



Thermometer of tombola?

Auteur(s):

Bergeijk, P.A.G.

De auteurs zijn werkzaam bij nyfer in Breukelen.

Verschenen in:

ESB, 87e jaargang, nr. 4358, pagina 356, 3 mei 2002

Rubriek:**Trefwoord(en):**

doorrekenen

De cpb-doorrekening van verkiezingsprogramma's is de opmaat voor een rituele dans. Spraak-makende economen geven aan dat er niks van deugt. Vier jaar later verschijnt er desondanks weer een kloeke cpb-studie. Daarna komt weer kritiek los en is het wachten op een nieuw verkiezingsjaar.

Verkiezingstijd is voor Nederlandse economen bijzonder. De doorrekening van de financieel-economische paragrafen van de verkiezingsprogramma's is niet alleen een mooie vaderlandse folklore waarbij het cpb haar econometrische vaardigheden etaleert. Voor academische economen is het verschijnen van de doorrekening het startschot voor het leveren van spits commentaar op de irrelevantie en theoretische zwakte van de doorrekening, niet alleen aan de koffietafel en de bierpomp, maar ook in themanummers en tijdens congressen. Deze woordenstrijd is een rituele dans. Ieder verkiezingsjaar verschijnt er ondanks alle kritiek van vier jaar daarvoor gewoon weer een kloeke cpb-studie (alleen bij de eerste keer in 1986 was het geheel overzichtelijk met vijftien bladzijden). Daarna geven spraakmakende economen aan dat er niks van deugt en is het wachten op een nieuw verkiezingsjaar. Het economische vakgebied kan nauwelijks van groot voortschrijdend inzicht worden beschuldigd. Waar gaat het nu eigenlijk om?

Lucas' kritiek

In de kern is het debat een botsing van denkwerelden en - anders dan de oprispingen rond de verkiezingen suggereren - een reflectie van een brede en langdurige richtingstrijd tussen economen. Het meningsverschil werd in de jaren zeventig geboren. Na de eerste oliecrisis kon met de Keynesiaans

georiënteerde modellen geen adequaat bestrijdingsmiddel worden ontwikkeld tegen stagflatie (hoge inflatie en stagnatie), waardoor veel wetenschappers hun geloof in de macromodellen verloren. Rond die tijd bracht bovendien de latere Nobelprijswinnaar Robert Lucas een belangrijke theoretische slag toe aan de geloofwaardigheid van de modelmatige beleidsvoorbereiding. In een van de invloedrijkste en meest geciteerde wetenschappelijke artikelen stelde Lucas vast dat de vergelijkingen van de macromodellen werden bepaald aan de hand van gedragspatronen uit het verleden. Het was onwaarschijnlijk dat de gedragingen van burgers en bedrijven gedurende lange tijd stabiel zouden zijn, zeker wanneer het beleid ondertussen ingrijpend veranderde. Indien de gedragspatronen instabiel zijn, kunnen de daarop gebaseerde modellen niet worden gehanteerd om beleidswijzigingen door te rekenen. Dit inzicht, naar zijn ontdekker de Lucas Critique genoemd, behoort tot een van de belangrijke leerstukken van het toegepast economisch onderzoek.

In de Nederlandse context kan men de Lucas Critique als volgt vertalen. Het doorrekenen van Paars III of iets vergelijkbaars kan er misschien mee door, maar bij écht ander beleid à la GroenLinks of Fortuyn resulteren nietszeggende prognoses. Naast deze logische verwerping speelt dat het ontwikkelen, operationaliseren en toetsen van een macro-model arbeidsintensief is; in dezelfde tijd produceert men een dozijn op kleine theoretische modellen gebaseerde artikelen, die interessanter zijn voor buitenlandse vakgenoten omdat ze niet op specifiek nationale condities zijn gebaseerd. Tenslotte hebben beleidsmaatregelen in macromodellen vaak nauwelijks invloed. Dat levert de academicus weinig op: "Ik heb iets bedacht, maar het werkt niet".

Beleidsresistentie

Cpb-ers vergelijken hun modellen daarentegen vertederd met een olietanker. Eenmaal op koers valt het bijsturen van zo'n bakbeest niet mee: veranderen gaat langzaam; de koers moet vooraf zijn uitgestippeld. De keerzijde is dat bijsturen soms nauwelijks lukt. Dan strandt de tanker en wordt het model log en beleidsresistent. Keuzes in kaart 2003-2006 geeft een treffende illustratie. De beleidsvoor-nemens kennen een ongekende spreiding: het verschil is tien miljard euro bij de overheidsuitgaven en acht miljard euro bij de microlastendruk. Het gaat niet om een onsje meer of minder van hetzelfde, maar om tegenovergesteld beleid. De een verlaagt de lasten, de ander verhoogt ze. Het beleidseffect is evenwel zelfs na vier jaar verwaarloosbaar: de sp scoort 2,5 procent economische groei, de vvd 2,6 procent. Moeilijk te geloven, maar bovendien vormt een vooraf verstrekte aflat dat slecht economisch beleid er volgens cpb-berekeningen niet toe doet nogal een risico voor de economische politiek.

Academici voelen zich ongemakkelijk bij zulke beleidsongevoeligheid, maar worden boos als essentiële instrumenten niet kunnen scoren. Daardoor krijgen goede ideeën geen kans in het debat. Dat kan gebeuren indien het cpb louter bestedingseffecten doorrekent en andere effecten van bijvoorbeeld onderwijs en infrastructuur buiten beeld laat omdat daarover te weinig bekend is. Dit zijn precies de volgens moderne inzichten groeibepalende factoren. Bezuinigen op onderzoek om cultuur te financieren, heeft in de cpb-aanpak bijvoorbeeld geen effect. Groeivertraging is hier echter geen risico maar een zekerheid, waarvan slechts de grootte onbekend is.

De blinde vlek van de economische structuur-effecten is groter. In 1994 bleven consequenties van marktwerkingsbeleid buiten beeld; later vormden verruimde winkeltijden, de Mededingingswet en liberalisering van de telecommunicatiesector de kern van Paars I. Het cpb is op zijn sterkst waar budgettaire consequenties en vraageffecten in kaart worden gebracht. De zwakke stee blijven de capaciteitseffecten van investeringen (zowel fysiek als in kennis), marktwerking en de ontmoedigende invloed van de marginale belastingdruk, kortom de aanbodzijde van de economie.

Alternatieven

Deze vaststelling is alleen verhelderend indien de effecten van aanbodbeleid betekenisvol zijn, want anders is het voor theoretici weliswaar jammer dat cpb-economen zulke effecten niet modelleren, maar praktisch gezien zou dat dan ook een onrendabele investering zijn. Idealiter hadden universitaire economen hun kritiek op modelbouw en -gebruik met alternatieve, zelf ontwikkelde modellen onderbouwd, maar aan die alleszins redelijke wens is niet tegemoet gekomen, waardoor het debat weinig zakelijk is.

We beschikken gelukkig over twee gepubliceerde alternatieve doorrekeningen. De eerste (als boek-recensie) vermomde analyse had als kernboodschap dat het veronachtzamen van de invloed van marginale belastingdruk op scholing en economische activiteit niet doorslaggevend is voor de beoordeling van de relatieve effectiviteit van 'middle of the road'-beleid. Voor D66, vvd en cda bleven de verschillen tussen de oorspronkelijke doorrekening en een alternatief model binnen de foutenmarge ¹. Voor beleid dat buiten de geijkte kaders trad, waren er wel opvallende, tot de door het cpb gekozen modelstructuur herleidbare verschillen. In het basisscenario groeide de Nederlandse economie met 1,7 procent en zouden per jaar 40.000 banen worden gecreëerd. Volgens het cpb leverde het beleid van GroenLinks meer banen (25.000) en iets minder groei (een kwart procentpunt) op. In de doorrekening met het alternatieve model kwamen echter grote risico's naar voren: jaarlijks twee procent groei-uitval en 70.000 banen minder. In het basisscenario zou dat per jaar een krimp van de economie met 0,2 procent en daling van de werkgelegenheid met 30.000 banen opleveren.

Een tweede internationale publicatie betreft een gevoeligheidsanalyse van de met het mimic-model doorgerkende belastingplannen die kernonderdeel vormden van de verkiezingsprogramma's uit 1998 ². Mimic is met 15.000 endogene, 2000 exogene variabelen en een enorme mate van detaillering (veertig huishoudtypen onderverdeeld naar tien inkomensklassen) een typisch olietankermodel. De gevoeligheidsanalyse maakt op vijf gebieden kwantitatief inzichtelijk waar het cpb zich in 1998 het minst zeker voelde: de elasticiteiten van arbeidsaanbod en uitvoer, reële loonstarheid, de opleidingsbeslissing en het baanzoekgedrag. Daarbij blijkt dat deze onzekerheid voor de werkgelegenheid ruwweg de helft (D66, VVD) tot driekwart (PvdA) van het gepubliceerde effect beslaat en dat de rangorde van de economische invloed van de verkiezingsprogramma's metterdaad afhankelijk is van keuzen om bepaalde economische samenhangen (niet) te modelleren en van 'educated guesses' over modelparameters.

Slot

De vraag of grote modellen voldoen aan kwaliteitseisen van moderne wetenschapsbeoefening is even relevant als de tegenvraag naar het realiteitsgehalte van theoretische spitsvondigheden uit vaktijdschriften. Mits met verstand van zaken toegepast kunnen beide benaderingen de economische politiek in belangrijke mate ondersteunen. De cpb-doorrekening biedt helder zicht op de budgettaire consequenties en vraageffecten van voorgenomen beleidsmaatregelen en vormt in die zin een gewaardeerde dienstverlening. Daarbij past wel de belangrijke kanttekening dat evident verkeerd beleid een economische voldoende kan krijgen indien er te weinig bekend is over de mogelijke aanbodeffecten daarvan. Een deel van de energie die het cpb nu steekt in het verder uitbouwen van haar traditioneel sterkte punten (meer partijprogramma's, koopkrachtplaatjes, enzovoort) zou daarom beter gericht kunnen worden op het beperken van dat risico.

1 R.C.G. Haffner, The economic consequences of Dutch politics, De Economist, 1994, blz. 497-506.

2 J.J. Graafland, R.A. de Mooij, A. Nibbelink en A. Nieuwenhuis, MIMIC-ing tax policies and the labour market, Contributions to economic analysis series 251, Elsevier, Amsterdam, 2001.