

Voorspellen

„Wie de toekomst wil voorspellen, maakt slechts de duivel aan het lachen”. Deze oosterse wijsheid heeft economen niet weerhouden. Nadat Tinbergen in de jaren dertig een macro-economisch model ontwierp waarmee de effecten van economisch-politieke maatregelen konden worden berekend, zijn vele duizenden in zijn voetspoor getreden. Talloze modellen zijn sindsdien ontwikkeld om uitspraken te doen over het toekomstige verloop van economische grootheden. Wat is het resultaat van al die inspanningen? Beschikken we thans over een instrumentarium om de economische ontwikkeling en de effecten van economisch beleid met een redelijke mate van zekerheid te voorspellen? Of tasten we ondanks alles omtrent de economische toekomst nog steeds in het duister?

Vooraf in de jaren zestig en het begin van de jaren zeventig kende het optimisme over de mogelijkheden om met behulp van wetenschappelijke methoden de toekomst te voorspellen, geen grenzen. In lijvige rapporten werd minutieus uiteengezet hoe de maatschappelijke ontwikkeling in de komende decennia zou verlopen. Wanneer de ontwikkeling van het gewenste pad zou afwijken, kon dank zij de vooruitgang van de sociale wetenschappen de gang van zaken worden bijgestuurd. In de ogen van velen was de toekomst niet alleen kenbaar, maar ook maakbaar geworden. De jaren zeventig en tachtig verstoorden de illusie ruw. Er voltrokken zich gebeurtenissen die door niemand waren voorzien of gewenst. De resultaten van de wetenschappelijke voorspelkunde bleken in de praktijk fors tegen te vallen. Het beeld van de maakbare samenleving viel in diggelen.

Ook binnen de economie is het tijdperk waarin men dacht dat de overheid het economische proces met wat trekken en duwen nauwkeurig kon sturen, definitief afgesloten. Uit een uitvoerig onderzoek van het American Enterprise Institute naar de betrouwbaarheid van macro-economische voorspellingen blijkt onverbiddelijk dat het met de voorspelkracht niet best is gesteld ¹⁾. Hoe verfijnd de modellen en geavanceerd de rekenmethoden ook zijn, het is geen uitzondering dat de afwijking tussen raming en realisatie onaanvaardbaar groot is. Alleen op de zeer korte termijn (minder dan een jaar) blijken de prognoses enigszins trefzeker. Zodra het gaat om een termijn van twee jaar of meer, zijn de (on)betrouwbaarheidsintervallen van de voorspellingen meestal zo groot, dat in feite geen zinvolle uitspraken meer mogelijk zijn. De economische voorspelkunde lijkt weer terug bij af. „Economische voorspellingen, wat heb je er aan?”

Het is duidelijk dat de geringe trefzekerheid van de economische voorspellingen de gebruikers van deze voorspellingen niet is ontgaan. In de praktijk van de beleidsvoorbereiding bij overheid en bedrijfsleven wordt dan ook uiterst behoedzaam met de prognoses omgesprongen. Dat dit het geval is, wordt in enkele artikelen in deze *ESB* geïllustreerd. Zo zet de secretaris-generaal van het Ministerie van Economische Zaken, prof. Rutten, uiteen, waarom de uitkomsten van de economische modellen van het Centraal Planbureau voor de voorbereiding van het macro-economische beleid slechts een beperkte waarde hebben. Ook Fase (Nederlandsche Bank), Van Duijn (Robeco) en De Jong (Philips) laten er geen twijfel over bestaan dat zij voor het monetaire beleid, het beleggingsbeleid resp. de ondernemingsplanning een zeer selectief gebruik van de beschikbare prognoses maken. Allen achten het noodzakelijk dat de beleidsmaker een eigen visie op het toekomstige verloop van de economie ontwikkelt in plaats van klakkeloos de voorspellingen van anderen over te nemen. Het zijn niet zozeer de voorspellingen die waardevol worden geacht, als wel de redeneringen die er aan ten

grondslag liggen. Die immers bevatten de bouwstenen waaruit de gebruiker een eigen toekomstbeeld kan opbouwen.

Hoewel bij de presentatie van voorspellingen de nadruk dus meer zou moeten liggen op de argumenten voor een bepaalde prognose dan op de prognose zelf, is het in de praktijk meestal andersom. Het verwachte groeicijfer van een economie of het verwachte winstcijfer van een onderneming krijgt in het algemeen veel meer aandacht dan de manier waarop de regering of de ondernemingsleiding dit cijfer denkt te bereiken. Het is te simpel om de schuld voor deze gang van zaken uitsluitend bij de media te leggen, die slechts op zoek zouden zijn naar eenvoudig te verkopen boodschappen. De overtrokken aandacht voor quasi-exacte cijfers wordt ook in de hand gewerkt door de manier waarop voorspelinstituten hun voorspellingen zelf naar buiten brengen. In het algemeen wordt er slechts één puntschatting gegeven van een bepaalde grootheid in plaats van een betrouwbaarheidsinterval waarbinnen de desbetreffende voorspelling zich bevindt. Zo wordt het b.v. voorgesteld alsof de economische groei volgend jaar 2½% bedraagt, terwijl men in werkelijkheid op grond van de modelresultaten niet méér kan zeggen dan dat er b.v. 68% kans is dat de groei tussen 1¼ en 3¾% ligt en 95% kans dat hij tussen 0 en 5% ligt. Natuurlijk lijkt het bij de laatste presentatie alsof men maar weinig aan de voorspelling heeft. Men dient echter te beseffen dat de schijnbare nauwkeurigheid van de puntschatting geen enkele extra zekerheid verschaft. Zij levert slechts schijnzekerheid op. En uiteindelijk teleurstelling over de onbetrouwbaarheid van de voorspellingen.

Wanneer er meer begrip ontstaat voor de grote onzekerheidsmarges waarmee voorspellingen zijn omgeven, wordt tevens duidelijk hoe gebrekkig onze kennis is en hoeveel werk er nog moet worden verzet om de doeltreffendheid van de voorspellingen te vergroten. Een eerste vereiste daarvoor is dat de oorzaken van de voorspelfouten worden opgespoord. De artikelen van Fase, Van den Berg (CPB) en Voorhoeve (Grecon) in deze *ESB* bevatten hiertoe interessante aanzetten. Het onderzoek naar de oorzaken van de verschillen tussen raming en realisatie zou echter veel systematischer dienen plaats te vinden dan nu gebeurt. Alleen op die manier immers kunnen de zwakke plekken van de gebruikte modellen worden opgespoord en gerepareerd. Daarnaast is het zinvol zich niet op één theorie of één voorspelmethode te verlaten. Er is niet één manier die het altijd beter doet dan alle andere. In het artikel van Kloek in deze *ESB* wordt een heel scala van verschillende voorspeltechnieken besproken.

Ondanks alle verbeteringen die er op het voorspelfront nog zijn te bereiken en waarvoor in deze *ESB* suggesties worden gedaan, zullen we er rekening mee moeten houden dat het met de trefzekerheid van economische voorspellingen altijd behelpen zal blijven. Zoals Van Vught in zijn artikel uiteenzet, is de sociale werkelijkheid te complex om in enkele simpele verbanden te vangen. De betekenis van voorspellingen is in zijn visie dan ook niet zozeer gelegen in het doen van uitspraken over de toekomst, als wel in het laten zien van fouten en het ontmaskeren van onwaarheden in de theorieën die we er thans op na houden. Zo opgevat is voorspellen onthullen. Niet van de toekomst, maar van het heden.

L. van der Geest

1) W.A. Spivey en W.J. Wroblewski, *Surveying recent econometric forecasting performance*, American Enterprise Institute, Washington D.C., 1980.