

Een tijdbom onder de econometrie (I)

Zoals bekend spelen econometrische modellen een belangrijke, vaak zelfs doorslaggevende, rol bij de voorbereiding van de economische politiek. Politici die voor de noodzaak staan economische beslissingen te nemen, achten zich — terecht — niet in staat het economische proces in al zijn ingewikkelde samenhangen te doorzien en roepen de hulp in van economische deskundigen. Deze immers beschikken over econometrische modellen waarmee de belangrijkste economische verbanden in de volkshuishouding kwantitatief worden beschreven. Onder bepaalde veronderstellingen is het met die modellen mogelijk de economische toekomst te voorspellen; bovendien kunnen de effecten van allerlei economisch-politieke maatregelen vooruit worden berekend. Zo kan de onzekerheid over de uitwerking van beleidsvoornemens worden vermindert en kan de economische politiek van een wetenschappelijke onderbouwing worden voorzien. In dat licht spreekt het haast vanzelf dat aan de berekeningen en adviezen van instanties als het Centraal Planbureau, die over geavanceerde macro-econometrische modellen beschikken, bij alle belangrijke economisch-politieke beslissingen een zeer groot gewicht wordt gehecht.

Dat wil niet zeggen dat de econometrische modellen onomstreden zijn. Integendeel, de discussie over het nut van omvangrijke rekenmodellen voor het doen van economische voorspellingen en voor het berekenen van de gevolgen van koerswijzigingen in de economische politiek, laat telkens weer op. Volgens sommigen is de waarde van de gebruikelijke grote modellen op dit punt nul komma nul en kan met kleine, veel eenvoudigere modellen een zelfde, zo niet beter resultaat worden bereikt 1); volgens anderen zijn de huidige modellen juist veel te grof en globaal van aard om de economische ontwikkeling adequaat te beschrijven en zouden ze verder gedetailleerd moeten worden met b.v. informatie over ontwikkelingen op sectorniveau 2). Daarnaast heeft elke stroming in de economie nog haar eigen voorkeuren ten aanzien van de modellering: monetaristen zouden graag meer aandacht voor monetaire variabelen zien; post-keynesianen en neo-marxisten laken de veronachtzaming van machtsfactoren en supply-siders vinden dat de aanbodkant van de economie verwaarloosd wordt. Waar allen het echter over eens zijn is dat de voorspelkwaliteit van de gebruikelijke modellen zeer veel te wensen overlaat.

Veel fundamenteler dan de vraag of modellen te groot of te klein, te monetaristisch of te keynesiaans zijn, is evenwel de kwestie of het überhaupt wel mogelijk is het economische proces te modelleren. Het principe waarop de econometrische modellen zijn gebaseerd, is dat het gedrag van individuen of groepen van individuen een zekere constantie in de tijd vertoont. Verondersteld wordt dat consumenten die in het verleden 90% van hun inkomen consumeerden, dat in de toekomst ook zullen doen. Er wordt dus een zekere regelmaat gepostuleerd. Maar bestaat er in het sociale leven wel zo'n orde? Bestaan er wel stabiele gedragspatronen? Als we het bestaan van regelmaat in het sociale leven ontkennen, dreigt het hele econometrische bouwwerk in elkaar te storten. Want het is onmogelijk bruikbare kwantitatieve uitspraken te doen als de parameters in de gepostuleerde verbanden alle kanten op kunnen springen. Het econometrische model is dan net een kruiwagen met kikkers: op de bestemming aangekomen blijkt de lading verdwenen.

Waar komt de gedachte van stabiele gedragspatronen eigenlijk vandaan? Laten we een stapje terug doen in de tijd, naar de beginperiode van de econometrie, toen onze landgenoot Tinbergen als een der eersten een macro-economisch model ontwierp voor een complete volkshuishouding. Het is interessant te memoreren dat Tinbergen een opleiding had genoten in de fysica en was gepromoveerd op een proefschrift waarin de analogie tussen natuurkundige en sociaal-economische vraagstukken werd aangetoond. Tinbergen was van mening dat de kwantitatieve methoden uit de fysica ook in de sociale wetenschappen bruikbaar waren. Zoals er in de natuur wetmatigheden bestonden, zoals de wet van de zwaartekracht van Newton, de gaswetten van Boyle en Gay-Lussac en het $E = mc^2$ van Einstein, zo

would er wellicht ook in sociale processen vaste patronen te onderkennen zijn. Als men deze eenmaal op het spoor gekomen zou zijn, zou daarvan gebruik kunnen worden gemaakt om het economische proces te besturen: de economie zou een soort „social engineering” kunnen zijn. Maar terwijl de valversnelling bij elke meting weer om en nabij de $9,8 \text{ m/sec}^2$ bleek te zijn en het getal van Avogadro bij elke stof gelijk, konden er in de economie nooit dergelijke constanten worden vastgesteld. Niet voor niets klaagde Goodwin dan ook: „It is a melancholy reflection that, after about a century and a half of intensive effort by a distinguished line of investigators, it is still doubtful, whether we can state any quantitative, empirical law in economics” 3). Dat was in 1953. En het is nog zo in 1983.

Het is duidelijk dat het ontbreken van kwantificeerbare wetmatigheden in de economie een aantal vervelende consequenties heeft. Misschien nog de minst vervelende daarvan is dat het twijfelachtig wordt of economische theorieën wel wetenschappelijk zijn volgens het falsificatiecriterium van Popper. Als de waarden van de te onderzoeken parameters steeds veranderen, kunnen we geen uitspraak doen over de juistheid van een verondersteld verband. Met een beroep op gewijzigde omstandigheden is er altijd een alibi aanwezig voor de vaststelling dat een theorie onjuist is. Misschien is dat ook de reden dat economen het nooit eens worden. De verschillende, elkaar uitsluitende theorieën betreffende een zelfde verschijnsel kunnen wel worden geverifieerd, maar niet gefalsificeerd en vervolgens verworpen. De empirie kan geen uitsluitel geven. Bij gebrek aan onduidelzinnige wetmatigheden heeft de richtingstrijd in de economie het eeuwige leven en zal de door Tinbergen bepleite synthese nooit worden bereikt 4).

Lastiger is dat we ook niet kunnen voorspellen. Het beste dat we kunnen doen is ons op grond van ervaringen uit het verleden, een idee te vormen van wat de toekomst zou kunnen brengen, in de wetenschap dat het ook anders kan zijn. De meeste voorspelers houden, door ervaring wijs geworden, deze slag wel om de arm, maar de cliëntèle, i.c. de beleidsmakers, wenst in een wetenschappelijkte wereld waar de macht van het getal heerst, exactheid, al is het maar schijn-exactheid. Niet altijd wordt tegen die wens voldoende weerstand geboden.

Nog erger is het ontbreken van wetmatigheden voor de gelovigen die er onvermoeibaar naar blijven zoeken: de econometristen die zich met steeds geavanceerdere technieken uitputten om non-existente wetmatigheden in de economie op te sporen. Wat een verspilling van moeite en talent!

Is alle rekenarij dan zinloos? Kunnen econom(etr)isten niets tot de beleidsvorming bijdragen? Is de economie dan toch niets anders dan een „praatwetenschap”, bij uitnemendheid geschikt voor een debatgezelschap, maar met negatieve opvoedkundige waarde en met negatief praktisch resultaat”, zoals Goudriaan haar tekende 5)? Die conclusie voert te ver, zoals ik volgende week hoop uiteen te zetten.

L. van der Geest

1) Zie b.v. E. J. Bomhoff, *De kunst van het bezuinigen*, Rotterdamse Monetaire Studies nr. 2, Rotterdam, 1982, in navolging van monetaristen als Lucas, Sargent en Barro; zie ook de jaarlijkse Grecon-voorspellingen in *ESB*.

2) Men herinnere zich de uitvoerige discussie over het Vintaf-model in *ESB*, later gebundeld in W. Driehuis en A. van der Zwan (red.), *De voorbereiding van het economisch beleid kritisch bezien*, Stenfert Kroese, Leiden, 1978. Een interessante uitbreiding van de gebruikelijke macro-economische modellen is ook de toevoeging van een politieke sector; zie F. A. A. M. van Winden, Een eenvoudig politiek-economisch model, *ESB*, 10 november 1982.

3) R. M. Goodwin, *Static and dynamic linear equilibrium models*, geciteerd in: G. J. van Driel, J. A. Hartog en C. van Ravenzwaaij, *Limits to the welfare state*, Martinus Nijhoff Publishing, Boston/Den Haag/Londen, 1980, blz. 44.

4) J. Tinbergen, De noodzaak van een synthese, *ESB*, 1 december 1982.

5) J. Goudriaan, *Economie in zestien bladzijden*, J. H. de Bussy, Amsterdam, 1953, blz. 17.