

LA CRESCITA DELLA SPESA PUBBLICA NELL'ANALISI ECONOMICA

ANTONIO DI MAJO *

1. Introduzione

Il secolo che si avvia alla fine è stato caratterizzato, dal punto di vista dei sistemi economici, da fatti molto rilevanti. Tra questi è sicuramente da annoverare la crescita del peso della spesa pubblica, comunque la si voglia misurare. I dati forniti di recente da V. Tanzi e Schuknecht (1995) e ripresi nella Tabella 1 evidenziano abbastanza chiaramente questo trend. In realtà, già verso la fine del secolo scorso alcuni economisti avevano iniziato a indagare sulla crescita della spesa pubblica, sulle sue cause e sulle sue conseguenze (Wagner, Nitti, ecc.). Nel corso del tempo la ricerca di spiegazioni del fenomeno è andata affinandosi: dalla formulazione delle «leggi» sintetiche di crescita della spesa (Wagner, Peacock e Wiseman) si è passati gradualmente ad analisi più articolate. La ricerca ha seguito un cammino particolare, rispetto ad altri problemi di finanza pubblica. Si è partiti dalle osservazioni «qualitative» di Wagner e dalle constatazioni empiriche di Peacock e Wiseman, e si sono progressivamente aggiunte circostanze esplicative di giustificazione dell'aumento della spesa pubblica, non necessariamente in contraddizione, anzi normalmente compatibili, con quelle pre-esistenti.

Lo sviluppo dell'econometria e la maggior ricchezza di informazioni quantitative, raccolte sistematicamente dalle istituzioni statistiche nazionali prima e da quelle internazionali successivamente, hanno stimolato la ricerca di conferme della rilevanza delle variabili via via introdotte a livello teorico.

L'evoluzione degli studi sulla crescita (di lungo periodo) della spesa pubblica rappresenta appunto l'oggetto di questo studio; si tratta di una rassegna che cerca di individuare le tendenze prevalenti tra i numerosi studi sull'argomento.

Come si vedrà, chi scrive non è pessimista sui progressi conoscitivi che gli studi economici ed econometrici possono consentire in questo

* *Dipartimento di Studi sullo Stato, Università di Firenze.*

campo di indagine della Finanza pubblica, specialmente se si considerano i contributi più recenti.

Come si è detto l'ultimo secolo ha visto una crescita continua del «peso» della spesa pubblica nei sistemi economici, specialmente nei paesi più sviluppati; vi è da chiedersi se questa tendenza si sia negli ultimi tempi durevolmente arrestata o se se ne possa addirittura prevedere un'inversione. Ma questi sono quesiti che si pongono al di fuori dei limiti di questo lavoro, anche se implicitamente presenti nei lavori passati in rassegna.

2. La crescita della spesa pubblica nell'ultimo secolo: le spiegazioni «sintetiche»

2.1. Già sul finire dell'Ottocento alcuni economisti osservarono che la spesa pubblica tendeva a svilupparsi a ritmi superiori a quelli del prodotto nazionale, almeno nei paesi di più antica industrializzazione. Si trattava pur sempre di rapporti spese pubbliche/PIL modesti, se con-

Tabella 1 – La crescita della spesa pubblica (totale spesa in % PIL)

	Fine '800 (intorno al 1870)	Inizi '900 (intorno al 1913)	Intorno al 1920	Intorno al 1937	1960	1980	1990	1994	1996
Austria	–	–	14,7	15,2	35,7	48,1	48,6	51,5	51,7
Belgio	–	–	–	21,8	30,3	58,6	54,8	54,8	54,3
Canada	–	–	13,3	18,6	28,6	38,8	46,0	47,4	44,7
Francia	12,6	17,0	27,6	29,0	34,6	46,1	49,8	54,9	54,5
Germania	10,0	14,8	25,0	42,4	32,4	47,9	45,1	49,0	49,0
Italia	11,9	11,1	22,5	24,5	30,1	41,9	53,2	53,9	52,9
Giappone	8,8	8,3	14,8	25,4	17,5	32,0	31,7	35,8	36,2
Olanda	9,1	9,0	13,5	19,0	33,7	55,2	54,0	54,4	49,9
Norvegia	3,7	8,3	13,7	–	29,9	37,5	53,8	55,6	45,5
Spagna	–	8,3	9,3	18,4	18,8	32,2	42,0	45,6	43,3
Svezia	5,7	6,3	8,1	10,4	31,0	60,1	59,1	68,8	64,7
Svizzera	–	2,7	4,6	6,1	17,2	32,8	33,5	37,6	37,6
Regno Unito	9,4	12,7	26,2	30,0	32,2	43,0	39,9	42,9	41,9
Stati Uniti	3,9	1,8	7,0	8,6	27,0	31,8	33,3	33,5	33,3
Media	8,3	9,1	15,4	18,3 ⁽¹⁾	28,5	43,3	46,1	49,0	47,1
Australia	–	–	–	–	21,2	31,6	34,7	37,5	36,6
Irlanda	–	–	–	–	28,0	48,9	41,2	43,8	37,6
Nuova Zelanda	–	–	–	–	26,9	38,1	41,3	35,7	47,1
Media	–	–	–	–	25,4	39,5	39,1	39,0	40,4
Media Totale	8,3	9,1	15,4	20,7	27,9	42,6	44,8	47,2	45,9

Fonti: Tanzi e Schuknecht (1995); *The Economist* (1997).

⁽¹⁾ Media senza Germania, Giappone e Spagna, paesi in cui la spesa pubblica è in quel periodo fortemente condizionata da impegni militari.

frontati con quelli odierni (meno del 10 per cento, secondo le valutazioni di Tanzi e Schuknecht, Tabella 1), ma già preoccupavano i forti tassi di crescita. Le preoccupazioni, in un periodo di forte sviluppo del movimento socialista, erano prevalentemente rivolte alla «statificazione progressiva» dell'economia, ma anche economisti meno ideologizzati cercavano spiegazioni del fenomeno e cercavano di valutarne le conseguenze economiche.

Come esempio delle analisi del tempo si può far riferimento ad uno studioso italiano di Scienza delle Finanze, F. S. Nitti (1903). Dopo aver sgombrato il campo da alcuni equivoci del genere «illusioni finanziarie», egli osservava che si poteva in realtà individuare un aumento effettivo del «peso» della spesa pubblica e ne individuava le cause: «a) l'aumento continuo e incessante delle spese militari; b) i grandi lavori pubblici (...); c) l'aumento dei debiti pubblici (...); d) la partecipazione sempre crescente delle classi popolari alla vita pubblica»¹. Queste «cause» sintetizzano in maniera esauriente il pensiero economico dell'epoca, ossia dei «precursori» dello studio della dinamica della spesa pubblica. La spiegazione indicata sub d) anticipa (come è tipico di una parte della scuola italiana di Scienza delle Finanze dell'epoca) le odierne analisi della *Public Choice*, e fa riferimento all'estensione del suffragio elettorale e, quindi, all'abbassamento del livello di reddito corrispondente all'elettore «mediano», le cui preferenze dovrebbero esercitare un forte influsso sulle scelte di Finanza pubblica.

2.2. Ma è A. Wagner, un socialista della cattedra, che cerca una spiegazione più approfondita, e allo stesso tempo «sintetica» della crescita di lungo periodo della spesa, e la sua analisi è ricordata, nei manuali di Finanza pubblica, come «legge di Wagner» o, con le sue parole, legge della «crescente espansione delle attività pubbliche, e in particolare statali»². Questa «legge» sembra essere stata confermata dagli eventi del secolo successivo alla sua formulazione; in realtà le interpretazioni, le confutazioni e i tentativi di verifiche empiriche (anche econometriche) sono stati numerosi e senza sbocco univoco. In breve, e a costo di qualche imprecisione, le cause della crescita di lungo periodo della spesa pubblica sono individuate in tre ordini: *i*) la sostituzione di attività private, derivante dall'industrializzazione e dall'urbanizzazione; *ii*) l'esistenza, tra i beni pubblici, di beni «superiori» ossia ad elasticità-reddito elevata (istruzione, cultura), ossia la cui domanda aumenta in misura più che proporzionale rispetto al reddito; *iii*) l'orizzonte temporale in cui si misura la convenienza di

¹ F.S. Nitti (1903), pagg. 81-85.

² A. Wagner (1893).

certi investimenti (ad esempio, ferrovie) richiede un intervento pubblico crescente, così come l'esistenza di monopoli naturali.

Senza scendere in approfondimenti non essenziali in questa sede, si può notare che la «legge di Wagner» rappresenta oggi una spiegazione «sintetica» della crescita della spesa che può essere efficacemente riportata all'osservazione secondo cui «l'elasticità reddito di un numero significativo di beni pubblici eccede l'unità, e quindi il rapporto tra la spesa pubblica (non militare) e il reddito nazionale tende a crescere con il reddito pro-capite»³.

Recenti verifiche econometriche, effettuate sui dati di un paese importante ai nostri fini, come la Svezia degli ultimi cinquant'anni, ne contestano la validità: solo un accostamento superficiale dei dati della spesa pubblica e del prodotto complessivo sembrerebbe confermarla⁴.

2.3. L'altra tradizionale spiegazione «sintetica» della dinamica della quota della spesa pubblica è il cosiddetto *displacement effect* legato ai nomi di Peacock e Wiseman⁵. Secondo questi autori, il peso della spesa pubblica (in una delle versioni possibili: quota sul PIL, spesa pro-capite) subisce un «salto» verso l'alto in corrispondenza di eventi eccezionali (guerre, ma anche profonde trasformazioni sociali) che giustificano l'accettazione, da parte dei cittadini di una democrazia, di un corrispondente forte aumento della pressione tributaria. Quando l'evento eccezionale (ad esempio, la guerra) finisce, il peso della spesa pubblica si riduce, ma non torna al livello iniziale: si è verificato uno «spostamento» (*displacement*) definitivo nel «peso» della Finanza pubblica. La domanda di maggiore spesa pubblica (sempre superiore a zero) può essere soddisfatta in misura maggiore perché il suo finanziamento (mediante maggiori tributi) si è in parte consolidato.

Anche questa spiegazione è stata sottoposta, oltre che a critiche di vario tipo (che è superfluo ricordare in questa sede), a verifiche econometriche che ne hanno fortemente messo in dubbio la validità.

L'articolazione e la complessità crescente della struttura economica e sociale dei paesi industrializzati ha reso sempre più evidente il carattere semplificativo di queste spiegazioni e la ricerca di cause più precise, anche se (come osservano molti studiosi) per questa via si perde la possibilità di generalizzazioni. Ma le semplificazioni generalizzatrici non servono né agli studiosi, né tantomeno a suggerire indirizzi di politica economica.

³ M. Henrekson (1992), pag. 23.

⁴ M. Henrekson (1992), pagg. 27-35.

⁵ A. Peacock e J. Wiseman (1961).

3. Le molteplici determinanti della dinamica della spesa pubblica

3.1. Le spese pubbliche rappresentano l'aspetto finanziario di numerosi, e spesso diversi, processi di organizzazione dell'offerta di beni pubblici ovvero della redistribuzione delle risorse (principalmente la spesa previdenziale). In economie molto complesse, come quelle dei paesi industrializzati, sarebbe illusoria la ricerca di una spiegazione sintetica della dinamica delle spese pubbliche; più produttiva risulta probabilmente la ricerca di spiegazioni separate per processi e per paesi. Sono molti, in effetti, gli studi recenti di questo tipo⁶, che arricchiscono una letteratura già abbondantissima⁷.

Questi studi consentono l'analisi della dinamica delle varie spese in diversi paesi, ma non permettono di cogliere la ragione comune, se esiste, della crescita generalizzata di lungo periodo delle spese pubbliche in tutti i paesi economicamente avanzati. L'importanza della ricerca di cause più generali deriva dalla possibilità di poter trarre così indicazioni sull'evoluzione futura. Proprio a metà degli anni Ottanta, quando erano ormai diffuse le preoccupazioni sull'espansione della Finanza pubblica (la spesa pubblica complessiva superava ormai in diversi paesi sviluppati il 50 per cento del PIL), venne dedicato un «Nobel Symposium»⁸ al tema in questione; i diversi approcci segnalano la varietà di spiegazioni, e tutte di carattere sufficientemente generale (anche nel caso in cui si nega uno stretto rapporto tra sviluppo del sistema economico e «peso» della spesa pubblica). Su queste spiegazioni torneremo tra breve, ma prima di procedere è opportuno precisare che, nel tentativo di mettere ordine in una serie di argomentazioni molto spesso tra loro compatibili, da tempo si è cercato di estendere alla spesa pubblica la metafora del mercato, organizzando le varie «teorie» intorno alle determinanti di «domanda» e di «offerta» di spesa pubblica⁹. Questa articolazione ci consente di ordinare le varie cause di crescita di lungo periodo della spesa pubblica,

⁶ Per l'Italia, ricordo, tra tutti, il lavoro di D. Franco (1993) che riferisce l'indagine al periodo 1960-90, con particolare dettaglio alle spese per l'istruzione, la sanità, la previdenza e l'assistenza, e per l'area OCSE, P. Saunders e F. Kau (1985).

⁷ Per il periodo precedente gli anni Ottanta la rassegna più completa degli studi sulla crescita della spesa è sicuramente quella di P. Larkey, C. Stolp e M. Winer (1981). Si veda anche D. Piacentino (1984), che esamina criticamente le teorie e i problemi dell'espansione delle Finanze pubbliche.

⁸ Svoltosi a Stoccolma nel 1984. Ad esso è dedicato l'intero fascicolo del dicembre 1985 del *Journal of Public Economics*. Hanno discusso il *Growth of Government*: R. Musgrave, A. Lindbeck, Beker, A. Wildawsky, D. North, T. Borcharding e J. Myhrman. Ad alcuni di loro è stato attribuito negli anni successivi il premio Nobel per le Scienze economiche.

⁹ P. Larkey, C. Stolp, M. Winer (1981), pag. 180. Questa divisione non è da tutti condivisa, per la sua imprecisione che porta a separare cause comuni alla domanda e all'offerta, ma sembra comunque utile, anche se le conclusioni vanno interpretate con cautela.

con qualche approssimazione. Intorno a questa classificazione ruota, tra l'altro, la distinzione, politicamente rilevante, effettuata dalla scuola di *Public Choice*, tra *responsive government* ed *excessive government*, ossia tra spesa pubblica giustificata dalle preferenze individuali degli elettori e spesa pubblica connessa, invece, ad altre determinanti (in particolare riconducibili agli interessi dei burocrati, dei politici, dei gruppi di interesse, ovvero a fattori «tecnici»).

4. La «domanda» di spesa pubblica

4.1. In un sistema economico caratterizzato dalla «sovranità del consumatore», nel quale cioè, dati i vincoli tecnologici, ecc., l'allocazione delle risorse è fondamentalmente il risultato delle preferenze degli individui, anche per i consumi di beni pubblici (purché il sistema di rivelazione delle preferenze funzioni in maniera soddisfacente e siano rispettati gli altri noti requisiti per l'offerta efficiente di beni pubblici) si otterrà un livello corrispondente a tali preferenze. Non vi è ragione, in linea di principio, per supporre, se si accetta questo approccio, che la spesa per beni pubblici possa rivelarsi eccessiva ovvero, al contrario, insufficiente¹⁰. In parte diverse sono le argomentazioni avanzate a proposito della redistribuzione del reddito perseguita attraverso la spesa pubblica. Se non vi è possibilità di definire il livello «ottimo» di spesa, non è possibile immaginare livelli «eccessivi», purché le preferenze individuali siano rispettate. Poiché l'interesse di questo paragrafo è per la dinamica temporale della quota di spesa, si tratta di vedere se, dal lato della «domanda», ossia delle preferenze individuali, si siano formate e manifestate tendenze a richiedere quote crescenti di spesa, anzitutto per beni pubblici, ma anche per la redistribuzione del reddito.

Si tratta, in altre parole, di osservare: a) come evolve la *formazione delle preferenze* in materia di beni pubblici (e, anche, di redistribuzione del reddito); b) come tali preferenze si *manifestano* e, eventualmente, vengono *distorte* nel processo politico che, nella metafora ricordata, svolge funzioni analoghe a quelle del mercato per i beni privati; infine, c) come *rispondono* gli agenti preposti all'offerta dei beni pubblici.

4.2. Nel lungo periodo l'assunzione di costanza delle preferenze individuali usualmente adottata (spesso implicitamente) dalla microeconomia, non può essere accettata. Si tratta, allora, di trovare spiegazioni rilevanti della modifica delle percezioni individuali dell'utilità delle spese pubbliche (al crescere del reddito). Naturalmente solo la ricerca empirica può, in linea di principio, dare delle risposte. E l'ana-

¹⁰ Come da sempre osserva R. Musgrave, spesso in polemica con la scuola di *Public Choice*.

lisi empirica non può che far riferimento, in questo caso, a determinati intervalli di tempo (ovvero, secondo alcuni, *a cross-sections* tra paesi a diverso livello di sviluppo). Con riferimento all'ultimo secolo, interessanti interpretazioni sono state avanzate da Wildavsky e D. North¹¹. Il primo connette la dinamica della spesa pubblica alle diverse tipologie di «cultura» dello Stato, e al loro avvicinarsi nel tempo; in particolare si possono sintetizzare queste tipologie nelle tre seguenti: a) cultura di mercato; b) cultura gerarchica; c) cultura settaria. In estrema sintesi, la prima è condizionata dall'idea prevalente di *self-regulation* e, quindi, dallo Stato «minimo»; la seconda, invece, che si accompagna di solito a un «benevolo paternalismo» delle istituzioni, comporta un forte coinvolgimento della spesa pubblica. Il terzo tipo di cultura, sempre secondo Wildavsky, tende alla riduzione delle diseguaglianze e, quindi, richiede un coinvolgimento dello Stato principalmente a fini redistributivi¹². Wildavsky ritiene di poter rilevare nella storia degli USA una successione di culture cui si possono legare le modifiche nella domanda per diverse dimensioni del budget pubblico.

Con riferimento ancora agli USA, D. North connette la domanda per maggior spesa pubblica a modifiche tecnologiche: «I cambiamenti tecnologici hanno comportato un enorme aumento nella specializzazione e nella divisione del lavoro, e quindi un mutamento profondo nei prezzi relativi che hanno alterato la struttura tradizionale della famiglia, dell'organizzazione politica, dell'organizzazione economica. La diversificazione di gruppi di interesse, risultante dalla maggiore divisione del lavoro, ha condotto al pluralismo politico. La domanda per nuove forme istituzionali di organizzazione, in sostituzione delle funzioni in precedenza svolte dalle famiglie e dalle tradizionali forme di organizzazione economica, non poteva essere soddisfatta completamente da organizzazioni volontarie, a causa del *moral hazard*, della selezione avversa, e della domanda per beni pubblici»¹³.

4.3. Una causa più generale di crescita del «peso» della spesa sarebbe connessa con le distorsioni derivanti dai *meccanismi di aggregazione e trasmissione delle preferenze*, in uno Stato democratico (in cui le scelte di Finanza pubblica vengono effettuate con la formazione di maggioranze e minoranze). Si tratta della «dominanza» delle preferenze del-

¹¹ A. Wildavsky (1985) e D. North (1985).

¹² Se la cultura dominante è di mercato, le preferenze andranno a uno Stato che «spende e tassa al minimo»; la cultura gerarchica, invece, richiede un forte coinvolgimento della spesa pubblica; la cultura settaria, infine, predilige uno Stato che «spende e tassa in misura sufficiente a redistribuire le risorse, ma il desiderio di rigetto dell'autorità non consente di portare il prelievo oltre certi limiti», cfr. A. Wildavsky (1985), pag. 352.

¹³ D. North (1985), pag. 392.

l'elettore mediano che, specialmente secondo la scuola di *Public choice*, comporterebbe una distorsione inevitabile a favore dell'aumento della spesa. A questo *bias* è attribuibile, almeno in parte, l'opinione di quegli autori che sostengono l'opportunità di introdurre stringenti vincoli costituzionali in materia di Finanza pubblica, opinione non condivisa da coloro che, come Musgrave, negano l'esistenza ineluttabile di un *excess bias* per la spesa pubblica.

In estrema sintesi, la teoria della prevalenza dell'elettore mediano, come spiegazione della dinamica della spesa, è legata alla sproporzione tra benefici dell'aumento della spesa, concentrabili a proprio vantaggio, e sacrifici imposti dal correlativo aumento tributario (o dal finanziamento in disavanzo), diffusi sulla generalità dei contribuenti. Nel lungo periodo sarebbe stato l'operare congiunto di questa distorsione e dell'estensione progressiva del suffragio universale a spingere la domanda di aumento della spesa: il reddito dell'elettore mediano si è mantenuto per lungo tempo al di sotto del reddito medio, rafforzando anche la spinta alle spese pubbliche di redistribuzione del reddito. La crescita del settore pubblico avrebbe, inoltre, generato un'ulteriore domanda di spesa a causa del crescente numero di elettori-dipendenti pubblici¹⁴.

Ma, prima di soffermarci sulla validità empirica di queste «visioni», sembra opportuno considerare gli aspetti dinamici, di lungo periodo, della parte della spesa destinata alla protezione sociale.

5. L'evoluzione della «domanda» di spesa per la protezione sociale

5.1. Gli arricchimenti specifici del principio dell'elettore mediano e il peso dei gruppi di interesse sono motivazioni spesso avanzate come spiegazione della costante estensione del ruolo della spesa pubblica nell'attività redistributiva. Ma queste osservazioni non vanno al fondo della questione, che deve ricercare le ragioni delle modifiche nella formazione delle preferenze per l'intervento pubblico. Da questo punto di vista un contributo interessante è fornito da A. Lindbeck¹⁵. Egli imposta, anzitutto, uno schema analitico nel quale inquadrare, in maniera più generale possibile, le politiche redistributive. A questo scopo, è necessario distinguere le dinamiche: a) dei fattori che definiscono il quadro di fondo (condizioni demografiche e tecnologiche); b) delle *driving forces* (standard di vita e distribuzione dei poteri politici).

Questi elementi interagiscono con le motivazioni delle politiche,

¹⁴ Tra le spiegazioni della modifica della domanda di spesa sono annoverate anche l'illusione finanziaria (che non fa percepire l'esatto onere della stessa) e la modifica dei prezzi relativi dei beni pubblici, rispetto a quelli dei beni privati.

¹⁵ A. Lindbeck (1985).

che possono essere distinte in tre grandi categorie: 1) il cosiddetto *narrow self-interest*, ossia l'utilizzo del potere coattivo dello Stato, da parte di vari soggetti, per perseguire il proprio interesse; 2) l'«altruismo» (*welfare altruism*), ossia l'atteggiamento positivo verso le condizioni di vita dei più sfortunati; 3) la reazione alle *consequential externalities* (ad esempio, la povertà non colpisce solamente perché si sente solidarietà verso il povero, ma anche perché se ne possono percepire conseguenze negative: instabilità sociale, criminalità, degrado urbano, ecc.).

Dalla mutevole interazione di questi elementi nascono gli obiettivi (*targets*) e gli strumenti concreti delle politiche redistributive. Lindbeck individua quattro tipi di obiettivi:

- 1) ridistribuzioni orizzontali di grande portata;
- 2) ridistribuzioni lungo il ciclo di vita e di tipo assicurativo, per i singoli individui;
- 3) ridistribuzioni verticali del reddito;
- 4) ridistribuzioni orizzontali frammentarie, tra un vasto numero di gruppi di minoranza, in paesi con struttura socio-economica molto articolata.

Per un esame approfondito di questo schema si rimanda al saggio di Lindbeck; dal punto di vista di questo lavoro bisogna soffermarsi sulle conseguenze dei passaggi tra i vari tipi di redistribuzione.

5.2. Il secondo tipo di redistribuzione è quello che nasce con il consolidamento dell'industrializzazione, ed è richiesto dall'abbandono dell'«income insurance systems by way of income-sharing within multi-generation family household»¹⁶ e dalla preferenza dei cittadini per una sicurezza economica basata su «impersonal, automatic entitlements». Questa domanda di redistribuzione è principalmente basata sul *workers self interest*, ma anche altre motivazioni (*altruismo*, *consequential externalities*) sono presenti. Di recente le ragioni per cui *insurance against income risks has not been left mainly to private insurance markets* sono state riprese da chi discute il futuro ruolo economico dello Stato (Sinn, 1995). Inoltre, bisognava considerare il costo marginale quasi nullo dell'acquisizione di nuovi membri al sistema obbligatorio e la necessità di evitare le conseguenze sociali negative della mancata partecipazione all'eventuale assicurazione volontaria.

Le ridistribuzioni del secondo e del terzo tipo sarebbero state sostituite, negli ultimi decenni, dall'ultimo tipo (*fragmented horizontal redistribution*).

Le implicazioni di queste «domande» sulla crescita della spesa

¹⁶ A. Lindbeck (1985), pag. 315.

pubblica derivano da argomenti analoghi, almeno in prima approssimazione, a quelli visti per il *median voter*; in realtà, i vari gruppi di potenziali beneficiari (minoritari) dell'aumento di spesa pubblica interagiscono con i politici alla ricerca di voti: «large per capita benefits that are concentrated within a minority buy more votes than the votes that are lost from the minority which is hit by diffused and therefore small per capita tax increases»¹⁷. Questo processo può aver luogo anche senza l'organizzazione di gruppi di interesse, che però sono normalmente presenti. Non è possibile discutere altri interessanti aspetti dell'analisi di Lindbeck, ma si deve ricordare che «the recent shift to fragmented horizontal redistribution has been seen mainly as a consequence of the emergence of a highly diversified socio-economic structure, with falling information costs between voters and politicians, receding class loyalty in voting and related fierce political competition. As a consequence, the original "welfare state", designed mainly to provide basic economic security, has gradually developed into a free-for-all competition for favors from the state, with every politician trying to buy votes from everybody»¹⁸.

Se questa fosse una descrizione realistica, almeno per i paesi sviluppati, bisognerebbe verificare la possibilità di una minore domanda di redistribuzione e, quindi, un ridimensionamento del «peso» della spesa pubblica. Un modello di crescita della spesa pubblica italiana, in gran parte ispirato all'analisi di Lindbeck, è stato stimato da Brosio e Marchese¹⁹ per il periodo 1951-81, trovando qualche interessante conferma.

6. I fattori di «offerta» nella crescita della spesa pubblica

6.1. Borchering²⁰ ritiene eccessivo quello sviluppo della spesa che non può essere spiegato dalla evoluzione della domanda. Le sue stime econometriche dell'andamento della spesa pubblica statunitense nei primi settantacinque anni di questo secolo nostrano, ad esempio, che i fattori di domanda spiegano solo meno della metà del tasso di crescita della spesa pubblica, portando a valutare come *excessive* l'altra metà dell'incremento, non giustificato dalle preferenze dei consumatori-elettori.

La spiegazione della crescita andrebbe quindi in parte ricercata in fattori di «offerta». Il più noto è il cosiddetto «male di Baumol» (dal nome dell'economista che per primo l'ha descritto); si tratta della crescita di spesa indotta da divari di dinamica della produttività tra i settori di mercato e le produzioni di beni pubblici. Poiché le retribuzioni

¹⁷ Idem, pag. 321.

¹⁸ Idem, pag. 327.

¹⁹ G. Brosio e C. Marchese (1988), pagg. 187-199.

²⁰ T. Borchering (1977), (1985).

tendono a seguire, nel settore privato e nel lungo periodo, la dinamica della produttività di questo settore e le retribuzioni del settore pubblico tendono a seguire la stessa dinamica di quelle private, il costo dei beni pubblici aumenta, anche a parità di prodotto offerto; nei beni pubblici, infatti, per loro natura i guadagni di produttività sono molto minori (spesso nulli) poiché sono prodotti attraverso processi ad alta intensità di lavoro: si pensi alla giustizia, all'istruzione, alla difesa, alla assistenza chirurgica, ecc.²¹.

Questo effetto si applica essenzialmente alla offerta di «beni» e non alle spese di redistribuzione in senso stretto (sicurezza sociale), che hanno normalmente una trascurabile intensità di lavoro, ma anche un «processo produttivo» a costo minimo.

6.2. L'altro elemento di offerta di un certo rilievo è attribuibile al comportamento dei «burocrati». Secondo alcune analisi²², in parte tra loro differenziate, i dirigenti pubblici tenderebbero a massimizzare (dati certi vincoli) le dimensioni del proprio «ufficio» (direzione, settore, ecc.). Questa possibilità è legata, tra l'altro, all'esistenza di asimmetrie informative che non consentono ai politici di rendersi pienamente conto dei costi «efficienti» dell'offerta dei servizi dell'«ufficio», accettando, così, crescite «ingiustificate» del budget. Naturalmente, se i dipendenti pubblici rappresentano anche una quota rilevante di elettori, questo fenomeno viene rafforzato dal lato della domanda di spesa pubblica.

6.3. Elementi di «offerta» posti in rilievo dalla letteratura economica sono ancora il più vasto ricorso, nei decenni successivi alla seconda guerra mondiale, alle politiche di espansione della domanda globale attraverso l'aumento di spesa pubblica (spesso finanziato in disavanzo), il tipo di governo (più espansivo se di sinistra, più restrittivo se di destra), l'articolazione territoriale della Finanza pubblica (federale, unitaria, ecc.) e la minore difficoltà tecnica (in una prospettiva di lungo periodo) di prelevare tributi.

Da un punto di vista teorico è difficile attribuire il giusto peso all'operare (o alla semplice esistenza) di tutti questi effetti, sia di offerta sia di domanda. Non è questa la sede per un'approfondimento delle caratteristiche teoriche e delle possibilità esplicative (*ex ante*) di queste spiegazioni, che può essere rimandato all'abbondante letteratura esistente. Nel seguito faremo riferimento agli studi empirici effettuati negli ultimi due decenni.

²¹ Da notare che l'effetto Baumol determina anche una modifica nei «prezzi» relativi beni pubblici/beni privati che può causare effetti di domanda (in senso restrittivo) sulla spesa pubblica.

²² W. Niskanen (1971) è il caposcuola di questo filone.

7. Le analisi empiriche sulla crescita della spesa pubblica: indicatori e dati

Non è agevole estendere all'analisi della spesa pubblica le metodologie econometriche sviluppate per verificare ipotesi sugli andamenti e le relazioni economiche che si realizzano nei mercati.

Tra le tante difficoltà preliminari bisogna affrontare quelle della individuazione e della scelta degli indicatori di spesa pubblica, per i quali non esistono comunque valori di mercato.

Naturalmente la scelta degli indicatori dipende dalla «teoria» di crescita della spesa pubblica che si vuole sottoporre a verifica empirica; senza scendere in maggiore dettaglio, si può osservare²³ che la variabile-indicatore (principalmente nella forma di qualche rapporto tra spesa pubblica e prodotto complessivo) può essere diversa in relazione al tipo di dinamica cui si vuol fare riferimento, ossia se si considera la pubblica amministrazione come:

1. consumatore di risorse;
2. produttore di risorse;
3. datore di lavoro;
4. ridistributore di risorse;
5. allocatore di risorse.

Una possibile individuazione di corrispondenti diversi indicatori di spesa pubblica è riportata da Diamond e Tait²⁴. Altra questione preliminare concerne l'alternativa di utilizzo, nelle serie temporali, di valori *assoluti* ovvero di *rapporti* tra spesa pubblica e altre grandezze economiche (normalmente il prodotto globale). Questa scelta è particolarmente rilevante nella verifica della legge di Wagner, data anche la difficoltà di interpretare univocamente la formulazione originaria²⁵.

Specialmente nel caso di indicatori-rapporto è particolarmente importante la scelta dei metodi di deflazione delle diverse variabili per ottenere indicatori a prezzi costanti. Com'è noto, una delle confutazioni della legge di Wagner è venuta proprio dalla scelta più accurata di diversi deflatori della spesa pubblica e del prodotto interno lordo²⁶: per un campione di paesi, mentre i dati nominali mostrano una crescita della spesa conforme a una interpretazione della legge di Wagner, il rapporto tra spesa «reale» e prodotto interno lordo «reale» sembrava, invece, smentirla.

Questi sono solo accenni ad alcuni dei problemi posti dall'indivi-

²³ Secondo quanto ricordano J. Diamond e A. Tait (1988), pag. 12, riportando le opinioni di R. Bird (1970).

²⁴ J. Diamond e A. Tait (1988), Appendice I.

²⁵ Per una sintesi delle alternative, si veda M. Henrekson (1992), pagg. 21-23.

²⁶ M. Beck (1976) e la letteratura che ne è derivata.

duazione delle variabili da utilizzare nelle ricerche empiriche; parallelamente si pone il problema della ricerca e della scelta dei dati. Questione preliminare, da questo punto di vista, è quella della scelta tra analisi di *cross-sections* e di «serie temporali»; poi, bisogna trovare l'aggregato di enti pubblici da prendere a riferimento, sia nel primo sia nel secondo caso, poiché non è agevole disporre né per lunghi periodi di tempo, né per molti paesi per lo stesso periodo, di dati di Finanza pubblica riferiti ad aggregati omogenei²⁷. Una delle poche fonti recenti di informazioni quantitative di lungo periodo sulla spesa pubblica di molti paesi è rappresentata dai dati ricostruiti e/o rilevati presso il «Department of Fiscal Affairs» del Fondo monetario internazionale e utilizzati in una ricerca di Tanzi e Schuknecht²⁸.

Si tratta di informazioni concernenti, in generale, l'aggregato pubblica amministrazione nel periodo 1870-1994; come si può notare dalla Tabella 1 che è stata estesa al 1996 dall'*Economist*²⁹ (su indicazioni dello stesso FMI), parte dei dati per il periodo precedente il 1960 non è disponibile. Si tratta del rapporto tra spesa pubblica complessiva e PIL (entrambi in termini nominali) e, come si può notare, questo rapporto si è pressoché sestuplicato nel corso di poco più di un secolo.

Dalla stessa fonte nella Tabella 2 sono riportati i dati sul rapporto tra spesa per consumi pubblici (come definita dalla Contabilità Nazionale) e PIL nel periodo 1870-1994.

Questo secondo indicatore sarebbe, secondo alcuni, quello più correttamente utilizzabile nella verifica empirica di varie teorie della crescita della spesa (in particolare della legge di Wagner). Come si può notare, questo indicatore è cresciuto di quasi tre volte tra l'inizio e la fine del periodo, molto meno di quello relativo alla spesa complessiva. Viceversa la spesa per sussidi e trasferimenti è quella che ha mostrato la dinamica più accentuata (Tabella 3).

Le informazioni quantitative sommariamente richiamate servono solo a porre in evidenza come le ricordate preoccupazioni avanzate all'inizio di questo secolo da F. S. Nitti fossero fondate, se riferite ai numeri della spesa pubblica, ma errate se da tali dati si volevano indurre previsioni «catastrofiche» sull'evoluzione del prodotto complessivo del sistema economico, la cui crescita si è invece accompagnata a quella della finanza pubblica.

²⁷ E si trascura la possibilità di rintracciare dati sugli effetti delle attività pubbliche di regolamentazione: B. Frey (1988), pag. 21.

²⁸ V. Tanzi e L. Schuknecht (1995).

²⁹ *The future of the state*, inserto dell'*Economist* del 20 settembre 1997. La Tabella con l'aggiornamento è a pag. 11.

Tabella 2 – Consumi pubblici 1870-1994 (in % del PIL)

	Intorno al 1870	Intorno al 1937	1960	1980	1990	1994
Francia	5,4	15,0	14,2	18,1	18,0	19,5
Giappone	–	–	8,0	9,8	9,1	9,8
Olanda	6,7	12,3	12,6	17,9	14,5	14,4
Norvegia	2,6	3,2	12,9	18,8	21,0	20,8
Spagna	4,9	10,7	8,3	12,5	15,5	17,0
Svezia	5,5	10,4	16,0	29,3	27,4	27,3
Stati Uniti	2,5	6,5	16,6	17,6	18,1	16,4
<i>Media</i>	4,6	9,7	12,7	17,7	17,7	17,9
Australia	–	–	11,2	17,6	17,1	17,2
Austria	–	–	13,0	18,0	17,8	19,0
Belgio	–	–	12,4	17,8	14,5	15,3
Canada	–	–	13,4	19,2	19,8	20,2
Germania	–	–	13,4	20,2	18,4	19,3
Irlanda	–	–	12,5	19,2	15,1	15,8
Italia	–	–	12,0	14,7	17,4	17,1
Nuova Zelanda	–	–	10,5	17,9	16,7	15,4
Svizzera	–	–	8,8	12,7	13,3	14,3
Regno Unito	–	–	16,4	21,6	20,6	21,6
<i>Media</i>	–	–	12,4	17,9	17,1	17,5
<i>Media Totale</i>	4,6	9,7	12,5	17,8	17,3	17,7

Fonte: Tanzi e Schuknecht (1995).

Tabella 3 – Spesa pubblica per trasferimenti (in % del PIL)

	Intorno al 1870	Intorno al 1937	1960	1970	1980	1992
Canada	0,5	1,6	9,7	12,4	13,2	14,9
Francia	1,1	4,2	11,4	21,0	24,6	28,9
Giappone	1,1	1,4	3,9	6,1	9,8	8,5
Norvegia	0,2	4,4	12,1	24,4	27,0	35,3
Spagna	0,1	2,5	1,0	6,7	12,9	21,0
Regno Unito	2,2	10,3	14,0	15,3	20,2	24,2
Stati Uniti	–	2,1	5,7	9,8	12,2	13,4
<i>Media</i>	0,9	3,8	8,3	13,7	17,1	20,9
Australia	–	–	–	10,5	16,7	18,5
Austria	–	–	–	16,6	22,4	22,6
Belgio	–	–	–	20,7	30,0	29,0
Germania	–	–	–	12,7	16,8	19,2
Irlanda	–	–	–	18,8	26,9	23,4
Italia	–	–	–	17,9	26,0	29,1
Olanda	–	–	–	29,0	38,5	38,5
Nuova Zelanda	–	–	–	11,5	20,8	16,5
Svezia	–	–	–	16,2	30,4	34,4
Svizzera	–	–	–	7,5	12,8	13,3
<i>Media</i>	–	–	–	16,1	24,1	24,5
<i>Media Totale</i>	0,9	3,8	8,3	15,1	21,2	23,0

Fonte: Tanzi e Schuknecht (1995).

8. Spiegazioni «sintetiche» e stime econometriche

8.1. Le prime verifiche econometriche della crescita della spesa pubblica si sono ovviamente concentrate sulle spiegazioni «sintetiche» (la legge di Wagner e il *displacement effect* di Peacock e Wiseman); solo in tempi più recenti i «modelli» da sottoporre a verifica sono diventati più articolati, anche sotto la spinta delle osservazioni di diversi studiosi della scuola della *Public Choice*.

In una prima fase, l'apparente «plausibilità» della legge di Wagner derivante da dati come quelli prima riportati, e in connessione con la parallela crescita del prodotto (assoluto e pro capite), ha spinto le analisi empiriche soprattutto in questa direzione. Molte sono state le analisi (non solo econometriche) sia *cross-sections* sia su serie temporali di singoli paesi.

La relazione da sottoporre a verifica era sostanzialmente quella tra prodotto pro capite e qualche rapporto tra spesa pubblica (totale, per consumo, ecc.) e prodotto complessivo. Il nesso di causalità veniva spesso implicitamente accettato: era la crescita del reddito pro capite a determinare la dinamica della quota della spesa pubblica. Venivano trascurati i problemi di simultaneità e di direzione del nesso di causalità³⁰. A questo proposito si può ricordare quanto concludevano Diamond e Tait dopo aver passato in rassegna i vari test econometrici della legge di Wagner (allora disponibili):

- a) verifiche approfondite (anche con test di causalità) su dati di più paesi sembravano mostrare che «different causal models may apply to different countries, undermining the universality of Wagner's law»;
- b) non venivano trattate accuratamente le variabili «tempo», sia nella specificazione dei ritardi sia per il comune trend temporale di diverse variabili³¹;
- c) in molti test econometrici l'adattamento (*fit*) dei dati alle stime appariva molto modesto, mentre risultava econometricamente molto significativo il «trend» temporale (che può «catturare» gli effetti delle variabili omesse).

Perplessità aggiuntive sorgevano sulle verifiche *cross-sections* della legge di Wagner. In particolare:

- a) i risultati variavano in relazione alla composizione del campione di paesi presi in considerazione;
- b) si poteva osservare qualche confusione «when moving from state-

³⁰ J. Diamond e A. Tait (1988), pagg. 14-18.

³¹ «Indeed, in most countries, when allowance is made for common trending and for the influence of other causal variables, the per capita income coefficient becomes significant only after a lag ... In still other countries, the relationship appears negative, contradicting Wagner's law» (J. Diamond e A. Tait, 1988, pag. 16).

ments about differences in levels to statements about changes between levels»³².

In conclusione, la letteratura sulla verifica empirica della legge di Wagner appariva a P. Diamond e A. Tait «piena di difetti sia nei dati utilizzati sia nel metodo statistico»³³.

In un lavoro più recente, più volte ricordato, Henrekson³⁴ riprende anche le stime della legge di Wagner e, dopo averle sottoposte a verifica critica, cerca di rimediare, almeno in parte, ai difetti rilevati, utilizzando tecniche econometriche più avanzate. Scelta la forma funzionale «the most easily..., and empirically correct, manner to test Wagner's law ... is to relate the chosen expenditure ratio to GDP per capita», l'autore individua nel rapporto tra la spesa pubblica (non destinata a usi militari), esclusi i trasferimenti, e il PIL, la variabile dipendente. La variabile indipendente è PIL pro capite della Svezia; i dati utilizzati coprono il periodo 1861-1988.

Le due serie temporali di dati non risultano stazionarie di ordine zero e necessitano, quindi, di essere trasformate in serie cointegrate prima di procedere alla regressione. Il risultato è che si può rilevare «a highly significant negative effect of a growth in income per capita on the share of government exhaustive expenditure on GDP»³⁵. In sostanza:

- a) bisogna correggere la metodologia econometrica per tener conto di un andamento temporale comune alle variabili, che si modifica lentamente nel corso del tempo (almeno per quanto concerne la Svezia), considerando un processo stocastico non stazionario;
- b) anche se sia il reddito pro capite sia la quota della spesa pubblica sul prodotto sono cresciuti enormemente in Svezia tra il 1861 e il 1988, non è possibile verificare una relazione positiva di lungo periodo tra le due variabili considerate.

È, quindi, molto improbabile che la crescita del reddito reale pro capite spieghi da sola l'aumento della spesa pubblica svedese; per questo paese (ma non solo per esso) bisogna allora cercare una spiegazione «for why there was a sudden take-off in the government expenditure share following World War II, that cannot be traced back to a fundamental change in the growth of real income»³⁶.

8.2. Se, quindi, anche l'analisi più recente conferma che non è possibile in realtà verificare sul piano empirico la validità generale di una «legge» di Wagner, altrettanto dubbia è l'altra spiegazione sintetica

³² J. Diamond e A. Tait (1988), pag. 17.

³³ Idem, pag. 17.

³⁴ M. Henrekson (1992).

³⁵ M. Henrekson (1992). Per queste analisi si vedano le pagg. 27-31 e pag. 34.

³⁶ Idem, pag. 37.

di crescita della spesa pubblica, ossia il *displacement effect* di Peacock e Wiseman.

A parte le analisi empiriche effettuate dagli stessi autori, in epoche diverse³⁷, resta probabilmente vero che, almeno per lungo tempo, non c'è stata verifica sufficiente perché «an appropriate hypothesis has not yet been rigorously formulated and tested»³⁸. In realtà, diverse ricerche empiriche sono state condotte sul *displacement effect* e si può rimandare alla rassegna di Diamond³⁹. Questo autore, peraltro, ritiene che la «displacement hypothesis should be interpreted as a theory of the structural break»⁴⁰. Anche se questo fosse provato, la «spaccatura» non eliminerebbe la necessità di trovare spiegazioni della crescita della spesa. I tests effettuati da Diamond sono stati a loro volta criticati⁴¹. Un'ulteriore verifica empirica è tentata da Henrekson, nel più volte ricordato volume, su dati concernenti la Svezia e la Gran Bretagna. Cruciale è il trattamento accurato dalla variabile tempo, spesso stranamente trascurato in altre ricerche; viene presentata un'analisi più avanzata di trattamento delle serie temporali, basata sul «trend» e sulle variabili sfasate⁴² e su quattro diverse versioni della «teoria» ricavate dalla preesistente letteratura. Una versione della «teoria» viene significativamente verificata sui dati 1922-87 relativi alla Gran Bretagna: la seconda guerra mondiale (il solo rilevante *social upheaval* del periodo) sembra, però, avere determinato uno *shift verso il basso* della spesa pubblica, pari al 4,6 per cento del PIL. Analogamente per la Svezia lo shift verso il basso risulterebbe del 2,3 per cento, ma quest'ultima stima econometrica non è significativa.

In definitiva, tralasciando di ricordare le tante altre ricerche empiriche effettuate, sembra emergere la conclusione che non sembra possibile, in generale, cercare di spiegare la dinamica di lungo periodo della spesa (o delle spese) pubblica (che) con il semplice ricorso a indicatori «sintetici», quali ad esempio il reddito pro capite. Come ricordato, spiegazioni più articolate sono necessarie, sia a livello teorico, sia per la verifica empirica.

³⁷ A. Peacock e J. Wiseman (1961) e (1979).

³⁸ R. Bird (1972). Si veda anche M. Henrekson (1992).

³⁹ J. Diamond (1977).

⁴⁰ Come ribadito in J. Diamond e A. Tait (1988), pag. 3: «A structural break posits two distinct regimes before and after a social upheaval»; di conseguenza «a total test of structural stability should be applied».

⁴¹ Si vedano in particolare A. Tussing e J. Henning (1979) e gli altri lavori ricordati in M. Henrekson (1992), pagg. 48-51.

⁴² M. Henrekson (1992), pagg. 51-60 e pag. 63 segg. In questo lavoro si osserva: «The most straightforward way to model the time pattern of growth is by means of an ARIMA (Auto Regressive - Integrated - Moving Average) model». Questo tipo di modelli «can be fitted to a single time-series» (pag. 63).

9. Le verifiche empiriche degli «altri» modelli di crescita della spesa pubblica

9.1. L'evidenza empirica che mostra, a partire dal secondo dopoguerra⁴³, una crescita rilevante della spesa pubblica, comunque la si misuri e si valutino le carenze delle rilevazioni statistiche, e l'inadeguatezza delle spiegazioni «sintetiche» che, come si è visto, non sembrano reggere alle verifiche econometriche, hanno favorito, negli anni Ottanta-Novanta, lo sviluppo di una letteratura empirica che ha fatto riferimento a spiegazioni più articolate.

I modelli proposti partono tutti dalla ovvia constatazione che le influenze sulla dinamica della spesa sono molteplici e di forma complessa: vengono distinte, in genere, tra quelle «politiche» e quelle «economiche»; spesso nelle stime econometriche le relazioni vengono «semplificate» e si preferisce porre enfasi (ed effettuare le stime) avendo preventivamente selezionato quelle «rilevanti». Naturalmente, poiché la maggior parte delle stime è del tipo *time series* per un singolo paese, molto diversificati sono i «modelli» presi a base. Non mancano, però, modelli *cross-sections* che, necessariamente, fanno riferimento a più paesi.

È Borcharding⁴⁴ che esplicitamente formula, come si è ricordato, un modello di domanda (che, almeno teoricamente, fa riferimento cioè alle preferenze degli elettori). Con evidenti richiami al *median voter* stima una funzione di domanda di spesa pubblica per gli USA nel periodo 1900-76; la sua analisi econometrica mostrerebbe che la domanda riesce a «spiegare» meno del 50 per cento del tasso di crescita della spesa nel periodo considerato. Di conseguenza, negli USA non si è avuto un governo *responsive*: il tasso di crescita della spesa sarebbe in misura notevole imputabile a un *excessive government*.

In un lavoro più recente Hamlin⁴⁵ distingue i modelli sul *growth* della spesa a seconda delle influenze prevalenti in: a) a dinamica essenzialmente politica e b) a dinamica essenzialmente economica.

I primi possono essere classificati in: modelli dell'elettore mediano, dei gruppi di pressione e modelli *supply-side*.

Tra questi, un rilievo particolare viene attribuito alle analisi di M. Olson⁴⁶. Questi osserva che nel corso del tempo l'attività dei gruppi di pressione tende a determinare una crescita del settore pubblico (incoraggiata da attività di *log-rolling* e di *rent-seeking*) principalmente attraverso funzioni di redistribuzione. Ma la generalità di que-

⁴³ «The growth of the public sector is largely a postwar phenomenon, if we disregard temporary increases due to wars or other crises» (J. Lybeck e M. Henrekson, 1988, pag. 3).

⁴⁴ T. Borcharding (1985).

⁴⁵ A. Hamlin (1993), pagg. 79-85.

⁴⁶ M. Olson (1992). Questo eminente studioso delle organizzazioni complesse è prematuramente scomparso da qualche mese.

sta analisi può essere contestata se si osservano società in cui l'eredità dei gruppi di pressione è debole (a causa di shock politici o sociali, come le guerre), per cui sarebbe possibile una crescita del reddito con una dinamica relativamente limitata del settore pubblico⁴⁷. Le analisi empiriche della legge di Wagner e dell'effetto Peacock e Wiseman sembrerebbero fornire una conferma a quest'ultima osservazione.

I modelli *supply-side* sono caratterizzati dall'individuazione del rapporto tra i cittadini elettori e il governo come una relazione *principal-agent*, con gli agenti che approfittano del loro potere discrezionale per estendere la dimensione del settore pubblico (e del loro potere). Tuttavia, a parte la difficoltà di individuare le variabili quantitative necessarie per una verifica econometrica, anche in via di principio bisognerebbe spiegare perché il ricordato potere discrezionale dei politici (o dei burocrati) dovrebbe crescere nel tempo.

Le dinamiche essenzialmente economiche, nell'ambito di un approccio sostanzialmente di *Public Choice*, non possono che partire di nuovo dal modello *median voter*, questa volta funzionante in maniera corretta, ossia come veicolo delle vere preferenze degli elettori. Si ammette, però, che la variabilità dei prezzi relativi (dei beni pubblici rispetto ai beni privati) può comportare una crescita del valore della spesa pubblica, come si è già osservato più indietro, se la domanda di beni pubblici è anelastica. A sua volta l'aumento dei prezzi relativi è attribuibile alla tecnologia, ma anche, in pratica, a inefficienze nell'offerta (del tipo inefficienza «X»).

Questo modo di osservare la dinamica della spesa pubblica è tipico della scuola di *Public Choice* e rappresenta, con le altre possibili varianti, l'approccio prevalente alla base delle analisi econometriche delle spiegazioni «articolate» del fenomeno: il «residuo» non spiegato fondamentalmente dall'evoluzione della domanda del *median voter* e dall'effetto prezzi relativi *deve* trovare ragione nell'offerta, con le inevitabili inefficienze (attribuibili alle burocrazie, ecc.).

Per quanto concerne la burocrazia in particolare, un esempio di stime econometriche è fornito da Cullis e Jones⁴⁸; questi autori ricordano che nell'ambito dell'approccio di *Public Choice* si lascia talvolta credere che la crescita di spesa non spiegata dalla domanda (dell'elettore mediano) deve essere attribuita all'azione della burocrazia guidata dalla sua funzione di utilità. In realtà «the unexplained residual could be the effect of any missed variable in the model»⁴⁹, per cui gli autori tentano di valutare esplicitamente l'impatto della variabile burocrazia.

⁴⁷ A. Hamlin (1993), pag. 81.

⁴⁸ J. Cullis e P. Jones (1993), pagg. 86-102.

⁴⁹ Idem, pag. 96.

La difficoltà principale è quella di provare l'esistenza di un nesso di causalità⁵⁰. Gli autori utilizzano i dati inglesi sulle spese della pubblica amministrazione e sul prodotto interno lordo. Per quanto riguarda il «potere burocratico» fanno riferimento al rapporto tra gli occupati nel settore pubblico e il numero di elettori inglesi; il periodo di stima va dal 1948 al 1989. Se si tralasciano gli aspetti più particolari, le stime effettuate portano a concludere: a) che la misura scelta come «potere burocratico» non influenza la quota della spesa pubblica sul prodotto complessivo (test di Granger); b) che la quota della spesa ha effetto (nel senso di Granger) sulla quota del numero di burocrati rispetto al totale di elettori, anche se nel lunghissimo periodo questo effetto non sembra persistere⁵¹.

9.2. La varietà di possibili spiegazioni della crescita della spesa pubblica nei paesi sviluppati rende fondamentale il ricorso ad analisi empiriche articolate, basate su dati di uno o più paesi ed estesi a lunghi periodi di tempo⁵², perché solo le verifiche empiriche (in genere econometriche) possono, in linea di principio, consentire di «selezionare» tra le varie spiegazioni teoricamente (o *a priori*) ipotizzabili. L'interazione tra variabili più propriamente legate alla struttura del sistema produttivo e variabili più squisitamente «politiche», messa in luce nella pregevole rassegna di Larkey, Stolp e Winer del 1981 e le riflessioni del «Nobel simposium» del 1985 hanno ridato impulso a ricerche empiriche articolate sulla crescita della spesa pubblica. L'insieme di ricerche curata da Lybeck e Henrekson, e pubblicata nel 1988, trae esplicitamente origine dal ricordato «Nobel simposium». Questo volume ha scelto di privilegiare l'approccio di analisi su serie temporali relative a singoli paesi. Come aveva fatto notare Musgrave⁵³ molti anni fa, l'utilizzo di *cross-sections* (in quel caso per stimare la legge di Wagner) è più rischioso, in quanto può più facilmente portare a conclusioni avventate sulla verifica della teoria derivanti dall'uso nelle regressioni di dati concernenti paesi a diverso livello di sviluppo. La preferenza è, poi, per analisi del tipo «non institutional explanations», ossia si tentano di sottoporre a verifica econometrica teorie «containing only variables of a structural character, reflecting

⁵⁰ Da questo punto di vista «The Granger causality tests cast doubt on the hypothesized power of bureaucrats to drive a relative public sector growth», idem, pag. 101.

⁵¹ Idem, pagg. 98-99.

⁵² Come si è già osservato, le varie teorie sullo sviluppo del *government* non sono generalmente tra loro incompatibili: «They are not mutually exclusive and, because of a typical monocausal focus, a relatively parsimonious overall model within a conventional economic framework that embraces the separate theories can be advanced» (T. Anderson - T. Stratmann, 1993, pag. 215).

⁵³ R. Musgrave (1969).

underlying individual preferences or cost structures for production»⁵⁴.

Fa eccezione uno studio dello stesso Lybeck⁵⁵ che utilizza *pooling* di dati di *cross-sections* e di serie temporali; lo stesso autore osserva, a proposito degli studi *cross-sections*, che l'espressione più corretta per individuare le conclusioni dei numerosi studi di questo tipo «would be confusion» e spesso «we have an empirical finding without a good theory behind it»⁵⁶. Per singoli paesi, la disponibilità di dati meno aggregati e la possibilità, entro certi limiti, di tenere conto di specificità possono consentire di separare i fattori più rilevanti e di valutare la consistenza delle teorie sottoposte a verifica. A parte il saggio ricordato, nel volume in questione tre studi si basano su teorie della sola offerta di spesa pubblica (USA, Olanda, Italia); gli altri sulla domanda ovvero su modelli di domanda e di offerta.

Anche se le varie ricerche sono lontane dal delineare «a common model that can explain the growth of the government sector in several countries»⁵⁷, qualche risultato interessante sembra poter essere individuato. In positivo: la verifica dell'esistenza dell'effetto Baumol nella spesa per beni pubblici; l'importanza della domanda di redistribuzione del reddito; il peso dei gruppi di interesse. In negativo: l'irrilevanza (per i paesi considerati) del colore politico dei governi; più in generale lo scarso peso dei fattori di tipo politico. Un discorso a parte merita la ricerca di Henrekson sulla Svezia, cui faremo riferimento più avanti.

Qualche modello di stima relativo a singoli paesi è anche rinvenibile in un volume curato di Gemmell⁵⁸.

Sembra interessante, in particolare, l'analisi relativa all'Australia⁵⁹, per varie ragioni: anzitutto si dispone di dati utili di lunghissimo periodo, dal 1860 al 1986. Inoltre, gli autori stimano diversi modelli, basati su diversi insiemi di variabili: a) un modello definito di *structural economic determinants* che utilizza solo variabili economiche (reddito reale, struttura dell'occupazione, popolazione), più *dummies* concernenti le due guerre mondiali e le «grandi» depressioni; b) quattro modelli istituzionali in cui le variabili esplicative possono essere raggruppate sotto le definizioni di *elections and ideologies*, *interest group and bureaucracy*, *stabilization policies*, *fiscal illusion* (si prendono in considerazione i «colori» dei governi, la vicinanza delle scadenze elettorali, la sindacalizzazione della forza lavoro, la quota di occupati pubblici, la struttura del sistema tributario, ecc.). Infine tutte le

⁵⁴ F. Hackl - F. Schneider - G. Withers (1993), pag. 214.

⁵⁵ Pubblicato anche due anni prima. J. Lybeck (1986).

⁵⁶ J. Lybeck - M. Henrekson (1988), pag. 40.

⁵⁷ Idem, pag. 44.

⁵⁸ N. Gemmell (1993).

⁵⁹ F. Hackl - F. Schneider - G. Withers (1993), pagg. 212-231.

variabili considerate in precedenza vengono raggruppate nella stima di un unico modello.

Quanto alle stime, i singoli modelli vengono verificati sul periodo 1955-85, anche perché in questo modo i risultati possono essere confrontati con stime analoghe effettuate sull'Austria⁶⁰, probabilmente perché (anche se il motivo non viene indicato dagli autori) si tratta in entrambi i casi di paesi federali.

Solo il modello strutturale (a) viene stimato per il periodo 1860-1986, perché non si dispone di dati «istituzionali» che coprono questo lungo lasso di tempo. Bisogna dire che i segni non sono sempre quelli attesi e che si notano diversi *structural break* (1929, 1939, 1950, 1974). Per gli altri modelli il *fit* è buono e molti coefficienti sono significativi e con i segni attesi. Per il periodo più recente (1955-85) «both economic structural and political institutional approaches have much to contribute»⁶¹. La crescita del reddito reale, l'illusione fiscale, la struttura dell'occupazione sembrano avere molto peso, specialmente nelle versioni in cui le variabili sono «aggiustate» per tenere conto del comune trend temporale.

Nel complesso: «both institutional and non-institutional approaches must be accorded a role in explaining the changing nature and extent of government»⁶². Fa sorgere perplessità il fatto che non siano state effettuate stime separate per le varie categorie di spesa pubblica, che, come risulta da stime relative ad altri paesi, sembrano rispondere a diverse determinanti.

Quanto all'Austria⁶³, anche se l'analisi è possibile su dati relativi al solo periodo successivo al 1955, emerge l'importanza dell'effetto prezzi relativi, mentre non sembrano significative le variabili relative alla burocrazia e ai gruppi di interesse.

Di rilievo nell'analisi sulla Francia, contenuta nel volume di Lybeck e Henrekson⁶⁴, l'osservazione che per i consumi e i trasferimenti pubblici gli effetti delle variabili di domanda e di offerta sono pressoché equivalenti, mentre risultano significative le sole variabili di offerta nella stima degli Investimenti pubblici.

Le stime di Kirchgassner e Pommerenne⁶⁵ concernono due paesi federali (Germania e Svizzera); gli autori tentano di integrare in un solo modello l'approccio politico-economico e quello dell'elettore mediano (che peraltro considerano una *mithical decision unit*). I risultati delle stime confermano le previste diverse caratteristiche dei due

⁶⁰ R. Neck - F. Schneider (1988), pagg. 231-263.

⁶¹ F. Hackl - F. Schneider - G. Withers (1993), pag. 230.

⁶² Idem, pag. 231.

⁶³ R. Neck e Schneider (1988).

⁶⁴ Aubin - Berdot - Goyeay e Lafay (1988).

⁶⁵ G. Kirchgassner e W. Pommerenne (1988).

paesi: in Germania la crescita della spesa è prevalentemente spiegata da variabili di offerta (specialmente per la spesa del governo federale), mentre in Svizzera sembrano più importanti le variabili di domanda, che sono specialmente importanti per i livelli inferiori di governo (quelli più rilevanti in questo paese).

9.3. Più volte si è fatto riferimento al volume di Henrekson⁶⁶ sulla crescita della spesa pubblica in Svezia, che comprende oltre ad analisi e stime delle «teorie» di Wagner e Peacock-Wisemam, modelli più complessi relativi allo stesso paese, sottoposti a interessanti verifiche econometriche.

Nel capitolo quinto di tale volume si affronta il problema della domanda di crescita della spesa pubblica, si ripercorrono i vari fattori discussi dalla letteratura e si formula un modello, successivamente sottoposto a stima econometrica. Il risultato mostra che i tassi di crescita della spesa per consumi pubblici, per trasferimenti in generale e per trasferimenti alle famiglie non vengono sufficientemente «catturati» da modelli di domanda: contro tassi medi di crescita osservati, nel periodo 1950-87, del 4,1, del 6 e del 5,4 per cento, i modelli considerati «spiegano» solamente il 3,2, il 3,5 e il 3,1 per cento⁶⁷. Situazione vicina a quella osservata, per un più lungo periodo di tempo, da Borcherding per gli Stati Uniti, come si è ricordato.

Di conseguenza l'autore prova a sottoporre a verifica econometrica un modello in cui alle preferenze dell'«elettore mediano» si aggiunge l'effetto Baumol; la variabile dipendente è rappresentata dal saggio di crescita della spesa per consumi pubblici⁶⁸.

La capacità previsiva del modello migliora notevolmente⁶⁹.

Ma il modello più originale di Henrekson è quello di disequilibrio, che utilizza la distinzione tra fattori che influenzano la domanda e fattori che influiscono sull'offerta di spesa pubblica, simile a quelli di Barro-Grossman e di Clower⁷⁰ per i beni scambiati nel mercato. Ma nel caso della spesa pubblica i prezzi non possono operare come meccanismo riequilibratore e, quindi, Henrekson introduce l'assunzione:

$$G = \text{Max} (G^D, G^S)$$

⁶⁶ M. Henrekson (1992).

⁶⁷ Idem, pag. 85.

⁶⁸ Idem, pagg. 103-105.

⁶⁹ «The model predicts changes in the growth rate of public consumption expenditures quite well ... The accuracy of the prediction are especially striking given the high aggregation of the data, the simplifying assumption of the model, and the errors inherent in the elasticity estimates I have used» (M. Henrekson, 1992, pag. 105).

⁷⁰ R. Barro e H. Grossman (1971); R. Clower (1965).

in cui G è la spesa pubblica effettivamente realizzata e G^D , G^S sono rispettivamente quella domandata e quella offerta⁷¹.

Senza entrare nei dettagli della costruzione e della formulazione del modello, sembra però opportuno ricordarne sinteticamente le equazioni fondamentali.

Per la domanda, che riflette principalmente le preferenze dell'elettore mediano, oltre all'effetto prezzi relativi, l'equazione-tipo da sottoporre a verifica econometrica, basata su elementi ricavati dalle diverse teorie, risulta della seguente forma:

$$G^D = A t^\theta p^\theta N^{(\alpha\theta + \alpha)} \dot{Y}^\varepsilon k^\varepsilon \prod_i m_i \beta_i$$

in cui:

A rappresenta una costante;

t è la quota di imposte dovute dall'elettore mediano rispetto al costo totale della spesa pubblica;

p è il costo unitario del bene pubblico in termini del prezzo dei beni privati;

N è la popolazione;

α è il grado di «pubblicità» dei beni pubblici, con $\alpha=0$ che indica il bene pubblico «puro» e $\alpha=1$ il bene privato «puro»;

θ è l'elasticità-prezzo della domanda di spesa pubblica;

ε è l'elasticità-reddito della stessa domanda;

β_i è l'elasticità della domanda di spesa rispetto a diverse variabili di tipo «politico», variabili rappresentate da m_i ;

\dot{Y} è il prodotto interno lordo pro capite, in termini reali;

k è il rapporto tra reddito mediano e reddito medio⁷².

In termini di saggi di sviluppo l'espressione diventa:

$$g = \theta t + \theta p + (\alpha\theta + \alpha) N + \varepsilon \dot{Y} + \varepsilon k + \sum \beta_i m_i$$

(in cui le variabili qui esprimono tassi di crescita).

Per quanto concerne l'offerta, l'equazione è di questo tipo:

$$G^S = B \prod V_i^{\delta_i}$$

in cui:

⁷¹ «Il demand exceeds supply politicians and bureaucrats are assumed to adjust promptly to an increase in demand, even though this may result in a budget deficit. Conversely, when supply exceeds demand, supply determines the actual quantity» (M. Henrekson, 1992, pag. 121).

⁷² Henrekson (1992), pag. 118. Si noti che le stime vengono effettuate in termini di saggi di sviluppo (si considerano i logaritmi e si differenzia rispetto al tempo), Henrekson (1992), pag. 84.

B rappresenta una costante;
 V^i le variabili di offerta e
 δ_i le corrispondenti elasticità.

Più precisamente, anche le variabili di offerta vengono prese in considerazione attraverso i tassi di crescita. In particolare, le principali variabili utilizzate sono: il rapporto tra il deflatore implicito delle diverse categorie di spesa utilizzate (consumi pubblici, trasferimenti, ecc.) e il deflatore implicito del PIL; la quota di occupati nella pubblica amministrazione sul totale degli occupati; *dummies* per il «colore» politico dei governi (1= socialdemocratici; 0= conservatori) e per la sua composizione (1= governo di coalizione all'interno di un blocco; 2= governo di coalizione trasversale; 0= non coalizione); la quota di imposte prelevate dal governo centrale sul totale; una variabile che consente di misurare un'espressione ampliata della disoccupazione, in quanto include i pensionati inferiori ai 65 anni di età, il cui pensionamento anticipato sia stato determinato da cause attinenti al funzionamento del mercato del lavoro.

Come si è detto la stima della sola funzione di domanda si dimostra, in termini di tassi di sviluppo, insoddisfacente; né sono soddisfacenti i risultati della stima di sole funzioni di offerta. In realtà è il modello di disequilibrio quello più idoneo a spiegare l'andamento effettivo della spesa pubblica svedese.

Questo modello viene stimato su dati annuali 1950-83 con variabili espresse sia a prezzi correnti sia a prezzi costanti; le verifiche econometriche, inoltre, vengono effettuate separatamente per le quote dei consumi pubblici, dei trasferimenti e della spesa pubblica complessiva, rispetto al prodotto interno lordo.

Il metodo di stima è la massima verosimiglianza (*maximum likelihood*). Senza scendere nel dettaglio dei risultati delle stime⁷³ (nemmeno dal punto di vista dei test statistici) si possono ricordare le conclusioni sintetizzate dallo stesso autore: «L'illusione fiscale connessa con il disavanzo di bilancio e le pressioni della burocrazia per un settore pubblico più esteso trovano forte conferma empirica come determinanti della crescita del settore pubblico svedese nel periodo successivo al 1950. Analogamente, la domanda per redistribuzione del reddito. Un notevole sviluppo dei consumi pubblici sembra attribuibile alla combinazione dell'effetto Baumol con una bassa elasticità prezzo della domanda di beni pubblici. Infine, si può trovare qualche evidenza che i governi di coalizione permettono al settore pubblico di crescere più rapidamente, sia perché trovano difficoltà interne a frenare questa evoluzione sia perché è più facile per i gruppi di interesse eser-

⁷³ Idem, pagg. 124-127 e Tabelle 9.2 e 9.3, alle pagine 133-134.

citare con efficacia azioni di lobby quando ci sono più partiti al potere»⁷⁴.

Esporre in questo modo le conclusioni delle stime del modello domanda/offerta in disequilibrio può, in realtà, mostrarsi parzialmente fuorviante: sarebbe più corretto far preciso riferimento ai valori dei coefficienti e alla significatività delle stime, per le diverse equazioni riferite alle diverse categorie di spesa. Ma nel complesso tali conclusioni possono essere accettate, purché considerate di prima approssimazione e, soprattutto, riferite al periodo di stima e non estrapolate superficialmente al futuro.

Altre stime, concernenti l'elasticità del valore assoluto della spesa pubblica rispetto alle diverse variabili di domanda e offerta sono anche state effettuate: esse si estendono al periodo 1950-84. Queste stime consentono di integrare in parte le conclusioni. Per i consumi pubblici le variabili di offerta sembrano avere maggiore efficacia di quelle di domanda: l'effetto Baumol, i prezzi relativi, e la quota dell'occupazione pubblica mostrano coefficienti sicuramente significativi e con il segno atteso. Le variabili di tipo politico, ossia le *dummies* concernenti il colore del governo e le coalizioni, sono significative, ma il loro «peso» è esiguo. Risulta, invece, rilevante la variazione della quota di gettito tributario prelevata dai livelli inferiori di governo, specialmente nelle stime della crescita dei consumi pubblici; anche la quota di lavoro femminile, usata come *proxy* del costo crescente di raccolta del gettito tributario, è significativa. Dal lato della domanda, l'effetto principale è quello che deriva dalla variabile costruita come quota (sul totale della popolazione) dell'insieme di ultra sessantacinquenni e persone non ancora entrate nel mercato del lavoro; l'elasticità della spesa rispetto al PIL risulta superiore all'unità, mentre il rapporto reddito mediano/reddito medio mostra il previsto segno negativo (anche se la significatività del coefficiente è scarsa).

Per quanto concerne i trasferimenti, sembrano importanti sia i fattori di domanda sia i fattori di offerta. La variabile «disoccupazione estesa» ha segno positivo e alta significatività, così come la quota di occupazione femminile che determina anche una elevata elasticità. Dal lato della domanda è importante la variabile che tende a «catturare» l'influenza dei gruppi di interesse (il grado di sindacalizzazione della forza lavoro) e ancora di più, dal punto di vista dell'entità del coefficiente, la percentuale non attiva di popolazione, mentre l'elasticità rispetto al reddito reale non è significativamente diversa da zero.

Infine è stata tentata qualche stima della crescita della spesa per investimenti pubblici, ma i risultati sono del tutto insoddisfacenti: «it is doubtful to assume that government growth theories are applicable

⁷⁴ M. Henrekson (1992), pag. 136.

for investment»⁷⁵. In ogni caso sarebbe necessario costruire un apposito modello, con variabili probabilmente molto diverse.

Mi pare che si possa sicuramente affermare che l'analisi di Henrekson rappresenta attualmente il livello più avanzato dalla ricerca empirica (econometrica) in materia di crescita di lungo periodo della spesa pubblica. L'innovazione più rilevante è stata l'applicazione del disquilibrio alla metafora della domanda e dell'offerta di spesa pubblica, data l'inesistenza in questo pseudo-mercato del meccanismo riequilibratore dei prezzi.

La sua ricerca è stata sicuramente favorita dalle ampie disponibilità di dati sulla finanza pubblica (e sull'economia) della Svezia. Anche per questa ragione in altri paesi si incontrano maggiori difficoltà ad effettuare stime econometriche della dinamica di lungo periodo delle spese pubbliche.

Più in generale, le ricerche più recenti qui ricordate sembrano mostrare che in questo campo qualche progresso (rispetto a quanto lamentato da Diamond e Tait nel 1988) sia stato compiuto.

Se si rovescia la problematica e si vogliono osservare gli effetti della spesa pubblica sulla crescita, i problemi di tipo econometrico non si riducono. Come osserva Slemrod⁷⁶: «...existing cross-country studies suggest that there is no persuasive evidence that the extent of government has either a positive or a negative impact on either the level or the growth rate of percapita income, largely because the fundamental problems of identification have not yet been adequately addressed».

10. Le caratteristiche delle analisi della crescita della spesa pubblica in Italia

I dati riportati nella Tabella 1 mostrano che l'Italia ha condiviso il «trend» di crescita di lungo periodo del rapporto tra spesa pubblica e prodotto interno lordo⁷⁷. Di conseguenza non sono mancati tentativi di spiegare questo andamento sia facendo riferimento alle analisi effettuate negli altri paesi e, quindi, a spiegazioni di tipo generale⁷⁸, sia soffermandosi sulle (vere o presunte) specificità del «caso» italiano.

In un volume del 1993⁷⁹, Daniele Franco sviluppa un'analisi della crescita della spesa pubblica italiana nel trentennio 1960-90, su cui ci soffermeremo tra breve, e passa anche in rassegna i lavori che nel nostro Paese si sono occupati, nel corso degli anni Settanta e Ottanta, della

⁷⁵ M. Henrekson (1992), pag. 144.

⁷⁶ J. Slemrod (1995), pag. 401.

⁷⁷ Per un'analisi più dettagliata della dinamica della Finanza pubblica italiana nell'ultimo trentennio si veda G. Morcaldo (1993).

⁷⁸ A partire dalle osservazioni di F.S. Nitti (1903), riportate in parte all'inizio.

⁷⁹ D. Franco (1993).

questione⁸⁰, il che ci esime dal compito di ripetere questo sforzo e di ricordare tutti i contributi. In sintesi, si tratta di studi che solo in alcuni casi utilizzano tecniche econometriche, mentre più spesso confrontano semplicemente i trend di diversi insiemi di dati e talvolta le osservazioni sono di tipo sostanzialmente qualitativo (con qualche insieme di dati sullo sfondo). In questi ultimi viene di solito attribuita molta importanza ai meccanismi istituzionali (di tipo procedurale) di approvazione delle variazioni di spesa pubblica (ad esempio, Giarda, 1989).

Quanto ai risultati e alle conclusioni di questi studi, per quanto concerne le determinanti «strutturali»:

- a) sembra rilevante l'effetto prezzi relativi (o Baumol): i costi dei beni pubblici crescono maggiormente di quelli dei beni privati;
- b) l'elasticità reddito della spesa pubblica risulterebbe inferiore all'unità;
- c) l'elasticità della spesa rispetto alla popolazione sembrerebbe maggiore di uno.

«Nel complesso, la variazione dei prezzi pubblici, l'aumento del reddito e l'espansione della popolazione sembrerebbero spiegare una parte rilevante (circa il 60 per cento) della crescita della spesa pubblica in termini reali registrata negli ultimi decenni»⁸¹.

Quanto alle spiegazioni di tipo «politico-istituzionale», vanno ricordati i contributi di Brosio e Marchese⁸², che fanno riferimento ai gruppi di pressione (la variabile che utilizzano nelle stime econometriche sono le ore di sciopero per abitante) e alle diseguaglianze di reddito (indicatore della pressione per la redistribuzione attraverso il bilancio pubblico). Le stime trovano il segno atteso e il coefficiente della redistribuzione è quello maggiore. Il modello del 1986 è articolato per le diverse fasi politiche attraversate nella storia del nostro Paese dall'Unità in poi; anche se diversamente «pesate» e spiegate, le principali determinanti della dinamica della spesa restano quelle ricordate. Ai meccanismi di tipo politico fanno riferimento esplicito molte analisi⁸³; particolarmente importante, per il caso italiano, sembra il riferimento alla «forza» del finanziamento in disavanzo della crescita della spesa pubblica: gli stessi dati mostrano come il rapporto spesa pubblica/PIL abbia raggiunto in Italia valori più alti della media dei paesi europei solo a causa dell'onere per interessi, determinato da un'espansione precedente in disavanzo che ha alimentato lo stock di debito pubblico. Espansione che è stata resa più agevole dall'illusione finanziaria dell'inesistenza dell'onere. Se si fosse ricorsi all'aumento

⁸⁰ D. Franco (1993), capitolo 2°, pagg. 35-51.

⁸¹ Idem, pag. 40. Un'analisi di Fossati (1989) raggiunge conclusioni drastiche: «la spesa non ha subito influenze di lungo periodo di tipo politico... contrariamente a quanto ci si poteva aspettare» (pag. 289).

⁸² G. Brosio e C. Marchese (1986), (1988).

⁸³ D. Franco (1993), pagg. 41-46.

del gettito tributario forse non sarebbe stato realizzato un tale ritmo di aumento della spesa. Qualche minore rilevanza sembrerebbe aver avuto l'istituzione delle regioni, all'inizio degli anni Settanta di questo secolo⁸⁴.

Come rileva Franco⁸⁵, gli studi considerati hanno seguito un approccio eccessivamente aggregato, sulla scia dei tentativi di stima di leggi generali di crescita della spesa pubblica. Già nel 1985, a cura dell'OCSE⁸⁶ era stato condotto invece uno studio di tipo diverso su più paesi che mirava ad individuare tassi di crescita «spiegabili» di categorie dettagliate di spesa, spiegabili principalmente con l'andamento delle grandezze più immediatamente determinanti la loro dinamica (ad esempio: il numero degli insegnanti per le spese di istruzione, ecc.).

Un approccio analogo viene seguito da Franco per l'Italia, limitatamente alla «spesa sociale» (ossia all'istruzione e alla sanità, oltre che alla previdenza e all'assistenza)⁸⁷. L'analisi, molto ricca, non può essere qui sintetizzata efficacemente, ma se ne vogliono ricordare le conclusioni più strettamente rilevanti per questo lavoro.

Tra il 1960 e il 1990 la spesa è cresciuta di oltre 11 punti percentuali del PIL; i fattori demografici sembrano aver contribuito per quasi l'1,5 per cento circa. L'estensione dei servizi, dovuta all'operare sia di elementi di domanda (ritenuti preminenti dall'autore) sia di fattori di offerta, ha contribuito per circa 6,7 punti percentuali del PIL.

Il costo dei servizi (effetto Baumol) sembra, invece, nell'ambito considerato (spesa sociale), aver avuto un effetto opposto (-0,28 per cento), a causa principalmente degli aumenti di produttività nella sanità e al ridimensionamento delle retribuzioni degli insegnanti⁸⁸.

La variazione della quantità reale dei servizi resi ha pesato per 5 punti e mezzo circa, mentre la crescita del reddito complessivo sembra aver indotto una contrazione del rapporto per circa 2 punti del PIL.

Nel complesso⁸⁹, quindi, la crescita del rapporto tra spesa sociale e PIL, è correlata a fattori con andamenti differenziati, difficilmente riconducibili a unità.

⁸⁴ I. Rizzo (1985). Una recentissima analisi (Anderson e Van Den Bergh, 1998) condotta, tra l'altro, sui dati dei singoli Stati degli USA non trova conferma all'effetto dell'articolazione federale sulla crescita della spesa (né in positivo né in negativo).

⁸⁵ D. Franco (1993), pag. 51.

⁸⁶ P. Saunders e F. Klau (1985).

⁸⁷ D. Franco (1993), pag. 179. Si tratta del 50 per cento circa delle spese (al netto degli interessi sul debito pubblico); inoltre la loro crescita corrisponde ai due terzi dell'incremento del rapporto tra le stesse spese e il PIL nel periodo 1960-90.

⁸⁸ «Il ruolo svolto dall'andamento dei costi relativi viene ridimensionato dal fatto che essi non sono rilevanti nel settore che più ha contribuito alla crescita della spesa, quello previdenziale e assistenziale, e del fatto che nel settore sanitario la produttività è cresciuta in misura significativa» (D. Franco, 1993, pag. 202).

⁸⁹ D. Franco (1993), pag. 198, Tabella 55.

Inoltre, il periodo sembra soggetto a uno *structural break*: tra il 1960 e la metà degli anni Settanta la crescita della spesa pare determinata prevalentemente da fattori «strutturali», mentre per il periodo successivo i fattori «politico-istituzionali» prevarrebbero⁹⁰.

A nostra conoscenza il lavoro di Franco rappresenta il tentativo più approfondito di fornire valutazioni «quantitative» delle spiegazioni della crescita della spesa pubblica italiana negli ultimi decenni; altre analisi sarebbero comunque auspicabili sia per completare l'analisi della spesa non coperta nel lavoro sia per sottoporre a «stime» di tipo diverso le spiegazioni della crescita, che molto probabilmente non sarebbero in contraddizione con quelle qui ricordate.

11. Considerazioni conclusive

La crescita del «peso» della spesa pubblica si è accompagnata nell'ultimo secolo a quella del prodotto (complessivo e pro capite), almeno nei paesi ad economia sviluppata.

Questa tendenza, individuata precocemente da alcuni studiosi già nel periodo a cavallo tra la fine dell'Ottocento e l'inizio del Novecento (si pensi principalmente a A. Wagner, ma anche a F. S. Nitti), ha generato un filone di ricerca sulla crescita di lungo periodo della spesa pubblica il cui sviluppo non si è ancora arrestato. Queste analisi, il cui punto di partenza viene normalmente individuato nell'opera di A. Wagner, si sono progressivamente arricchite di maggiore accuratezza; le stesse opinioni di A. Wagner, espresse in maniera imprecisa, sono state sottoposte a interpretazioni che hanno cercato di aumentarne il rigore, fino a presentarle in formulazioni che hanno assunto il rango di «legge» scientifica da sottoporre a verifica.

Nel corso di questo secolo le tendenze effettive delle economie e delle finanze pubbliche dei paesi sviluppati sembravano in prima approssimazione avvalorare la validità di tale «legge». In realtà, le analisi sempre più articolate del fenomeno della crescita della spesa pubblica hanno portato a smentire sia la legge di Wagner sia altre spiegazioni «sintetiche» del fenomeno (sostanzialmente quelle legate ai nomi di Peacock e Wiseman).

Dal punto di vista metodologico, bisogna attribuire alla scuola di *Public Choice* il merito di aver favorito analisi molto più articolate del problema, abbandonando l'approccio uni-causale. La separazione delle cause di aumento della spesa attribuibili a spinte provenienti dalla domanda dei cittadini-elettori da quelle originate nell'offerta, ha consentito di articolare più precisamente anche le stime econometriche, anche se discutibile resta il ruolo specifico attribuito alle singole variabili. I risultati di questi studi (che hanno, ad esempio, consen-

⁹⁰ Idem, pag. 201.

tito di valutare la diversa rilevanza nei vari paesi del *Baumol disease*) hanno scosso profondamente le fondamenta delle «leggi» di crescita della spesa pubblica.

Gli studi più recenti, oltre a sottoporre a verifica econometrica modelli simultanei di domanda e di offerta, hanno adottato modelli di stima in disequilibrio (Henrekson).

La conclusione, di tipo sostanziale, che queste analisi sembrano suggerire è che l'innegabile (anche se i problemi di misurazione sono molto rilevanti) diffusa crescita della spesa che si è avuta negli ultimi decenni non è necessariamente connessa con quella del reddito, nel senso che non si può ad esempio sostenere che un suo ulteriore aumento comporterà necessariamente un'ulteriore crescita del «peso» della spesa pubblica (e/o delle sue diverse componenti).

Quasi metà del prodotto interno lordo dei paesi sviluppati passa «attraverso» i bilanci pubblici (Tabella 1): il rapporto spesa pubblica-PIL ha in questi paesi raggiunto il suo massimo? Se ne può prevedere un arresto o addirittura una riduzione?

È impossibile rispondere a queste domande utilizzando i modelli di dinamica della spesa considerati in questo lavoro. Le variabili politico-economiche sono molto rilevanti nella spiegazione del trend osservato e sono variabili i cui livelli e i cui andamenti sono, con qualche difficoltà, «spiegabili» per il passato, ma difficilmente prevedibili.

È necessario far riferimento agli studi che si interrogano sul futuro del «ruolo economico dello Stato», che non sono numerosi e sono condizionati spesso da premesse ideologiche, del tipo «più mercato, meno Stato» o, per quel che vale, viceversa.

In un *paper* recente D. Rodrik⁹¹ pone in rilievo il carattere complementare di Stato e mercato, derivante da quella parte di funzione di *social insurance* che lo Stato svolge in maniera esclusiva. A questo ruolo, tra l'altro, D. Rodrik attribuisce il maggior peso della spesa pubblica nei paesi ad economia aperta. Questa caratteristica di maggior sicurezza offerta dalla spesa pubblica all'attività produttiva e alle scelte di tutti gli agenti economici è stata rilevata anche da altri economisti⁹². Da questo punto di vista è prevedibile che la presenza della spesa pubblica si manterrà ancora rilevante. D'altro canto, si fa notare⁹³ che lo sviluppo dell'intervento dello Stato nel mercato si è accompagnato negli ultimi decenni a una «dereliction of attention to the core activities of the state ... The end result was a deterioration in

⁹¹ D. Rodrik (1997).

⁹² G. W. Sinn (1996), che ricorda anche importanti episodi storici (Repubblica di Venezia, città anseatiche) in cui la presenza della spesa pubblica, riducendo il rischio dell'attività economica, determinò il successo economico di questi Stati rispetto ai paesi contemporanei. Si veda anche H. W. Sinn (1995).

⁹³ V. Tanzi (1997), pag. 15.

the quality of the basic services provided by the state». Sarebbe troppo impegnativa, e andrebbe oltre l'oggetto di questo lavoro, una discussione di questi temi, ma il ricordarli serve a confermare la difficoltà di individuare la futura dinamica della spesa pubblica. Ancor più complessa, tra l'altro, è la questione nei paesi in via di sviluppo⁹⁴.

Dal punto di vista metodologico, sembra importante superare la dicotomia Stato/mercato, legata a una visione «normativa» della politica economica, alla economia dei «fallimenti del mercato», né può essere condiviso l'opposto approccio del «fallimento dello Stato», spesso proposto con spirito dogmatico. Come osserva Dixit⁹⁵: «what we can do is to understand how the whole system consisting of markets and governments copes with the whole sets of problems of conflicting information, incentives, and actions...».

D'altro canto, la storia dimostra che il ruolo economico dello Stato è cambiato varie volte, seguendo più la logica del pendolo⁹⁶ che quella della linea retta: ad esempio, dal mercantilismo al *laissez-faire*, da questi al *welfare state*, ecc.

Si tratta di questioni che meritano complessi approfondimenti, ma che consentono di escludere facili previsioni: il periodico *The Economist*, nel ricordato inserto sul «futuro dello Stato», concludeva «The notion that the pendulum is switching back from too much reliance on market to a wiser understanding of the role of government» mostra quanto sia radicata l'idea dell'utilità della presenza dello Stato e che la diffusa concezione che bisogna mantenere un forte legame tra i cittadini, attraverso lo Stato, «augurs well for big governments»⁹⁷.

⁹⁴ D. Rodrik (1997).

⁹⁵ A. Dixit (1996), pagg. 2-3.

⁹⁶ D. Rodrik (1997), pag. 412.

⁹⁷ *The Economist* (1997), pag. 56.

BIBLIOGRAFIA

- Anderson J. - Van Den Bergh H. (1998), *Fiscal decentralization and Government size: an international test for Leviathan Accounting for Unmeasured economic activity*, in *International Tax and Public Finance*, pagg. 171-186.
- Anderson T. - Stratmann T. (1993), *The political economy of Public sector growth in the United States*, in Gemmell N. (1993).
- Aubin C. - Berdot J. P. - Goyeay D. - Lafay J. D. (1988), *The growth of public expenditure in France*, in Lybeck J. - Henrekson M. (1988).
- Barro R. - Grossman H. (1971), *A general disequilibrium model of income and employment*, in *American Economic Review*, pagg. 82-93.
- Beck M. (1976), *The expanding public sector: some contrary evidence*, in *National Tax Journal*, pagg. 15-21.
- Becker G. S. (1985), *Public policies, Pressure groups, and deadweight costs*, in *Journal of Public Economics*, pagg. 329-348.
- Bird R. M. (1970), *The growth of government spending in Canada*, in *Canadian Tax papers*.
- Bird R. M. (1972), *The displacement effect: a critical note*, in *Finanzarchiv*, pagg. 454-463.
- Borcherding T. E. (1977), *The sources of growth of public expenditures in the United States, 1902-1970*, in Borcherding T. E. (a cura di), *Budgets and Bureaucrats: the sources of government growth*, Durham, Duke University Press.
- Borcherding T. E. (1985), *The causes of government expenditure growth: a survey of the U.S. evidence*, in *Journal of Public Economics*, pagg. 359-392.
- Brosio G. - Marchese C. (1986), *Il potere di spendere. Economia e storia della spesa pubblica dall'unificazione a oggi*, Bologna, Il Mulino.
- Brosio G. - Marchese C. (1988), *The growth of public expenditure in Italy since the second world war*, in Lybeck J. - Henrekson M. (1988).
- Clower R. (1965), *The Keynesian counter-revolution: a theoretical appraisal*, in Hahn F. M. - Brechling, *The theory of Interest rates*, London, Mac Millan.
- Cullis J. - Jones P. (1993), *The economics of bureaucracy*, in Gemmell N. (1993).
- Diamond J. (1977), *Econometric testing of the «Displacement effect»: a reconsideration*, in *Finanzarchiv*, pagg. 387-404.
- Diamond J. - Tait A. (1988), *The growth of government expenditure: a review of quantitative analysis*, in *International Monetary Fund working paper*, n. 88/17.
- Dixit A. (1996), *The making of economic policy: A transaction- cost politics perspective*, MIT Press, Cambridge (Mass.).
- The Economist* (1997), *The future of the state*, 20 settembre.
- Fossati A. (1989), *Economia pubblica*, Milano, F. Angeli.
- Franco D. (1993), *L'espansione della spesa pubblica in Italia*, Bologna, Il Mulino.
- Frey B. (1988), *Explaining the growth of government: international perspectives*, in Lybeck J. - Henrekson M. (1988).

- Gemmell N. (1993), *The growth of public sector: theories and international evidence*, Aldershot, Elgar.
- Giarda P. (1989), *Riflessioni sulla crescita della spesa pubblica in Italia*, in *Rivista milanese di economia*.
- Hackl F. - Schneider F. - Withers G. (1993), *The public sector in Australia: a quantitative analysis*, in Gemmell N. (1993).
- Hamlin A. (1993), *Public expenditure and political process*, in Gemmell N. (1993).
- Henrekson M. (1992), *An economic analysis of Swedish government expenditure*, Aldershot, Avebury.
- Kirchgassner G. - Pommerenne W. (1988), *Government spending in federal systems: a comparison between Switzerland and Germany*, in J. Lybeck - M. Henrekson (1988).
- Larkey P. - Stolp C. - Winer M. (1991), *Theorizing about the growth of government: a research assessment*, in *Journal of Public Policy*, pagg. 157-220.
- Lindbeck A. (1985), *Redistribution policy and the expansion of the public sector*, in *Journal of Public Economics*, pagg. 309-328.
- Lybeck J. (1986), *The growth of government in developed economies*, Aldershot, Gower.
- Lybeck J. - Henrekson M. (1988), *Explaining the growth of government*, Amsterdam, North-Holland.
- Myhrman J. (1985), *Introduction: reflections on the growth of government*, in *Journal of Public Economics*, pagg. 275-286.
- Morcaldo G. (1903), *La finanza pubblica in Italia*, Bologna, Il Mulino.
- Musgrave R. (1969), *Fiscal Systems*, New Haven, Yale University Press.
- Musgrave R. (1985), *Excess bias and the nature of budget growth*, in *Journal of Public Economics*, pagg. 287-308.
- Neck R. - Schneider F. (1988), *The growth of public expenditure in Austria: an exploratory analysis*, in Lybeck J. - Henrekson M. (1988).
- Niskanen W. (1971), *Bureaucracy and representative government*, Chicago, Aldine.
- Nitti F. S. (1903), *Principi di Scienza delle Finanze* (specialmente capp. IV-V, pagg. 55-84) Napoli, Pierro.
- North D. (1985), *The growth of government in the United States: An economic historian's perspective*, in *Journal of Public Economics*, pagg. 383-400.
- Olson M. (1992), *The rise and decline of Nations: economic growth, stagflation and social rigidities*, New Haven, Yale Univ. Press.
- Peacock A. - Wiseman J. (1961), *The growth of public expenditures in the U.K.*, Princeton, Princeton Univ. Press.
- Peacock A. - Wiseman J. (1979), *Approaches to the analysis of government expenditure growth*, in *Public Finance Quarterly*, pagg. 3-23.
- Placentino D. (1984), *L'espansione delle finanze pubbliche nei paesi industriali*, Milano, F. Angeli.
- Rizzo I. (1985), *Regional disparities and decentralization as determinants of public sector expenditure in Italy (1960-1981)*, in Forte F. - Peacock A. (a cura di), *Public expenditure and Government growth*, Oxford, Blackwell.
- Rodrik D. (1997), *The «paradoxes» of the successful state*, in *European Economic Review*, pagg. 411-442.
- Saunders P. - Klau F. (1985), *Le rôle du secteur public: causes et conséquences de l'élargissement du secteur public*, Paris, OCDE.

- Sinn H.W. (1995), *A Theory of the welfare state*, in *Scandinavian Journal of Economics*, pagg. 495-526.
- Sinn H.W. (1996), *Social Insurance, Incentives and Risk Taking*, in *International Tax and Public Finance*, pagg. 259-280.
- Slemrod J. (1995), *What do cross-country studies teach about government involvement, prosperity, and economic growth?*, in *Brookings Papers on Economic Activity*, n. 2, pagg. 373-415.
- Tanzi V. - Schuknecht L. (1995), *The growth of government and the Reform of the State in industrial countries*, in *International Monetary Fund working paper*, 95/130.
- Tanzi V. (1997), *The changing role of the State in the economy: a historical perspective*, in *International Monetary Fund working paper*, 97/114.
- Tussing A. - Henning J. (1979), *Econometric testing of the Displacement effect: a comment*, in *Finanzarchiv*, pagg. 476-484.
- Wagner A. (1893), *Finanzwissenschaft*, Leipzig, riprodotto in inglese in Musgrave R. - Peacock A., *Classics in the Theory of public finance*, London, MacMillan, 1958.
- Wildavsky A. (1985), *A cultural theory of expenditure growth and (un) balanced budgets*, in *Journal of Public Economics*, pagg. 349- 358.