

Macro-economische modelbouw in discussie (III)

Een valse bommelding
 PROF. DR. J. S. CRAMER

In *ESB* van 24 en 31 augustus schreef directeur-secretaris Van der Geest twee stukken onder de titel „Een tijdbom onder de econometrie”, en onlangs heeft hij mij (en anderen) gevraagd op zijn stukken te reageren ten einde aldus een interessante discussie te verkrijgen. Vooruit dan maar! Van der Geests mening dat er onder de econometrie een tijdbom ligt te tikken berust naar mijn indruk op vrij oppervlakkige lectuur, en hij schrijft wel erg gemakkelijk naar onbewezen conclusies toe. Ik zal dat voor enkele van zijn stellingen toelichten. Daarbij blijkt dan vanzelf wel wat ik van de door Van der Geest aangesneden kwesties vind.

In zijn eerste stuk maakt Van der Geest melding van allerlei controverses tussen modelbouwers, en hij besluit zijn overzicht met de zin: „Waar allen het echter over eens zijn is dat de voorspelkwaliteit van de gebruikelijke modellen veel te wensen overlaat”. Hebben allen gelijk, indien zij dit al met zo grote unanimiteit menen? Ik betwijfel het. De opvatting dat macro-economische modellen niet veel soeps zijn is langzamerhand zozeer modieus gemeengoed onder leken geworden dat ik erg naar een feitelijke bewijsvoering verlang. Zeker, de oliecrises zijn niet door macro-modellen voorspeld, maar daar zijn die ook niet voor ontworpen; men zou de modellen aan hun eigen pretenties moeten toetsen. Bestaan er vergelijkende studies waarin de gebruikelijke modellen als voorspellers door ongebruikelijke methoden worden overtroffen? Ik ken ze niet; misschien kan Van der Geest er mij echter een paar noemen, want ik volg de literatuur op dit punt niet zorgvuldig. Voorlopig houd ik het erop dat wij voor de korte-termijnvoorspelling en de beleidsvoorbereiding echt geen beter alternatief hebben dan de gebruikelijke modellen, zoals b.v. het CPB die hanteert. De werkwijze die Van der Geest aanbeveelt maakt trouwens óók gebruik van een (deel-)model dat niet van een geheel andere soort is. Zou dat nu werkelijk van zoveel betere kwaliteit zijn als een compleet model? Ik zou daar wel eens argumenten voor willen horen.

Van der Geest stelt de macro-economische modelbouw vervolgens gelijk aan de econometrie, en schreit krokodilletranen van verdriet omdat dit vak geen wetmatigheden aan het licht zou hebben gebracht (24 augustus, blz. 741, 2e kolom, bovenaan). Dit is nu eens niet de mening van „allen”, maar van

Goodwin, uit 1953, in 1980 geciteerd, en volgens Van der Geest nog altijd waar in 1983. Is dat waar? Een „getal van Avogadro” (wat dat ook moge zijn) heeft de econometrie inderdaad nog niet voortgebracht, maar ik weet niet of dat zo erg is: het voorbeeld komt voort uit de nogal naïeve opvatting van de natuurkunde als de enige „echte” wetenschap, die ons niet voor het eerst als voorbeeld wordt voorgehouden. Mijns inziens kan de econometrie beter worden vergeleken met de biologie of de psychologie, ook vakken waar zelfs laboratoriumproeven onsystematische variatie vertonen, ook vakken waar de mathematische statistiek moet worden gebruikt om uit de waarnemingen conclusies te trekken. Een „getal van Avogadro” of een constante zoals de „valversnelling” zal dat wel nooit opleveren. Zoals bij alle wetenschap is de voortgang langzaam, laag na laag, als bij een koraalrif; maar uit het feit dat er nog niet veel boven water uitsteekt mag men niet con-

cluderen dat er geen groei is. Als Van der Geest dat verlangt zal ik hem graag een paar artikelen noemen die „empirisch harde” resultaten aan onze kennis van de economie toevoegen. Van deze kleine stappen op een lange weg zal het toch moeten komen, ook al zijn de beleidsproblemen van de Nederlandse samenleving anno 1983 er natuurlijk niet eensklaps mee verholpen. Er gaat nu eenmaal enige tijd mee heen voor de vondsten die in *Econometrica* staan vertaald en bewerkt in de Troonrede terechtkomen.

De derde stelling van Van der Geest (31 augustus, blz. 761, 1e kolom, midden) is dat men over het *menselijk gedrag* maar moeilijk uitspraken kan doen, om het even of het nu individuen of groepen betreft, blijkbaar omdat het in tegenstelling tot andere verschijnselen geen regelmaat of wetmatigheid vertoont. Dit is vermoedelijk een laatste rest van de romantische opvatting uit de vorige eeuw dat de mens als drager van de vrije wil iets bijzonders is. De stelling is in zoverre onhoudbaar dat men gemakkelijk onaangename experimenten kan verzinnen die de aanhangers spoedig tot beter inzicht zouden brengen. Bovendien is de stelling echter, zeker in de sociale wetenschappen, erg onvruchtbaar omdat ze het onderzoek van moeilijke doch belangrijke kwesties belet. Sommigen menen dat ze de consumptiefunctie onder de knie hebben, en ik zie niet in waarom de investeringsfunctie niet zou volgen. De speculaties van Van der Geest op dit punt houden ons maar van ons werk.

Het zal duidelijk zijn dat ik, zonder ongunstig te oordelen over het werk van Hartog en de zijnen, weinig angst voel voor de bom van Van der Geest. Zo gemakkelijk blazen ze de econometrie niet op!

J. S. Cramer