

# Krisis

Tijdschrift voor actuele filosofie

---

HARRO MAAS

REKENMEESTERS, HEELMEESTERS, VOGELAARS  
DE VINGER AAN DE POLS VAN DE ECONOMIE<sup>1</sup>

Krisis, 2010, Issue 3  
[www.krisis.eu](http://www.krisis.eu)

I

Het CPB bestaat dit jaar vijftenzestig jaar. In deze jaren heeft het zijn sporen verdiend als hét belangrijkste beleidsvoorbereidende instituut op economisch terrein. Het heeft model gestaan en dient nog steeds als ijkpunt voor andere beleidsvoorbereidende instituties als het Sociaal en Cultureel Planbureau of het Planbureau voor de Leefomgeving (Halffman 2009). Dit prestige ontleent het CPB in niet geringe mate aan de onbetwiste autoriteit van zijn eerste directeur Jan Tinbergen en de veronderstelde superioriteit van econometrische modellen als instrument ter voorbereiding van het economisch beleid.

Met Jan Tinbergen begon de traditie van econometrisch modelleren die tot op de dag van vandaag een belangrijk deel uitmaakt van de activiteiten van het CPB. Econometrische modellen zijn wiskundige instrumenten die verschillende heren dienen. Ze geven een representatie van concrete economische structuren; ze geven precisie aan (korte termijn)voorspellingen

over economische ontwikkelingen; en ze dienen als platform voor simulaties, of simulatie-experimenten, waarin de consequenties van veranderingen in de economische omgeving of het economisch beleid systematisch in beeld worden gebracht, de zogenoemde 'spoorboekjes' of 'scenario-analyses'. Als er in de dag- en weekbladen wordt verwezen naar het werk van de 'rekenmeesters van de Van Stolkweg' wordt gewoonlijk gerefereerd naar deze modellen en deze modeltraditie.

De drie genoemde functies van modellen staan niet los van elkaar. Als kortetermijnvoorspellingen van modellen er systematisch naast zitten, rijst de vraag of deze modellen wel een betrouwbare representatie van een economie geven. Milton Friedman beantwoordde deze vraag negatief in een korte, maar zeer puntige kritiek op een 'test' van het macro-econometrische model dat de zogenaamde Cowles Commission for Econometric Research vlak na de Tweede Wereldoorlog van de Amerikaanse economie had ontwikkeld (het Klein-, en later Klein-Goldbergermodel); als een model slechter voorspelt dan een bijna structuurloos model (het weer van vandaag is de voorspeller van het weer van morgen), is er geen reden te veronderstellen dat dit model structurele kenmerken van een economie heeft geïdentificeerd (Friedman 1951, 107-114). Een soortgelijk argument kan worden gegeven voor modelsimulaties. Het heeft alleen zin om scenario's of spoorboekjes met een model door te rekenen als we er vertrouwen in kunnen hebben dat het model waarmee deze scenario-analyses worden gemaakt een representatie geeft van de economie waarvoor deze scenario's worden ontworpen.<sup>2</sup> De beoordeling van modelvoorspellingen, -representaties en -simulaties staan kortom niet los van elkaar, noch staan zij los van de autoriteit en expertise van de economen, statistici en econometristen die deze modellen maken.

Met de val van Lehman Brothers en de kredietcrisis die zich daarop in sneltreinvaart wereldwijd verspreide, werd acuut zichtbaar dat 'speaking precision to power' door middel van modellen niet langer vanzelfsprekend was (Porter 2006). De positieve ramingen over economische groei en begrotingsoverschotten in de Macro-Economische Verkenningen van september 2008 moesten voortdurend naar beneden worden bijgesteld en in de wandelgangen van de Faculteit Economie en Bedrijfskunde van de Universiteit van Amsterdam vertelde Casper van Ewijk, hoogleraar

macro-economie en onderdirecteur van het CPB, toentertijd dat men zich op het CPB ernstig afvroeg wat precies de waarde van econometrische modellen was, nu deze het met de crisis zo ernstig lieten afweten. Hij vertelde over de herwaardering op het CPB van manieren om de ‘vinger aan de pols’ van de economie te houden die met de opkomst van de econometrie in de jaren dertig eigenlijk overwonnen leken en verwees naar twee medewerkers die beiden werkten aan een economische ‘monitor’ die op dat moment, in het najaar van 2008, van meer waarde was om een beeld te vormen van de economische gebeurtenissen dan de modellen van het CPB. Toen de directeur van het CPB in maart 2009 bij Pauw en Witteman aanschoof om een toelichting te geven op de meest recente ramingen van het CPB verwees hij interessant genoeg naar deze twee mensen, en niet naar de respectabele modeltraditie van het CPB om duidelijk te maken hoe het CPB op dat moment zijn ramingen over de economie maakte.

De vragen die ten tijde van de crisis rond de econometrische modelpraktijk naar boven kwamen, maakten de waarde zichtbaar van een empirische benadering van de economie die berustte op een vorm van statistische ervaringskennis die haar neerslag vond in deze ‘monitors’. Deze benadering was op het CPB onder druk van een academisch discours dat zich steeds sterker richtte op verfijnde mathematische en statistische technieken wel bijna maar nooit helemaal verdwenen. In wat volgt ga ik vooral in op deze statistische ervaringskennis en haar eindproduct, een ‘monitor’ van de economie. De waarde hiervan berust in belangrijke mate op het geloof dat een econoom-statisticus in staat is een beredeneerd oordeel te vellen over een heterogene veelheid aan statistische gegevens die uiteindelijk inzicht geven in de huidige stand van de economie. Voordat de kredietcrisis losbarstte kon deze benadering slechts rekenen op lauw academisch enthousiasme. Pas door de kredietcrisis begonnen de hogere echelons van het CPB zich te realiseren dat de nadruk op wat doorgaat voor up-to-date academisch onderzoek minder bijdraagt aan een begrip van de crisis dan verwacht. Dit heeft, in ieder geval gedeeltelijk, geleid tot een herwaardering van empirisch-statistisch werk. Voor oudgedienden op het CPB is dat oud nieuws; zij hebben er, zoals we zullen zien, nooit twijfel over laten bestaan dat zonder ervaringskennis geen kortetermijnvoorspellingen met econometrische modellen te maken zijn.

Voor hen stond daarom ook het belang van het werk aan een economische monitor niet ter discussie.

Mijn verhaal is historisch en beschrijvend van karakter. Ik geef eerst een (enigszins opgeschoond) transcript van het interview van Teulings bij Pauw en Witteman, om vervolgens, via een bespreking van de veranderende rol van de econoom in het publieke domein ten gevolge van de kredietcrisis in te gaan op de achtergrond van beide vormen van representatie van een economie: monitoren en modelleren.<sup>3</sup> Die ligt in de opkomst van statistisch conjunctuuronderzoek in het interbellum. Mijn bespreking van deze achtergrond roept tevens de vraag op wat het ‘wetenschappelijke profiel’ van een econoom behelst – is hij een expert-deelnemer in een publiek debat zoals de huidige economische BN’ers of zoals Keynes vroeger, die in een van zijn laatste gesprekken met Hayek gezegd zou hebben dat hij ‘met een knip van zijn vingers’ de publieke opinie kon veranderen, of is het iemand die op de achtergrond, buiten het publieke bereik, zijn expertise inzet?<sup>4</sup> En wat houdt die expertise dan eigenlijk in? Berust die op jarenlange ervaringskennis met statistische data, of uit up-to-date academische inzichten? Of bestaat deze expertise per saldo, in tijden van crisis, misschien uit niets anders dan het vermogen een beredeneerd oordeel te vellen over de stand en toekomstige ontwikkeling van de economie, een oordeel dat in het beste geval richting geeft aan beleid?

## II

*Op 17 maart 2009 trad Coen Teulings, directeur van het CPB, op in het praatprogramma van Pauw en Witteman voor een interview over de kredietcrisis naar aanleiding van de economische prognoses die het CPB die dag had gepubliceerd. Rond de tafel zaten, zoals gewoonlijk, een aantal andere gasten waaronder Anne-Marie Rakhorst, een specialiste op het gebied van de woningmarkt die was uitgenodigd omdat ze was genomineerd als vastgoedvrouw van het jaar. Teulings was het eerst aan de beurt.*

[...]

*Witteman:* We beginnen met de economie en u meneer Teulings, hoewel ik eigenlijk moet zeggen dat we eerst naar Amerika gaan. Want daar was zomaar iemand, en niet zomaar iemand, maar er was zomaar iemand die zei dat het nog wel eens vrij snel goed zou kunnen komen en die man is de baas van de Federale Bank daar, Ben Bernanke, en die zei dit: (volgt een fragment uit de persconferentie van Bernanke dat groot geprojecteerd wordt) *Bernanke:* There is a good chance that the recession will end later this year and that 2010 will be a period of growth.

*Witteman:* En dan is de vraag: Hier ook?

*Teulings* [*zoekt naar een begin*]: Voor 2009 weten we langzamerhand redelijk waar we aan toe zijn. We gaan 3,5% krimpen, dat kan wat meer zijn, wat minder, maar dat is wel redelijk vast. We zijn ook al twee maanden onderweg. Voor 2010 is het allemaal nog zeer onzeker. Je ziet dat Europa in deze crisis wat achterloopt op Amerika; Amerika loopt, zeg maar, een half jaar voor, dus dat maakt al uit ...

*Witteman* [*onderbreekt*]: Dus dat zou ook gelden voor het herstel?

*Teulings* [*knikt bevestigend*]: Dat zou voor het herstel ook zomaar kunnen gelden en ... ja, de onzekerheid blijft groot. Dus ... het is goed dat meneer Bernanke zo optimistisch is, we moeten voorlopig nog even kijken hoe zich dat precies gaat ontwikkelen.

*Witteman:* Zegt zo'n man nou de waarheid? Ik bedoel, in die zin: manipuleert hij met de waarheid omdat hij denkt: 'het is goed als iemand van mijn positie op dit moment wat aardigs, wat positiefs laat horen?'

*Teulings* [*nadrukkelijk*]: Ik weet dat niet. Mij lijkt dat iedereen in zo'n positie nadenkt over de gevolgen van niet de waarheid spreken, namelijk als je een keer ... voor je ... laten we zeggen om mensen moed in te spreken maar zeg je 'het komt allemaal wel goed' en het komt niet goed, dan ben je je geloofwaardigheid kwijt en dat is veel erger. [*haalt diep adem*] Dus ik neem aan dat hij goede redenen heeft gehad om dit te zeggen, er waren vandaag berichten dat de Amerikaanse huizenmarkt eindelijk weer aantrok en dat is echt de voorwaarde voor herstel. [*Anne-Marie Rakhorst,*

*vastgoedspecialiste, knikt bevestigend*] Ik heb dat nog niet gezien, ik heb dat eigenlijk net op het journaal gehoord. ... Dus we moeten maar kijken wat daar verder [gebeurt – HM], we wachten af en dan komt er meer helderheid.

*Pauw:* Dit is een belangrijke man. Hij wordt in Amerika op de president na als de belangrijkste man gezien als het gaat om economische voorspellingen, vanwege zijn functie die hij heeft, Ben Bernanke. Die zegt, het gaat goed met de huizenmarkt, er worden meer huizen gebouwd in Amerika in de maand februari. We hoorden eind vorige week al wat voorzichtige berichten dat het bij de banken alweer wat beter zou gaan. Memootjes van de topman van de City-group die zei dat er in februari en januari alweer een beetje een lift zat. Dat zijn toch allemaal elementen die u ook meeneemt, neem ik aan, als u dat allemaal hoort, in de voorspellingen die u geeft. Of helemaal niet?

*Teulings:* Nou, kijk, de voorspellingen die we nu hebben ... de ramingen die we nu hebben afgegeven die zijn feitelijk afgesloten in februari. 17 februari zijn we met die ramingen naar buiten gekomen dat de economie dit jaar 3,5% krimpt.<sup>5</sup> We hebben de afgelopen maanden, de afgelopen maand bijgehouden wat er aan nieuw bericht binnenkwam en dat spoorde over het algemeen vrij aardig met wat wij in februari hadden voorzien. Het was eigenlijk iets negatiever. Dit is een bericht – nu vandaag over de Amerikaanse huizenmarkt – dat misschien wat positiever is dan we verwachtten ... ja, het gaat altijd een beetje heen en weer. Dus dat kun je niet langs een ... op een goudschaaltje wegen.

*Pauw:* Ja maar kun je nou zeggen dat er reden voor optimisme is als de plek waar het slechte nieuws vandaan kwam nu de plek is waar voorzichtig goed nieuws vandaan komt?

*Teulings:* Ja, dat is op zich gunstig. Maar er is ook een heleboel ander nieuws dat juist weer slecht nieuws is dus ... Laten we wel ... De afgelopen maand zijn de aandelenkoersen weer fors onderuitgegaan. Nou, dat was heel slecht nieuws. De wereldhandel, die de voornaamste reden is voor de verslechtering van de Nederlandse economie, die is in november met 5% achteruitgegaan, die is in december met 5% achteruitgegaan, zo,

gemiddeld genomen, en in januari zag het er ook niet heel best uit. Dus ja, een zwaluw maakt niet onmiddellijk lente.

*Witteman:* Gooit u al die zwaluwen nou in een volièrre en daar [*steekt arm naar voren*] steekt u een thermometer in ... [*Teulings:* Ja, zo doen we dat] [*gelach aan tafel*] Dus al die berichten ... [*Teulings:* Dus er zijn bij ons mensen ...] die we tevoren even opnoemden die komen ook allemaal ... [*Teulings:* Ja.] in uw ... ja wat is het ... computer uiteraard?

*Teulings:* Niet in de computer. Er zit, er zijn bij ons een aantal mensen, dat heet bij ons de afdeling Internationale Conjunctuur, en die houdt gewoon bij ... die geeft iedere week een berichtje uit met dit zijn de nieuwsfeiten van de komende week, dit zijn de persconferenties die gepland zijn, dit was wat er van de vorige week is uitgekomen. En gegeven wat we verwachten viel dat tegen en valt dat mee ... en op die manier houden we als het ware permanent de vinger aan de pols.

*Pauw:* Nou heeft u het over procenten en procenten groei of procenten krimp: dat is natuurlijk ook soms wat moeilijk te voelen. Is het zo, d'r zijn mensen die zeggen: 'Kijk, als je drie procent krimp hebt, dan kom je dus (behalve als je je baan verliest) eigenlijk gewoon uit op het welvaartsniveau wat je had in 2006.' Is het zo simpel?

*Teulings:* Ja ... nou, ik denk dat het uiteindelijk alles bij elkaar wat forser zal zijn. Dat als je nou die hele kredietcrisis straks achter de rug hebt ... dat dan zal blijken dat je, qua welvaartsniveau, weet ik veel, per inwoner – daar moet je ook nog een beetje rekening mee houden – 2004, 2005 of zo zit. Maar dat is inderdaad waar: in die zin is het allemaal best te overleven. In 2004 of 2005 was het in Nederland ook best aardig toeven. ... Maar het komt natuurlijk zeer ongelijk terecht. Mensen die werkloos worden of mensen die nu twee huizen hebben ... ja, die hebben het echt lastig. Dus de gevolgen van zo'n crisis zijn zeer ongelijk verdeeld en daar hebben sommige mensen ... kunnen het daar zeer zwaar mee krijgen.

(*Hierna ging Witteman over naar Anne-Marie Rakhorst*)

### III

In maart 2009 was de kredietcrisis een dik halfjaar oud. Met het uitbreken van de crisis, in september 2008 met de val van Lehman Brothers, transformeerden economen van specialisten achter de schermen in publieke persoonlijkheden en opiniemakers. Waar economenblogs tot dan toe een goed bezocht, maar gespecialiseerd publiek hadden gekend, kon een discussieforum als *Mejudice* in Nederland, of persoonlijke blogs van Paul Krugman, Joseph Stiglitz en vele anderen zich in korte tijd verheugen in de warme belangstelling van een veel breder publiek dan alleen economen. In Nederland groeiden economen als Sweder van Wijnbergen, Arnout Boot en Sylvester Eijffering uit tot BN'ers die niet van de beeldbuis waren weg te slaan. Maar hetzelfde gold voor mensen als Nout Wellink, president-directeur van de Nederlandsche Bank, of Coen Teulings, directeur van het Centraal Planbureau, die ineens in praatprogramma's werden uitgenodigd (of zorgden dat ze werden uitgenodigd) om hun kant van het verhaal te vertellen.

Op een enkele uitzondering na speelden economen tot dan toe een geheel andere rol. Niet die van publieke persoonlijkheid, maar van specialist op de achtergrond. De financiële crisis maakte niet alleen dat deze specialisten zich uit zichzelf aanmeldden in het publieke domein, maar ook dat er vanuit het publieke domein behoefte bestond om beter te begrijpen hoe economen aan hun kennis over de economie kwamen en wat de waarde van dergelijke kennis was. Als ze de crisis niet hadden zien aankomen (en dat hadden ze niet), hoe konden ze dan nu wel met autoriteit spreken over de toestand en toekomstige ontwikkeling van de economie?<sup>6</sup> Wat voor soort instrumenten hadden ze om 'de waarheid' te spreken over de economie? Waren dat wel de juiste instrumenten?<sup>7</sup>

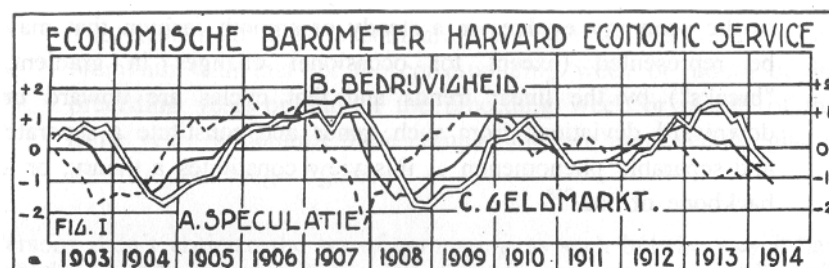
In een paginagroot interview in *NRC Handelsblad* van zaterdag 25 en zondag 26 oktober vertelde Willem Buiters, toentertijd verbonden aan de *London School of Economics* en tegenwoordig eerste econoom van de Citybank, over de verbijstering die hem was overvallen in de eerste weken van de crisis: 'Zo'n catastrofale inzinking in vertrouwen en zo'n golf van vrees en volkomen irrationeel pessimisme heb ik nooit eerder gezien. Je moet het echt gezien, gehoord en geproefd hebben voordat je de kracht

en het onwezenlijke ervan onderkent.<sup>8</sup> Een opmerkelijke uitspraak. Want hoe zie, hoor of proef je een kredietcrisis? Welke smaak heeft een daling van de beurskoersen? Hoe 'hoor' je het onwezenlijke van irrationeel pessimisme? Jeroen Pauws vraagt aan Teulings hoe procenten daling van het BNP precies te voelen zijn sloeg de spijker op de kop, net als Wittemans vraagt hoe Teulings een thermometer in de economie stopt. Een thermometer is een prima manier om de toestand van een patiënt te peilen. Iemand die de 'vinger aan de pols' van de economie wil houden, zou graag de beschikking over zo'n instrument willen hebben. Hadden economen wel een dergelijk instrument? Witteman dacht dat zo'n instrument 'uiteraard' de computer was, maar opvallend genoeg werd juist dat door Teulings ontkend. Opvallend, omdat het CPB zijn naam en faam tot op de dag van vandaag ontleent aan zijn economische structuurmodellen.

## IV

Witteman verwoordde eigenlijk het oude ideaal van een conjunctuurbarometer. In navolging van de zogenaamde ABC-barometer die door de economische studiedienst van Harvard in 1919 was ontwikkeld (zie afbeelding 1), was het vooral John Maynard Keynes geweest die de ontwikkeling van gelijksoortige barometers voor de Europese landen stimuleerde.<sup>9</sup> Aanleiding vormden de zogenaamde wederopbouwsupplementen die de *Guardian* na de Eerste Wereldoorlog uitbracht, waarvan Keynes de gastredacteur was. Keynes wilde door middel van deze barometers de inspanningen van de wederopbouw na de Eerste Wereldoorlog zichtbaar maken voor het brede publiek. Maar de Harvard-barometer beloofde meer te zijn dan louter een representatie van de verschillende Europese economieën. Door te spreken van een *barometer* speelden de Harvard-economen met het gegeven dat een barometer zowel een momentopname als een kortetermijnvoorspeller, in dit geval van een economie, is. Bovendien suggereerden de drie verschillende grafieken in het diagram een volgtijdelijke samenhang van de drie afgebeelde markten: de effectenbeurs (speculatie), de goederenmarkt en de geldmarkt. In hun *show-case*presentatie leek het dat de gebeurtenissen op de effectenbeurs vooruitliepen op de ontwikkelingen op beide andere markten. De Harvard-barometer leek daarmee

inderdaad de 'vinger aan de pols' van de economie te houden. Hij toonde de huidige ontwikkeling en gaf tegelijkertijd een indicatie van de richting waarin de reële productie zich in de toekomst zou ontwikkelen. Ook al oversteeg een dergelijke interpretatie de bedoelingen van Keynes, het was met een dergelijk doel dat het conjunctuuronderzoek in Nederland op het CBS (niet het CPB – dat was er nog niet) in de jaren twintig werd opgepakt. Dit onderzoek vormde de achtergrond voor Tinbergens economische modellenbouw in de dertiger jaren.



Afbeelding 1. Harvard-barometer. Bron: Adrienne van den Bogaard (1998) *Configuring the Economy. The Emergence of a Modelling Practice in the Netherlands, 1920-1955*. Amsterdam: Thela/Thesis), 114.

In zijn retrospectief geschreven *Dagboek Conjunctuuronderzoek* schreef het toenmalige hoofd van de afdeling Conjunctuuronderzoek M.J. de Bosch Kemper dat zijn hoop in eerste instantie gericht was op de ontwikkeling van een instrument dat 'vrijwel automatisch' niet alleen de huidige toestand van de economie zou weergeven, maar ook een indicatie zou geven over het toekomstig verloop van de conjunctuur (De Bosch Kemper 1933).

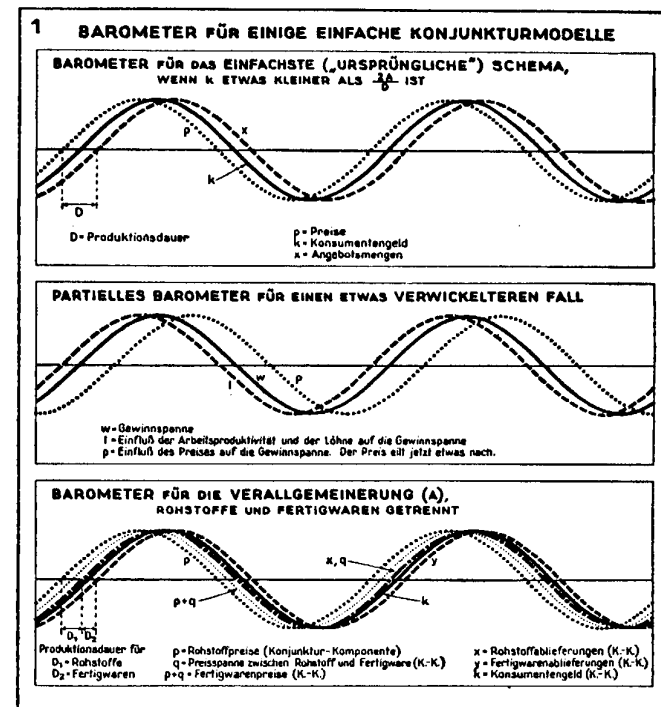
Al snel bleek dat daar helemaal niets van terecht kwam. Zonder veel succes worstelde De Bosch Kemper met zo'n vijftig verschillende tijdsereïes die hij tot eenzelfde eenvoud probeerde te comprimeren als de drie grafieken van de Harvard-barometer.<sup>10</sup> Ook de lijnen van deze barometer bestonden uit een samenstel van andere tijdreeksen. Het was

met een bijna hoorbare zucht van verlichting dat De Bosch Kemper melding maakte van de komst van Jan Tinbergen op zijn afdeling (De Bosch Kemper 1933, 10). De Bosch Kemper (en niet alleen hij) was duidelijk onder de indruk van Tinbergens statistische en wiskundige vaardigheden (verworven tijdens zijn studie natuurkunde onder Ehrenfest in Leiden) en al snel nam Tinbergen het voortouw bij de ontwikkeling van de barometer. Tinbergen vormde de conjunctuurbarometer om in een vergelijkende representatie van Nederland met de economieën van Engeland, de VS en Duitsland voor de goederenmarkt, de effectenmarkt en de geldmarkt die in drie verschillende diagrammen werden afgebeeld. In tegenstelling tot de Harvard-barometer suggereerde Tinbergens barometer geen causale samenhang meer tussen deze drie markten.<sup>11</sup> Het werd een louter beschrijvende vergelijking van de stand van de economie in een aantal belangrijke handelspartners van Nederland zonder voorspellende pretenties. Van De Bosch Kempers ideaal van een instrument dat automatisch de huidige stand en kortetermijnontwikkeling van de (Nederlandse) economie zou aangeven, was weinig over.

V

Tinbergen gooide het conjunctuuronderzoek op het CBS over een geheel andere boeg. In plaats van een statistisch instrument te ontwikkelen dat de stand van de conjunctuur 'automatisch' zou registreren en voorspellen, ontwikkelde hij een geheel ander soort 'barometers': wiskundig modellen – die hij in het begin ook wel aanduidde als 'schemata' of 'wiskundige machines'. Dergelijke modellen waren geïdealiseerde representaties van de causale samenhang – de structuur – van verschillende macro-economische variabelen in een fictieve economie. Tinbergen stoeide met de wiskundige karakteristieken van deze modeleconomieën die hij probeerde de laten aansluiten bij een aantal 'gestileerde feiten' over conjunctuurcycli, zoals de gemiddelde lengte van een conjunctuurgolf. Afbeelding 2 laat zien dat Tinbergen zich in deze zoektocht duidelijk liet inspireren door de Harvard-barometer. Maar waar de Harvard-barometer beruiste op zwaar bewerkte statistische tijdseries, beschreef Tinbergens 'barometer' een fictieve wereld die pas in een volgende stap aan statistische

tijdreeksen werd geschat. Tinbergens modelexercities mondden in 1936 uit in het eerste model van een economie (de Nederlandse) ooit dat aan statistische data was geschat. Kort daarop vertrok Tinbergen naar Genève om in opdracht van de Volkerenbond onderzoek te doen naar conjunctuurtheorieën. In dat kader ontwikkelde hij een gelijksoortig model van de Amerikaanse economie. Wiskundige modellen (en niet het type barometers als van Harvard) gingen dienen om uitspraken te doen over de huidige stand en het toekomstige verloop van een economie. Met deze twee modellen begon de modeltraditie die met Tinbergen als eerste directeur kenmerkend zou worden voor het vlak na de Tweede Wereldoorlog opgerichte Centraal Planbureau.



Afbeelding 2. Een voorbeeld van Tinbergens geïdealiseerde 'barometers'. Het bovenste diagram geeft prijzen, consumptie en goederenproductie weer. Het middelste diagram is

# Krisis

Tijdschrift voor actuele filosofie

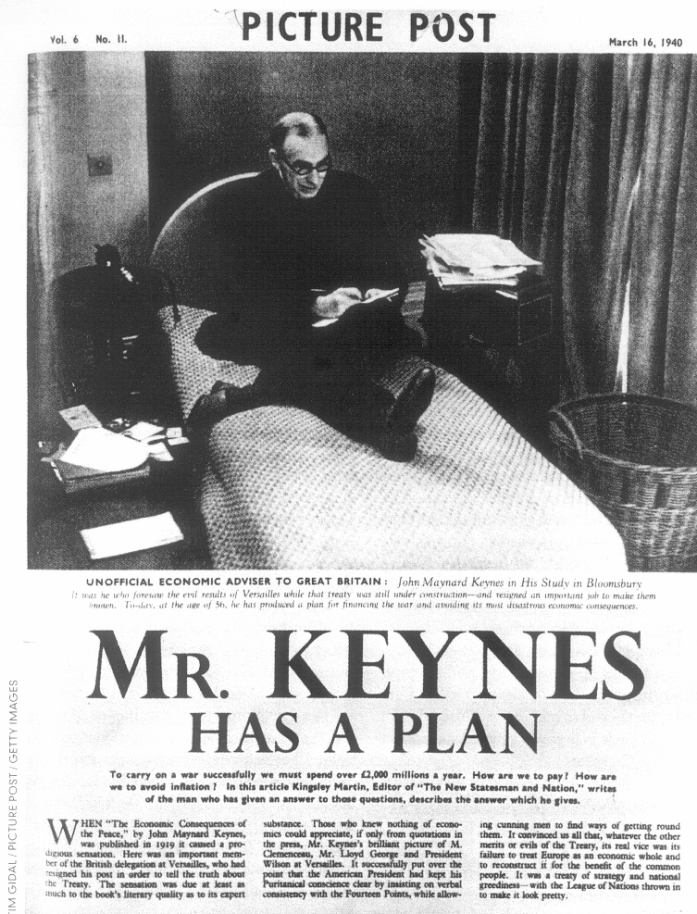
een 'partiële barometer' voor een 'iets gecompliceerdere situatie' waarin Tinbergen de invloed van wijzigingen in de arbeidsproductiviteit en lonen onderzoekt. Het onderste diagram toont een 'gegeneraliseerde barometer', waarin grondstoffen en eindproducten apart worden behandeld. Bron: Jan Tinbergen (1936) 'Über den Wert mathematischen Konjunkturtheorien'. *Beiträge zur Konjunkturlehre. Festschrift zum zehnjährigen Bestehen des Instituts für Konjunkturforschung*. Hamburg, 198-224.

VI

In een roemruchte bespreking in de *Economic Journal*, het huisblad van de Britse Royal Economic Society waarvan hij de hoofdredacteur was, leverde Keynes een vernietigende kritiek op Tinbergens werk voor de Volkerenbond. Keynes maakte bezwaar tegen de willekeurige selectie van de variabelen in het model, die eerder leken te zijn gekozen op pragmatische gronden dan op basis van een coherente analyse van de samenhang van economische grootheden. Hij maakte bezwaar tegen het gebruik van alleen maar lineaire vergelijkingen, terwijl duidelijk was dat dit een ongeoorloofde simplificatie was, en tegen de lukraak bij elkaar geraapte statistische tijdreeksen die Tinbergen gebruikte om zijn vergelijkingen te schatten.<sup>12</sup>

Keynes vreesde dat de belangrijkste drijfveer voor Tinbergen was geweest om de 'klus te klaren', onafhankelijk van wat eigenlijk de waarde van de klus zelf was. En hij vreesde nog meer dat Tinbergen maar al te bereid zou zijn om dit allemaal toe te geven, maar dat hij vervolgens 'zijn verdriet zou verdrinken' door nog meer rekenaars ('computers' – dat waren toen natuurlijk nog mensen) in te huren. Voor Keynes was Tinbergens model *a nightmare to live with*, en het was hem een raadsel hoe de Volkerenbond Tinbergen met een dergelijke opdracht had kunnen opzadelen, alsof er in 1939 aan de vooravond van een nieuwe wereldcatastrofe geen dringender zaken waren.

Harro Maas – Rekenmeesters, heelmesters, vogelaars



Afbeelding 3. John Maynard Keynes in zijn studeerkamer in Bloomsbury, naar aanleiding van zijn plannen hoe de oorlog tegen Duitsland te financieren. 16 maart 1940. Bron: Getty Images.

Weliswaar had Keynes zelf de ontwikkeling van conjunctuurbarometers aangemoedigd, maar niet met de inzet om in modelvorm een soort quasimechanische wiskundige beschrijving van een economie te

produceren. De volgende, sterk geposeerde foto van Keynes in zijn werkkamer in Bloomsbury toont een geheel andere werkwijze (zie afbeelding 3). Volkomen ontspannen zit Keynes op zijn chaise longue. Naast de bank staat een grote rieten wasmand die dienst doet als prullenbak. Keynes is omringd met papier – rapporten en documenten die ongetwijfeld betrekking hebben op voorgenomen overheidsbeleid, of die samenvattingen geven van belangrijke economische gebeurtenissen. Opschrijfboekje losjes in de hand om aantekeningen te maken. Op een tafeltje een telefoon voor het geval een hoge overheidsfunctionaris, of de minister-president zelf hem belt voor advies. ‘Mr. Keynes has a plan’, schreeuwt de tekst onder de foto. Keynes, de morele held die ziedend wegliep van de onderhandelings-tafel in Versailles, omdat hij vond dat de geallieerden een duurzame vrede verkwanselden voor een wraakoefening op de Duitsers die ongetwijfeld op een nieuwe catastrofe uit zou lopen. Keynes, de informele adviseur waar de Britse overheid niet omheen kon. Keynes, die uitdokterde hoe Groot-Brittannië de nieuwe oorlogsinspanning zou kunnen doorstaan. In tegenstelling tot Tinbergens poging om de structuur van een economie in de objectieve taal van wiskunde en statistiek te beschrijven en te schatten, spat de centrale rol van Keynes’ persoonlijke oordeelsvermogen van de foto. Voor Keynes is de taak van de econoom om vanuit zijn diepgaande persoonlijke kennis van de economie te komen tot een oordeel dat ook richting geeft aan beleid. Keynes functioneert zelf als de thermometer die ‘voeling heeft’ met ‘de economie’.

Voor de naoorlogse economische professie voerde Keynes een achterhoedegevecht. Weliswaar werden zijn ideeën van grote waarde gevonden, maar zij hingen te zeer op zijn persoonlijke oordeel. Voordeel van een modelmatige aanpak als die van Tinbergen was dat zijn resultaten objectief toegankelijk waren; iedereen (met de juiste opleiding) was in staat de schattingsresultaten te controleren. Deze waren niet afhankelijk van de subjectieve bril van de individuele econoom. Bovendien verleenden modellen precisie aan vage voorstellen. Waar Keynes in de ogen van de opkomende klasse van econometristen alleen maar in staat was *plausible stories* te produceren, garandeerde Tinbergens werkwijze objectieve en toetsbare resultaten. Zij leek daarmee een instantiatie van de roemruchte uitspraak van een van de grondleggers van de kwantitatieve statistiek, Karl

Pearson, dat ‘scientific man has above all things to strive for self-elimination in his judgments’.<sup>13</sup>

## VII

Dat gold zeker in het Nederlandse verzuilde polderlandschap. Al in de ambtelijke nota uit 1936 waarin Tinbergen zijn model presenteerde maakte hij duidelijk hoe het model de vragen objectiverde en disciplineerde die aan en over de economie gesteld konden worden:

‘Het zou voor een doelmatige discussie van groote waarde zijn, wanneer de bezwaren tegen het hier weergegeven model aldus geformuleerd werden, dat daarbij steeds werd vermeld op welke vergelijking zij betrekking hebben, of welke detaillering van het model als noodzakelijk wordt gezien’ (Tinbergen 1936).

In dezelfde geest schreef de voorlaatste directeur van het CPB, Henk Don, in een gezamenlijk artikel uit 2006 met Johan Verbruggen, hoofd CPB afdeling Conjunctuur:

‘Many policy measures in the macroeconomic sphere can only be understood and discussed properly with the help of a model which sets out the key relationships between macroeconomic variables. Such a model is an important instrument in considering relevant relationships’ (Don en Verbruggen 2000).

In de Nederlandse context structureerden en beperkten econometrische modellen de politieke speelruimte. Juist omdat deze modellen gekwantificeerd en – althans op het oog – ‘objectief’ waren, werd het CPB het instituut bij uitstek dat politiek onpartijdig ‘de waarheid zei’ (Van den Boogaard 1998). In de jaren zestig en zeventig groeide het prestige van het CPB tot zulke hoogten, dat de Nederlandsche Bank besloot tot een herstructurering van haar eigen onderzoeksafdeling en tot de ontwikkeling van een eigen econometrisch model, omdat zij het in instellingen als



de SER bij voortdoring moest afleggen tegen de veel gedetailleerdere en coherenter analyses van het CPB (Maas 2010, hoofdstuk 9).

Gedetailleerder, omdat het model door de almaar toenemende rekencapaciteit van computers complexere modelspecificaties toeliet, waarbij de weliswaar ook statistisch onderbouwde, maar toch grotendeels verbale analyses van de Nederlandsche Bank bleek afstaken. Coherenter, omdat de causale samenhang tussen de variabelen tot in de plussen en minnen kon worden gevolgd. Vanwege deze deugden wist ook kritiek vanuit academia in het begin van de jaren tachtig de onafhankelijke status van de analyses en voorspellingen van het CPB nooit effectief in twijfel te trekken.<sup>14</sup> Weliswaar richtte de economische horzel Eduard Bomhoff het concurrerende onderzoeksinstituut Nyfer aan de business school van Nijenrode op, maar zijn glazen bol kon toch niet wedijveren met de berekeningen die aan de Van Stolkweg in Den Haag werden geproduceerd.<sup>15</sup> Het meest kenmerkend voor de onafhankelijke status van het CPB tot op de dag van vandaag is de volstrekt unieke Nederlandse polderfolklore om partijprogramma's op de pijnbank van het CPB te leggen, waarna het goedkeuringsstempel vervolgens te pas en te onpas een rol speelt in het politieke debat. Wie wilde weten hoe het er met de Nederlandse economie voorstond, stelde een vraag aan het model, dat, zo was lange tijd het beeld, vervolgens een onpartijdig en onafhankelijk antwoord gaf.

## VIII

Witteman had duidelijk deze modeltraditie van het CPB voor ogen toen hij Teulings vroeg of alle nieuwsfeiten die tijdens het interview over de tafel vlogen 'uiteraard' in een computer werden gestopt. Zijn vergelijking met een 'volière' leek net als Pauws vraag naar de gevoelswaarde van procenten een poging om de werkwijze en conclusies van het CPB te visualiseren. Verrassend genoeg wilde Teulings al tijdens Wittemans vergelijking zeggen dat op het CPB de 'vinger aan de pols wordt gehouden' door een aparte afdeling, de afdeling Internationaal Conjunctuuronderzoek.<sup>16</sup> En nee, de nieuwsfeiten die over de tafel gingen, gingen *niet* de computer – een model – in, maar werden bijgehouden in een nieuwsbrief

die iedere week op het CPB werd gedistribueerd. In deze nieuwsbrief stonden de belangrijkste nieuwsfeiten van de afgelopen week, geplande persconferenties, dat soort nieuws.

Niet het model dient als een soort 'thermometer' om de 'vinger aan de pols' van de economie te houden, maar een aparte afdeling, Internationaal Conjunctuuronderzoek, die nieuwsfeiten verzamelde en deze op wekelijkse basis binnen het CPB distribueerde. Aan wat voor nieuws moesten we denken? Aan 'persconferenties die gepland zijn', aan memootjes van een CEO van de City-groep, waarin staat dat het alweer stukken beter gaat met de banken? Naast statistische informatie was dat het soort nieuws dat mensen als Keynes (of tegenwoordig Krugman) gebruikten om te beoordelen in welke richting de economie zich bewoog om vervolgens een oordeel te vellen over de vraag of de voorgenomen beleidsmaatregelen wel de juiste zijn. *Can Lloyd George Do It?* dat Keynes in 1929 in *The Nation and Athenaeum* publiceerde, was zo'n soort stuk. Was het mogelijk om Engeland door middel van inflatoir begrotingsbeleid de crisis uit te financieren? En welke feiten ondersteunden Keynes' oordeel?

Dat Teulings een verzameling van nieuwsfeitjes en persconferenties publiekelijk naar voren haalde, was te meer opvallend omdat er tot het uitbreken van de kredietcrisis bij internationale visitatiecommissies maar weinig waardering bestond voor de medewerkers van de afdeling Internationaal Conjunctuuronderzoek die van het systematisch verzamelen van economisch nieuws hun dagelijks werk hadden gemaakt. Zij maakten een beredeneerde keuze uit de ongeveer 5000 berichten die dagelijks door Bloomberg gepubliceerd worden, misschien wel de belangrijkste up-to-date site voor economische 'feitjes'.

Internationale visitatiecommissies die de kwaliteit van het onderzoek op het CPB onderzochten, waren altijd vol lof over de prestaties van de modellenbouwers, maar ze waren veel minder te spreken over de afdeling Internationaal Conjunctuuronderzoek. Het advies was om 'fewer resources' te besteden aan het produceren van 'in-house forecasts of foreign variables that are easily available from a variety of international sources. Examples would be macroeconomic data from trading partners, e.g. real growth, inflation, or global variables such as oil prices, etc.'<sup>17</sup> In gewoon

Nederlands, het werk van de afdeling Internationaal Conjunctuuronderzoek was niet wetenschappelijk, zonder theoretisch fundament, slecht controleerbaar en gedreven door willekeur in de dataverzameling.

Toen Teulings in 2006 als directeur van het CPB aantrad, overwoog hij om deze afdeling op te heffen. Door interne oppositie binnen het CPB, onder andere vanuit de afdeling Conjunctuur (die verantwoordelijk is voor de macromodellenbouw), maar ook door oppositie vanuit de Haagse departementen en zelfs vanuit de Europese Commissie, zijn deze overwegingen nooit buiten de muren van het CPB gekomen. Een van de medewerkers van de afdeling Internationale Conjunctuur wordt nu gedeeltelijk door de Europese Commissie betaald.

Met het uitbreken van de kredietcrisis bleek juist de dataverzameling en -analyse door deze medewerkers van onschatbare waarde. Toevallig had ik vlak na de uitzending van Pauw en Witteman een interview met beide betrokken medewerkers, en zij waren begrijpelijk uitgelaten over de erkenning die zij eindelijk, en zo publiekelijk, voor hun werk kregen. In plaats van een model had een van hen, Gerard van Welzenis, een 'wereldhandelsmonitor' ontwikkeld die op basis van maandcijfers de groei of krimp van de wereldhandel liet zien. Wim Suyker maakte wat hij een *world-release assessment-monitor* noemde.<sup>18</sup>

## IX

Van Welzenis construeert zijn monitor op basis van zo'n 4000 verschillende tijdreeksen, lopend van de maandelijksse handelscijfers van Argentinië tot die van Zuid-Korea. Van Welzenis had in de jaren negentig onder leiding van Hans Timmer meegewerkt aan de constructie van een wereldmodel.<sup>19</sup> Dat model is uiteindelijk nooit in gebruik genomen, ook al heeft hun werk wel bijgedragen aan de modellen die het CPB in de jaren negentig ontwikkelde. Aan het eind van de jaren negentig kwam Van Welzenis te werken op de afdeling Internationale Conjunctuur, waar hij begon met onderzoek naar de verhouding van economische voorspellingen en realisaties. Een van zijn conclusies was dat de kwaliteit van

voorspellingen belangrijk zou kunnen worden verbeterd door het gebruik van een zo goed mogelijke economische monitor (ook wel aangeduid als *nowcasting*), met name voor internationale goederenhandel en de daarmee nauw verbonden industriële productie. In dat kader begon Van Welzenis met de verzameling van wereldhandelscijfers, eerst op basis van een beperkt aantal tijdreeksen, maar vervolgens op basis van een steeds uitgebreidere set statistische tijdreeksen (die zich nog steeds uitbreidt). Door jarenlange ervaring heeft hij een expertise ontwikkeld over de kwaliteit van de statistische datareeksen die hem er, sporadisch, toe brengt een buitenlands statistisch instituut te benaderen wanneer hij een specifiek cijfer niet vertrouwt.

Voor een onderzoeksvisitatiecommissie is een dergelijke manier van werken onnavolgbaar. Zo zij er al iets van waarde in kon zien, was Van Welzenis' werk een vorm van beschrijvende statistiek; zonder enige blik op economische theorie zocht hij naar een zo precies mogelijk cijfer voor de (verandering van de) wereldhandel. Dat was geen werk voor een beleidsvoorbereidend onderzoeksinstituut met wetenschappelijke pretenties als het CPB.

Het moet voor Teulings dan ook een verrassing geweest zijn dat Van Welzenis' getallenacrobatiek met wereldhandelscijfers nauwlettend gevolgd werd door de toenmalige Europese Commissie, en ondertussen zelfs ook door de Wereldbank en de OESO gebruikt worden. Van Welzenis behoort tot het uitstervende ras van economen-statistici die bij wijze van spreken bij een verandering in een statistisch gegeven weten welk bedrijf waar een grote order had geplaatst; iemand voor wie binnen de steeds sterker geacademiseerde cultuur van het CPB steeds moeilijker plaats was. Het succes van Van Welzenis' wereldhandelsmonitor tijdens de eerste maanden van de kredietcrisis heeft evenwel tot gevolg gehad dat het CPB ondertussen (ook op de Engelse versie van zijn website) adverteert met de *rather unique monthly world trade monitor* die het gebruikt voor zijn modelmatige kwartaalprojecties. Van Welzenis' berekening van de verandering in de wereldhandel dient als een van de belangrijkste inputs in de kortetermijnvoorspelmodellen van het CPB. Dat is ook begrijpelijk, want een model biedt een structuur, maar zegt uit zichzelf niets over veranderingen in variabelen waarvan de waarde buiten het model tot

stand komt. Voor Nederland zijn veranderingen in de wereldhandel daar een belangrijk voorbeeld van.

datum	land	variabele	maand	resultaat	index	volg	volg
6-mrt	Brazili	industrial production	1 jan	2.3% mom -17.2% 12m worst on record (1991)	0	-0.94	0 -206
9-mrt	Turkey	industrial production	1 jan	-21.3% mom t-1 -17.6	-1	-0.90	-1 -207
9-mrt	France	GDP forecast	1 Q1	0.6% qoq unchanged	0	-0.87	0 -207
9-mrt	Taiwan	foreign trade	1 feb	x -28.8% 12m t-1 -44.1 m -31.6 t-1 -56.5	-1	-0.85	-1 -208
9-mrt	Japan	current account	1 jan	first deficit in 13 yrs	-1	-0.82	-1 -208
9-mrt	Japan	bank loans	0 feb	3.5% 12m t-1 3.6	0	-1.00	0 -208
9-mrt	Slovak Rep	industrial production	1 jan	-27% 12m worst in decade automotive -47.7% t-1 -44.6	-1	-1.00	-1 -210
9-mrt	Cyprus	tourism arrivals	1 feb	-19.3% 12m	-1	-1.00	-1 -211
10-mrt	Germany	foreign trade	2 jan	x -4.4% mom t-1 -4.0; m -0.8 t-1 -4.8	-2	-1.12	-4 -215
10-mrt	France	industrial production	1 jan	-3.1% mom t-1 -1.4; manuif -4.1 t-1 -2.1	-2	-1.15	-2 -217
10-mrt	Finland	industrial production	0.5 jan	-2.3% mom t-1 -4.8; t-2 -4.7 12m: -19.5 t-1 -16.2	-1	-1.21	-1 -217
10-mrt	Japan	leading indicator	1 jan	-2.3 mom t-1 -2.2 coinc -2.6 t-1 -2.5 lagging -1.2 t-1 -2.7	-1	-1.17	-1 -218
10-mrt	China	api	0 feb	-1.6 12m t-1 1.0 jun 7.1	0	-1.13	0 -218
10-mrt	Philippines	foreign trade	0.5 jan	x -41.0% 12m t-1 -40.3	-2	-1.17	-1 -219
10-mrt	East Europ	business climate	0.5 Q1	-59 t-1 -1 t-2 31	-2	-1.21	-1 -220
10-mrt	UK	manufacturing production	1 jan	-2.9% mom t-1 -1.9 3m3m -6.4 t-1 -4.9 industrial prod -2.6 t-1 -1.5	-2	-1.25	-2 -222
10-mrt	Sweden	industrial production	0.5 jan	-2.5% mom t-1 -2.6	-2	-1.25	-1 -223
11-mrt	China	foreign trade	2 feb	x -25.7 t-1 -17.5 m -24.1 t-1 -43.1	-2	-1.37	-4 -227
11-mrt	China	fixed-asset investment	1 jan-feb	26.5% 12m dec 26.1	1	-1.33	1 -226
11-mrt	Japan	machinery orders (private excl. volatile)	2 jan	-3.2% mom t-1 -1.7; overseas -49.0 t-1 +27.6	-1	-1.44	-2 -228
11-mrt	Germany	factory orders	3 jan	-8.0% mom t-1 -7.6 2m2m -14.4 12m: -37.9; dom -4.3 t-1 -4.6 2m2m -10.8; x -11.4 t-1 -10.0 2m2m -17.5; euro -9.6 t-1 +2.3; other -26.5 t-1 -21.0	-3	-1.71	-9 -237
11-mrt	UK	foreign trade volume	1 jan	m -8.5 3m3m t-1 -7.5; x -9.5 t-1 -7.5	-2	-1.75	-2 -239
12-mrt	Germany	industrial production	2 jan	-7.5% mom t-1 -3.9	-2	-1.75	-4 -243
12-mrt	US	retail sales	3 feb	-0.1% mom t-1 1.8 revised up from 1.0 ex cars gaso build mat 0.5 t-1 1.7 (up from 1.2)	0	-1.71	0 -243
12-mrt	US	initial jobless claims	1 last week	654k up from 645k t-2 670k 4wma 650k up from 643k claims t-2 5.3m up from 5.1m	-1	-1.83	-1 -244
12-mrt	China	industrial production	2 jan-feb	3.8% 12m slowest on record dec 5.7	-1	-1.56	-2 -246
12-mrt	China	retail sales	1 jan-feb	15.2% 12m t-1 19.0%	-1	-1.80	-1 -247
12-mrt	India	industrial production	1 jan	-0.5% 12m t-1 -0.6	-1	-1.80	-1 -248
12-mrt	Malaysia	industrial production	1 jan	-20.2% 12m t-1 -15.6	-2	-1.67	-2 -250
13-mrt	Japan	consumer sentiment	1 feb	26.7 up from 26.4 t-2 26.2 t-3 28.4	0	-1.83	0 -250
13-mrt	US	foreign trade volume	2 jan	x -8.6% mom t-1 -6.1 m -4.6 t-1 -1.8	-2	-1.75	-4 -254
13-mrt	euro	retail sales volume	2 jan	0.1% mom t-1 -0.3	-0.5	-1.79	-1 -255
13-mrt	euro	hourly labour costs	0 Q4	3.8% 4q% t-1 4.2. t-2 2.6	0	-1.75	0 -255
13-mrt	US	consumer sentiment Michigan	2 mrt	prelim 56.6 up from 56.3 t-2 61.2	-0.5	-1.75	-1 -256
16-mrt	US	industrial production	2 feb	-1.4% mom t-1 -1.9 (revised down from -1.8) manuif -7 t-1 -2.7 (revised down from -2.5)	-1	-1.67	-2 -258
17-mrt	Singapore	non-oil exports (value)	1 feb	-23.7% 12m mom: 1.8% mom t-1 -3.3	0	-1.80	0 -258
17-mrt	US	housing starts	1 feb	22.2% mom t-1 -14.5 t-1 -14.8 permits 3.0 t-1 -2.9 t-1 -11.1	2	-1.50	2 -256
18-mrt	UK	unemployment	1 jan	6.5% highest since 1997; >2 min	-1	-1.50	-1 -257
18-mrt	Spain	retail sales	1 jan	-5.4% 12m t-1 -6.1	-1	-1.54	-1 -258
18-mrt	US	current account	0 Q4	smallest since 2003Q4	0	-1.50	0 -258
18-mrt	Thailand	foreign trade	1 feb	x -11.3 12m t-1 -26.5 m -40.3 t-1 -37.6	-1	-1.50	-1 -259
18-mrt	US	leading indicator	1 feb	-0.4% mom t-1 0.1 (revised down from 0.4); coinc -4 t-1 -6; lagging -4 t-1 -3	-2	-1.50	-2 -261
18-mrt	US	initial jobless claims	1 last week	646k down from 658k 4wma 654k up from 651k claims t-2 5.47m t-1 5.288m	-1	-1.50	-1 -262
19-mrt	Hong Kong	foreign trade	1 jan	domestic x -49.7 total exports -23.6	-1	-1.38	-1 -263
19-mrt	Malaysia	manufacturing production	1 jan	-22.7% 12m	-1	-1.46	-1 -264
19-mrt	Japan	Reuters Tankan business survey	1 mrt	manuf -78 down 4 new record low	-1	-1.42	-1 -265
20-mrt	Ireland	retail sales	1 jan	9.4% mom t-1 0.3 12m: -20.4 t-1 -8.8 biggest drop since 1974	-1	-1.12	-1 -266
20-mrt	euro	industrial production	2 jan	-3.5% mom t-1 -2.7 1m2: -17.3 t-1 -11.8	-2	-1.19	-4 -270

Afbeelding 4. Wijze waarop Wim Suyker het nieuws bijhoudt en 'weegt'. De nieuwsitems lopen van 6 tot en met 20 maart en kunnen betrekking hebben op een geheel verschillend soort waarnemingen. Kolom 5 geeft de periode aan waarop het nieuwsitem betrekking heeft. Kolom 4 geeft de subjectieve wegingsfactor van het belang van het item aan, op een halfprocentsschaal van 0 tot 3. Kolom 6 geeft een korte beschrijving van de inhoud van het nieuwsitem. Kolom 7 geeft aan of er sprake is van positief of negatief nieuws, op een schaal die loopt van -3 tot 3. Kolom 9 geeft een gewogen bijdrage van het nieuwsitem aan de al bestaande verzameling nieuws (die rond het interview uit zo'n 18.000 nieuwsitems bestond). De laatste kolom telt deze bijdrage op in een soort index. Kolom 8 ten slotte geeft een 'tennisranking' van het nieuwsitem.

X

Waar Van Welzenis' wereldhandelsmonitor gebruik maakt van voor economie conventionele bronnen als import- en exportstatistiek, was de zogenaamde *world-release assessment monitor* van Wim Suyker een stuk exotischer. Ten tijde van het interview was Suyker hoofd van de afdeling Internationaal Conjunctuuronderzoek. Zijn carrière was begonnen op het CPB, waarna hij een aantal jaren bij de OESO in Parijs had gewerkt om in 2002 op het CPB terug te keren. In datzelfde jaar begon Suyker met het bijhouden van 'nieuws'. Op zich niets bijzonders. Het werk van jonge medewerkers op de studiediensten van banken bestond in de jaren tachtig en negentig nog steeds uit het bijhouden van 'nieuws' voor een bepaalde regio. Op basis van dit 'nieuws' werden vervolgens met enige regelmaat rapporten geschreven die gebruikt werden om het bankbeleid voor die regio te evalueren.

Het bijzondere van Suykers monitor was dat hij van *zichzelf* een soort weegschaal maakte om het belang van het door hem verzamelde nieuws te kwantificeren. Afbeelding 4 laat zien op welke wijze Suyker te werk ging. In een tabel verzamelt hij een keuze uit economisch nieuws (in de afbeelding van 6 t/m 20 maart 2009), variërend van de verandering van de industriële productie van Brazilië in januari die slechter blijkt dan het laatste dieptepunt, uit 1991, tot en met het bericht van Reuters in Japan op 19 maart dat de productie-index van Japan een nieuw laagterecord heeft

# Krisis

Tijdschrift voor actuele filosofie

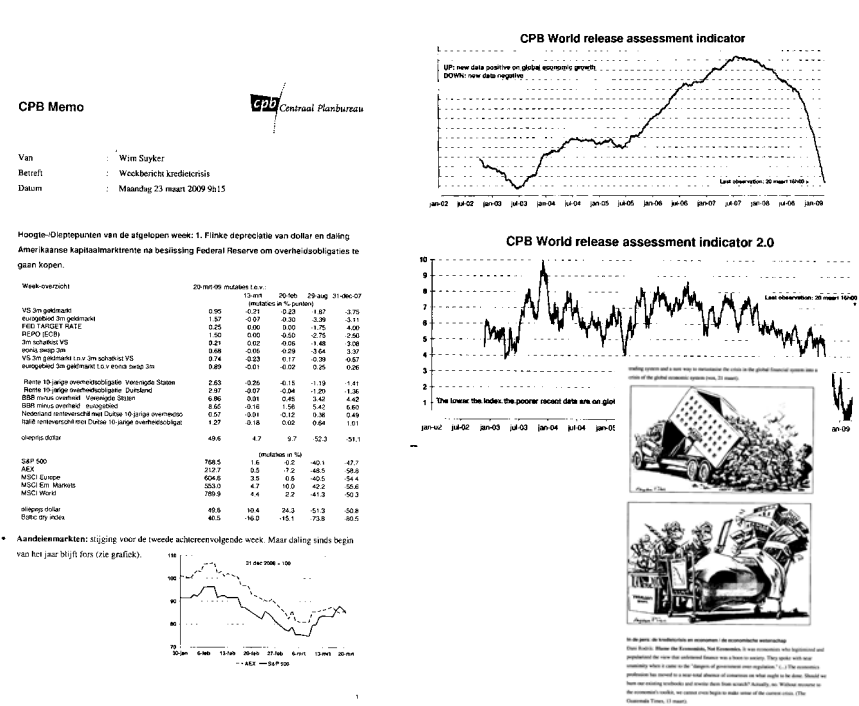
bereikt. Het soort nieuws heeft betrekking op landen, wisselkoersen, consumentensentiment (in Michigan) of berichten van persbureaus als Reuters et cetera – kortom, divers van karakter.

Vervolgens scoort Suyker deze berichten op hun ‘relevantie’ op een schaal van 0 tot 3. De orderportefeuille van Duitsland in januari bijvoorbeeld (bericht genoteerd op 11 maart) is zeer relevant en krijgt een 3. Het ondernemersklimaat in Oost-Europa (bericht van 10 maart) is veel minder relevant en krijgt een 0,5. Deze wegingsfactoren worden vermenigvuldigd met Suykers oordeel of er sprake is van positief of negatief nieuws. Voor de enorme daling van de Duitse orderportefeuille levert dat  $3 \times -3 = -9$  op. De daling van de industriële productie in de VS (bericht van 16 maart) is minder dramatisch dan zij zou kunnen zijn en krijgt een  $2 \times -1 = -2$ . En zo verder. De tweede column rechts geeft een ‘tennisranking’ voor de nieuwsitems aan, de laatste column telt de gewogen positieve of negatieve bijdragen op in een soort index.

Deze index presenteerde Suyker in een grafiek die in een oogopslag het verloop van het nieuws door de tijd liet zien (zie afbeelding 5). Tevens presenteerde Suyker een grafiek waarin het nieuws van de afgelopen week een ‘rapportcijfer’ kreeg. Na het uitbreken van de kredietcrisis vulde Suyker zijn grafieken aan met citaten over de stand van de economische wetenschap uit de pers, komende conferenties, maar ook met cartoons uit de internationale pers. Deze aanvulling diende vooral om de internationale economische beleidsdiscussies weer te geven, met als overweging dat discussies elders op kortere of langere termijn ook in Nederland gaan spelen. Afbeelding 5 toont een compilatie van Suykers nieuwsbrief. Goed te zien is dat Suykers globale indicator al vanaf halverwege 2007 daalt, terwijl er in die periode van een conjunctuuromslag in de modelvoorspellingen van het CPB nog geen sprake is. Na het uitbreken van de kredietcrisis in september 2008 gaat de lijn natuurlijk steil naar beneden. De reactie van het CPB was dat dergelijke onverwachte schokken niet te voorzien zijn. Maar vanaf september 2008 probeerde Teulings te begrijpen wat Suyker aan het doen was, want blijkbaar was Suyker in staat om veranderingen waar te nemen die op basis van voorspellingen met modellen niet naar boven kwamen. Want een model beschrijft wel een struc-

Harro Maas – Rekenmeesters, heelmeesters, vogelaars

tuur, maar zegt zelf niets over veranderingen van variabelen die buiten het model om worden bepaald.



Afbeelding 5. Een aantal fragmenten uit het weekbericht kredietcrisis van maandag 23 maart 2009, 9.15 uur van Wim Suyker. Het weekbericht is aangevuld met stemmen vanuit de tijdschriften en de economische professie in verband met de kredietcrisis (en het reputatieverlies van de economische professie), met cartoons, met kerncijfers en met een agenda van komende belangrijke gebeurtenissen. De eerste grafiek toont het verloop van de ‘wereldnieuwsmonitor’ vanaf het begin van Suykers observaties tot heden. De tweede grafiek geeft het verloop weer van het wekelijkse nieuws met een ‘rapportcijfer’.

Of Suyker erin geslaagd is Teulings van de waarde van zijn monitor te overtuigen weet ik niet. Waarschijnlijk niet. Zeker is dat Suyker met zijn overstap naar de afdeling Overheidsfinanciën op 1 oktober 2009 stopte met zijn weekbericht. De laatste editie van deze nieuwsbrief dateert van maandag 7 september 2009. De reden die Suyker toen aangaf om te stoppen was dat de crisis in ‘rustiger vaarwater’ was terechtgekomen, waarmee de urgentie om op dagelijkse voet de vinger aan de pols van de economie te houden verminderde. Wellicht. Maar zeker ook speelde de enorme hoeveelheid werk een rol die de nieuwsbrief met zich meebracht. In een e-mail schreef Wim Suyker me dat ‘een weekbericht niet [is] vol te houden zonder organisatorische aanpassingen hier in het CPB. Het heeft tot nu toe zeer zwaar geleund op mijn werkzaamheden tijdens het weekend’.<sup>20</sup> Een hoge ambtenaar uit de economische driehoek schreef Suyker: ‘Neeeee, toch niet stoppen met het meest succesvolle product van het CPB? door DG’s en andere hoge pieten hier gretig verslonden en regelmatig aan medewerkers doorgestuurd. En voor die medewerkers sowieso onmisbaar. Moet ik een handtekeningactie beginnen?’<sup>21</sup>

XI

We hebben gezien dat J.M. de Bosch Kemper in het interbellum op het CBS hoopte te komen tot een barometer die ‘bijna automatisch’ de toestand en ontwikkeling van de conjunctuur zou registreren. In plaats daarvan ontwikkelde Tinbergen zijn quasimechanische modellen waarmee economieën konden worden gerepresenteerd ten behoeve van het doorrekenen van beleidsscenario’s. Keynes’ kritiek op deze modellen kwam onder andere voort uit het grote vertrouwen dat hij in zijn eigen ervaringen en oordeelsvermogen stelde. Door econometristen werd deze kritiek weggezet als alleen maar leidend tot plausibele verhalen. Ondanks de kritiek die vanaf de Tweede Wereldoorlog ook binnen de universiteitsmuren op economische modellen werd geuit, werd de voorkeur gegeven aan theoretisch geïnformeerde en empirisch geteste modellen.

Met name in Nederland wist het CPB met deze modellen een bijna onaanastbare positie te verwerven. Binnen zo’n werkwijze was eigenlijk geen

plaats voor een beschrijvende statistische aanpak als die van Van Welzenis, laat staan voor de hoogst idiosyncratische manier van getallenmanipulatie die Wim Suyker tot zijn gekwantificeerde oordeel over het ‘nieuws’ bracht. Vooral Suykers aanpak was een verrassende hybride tussen geloof in kwantificering en vertrouwen in zijn eigen oordeel. Alsof Suyker zelf een weegschaal was die goed geijkt van dag tot dag, week op week, door de jaren heen het nieuws op dezelfde wijze in de linker- en rechterschaal zou kunnen leggen. Het is niet zo vreemd dat niet alleen leden van visitatiecommissies die academische standaarden hoog wilden houden, maar ook een net aangetreden directeur het liefst de deuren van de Van Stolkweg wilde sluiten voor een dergelijke manier van werken.

Des te opvallender was het dat Teulings ontkende dat informatie ‘in een computer werd gestopt’, maar werd verzameld in een nieuwsbrief die wekelijks op het CPB circuleerde. Teulings leek te bevestigen wat economen in de hoogtijdagen van de crisis in de wandelgangen en op de blogs tegen elkaar en het brede publiek zeiden: dat de economische modellen op ‘zwart’ sloegen, en geen zinnige voorspellingen opleverden.<sup>22</sup> Teulings leek impliciet te laten doorschemeren dat hij zelf de eerste maanden na het uitbreken van de kredietcrisis ook twijfelde aan de waarde van de modellen die het CPB hadden grootgemaakt.<sup>23</sup>

In deze eerste maanden bleken de macro-economische voorspellingen van het CPB er in ieder geval keer op keer volkomen naast te zitten. Waar de *track record* van economen als het om voorspellingen gaat hoe dan ook niet onberispelijk is, was het vanaf september 2008 goed mis. Groei veranderde in krimp en een begrotingsoverschot verdampte waar je bijstond. Het verweer van medewerkers van het CPB dat macro-economische modellen onverwachte schokken in de economie natuurlijk nooit goed kunnen voorspellen, werd ondersteund met retrospectieve berekeningen waaruit bleek dat als de CPB-modellen ‘met de kennis van nu’ opnieuw werden doorberekend ze zeer goed in staat waren de feitelijke catastrofale ontwikkeling van de economie te berekenen (Kranendonk, De Jong en Verbruggen 2009). Maar dat is toch een vreemd argument. Op het moment dat je een model het hardst nodig hebt, om te beoordelen wat voor soort maatregelen gegeven de *huidige* stand van de economie er

zouden moeten worden genomen om een economische crisis zo goed mogelijk het hoofd te bieden, biedt het geen adequaat richtsnoer.<sup>24</sup>

Als macro-economische modellen alleen maar het achteraf gelijk van economen kunnen laten zien, waaruit bestaat dan de toegevoegde waarde van een dergelijke econometrische benadering voor de toekomst? Dat was precies de kritiek die Milton Friedman al in 1951 tegen de modelexercities van het toen belangrijkste econometrische instituut in de VS naar voren had gebracht. Met de wereldhandelsmonitor van Van Welzenis en de nieuwsbrief van Suyker leek het CPB beter de ‘vinger aan de pols’ van de economie te kunnen houden dan met zijn modellen. Van Welzenis en Suyker van de afdeling Internationaal Conjunctuuronderzoek leken de crisis – in de woorden van Willem Buiter – beter te ‘zien, horen en proeven’ dan de rekenmeesters van de afdeling Conjunctuuranalyse waar het Planbureau zijn modellen maakt. Keynes schreef *plausible essays* om zijn oordeel te onderbouwen. In lijn met de getallencultuur van het CPB presenteerden Van Welzenis en Suyker hun oordeel niet in een essay, maar in een getal.

## XII

Misschien bedoelde Willem Buiter zijn uitspraak niet zo letterlijk. Maar het is opmerkelijk dat hij voor de karakterisering van zo’n ingrijpende gebeurtenis als de kredietcrisis teruggreep op vormen van waarnemen die binnen de economische wetenschap geen plaats meer hebben. Zien, horen en proeven verwijst naar zeventiende-eeuwse piskijkers en heelmeesters die niet te beroerd waren om een slok van de urine te nemen om een adequate diagnose van een patiënt te stellen. Het verwijst naar negentiende-eeuwse sanatoria waar artsen aan de rochel van een patiënt hun diagnoses stelden. Wie zoekt naar equivalenten op het gebied van de (politieke) economie, komt snel uit op Dickens’ *Hard Times* (1854), Henry Mayhews’ *London Labour and the London Poor* (1861), Friedrich Engels’ beschrijving van de toestand van de arbeidersklasse in Manchester (1845), waar hij als (rijke) buitenstaander met een Iers liefje zeer direct toegang had, of *The Pit* van Frank Norris, over een beurspeculant aan de Chicago *board of*

*trade* die het leven van gewone mensen verwoest. Of, inderdaad, bij boeken als *Economic Consequences of the Peace* uit 1919 van Keynes of *De Prooi* van Jeroen Smit. Wie dergelijke boeken leest, ziet, hoort en proeft wat de gevolgen van *greed*, speculatie en mismanagement zijn.

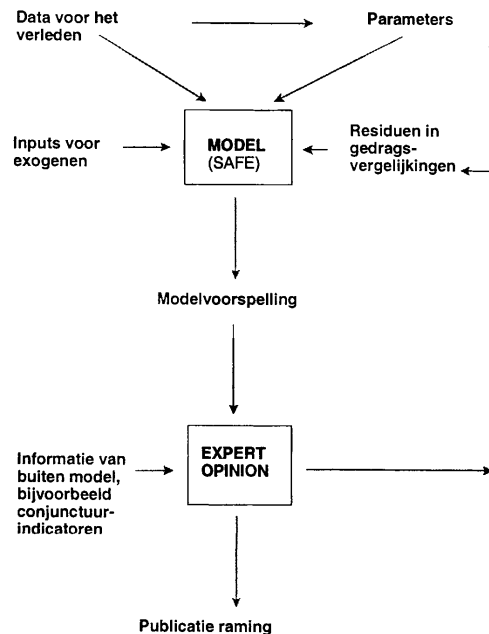
Met de opkomst van de econometrie in de jaren dertig namen economen afscheid van de observatiepraktijken van de negentiende-eeuwse piskijkers van de economie. Modellen werden de instrumenten waarmee economen naar de wereld keken. Met deze wiskundige en statistische instrumenten werden twee belangrijke bezwaren tegen traditionele observatiepraktijken weggenomen. Modellen waren niet anekdotisch maar systematisch, modellen waren evenmin afhankelijk van het persoonlijke oordeel van de politiek econoom. De politiek econoom veranderde van een partijdige essayist als Keynes in een scheidsrechter, in iemand die met behulp van een neutraal instrument objectieve uitspraken over de economie kon doen.

Zeker tot halverwege de jaren zeventig ontleende het CPB deze rol van onafhankelijke arbiter juist ook aan het feit dat zijn modellen ‘geblack-boxt’ waren. Voor zover het algemene publiek al enig zicht had op de rol van het CPB in de beleidsvoorbereiding was dat in termen van de ‘rekenmeesters van de Van Stolkweg’ die met ingewikkelde wiskunde in staat waren de stand van de economie objectief te kwantificeren. En ten opzichte van het politieke domein was het CPB hét voorbeeld van een instituut dat *truth to power* sprak; het oordeel van de individuele medewerkers verdween achter de objectieve modelspecificatie en de statuur van het CPB als instituut.

Maar de modellenbouwers op het CPB weten als geen ander dat dit maar de helft van het verhaal is. Net zoals de constructie van de monitoren van Van Welzenis en Suyker persoonsgebonden expertise vraagt, zo vereist ook de bouw van modellen jarenlange ervaring. Johan Verbruggen, een van de belangrijkste modellenbouwers op het CPB, vergelijkt het bouwen van een model dan ook met een ambacht, een vergelijking die ver afstaat van academische pretentie van objectiviteit die uit de internationale visitatierapporten van het CPB spreekt.<sup>25</sup> Los van technische expertise en persoonsgebonden ervaring die nodig is voor het bouwen van een model,

zijn de eerstverantwoordelijken voor de modellenbouw op het CPB zich er maar al te goed van bewust dat in de schijnbaar objectieve modelspecificaties ook een andersoortige persoonsgebonden expertise zit ingebouwd die buiten het model om is verkregen. Een schema dat Verbruggen gebruikt voor de postdoctorale opleiding voor veelbelovende financieel-economische ambtenaren BOFEB laat dat mooi zien. (zie afbeelding 6).

Figuur 3.3 Proces van de korte-termijnramingen op het CPB



Afbeelding 6. Verhouding tussen de kennis van experts en het model zoals gezien door het CPB. Het schema heeft betrekking op kortetermijnramingen (waarvoor het model SAFE halverwege de jaren negentig werd ontwikkeld), maar geldt in het algemeen voor

CPB-modellen en a fortiori voor het gebruik van modellen voor scenarioanalyse. Bron: syllabus BOFEB-opleiding, 29 oktober 2009, Johan Verbruggen, CPB.

Het gaat in het schema om een model (SAFE) dat het CPB niet meer gebruikt, maar de structuur van modelleren is nog steeds dezelfde. Wat opvalt, is dat de vakjes ‘ experts’ en ‘model’ even groot zijn. Niet voor niets. Want er is geen model te maken zonder dat er oordelen van economen meegenomen worden in de opzet van het model, de specificatie van individuele vergelijkingen en de aanpassingen die nodig zijn op de schattingsresultaten. In deze aanpassingen speelt kennis die komt van *buiten* het model een belangrijke rol. Het is precies deze kennis die ook een belangrijke rol speelt in de constructie van de monitors van Van Welzenis en Suyker.

Is het toeval dat Teulings zichzelf en Jeroen Pauw corrigeert door in plaats van ‘voorspellingen’ over ‘ramingen’ te spreken? Het lijkt me niet. Want nog steeds speelt het oordeel van de econoom een belangrijke, maar voor het publiek verborgen rol. In rustige tijden veranderen variabelen minder heftig en lijkt er weinig mis mee om een model te zien als een objectieve representatie van een economie die ook sturing geeft aan beleid. Maar in tijden van crisis veranderen variabelen heftig, en is het maar de vraag of de gekozen modelspecificatie een stabiele onderliggende structuur van een economie beschrijft. Niet voor niets groeit op zo’n moment het belang van expertkennis zoals van Van Welzenis of Suyker. Op zo’n moment verliest ook het CPB zijn rol van onafhankelijke scheidsrechter en verandert zijn directeur in een vogelaar die zoekt naar structuur in een diverse verzameling informatie.

## XIII

De *Oxford English Dictionary* geeft de volgende omschrijving van het woord *jizz*: ‘The characteristic impression given by a plant or animal.’ Het woord werd in de jaren twintig gebruikt door iemand die heel goed bekend was met de planten en dieren die aan de Ierse Westkust voorkwamen. Op de vraag hoe hij ze herkende, antwoordde hij: ‘By their “jizz”.’ Ik vroeg een Amerikaanse collega, een vogelaar, of hij wist wat *jizz*

betekende. Natuurlijk kende hij het woord, want nog steeds geldt voor goede vogelaars dat zij aan de *jizz* van een vogel kunnen zien tot wat voor soort die behoort (Daston 2008, Coward 1922). In dit essay heb ik verschillende strategieën de revue laten passeren om de *jizz* van een economie te bepalen. Terugkijkend is de verhouding tussen de persoonsgebonden kennis, het persoonlijke oordeel en onpersoonlijke technieken om tot een beeld van een economie te komen verre van constant. De Bosch Kemper had de hoop een economische barometer te ontwikkelen die volstrekt onafhankelijk van een econoom of statisticus een beeld van de economie zou produceren. Tinbergen realiseerde zich dat dit een onbegaanbare weg was en ontwikkelde in plaats daarvan theoretisch geïnformeerde representaties van een economie die daarenboven een coherent beeld gaven van de samenhang tussen economische variabelen – econometrische modellen. Deze modellen leken alsnog te voldoen aan de eis van wetenschappelijke objectiviteit; de modelspecificaties suggereerden onafhankelijk te zijn van het subjectieve oordeel van de econoom. Met de kredietcrisis drong zich (hernieuwd) de vraag op *wat* eigenlijk gerepresenteerd werd met deze modellen, gegeven de beroerde voorspellingen die er uit deze modellen rolden. Waarop de ambachtelijk geproduceerde monitoren van de afdeling Internationaal conjunctuuronderzoek ineens in het centrum van de belangstelling kwamen te staan.

Maar het oordeel van de econoom is natuurlijk nooit weggeweest. Van Keynes tot en met Krugman waren economen in het publieke domein zich ervan bewust dat het juist de kwaliteit van hun oordeel was die gewicht gaf aan hun uitspraken. Voor Nederlandse BN'ers als Boot, Van Wijnbergen en anderen ligt dat niet anders. Maar het zou een verkeerde conclusie zijn te denken dat het oordeel van de econoom alleen in het publieke domein een rol speelt. De modellenbouwers op het CPB zelf zijn zich er maar al te zeer van bewust dat ook zij, net als Van Welzenis en Suyker een ambachtelijk product maken waarvoor ervaring en oordeelsvermogen onontbeerlijk zijn. Het gaat hier niet om *tacit knowledge*. Het gaat om wat vogelaars *jizz* noemen. Het gaat erom – in de woorden van Sherlock Holmes – dat je niet alleen kijkt, maar observeert; dat je beoordeelt wat je ziet. En in tijden van crisis is dat zo makkelijk nog niet.

Aan tafel bij Pauw en Witteman veranderde de directeur van het Centraal Planbureau van een onafhankelijke en onpartijdige expert in iemand die samen met zijn interviewers het nieuws doornam om de *jizz* van de conjunctuurbeweging te bepalen. Ben Bernanke zal wel goede redenen hebben voor wat hij zegt, één zwaluw maakt nog geen zomer, en het kan een beetje meer of minder zijn. Dat is allemaal waar. Plausibele verhalen; als het erop aankomt heeft een econoom, in tijden van crisis, misschien niet meer te bieden.

Harro Maas is universitair hoofddocent in de geschiedenis en methodologie van de economie aan de Faculteit Economie en Bedrijfskunde van de Universiteit van Amsterdam. Zijn Boek *William Stanley Jevons and the Making of Modern Economics* (Cambridge, 2005), dat gaat over een van de grondleggers van de tegenwoordig dominante neoklassieke economische theorie, won de Joseph J. Spengler Best Book Prize van de History of Economics Society. Momenteel leidt hij met een VIDI-beurs van NWO een historisch onderzoeksproject naar observatiepraktijken van economen, dat voortbouwt op zijn deelname aan een interdisciplinair onderzoeksproject naar de geschiedenis van wetenschappelijke observatie aan het Max Planck Instituut voor Wetenschapsgeschiedenis te Berlijn. Zijn meest recente boek verscheen bij Boom-Lemma in 2010 onder de titel *Spelregels van economen: de ontwikkeling van de economiebeoefening*. Hij verhuist binnenkort met zijn VIDI-project naar de Universiteit Utrecht, waar economen meer openstaan voor de geschiedenis van hun vakgebied dan hun collega's aan de UvA.

## Literatuur

Bezemer, Dirk J. (2009) “No One Saw This Coming”. Understanding Financial Crisis Through Accounting Models’. *MPRA Paper No. 15892*, geplaatst op 16 Juni 14:58 uur.



Bogaard, Adrienne van den (1998) *Configuring the Economy. the Emergence of a Modelling Practice in the Netherlands, 1920-1935*. Amsterdam: Thela-thesis UvA.

Boumans, Marcel J. (1992) *A Case of Limited Physics Transfer. Jan Tinbergen's Resources for Re-shaping Economics*. Amsterdam: PhD-thesis UvA.

Boumans, Marcel J. (1998) 'Lucas and artificial worlds'. In: John B. Davis (red.) *New Economics and its history*. Annual suppl. to vol. 29 of *History of Political Economy*, 63-88.

Boumans, Marcel J. (2005) *How Economists Model the World Into Numbers*. Londen en New York: Routledge.

Commissie-De Wit (2009/2010) 'Parlementair onderzoek financieel stelsel'. *Tweede Kamer, vergaderjaar 2009-2010*, 31980, nr. 5. Gesprekken.

Coward, Thomas (1922) "'Jizz'". In: *Bird Haunts and Nature Memories*. London: Warne, 141-144.

Daston, Lorraine (2008) 'On Scientific *Observation*'. *Isis*, 99, 97-110.

Daston, Lorraine en H. Otto Sibum (red.) (2004) 'Scientific Personae and their Histories'. *Science in Context*, vol. 16 (1/2).

De Bosch Kemper, M.J. (1933) *Dagboek Conjunctuur-Onderzoek (Economische Barometers). Kort retrospectief overzicht 1921-1933*, 3.

De Gans, Henk en Harro Maas (2008) 'Making Things Visible. The Development and Use of the Graphical Method in the Netherlands, 1870-1940'. In: Jacques van Maarseveen, Ida Stamhuis and Paul Klep (red.) *The Statistical Mind in the Netherlands 1850-1940*. Atlanta: Rodopi, vol. 2, 199-230.

De Haan, Wouter <http://www.mejudice.nl/artikel/296/gooi-niet-allemacro-economische-modellen-op-een-hoop> (site bezocht op 1 september 2010).

Don, Henk en Johan Verbruggen (2000) 'Models and methods for economic policy. 60 years of evolution at CPB'. *Statistica Neerlandica*, 60 (2), 145-170.

Driehuis, Wim en Arie van der Zwan (1978) *De voorbereiding van het economisch beleid kritisch bezien*. Leiden: Stenfert Kroese.

Friedman, Milton (1951) 'Comment on Carl Christ'. In: *Conference on Business Cycles*. New York: National Bureau of Economic Research, 107-114.

Halffman, Willem (2009) 'Measuring the Stakes. The Dutch Planning Bureaus'. In: Peter Weingart en Justus Lentsch (red.) *Scientific Advice in Policy Making. International Comparison*, 41-65.

Hendry, David F. en Mary S. Morgan (1995) *The Foundations of Econometric Analysis*. Cambridge: Cambridge University Press.

Hoppe, Rob (1999) 'Policy Analysis, Science, and Politics. From "Speaking Truth to Power" to "Making Sense Together"'. *Science and Public Policy* 26 (3), 201-210.

[http://pauwenwitteman.vara.nl/Archief-detail.113.0.html?&no\\_cache=1&tx\\_ttnews\[tt\\_news\]=5577&tx\\_ttnews\[backPid\]=111&cHash=3d14f54ecb](http://pauwenwitteman.vara.nl/Archief-detail.113.0.html?&no_cache=1&tx_ttnews[tt_news]=5577&tx_ttnews[backPid]=111&cHash=3d14f54ecb) (site bezocht 1 september 2010).

Jolink, Albert (2003) *Jan Tinbergen. The Statistical Turn in Economics: 1903-1955*. Rotterdam: Chimes.

Kalshoven, Frank 'Bomhoffs glazen bol'. In: *Elsevier*. Exacte referentie onbekend.

Kranendonk, Henk, Jasper de Jong en Johan Verbruggen (2009) 'Trefzekerheid CPB-prognoses 1971-2007'. *CPB-document* 178.

Maas, Harro (2010) *Spelregels van Economen. De Ontwikkeling van de Economiebeoefening*. Den Haag: Boom.

Morgan, Mary S. (1990) *The History of Econometric Ideas*. Cambridge: Cambridge University Press.

Morgan, Mary S. (2004) 'Simulation. The Birth of a Technology to Create "Evidence" in Economics/La Simulation. Naissance d'une Technologie de la Création des "Indices" en Economie'. *Revue d'histoire des sciences*, 57 (2), 339-375.

Noordegraaf-Eelens, Liesbeth en Olav Velthuis (2009) *Op naar de Volgende Crisis!* Kampen: Klement.

*NRC Handelsblad* (25 en 26 oktober 2010) *Economiekatern*, 6. Interview met Willem Buiters.

Porter, Theodore M. (1994) 'Making Things Quantitative'. *Science in Context*, 7, 389-407.

Porter, Theodore M. (2004) *Karl Pearson. The Scientific Life in a Statistical Age*. Princeton: Princeton University Press.

Porter, Theodore M. (2006) 'Speaking Precision to Power. The Modern Political Role of Social Science'. *Social Research*, 73 (4), 1273-1294.

Rapport visitatiecommissie (2003) *CPB in Focus*.

Salverda, Wiemer, (1993) 'De Planbureauparadox. Minder Gezag en Meer Invloed'. *Tijdschrift voor Politieke Economie*, 15(3), 106-111.

Tinbergen, Jan (1936) *Nota Betreffende het Algemeene Conjunctuuronderzoek*. CBS, afdeling II. ARA classificatie 12.330.1 file 381.

Van Ewijk, Casper e.a. (1980) *Economisch Beleid uit de Klem*. Amsterdam: SUA/TPE.

Van Ewijk, Casper e.a. (1982) *Macro-economisch Stimuleringsbeleid. Een Analyse van Grondslagen en Effecten van Bestedingsverruiming en*

*Arbeidstijdverkorting*. Economische monografie nr. 1. Amsterdam: Universiteit van Amsterdam.

Van Ewijk, Casper e.a. (2009) *De Grote Recessie. Het Centraal Planbureau over de Kredietcrisis*. Amsterdam: Balans.

Van Welzenis, Gerard: <http://www.cpb.nl/nl/research/sector2/data/trade-monitor.html> (site bezocht 1 september 2010).

 De Creative Commons Licentie is van toepassing op dit artikel (Naamsvermelding-Niet-commercieel 3.0). Zie <http://creativecommons.org/licenses/by-nc/3.0/nl> voor meer informatie.

---

<sup>1</sup> Dank gaat uit naar Casper van Ewijk, die mij wees op het werk van Gerard van Welzenis en Wim Suyker, naar Gerard van Welzenis en Wim Suyker zelf, en naar Henk Kranendonk en Johan Verbruggen, die allen welwillend bereid waren met mij te spreken. Ik ben vanzelfsprekend verantwoordelijk voor eventuele fouten en omissies in dit artikel.

<sup>2</sup> Een manier om de kwaliteit van een model in de context van modelsimulaties te beoordelen is de zogenaamde Adelman-Adelmantest. Zie bijvoorbeeld Boumans (1998); Morgan (2004); Maas (2010).

<sup>3</sup> Zie voor het interview [http://pauwenwitteman.vara.nl/Archief-detail.113.0.html?&no-cache=1&tx\\_ttnews\[tt\\_news\]=5577&tx\\_ttnews\[backPid\]=111&cHash=3d14f54e6b](http://pauwenwitteman.vara.nl/Archief-detail.113.0.html?&no-cache=1&tx_ttnews[tt_news]=5577&tx_ttnews[backPid]=111&cHash=3d14f54e6b). (bezocht 1 september 2010). In het transcript heb ik stopwoorden en aarzelingen vervangen door puntjes. Versprekingen en grammaticale fouten heb ik laten staan.

<sup>4</sup> Ik gebruik 'wetenschappelijk profiel' voor het Angelsaksische *scientific persona*. Zie over dit begrip Daston en Sibum (2004).

<sup>5</sup> In december 2008 raamde het CPB de krimp nog op ¾%, waarbij het CPB wel aangaf dat de onzekerheid rond deze raming 'bijzonder groot' was. Zie bijvoorbeeld CPB-nieuwsbrief december 2008.

<sup>6</sup> Eén van de drie vragen van de commissie-De Wit aan Teulings was dan ook 'hoe het kan dat de economische wetenschap niet in staat is gebleken voldoende te waarschuwen voor de crisis'. Teulings' antwoord benadrukt de 'heel zware niet-lineariteiten' waar economische modellen mee te maken hebben. Als ingegaan wordt op de toekomstige taakopvatting van het CPB antwoordt Teulings dat het CPB meer aandacht moet besteden aan het verzamelen van 'kernstatistics, een aantal sleutelvariabelen' die het CPB 'als een soort indicatoren' moet bijhouden. Teulings doelt hier met name op financiële kernvariabelen. Zie ook Bezemer (2009) en de discussie met Wouter den Haan op *Me Judice*, waarin De Haan met name zogenaamde dynamische stochastische algemene evenwichtsmoedellen (die theoretisch interessant, maar empirisch hoogst problematisch zijn) verdedigt. [http://www.mejudice.nl/artikel/296/gooi-niet-alle-macro-economische-modellen-op-  
een-hoop](http://www.mejudice.nl/artikel/296/gooi-niet-alle-macro-economische-modellen-op-een-hoop).

<sup>7</sup> Er is een uitgebreide literatuur over experts (economen) en expertinstituten die in de naoorlogse periode de positie verworven dat zij 'de macht de waarheid zeggen'. Zie voor een overzichtsartikel, Hoppe (1999) en specifiek voor Nederlandse beleidsvoorbereidende instituties het al eerder aangehaalde Halffman (2009).

<sup>8</sup> *NRC Handelsblad* 25 en 26 oktober, Economiekatern, p. 6.

<sup>9</sup> Voor een geschiedenis van conjunctuurbarometers, zie Morgan (1990). Zie ook Van den Bogaard (1998) en De Gans en Maas (2008).

<sup>10</sup> Zie voor een uitgebreide analyse van deze episode, Van den Bogaard (1998) en De Gans en Maas (2008).

<sup>11</sup> Voor biografische informatie over Jan Tinbergen, zie Jolink (2003). Voor een analyse van Tinbergens werk, zie Boumans (1992) en Boumans (2005).

<sup>12</sup> Deze kritiek is herdrukt in Hendry en Morgan (1995, 382-389), gevolgd door de (door Keynes voor de *Economic Journal* geweigerde) reactie van Jakob Marschak en Oskar Lange (390-398).

<sup>13</sup> Geciteerd uit Porter (1994). Voor de diepere betekenis van Pearsons uitspraak, zie Porter (2004). Zie ook de reactie van Marschak en Lange op Keynes' bespreking van Tinbergens werk in Hendry en Morgan (1995).

<sup>14</sup> Voor deze discussie rond het Vintaf-model eind jaren zeventig, begin jaren tachtig, zie Driehuis en Van der Zwan (1978) en Van Ewijk e.a. (1982), Van Ewijk e.a. (1980). Over de veranderende invloed van het CPB in de jaren tachtig, zie ook Salverda (1993).

<sup>15</sup> In een column in *Elsevier* rond 1986 van Kalshoven. Ik ben niet in staat geweest de oorspronkelijke column te achterhalen.

<sup>16</sup> Deze paragraaf en de volgende twee paragrafen zijn mede gebaseerd op een interview met Gerard van Welzenis en Wim Suyker dat ik samen met Tiago Mata op maandag 23 maart 2009 heb afgenomen.

<sup>17</sup> Rapport visitatiecommissie 2003 *CPB in Focus*, 12. Teulings is hier duidelijk van teruggekomen. Voor de commissie-De Wit stelt Teulings dat het CPB in de toekomst meer aandacht moet besteden aan het verzamelen van 'kernstatistics, een aantal sleutelvariabelen' die het CPB 'als een soort indicatoren' moet bijhouden. Teulings doelt hier op indicatoren van de financiële sector, waarover het CPB evident in gebreke was gebleven. Zie 'Parlementair onderzoek financieel stelsel,' *Tweede Kamer, vergaderjaar 2009-2010*, 31980, nr. 5. Gesprekken, 13-14.

<sup>18</sup> Voor Van Welzenis' wereldhandelsmonitor, zie de website van het CPB <http://www.cpb.nl/nl/research/sector2/data/trademonitor.html>, waar ook een beschrijving van de methodologie achter de wereldhandelsmonitor is te downloaden. Wim Suykers 'world-release assessment-monitor' maakte deel uit van een nieuwsbrief die hij na het uitbreken van de kredietcrisis op wekelijkse basis via interne mail op het CPB en een selecte verzendlijst verspreidde.

<sup>19</sup> Hans Timmer is op dit moment directeur van de Development Prospects Group van de Wereldbank.

<sup>20</sup> E-mail Wim Suyker van 24-8-1998.

<sup>21</sup> Geciteerd in e-mail Wim Suyker van 11 oktober 2010 aan de auteur.

<sup>22</sup> Voorzitter De Wit citeert in een vraag aan Teulings *The Economist* van 18 juli 2009: ‘Van alle zeepbellen die het afgelopen jaar zijn doorgeprikt, is er geen een die zo spectaculair tot ontploffing is gekomen als de reputatie van de economische wetenschap.’

<sup>23</sup> Iets was ook blijkt uit het gesprek met de commissie-De Wit. ‘Wij rapporteren op de website ieder jaar onze voorspelprestaties: die zijn niet zo heel geweldig.’ Tweede Kamer, vergaderjaar 2009-2010, 31980, nr. 5, 13.

<sup>24</sup> Zie bijvoorbeeld Velthuis en Noordegraaf-Eelens (2009). Voor het verhaal vanuit het CPB, zie Van Ewijk e.a. (2009).

<sup>25</sup> Interview op donderdag 5 november 2009 met Henk Kranendonk en Johan Verbruggen. Het is belangrijk te benadrukken dat voor Kranendonk en Verbruggen de waarde van de CPB-modellen niet zit in hun al dan niet vermeende vermogen om de economie te voorspellen, maar in hun vermogen om een coherente representatie van een economie te geven. Dit beeld van economische modellen wordt bijvoorbeeld gedeeld door Frank den Butter, hoogleraar macro-economie. Den Butter was nauw betrokken bij de ontwikkeling van het econometrische model van de Nederlandsche Bank in de jaren zeventig. De modelopvatting van Den Butter, Kranendonk en Verbruggen sluit veel meer aan bij de tinbergeriaanse traditie van scenarioanalyses (spoorboekjes) dan bij de uit Chicago overgewaaide traditie die aan voorspellingen de waarde van modellen afmeet.