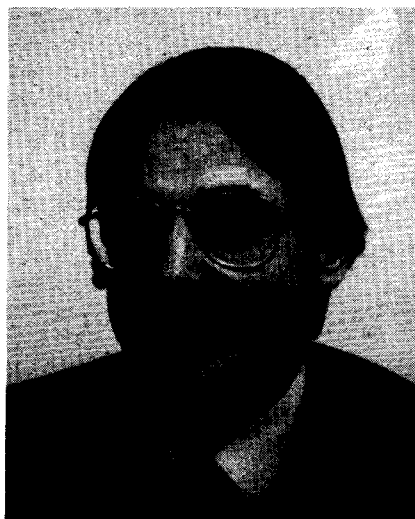


## Ter heroverweging: macromodellen

Ons land barst van de twijfel over de mogelijkheden om de sociaal-economische omstandigheden naar de hand te zetten. Nog groter is de verwarring over de manier waarop dat zou moeten gebeuren. Er is geen sprake van vertrouwen in de uitkomsten van de traditionele middelen van beleidsvoorbereiding: de macromodellen van het CPB. Integendeel, de kritiek op deze modellen neemt nog voortdurend toe. Er gaat vrijwel geen maand voorbij of de relevantie en betrouwbaarheid van deze modellen worden ter discussie gesteld. Afgelopen maand was het Bomhoffs beurt 1). Hij laat geen spaan heel van het nut dat beleidsvoorbereiding zou kunnen ontleen aan macromodellen (grote econometrische macromodellen althans). Tenminste niet waar het gaat over koerswijzigingen in het sociaal-economisch beleid. En voor de mug van een extrapolatief beleid hebben we het kanon van deze modellen niet nodig.

Bomhoffs uitspraak verdient m.i. alle aandacht. Vanuit het werkgelegenheidsbeleid zal ik zijn uitspraak verder onderbouwen. De grote macromodellen leiden eerder tot een vertroebeling van de inzichten in alternatieve beleidskoersen, dan tot verheldering. Daaruit volgen vragen over de institutionele rol van het CPB: de belichaming van de bijdrage van modellen aan de beleidsvoorbereiding.

Er zijn minstens twee belangrijke redenen om het nut van grote rekenmodellen voor de voorbereiding van het werkgelegenheidsbeleid te betwijfelen. Het betreft de in modellen veronderstelde omkeerbaarheid van economische processen en de mate waarin rekening gehouden wordt met sociale kosten. In de regel wordt er van uitgegaan in economische modellen dat economische processen omkeerbaar zijn. In zo'n model zal de invloed van loonmatiging dezelfde zijn als van loonstijging, zij het dat het teken van de invloed verschilt. Ook zal terugdringing van het financieringstekort een zelfde, zij het in teken tegengestelde, invloed hebben op de vector die de toestand van de economie beschrijft, als vergroting van het financieringstekort. De voorbeelden van loonmatiging en terugdringing van het financieringstekort zijn natuurlijk niet willekeurig. Het zijn allebei belangrijke elementen van de door dit kabinet uitgezette beleidslijnen voor de bevordering van de werkgelegenheid. In geval de ver-



onderstelde omkeerbaarheid van economische processen in de praktijk niet opgaat, heeft de beleidsvoorbereiding weinig aan een model.

Onomkeerbaarheid of beperkte omkeerbaarheid in economische processen vindt steun in een analoge redenering. In de economische literatuur worden thermodynamische processen algemeen geaccepteerd als een bruikbaar analogon voor economische processen. Nu zegt de tweede wet van de thermodynamica dat het effect van toevoeging van warmte aan een proces alleen dan gelijk is (maar in teken tegengesteld) aan dat van vermindering van warmte, als de omstandigheden waaronder warmte wordt toegevoerd exact dezelfde zijn.

De tweede wet, vertaald naar de economie, houdt in feite in dat er van volledige omkeerbaarheid geen sprake kan zijn. Daarmee komen modeluitkomsten van beleidslijnen als loonmatiging en terugdringing van het financieringstekort op losse schroeven te staan. In de gehanteerde modellen wordt er immers vanuit gegaan dat het effect van bij voorbeeld loonmatiging hetzelfde is als van loonstijging, zij het met een tegengesteld teken voor de vector van de economische toestand.

Omdat loonmatiging nu al voor een reeks van jaren als instrument is gehanteerd, biedt deze beleidsvorm de mogelijkheid voor evaluatie op de reversibiliteitsveronderstelling. De beschikbare cijfers geven aan dat Nederland het enige land van de drie landen Nederland, België en Duitsland is, waar de reële loonvoet in bedrijven in de periode 1979-1981 daalde. Het is ook het enige land (van de drie) waarin in dezelfde periode het volume van de bedrijfsinvesteringen (exclusief woningen) daalde. Daarmee heb ik niet de pretentie iets bewezen te hebben. Maar er doet zich wel een duidelijke suggestie uit voor. Ingrijpende loonmatiging (met daling van de reële loonvoet) zou wel eens minder positief voor de werkgelegenheid kunnen zijn, dan de vanuit reversibiliteit werkende modellen ons doen aannemen.

Een tweede punt betreft de sociale kosten. Sociale kosten zijn voor de macromodellen, waarmee voor de voorbereiding van het economische beleid wordt gewerkt, exogeen. Toch zijn ze heel reëel, zoals aan een ieder duidelijk is geworden aan het voorbeeld van de voorstellen de ziektebewijzingen te beperken. De welvaartsverliezen die te verbinden zijn aan sociale en industriële disharmonie, dienen een belangrijke rol te spelen bij het maken van afwegingen tussen alternatieve beleidslijnen in de huidige situatie waar er voortdurend sprake is van beleidslijnen die gevestigde posities aantasten. Het ontbreken van elke schatting van de sociale kosten maakt het niet alleen moeilijk voor politici om tot afwegingen te komen, het brengt ze wellicht ook teveel in verleiding om pijnlijke ingrepen maar niet te doen plaatsvinden.

Tegen de achtergrond van de geschetsde beperkingen van macromodellen verkeert het CPB in een uiterst moeilijke en weinig benijdenswaardige positie. Het CPB is de gevangene van het eigen, op de markt voor sociaal-economische beleidsvoorbereiding opgebouwde, monopolie. Wie met een beleidsplan insteekt op het operationele middellange termijnmodel van het CPB, weet bij voorbaat dat het plan volgens dat model goed zal werken, alle twijfels over de praktische waarde van zo'n plan ten spijt. Een treffend voorbeeld daarvan is het RCO-plan, dat op 2 december 1981 in de Stichting van de Arbeid ter tafel werd gebracht bij het arbeidsvoorwaardenoverleg. De RCO formuleerde dit plan als alternatief voor het werkgelegenheidsplan van het kabinet. Het plan ging uit van zware bezuinigingen in de collectieve sfeer en lastenverlichting voor het bedrijfsleven, reversibiliteit veronderstellende en sociale kosten volstrekt negerend.

Hoe verlossen we het CPB uit die positie ten einde maximaal gebruik te kunnen maken van de daar aanwezige deskundigheid, talent, ijver en inzet? Een rechtgeaard econoom zal eraan twijfelen of er wel optimale aanpassing kan plaatsvinden aan gewijzigde marktomstandigheden bij de huidige monopoliepositie. West-Duitsland doet dan ook haar voordeel met het advies van de „vijf wijzen“, de directeurs van een vijftal economische onderzoeksinstituten. Heroverweging van macromodellen impliceert m.i. de overweging om naast het CPB een of twee onderzoeksinstituten te betrekken bij de voorbereiding van het sociaal-economische beleid. Waarmee aangegeven dat ik geloof in reversibiliteit in de ontwikkeling van het ambtelijk apparaat, de tweede wet ten spijt.

J. M. M. Ritzen

1) E. J. Bomhoff, *De kunst van het bezuinigen*, Inaugurale rede, nr. 2, Rotterdamse Monetaire Studies, 1982.