van immigranten meet het effect alleen, als we veronderstellen dat de immigranten volstrekt onwetend zijn over de werkloosheid of zich er niets van aantrekken. Wat in beide voorbeelden nodig is, is een soort experiment. Stel dat iemand het aanbod van het goed of de instroom van immigranten manipuleert en dat doet om redenen die niets met de prijs of de lokale werkloosheid te maken hebben. Met zo'n experiment kunnen we een 'schone' schatting van het effect krijgen, een schatting die niet vertekend is door de altijd aanwezige terugkoppeling in de economie.

Dit inzicht heeft geleid tot een herbezinning op empirische methoden in de arbeidseconomie. Er is een kleine industrie ontstaan die zoekt naar 'natuurlijke experimenten'. Een mooi voorbeeld is het onderzoek naar de

gevolgen van de massale immigratie van Cubanen vanuit de Cubaanse havenstad Mariel. Deze immigranten hadden niet veel keus bij hun bestemming: Miami. Het moment van hun vertrek was bepaald door een aftakende dictator. Het resultaat was een exogene toename van het arbeidsaanbod in Miami van 7%. De opmerkelijke conclusie van dit 'experiment' was dat het effect op de arbeidsmarktpositie van de niet-Cubaanse bevolking gering was¹¹. Het onderzoek van Card en Krueger naar het effect van het minimumloon op de werkgelegenheid maakt gebruik van een zelfde methode¹².

Wetteloos?

De arbeidseconomie is vanouds een empirisch vak. Arbeidseconomen hebben veel energie gestoken in het verzamelen van gegevens, die inzicht geven in het gedrag van individuele participanten op de arbeidsmarkt. Dat de theorievorming achterloopt bij de waarneming is een gezonde situatie. Dit illustreert slechts het primaat van de empirie en het ontbreken van theoretische vooroordelen. Het is wel wenselijk dat het gat tussen de theorie en de empirie kleiner wordt. De tijd dat de arbeidseconoom van zijn of haar welverdiende rust kan genieten is nog lang niet aangebroken.

Geert Ridder

De auteur is hoogleraar bij de vakgroep Econometrie van de Economische faculteit van de Vrije Universiteit te Amsterdam.

7. C.N. Teulings, mondelinge informatie.

8. D. Hamermesh, Labor demand and the structure of adjustment costs, *American Economic Review*, 1989, blz 674-689.

9. S.J. Davis en J. Haltiwanger, Gross Job creation, gross job destruction, and employment reallocation, *Quarterly Journal of Economics*, 1992, blz. 819-863.

10. Zie b.v. T.A. Mroz, The sensitivity of an empirical model of married women's hours of work to economic and statistical assumptions, *Econometrica*, blz. 765-801.

11. D. Card. The impact of the Mariel Boatlift on the Miami Labor Market, *Industrial and Labor Relations Review*, 1990, blz. 245-257. Dit is geen unieke observatie. De Israëlische arbeidsmarkt heeft de Joodse immigranten uit Rusland betrekkelijk gemakkelijk geabsorbeerd. De relatieve groei van het arbeidsaanbod in Israël was ongeveer even groot.

12. C.N. Teulings, Hoger minimumloon: meer werkgelegenheid, *ESB*, 1994, blz. 1112.