

Tilburg University

Modellen verhullen onzekerheden

Graafland, J.J.

Published in:
Een kwestie van kiezen

Publication date:
2005

[Link to publication in Tilburg University Research Portal](#)

Citation for published version (APA):
Graafland, J. J. (2005). Modellen verhullen onzekerheden. In P. A. de Vries (Ed.), *Een kwestie van kiezen* (pp. 19-24). Friesch Dagblad/Het goede leven.

General rights

Copyright and moral rights for the publications made accessible in the public portal are retained by the authors and/or other copyright owners and it is a condition of accessing publications that users recognise and abide by the legal requirements associated with these rights.

- Users may download and print one copy of any publication from the public portal for the purpose of private study or research.
- You may not further distribute the material or use it for any profit-making activity or commercial gain
- You may freely distribute the URL identifying the publication in the public portal

Take down policy

If you believe that this document breaches copyright please contact us providing details, and we will remove access to the work immediately and investigate your claim.

2

Modellen verhullen onzekerheden

Johan Graafland

Op een cartoon op een muur in mijn kamer banjert een stoet van geblinddoekte beleidsmakers in ganzenmars door het water. Hun handen op de rug van hun voorganger. Helemaal vooraan loopt een onderzoeker van het RIVM. De cartoon illustreert de ontgoocheling toen bleek dat analyses van het RIVM in het geheel niet op werkelijke metingen in het veld waren gebaseerd, maar slechts op model- uitkomsten.

Onontkoombaar dringt zich hier een parallel op met de economische wetenschap. Ook op economisch gebied laten beleidsmakers zich leiden door inzichten uit modellen die slechts in beperkte mate op empirische inzichten gebaseerd zijn. Het vertrouwen in de economie als wetenschap is zo groot, dat vrijwel alle politieke partijen hun verkiezingsprogramma's laten doorrekenen door de economen van het Centraal Planbureau (CPB). Politieke partijen die zich niet aan deze toets onderwerpen, laden de verdenking op zich dat hun plannen wel eens slecht kunnen zijn voor de economie.

Nu is de invloed van dit soort analyses op de verkiezingen uiteraard erg afhankelijk van het thema dat de verkiezingen beheerst. Zo speelde tijdens de verkiezingen van 2002 de economie vrijwel geen rol, in tegenstelling tot eerdere verkiezingen in 1994 en 1998. Desalniettemin laat het verschijnsel dat een overheidsinstelling als het CPB rapportcijfers geeft voor verkiezingsprogramma's een groot vertrouwen in het voorspellingsvermogen van economen zien. Is dit terecht of zijn wij in Nederland een beetje naïef? In de rest van de wereld komt

men dit immers niet tegen. De vraag kan ook zo worden gesteld: hoeveel weten wij van de economie? Hoe nauwkeurig kunnen wij de verwachte gevolgen van beleid in beeld brengen?

Modellen versimpelen de werkelijkheid

Om deze vraag te beantwoorden, is het nodig inzicht te hebben in hoe economen te werk gaan. Als economen de effecten van een beleidsmaatregel of een combinatie van verschillende maatregelen (zoals in de verschillende verkiezingsprogramma's worden voorgesteld) proberen te voorspellen, vormen zij zich vooraf een idee op welke manier deze maatregelen in de gedragingen van mensen zullen doorwerken. Voor elk type gedrag wordt een theorie opgesteld. Deze theorie start met een aantal basisveronderstellingen. Een belangrijke veronderstelling uit de nog steeds overheersende neoklassieke theorie is bijvoorbeeld dat mensen rationeel zijn en naar maximalisatie van hun eigen consumptie streven. Deze veronderstelling is echter nog te grof om tot een precieze beschrijving van het gedrag te komen. Daarom wordt nog een aantal aanvullende vooronderstellingen bedacht, bijvoorbeeld ten aanzien van de informatie waarover mensen beschikken bij het maken van keuzes en het type markt waarop zij zich bewegen (veel of weinig concurrentie). Maar zelfs dan is de theorie te algemeen en zijn nog veel aanvullende en sterk vereenvoudigende veronderstellingen nodig om de theorie zo concreet en eenvoudig te maken dat deze getoetst kan worden aan de werkelijkheid.

Met behulp van gegevens over de economie wordt vervolgens nagegaan hoe sterk mensen reageren op bepaalde veranderingen, zoals een verhoging van de belasting. Dit gebeurt vervolgens voor ieder onderdeel van het model. Na samenvoeging van de verschillende onderdelen ontstaat uiteindelijk een model waarmee de effecten van beleidsmaatregelen kunnen worden doorgerekend. Er zijn echter verschillende redenen waarom de berekeningen aan de hand van zo'n model veel in het onzekere laten. Allereerst is het zo dat de veronderstellingen abstracties zijn die de werkelijkheid maar ten dele beschrijven. Zo laat psychologisch onderzoek zien dat mensen maar in beperkte mate rationeel zijn en zich niet alleen door het eigenbelang laten leiden. Alhoewel deze complicatie onderkend wordt door economen, wordt er in economische modellen weinig mee gedaan, ook al omdat de modellen anders te ingewikkeld worden. De

onnauwkeurigheid wordt verder vergroot door de vele andere aanvullende vooronderstellingen en vereenvoudigingen die nodig zijn om de economische analyse hanteerbaar te maken.

Een tweede reden is dat het toetsen van economische theorieën aan de werkelijkheid doorgaans moeilijk is. Vaak ontbreken goede gegevens die voldoende gedetailleerd zijn en een voldoende lange tijdsperiode omvatten om de effecten op het gedrag van mensen precies te kunnen meten. Met name de voorkeuren en verwachtingen van mensen, die toch bepalend zijn voor hun economisch gedrag, zijn zeer moeilijk te meten. Een extra complicatie is dat menselijk gedrag aan verandering onderhevig is. Gelden metingen uit het verleden ook voor de toekomst?

De rol van de overheid

Wat betekent deze onzekerheid nu voor actuele beleidsproblemen zoals de vraag of de overheid in het huidige economische klimaat haar uitgaven niet méér zou moeten stimuleren dan het Europese Stabiliteitspact toelaat?

Verschillende economen zeggen dat het handhaven van de 3-procentnorm schadelijk is voor de economie. De beperking van de overheidsuitgaven zet de productie en werkgelegenheid namelijk onder druk, waardoor de werkloosheid nog verder oploopt. Hierdoor zullen de inkomsten van de overheid dalen, met als gevolg dat zij tot additionele bezuinigingen moet besluiten en er een neerwaartse spiraal ontstaat. Een ruimer bestedingsbeleid van de overheid zou zo'n spiraal kunnen stoppen.

In de jaren zeventig is onder invloed van een economische theorie (de zogenaamde Lucas-kritiek) dit Keynesiaanse recept echter sterk bekritiseerd. Deze kritiek sloot aan bij de feitelijke ontwikkeling van de economie in de jaren zeventig. Ook toen steeg de werkloosheid en voerde de overheid haar bestedingen op, maar effectief was het niet. De achtergrond hiervan was dat de stijgende werkloosheid niet zozeer veroorzaakt werd door te weinig vraag naar goederen, maar door factoren die het aanbod belemmerden. Zo kunnen (te) hoge werkloosheidsuitkeringen ertoe leiden dat werklozen onvoldoende bereid zijn om een baan te accepteren die zij niet zo leuk vinden. Hierdoor is de concurrentie op de arbeidsmarkt niet sterk genoeg, dalen de lonen onvoldoende en blijft arbeid te duur, waardoor de werkgelegenheid onvoldoende aantrekt. In de

jaren tachtig is de aandacht van economen daarom verschoven naar de aanbodkant van de economie. Ook de CPB-modellen bieden sindsdien een mix van Keynesiaanse vraageffecten en neoklassieke aanbodeffecten. Maar hoe sterk is de uitwerking van dit soort gedrageffecten?

Een voorbeeld: kinderopvang

Een concreet voorbeeld van een overheidsbesteding zijn de subsidies voor kinderopvang. De overheid heeft onlangs besloten deze te verminderen. Wat zijn nu precies de gevolgen van deze bezuinigingen?

Zelf heb ik toen ik werkzaam was bij het Centraal Planbureau een modelmatige analyse verricht naar de effecten van subsidiëring van kinderopvang. Daaruit blijkt dat subsidies aan kinderopvang de overheid op de lange termijn per saldo geen geld kosten, omdat de subsidie niet alleen de koopkracht verbetert van degenen die gebruik maken van betaalde kinderopvang, maar hen ook stimuleert om meer arbeid aan te bieden. Daardoor dalen de lonen en neemt de concurrentiepositie van Nederlandse bedrijven toe. De productie stijgt en zo ook de werkgelegenheid. Derhalve nemen de belastinginkomsten toe, terwijl door de loondaling verschillende uitgaven van de overheid (die daaraan gekoppeld zijn) afnemen. Door deze gunstige effecten, de zogenoemde inverdieneffecten, stijgt het begrotingstekort nauwelijks. Het lijkt een vorm van Keynesiaans bestedingsbeleid, met dit verschil dat subsidiëring van kinderopvang de economie niet alleen via de vraag (extra koopkracht voor degenen die al gebruik maken van kinderopvang) maar ook via het aanbod stimuleert (het wordt aantrekkelijker om te werken).

Het probleem is dat mijn analyse steunt op een veelheid van veronderstellingen. Bijvoorbeeld: vrouwen laten de beslissing om meer of minder te werken afhangen van wat ze netto, na aftrek van alle kosten, van hun loon overhouden. Maar hoe sterk weegt dat precies mee? Uit onderzoek blijkt een grote variatie. Schattingen van de arbeidsaanbodelasticiteit (het getal dat aangeeft hoeveel het arbeidsaanbod procentueel stijgt als de netto beloning met 1 procent toeneemt) variëren van 0.33 tot zelfs 5.0 procent. Het is duidelijk dat de hoogte van deze schatting cruciaal is voor het effect van extra subsidie voor kinderopvang en de eventuele terugverdieneffecten hiervan voor de overheid.

In mijn model is gewerkt met een elasticiteit van 1.0. Dit percentage is vervolgens toegepast op alle typen arbeid. Afgezien van de onzekerheid van deze waarde, kan men zich ook nog afvragen of deze elasticiteit wel gelijk is voor verschillende typen huishoudingen (bijvoorbeeld laag of hoog geschoolden). Bovendien hebben de schattingen betrekking op gegevens uit de eerste helft van de jaren negentig, maar gedragen vrouwen zich anno 2004 nog wel hetzelfde? Ook weten wij niet hoe snel de gedragseffecten optreden: binnen 1 jaar, 3 jaar of 8 jaren?

Daar bovenop komt nog eens de onzekerheid in verband met het weglaten van andere mogelijk relevante effecten. Het stimuleren van het arbeidsaanbod van vrouwen gaat namelijk waarschijnlijk gepaard met diverse andere effecten die in de modelanalyse niet zijn meegenomen. Voorbeelden zijn een stijging van het menselijke kapitaal (vanwege de ervaring opgedaan tijdens het werk); de kwaliteit van de opvoeding van de kinderen (kan positief zijn bij goede kinderopvang maar negatief worden als de arbeidsmarktparticipatie tot minder persoonlijke aandacht voor het kind leidt); hoger arbeidsongeschiktheidsrisico (vanwege de stress door de combinatie van zorg en arbeid) en een uitholling van de relatieve welvaart van anderen (die zich bijvoorbeeld uitdrukt doordat stijgende huizenprijzen het noodzakelijk maken om te werken).

Men zou zich ook buiten het traditionele neoklassieke economische paradigma kunnen bewegen en zich kunnen afvragen op welke wijze een toenemende arbeidsmarktparticipatie de sociale en persoonlijke deugden van mensen beïnvloedt.

In de recente economische literatuur wordt in toenemende mate belang gehecht aan sociale deugden zoals vertrouwen, integriteit en rechtvaardigheid, alsook aan persoonlijke deugden zoals zelfbeheersing, discipline en de bereidheid om zelf verantwoordelijkheid en initiatief te nemen. Zonder deze deugden verloopt het economisch proces minder efficiënt. Omdat onderzoek heeft laten zien dat economische factoren van invloed zijn op deugden van mensen (zowel positief als negatief), zouden economen ook met deze terugkoppeling rekening moeten houden. Wat dat betekent voor de effecten van subsidiëring van kinderopvang in Nederland is echter niet bekend.

Wij zien derhalve dat wij zelfs bij de beoordeling van één enkele maatregel al geconfronteerd worden met een scala aan mogelijke positieve en negatieve effecten op het gedrag van mensen en dat wij slechts voor een deel van deze

effecten een indicatie hebben hoe sterk zij zijn. Maar ook deze indicaties zijn weer met onzekerheid omgeven. Dat maakt het heel moeilijk om met zekerheid te zeggen wat een maatregel per saldo voor gevolgen heeft, bijvoorbeeld voor het begrotingstekort van de overheid. En dat geldt nog meer als we in algemene zin moeten oordelen over een ruimer bestedingsbeleid van de overheid, waarbij het geld aan verschillende doelen wordt besteed.

Het gaat om vertrouwen

Wat betekent dat bijvoorbeeld voor het debat over de 3-procentsnorm voor het maximale begrotingstekort. Hoe heilig is deze norm? Zou het niet beter zijn om deze norm wat hoger te stellen: 4 procent, of is juist een lager percentage wenselijk: 2 procent?

Ik denk dat daar weinig met zekerheid over gezegd kan worden. Wel is het wenselijk dat er een grens wordt gesteld en dat de verschillende landen zich daaraan houden. Ook al weten we niet hoe hoog de optimale grens precies is, het is aannemelijk dat als het begrotingstekort voor de Europese economie substantieel hoger ligt dan 3 procent, het vertrouwen in de Europese economie afneemt. Omdat dit vertrouwen een collectief goed is van de Europese landen als geheel, wentelt een individueel land de kosten van een oplopend begrotingstekort in eigen land dus voor een groot deel af op de andere Europese landen. Indien de politieke baten van een dergelijk beleid groot zijn en de kosten ervan kunnen worden afgewenteld op anderen, wordt de verleiding daartoe wel erg groot. En als één schaap over de dam is. Het vertrouwen in de Europese economie kan daarom alleen worden beschermd als er een regel is die hier een stokje voor steekt.

Uit het voorafgaande moge duidelijk zijn dat het uiterst onzeker is welke effecten een tijdelijke overschrijding van de 3-procentsnorm heeft op de middellange en lange termijn. Maar het handhaven van een duidelijke regel heeft mijns inziens meer voordelen dan de eventuele, onzekere terugverdieneffecten van een ruimer bestedingsbeleid van de overheid.