

Att planera är nödvändigt

Carl Johan Åberg försvarar i sin artikel den prognos- och planeringsverksamhet som Jan Wallander attackerat. Åberg menar att det är de enkla trendbaserade prognosmodellerna som måste bort, inte prognoserna som sådana. Tvärtom kräver större ekonomisk variabilitet mer prognosverksamhet, inte mindre. Han påpekar också att prognoserna inte behöver ges som en enda siffra utan mycket väl med ett konfidensintervall som visar osäkerheten.

Jan Wallander har sedan flera år tillbaka försökt att stimulera till en debatt om prognoser och planering. Det är i första hand i två olika småskrifter från Handelsbanken 1979 och 1981 där dessa problem tagits upp till behandling. Men är man — som Wallander — styrelseordförande i ett antal storföretag, kan man snabbt omsätta sina synpunkter och teorier i konkret handling, vilket tydligen Wallander också gjort i t ex Handelsbanken och Dagens Nyheter.

Han har också på ett något ytligt plan fått stöd för sin förment planeringsfientliga inställning från t ex Gösta Bystedt i Electrolux och Ivar Kamprad i Ikea. "Mindre planering och mera flexibilitet" är den slagordsmässiga förnklingen av Wallanders budskap.

Något större gensvar i den teoretiska debatten har han emellertid inte fått. Det är egentligen bara Rune Brandinger som i tidskriften *Ekonomien* tagit upp Wallanders teser till en närmare granskning. Men de är väl värda en fortsatt diskussion — och detta av två delvis motstridiga skäl. Dels har han i långa stycken rätt i sin grundläggande

observation att planerings- och prognosförutsättningarna förändrats till följd av utvecklingen under 70-talet. Konsekvenserna av detta förhållande kan behöva studeras närmare.

Dels har han emellertid, enligt min mening, dragit fel slutsatser av detta förhållande. Bli framtiden svårare att förutsäga så krävs det *mer* — inte mindre — planerings- och prognosarbete. Detta är inte minst viktigt för att kartlägga vilka konsekvenserna blir av den ökade osäkerheten. Eljest finns det en risk för att mera planeringsinriktade företag eller länder tar överhanden och att den egna verksamheten mer och mer kommer att få den defensiva reträttens karaktär.

Wallanders teser

I den första småskriften "Om prognoser, budgetar och långtidsplaner" (Wallander [1979]) redovisar han hur prognososäkerheten ökat under 70-talet. Med exempel från i första hand 1975 års långtidsutrednings branschprognoser kan han visa hur förändringarna under åren omkring 1975 missades. Tidigare år följde produktionen inom flertalet branscher en trendmässig utveckling som gjorde det möjligt att relativt väl förutsäga den framtida utvecklingen. "Försiktighetsfelen" dominerade. I den snabbt expanderande varvsindust-

*Docent CARL JOHAN ÅBERG var tidigare planeringschef inom finansdepartementet och är nu chefredaktör för *Aftonbladet*.*

rin underskattades t ex oftast öknings-talen — medan de överskattades i t ex den stagnerande textil- och beklädnadsindustrin. Men skillnaderna var i allmänhet små ända fram till mitten av 70-talet då trenderna bröts på ett långt mera dramatiskt sätt än vad 1975 års långtidsutredning kunde förutsäga.

Ett fortsatt studium av långtidsutredningarna — vi har sedan dess fått ytterligare tre sådana utredningar — skulle ge vid handen att prognosfelen inte bli vit mindre under senare år. De har måhända förändrat karaktär och består numera till större delen av felslagna förhoppningar om att den ekonomiska politiken skall kunna åstadkomma förändringar. Men likväl är de knappast i sin nuvarande form någon säker grund för vare sig handlandet inom den ekonomiska politiken eller inom företagen.

Wallander har ytterligare ett exempel i denna första småskrift på prognoserna inom ett enskilt företag. Det gäller L M Ericssons interna prognoser över behovet av leveranser från fabriker av dels den gamla typen av elektromekaniska telefonväxlar, dels växlar till elektroniska stationer (AXE-systemet). I ett intressant material kan Wallander visa hur detta företag, som betraktas som ett av de mera välskötta och professionella bl a just på framtidsbedömningarnas område, systematiskt överskattade behovet av elektromekaniska växlar — samtidigt som man underskattade uppgången på den elektroniska sidan. Se *diagram 1*.

Fallet i efterfrågan på de elektromekaniska växlar blev betydligt snabbare än vad företaget räknat med. Denna överskattning av marknaden ledde till att man höll kvar en produktionskapacitet inom detta produktområde längre än vad som var försvarbart. De omställningsproblem detta ledde till när de väl tvingades fram har vi sett en rad exempel på landet över.

I en följande småskrift "Om styrning

av företaget" (Wallander [1981]) fullföljer Wallander de slutsatser som antytt redan i den tidigare skriften. Han är starkt kritisk till den speciella typ av framtidsplanering som tar sig formen av årsbudgetar vilka som grundmaterial har en rad olika prognosförutsättningar om företags externa förhållanden vad gäller efterfrågeutveckling, konkurrentbeteende m m.

Det som Wallander i realiteten här avråder från är användningen av ett *fix-periodiskt planeringssystem* som innebär att man vid inledningen av en viss planeringsperiod fastlägger en budget eller plan — baserad på ett visst antal förutsättningar om omvärldens utveckling. Sedan ligger den budgeten i stort sett still under den ifrågavarande tidsperioden — det kan röra sig om både år och längre tidsperioder — varefter man avläser resultatet när perioden har gått till ända. Det är alltså först efter det att perioden har gått till ända som man registrerar utfallet och vidtar ev förändringar.

Vad Wallander förefaller argumentera för är i stället en rullande planering i korta perioder som innebär att inga beslut tas förrän de är nödvändiga att ta och att alla förändringar som påverkar verksamhetens resultat omedelbart föranleder en omprövning av budgeten.

Utan att ha själv i alla delar stått bakom slutsatserna har dock Wallanders skrifter i den allmänna debatten tolkats som planeringsfientliga och flexibilitetsvänliga. Ökar osäkerheten om framtiden bör man söka förändra sin verksamhet så att känsligheten för denna osäkerhet minskar. Resurserna bör inte låsas vid vissa bestämda inriktningar utan göras så rörliga som möjligt. I stället för att ägna tid åt prognoser och framtidsbedömningar bör man skärpa uppmärksamheten kring den faktiska utvecklingen och snabbt anpassa sig till dess förändringar.

Wallander har i sin debatt med Bran-

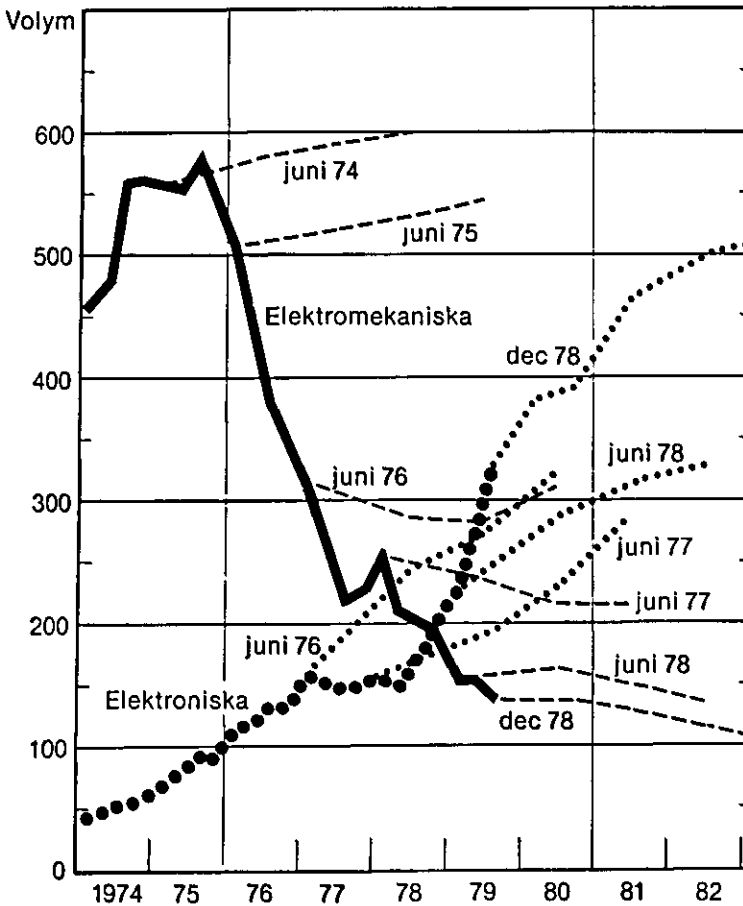


Diagram 1. Prognoser för LM Ericssons produktion av elektromekaniska respektive elektroniska stationer och växlar.

dingar värjt sig mot alltför fyrkantiga tolkningar av sitt budskap. Men han har inte varit särskilt pedagogisk i sina försök att klargöra på vilket sätt dessa fyrkantiga slutsatser är felaktiga. Jag tror därför att det är viktigt att debatten fortsätter och att vi inte lämnar Wallanders resonemang med fullt så enkla slutsatser som de som hittills dragits.

Wallanders felslut

Wallander har i en viss mening rätt när han säger att prognososäkerheten ökat sedan mitten av 70-talet. Han har rätt i den meningen att de enkla trendmodeller som gick igen i så många marknadsundersökningar och i enklare ekono-

metriska modeller inte längre fungerar. Men det är viktigt att slå fast att *den ökade osäkerheten just består i att de enkla trendframskrivningarna inte längre fungerar*. De relativt stabila trender som vi levde med under en stor del av efterkrigstiden baserades t ex på långsamt fallande relativa råvaru- och energipriser och därmed på en ständigt förbättrad "terms of trade"-situation för industriländerna i förhållande till utvecklingsländerna. De baserades också på en hög och tämligen stabil investeringskvot och kapitalbildning och en därmed sammanhängande snabb ökning av produktiviteten per arbetstimme.

Men många av dessa grundtrender bröts i början och mitten av 70-talet. En

utlösande faktor var att den monetära disciplin som legat bakom Bretton-Woods-överenskommelsen upphörde att fungera. En annan var att oljeländerna för första gången kunde förena sig i en effektiv priskartell. Vi fick en jättelik omfördelning av sparandet i världsekonomin som fick kraftiga återverkningar på investeringsbeteendet och på räntorna.

Denna delvis dramatiska utveckling kan naturligtvis tolkas som att osäkerheten har ökat och att det inte längre är möjligt att effektivt förutsäga framtiden. Den kan också tolkas så att man måste överge de trendbaserade modeller som ekonometrikerna arbetat med under en så stor del av efterkrigstiden och i stället ersätta dessa med modeller som innehåller helt nya variabler och helt nya ekvationer.

Den ekonomiska utveckling vi haft sedan mitten av 70-talet är naturligtvis också förutsägbar, under förutsättning att man har en i någon mening riktig modell som återspeglar den nya situation som världsekonomin nu befinner sig i. Även om det är ett brott i en tidigare trend är det t ex ingen omöjlighet att förklara den kraftiga nedgången i efterfrågan på nybyggda oljetankers med hjälp av en tämligen enkel modell över oljepris, oljeefterfrågan, transportbehov och existerande tanktonage. Vi var i själva verket i 1975 års långtidsutredning, vilket också Wallander påpekar i sin uppsats 1979, ganska nära att på grundval av en sådan modell förutsäga en stor del av den omsvängning i nybyggnadsbehovet som sedermera skapat sådana kriser i den svenska varvsindustrin.

På motsvarande sätt måste det också vara möjligt att bygga en modell som fångar upp de senaste årens utveckling på järn- och stålområdet och som också på ett liknande sätt i sig bygger in en investeringsfunktion och olika kapacitetsvariabler.

Jag vill självfallet inte hävda att det här är gjort i en handvändning. Tvärtom krävs det säkert ett hårt arbete att anpassa prognosmaskineriet till de nu existerande förutsättningarna. Men så länge vi har ett antal förutsägbara grundbeteenden hos företag och konsumenter så måste man med utgångspunkt ifrån dessa ändå kunna förutsäga vad resultatet av även tämligen omvälvande förändringar kommer att bli. Det viktiga är att man bryter upp från de trendbaserade modellerna; däri vill jag ge Wallander helt rätt.

Men det är inte tillräckligt att enbart raffinera prognostekniken. Väl så viktigt är det att komma åt den felaktiga användning av prognosinformation som Wallander själv egentligen gör sig skyldig till. Wallanders andra felslut är nämligen att han, så långt jag har kunnat tolka honom, kritiserar en beslutsstrategi som skulle kunna kallas för "Als ob"-strategin.

Den innebär att man försöker reducera en osäkerhetssituation till en situation då man kan simulera ett beslutsfattande under säkerhet ("certainty equivalence"). Beslutsfattaren ger helt enkelt prognosmakaren i uppdrag att ta fram den mest sannolika prognosen över utvecklingen av t ex inflåningen till en affärsbank för ett kommande år eller — för att ta ett mig närliggande exempel — upplageutvecklingen för en dagstidning. Efter olika beräkningar levererar sedan statistikern de efterlysta uppskattningarna i form av en enda prognos över den mest sannolika utvecklingen, varpå beslutsfattaren handlar som om detta skulle komma att förverkligas, dvs som om denna utsaga om framtiden vore helt säker. Genom prognoserna kan han alltså handla "als ob" han befann sig i en situation med full säkerhet om framtiden.

Detta grundläggande beteende förändras inte nämnvärt om prognosmakaren får i uppdrag att utarbeta alterna-

tiv. De flesta beslutfattare väljer då något mittenalternativ (mittenregression).

Det är givet att om prognoserna är osäkra så kommer denna "Als-ob"-strategi att leda till att beslutfattaren många gånger upplever sig ha handlat fel. Ju oftare prognoserna slår fel desto oftare kommer de att ha gett upphov till felaktiga beslut. Och då är det lätt att hamna i Wallanders defaitistiska slutsats, nämligen att det "expost" framstår som rationellare att inte alls ha använt prognoser, utan att i stället anpassa sig så snabbt som möjligt till den förändrade faktiska utvecklingen.

Enligt min mening utgår emellertid Wallander — och alla andra som använder samma enkla beslutsstrategi — från en felaktig användning av prognoser och framtidsbedömningar. Det har sedan länge visats — först i Luce-Raiffa [1957] och mest systematiskt och detaljrikt i Theil [1965] — att denna mest sannolika utfallsstrategi inte är ett optimalt sätt att hantera information om framtiden. Tvärtom gäller det att försöka kartlägga alla de olika kombinationer av efterfrågan, konkurrentbeteenden, marknader och egna beslut som framtiden innehåller. I den tidiga planeringslitteraturen sammanfattades denna "mapping"-process under beteckningen Konstruktionen av ett topologiskt träd.

I de oligopolistiska konkurrenssituationerna utvecklas detta snabbt till att bli en ren spelstrategi där förebilder kunde hämtas från rent militära, operationsanalytiska strategier.

Avsikten med en sådan "mapping" av framtiden är att den skall avslöja verksamhetens intertemporala egenskaper, dvs vilka framtida tillstånd hos de externa faktorerna som är särskilt känsliga för de egna resultatsvariablerna och hur olika typer av beslut binder det framtida handlandet och under vilka omständigheter detta kan vara till fördel eller till nackdel för företaget.

För mig är detta själva essensen i en planerings- och prognosverksamhet. Jag tror inte att något företag eller någon nation kan vara den förutan. Men det är så vitt jag förstår inte denna planeringsfunktion som Wallander polemiserat mot utan det är den avart av fix-periodisk budgetering som bara utgår från att den mest sannolika prognossiffran också är det enda framtida tillståndet. Det är viktigt att denna planerings- och prognosstrategi kritiseras.

Men om man tar denna kritik till förevändning (vilket många ansett att Wallander gör) för att kasta ut all planeringsverksamhet inom företaget, då har Wallander gjort hela planeringsverksamheten en stor otjänst.

I det följande avsnittet skall jag något mera beröra hur en planeringsverksamhet skall kunna läggas upp som inkorporerar det som är Wallanders grundläggande utgångspunkt, nämligen att alla framtidsbedömningar är osäkra.

En referensram

När man diskuterar planerings- och prognosproblemen har man enligt min mening nytta av att skilja mellan två olika egenskaper hos denna process. (Brandinger var inne på en enklare version av samma uppdelning i sin artikel.) Den ena egenskapen gäller själva verksamhetens intertemporala egenskaper. Hur snabbt kan man ställa om verksamheten till ändrade förutsättningar? Vilken grad av bindning för kommande perioder föreligger när man väl en gång har tagit ett beslut?

Denna skillnad i anpassningsbarhet finns t ex mellan å ena sidan en enklare handelsrörelse eller ett serviceföretag som i allmänhet inte har längre bindningar än det ineliggande varulagret och den egna lokalen, och å andra sidan en massafabrik eller ett järnverk, där produkten är hårt bunden vid produktionstekniken och där denna teknik i

sin tur har en ofta 20–25-årig livslängd.

I *diagram 2* har jag betecknat denna egenskap hos planeringsprocessen med anpassningstid (t_a).

Den andra egenskapen, som jag i diagrammet kallar förvarningstid (t_f), gäller med vilken grad av förutseende som man kan beskriva den relevanta omgivningens handlande och reaktioner. Börskurser och lagervariationer är exempel på variabler som är svåra att i varje fall på kort sikt göra förutsägelser över. De styrs ofta av irrationella förväntningar eller olika "dis-informationer" om framtiden.

Även politikens beteende och beslut sågs i vissa länder vara svåra att få ett grepp om.

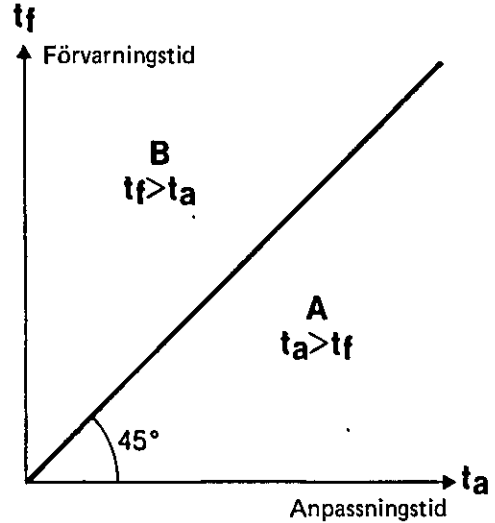
Däremot kan t ex pappersefterfrågan användas som exempel på en variabel som visat sig ha en viss stabilitet och stå i ett enkelt samband med grundläggande ekonomiska fakta. Den oerhörda mångfalden i denna produkts användning kan vara en förklaring till den relativt sett stora stabiliteten i dess efterfrågan.

Om man som i diagrammet sammanställer de båda variablerna i ett gemensamt koordinatsystem kan man urskilja två olika fall, dels en situation då förvarningstiden är kortare än anpassningsperioden (ytan A i diagrammet), dels det fall då förvarningen är längre än själva anpassningsperioden (ytan B i diagrammet).

I det senare fallet har man att göra med en verksamhet där de externa faktorerna — de exogena variablerna — i allmänhet låter sig väl förutses i förhållande till den tid det tar att ställa om verksamheten. I detta fall kommer en rationell planering att ta sig formen av en "ett steg i taget"-strategi där en långsiktig målsättning för verksamheten tas genom en serie kortare steg.

Allt eftersom de yttre förutsättningarna förändras kan man alltid modifie-

Diagram 2. Kombination mellan anpassningsperiod och förvarningstid.



Källa: Det svenska bidraget "Problems of long term range sectoral planning" till ECE; se skriften *Long-term Planning*, United Nations New York 1971.

ra detta i den takt som ny information om de faktiska utfallen blir tillgänglig förutsatt att man inte bundit sitt handlande för längre perioder.

Då är situationen A betydligt svårare att hantera planerings- och prognosmässigt sett. I detta fall är bindningen av verksamheten så långsiktig att man har svårt att förutse den miljö och de marknadssituationer som kommer att vara rådande mot slutet av planperioden.

Den första reaktionen på en situation av detta slag, som ju egentligen är en ojämviktssituation, kan vara att man försöker förändra karaktären på sin verksamhet så att den intertemporala bindningen blir mindre.

Det finns exempel från utbildningsplaneringen på detta. En människas utbildning har i allmänhet en mycket lång varaktighet. En felaktig dimensionering av en mycket specialiserad utbildning kan vara svår att ändra på och kan därför få allvarliga sociala och ekonomiska konsekvenser. Därför har en hel

del av utbildningsplaneringen siktat till att minska specialiseringen och i stället göra utbildningen så "robust" att den skall kunna passa i en rad olika framtider.

En andra utväg, om den första inte skulle gå, är att verkligen försöka ge sig i kast med prognososäkerheten. En del av Wallanders kritik mot nuvarande planeringsmetoder har jag fattat så att han kritiserar de enkla trendmodellerna. Genom att använda "djärvare" modeller som inkorporerar mer av grundläggande ekonomisk teori borde det vara möjligt att bättre fånga de ekonomiska reaktionerna vid de betydligt större kastningar i relativpriser och ekonomisk politik som inträffat under senare år. Det ekonomiska livet är trots allt mycket lagbundet. Politiska händelser, militära konflikter eller år av kraftig missväxt får det ekonomiska systemet att ibland reagera häftigt. Men reaktionerna sker dock i allmänhet inom ramen för ett snävt beteende. Det kan vara svårt att förutsäga när dessa externa händelser inträffar. Men det bör vara möjligt att betydligt bättre än som skett på senare år belysa deras konsekvenser.

Istället för att ta 70-talets prognosmissar till intäkt för mindre prognosarbete drar jag för min del den motsatta slutsatsen — nämligen att det vore väldigt värt att satsa ännu mera på denna verksamhet.

Men det är klart att det finns fält som trots en ekonometriskt intensiv bearbetning ändå framstår som genuint osäkra. Är ett företag verksamt på ett sådant

område blir slutsatsen enkelt den att man måste utarbeta någon form av osäkerhetsstrategi. Det finns en rad sådana i litteraturen — alltifrån maxi-min-strategin till maximering av den *förväntade* avkastningen. Vilken man väljer beror i sista hand på vem man spelar emot och på den egna preferensstrukturens utseende — i vilken utsträckning man är en "risk-averter" eller en "gambler".

Men den viktigaste slutsatsen är ändå att även i detta rena osäkerhetsstrategifall har man ett behov av ett underlag för val av rationellt alternativ. De företag kommer att vinna kampen om framtidens marknader som har det bästa underlaget för sina ställningstaganden. Detta underlag måste man skaffa sig genom mer planerings- och prognosarbete — inte genom att lägga ner dessa verksamheter.

Referenser

- Brandinger, R., [1981], "Vill man vara flexibel måste man planera," *Ekonomen*.
 Economic Commission for Europe, ECE [1971], *Long Term Planning*, New York.
 Luce, R.D. och Raiffa, H., [1957], *Games and Decisions*, New York.
 Theil, H., [1965], *Economic Forecasts and Policy*, Amsterdam (andra uppl.)
 Wallander, J., [1979], "Om prognoser, budgetar och långtidsplaner," *Handelsbankens småskriftserie*, nr 15.
 - [1981], "Om styrning av företag", *Handelsbankens småskriftserie*, nr 19.
 - [1982], "Budgetprofeterna har bevisbördan," *Ekonomen*.
 Åberg, C.J., [1967], "Forecast, Uncertainty and Decision Making," *Swedish Journal of Economics*.