

CPB Memorandum



Sector : 1 en 2
Afdeling/Project : Arbeidsmarkt en Sociale Zekerheid
Samensteller(s) : Hans Stegeman en Daniel van Vuuren
Nummer : 88
Datum : 6 april 2004

Raming bijstandsvolume in CEP2004

Samenvatting:

- De volumestijging van de bijstand is in de laatste jaren systematisch overschat (paragraaf 1)
- Nieuw onderzoek naar het verband tussen de ontwikkeling van de werkloze beroepsbevolking (WBB) en het bijstandsvolume (ABW) leidt tot een bijstelling van de ramingsregel (paragraaf 2).
- De raming van het volume ABW voor het jaar 2004 zal op basis van de nieuwe ramingsregel in het CEP2004, ten opzichte van het CPB-report uit december 2003, neerwaarts worden bijgesteld met circa 20 000 personen (paragraaf 3). Overigens zou ook zonder actualisering van de ramingsregel de raming voor 2004 in dezelfde orde van grootte zijn aangepast vanwege overschatting in het recente verleden met de oude ramingsregel.
- De nieuwe ramingsregel, waarin het onvertraagde verband tussen de WBB en de ABW beperkt is, is de basis voor de conjuncturele bijstelling van het macrobudget in september 2004 (paragraaf 4).

1 Achtergrond

In het kader van de Wet Werk en Bijstand (WWB), die op 1 januari 2004 in werking is getreden, krijgen gemeenten jaarlijks een eigen budget voor de bijstandsuitgaven. Het macrobudget, dat wil zeggen het totale budget voor alle gemeenten, wordt bepaald aan de hand van ramingen van het bijstandsvolume in het Centraal Economisch Plan (CEP) en de Macro Economische Verkenning (MEV). Bijvoorbeeld voor 2005 wordt het macrobudget voorlopig bepaald op basis van de MEV 2005 (gepubliceerd in september 2004). De vaststelling van het budget voor 2005 vindt plaats op basis van het CEP 2005 en de conjuncturele ontwikkeling tussen CEP 2005 (gepubliceerd in april 2005) en MEV 2006 (gepubliceerd in september 2005).¹

In de voorheen op het CPB gehanteerde ramingsystematiek wordt eerst de verandering in het totale aantal werkloosheidsuitkeringen geraamd op basis van de werkloze beroepsbevolking (WBB). Hierbij wordt de mutatie van de WBB vermenigvuldigd met 1,06 bij dalende WBB en 1,23 bij een stijgende WBB, en wordt hier 7 500 vanaf getrokken.² Vervolgens wordt 40% van deze mutatie aan de ABW toegekend, waarbij eventueel nog wordt gecorrigeerd voor beleidseffecten. Tot slot wordt deze uitkomst nog aangepast voor ramingsfouten uit het verleden op basis van een residuen-analyse.

Gezien het toegenomen belang van de raming van het aantal bijstandsuitkeringen is de ramingsregel voor de bijstand nog eens tegen het licht gehouden. Uit tabel 1 blijkt dat vanaf 1995 de stijging van het ABW-volume voor het lopende jaar in het CEP is overschat. Voor een deel hangt dat samen met de overschatting van de WBB in diezelfde jaren. Dit verklaart ongeveer 40% van de gemiddelde ramingsfout in de periode 1995-2003. Maar zelfs indien ten tijde van het CEP in die jaren was gerekend met de, achteraf, juiste stijging van de WBB (zie regel Raming op basis van oude ramingsregel), is de stijging van het ABW-volume overschat, vooral in recente jaren. Bij strikte toepassing van de in de periode 1995-2003 gehanteerde relatie tussen WBB en ABW-volume³, resulteert nog steeds een overschatting van de stijging van het ABW-volume met gemiddeld 7000 personen en een absolute ramingsfout van 15 000 personen.

¹ Zie Memorie van Toelichting Wet Werk en Bijstand (2003), kamerstuknummer. 68004

² Dit is de constante afkomstig uit de schatting die ten grondslag ligt aan deze ramingsregel.

³ In de praktijk gold voor de periode voor 2000 een andere ramingsregel. Na 2000 is de ramingsregel ook niet in alle jaren strikt toegepast.

Tabel 1 Raming versus realisatie ABW-volume en werkloze beroepsbevolking

	1995	1996	1997	1998	1999	2000	2001	2002	2003
Raming WBB CEP t	550	540	465	375	330	235	260	290	415
Realisatie WBB	533	494	438	348	292	269	251	302	396
Vershil	17	46	27	27	38	-34	9	-12	19
Raming ABW CEP t	507	532	498	445	422	349	334	340	345
Raming op basis van oude ramingsregel	479	475	464	428	392	363	336	346	367
Raming op basis van nieuwe ramingsregel	503	490	474	436	380	344	328	321	335
Realisatie ABW	492	494	466	427	384	348	328	319	328
Vershil raming CEP t/realisatie	15	38	32	19	38	1	7	21	17
Vershil raming oude ramingsregel/realisatie	-13	-19	-2	2	8	15	9	26	39
Vershil raming nieuwe ramingsregel/realisatie	11	-4	8	10	-4	-3	0	1	7

De ramingsfout van het ABW-volume die resulteert bij de juiste inschatting voor de WBB heeft meerdere bronnen. Allereerst de ramingsregel die het verband weergeeft tussen de stijging van de WBB en de stijging van het ABW-volume. Maar ook de effecten van beleidsmaatregelen die wat anders uitpakken dan van tevoren was ingeschat en overige, al dan niet trendmatige, factoren. Over deze laatste factoren valt op korte termijn zonder nader onderzoek niet veel te zeggen. Dit memo concentreert zich derhalve op de ramingsregel.

2 Naar een nieuwe ramingsregel

Het datamateriaal met betrekking tot het ABW-volume en de WBB is inherent gebrekkig. Naast de gebruikelijke (steekproef-)fouten, verstoren ook definitiewijzigingen en beleidsmatige wijzigingen het beeld in meerdere jaren. Om tot een robuuste ramingsregel te komen is gebruik gemaakt van macrodata over de periode 1987-2002 (dus na de stelselwijziging van 1987) en regionale gegevens over de periode 1997-2002.

Het doel is om het aantal personen met een bijstandsuitkering te verklaren uit de werkloze beroepsbevolking. De volgende specificatie is geschat op basis van regionale data op Corop-niveau en tijdreeksgegevens :

$$(1) \quad \Delta ABW(r) = \alpha + \beta \Delta WBB(r) + \gamma \Delta WBB_{-1}(r) + \delta \Delta WBB_{-2}(r).$$

In de schatting met regiogegevens wordt met r de betreffende Corop-regio genoteerd. In de schatting met tijdreeksgegevens wordt de variabele r weggelaten (er is dan in feite maar één 'regio'). De subscripts duiden de respectievelijk één en twee periode(n) vertraagde variabelen. Beide schattingen worden hieronder besproken, en uiteindelijk wordt de gekozen ramingsregel gepresenteerd.

2.1 Model geschat op regiogegevens

Voor alle Corop-regio's zijn 5 waarnemingen beschikbaar: vanaf 1998 tot en met 2002. Voor de WBB zijn echter ook gegevens beschikbaar voor 1997. Omdat de modellen steeds gespecificeerd worden in eerste verschillen, en er bovendien twee vertraagde termen in worden opgenomen blijven per regio steeds drie waarnemingen over. De verandering in het bestand ABW'ers wordt dus verondersteld afhankelijk te zijn van de verandering in het bestand van WBB'ers, en tevens van vertraagde waarnemingen van deze laatste variabele. Wanneer de constante term in de vergelijking niet gelijk is aan 0, zal sprake zijn van een trendmatige toename in de discrepantie tussen het aantal ABW'ers en het aantal WBB'ers. Dit kan veroorzaakt worden door beleidsmaatregelen of andere ontwikkelingen. Gezien de variatie in de grootte van de verschillende Corop-regio's wordt aangenomen dat de variantie van de storingstermen verschillend is voor verschillende regio's.⁴ Schatting van de vergelijking op regionale data levert vervolgens:⁵

$$(2) \quad \Delta ABW(r) = -4,6 + 0,10\Delta WBB(r) + 0,13\Delta WBB_{-1}(r) + 0,13\Delta WBB_{-2}(r),$$

(1,3) (0,014) (0,018) (0,016)

waarbij de constante is weergegeven in duizenden, en standaardfouten onder de corresponderende puntschatters worden vermeld. Wanneer jaardummies worden opgenomen in plaats van de constante, dan wijkt geen enkele coëfficiënt significant af van de bovenvermelde puntschatting van de constante, zodat de aanname van een constante verandering in de discrepantie voor de huidige periode niet onredelijk lijkt.

Uit vergelijking (2) blijkt dat in een evenwichtssituatie 36% van de verandering in de werkloze beroepsbevolking⁶ terecht komt in de bijstand, en voorts dat de discrepantie tussen ABW en WBB jaarlijks met ongeveer 4 500 personen toeneemt. Met de regionale gegevens is bovendien aangetoond dat deze toename in de discrepantie ongeveer constant is over de periode 1998-2002.

⁴ Aangenomen wordt dat variantie van de heteroskedastische storingstermen recht evenredig zijn in de (regionale) WBB.

⁵ Merk op dat de vergelijking in eerste instantie is geschat op het niveau van een willekeurige Corop-regio. Ophoging naar nationaal niveau als in vergelijking (3) beïnvloedt de hellingscoëfficiënten niet, maar wel het intercept. Deze laatste coëfficiënt is naar nationaal niveau vertaald door te vermenigvuldigen met het aantal Corop-regio's (n=40) en daarbij te wegen naar de grootte van de verschillende regio's.

⁶ 36 is de som van de coëfficiënten van de de WBB-variabelen in vergelijking (2)

2.2 Model geschat op tijdreeksgegevens

Schatten we dezelfde vergelijking op basis van geaggregeerde tijdreeksgegevens voor de periode 1987-2002 dan krijgen we:

$$(3) \quad \Delta ABW = -10,00 + 0,14\Delta WBB + 0,18\Delta WBB_{-1} + 0,10\Delta WBB_{-2}.$$

(1,76) (0,06) (0,08) (0,06)

Standaardfouten staan weer onder de schatters. De keuze voor de periode na 1987 wordt ingegeven doordat tot en met 1987 belangrijke beleidswijzigingen zijn doorgevoerd: hoogte en duur van de WW-uitkeringen zijn aangepast en daarnaast ook de toegangseisen tot de WW. Dit bracht verschuivingen tussen bijstandsvolume en WW-volume met zich mee, zodat sprake is van een inconsistente reeks. Opmerkelijk is dat geen van de geschatte coëfficiënten significant verschilt van de eerdere puntschattingen voor regionale data. De trendmatige verandering in de discrepantie tussen ABW en WBB wijkt echter wel af van (2). Voor de afgelopen paar jaar correspondeert de autonome daling uit vergelijking (3) redelijk met de ex ante inschatting van beleidsmaatregelen. Het lijkt dan ook niet onredelijk om de specificatie in (3) als uitgangspunt te nemen bij de ramingen voor het aantal ABW'ers, zonder de discrepantiefactor mechanisch mee te nemen. Voor toekomstige ramingen dient deze steeds kritisch te worden bekeken, en zonodig aangepast te worden aan nieuwe ontwikkelingen.

2.3 De nieuwe ramingsregel

De gekozen ramingsregel is gebaseerd op vergelijking (3) en luidt:

$$(4) \quad \Delta ABW(t) = 0,15 \Delta WBB(t) + 0,20 \Delta WBB(t-1) + 0,10 \Delta WBB(t-2)$$

Een verandering van de werkloosheid leidt in het jaar zelf maar tot een beperkte verandering van het aantal personen in de bijstand (namelijk 15% van de verandering in de werkloosheid). Op korte termijn werken veranderingen in de werkloosheid voornamelijk via de WW. Op wat langere termijn loopt het effect van de werkloosheid op het ABW-volume nog wel op, voor een belangrijk deel doordat de verblijfsduur in de WW gemiddeld na 2 à 3 jaar afloopt. Belangrijkste verandering ten opzichte van de bestaande ramingsregel zit hem in de vertragingen. Tot nu toe werd de verandering van de WBB onvertraagd doorvertaald naar de verandering van het ABW-volume (met coëfficiënt 0,49 bij stijgende werkloosheid en 0,42 bij dalende werkloosheid).

De constante term die bij de schattingen wordt gevonden (zie vergelijking 3) wordt niet opgenomen in de ramingsregel. Voor de afgelopen paar jaar correspondeert deze autonome daling redelijk met de (ex ante) inschatting van het effect van beleidsmaatregelen. Voor voorspeljaren wordt de raming van de ABW ook steeds bijgesteld op basis van een inschatting van de dan actuele beleidsmaatregelen.

De nieuwe ramingsregel geeft, voor de periode 1995-2003 een kleinere gemiddelde voorspelfout (3 000 personen) en ook een kleinere absolute voorspelfout (5 000 personen) dan de oude ramingsregel (zie ook tabel 1).⁷

3 Toepassing nieuwe ramingsregel voor 2004

Bij het economische beeld voor 2004 van het CPB-Report uit december 2003 leidt de overgang op de nieuwe ramingsregel ceteris paribus tot een neerwaartse bijstelling van het ABW-volume met circa 20 000 personen (zie tabel 2). Dat komt qua orde van grootte overeen met de ramingfouten die achteraf zijn geconstateerd voor de jaren 2002-2003 (tabel 1).

Ook zonder expliciete aanpassing van de nieuwe ramingsregel, zou op basis van deze residuen de raming voor 2004 neerwaarts zijn aangepast. Op dit moment raamt het CPB dat het aantal

Tabel 2 Raming Werkloze beroepsbevolking en bijstandsvolume in CEP 2004 (x 1000)

	2002	2003	2004	2005
(1) WBB	302	396	515	550
(2) mutatie WBB	51	94	119	35
(3) arbeidsaanbodcorrectie op WBB	1	4	1	-3
(4) Gecorrigeerde mutatie WBB (2+3)	52	98	120	32
(5) mutatie bijstand cf. rekenregel			43	39
(6) directe beleidseffecten			-2	21
(7) mutatie bijstandsvolume (5+6)			41	59
Raming bijstandsvolume CEP 2004	319	328	368	428
Raming CPB-report 2003/4		328	387	-

personen met een bijstandsuitkering stijgt van 328 000 in 2003 naar 368 000 in 2004 en 428 000 in 2005 (zie ook tabel 2).⁸

⁷ Dat is niet verwonderlijk, want de nieuwe ramingsregel is ook geschat over deze periode.

⁸ De raming van het bijstandsvolume betreft het volume van ABW-gerechtigden jonger dan 65 jaar, het totale ABW-volume komt hoger uit (in 2003 356 000).

De onderbouwing van deze raming is ook in de tabel weergegeven. De mutatie van de werkloze beroepsbevolking (regel 2) is bij de raming het uitgangspunt. Vervolgens wordt deze mutatie gecorrigeerd voor beleidsmatige effecten op het arbeidsaanbod (wisselend per jaar). Beleidsmatige effecten op het arbeidsaanbod zorgen voor een mutatie op het arbeidsaanbod, die niet in hetzelfde jaar leiden tot een toename van werkloosheidsuitkeringen (WW+ABW). Een voorbeeld hiervan is het afschaffen van de vervolguitering in de WW. Een deel van de werknemers die voorheen recht hadden op een WW-uitkering, komt nu in het arbeidsaanbod terecht. Dit leidt tot extra arbeidsaanbod. Echter, deze toename van het arbeidsaanbod zal op korte termijn nauwelijks geabsorbeerd worden op de arbeidsmarkt, en dientengevolge grotendeels in de werkloze beroepsbevolking terechtkomen. Deze mensen hebben geen recht op een uitkering (weglek naar de bijstand wordt via directe beleidseffecten geboekt), en daarom dient de werkloze beroepsbevolking hiervoor te worden gecorrigeerd. Deze correctie wordt in volgende jaren afgebouwd, omdat werknemers alsnog een baan vinden, zich terugtrekken van de arbeidsmarkt, of, op langere termijn, wel in aanmerking komen voor een uitkering. Over het algemeen zijn deze correcties relatief klein (zie ook tabel 2, regel 3). Op de jaarmutaties van de gecorrigeerde werkloze beroepsbevolking (regel 4) wordt vervolgens de rekenregel zoals beschreven in paragraaf 2.3 toegepast (regel 5). Deze mutatie wordt vervolgens nog gecorrigeerd voor beleidseffecten die direct van invloed zijn op het bijstandsvolume. In 2004 betreft dit met name een lager verwachte instroom (7 000 personen lager) door het doelmatiger activeringsbeleid dat wordt verwacht van de Wet Werk en Bijstand. Daarnaast leidt de afschaffing van de vervolguitering in de WW tot een groter beroep op de bijstand. In 2005 wordt gerekend met een aanzienlijke toename van het beroep op de bijstand voornamelijk als gevolg van de voorgenomen afschaffing van de kortdurende uitkering in de WW en het aanscherpen van de toegangseisen tot de WW.

4 Conjecturele bijstelling macrobudget

Voor de vaststelling van het macrobudget voor 2004 voor de bijstandsuitgaven wordt in september 2004 het in april 2004 vastgestelde budget alleen nog gecorrigeerd voor de bijstelling van de raming van de WBB tussen CEP2004 en MEV2005. Volgens de nieuwe ramingsregel betreft dit 15% van de bijstelling van het aantal personen in de WBB.

Tabel 3 laat de bijstellingen van de werkloze beroepsbevolking tussen CEP en MEV in de afgelopen jaren zien. Gemiddeld was de bijstelling in de periode 1995-2003 -11 000 personen. De grootste (neerwaartse) bijstellingen waren in 1996 en 1999, met - 40 000 personen. Op basis van de nieuwe ramingsregel zou dit leiden tot een bijstelling van het bijstandsvolume met $0,15 \times -40\ 000 = -6\ 000$ personen. De gemiddelde bijstelling zou -1 700 personen zijn geweest.

Tabel 3 Bijstelling van werkloze beroepsbevolking tussen CEP en MEV en effect op Bijstandsvolume

	1995	1996	1997	1998	1999	2000	2001	2002	2003
bijstelling van WBB tussen CEP en MEV	- 10	- 40	- 10	- 20	- 40	20	- 20	10	10
mutatie ABW-volume cf. nieuwe rekenregel	- 1,5	- 6	- 1,5	- 3	- 6	3	- 3	1,5	1,5
