

MODELLENBOUW EN ECONOMISCHE REALITEIT: COMMENTAAR

door

Drs. A. A. J. SMULDERS

In een der recente nummers van *Economie* is van de hand van Dr. Th. van de Klundert een artikel verschenen onder de titel „Modellenbouw en economische realiteit”¹⁾. In dit artikel beoogt de auteur een rechtvaardiging te geven voor het modeltheoretisch denken, terwijl hij tevens tracht aan te geven welke plaats dit denken in de verschillende mogelijke benaderingswijzen van de economische wetenschap dient in te nemen.

De controverse modellenbouw — anti-modellenbouw wordt, nu voor het kwantitatieve denken in onze wetenschap een steeds grotere plaats wordt ingeruimd, van steeds actueler betekenis, al heeft deze controverse zich — voorzover wij weten — nog niet in discussies toegespitst. Voorzover ons bekend, vormt het artikel van van de Klundert, waarin pro en contra van de modellenanalyse tegen elkaar worden afgewogen, voor Nederland een primeur. Mede hierom en met name ook vanwege de actualiteit van het vraagstuk hebben wij genoemd artikel met veel interesse gelezen. Al lezende zijn wij echter tot de conclusie gekomen, dat er wel aanleiding is tot enig kritisch commentaar. Voordat wij hiertoe overgaan, lijkt het echter gewenst om nog eens in het kort het betoog van van de Klundert samen te vatten.

Uitgangspunt voor de beschouwingen van de auteur is de controverse tussen de neo-klassieke en post-keynesiaanse groeperingen, waarbij eerstgenoemden aan de laatsten verwijten, dat hun beschouwingen vaak te fragmentarisch en te partieel zijn, terwijl de objectie van de post-Keynesianen tegen de neo-klassieke denkwijze is, dat deze zich wel van simultane vergelijkingenstelsels bedient, maar zich op een te abstract niveau beweegt. De schrijver is van mening, dat er voor dit antagonisme eigenlijk geen reden is, maar dat beide benaderingswijzen elkaar op nuttige wijze kunnen aanvullen. De arbeidsverdeling tussen de approaches ziet van de Klundert als volgt: het is de taak van de algemene evenwichtsanalyse om de werking van het economisch mechanisme te verklaren en de factoren te analy-

¹⁾ Maandschrift *Economie*, sept 1962, blz. 555-568.

seren, die op lange termijn tot een evenwicht leiden; aan de andere benaderingswijze komt dan de taak toe aandacht te schenken aan bepaalde vertragingsfactoren, welke op korte termijn werkzaam zijn en welke een tijdelijke afwijking van het evenwicht, waarnaar de economie op lange termijn tendeert, kunnen veroorzaken. Deze vertragingsfactoren zijn van institutionele of psychologische aard ofwel houden zij verband met de heterogeniteit van goederen en produktie-factoren.

Vervolgens gaat de schrijver in op de mogelijkheden en tekortkomingen van de algemene evenwichtsanalyse, waarbij hij met name aandacht schenkt aan de problemen die opduiken bij de desaggregatie van het macro-model en die verband houden met de heterogeniteit van eindprodukten en kapitaalgoederen. Hierbij komt hij tot de conclusie, dat deze heterogeniteit een ondubbeltzinnige gevolgtrekking met betrekking tot de stabiliteit van het economisch leven enigszins illusoir maakt. Tegelijkertijd heeft het modelmatige denken echter, volgens de auteur, een grote waarde. Dit denken kan nl., zegt hij, indien er voldoende redenen voorhanden zijn om in een stabiele ontwikkeling te geloven, enig inzicht verschaffen in de complexe samenhangen, waardoor het maatschappelijk gebeuren zich kenmerkt. Uit deze formulering blijkt reeds, dat van de Klundert van mening is, dat de theorie zelf niet in staat is het bestaan van een harmonische en evenwichtige ontwikkeling afdoende te motiveren. Vandaar dat hij in een slotparagraaf tracht zijn visie op het economisch gebeuren in een breder maatschappij- en mensbeeld te integreren. Hierbij blijkt dat de auteur de maatschappelijke evolutie in het algemeen en de economische groei in het bijzonder ziet als een harmonisch geordende beweging, een convergentie naar een voleinding der tijden, zoals hij zelf zo fraai zegt. Hij is van mening dat zowel het individueel handelen als de groepsactiviteiten betrokken zijn op een fundamentele harmonie. Het denken met behulp van wiskundige modellen heeft nu tot functie dit a priori mede te bevestigen.

Het wil ons voorkomen, dat er tegen de beschouwingen van de auteur een drietal objecties kunnen worden ingebracht, welke wij hier eerst puntsgewijs zullen weergeven en vervolgens nader zullen toelichten.

1. Van de Klundert beperkt zich in zijn beschouwingen tot de algemene evenwichtsmodellen.
2. Van de Klundert fundeert de rechtvaardiging voor het modeltheoretisch denken op een levensbeschouwelijk a priori.

3. De taakverdeling zoals de schrijver die ziet tussen het modelmatig denken (lees: evenwichtsanalyse) enerzijds en de andere benaderingswijzen anderzijds is gebaseerd op een minder juiste interpretatie van de betekenis en de rol van de institutionele en psychologische factoren in het economisch gebeuren.

Ad. 1. De auteur beperkt zich in zijn beschouwingen tot de neo-klassieke evenwichtsmodellen. Hierdoor wordt het begrip modellenbouw door hem wel in erg pregnante zin opgevat. Zo wordt door de schrijver nauwelijks aandacht geschonken aan de niet-neo-klassieke modellen, terwijl ook weinig aandacht wordt besteed aan het probleem van de verificatie van de modellen.

De vraag welke benaderingswijze de economische realiteit het dichtst benadert, is nl. met een bespreking van de controverse tussen neo-klassieken en post-Keynesianen niet uitputtend beantwoord. De moeilijkheid die zich voordoet bij de keuze tussen neo-klassieke en post-Keynesiaanse benaderingswijze nl. dat de eerste te abstract en de tweede te fragmentarisch is, is eigenlijk een onderdeel van een veel algemener probleem, nl. de methodologie. Als researcher wordt men herhaaldelijk geconfronteerd met een moeilijk methodologisch probleem, nl. om op verantwoorde wijze een keuze te maken uit een aantal methoden, zodat men voor het concrete project tot de meest werkelijkheidsgetrouwe analyse komt. Het gaat hierbij niet alleen om een keuze tussen een structuur- en conjunctuuranalyse of om een keuze tussen een modelmatige en meer verbale, zij het eventueel kwantitatief opgevatte, benaderingswijze, maar indien men eenmaal geopteerd heeft voor een modeltheoretische aanpak, heeft men opnieuw met een keuzeprobleem te maken. Er zijn modellen die simultaan zijn, maar zo abstract en zo moeilijk statistisch toetsbaar dat hun operationele waarde miniem is; andere modellen maken een tamelijk gedetailleerde analyse mogelijk en zijn ook verifieerbaar, maar zijn te partieel van karakter. Als navorser voelt men zich dan vaak „between the devil and the deep blue sea”. Kiest men het ene dan is men te abstract, kiest men het andere dan gaat men te partieel tewerk. De aard van de problematiek zal dan moeten uitmaken, welke methode tot de beste oplossing leidt. Ik wil er nog eens met nadruk op wijzen, dat deze keuze vaak een dwingend karakter heeft en ononkoombaar is, omdat een simultaan maar niet kwantificeerbaar model nu eenmaal niet kan worden gecombineerd met een partieel wel meetbaar model. Wel kan men de resultaten van het partiële model nader aanvullen en amenderen met kwalitatieve conclusies ontleend aan het simultane model.

Hieruit moge blijken, dat het probleem modellenbouw en economische realiteit wel wat genuanceerder is en meer facetten vertoont dan in de tweedeling neo-klassieke versus post-Keynesiaanse analyse tot uitdrukking komt. Het ware ons dan ook liever geweest, indien van de Klundert het vraagstuk van de realiteitswaarde van de modellenbouw geplaatst had in het meer algemene kader van de methodenleer.

Ad. 2. De auteur fundeert de rechtvaardiging voor het modeltheoretisch denken (lees: algemene evenwichtsanalyse) op een levensbeschouwelijk a priori. Zo zegt hij op blz. 557: „Van veel groter belang (dan de opvattingen ten aanzien van de actualiteit van de wet van Say), ja zelfs fundamenteel, is het vertrouwen dat men heeft in een *harmonische en evenwichtige ontwikkeling* (cursive-*ring van de schrijver*) van de samenleving met name in economisch opzicht. Is dit vertrouwen aanwezig, dan betekent wetenschapsbeoefening het opsporen van de interdependenties, het blootleggen van samenhangen...” en op blz. 565 merkt hij op, dat de modelmatige analyse een grote rijkdom betekent; hij motiveert deze opvatting als volgt: „Immers, *indien er voldoende redenen voorhanden zijn om in een stabiele ontwikkelingsgang van het economisch leven te geloven* (cursive-*ring van ons*), dan biedt dit denken de mogelijkheid om enige tipjes van de ongetwijfeld complexe sluier, die het gehele maatschappelijke gebeuren omhult, op te lichten”. Het vertrouwen en het geloof in de harmonische ontwikkeling, die door de theorie wordt beschreven, kan echter niet uit de theorie worden geput; zoals de schrijver zelf zegt: de theorie is zelf niet in staat het bestaan van een harmonische en evenwichtige ontwikkeling afdoende te motiveren. Dit nu is voor de auteur aanleiding om de rechtvaardiging voor het modelmatig denken (in de door hem gezegde pregnante betekenis) te funderen op zijn levensbeschouwing. Hij gelooft, dat de maatschappelijke en ook de economische evolutie een harmonische, geordende beweging is, een convergentie naar een voleinding der tijden. Het is voorwaar een schone, welhaast apocalyptische visie die ons hier geschilderd wordt, maar men kan ook een andere levensbeschouwing hebben. Dit credo in een inherente harmonie die aan de economische evolutie eigen zou zijn, is trouwens niet zo nieuw als de schrijver met zijn verwijzing naar moderne auteurs suggereert; het dateert al van de tijd dat onze wetenschap nog in de kinderschoenen stond en gaat terug op de ons inziens verouderde filosofie van de *ordre naturel*. Deze filosofie lag ook aan de basis van het oude liberalisme, dat in zijn aan het ada-

gium had geschreven: *Laissez aller, laissez passer et tout le monde va de lui-même*. Uiteraard is het het goed recht van de schrijver om deze levensbeschouwing, die niet de onze is, aan te hangen, maar dat de modellenbouw haar waarde ontleent aan het feit, dat de maatschappelijke dynamiek een geordende dynamiek zou zijn, gaat ons beslist te ver. Dit laatste is, zoals gezegd, een levensbeschouwelijk a priori. Moet men hier nu de rechtvaardiging voor het modeltheoretisch denken op baseren? M.a.w. als men nu eens een andere filosofie aanhangt, heeft dan het modelmatig denken, in de speciale betekenis die van de Klundert aan dit woord geeft, geen betekenis meer?

Ad. 3. Ook de arbeidsverdeling tussen de algemene evenwichts-analyse en de overige benaderingswijzen, zoals de auteur die schetst, vertoont duidelijk de sporen van zijn filosofisch a priori en is ons inziens onaanvaardbaar. De werking van het economisch mechanisme impliceert, volgens de schrijver, dat op langere termijn krachten aanwezig zijn die de ontwikkeling naar een evenwicht doen tenderen. De verstoringen en afwijkingen van het evenwicht uit hoofde van institutionele en psychologische factoren zouden in principe slechts van tijdelijke aard zijn. Het zou nu de taak zijn van het modelmatig denken om de werking van het economisch evenwichtsmechanisme te schetsen, terwijl het de taak van de andere benaderingswijzen zou zijn om de korte-termijn problematiek verband houdende met de institutionele en psychologische factoren te analyseren

De belangrijke vraag die zich ook hier weer stelt is: kan bewezen worden, dat er een automatische tendentie is naar een evenwicht op lange termijn en dat afwijkingen van het harmonisch evenwicht slechts tijdelijk zijn? Zijn de institutionele ontwikkelingen slechts van belang op korte termijn? Moet men de historisch gegroeide en historisch groeiende institutionele ontwikkelingen niet mede opnemen in een lange-termijn analyse? Mag men deze evolutie van de instituties wel aanduiden en omschrijven met „het institutionele bepaalde gebeuren van elke dag?” Naar onze mening blijven de dieperliggende ontwikkelingen en tendenties niet beperkt tot de kwantitatieve groei van de aanbod- en vraagfactoren, maar strekken zij zich mede uit tot het institutionele kader waarbinnen de kwantitatieve evolutie zich voltrekt. De voortdurend veranderende instituties vormen een belangrijk element in de maatschappelijk-economische dynamiek en zij kunnen het aanschijn van onze economische wereld permanent veranderen; zij kunnen onder omstandigheden ook, wanneer men het *laissez faire* beginsel op orthodoxe — d.w.z. rigoureuze — wijze hanteert, verhinderen dat een harmonische en geordende econo-

mische ontwikkeling zich voordoet en dat niet tijdelijk of op korte termijn, zoals van de Klundert stelt, maar ook op lange termijn en misschien zelfs permanent.

Ik zou dit laatste willen illustreren met te wijzen op de toenemende betekenis van de pressiegroepen voor de afloop van het economisch proces. Van de Klundert stelt, wederom vanuit zijn a priori, dat het individueel handelen en de groepsactiviteiten betrokken zijn op een fundamentele harmonie. Deze optimistische visie wordt echter ons inziens weersproken door de ontwikkeling zoals men die in verschillende landen kan waarnemen. Zo is het bijv. in de V.S. onmogelijk gebleken om de beide doelstellingen van volledige werkgelegenheid en prijsstabiliteit gelijktijdig te realiseren met uitsluitende toepassing van monetaire en fiscale instrumenten. De pressiegroepen zijn in dit land zo machtig, dat zij bij een werkloosheid van vijf procent niet bereid zijn hun inkomenseisen in overeenstemming te houden met hetgeen de groei van de macro-economische arbeidsproduktiviteit gedooft. Het gevolg is een beloningsinflatie ondanks de vrij sterke mate van werkloosheid. Volgens gezaghebbende auteurs¹⁾ zou de werkloosheid die door de monetaire autoriteiten zou moeten worden gecreëerd om de beloningsinflatie te beteugelen en monetaire stabiliteit te bereiken zelfs zeven à acht procent bedragen, een percentage dat zowel vanuit economisch als sociaal standpunt onaanvaardbaar is. Hoe komt het nu dat zo'n grote werkloosheid noodzakelijk is om de structurele loonsverhogingen in overeenstemming te brengen met de groei van de arbeidsproduktiviteit? Ons inziens zijn het de pressiegroepen in samenhang met andere institutionele factoren, die een inflatoire ondergrond in de Amerikaanse economie hebben gebracht. Juist omdat de pressiegroepen opereren in een veranderd institutioneel kader, waarbij veel meer dan vroeger de sociale zekerheid en de beschermingsgedachte op de voorgrond staat, is het mogelijk geworden dat de pressiegroepen tot zo grote machtsontplooiing konden geraken. In de oude liberale economie toen er nog geen werkloosheidsuitkeringen waren, vormde de werkloosheid inderdaad (veel meer dan thans) een reële barrière tegen excessieve looneisen, maar in onze tijd van sociale wetgeving loopt de werkloze veel minder risico. Hij krijgt in de V.S. gedurende twintig weken uitkering en wanneer de „compensation schemes” van de staten zijn uitgeput, dan springt de Federale overheid, zoals gebleken is, onmiddellijk bij met een „emergency program” dat voorziet in een verlenging van de uitkeringstermijn.

¹⁾ Zie P. A. Samuelson, and R. M. Solow, Analytical Aspects of Anti-Inflation Policy, American Economic Review, Proc., mei 1960 blz. 177-194.

Door deze factoren van institutionele aard, is het dus mogelijk dat het klassieke aanpassingsmechanisme niet werkt zoals door de theorie wordt beschreven en dat een structurele onevenwichtigheid ontstaat. Wil dat nu zeggen, dat we naar de oude tijd terug moeten? Dat zou betekenen dat we de klok veertig of vijftig jaar terugzetten, hetgeen ons inziens niet mogelijk noch wenselijk is. De werkloosheidsuitkeringen vormen een sociale verworvenheid die wij niet graag zouden missen. Bovendien vervullen zij ook economisch een nuttige functie, doordat zij als ingebouwde stabilisator de macro-economische repercussies van de werkloosheid op de algemene economische bedrijvigheid verzachten. Ook de vakbonden kan men niet afschaffen.¹⁾ Wat men moet doen indien men de beide doelstellingen van volledige werkgelegenheid en prijsstabiliteit wil realiseren, is niet de sociale voorzieningen verminderen, maar de ongeremde machtsuitoefening van de pressiegroepen kanaliseren. Dit eist een zodanige institutionele opzet van het loon- en prijssysteem dat de doeleinden van het economisch beleid van de overheid niet worden gefrusteerd. Een en ander kan een zekere controle van de overheid op de loon- en prijsvorming noodzakelijk maken. De taak van de modellenbouwer kan nu zijn dat hij er op wijst, dat de overheidsinterventie niet te sterk moet zijn, omdat anders de optimale allocatie van produktiefactoren wordt verstoord. Op grond van de inzichten die het model verschaft en op basis van de kennis die men heeft van het institutionele mechanisme van de maatschappij zoals dat historisch is gegroeid, kan men dan streven naar een zodanige institutionele opzet van het loonsysteem, dat aan beide gezichtspunten, monetaire stabiliteit en volledige werkgelegenheid enerzijds en optimale allocatie anderzijds, zoveel mogelijk recht wordt gedaan.²⁾ Uiteraard is het ook mogelijk dat monetaire stabiliteit en volledige werkgelegenheid slechts kunnen worden bereikt bij een vrij straffe mate van overheidsinterventie in de loonvorming. Het is dan aan de politieke autoriteiten om uit te maken welke doelstelling zij

¹⁾ In een kritisch commentaar op het in juli 1962 uitgebrachte S.E.R.-advies inzake het systeem van loonvorming betoogt Wemelsfelder dat het probleem van de loonvorming slechts oplosbaar is, indien men het instituut van de C.A.O afschaft en overgaat tot een systeem van individuele loononderhandelingen tussen werkgever en werknemer. Deze opvatting is niet de onze. De vakverenigingen en het systeem van collectieve loononderhandelingen zijn juist in het leven ge-roepen met het oog op de zwakke positie, waarin de werknemer bij een stelsel van volledige mededinging op de arbeidsmarkt verkeert; als zodanig vervullen deze instituties dan ook een belangrijke sociale functie. Zie J. Wemelsfelder, Tekenend symptoom, Het Financiële Dagblad, 11 augustus 1962.

²⁾ Dit is kennelijk ook het streven geweest van de S.E.R. die het advies voor het nieuwe systeem van loonvorming heeft vastgesteld. Zie S.E.R.-advies inzake het systeem van loonvorming, juli 1962.

zullen laten vallen of in mindere mate realiseren. De econoom heeft slechts tot taak de consequenties van de keuze duidelijk te maken. Zoals gezegd kan zowel het inzicht in de historisch gegroeide instituties als de op basis van de modelmatige analyse verkregen kennis hierbij van grote betekenis zijn. Men kan deze taakverdeling voor het onderhavige geval ook als volgt formuleren: het inzicht in de instituties (i.c. groepsvorming, de wijze van loon- en prijsvorming, sociale wetgeving enz.) maakt ons duidelijk, dat naast monetaire en fiscale politiek ook loonpolitiek gevoerd moet worden; de modelmatige analyse maakt ons duidelijk dat deze loonpolitiek liefst op zodanige wijze moet geschieden, dat de optimale allocatie van produktiefactoren zoveel mogelijk gewaarborgd blijft.

Wij hebben hier een concreet voorbeeld enigszins uitgewerkt en natuurlijk is hiermede de betekenis van het modeltheoretisch denken, ook indien men dit begrip bezigt in de beperkte zin van algemene evenwichtsanalyse, slechts zeer onvolledig aangegeven. Dat was ook niet onze bedoeling. Wij wilden slechts de complementariteit tussen de twee benaderingswijzen illustreren in hun dienende taak tot de economische politiek en hierbij duidelijk maken dat de institutionele ontwikkelingen in het economisch bestel ook wel degelijk een onderdeel van de lange-termijn problematiek kunnen zijn.

Indien op de hier geschetste wijze een vruchtbare samenwerking tussen de diverse benaderingswijzen in onze wetenschap tot stand komt, dan is hiermede tevens aan het bezwaar van sommigen, dat het typisch menselijke handelen bij de modellenbouw te weinig tot zijn recht komt, zijn grond ontnomen. Van de Klundert geeft als antwoord op genoemd bezwaar, dat de arbeidsverdeling tussen de maatschappijwetenschappen onherroepelijk en onvermijdelijk is in de huidige tijd en dat van deze wetenschappen de economie per definitie het dichtst betrokken is bij de stoffelijke wereld. De noodzaak van arbeidsverdeling tussen de verschillende maatschappijwetenschappen erkennend, zouden wij toch willen opmerken, dat deze als een noodzakelijk kwaad moet worden beschouwd en nimmer als excuus mag gelden om belangrijke economische facetten van het menselijk handelen en de menselijke activiteit, ook al zijn deze moeilijk in een model te integreren, buiten de economische discipline te houden. De noodzaak van arbeidsverdeling dwingt ons juist met des te groter scherpzinnigheid er op toe te zien, dat dit niet gebeurt. In dit verband zijn wij met Pen van mening, dat dient te worden overwogen of niet de conflictologie, die naast sociologische ook zeer belangrijke economische aspecten vertoont, tot onderwerp van economische analyse moet worden gemaakt.