

Metodologisiin ongelmiin ei pidä kompastua

AUGUST LEPPÄ

Hätäilystä moitiskelleet kritiikot ovat VATTin integraatioselvityksen metodologisissa arvioissaan syyllistyneet hätäisiin arvioihin. Yleisen numerovihamielisyyden lisäksi keskustelu on kiinnittänyt huomiota yleisen tasapainon mallin tarpeeseen. Kumpaankin kritiikkiin on helppo vastata.

Mallilaskelmat pakottavat kvantifioimaan oletukset ja vaikutukset kaikessa epävarmuudessaan. Laskelmilla on mahdollisuus jäsentää ongelman käsittelyä, verrata yhteismitallisesti eri vaikutuskanavia ja tarjota meheviä luita kriitikoille. Toiseksi KESSU IV -malli on varsin lähellä realistisesti määriteltä tasapainomallia ja integraatiolaskelmissa on kyse myös eri tasapainoehdojen vertailusta.

Eräs väärinkäsitysten lähde on ollut laskelmien partiaalisuus. Mallin käyttäjä pystyy kuitenkin oletuksia varioimalla varioimaan myös tuloksia; siksi VATTin laskelmat esitettiin dekomponoituina. Tuloksia on myös väitetty oletuksiksi ja päinvastoin. Todellisuudessa oletuksia, parametreja ja tuloksia ei voida erotella toisin kuin mallissa.

Yleisen tasapainon mallia on pidetty sopivana välineenä integraatiotutkimuksiin. Parametrien ja markkinoiden sulkemisehtojen muuttamiseen kahden tasapainotilan vertailussa liittyy kuitenkin samoja ongelmia kuin ekonometrisissäkin malleissa. Eri mallityyppien vertailua vaikeuttaa myös niiden eritasoinen realismi.

Tasapainomallin realismia voidaan lisätä ottamalla siinä huomioon eri markkinoille ratkaisuja, jotka poikkeavat normaalista tasapaino-

mekanismista. Esimerkkeinä ovat tulonjakokamppailu työmarkkinoilla, kiinteä valuuttakurssi ulkomaankaupassa sekä maatalouden tuotannon tekijöiden vähäinen liikkuvuus ja kustannushinnoittelu suljetulla sektorilla.

Yleisen tasapainon malleja käytetään integraatiotutkimuksessa tavallisesti tarkasteltaessa tullien ja tukipalkkioiden poistamisen sekä skaalaetujen tuoman tehokkuuden nousun vaikutuksia. Tavallisesti kaupan vapautumisen tuloksena on hyvinvoinnin kasvu. Paljon riippuu kuitenkin oletuksista.

Suurin hyvinvoinnin lisäys esimerkiksi maatalouden tapauksessa saadaan olettamalla resurssien vapaa liikkuminen tuotannon tekijämarkkinoilla sekä kelluttamalla valuuttakursseja aluksi syntyvän vaihtotaseongelman takia. Työmarkkinoiden jäykkyys vastaavasti pienentää vaikutusta. Kiinteän valuuttakurssin tapauksessa vaihtotaseen tasapainottuminen jää muiden markkinoiden huoleksi. Täydytysohjelmissä tavoitteessa ja erityisesti pienessä taloudessa sopeutuminen perustuu palkkojen joustavuuteen.

1. KESSU IV ja CGEM

KESSU-malli on syytä suhteuttaa ekonometrisenä laskentakehikkona yleiseen tasapainomalliin. Niiden välillä on eroja, mutta dynamiikka lukuunottamatta erot ovat erikoistapauksia, jotka johtuvat usein puutteellisesti toimivista markkinoista. Esimerkiksi hyödykemarkkinoilla pienen avoimen talouden teollisuuden ase-

ma poikkeaa KESSU-mallissa yleisestä tasapainoratkaisusta siten, että se joutuu ottamaan maailmanmarkkinahinnat annettuina. Suljetussa sektorissa erona on KESSU-mallin kustannushinnoittelu.

Integraatiolaskelmassa siirrytään suljetuilla aloilla uuteen sisämarkkinoiden hinnoitteluun. Metodologinen ongelma on työllisyysyhtälöiden parametrien periytyminen toisenlaisesta järjestelmästä, minkä seurauksena yhtälöihin jäävä kysyntätekijä liioittelee integraatiohyötyjä.

Työmarkkinoilla KESSU IV -malli poikkeaa yleisestä tasapainomallista historiasta estimoidun palkkayhtälöiden työttömyyden pienen kertoimen ja skandinaavisen tulonjaon vuoksi. Tästäkin »vanhasta» oletuksesta luovutaan integraatiolaskelmassa eksogenisoimalla palkat ja päätyemällä aproksimoiden tasapainomallin todennäköiseen tulokseen.

Kaupan rajoitteiden poistaminen työvoimaintensiivisessä suljetussa sektorissa vapauttaa enemmän työtä kuin pääomaa ja johtaa todennäköisesti reaalipalkan laskuun. Tältä osin selvitys aliarvioi vaikutuksia. Toisaalta metodologiseksi ongelmaksi jää toimialoitainen palkkakehitys; ilmeisesti integraatio muuttaisi palkkahaitaria tuottavuuden mukaan.

KESSUn käyttökelpoisuus perustuu osin sen disaggregointiin. Kolmenkymmenen toimialan ja lähes yhtä monen kulutusmenoryhmän mallina se antaa viitteitä allokaatiovaikutuksista. Suljetun sektorin hinta- ja kustannustason muutosta voidaan arvioida käyttäen perustana nykyisiä lopputuotteiden hintaeroja Suomen ja EY:n välillä. Malli konvergoi klassisten pitkän ajan ominaisuuksiensa mukaiseen tasapainotilaan. Kysymyksessä on siis approksimaatio yleisen tasapainon mallista pienessä avoimessa taloudessa suljetun sektorin hintoja, työn hintaa ja vaihtotasetta koskevin rajoituksin.

Keskeistä on se, että integraatiolaskelman ekonometrisessä mallissa on siirrytty EY-skenaariossa tavaramarkkinoilla uuteen tilanteeseen; suljetulla sektorilla kustannushinnoittelu on korvattu maailmanmarkkinahinnoilla. Myös työmarkkinoilla on siirrytty uuteen järjestelmään ilman uusia käyttäytymisyhtälöitä.

2. Kilpailun tehostumisen metodologiset ongelmat

Integraatioselvityksessä kilpailun tehostumisesta johtuva hintamuutos perustuu kahteen lähtökohtaan: hintatasoero Suomen ja EY:n välillä tulkitaan seuraukseksi markkinoiden epätäydellisyydestä ja inflaatioero seuraukseksi erilaisesta talouspoliittisesta käytännöstä (kurssimuutosten käyttämisestä Suomessa kilpailukyvynturvaamiseksi).

Yksityiskohtaisia toimialoitaisia tietoja hintatasoeroista Suomen ja EY:n välillä ei ollut käytettävissä. Tarkastelu perustui vuosien 1985 ja 1990 hintatasoeroihin yksityiskohtaisella hyödyketasolla, jotka ovat muutettavissa myös toimialoitaisiksi hintaeroiksi. Kilpailun vaikutukset näkyvät hintaerojen supistumisena. Tekstiiliteollisuuden avautuminen tuonnille näkyy jo selvästi. Sen sijaan lääketeollisuudessa hintaero on pikemminkin kasvanut.

Suomessa ei juuri ole tutkimustietoa siitä, mihin yhden hinnan periaate yksillä markkinoilla johtaa. Lähtökohdaksi tarkastelussa otettiin kuluttajahintatason lievä yhtenäistyminen EY:n hintatason kanssa. Suomalaisen hintatason 27 prosentin ero suhteessa EY:n hintatasoon on toki vielä paljon.

Hintatasojen lähentyminen ei kuitenkaan synny yksinomaan EY-jäsenyyden seurauksena. Investointitavaroiden hintaerot ovat jo nyt suurelta osin jo hävinneet. Ennen devalvaatiota vallinnut noin 10 prosentin hintaero on yksi arvio luonnollisesta hintaerosta.

3. Esimerkinä maatalous

Kansainväliseltä kilpailulta suojassa elänyt maatalous sopeutetaan integraatioissa periaatteessa EY:n laajuiseen kansainväliseen kilpailuun. Teorian mukaan koko kansantalous hyötyy resurssien uudesta allokaatiosta. Olennaista on, missä määrin tarkasteluun jätetään markkinoiden epätäydellisyyksiä.

Yleisen tasapainon mallissa vientisubventioiden ja tuontitullien poistaminen johtaa hyvinvoinnin kasvuun. Suojatun hyödykkeen tuettu vienti ja tuotanto supistuvat. Tuotannon tekijöi-

den vapaa siirtyminen sektorilta toiselle johtaa työvoimaintensiivisen tuotannon supistumiseen ja alentaa reaali-palkkoja.

Maatalouden resurssien liikkuvuus tulee olemaan todennäköisesti vähäisempää kuin muiden alojen. Siirtymäkauden aikana vaihtoehtoja ovat mahdollisesti jatkaminen vanhalla pääomalla tai tuotannosta luopuminen. Rakennemuutoksen vauhdittaminen taas voisi edellyttää lisää investointeja alalle, mikä yhä kiihdyttäisi työvoiman supistumista maataloudessa.

Sama analogia pätee myös muuhun suljettuun sektoriin, joka on teollisuuden verrattuna hyvin työntensiivistä. Kilpailun tehostuminen ei välttämättä johda kotimaisen tuotannon laskuun, sillä kysynnän hintajousto lisää halventuvien hyödykkeiden kysyntää. Toisaalta työvoiman kysyntää laskee mahdollinen työvoiman reaalihinnan kasvu, jos työmarkkinat eivät toimi. Kysynnän lisäys riippuu kulutuksen hintajoustoista eli suoraa ja yksikäsitteistä vastausta ei ilman empiriaa saa. Jos oletetaan kaupan tekniset esteet ja markkinoiden segmentointi kilpailua estäväksi tulliksi, alentaisi integraatio tältä osin reaali-palkkaa. Vastapainona on sitten kysynnän lisäyksestä syntyvä vaikutus.

Yleisesti ottaen yleisen tasapainon mallit yliarvioivat liberalisoinnista (EY-hinnoista) syntyvää hyvinvoinnin muutosta. Ekonometrisessä mallissa on enemmän kyynistä realismia — joskin historiasta johdettuna — ellei käyttäytymishypoteeseja muuteta, kuten integraatioselvityksessä tehtiin.

Toisaalta maatalouden sopeutumisessa ei ole kysymys vain hintojen ajallisesta konvergenssista vaan myös tuottajien reaktioista odotettavissa oleviin muutoksiin. Integraatioselvityksessä on valittu hyvin varovainen käyttäytymisen muutos. Suoran tulotuen hylkääminen johtaisi selvään tuotannon supistumiseen ja tuki muuttuisi joka tapauksessa sosiaaliturvaksi. Investoinneissa vaihtoehtoja ovat yhteiskunnan tuella suoritettu investointivaltainen rakennemuutos ja toisaalta jo tehtyihin investointeihin perustuva työvaltainen alhaisen tuottavuuden »maitotilamaatalous».

4. Työ on myös markkinatuote

Nimellis-palkkakehityksen sopeutuminen on yksi integraatioselvityksen keskeisistä tuloksista, oletuksista ja kiistakysymyksistä. Kriittikissä palkkakehityksen on katsottu yhä edelleenkin määräytyvän historian mukaan, mutta integraatitarkastelussa pitäisi lähteä myös sisämarkkinoiden periaatteista eli tuotantotekijöiden liikkuvuudesta.

Teoriassa työvoima siirtyy eurooppalaisillakin työmarkkinoilla sinne, missä reaaliensiot ovat korkeimmat. Käytännössä tuottavuuserot eivät katoa kovin nopeasti eikä sopeutuminen ole kulttuurisivistä täydellistä. Selvityksessä ei ole tehty periaatteellista eroa reaali-palkkatason välillä ETA-vaihtoehdossa ja EY-vaihtoehdossa.

Yleisen tasapainon mallissa työmarkkinoiden tasapaino annetulla työvoiman tarjonnalla toteutuu palkkaa muuttamalla. Tällöin integraatiota aproksimoiva suljetun sektorin tehokkuuden ja tuottavuuden nosto sekä hintakilpailu laskee sekä hintoja että palkkoja.

VATTin integraatioselvityksen valintaa kiinteästä reaali-palkasta voidaan edelleen kehittää kolmeen suuntaan. Ensinnäkin oletettaessa työvoiman tarjonta annetuksi KESSU IV -mallin normaali palkkayhtälö tuo vähäisemmän sopeutuksen palkkatasoon; integraation tuoma hyvinvoinnin lisäys siis pienenesi. Toiseksi, työvoiman tarjonta ei rajojen madaltuessa enää ole annettu. Sen seurauksena työttömyysasteen kerroin palkkayhtälössä menettää muuttumatomanakin merkitystään jo ETA-vaihtoehdossa. Kolmanneksi Phillips-relaation parametrit ja tulonjakotavoite voivat estimoiduissa yhtälöissä muuttua.

Integraation aikaansaama tuottavuuden kasvu vähentää työpaikkoja. Tuottavuudeltaan alhaisen toiminnan supistaminen mm. maataloudessa nostaa koko kansantalouden tuottavuutta. Kuitenkin kyseessä on lähinnä tehottomasta kilpailusta johtuvien monopolivoittojen ja tuottavuuteen perustumattomien palkkojen sopeuttaminen markkinoiden tasolle. Työllisyysvaikutus olisi tällöin suljettusakin sektorissa kysynnän lisäyksestä johtuen todennäköisesti positiivinen.

5. Sopeutumisuuden ongelmallisuus

Asteittaista siirtymistä suojatummasta taloudesta kohti markkinataloutta eri alueilla ei voi helposti mallintaa KESSUllakaan. Integraatioselvityksessä siirtyminen lähempänä täydellistä kilpailua oleviin EY-markkinoihin on toteutettu muuttamalla merkittävästi KESSUn vanhoja käyttäytymisyhtälöitä suljetun sektorin hinnoittelussa ja palkanmuodostuksessa.

Rahamarkkinoiden voisi olettaa sopeutuvan kaikkein nopeimmin. Tavaroiden ja palvelusten kaupassa kilpailun tehostuminen rajamuodollisuuksien kadotessa toteutuisi ilmeisen nopeasti. Sen sijaan on erityisen vaikea arvioida, kuinka pian skaalaetujen hyödyt alkaisivat vaikuttaa eri markkinoilla. Investointeihin voi vaikuttaa jo yksinomaan Suomen päätös liittyä EY:öön. Verotuksen harmonisoinnin aikataulussa ongelmana on, kuinka nopeasti voidaan aikaansaada riittävän suuria kustannussäästöjä korvaamaan verotulojen supistuminen.

Kaksi hitaasti sopeutuvaa osa-aluetta suomalaisessa taloudessa ovat maatalous ja työmarkkinat. Maatalouden sopeutumisoikeuteen vai-

kuttaa oleellisesti se, kuinka pitkän siirtymäajan Suomi onnistuu maataloudelle neuvottelemaan. Tuottajien asenteet ja siten tarjontakäyttäytyminen muuttunevat hyvin hitaasti. Työmarkkinoiden sopeutumista hidastanee työvoiman liikkuvuuden vähäisyys ja muut työmarkkinoiden jäykkyydet, jotka voivat johtaa hitaaseen työttömyyden kautta tapahtuvaan sopeutukseen. Tulopolitiikan ja skandinaavisen kansankodin perinteiden muutos kulkee myös asenteiden eikä vain markkinoiden kautta.

Kirjallisuus

- Capros, P., Karadeglou, P., Metzner, G. (1991): »Market imperfections in a general equilibrium framework, An empirical analysis», *Economic Modelling* January 1991.
- Kajaste, Ilkka (1990): »The Impact of 1992 on Finnish Industry», Part 2, The analysis of competitive performance, Valtiovarainministeriön kansantalousovosaston keskustelualoitteita 28, 1990
- Vaittinen, Risto (1991): Esitelmä Taloustieteen Kesäpäivillä Jyväskylässä kesäkuussa 1991