

DIGITALES ARCHIV

ZBW – Leibniz-Informationszentrum Wirtschaft
ZBW – Leibniz Information Centre for Economics

Pistoresi, Barbara; Rinaldi, Alberto; Salsano, Francesco

Book

La spesa pubblica in Italia : una crescita senza limiti?

Provided in Cooperation with:

ZBW OAS

Reference: Pistoresi, Barbara/Rinaldi, Alberto et. al. (2018). La spesa pubblica in Italia : una crescita senza limiti?. Milano, Italy : FrancoAngeli.

This Version is available at:

<http://hdl.handle.net/11159/4534>

Kontakt/Contact

ZBW – Leibniz-Informationszentrum Wirtschaft/Leibniz Information Centre for Economics
Düsternbrooker Weg 120
24105 Kiel (Germany)
E-Mail: [rights\[at\]zbw.eu](mailto:rights[at]zbw.eu)
<https://www.zbw.eu/>

Standard-Nutzungsbedingungen:

Dieses Dokument darf zu eigenen wissenschaftlichen Zwecken und zum Privatgebrauch gespeichert und kopiert werden. Sie dürfen dieses Dokument nicht für öffentliche oder kommerzielle Zwecke vervielfältigen, öffentlich ausstellen, aufführen, vertreiben oder anderweitig nutzen. Sofern für das Dokument eine Open-Content-Lizenz verwendet wurde, so gelten abweichend von diesen Nutzungsbedingungen die in der Lizenz gewährten Nutzungsrechte.



<https://savearchive.zbw.eu/terms-of-use>

Terms of use:

This document may be saved and copied for your personal and scholarly purposes. You are not to copy it for public or commercial purposes, to exhibit the document in public, to perform, distribute or otherwise use the document in public. If the document is made available under a Creative Commons Licence you may exercise further usage rights as specified in the licence.



Leibniz-Informationszentrum Wirtschaft
Leibniz Information Centre for Economics

Mitglied der



**Barbara Pistoiresi
Alberto Rinaldi
Francesco Salsano**

**LA SPESA PUBBLICA
IN ITALIA.
UNA CRESCITA SENZA LIMITI?**

FrancoAngeli

OPEN  ACCESS



Il presente volume è pubblicato in open access, ossia il file dell'intero lavoro è liberamente scaricabile dalla piattaforma **FrancoAngeli Open Access** (<http://bit.ly/francoangeli-oa>).

FrancoAngeli Open Access è la piattaforma per pubblicare articoli e monografie, rispettando gli standard etici e qualitativi e la messa a disposizione dei contenuti ad accesso aperto. Oltre a garantire il deposito nei maggiori archivi e repository internazionali OA, la sua integrazione con tutto il ricco catalogo di riviste e collane FrancoAngeli massimizza la visibilità, favorisce facilità di ricerca per l'utente e possibilità di impatto per l'autore.

Per saperne di più:

http://www.francoangeli.it/come_pubblicare/pubblicare_19.asp

I lettori che desiderano informarsi sui libri e le riviste da noi pubblicati possono consultare il nostro sito Internet: www.francoangeli.it e iscriversi nella home page al servizio "Informatemi" per ricevere via e-mail le segnalazioni delle novità.

**Barbara Pistoresi
Alberto Rinaldi
Francesco Salsano**

**LA SPESA PUBBLICA
IN ITALIA.
UNA CRESCITA SENZA LIMITI?**

FrancoAngeli
OPEN  ACCESS

Copyright © 2018 by FrancoAngeli s.r.l., Milano, Italy.

Pubblicato con licenza *Creative Commons Attribuzione-Non Commerciale-Non opere derivate 3.0 Italia*
(CC-BY-NC-ND 3.0 IT)

L'opera, comprese tutte le sue parti, è tutelata dalla legge sul diritto d'autore. L'Utente nel momento in cui effettua il download dell'opera accetta tutte le condizioni della licenza d'uso dell'opera previste e comunicate sul sito

<http://creativecommons.org/licenses/by-nc-nd/3.0/it/legalcode>

INDICE

Introduzione	pag.	7
1. La legge di Wagner	»	13
1.1. La formulazione originaria	»	13
1.2. Le diverse specificazioni della legge di Wagner	»	14
1.3. Una rassegna della letteratura empirica	»	17
2. La spesa pubblica dall'Unità ai giorni nostri	»	21
2.1. I dati utilizzati	»	21
2.2. Dalla formazione dello Stato unitario alla prima guerra mondiale	»	22
2.3. Gli anni tra le due guerre mondiali	»	25
2.4. La crescita postbellica	»	26
2.5. Il tentativo di risanamento degli anni novanta	»	31
3. Dati, fonti e risultati	»	35
3.1. Dati, fonti e variabili	»	36
3.2. La periodizzazione dell'analisi	»	37
3.3. Comovimento di lungo periodo tra spesa statale e PIL	»	40
3.4. Relazione di lungo periodo tra spesa statale e PIL	»	48
4. La spesa statale in istruzione	»	56
4.1. Il sistema scolastico italiano dall'Unità ai giorni nostri	»	57

4.2. La spesa statale italiana in istruzione: un'analisi di lungo periodo	pag.	61
4.3. Un confronto europeo della spesa pubblica in istruzione	»	64
Conclusioni	»	66
Appendice	»	69
A. Analisi di integrazione: i risultati dell'analisi di stazionarietà delle variabili	»	69
B. Analisi di cointegrazione	»	69
C. Cambiamenti strutturali	»	71
D. Modelli ECM e analisi della causalità di Granger	»	72
E. Stima della relazione di lungo periodo: DOLS	»	73
Bibliografia	»	75

INTRODUZIONE*

Nell'ultimo decennio, nei paesi occidentali la sostenibilità dei debiti sovrani dovuta alla dimensione ed al finanziamento dei disavanzi pubblici ha posto al centro del dibattito politico-economico il livello e la crescita della spesa pubblica. Il caso italiano è emblematico al riguardo: negli ultimi cinque governi si sono alternati 15 fra commissari e consiglieri alla *spending review* (revisione della spesa) che hanno prodotto 33 rapporti, ciononostante nello stesso periodo la spesa pubblica è aumentata di 107 miliardi di euro.

Ancora alla fine del XIX secolo, la spesa pubblica in rapporto al PIL nei paesi occidentali era esigua. Essa consisteva essenzialmente in spesa militare e per l'ordine pubblico. Da allora in poi è cominciata una crescita costante, ma con improvvise accelerazioni in determinati periodi storici. Oggi nell'Europa occidentale il settore pubblico assorbe intorno al cinquanta per cento del prodotto nazionale, negli Stati Uniti intorno al trenta. Questa trasformazione del ruolo dello Stato nelle economie di mercato è uno degli avvenimenti più rilevanti ed affascinanti nella storia economica moderna e per tale motivo è uno degli argomenti più dibattuti tra gli economisti (Atkinson e Stiglitz 1980; Lindert 1994, 1996, 2004a, 2004b; Tanzi e Schuknecht 2007). In effetti, esistono forti contrasti tra chi pensa che essa sia di

* Questa pubblicazione si è avvalsa di un finanziamento del Dipartimento di Economia "Marco Biagi" dell'Università di Modena e Reggio Emilia e del Dipartimento di Scienze Giuridiche "Cesare Beccaria" dell'Università di Milano. Ringraziamo Maria Ambrosanio, Giovanna Messina, Aline Pennisi, Paolo Silvestri ed Erika Uberti per gli utili suggerimenti nell'interpretazione dei dati della Ragioneria Generale dello Stato. Eventuali errori ed omissioni rimangono ovviamente responsabilità degli autori.

ostacolo allo sviluppo, e che debba pertanto essere riportata entro limiti più ristretti, e chi invece ritiene che il modo migliore di ridurne l'incidenza sia far aumentare ancor più rapidamente il PIL, attraverso il rilancio del processo di sviluppo per mezzo di ulteriori aumenti di spesa. Le due posizioni alternative sottintendono due direzioni opposte di causalità: una che va dal reddito alla spesa pubblica, e l'altra dalla spesa pubblica al reddito. Questo ultimo approccio, che è quello keynesiano, vede la spesa pubblica come una variabile comportamentale, dal momento che viene considerata come uno strumento esogeno di *policy* per la gestione della domanda aggregata¹.

Così, a tutt'oggi gli scienziati sociali – economisti, sociologi e storici – indagando sui fattori in grado di esercitare influenze sulla crescita, o sulla diminuzione, della spesa pubblica, per stabilire i collegamenti fra tali fattori e la spesa. In questa ottica è ritornata di attualità la “legge di Wagner”, che prende il nome dallo studioso tedesco Adolf Wagner, il quale, alla fine dell'ottocento, aveva individuato una regolarità empirica, secondo cui, con lo sviluppo economico, aumenta la quota della spesa pubblica sul reddito nazionale. Verificare empiricamente ed approfondire il ruolo dei fattori che possono determinare tale “uniformità empirica” può rappresentare un'ottima strada per comprendere l'evoluzione di lungo periodo della spesa pubblica.

Con riferimento al contesto su esposto, obiettivo di questo volume è analizzare l'evoluzione della spesa pubblica italiana lungo l'intera storia post-unitaria. Al momento dell'Unità nazionale l'Italia era un paese agricolo arretrato. Alla fine del XX secolo era divenuta uno dei paesi più industrializzati del mondo ed era membro del G-7. Si è dibattuto a lungo su quale sia stato il ruolo dello Stato nel rendere possibile questo risultato. Vi è accordo tra gli studiosi che lo Stato italiano è stato tra i più interventisti nel mondo capitalistico, insieme a Francia, Germania e Giappone (Bonelli 1978; Gualerni 1994; Amatori 1997; Zamagni 2012).

Gli interventi dello Stato a sostegno dell'economia hanno assunto nel tempo una vasta gamma di forme. Il primo fu la *legge Casati* di riforma del sistema di istruzione emanata subito dopo l'annessione della Lombardia al Piemonte nel 1859 e in seguito estesa al resto d'Italia. Ad esse si aggiunse-

¹ Negli ultimi anni, un certo numero di studi ha analizzato il rapporto tra spesa pubblica e reddito durante i cicli economici. Alesina e Ardagna (2010) e Alesina, Favero e Giavazzi (2010) sostengono che i tagli alla spesa pubblica, se accompagnati da una diminuzione delle imposte e da riforme del mercato del lavoro e liberalizzazioni del mercato dei beni, risultano essere espansive, piuttosto che recessive, anche nel breve periodo.

ro, nel primo decennio post-unitario, il riordino del sistema della finanza pubblica e quello degli istituti di emissione, con la successiva creazione della Banca d'Italia, nel 1893; la creazione di una rete ferroviaria nazionale tra gli anni sessanta e settanta dell'ottocento; le commesse pubbliche e il protezionismo per il sostegno a complesso militare-industriale, iniziato negli anni settanta dell'ottocento e protrattosi sino al 1940; il salvataggio, in varie fasi, di imprese in difficoltà; la politica per lo sviluppo delle aree depresse, iniziata con la *legge per Napoli* del 1904 e proseguita poi soprattutto con la Cassa per il Mezzogiorno tra il 1950 e i primi anni novanta; la programmazione economica negli anni del centro-sinistra, la nascita di campioni nazionali nei settori considerati strategici per l'economia negli anni ottanta del novecento; la diffusa presenza dell'impresa pubblica a partire dalla creazione dell'IRI negli anni trenta (Giannetti e Vasta 2005; Zamagni 2012).

Si è trattato di interventi assai diversi nel tempo, che hanno conseguito risultati controversi. I più noti economisti italiani, a partire da Vilfredo Pareto e Luigi Einaudi, hanno criticato l'intervento dello Stato nell'economia in quanto fonte di distorsioni e spreco di risorse (Cohen e Federico 2001). Lapidariamente, Giovanni Federico ha definito la politica industriale dell'Italia negli anni della *Golden Age* «harmful or irrelevant» (Federico 1999: 309). A giudizio di questi autori, sarebbe stato preferibile mantenere il *laissez-faire* e lasciare che il mercato stabilisse la natura ed il ritmo dello sviluppo industriale.

Altri studiosi rigettano questa interpretazione e sostengono che l'intervento pubblico sia stato utile, forse necessario, per promuovere lo sviluppo industriale dell'Italia. In particolare, Vera Zamagni ha sottolineato come, in un paese nel quale la grande impresa è scarsamente affermata, solo lo Stato può delineare quei grandi progetti che sono necessari per sostenere la crescita dell'economia e più in generale della società (Zamagni 2012).

Nonostante la rilevanza dell'argomento, esistono ancora pochi lavori² che cercano di studiare le tendenze di lungo periodo della crescita della quota del settore pubblico all'interno dell'economia. Focalizzandosi sul caso italiano, si vuole cercare di spiegare le determinanti che influiscono sulla dinamica della spesa pubblica, utilizzando le “teorie sintetiche societarie”,

² Tra questi va ricordato il recente lavoro di Durevall e Henrekson (2011) per la Svezia ed il Regno Unito.

che associano in maniera deterministica le variazioni della spesa alle trasformazioni della società nel suo complesso³.

Per tale motivo anche nel presente lavoro viene considerato un approccio “alla Wagner”. Le trasformazioni della società che guidano il processo di crescita della spesa pubblica sono avvenute nei paesi occidentali in presenza di sistemi istituzionali diversi⁴, ma secondo l’orientamento interpretativo di Wagner l’evoluzione della spesa prescinde da queste differenze. In questo volume si assume una posizione meno rigida, nel senso che si interpreta la crescita della spesa pubblica anche come domanda di istituzioni. L’evoluzione dei sistemi istituzionali non è casuale. Se la legge di Wagner è verificata empiricamente, essa può rappresentare una prova che esiste una domanda di istituzioni guidata dallo sviluppo economico⁵.

Inoltre l’approccio *demand-oriented* alla spesa pubblica comporta l’esigenza di una maggiore riflessione sui fattori che determinano l’ammontare delle risorse finanziarie a disposizione dell’operatore pubblico. La disponibilità di risorse raccolte attraverso la tassazione e le modalità di raccoglierle assumono un rilievo crescente per la determinazione dell’andamento della spesa pubblica. In questa direzione si muove la teoria della *fiscal capacity* (Besley e Persson 2009, 2013; Besley, Ilzetzki e Persson 2013), che letteralmente si riferisce alla capacità di tassare, ma indirettamente anche a quella di spendere. Alcuni stati si dimostrano incapaci di sviluppare *fiscal capacity*. Le determinanti di tale *capacity* sono legate allo sviluppo economico del paese e quindi questa teoria rappresenta un collegamento verso l’interpretazione dell’evoluzione della spesa pubblica data da Wagner.

Così, il presente lavoro analizza la legge di Wagner per l’Italia dal 1862 al 2009. A tale scopo, fa uso del dataset prodotto dalla Ragioneria Generale dello Stato (RGS) in occasione del centocinquantenario dell’Unità nazionale, che fornisce le serie storiche omogenee della spesa statale italiana sia totale che disaggregata per categorie economiche e fun-

³ Infatti, la crescita della spesa si è verificata nell’ultimo secolo e mezzo, in un periodo in cui le società occidentali attraversavano un cambiamento strutturale mai verificatosi in precedenza: l’industrializzazione, l’urbanizzazione ed i cambiamenti sociali ad essa associati.

⁴ Ad esempio, monarchie costituzionali, dittature, democrazie ristrette o universali.

⁵ In questo senso, il presente lavoro è vicino anche alla letteratura di *political economics* sviluppata da Acemoglu, Johnson e Robinson sulla nascita delle istituzioni e sintetizzata nel volume *Perché le nazioni falliscono* (2013). A seconda dei livelli di sviluppo o di coesione sociale le istituzioni sono endogene o esogene alla crescita economica.

zionali per un periodo di quasi un secolo e mezzo. Questa circostanza consente di analizzare l'evoluzione della composizione della spesa in risposta al mutare delle domande e dei bisogni della società nel lungo periodo⁶.

Il presente lavoro è strutturato come segue. Il Capitolo 1 presenta la legge di Wagner a livello teorico, illustra le diverse specificazioni econometriche che sono state utilizzate in letteratura per verificarne la validità empirica e propone una rassegna della letteratura empirica sull'argomento. Il Capitolo 2 presenta un profilo storico della spesa pubblica in Italia dall'Unità nazionale ai giorni nostri. Il Capitolo 3 illustra i dati, le fonti, le variabili utilizzate e la strategia econometrica impiegata per sottoporre a verifica la legge di Wagner in Italia nell'arco temporale dal 1862 al 2009. Il Capitolo 4 sviluppa un approfondimento sulla spesa pubblica per l'istruzione e l'investimento in capitale umano dello Stato italiano. Infine, il Capitolo 5 conclude.

⁶ Kolluri, Panik e Wahab (2000) hanno studiato la relazione tra il reddito nazionale e tre diverse categorie di spesa per l'Italia con riferimento al più corto sottoperiodo 1960-93.

1. LA LEGGE DI WAGNER

1.1. La formulazione originaria

Come si è anticipato nell'Introduzione, negli anni recenti è ritornato di attualità il quesito, che gli scienziati sociali si erano già posti alla fine dell'ottocento, sull'esistenza di un limite desiderabile alle dimensioni relative del settore pubblico. La risposta che ne diede l'economista tedesco, di orientamento socialista, Adolf Wagner è negativa. Egli, infatti, sostenne che esiste una relazione tra l'aumento della spesa pubblica e lo sviluppo economico – che definì, enfaticamente, “legge della crescente espansione del settore pubblico” – per cui, col passare del tempo, la spesa è destinata a crescere ad un tasso maggiore del tasso di crescita del reddito nazionale pro capite (Wagner 1883, 1911). Wagner individuò tre determinanti della crescita di lungo periodo della spesa pubblica:

1. La sostituzione di attività private, derivante dall'industrializzazione, dall'urbanizzazione e dalla connessa crescente complessità della vita e dal moltiplicarsi dei rapporti giuridici, con aumento degli attriti sociali.

2. L'esistenza, tra i beni pubblici, di beni “superiori”, ossia ad elasticità di reddito elevata (istruzione, cultura, welfare), la cui domanda aumenta in misura più che proporzionale rispetto al reddito.

3. L'orizzonte temporale molto lungo con cui si misura la convenienza di alcuni investimenti (ad esempio, le ferrovie) richiede un intervento pubblico crescente, così come l'esistenza di monopoli naturali.

La legge di Wagner si presenta come una spiegazione orientata prevalentemente dal lato della domanda. La crescita della spesa pubblica, quindi, è giudicata una conseguenza inevitabile della espansione dell'attività dello Stato prodotta dal progresso sociale ed economico di un paese (Mastromatteo 1986; Durevall e Henrekson 2011)¹.

¹ I più importanti approcci alternativi sono il *displacement effect* (Peacock e Wisemann 1961) e il *ratchet effect* (Bird 1970) che asseriscono che durante una recessione la spesa

Wagner fu il primo a tentare una verifica empirica della sua legge, per alcuni paesi europei², che vivevano il periodo della prima industrializzazione, alla fine del XIX secolo.

Un primo punto da considerare è verificare se questa “uniformità empirica” esiste anche in periodi successivi e si è mantenuta anche in contesti differenti, come ad esempio i paesi in via di sviluppo del XX secolo. È chiaro che i mutamenti intervenuti nel corso del tempo pongono il problema della permanenza di tale regolarità.

Inoltre, nell’analisi di Wagner manca un esplicito riferimento ai meccanismi politici di decisione, non si dà sufficiente importanza ai fenomeni di crescita e composizione demografica, ai fattori culturali, ed ai conflitti sociali (Mastromatteo 1986).

1.2. Le diverse specificazioni della legge Wagner

Wagner non specificò mai una forma funzionale volta alla verifica della sua ipotesi; una corretta specificazione dunque è stato il primo problema da risolvere al fine di procedere ad una corretta analisi empirica della legge. A questo scopo sono state formulate diverse forme funzionali. I diversi approcci possono essere classificati sulla base della specificazione in termini di livelli della spesa pubblica o di quote della spesa sul reddito o prodotto nazionale, della variabile dipendente.

Le più importanti forme funzionali sono qui di seguito sintetizzate:

1. Peacock e Wiseman (1961):

$$G = f(PIL)$$

dove G, la spesa pubblica è funzione del prodotto interno lordo (PIL).

2. Gupta (1967):

$$\frac{G}{POP} = f\left(\frac{PIL}{POP}\right)$$

dove la spesa pubblica pro capite è funzione del reddito pro capite.

3. Goffman (1968):

$$G = f\left(\frac{PIL}{POP}\right)$$

pubblica declina meno che proporzionalmente rispetto al reddito pro capite così che la spesa pubblica aumenta in rapporto al reddito nazionale, mentre la situazione opposta si verifica durante le fasi di espansione economica.

² Prussia, Baviera, Inghilterra e Svizzera.

dove la spesa pubblica è funzione del reddito pro capite.

4. Pryor (1969):

$$C = f(PIL)$$

dove i consumi pubblici sono funzione del PIL.

5. Musgrave (1969):

$$\frac{G}{PIL} = f\left(\frac{PIL}{POP}\right)$$

dove la spesa pubblica rispetto al PIL è funzione del PIL pro capite.

6. Mann (1980):

$$\frac{G}{PIL} = f(PIL)$$

dove la spesa pubblica rispetto al PIL è funzione del PIL.

Dal punto di vista del modello utile alla stima, la letteratura propone specificazioni log-log delle relazioni 1-6 sopra riportate. Le specificazioni possono quindi essere riscritte come segue, dove il pedice t indica il tempo t e u_t indica l'errore.

Autore	Specificazioni log-log
Peacock e Wiseman (1961)	$\ln G_t = \alpha + \varepsilon \ln PIL_t + u_t$
Gupta (1967)	$\ln\left(\frac{G}{POP}\right)_t = \alpha + \varepsilon \ln\left(\frac{PIL}{POP}\right)_t + u_t$
Goffman (1968)	$\ln G_t = \alpha + \varepsilon \ln\left(\frac{PIL}{POP}\right)_t + u_t$
Pryor (1969)	$\ln C_t = \alpha + \varepsilon \ln PIL_t + u_t$
Musgrave (1969)	$\ln\left(\frac{G}{PIL}\right)_t = \alpha + \beta \ln\left(\frac{PIL}{POP}\right)_t + u_t$
Mann (1980)	$\ln\left(\frac{G}{PIL}\right)_t = \alpha + \beta \ln PIL_t + u_t$

Nelle prime quattro specificazioni, affinché la legge di Wagner risulti verificata occorre che l'elasticità della spesa pubblica rispetto al PIL sia $\varepsilon > 1$, mentre per le ultime due specificazioni – Musgrave (1969) e Mann (1980) – la condizione per cui l'elasticità sia maggiore di uno è garantita da $\beta > 0$. Infatti, la relazione tra il parametro ε e il parametro β nelle varie specificazioni è: $\varepsilon = (1 + \beta)^3$.

In letteratura vengono utilizzate queste specificazioni, spesso considerando le variabili in termini reali. Seguendo Shelton (2007) e Durevall e Henrekson (2011), la specificazione utilizzata nell'analisi empirica nel presente lavoro è la seguente:

$$\ln\left(\frac{G}{PIL}\right)_t = \alpha + \beta \ln\left(\frac{PIL_{reale}}{POP}\right)_t + u_t$$

dove $\ln\left(\frac{G}{PIL}\right)_t$ è il logaritmo della quota di spesa pubblica nominale ri-

spetto al PIL nominale mentre $\ln\left(\frac{PIL_{reale}}{POP}\right)_t$ è il logaritmo del reddito

reale pro capite, il pedice t indica il tempo t e u_t è il termine di errore. In questo caso la validità della legge di Wagner viene verificata quando $\beta > 0$; questa è la formulazione più comune e probabilmente la più corretta per la verifica della legge⁴. Alternativamente, si sarebbe potuto conside-

³ Si consideri la relazione tra β ed ε nelle varie specificazioni riscrivendo la specificazione di Musgrave (1969) nel modo seguente: $\ln G = \alpha + (1 + \beta)\ln PIL - \beta \ln POP + u_t$. Si considerino ora le variazioni delle variabili ottenendo:

$$\ln(G + \Delta G) = \alpha + (1 + \beta)\ln(PIL + \Delta PIL) - \beta \ln(POP + \Delta POP) + u_t.$$

Sottraendo le due relazioni si ottiene la seguente specificazione:

$$\ln(G + \Delta G) - \ln G = (1 + \beta)[\ln(PIL + \Delta PIL) - \ln(PIL)] - \beta[\ln(POP + \Delta POP) - \ln(POP)].$$

Dunque $\frac{\Delta G}{G} \cong (1 + \beta) \frac{\Delta PIL}{PIL}$ da cui: $\varepsilon = (1 + \beta) = \frac{\Delta G / G}{\Delta PIL / PIL}$ per piccoli ΔPIL . Nella spe-

cificazione log-log quindi $(1 + \beta) = \varepsilon$ rappresenta l'elasticità della spesa G rispetto al PIL.

⁴ L'uso della spesa pubblica in termini reali presenta inconvenienti come sottolineato da Durevall e Henrekson (2011: 710): «l'uso della spesa pubblica in termini reali è opinabile; la legge di Wagner descrive infatti l'evoluzione della spesa pubblica rapportata al PIL, la quale non è pienamente catturabile quando questa viene espressa in termini reali e non vengono neanche catturate le variazioni dei redditi del settore pubblico fintanto che non vengono analizzati a valori correnti».

rare la quota della spesa pubblica rispetto al reddito reale, ma l'esclusione della popolazione dal reddito reale, come evidenziato da Durevall e Henrekson (2011), in caso di aumento del reddito potrebbe generare un aumento più che proporzionale nella domanda dei servizi pubblici.

Inoltre mantenendo il reddito pro capite come indicatore principale di sviluppo economico, è possibile ed opportuno integrare la spiegazione della domanda di spese pubbliche con variabili che esprimono gli aspetti socio-demografici⁵.

1.3. Una rassegna della letteratura empirica

Nel corso degli ultimi cinquanta anni molti autori si sono cimentati a sottoporre a verifica empirica varie specificazioni della legge di Wagner. Questi studi utilizzano sia serie storiche, sia dati cross-sezionali e considerano sia paesi sviluppati, che paesi in via di sviluppo⁶.

Gli studi che utilizzano serie storiche esaminano l'effetto della crescita del reddito nazionale sull'espansione della spesa pubblica nel corso del tempo, per un determinato paese o gruppo di paesi⁷. Le analisi cross-sezionali indagano la relazione tra reddito e spesa dei governi nazionali tra diversi paesi nello stesso istante temporale o su una media di periodo.

Come suggerito da Mastromatteo (1986), essendo la legge di Wagner riferita non tanto al breve periodo quanto piuttosto come una legge di sviluppo storico, l'analisi più appropriata dovrebbe basarsi su serie storiche. Afxentiou (1980), per esempio, sostiene che solo tale approccio riflette

⁵ Si veda Shelton (2007), il cui modello spiega l'andamento della spesa pubblica per un panel di dati, che comprende circa cento paesi nel periodo 1970-2000, considerando oltre alle tradizionali variabili economiche anche il ruolo dei fattori demografici e sociali. Shelton conclude che la legge di Wagner è guidata dalla demografia, particolarmente dalla quota della popolazione con più di 65 anni d'età. Insomma, sarebbero le spese sociali e sanitarie a "guidare" la relazione tra spesa pubblica totale e reddito pro capite, che altrimenti non crescerebbero congiuntamente.

⁶ Diversi autori (Papas e Richter 2013; Kuckuck 2014) sostengono che l'evidenza empirica a favore della legge di Wagner sia più forte quando si analizzano le prime fasi di sviluppo di un paese. Infatti, una delle assunzioni più importanti della ipotesi iniziale di Wagner (1883) è che il paese deve essere considerato nella sua fase iniziale di sviluppo, urbanizzazione e modernizzazione. Per tale ragione i summenzionati autori ritengono che la verifica empirica debba essere condotta sui paesi in via di sviluppo o, in alternativa, sui paesi sviluppati, riferendosi però al periodo precedente la seconda guerra mondiale, quando essi trasformarono le loro economie da agricole ad urbano-industriali con un forte aumento della domanda di servizi pubblici ed infrastrutture.

⁷ In quest'ultimo caso si tratta di dati panel.

realmente lo spirito di Wagner di una evoluzione continua della spesa pubblica durante il processo di crescita.

Anche Bird (1970) afferma che i risultati delle analisi cross-sezionali sono spesso fuorvianti, poiché non tengono in considerazione i cambiamenti che nel settore pubblico avvengono nel corso del tempo. Infatti, secondo questo autore la legge di Wagner esprime la relazione tra aumento del reddito e crescita della spesa pubblica, ma non giunge a postulare che in alcuni paesi l'aumento di quest'ultima debba essere maggiore solo perché esiste un più elevato livello di reddito.

D'altra parte Michas (1975) sostiene che l'analisi cross-sezionale sia anch'essa rilevante perché c'è un controllo per un determinato numero di paesi, che poi può essere generalizzato.

Per questo motivo alcuni studi recenti considerano congiuntamente le serie temporali con la dimensione cross-sezionale (Shelton 2007; La Martina e Zaghini 2011).

Spesso la scelta di analisi di tipo cross-sezionale è obbligata in quanto, come suggerito da Ram (1987), la maggior parte degli autori che esaminano i paesi in via di sviluppo hanno a disposizione dati con una dimensione temporale poco rilevante che li rendono non idonei per l'utilizzo di tecniche di analisi proprie delle serie temporali.

Oltre alla tipologia dei dati che condiziona il tipo di analisi empirica effettuabile, altrettanto rilevante risulta lo sviluppo delle tecniche econometriche che si è avuto nel corso degli ultimi due decenni. Infatti, la letteratura empirica prima degli anni novanta usava semplici regressioni OLS per sottoporre a verifica la legge di Wagner. In questo contesto, il nesso di causalità viene semplicemente assunto: è la crescita del reddito pro capite a determinare la dinamica della quota della spesa pubblica. Vengono quindi trascurati i problemi di simultaneità e di direzione del nesso di causalità tra le variabili.

Gli studi successivi agli anni novanta, che utilizzano prevalentemente serie storiche con una evoluzione temporale rilevante (talvolta dati panel), propongono strumenti quantitativi che consentono di analizzare l'esistenza di una relazione tra spesa e reddito fornendo una indicazione sul nesso di causalità distinguendo tra relazione causale di breve o lungo periodo. In questo lavoro si farà riferimento solamente agli studi più recenti che tra le tecniche econometriche di analisi delle serie temporali usano l'analisi di cointegrazione e della causalità di Granger.

La maggior parte di questi studi sottopone a verifica la legge di Wagner con riferimento al periodo più recente di industrializzazione di un paese. In genere l'orizzonte temporale esaminato è quello successivo alla seconda

guerra mondiale che conduce il più delle volte a risultati meno favorevoli alla legge, per i motivi indicati in precedenza⁸.

Inoltre, in questi studi non vengono quasi mai considerate disaggregazioni della spesa per categorie economiche o funzionali⁹ anche se l'uso di queste disaggregazioni offrirebbe una migliore spiegazione del ruolo giocato da ogni singola componente della spesa pubblica nel processo economico qualificando con più attenzione i risultati (Chletsos e Kollias 1997). Infatti, come sottolineato da Magazzino (2012a, 2012b), è possibile che l'aggregazione della spesa pubblica, mediante i singoli capitoli di spesa, influenzi anche i risultati empirici. Dopo tutto, non tutte le voci di spesa sono necessariamente funzione del reddito nazionale, dal momento che alcune di esse potrebbero influenzare positivamente il reddito nazionale in futuro.

Solo pochi studi sottopongono a verifica la legge di Wagner su periodi di tempo molto lunghi – superiori a settant'anni – e nessuno di essi la conferma. È questo il caso di Henrekson (1993) per la Svezia dal 1861 al 1990, di Bohl (1996) per il Regno Unito dal 1870 al 1995, e di Ghate e Zak (2002) per gli Stati Uniti dal 1929 al 2000. Durevall e Henrekson (2011) non trovano conferma per la legge di Wagner nel Regno Unito e in Svezia nel lungo periodo (1830-2006 per il Regno Unito e 1800-2006 per la Svezia); tuttavia, in base ai loro risultati la legge di Wagner risulta verificata per alcuni sotto-periodi più brevi: approssimativamente negli anni 1860-1913 e 1920-1975 in entrambi i paesi. Kuckuck (2014) rigetta la legge di Wagner per cinque paesi europei nel lungo periodo 1850-2010; nondimeno, anche questo autore trova una evidenza a favore della legge di Wagner durante le fasi iniziali dell'industrializzazione dei paesi considerati, che poi scompare quando si passa a stadi di sviluppo più avanzati.

Alcune ipotesi sono state fornite in letteratura per spiegare la più forte evidenza a favore della legge di Wagner negli stadi iniziali di sviluppo, soprattutto nei 40-50 anni precedenti la prima guerra mondiale. La crescita economica nella seconda metà dell'ottocento rese possibile introdurre in molti paesi dei sistemi di riscossione delle imposte più efficienti di quelli sino allora vigenti che erano basati sulle accise e sui diritti doganali, senza prevedere una tassazione sul reddito. In tal modo fu notevolmente accresciuta la capacità fiscale degli stati (Levi 1988). Inoltre, Meltzer e Richard

⁸ Per un elenco dettagliato di questi studi e dei risultati ottenuti, si rimanda a Pistoresi, Rinaldi e Salsano (2015: Appendice A).

⁹ Le disaggregazioni più comuni sono spesa corrente, in conto capitale, spesa per istruzione, spesa per sanità.

(1983) e Lindert (1994, 2004a) sostengono che la spesa pubblica aumentò in conseguenza dell'estensione del diritto di voto a fasce sempre più ampie della popolazione, di modo che si accrebbe la proporzione degli elettori che percepivano un reddito inferiore a quello mediano. La conseguenza fu una spinta sempre più forte da parte dell'elettorato all'utilizzo della spesa pubblica quale strumento per il perseguimento di politiche redistributive.

Alcune ipotesi sono state fornite anche per spiegare il venir meno della legge di Wagner negli anni più recenti, soprattutto dalla metà degli anni settanta del XX secolo. Si è sottolineato che una serie di innovazioni tecnologiche e di cambiamenti istituzionali hanno ampliato lo spazio per la produzione dei servizi sociali direttamente sul mercato. Ad esempio, è oggi disponibile tutta una serie di prodotti assicurativi e finanziari che consente ai cittadini di redistribuire nella maniera desiderata il proprio reddito e le proprie spese individuali durante il proprio ciclo di vita (Durevall e Henrekson 2011). Questo cambiamento è stato stimolato dal ritorno dell'economia neoclassica quale paradigma economico dominante, che ha spinto i governi a perseguire politiche di taglio della spesa pubblica e massicci programmi di privatizzazione delle imprese di proprietà statale. Inoltre, l'avvento della globalizzazione a partire dagli anni novanta ha accresciuto la competizione tra i governi per ridurre l'imposizione sulle imprese al fine di attirare investimenti esteri, riducendo in tal modo la capacità fiscale degli stati e, di conseguenza, la loro capacità di finanziare la spesa pubblica (Sinn 1998; Bergh e Karlsson 2010).

2. LA SPESA PUBBLICA DALL'UNITÀ AI NOSTRI GIORNI

2.1. I dati utilizzati

Questo capitolo analizza l'evoluzione della spesa del bilancio dello Stato dal 1862 al 2009. Si considerano sia la spesa totale che la sua disaggregazione relativa alle principali categorie economiche e funzionali, che sono state definite aggregando le voci tipicamente adottate nei documenti di bilancio dello Stato. I dati sono tratti da RGS (2011). Per spesa si intendono i pagamenti totali espressi in valori monetari correnti e migliaia di euro¹.

Le categorie economiche prese in considerazione sono le seguenti:

- spesa corrente = spesa corrente direttamente legata alla produzione di servizi + trasferimenti correnti ad altre amministrazioni pubbliche, imprese e famiglie;
- spesa in conto capitale = spesa in conto capitale direttamente legata alla produzione di servizi + trasferimenti in conto capitale ad altre amministrazioni pubbliche, imprese e famiglie;
- spesa totale = spesa corrente direttamente legata alla produzione di servizi + spesa in conto capitale direttamente legata alla produzione di servizi + trasferimenti correnti ad altre amministrazioni pubbliche, imprese e famiglie + trasferimenti in conto capitale ad altre amministrazioni pubbliche, imprese e famiglie + interessi + altre uscite.

¹ I dati di spesa del bilancio dello Stato fanno riferimento ai pagamenti totali erogati nell'anno solare e sono desunti dal bilancio consuntivo. Poiché dal 1884 al 1965 l'esercizio finanziario si svolgeva da luglio a giugno dell'anno successivo, i dati sono stati ricondotti all'anno solare sulla base di una stima ottenuta sommando la metà delle spese sostenute nei due esercizi successivi, adottando l'ipotesi di equidistribuzione della spesa nel corso dell'esercizio.

Le categorie funzionali, invece, sono:

- difesa nazionale;
- giustizia e sicurezza pubblica;
- azioni ed interventi nel campo sociale;
- azioni ed interventi nel campo economico;
- istruzione e cultura.

In linea teorica, la legge di Wagner andrebbe studiata ponendo in relazione la spesa pubblica al PIL. Per spesa pubblica si intende il totale delle uscite delle amministrazioni pubbliche per svolgere la loro attività di fornitura di servizi pubblici e trasferimenti. Queste sono costituite dall'Amministrazione Centrale dello Stato e dalle amministrazioni decentrate, come gli enti locali, gli enti previdenziali e di sicurezza sociale. Dati affidabili e comparabili sulla spesa totale delle amministrazioni pubbliche sono però disponibili solo dal 1980 (RGS 2011). Pertanto, si è deciso di limitare l'analisi «al solo bilancio statale, di per sé non priva di interesse e sempre suscettibile di costituire la base indispensabile per uno studio più completo» (RGS 1969: 14). D'altra parte, l'assenza di serie storiche affidabili sulla spesa totale delle amministrazioni pubbliche, oltre a rendere obbligata la scelta dei dati da utilizzare, è comune con la maggior parte della letteratura internazionale sulla legge di Wagner, il cui oggetto dell'indagine è la *central government expenditure*, ossia proprio la spesa del bilancio dello Stato (Durevall e Henrekson 2011; Diza Fuentes 2011; Kuckuck 2014). Va, inoltre, considerato che il bilancio dello Stato è la voce decisamente preponderante della spesa totale delle amministrazioni pubbliche, sulla quale nell'Italia post-unitaria incide in una misura compresa tra il 60 e l'80% (Brosio e Marchese 1986).

2.2. Dalla formazione dello Stato unitario alla prima guerra mondiale

La costituzione dello Stato unitario nel 1861 pose il problema di integrare in un'unica entità, con un'amministrazione unitaria, lo stesso insieme di leggi e una moneta unica Stati sino a quel momento indipendenti. Era anche necessario migliorare il capitale sociale complessivo del paese, inadeguato e distribuito in maniera non uniforme. In Italia vi erano solo 2.404 chilometri di ferrovie, corrispondenti a 0,096 chilometri per abitante, rispetto ai 0,251 della Francia, 0,295 della Germania e 0,734 del Regno Unito (Schram 1997). Circa il 40% della rete ferroviaria si trovava in Piemonte, mentre l'intero Mezzogiorno ne aveva meno del 10%. Il patrimonio di stra-

de, porti e altre infrastrutture pubbliche era parimenti scarso e distribuito in modo difforme a livello regionale (Cohen e Federico 2001).

Lo sforzo del nuovo Stato per potenziare le infrastrutture fisiche fu notevole, date le risorse. Si ampliarono i porti, si estese il sistema viario, si creò un servizio telegrafico nazionale. Ma, soprattutto, si sviluppò la rete ferroviaria. Le linee ferroviarie a lunga percorrenza furono costruite negli anni sessanta e settanta, con l'aggiunta di 6.500 chilometri di rotaie, mentre le reti locali seguirono nell'ultimo ventennio del secolo (Schram 1997).

Nel primo cinquantennio post-unitario la spesa statale in termini reali aumentò lentamente. Mediamente, la crescita della spesa totale non superò quella del reddito. Tuttavia, come si evince dalla Figura 2.1, vi furono forti oscillazioni da un anno all'altro, con picchi intorno alla metà degli anni sessanta e nella seconda metà degli anni ottanta. La Figura 2.2 mostra come tra il 1862 e la metà degli anni novanta la quota della spesa statale totale rispetto al PIL e la crescita del PIL reale pro capite evidenzino un andamento molto simile. Successivamente, nell'età giolittiana le due serie divergono profondamente: il PIL pro capite prende a crescere a tassi più rapidi rispetto a prima, mentre la spesa totale rispetto al PIL cala costantemente sino allo scoppio della prima guerra mondiale. Se per i governi precedenti l'unico limite all'espansione della spesa era stato costituito dalle difficoltà di finanziamento (*fiscal capacity*), per Giolitti la limitazione dell'intervento pubblico si configurò come una scelta consapevole di politica economica finalizzata alla valorizzazione del ruolo del mercato e al risanamento del bilancio pubblico. È stato osservato come questa politica, dando luogo ad un'attenuazione del peso della finanza pubblica nel momento in cui la spesa privata per investimenti era particolarmente vivace, sia stata funzionale allo sviluppo dell'economia. In particolare, il mantenimento in pareggio del bilancio statale dalla fine del XIX secolo al 1909, e la regressività dell'imposizione, avrebbero offerto condizioni favorevoli alla formazione del risparmio e al suo afflusso all'investimento industriale (Castronovo 1995).

In media, tra il 1862 ed il 1913 la spesa statale fu pari a circa il 10% del PIL. Si trattò di uno sforzo considerevole, in considerazione della situazione esistente nel paese, con una finanza pubblica arretrata, un sistema tributario sperequato, a riscossione inefficiente e ad aliquote basse. La spesa fu destinata per la maggior parte alla difesa e al pagamento degli interessi sul debito pubblico. Infatti, a causa della sua impegnativa posizione geopolitica, il neo-costituito Stato italiano si pose sin dall'inizio obiettivi di grande potenza. La mobilitazione militare necessaria per combattere la guerriglia anti-unitaria nel primo decennio di vita del nuovo Stato richiese uno sforzo di uomini e di mezzi che solo una grande potenza poteva permettersi. Ad

essa si aggiunse l'imponente mobilitazione necessaria per spostare i confini del 1861 verso le Alpi, combattendo, insieme alla Prussia, una costosa guerra contro l'Austria. Obiettivo del nuovo Stato era di raggiungere nel minor tempo possibile quello che la dottrina militare del tempo riteneva un assetto geo-strategico equilibrato per la penisola e per il resto d'Europa: il confine delle Alpi orientali. Non essendo riuscita con la terza guerra d'indipendenza ad ottenere la parte estrema del nuovo territorio, l'Italia prese ad avanzare una rivendicazione territoriale che solo la prima guerra mondiale avrebbe soddisfatto. E, perdurando lo squilibrio del confine orientale, ne derivò una necessità pluridecennale di preparazione militare in attesa della occasione propizia per conseguire lo scopo (De Cecco 2003).

Nei primi anni del Regno d'Italia (1861-66) le spese per la difesa assorbirono la parte prevalente del bilancio dello Stato. La loro incidenza, che superò il 40% della spesa totale nel 1866, scese al 18% tra il 1868 e il 1877, per crescere gradualmente a circa il 25% negli anni successivi, anche per effetto delle guerre coloniali. Con lo scoppio della prima guerra mondiale, esse assorbirono di nuovo quasi il 50% delle risorse, che salirono ad oltre il 75% negli anni centrali del conflitto (RGS 2011). Una dinamica analoga è evidenziata dal rapporto delle spese per la difesa rispetto al PIL (Fig. 2.3).

A motivo dell'elevato debito pubblico, la spesa per interessi rimase a lungo assai elevata, assorbendo ogni anno circa un terzo della spesa complessiva. Essa diminuì sensibilmente con la conversione della rendita del 1907, che ne abbassò il tasso dal 5 al 3,5%. Alla vigilia della prima guerra mondiale gli interessi sui titoli del debito pubblico erano scesi al 10,6% della spesa complessiva (RGS 2011).

I servizi generali (mantenimento dei ministeri, giustizia, istruzione secondaria²) assorbono tra il 20 e il 30% della spesa statale complessiva. La quota delle opere pubbliche (che nella classificazione per categorie economiche rientrano tra le spese in conto capitale e in quella funzionale tra le azioni ed interventi in campo economico) fu pari, nel primo decennio post-unitario, a circa il 10%, e salì al 20% dopo il 1870, mantenendosi su quei livelli fino al 1904, quando riprese a salire superando il 30% nel 1909, per poi diminuire leggermente nei cinque anni successivi.

Come si è visto, la parte prevalente della spesa per opere pubbliche (circa i tre quarti) fu destinata alle ferrovie la cui costruzione, realizzata prevalentemente dallo Stato, assorbì tra il 1861 e il 1913 circa 10 miliardi di lire,

² Il costo dell'istruzione elementare, ed in particolare gli stipendi dei maestri, gravò sui comuni sino al 1911. Fino al 1914 il contributo degli Enti Locali alla spesa per istruzione fu superiore al 50% (Brosio e Marchese 1986).

portando la dotazione nazionale a 16.210 km rispetto ai 1.829 km in funzione negli Stati pre-unitari, inclusa la costruzione delle tre grandi gallerie alpine. Anche la rete stradale fu aumentata, nei primi vent'anni del Regno, di circa 13.000 km ed analogo sviluppo ebbero la rete telegrafica e la diffusione degli uffici postali (Brosio e Marchese 1986).

Nel complesso, la spesa in conto capitale mostra un andamento irregolare, che partendo dal 5% della spesa statale totale negli anni immediatamente successivi all'Unità nazionale, ha visto periodi con punte superiori al 10% tra il 1882 e il 1890 e nel 1905 (RGS 2011). Un andamento analogo mostra il suo rapporto rispetto al PIL (Fig. 2.4).

Invece, le spese per l'istruzione e la cultura aumentarono costantemente dall'unificazione alla prima guerra mondiale sia come percentuale della spesa statale totale (dall'1,6 al 5%) sia come percentuale del PIL (Fig. 2.3).

2.3. Gli anni tra le due guerre mondiali

La partecipazione alla prima guerra mondiale comportò un sensibile aumento della spesa statale da poco più del 10 ad oltre il 35% del PIL (Fig. 2.1). Essa ridiscese poi negli anni successivi al conflitto, per attestarsi nel 1926, rispetto al PIL, sui valori antebellici.

La drastica riduzione della spesa e il raggiungimento del pareggio del bilancio statale ebbero luogo in un contesto di rapida espansione del PIL (Fig. 2.2) e sono difficilmente spiegabili senza far riferimento alle difficoltà della classe politica prefascista ad interpretare e accogliere le domande sociali del dopoguerra, e all'indirizzo liberista di "finanza conforme" e di repressione sociale dei primi anni del fascismo. La composizione della spesa riacquistò la struttura dell'anteguerra: diminuì l'incidenza delle spese per la difesa, mentre ripresero gli investimenti in opere pubbliche ed altri interventi economici. Gli investimenti furono particolarmente rilevanti nelle ferrovie, con la costruzione delle direttissime e l'elettrificazione delle linee principali, e le prime autostrade a pedaggio (costruite dai privati con contributi statali) (Felice 2015).

Dopo aver raggiunto nel 1926 il livello minimo del periodo in termini reali, la spesa statale ricominciò a crescere in relazione con una svolta nella politica economica del regime fascista che ne accentuò il carattere interventista e, dopo il 1929, con i provvedimenti volti a fronteggiare gli effetti della crisi economica internazionale (Castronovo 1995). La crescita divenne particolarmente intensa nella seconda metà degli anni trenta in seguito alla guerra di Abissinia, alla partecipazione alla guerra civile spa-

gnola a fianco dei nazionalisti e dell'avvio della preparazione alla seconda guerra mondiale³.

Per quanto riguarda la composizione della spesa per funzioni, dal 1919 al 1926 la compressione della spesa fu ottenuta riducendo drasticamente la componente militare. Una contrazione relativa della spesa civile si manifestò invece a partire dalla seconda metà degli anni venti. Le opere pubbliche continuarono ad assorbire quote elevate della spesa civile (attorno al 12% nella media del periodo) con un massimo nei primi anni trenta, senza tuttavia raggiungere l'incidenza toccata nel 1885-90. Al crescere della spesa pubblica complessiva le opere pubbliche incrementarono la loro quota sul PIL, avvicinandosi al 4% nel 1932.

Si ebbe anche una crescita della spesa sociale. L'assicurazione pensionistica, istituita su base volontaria in età giolittiana, fu resa obbligatoria nel 1919 con la costituzione della Cassa nazionale per le assicurazioni sociali. Nel 1933 l'ente fu riorganizzato con la creazione dell'Istituto nazionale della previdenza sociale (INPS), al quale fu affidata anche la gestione della Cassa nazionale di maternità, istituita nel 1927. Così rifondato, l'INPS divenne il principale strumento per contrastare gli effetti della recessione (Felice 2015). A queste misure si aggiunsero gli assegni familiari, istituiti nel 1934 sul modello di precedenti esperienze belghe e francesi. Si trattava di un'integrazione salariale per i lavoratori con a carico moglie e figli, dapprima riconosciuta ai soli operai dell'industria e poi anche agli impiegati e ai dipendenti del settore agricolo (Zamagni 1990).

La spesa per l'istruzione è tra le componenti meno dinamiche del periodo. Il suo andamento diverge da quello delle altre categorie di spesa precedentemente considerate, poiché si ebbe un incremento relativamente rapido nel primo decennio del dopoguerra, e poi una crescita limitata (inferiore a quella della spesa complessiva) a decorrere dal 1926.

2.4. La crescita postbellica

La seconda guerra mondiale ebbe costi enormi in termini di risorse impegnate (42% della spesa statale media annua), per la drastica caduta del

³ Le spese militari negli anni 1930-34 furono mediamente pari al 28% della spesa statale e salirono al 36% nel quinquennio 1935-39. Le spese per le colonie – che comprendevano anche voci legate alla “difesa nazionale” – furono pari a pochi punti percentuali della spesa statale fino al 1935, ma nel 1936-39 balzarono a poco meno di un terzo del totale (Ciocca 2007).

PIL (ridotto a metà di quello prebellico), per i danni subiti dallo stock di capitale pubblico (strade, ponti, ferrovie e porti inutilizzabili, reti elettriche ed idriche inservibili) e dall'agricoltura. Meno gravi erano le condizioni dell'industria: la capacità produttiva globale e il valore degli impianti si erano ridotti del 10% rispetto all'anteguerra, con punte però del 90% nel settore siderurgico e armatoriale, del 45% nella meccanica e del 40% nell'industria elettrica (Amatori e Colli 1999).

Alla fine della guerra la spesa pubblica complessiva raggiungeva il 35% appena di un PIL ridotto alla metà di quello anteguerra: in termini reali essa era scesa al livello del 1922 ed era effettuata in disavanzo per circa i quattro quinti (Francese e Pace 2008).

Dal 1950 al 1963 la spesa statale crebbe notevolmente in termini reali. Nondimeno, essa rimase ampiamente al di sotto del 25% di un PIL che cresceva ai tassi più elevati mai registrati nella storia d'Italia (Fig. 2.5). Il bilancio pubblico incominciò ad entrare in tensione nella seconda metà degli anni sessanta. Tuttavia, nel 1970, nonostante un disavanzo cospicuo (3,7%) il totale della spesa pubblica (33%) e della spesa primaria corrente (27%) erano, rispetto al PIL al di sotto della media dei paesi della CEE (Ciocca 2007).

A partire dagli anni cinquanta si è avuto un sostanziale cambiamento nella composizione della spesa pubblica. In seguito alla sconfitta nella seconda guerra mondiale, all'Italia – come alla Germania ed al Giappone – fu vietato di ricostruire una potenza militare autonoma. Ciò comportò una drastica riduzione delle spese per la difesa sia rispetto al PIL che alla spesa statale complessiva.

Di converso, crebbero le componenti sociali della spesa: *welfare*, infrastrutture, istruzione. Nonostante i contenuti molto avanzati della Costituzione repubblicana del 1947, il governo italiano non impiantò un sistema di *welfare* universalistico, ma perseguì il miglioramento della protezione sociale esistente e la risoluzione delle principali emergenze, conservando un impianto di tipo occupazionale di stampo bismarckiano. In questo quadro, si conservarono gli istituti pubblici ai quali in epoca fascista era stata affidata la copertura di specifici bisogni: l'INPS per le pensioni, l'INAIL per gli infortuni sul lavoro e l'INAM per l'assicurazione sulla malattia (Battilani e Fauri 2008).

Negli anni cinquanta e sessanta si estese la copertura a nuove categorie sociali e migliorarono i trattamenti erogati. La maggior parte dell'incremento della spesa sociale riguardò le pensioni: anzianità, vecchiaia e invalidità. Le pensioni crebbero principalmente a seguito dell'estensione della rete protettiva ai lavoratori autonomi (coltivatori diretti, artigiani, commer-

cianti), dal cui consenso dipendeva in larga parte il primato politico della DC (Franco 1993). Inoltre, si istituirono casse pensioni per ciascuna categoria di professionisti. Infine, la riforma del sistema pensionistico del 1969 introdusse la pensione sociale per tutti i cittadini di età superiore a 65 anni, fissò un minimo di pensione per tutti i lavoratori (codificando tale diritto in modo universalistico) e stabilì il criterio retributivo (in cui le pensioni sono calcolate sulla base della retribuzione percepita negli anni precedenti il collocamento a riposo) in sostituzione di quello contributivo (in cui esse sono calcolate in relazione ai contributi versati). Inoltre, la stessa legge dispose un'indicizzazione automatica delle pensioni rispetto all'aumento del costo della vita (Castellino 1976).

Così, la riforma del 1969 codificò in modo universalistico il diritto alla pensione e, allo stesso tempo, indebolì il legame fra storia contributiva del pensionato e prestazioni. In questo modo, essa realizzava una conquista sociale – la pensione per tutti – ma lo faceva nel quadro di un sistema farraginoso di cui era ignota la sostenibilità nel lungo periodo e dove, pur avendo spezzato il legame tra contributi e prestazioni, permanevano forti sperequazioni.

Anche per quanto riguarda la tutela della salute lo stato italiano seguì la strategia dell'ampliamento progressivo delle prestazioni gratuite. Il dopoguerra aveva ereditato un sistema organizzato per categorie professionali, ciascuna delle quali aveva la propria cassa mutua, che si finanziava sia attraverso ritenute al personale sia grazie al contributo dello Stato. L'assistenza sanitaria fu estesa ai lavoratori domestici (1950), ai coltivatori diretti, coloni e mezzadri (1954), agli artigiani (1956), ai lavoratori a domicilio e ai pescatori (1958) e ai commercianti (1960). Inoltre, tra il 1953 ed il 1955 la copertura sanitaria venne concessa anche ai pensionati (Battilani e Fauri 2008).

La spesa statale si riversò anche nelle infrastrutture. Si trattò di opere civili (acquedotti, fognature), che in questo periodo per la prima volta vennero realizzate in maniera massiccia anche al Sud, e, soprattutto, di autostrade: nel 1955 fu lanciato il piano decennale per le autostrade, seguito da un secondo piano nel 1961 (Felice 2015)⁴. Al contrario, il piano di ammodernamento della rete ferroviaria presentato dalle Ferrovie dello Stato risultò ampiamente sotto-finanziato. Queste scelte sancirono la centralità del

⁴ I risultati furono ragguardevoli: nel 1970 l'Italia raggiunse i 3.913 km di autostrade (ne aveva 479 nel 1950), situandosi al secondo posto in Europa, dopo la Germania (4.110 km), ma sensibilmente davanti alla Francia (1.560 km) e al Regno Unito (1.057 km) (Battilani e Fauri 2008).

trasporto su strada a discapito di quello ferroviario ed aereo per i decenni a venire (Maggi 2005).

Dalla metà degli anni settanta la spesa statale prese a crescere più rapidamente del PIL, raggiungendo un massimo del 44% alla fine degli anni ottanta (Fig. 2.5). Vi corrisposero i picchi sia della spesa primaria corrente, sia della spesa per interessi, e il massimo scarto (5 punti percentuali) nel rapporto tra la spesa complessiva e il PIL rispetto alla media europea. Quest'ultima era stata raggiunta nel 1983 e fu poi sistematicamente superata (Ciocca 2007).

La creazione di un sistema di *welfare* universalistico e l'azione redistributrice della spesa pubblica – sotto la spinta delle lotte sociali degli anni sessanta e settanta – concorsero ad una rapida riduzione della disuguaglianza dei redditi e della povertà assoluta in Italia. Dal 1968 al 1982 la quota di persone povere scese dal 20 al 3,6%, mentre in numeri assoluti i poveri crollarono da 11 a 2 milioni (Amendola, Salsano e Vecchi 2011). Un andamento simile registrò anche l'indice Gini della disuguaglianza dei redditi, che nello stesso periodo diminuì di oltre 10 punti (Amendola, Brandolini e Vecchi 2011).

Il governo e la classe politica non riuscirono però a conciliare l'efficienza delle pubbliche amministrazioni ed il rigore di bilancio con le richieste che montavano dal corpo sociale e da una condizione dell'economia meno favorevole. Così, tra il 1974 e il 1992 la spesa pubblica crebbe del 166%. Le entrate dello Stato non crebbero in misura corrispondente pur raggiungendo livelli elevatissimi. Si creò un disavanzo crescente e il debito pubblico, che nel 1963 era pari al 25% del PIL, salì al 60% nel 1980 e superò il 120% nel 1993. La spesa fu orientata decisamente all'espansione del *welfare state*, specialmente nei seguenti campi.

- a. Previdenziale: come si è visto, nel 1969 la legislazione sulle pensioni era stata radicalmente innovata, con l'introduzione del criterio retributivo. Questa misura poneva forti problemi di sostenibilità dell'intero sistema nel lungo periodo, dato che ancorava l'entità delle pensioni alle ultime retribuzioni percepite, indipendentemente dai contributi versati, di norma inferiori. Così, con l'allungamento della vita media e l'aumento della quota dei pensionati sulla popolazione totale, il peso del sistema pensionistico sui conti pubblici divenne progressivamente più gravoso, tanto che tra il 1973 e il 1990 la spesa per l'erogazione delle pensioni crebbe dal 12 al 17% del PIL (Battilani e Fauri 2008);
- b. Occupazionale: i conflitti sindacali dell'autunno caldo del 1969 portarono, l'anno successivo, all'approvazione dello Statuto dei lavora-

tori. Il settore del pubblico impiego fu utilizzato come strumento per aumentare i livelli occupazionali e ridurre le tensioni sociali, spesso con massicce assunzioni di personale poco giustificate da esigenze oggettive. Altri interventi riguardarono il salvataggio di imprese private in crisi, assorbendole nel sistema delle partecipazioni statali o assegnando loro cospicui finanziamenti a fondo perduto. Furono ampliati i trasferimenti alle imprese con il ricorso sempre più frequente alla fiscalizzazione degli oneri sociali (Ranci 1987). La stessa prima attuazione della riforma regionale divenne occasione per creare grandi strutture amministrative intermedie, dispensatrici di posti di lavoro anche oltre le necessità di servizio.

- c. Sanitario: la riforma sanitaria del 1978, con l'istituzione del Servizio sanitario nazionale, sostituì alle mutue un'unica assicurazione nazionale, riconoscendo a tutti i cittadini uguali trattamenti sanitari erogati dalle unità sanitarie locali. Le entrate furono accentrate in un unico fondo sanitario nazionale, ma dal punto di vista delle uscite la riforma si rivelò un fallimento e la spesa sanitaria crebbe senza controllo. Tra il 1980 e il 1992 le unità sanitarie locali accumularono un disavanzo complessivo di 72.000 miliardi di lire, che fu ripianato dallo stato (Battilossi 1998).

I cambiamenti strutturali intervenuti nel sistema economico hanno concorso a sostenere l'espansione della spesa pubblica. Anche l'evoluzione della struttura della popolazione ha avuto un ruolo rilevante: infatti, tra il 1960 e il 1990, gli ultrasessantenni, ovvero i potenziali percettori di pensioni di vecchiaia e maggiori fruitori di servizi sanitari, sono cresciuti di circa i due terzi. Inoltre, molte delle decisioni di spesa hanno risposto ad esigenze equitative che in molti altri paesi occidentali erano già state soddisfatte, come il prolungamento della scuola dell'obbligo, l'istituzione delle scuole materne statali, l'estensione dell'assistenza sanitaria a tutti i cittadini, l'istituzione delle pensioni per gli anziani poveri e per gli invalidi civili, l'ampliamento delle categorie tutelate contro gli effetti della disoccupazione.

Tuttavia, la spesa pubblica venne utilizzata anche per attenuare le situazioni di conflittualità e le conseguenze sociali delle crisi economiche. L'espansione della spesa si era incentrata negli anni sessanta e nella prima metà degli anni settanta sull'espansione dei servizi, ossia sull'estensione dell'accesso all'istruzione, sanità, previdenza e assistenza a fasce più ampie della popolazione. Invece, da 1975 al 1990 influi, più della "quantità" dei servizi erogati, la lievitazione del loro costo unitario, dovuta in molti casi a pure inefficienze (Franco 1993).

Anche l'ammodernamento infrastrutturale rimase stentato. Soprattutto, si perse in quegli anni la possibilità di dotare il Sud – al quale pure erano destinate ingenti risorse – di un sistema ferroviario e autostradale di livello pari a quello del resto del paese. L'Italia accumulò, inoltre, un ritardo crescente, rispetto agli altri paesi avanzati, nell'ammodernamento della rete ferroviaria, che iniziò a ridursi solo negli anni novanta con l'avvio del progetto dell'Alta velocità (Felice 2015).

2.5. Il tentativo di risanamento negli anni novanta

A partire dal 1993, nella prospettiva dell'adesione dell'Italia alla moneta unica europea, iniziò un'azione di correzione degli squilibri dei conti pubblici, che cominciò a dare frutti evidenti nel 1995, con un progresso decisivo nel 1997, quando l'indebitamento netto scese al 2,7% del PIL, al di sotto del 3% previsto dal Trattato di Maastricht (Ciocca 2007).

L'azione di risanamento affrontò la sostenibilità nel lungo periodo di alcune voci di spesa, come le pensioni e la sanità. Riguardo al sistema pensionistico, la legge n. 335/1995, varata dal governo Dini, sostituì, sia pure gradualmente, il sistema retributivo con quello contributivo; nel 1997, durante il primo governo Prodi, si innalzò il requisito anagrafico per accedere alla pensione di anzianità e si cancellarono alcuni benefici di cui godevano i dipendenti pubblici; nel 2004, durante il secondo governo Berlusconi, un nuovo provvedimento cercò di elevare l'età pensionabile; infine, nel 2006, il secondo governo Prodi dilazionò nel tempo i requisiti per accedere alle pensioni di anzianità (Pennacchi 1997).

Riguardo alla spesa sanitaria, nel 1992 e 1993 una serie di interventi modificò il modello organizzativo della sanità italiana in due direzioni: da un lato, si cercò di introdurre elementi di concorrenza nei meccanismi di fornitura dei servizi sanitari, in sintonia con quanto si stava sperimentando negli altri paesi europei; dall'altro ci si orientò verso un modello federalista che consentiva alle regioni di disegnare con larga autonomia modelli di concorrenza amministrata diversi tra loro. Tuttavia, non tutte le regioni si portarono su sentieri virtuosi, tanto che nel 2006 per Sicilia, Campania e Lazio si rese necessaria una rinegoziazione del debito contratto con lo Stato negli anni precedenti (Battilani e Fauri 2008).

Al fine di ridurre la spesa e, soprattutto, il debito pubblico venne attuato un massiccio programma di privatizzazioni, che portò alla liquidazione dell'EFIM (1992) e dell'IRI (2000) e alla cessione ai privati delle banche e di gran parte delle imprese manifatturiere e di servizi di pubblica utilità

possedute dallo Stato (R&S 2001). Nel complesso, tra il 1992 ed il 1999 in Italia furono privatizzate imprese per un valore di 101,9 miliardi di dollari, rispetto ai 61,1 miliardi della Germania, 59,8 miliardi della Francia e 47,8 miliardi del Regno Unito (Bianchi 2002).

Tuttavia, dopo l'entrata dell'Italia nell'euro (1999), la spesa statale ricominciò a crescere in termini assoluti, con frequenti oscillazioni da un anno all'altro in rapporto al PIL (Fig. 2.1). Dal 2001 al 2005 (secondo governo Berlusconi) tutti gli indicatori del bilancio pubblico peggiorarono: il saldo primario si ridusse sino a scomparire e l'indebitamento netto superò il 3%. Il deterioramento dei conti pubblici venne ufficialmente sancito dalla Commissione Europea preposta alla sorveglianza del Patto di stabilità, che nel 2005 avviò la procedura per deficit eccessivo nei confronti dell'Italia. Il rientro dal disavanzo venne attuato dal successivo governo Prodi insediato nel 2006 e nel maggio 2008 la Commissione Europea chiuse la procedura di infrazione nei confronti dell'Italia (Battilani e Fauri 2008). Nel complesso, il contenimento della spesa pubblica è stato solo di poco inferiore a quello della Germania: tra il 2001 e il 2013 la spesa pubblica primaria – al netto degli interessi passivi sul debito pubblico – è cresciuta in Italia del 27,4% rispetto al 24,7% della Germania, anche se va tenuto presente che questo paese spendeva, nel 2013, 14.178 euro per ogni suo cittadino, contro gli 11.632 euro dell'Italia (Ministero dell'Economia e delle Finanze 2014).

Fig. 2.1. Spesa statale totale (quota del PIL) (1862-2009)

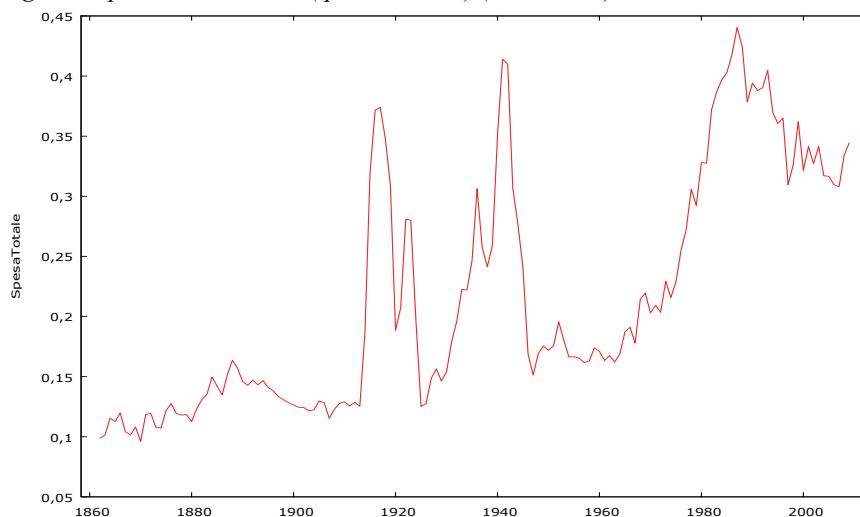


Fig. 2.2. Spesa statale totale (quota del PIL) e PIL reale pro capite (1862-1945)

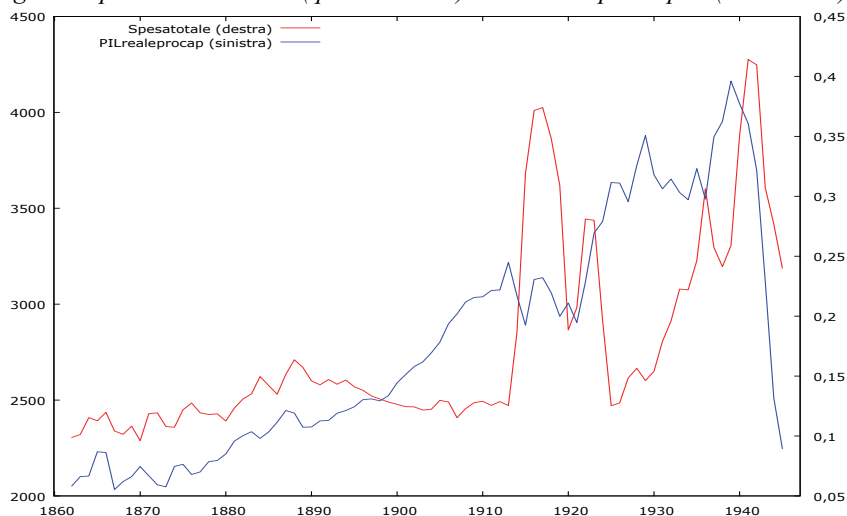


Fig. 2.3. Spesa statale (quota del PIL) per categorie funzionali (1862-2009)

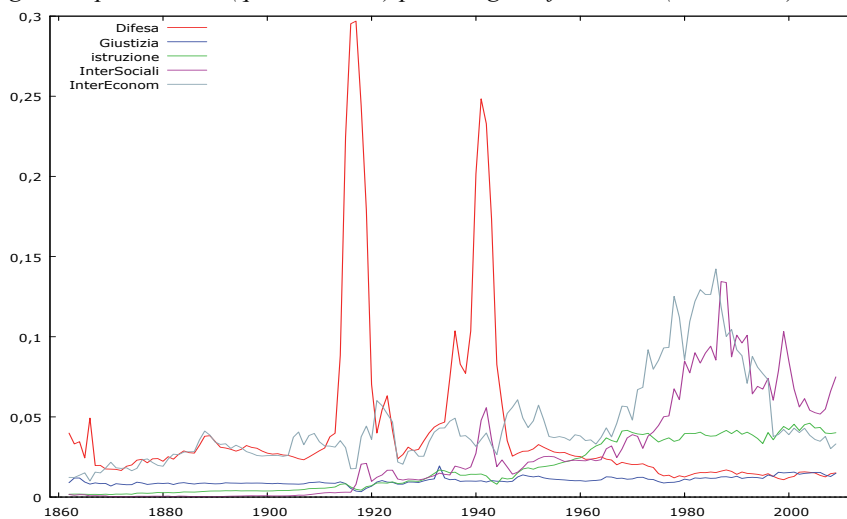


Fig. 2.4. Spesa statale (quota del PIL) per categorie economiche (1862-2009)

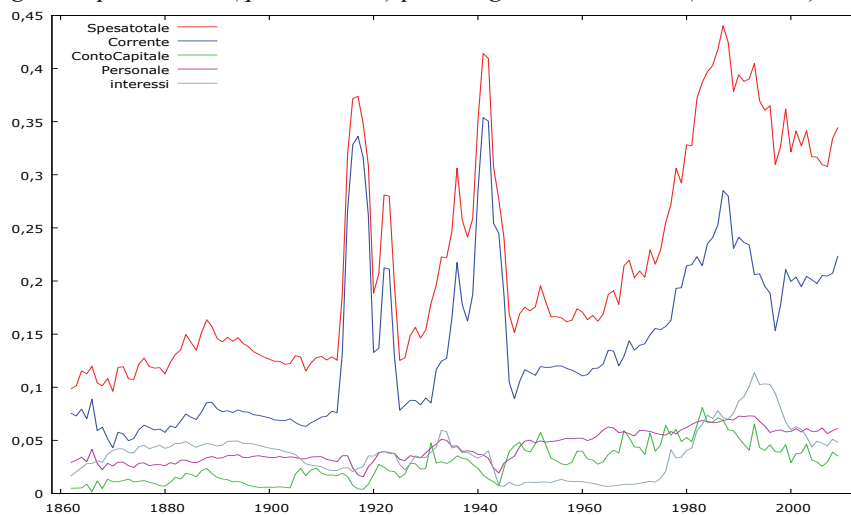
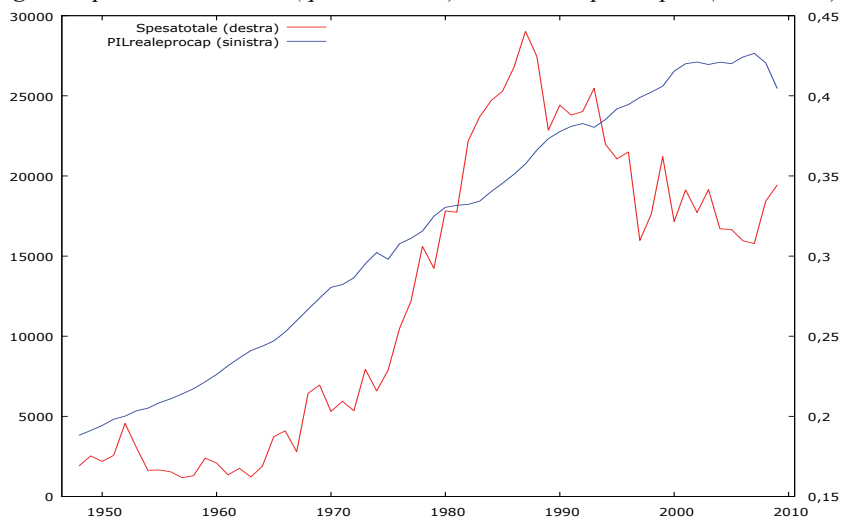


Fig.2.5. Spesa statale totale (quota del PIL) e PIL reale pro capite (1945-2009)



3. DATI, FONTI E RISULTATI

Questo capitolo illustra i dati, le fonti e le variabili utilizzate nella stima della relazione tra la spesa statale e il PIL. La strategia econometrica usata consta di quattro parti: l'analisi di integrazione, l'analisi di cointegrazione, l'analisi di causalità di Granger e la stima consistente dell'elasticità di lungo periodo.

La prima fase studia le proprietà statistiche delle due serie storiche, che sono caratterizzate da un persistente movimento nel corso del tempo. Questa persistenza è generalmente dovuta alla presenza sia di un *trend* deterministico, funzione non aleatoria del tempo, che di un *trend* stocastico, funzione aleatoria del tempo. La presenza di questi due tipi di *trend* implica *non stazionarietà* nelle variabili osservate, in altre parole la loro media e la loro varianza dipendono dal tempo. Qualunque sia la fonte di non stazionarietà stocastica e/o deterministica, l'inferenza statistica standard non è più utilizzabile. Per stimare qualunque relazione economica e valutarne la significatività è necessario, quindi, porsi la questione se le variabili siano o meno stazionarie.

La serie storiche della spesa pubblica e del PIL risultano essere non stazionarie in media e varianza e quindi per poterne analizzare il comovimento nel lungo periodo verrà usata una tecnica appropriata: l'analisi di cointegrazione. Con la cointegrazione si valuterà se spesa e reddito, benché singolarmente non stazionarie in varianza, condividano un legame di lungo periodo che le tiene vincolate ad un sentiero comune di crescita. L'esistenza di cointegrazione è una condizione necessaria, ma non sufficiente, per stabilire quale delle due variabili aggiusti allo *steady state*. Per questo motivo, il passo successivo sarà quello della valutazione della causalità, che consente di stabilire se le variazioni del PIL "causano nel senso di

Granger”, ovvero anticipano, le variazioni della spesa pubblica come suggerito dalla legge di Wagner. Come ultimo passo, se esiste una relazione di lungo periodo tra le variabili analizzate, e se questa è della forma dettata dalla legge di Wagner, sarà stimata l’entità della relazione che contribuisce a definire l’elasticità di lungo periodo tra spesa pubblica e PIL.

3.1. Dati, fonti e variabili

I dati che saranno utilizzati nell’analisi empirica per verificare l’esistenza di una relazione di lungo periodo tra la spesa statale in rapporto al PIL e il PIL reale pro capite sono tratte da una pluralità di fonti¹. Come anticipato nell’Introduzione, per la spesa statale vengono usate le serie della spesa dal 1862 al 2009 ricostruite dalla RGS in occasione del centocinquantenario dell’Unità nazionale (RGS 2011).

I dati del PIL a valori correnti e del PIL reale pro capite (espresso in euro del 2010) sono tratti dalle nuove serie storiche della contabilità nazionale italiana prodotte recentemente dalla Banca d’Italia (Baffigi 2011)². I dati sulla popolazione sono ottenuti dal dataset, “Ricostruzione della popolazione residente e del bilancio demografico” (Istat 2012).

Nella Tabella 3.1 vengono riportate le variabili utilizzate nell’analisi empirica. La prima colonna indica l’acronimo che verrà utilizzato in tutte le tabelle relative ai risultati. La seconda colonna riporta invece come la variabile è costruita. Quando impiegate nelle stime sono le variabili saranno in logaritmi.

¹ In quanto segue si useranno indifferentemente i termini spesa pubblica e spesa statale. Si noti tuttavia che in questo lavoro disponiamo solo dei dati relativi alla spesa statale, un aggregato che, come si è visto nel Capitolo 2, è meno ampio della spesa totale delle amministrazioni pubbliche.

² I dati usati nel presente lavoro differiscono da quelli di Kuckuck (2014), il quale per gli anni dal 1850 al 1995 si avvale delle serie del PIL e della spesa statale tratte da Mitchell (2007). Queste sono basate sulle serie presentate dall’Istat (1958) e successivamente aggiornate da un gruppo di ricerca diretto da Giorgio Fuà (1969), ma che presentavano alcuni difetti rilevanti (Cohen e Federico 2001). Per gli anni dal 1996 al 2010 Kuckuck (2014) si avvale invece dei dati della spesa statale di Eurostat e della contabilità nazionale resi disponibili dal database *International Financial Statistics* del Fondo Monetario Internazionale.

Tab. 3.1. Acronimi e variabili utilizzati nell'analisi empirica *

Acronimo	Variabile (logs)
Spesa corrente	Spesa statale corrente / PIL nominale
Spesa in conto capitale	Spesa statale in conto capitale / PIL nominale
Spesa totale	Spesa statale totale / PIL nominale
Spesa per il personale	Spesa statale per il personale / Pil nominale
Spesa per interessi	Spesa statale per interessi / PIL nominale
Difesa nazionale	Spesa statale per difesa nazionale / PIL nominale
Giustizia e pubblica sicurezza	Spesa statale per giustizia e pubblica sicurezza / PIL nominale
Interventi nel campo economico	Spesa statale per azioni ed interventi nel campo economico / PIL nominale
Interventi nel campo sociale	Spesa statale per azioni ed interventi nel campo sociale / PIL nominale
Istruzione e cultura	Spesa statale per istruzione e cultura / PIL nominale
PIL	Prodotto interno lordo in termini reali / popolazione
Popolazione	Popolazione totale
DR: (<i>dependency ratio</i>)	(Popolazione 0-14 - Popolazione +65) / Popolazione 15-64

* Per una illustrazione dettagliata su come le categorie economiche e funzionali della spesa statale utilizzate nel presente lavoro si raccordano alle categorie di spesa del bilancio dello Stato, si rimanda a Pistoresi, Rinaldi e Salsano (2015: Appendici B, C e D).

3.2. La periodizzazione dell'analisi

L'analisi econometrica che segue viene condotta sia sull'intero periodo 1862-2009 che per i due sotto-periodi 1862-1939 e 1948-2009. La scelta di una periodizzazione siffatta è dovuta a due motivi principali.

1) La seconda guerra mondiale è lo spartiacque più importante nella storia dell'Italia post-unitaria. È qui che si ebbe, per un certo periodo (dal settembre 1943 all'aprile 1945) la scomparsa dello stato unitario italiano con la divisione del paese tra il Regno del Sud e la Repubblica Sociale Italiana. Il conflitto portò, inoltre, alla maggiore cesura istituzionale nella storia recente del paese con l'abolizione della monarchia e l'instaurazione della repubblica. Pertanto, appare giustificata, anche ai fini del presente studio, una disaggregazione dell'analisi tra il periodo antecedente (1862-1939) e quello successivo (1946-2009) al secondo conflitto mondiale.

2) La disaggregazione dell'analisi per sotto-periodi relativamente brevi si osserva spesso nella letteratura sugli altri paesi ed è suggerita come metodologia di indagine efficace da vari autori, tra cui Durevall e Henrekson (2011) e Kuckuck (2014). Durevall e Henrekson (2011) non trovando – per il Regno Unito e per la Svezia – risultati significativi dall'analisi di co-integrazione sul lungo periodo dal 1800 al 2006, esaminano separatamente, per ambedue i paesi, i due sotto-periodi 1800-1913 e 1920-2006 e, successivamente, anche i quattro sotto-periodi più brevi 1800-1859; 1860-1913, 1920-1973 e 1974-2006. Un approccio di questo tipo è stato seguito anche da Kuckuck (2014), che sottopone a verifica la legge di Wagner per cinque paesi (Regno Unito, Danimarca, Svezia, Finlandia ed Italia) dal 1850 al 2010 in relazione ai loro stadi di sviluppo, approssimati da tre classi del livello del reddito pro capite. In relazione a ciò, occorre ricordare che, come sottolineato dallo stesso Wagner, la relazione tra reddito e spesa statale ha una valenza maggiore per la fase iniziale di industrializzazione di una economia. Di qui si giustifica una disaggregazione dell'analisi per periodi corrispondenti a diversi stadi di sviluppo del paese.

Questi argomenti in favore della suddivisione nei sotto-periodi indicati sono confortati dall'analisi grafica: le serie, infatti, co-muovono in modo più stretto nei due sotto-periodi 1862-1939 e 1946-2009 piuttosto che nell'intero periodo 1862-2009. Questo si evince dall'andamento della spesa totale in rapporto al PIL nominale e del PIL reale pro capite (*in logs*) nella Figura 3.1. Il PIL reale pro capite mostra sin dagli anni immediatamente successivi alla seconda guerra mondiale una crescita molto più sostenuta, che implica una rottura del trend rispetto all'intero periodo dal 1861 alla fine degli anni trenta del XX secolo. Così, se il periodo dal 1861 al 1939 aveva un tasso medio di crescita del PIL reale pro capite dello 0,9%, il dato corrispondente balza al 3,8% dopo il 1946. Va, inoltre, osservato che gli anni dal 1914 al 1945 furono particolarmente tormentati dalle crisi, con due guerre mondiali e la Grande Depressione degli anni trenta, per cui non sorprende che le serie della spesa statale totale in rapporto al PIL e del PIL reale pro capite non comuovono in questo periodo. Il maggior legame sembra esserci nel periodo 1862-1897 (Figura 3.2), mentre nel secondo dopoguerra la relazione appare più ambigua e relativa ad intervalli più brevi che saranno indagati nel prosieguo di questo capitolo (Figura 3.3).

Fig. 3.1. Spesa statale totale (quota del PIL) e PIL reale pro capite (1862-2009) (in logs)

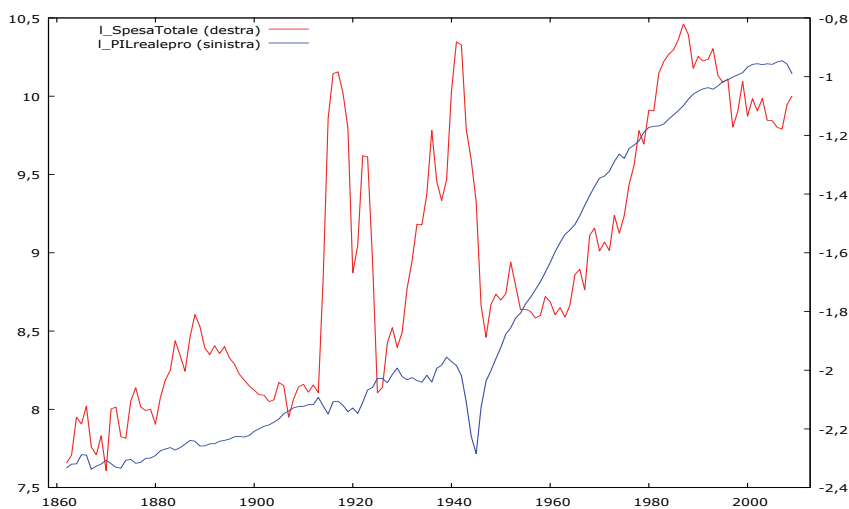


Fig. 3.2. Spesa statale totale (quota del PIL) e PIL reale pro capite (1862-1939) (in logs)

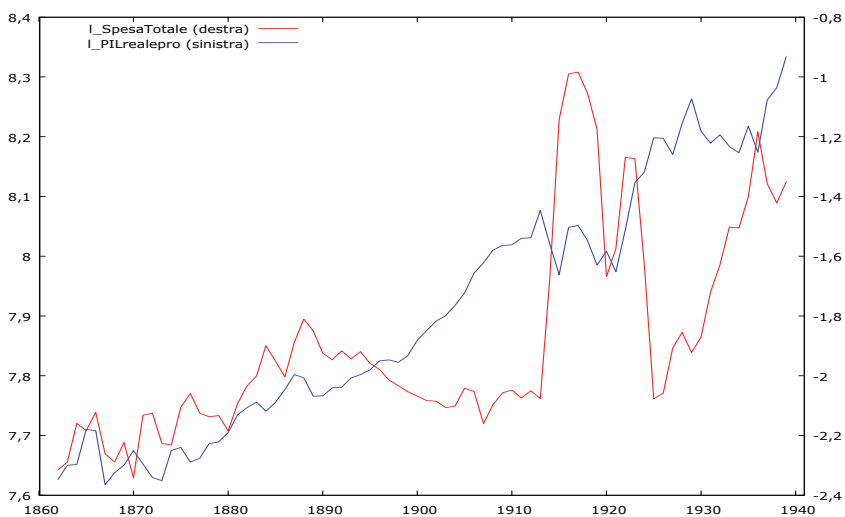
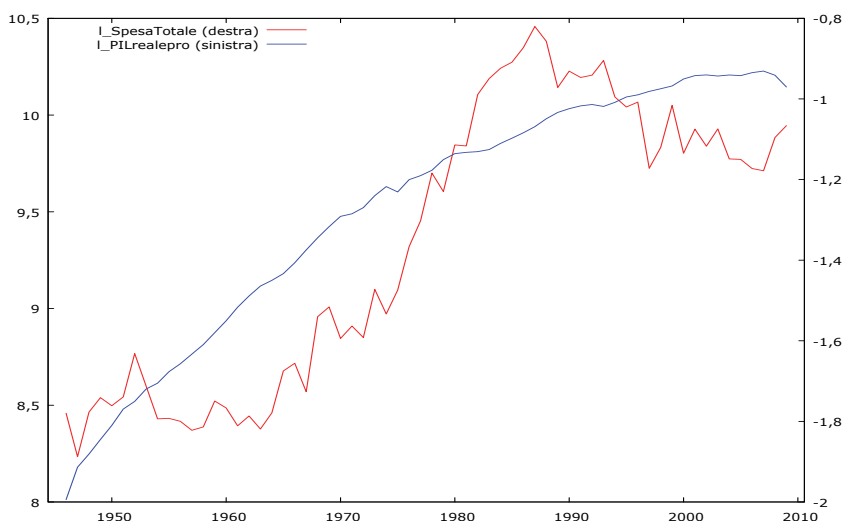


Fig. 3.3. Spesa statale totale (quota del PIL) e PIL reale pro capite (1946-2009) (in logs)



3.3. Comovimento di lungo periodo tra spesa statale e PIL

L'analisi econometrica giustifica la disaggregazione dell'analisi per fasi corrispondenti a diversi stadi di sviluppo del paese. In questo paragrafo si utilizzerà l'analisi di cointegrazione per valutare se la spesa statale e il PIL comuovono nel lungo periodo. Se le due serie sono cointegrate hanno un *trend* stocastico comune. Se oltre ad avere un *trend* stocastico comune hanno anche il *trend* deterministico comune, allora la cointegrazione si definisce cointegrazione *deterministica*. Se invece le serie hanno solo il *trend* stocastico comune, allora la cointegrazione si definisce *stocastica*. Il concetto più stringente di comovimento, ma anche quello più comunemente utilizzato in letteratura, è quello di cointegrazione deterministica.

Analizzare la legge di Wagner in un contesto di cointegrazione deterministica significa verificare se esiste la relazione di lungo periodo che segue:

$$\ln\left(\frac{G}{PIL}\right)_t = \alpha + \beta \ln\left(\frac{PILreale}{POP}\right)_t + u_t \quad (1)$$

dove $\ln \left(G / PIL \right)_t$ è il logaritmo della quota di spesa pubblica nominale rispetto al PIL nominale mentre $\ln \left(PIL_{reale} / POP \right)_t$ è il logaritmo del PIL *reale* pro capite, il pendice t indica il tempo t e u è l'errore. Se invece le serie hanno solo il *trend* stocastico comune, allora la cointegrazione si definisce stocastica e la relazione assume la forma

$$\ln \left(\frac{G}{PIL} \right)_t = \alpha + \beta \ln \left(\frac{PIL_{reale}}{POP} \right)_t + \mu T + u_t \quad (2)$$

dove T è il trend deterministico. Il parametro di cointegrazione β rappresenta l'entità della relazione tra le variabili e contribuisce a definire l'elasticità di lungo periodo, ε . In entrambi i casi, se $\beta > 0$ l'elasticità della spesa rispetto al reddito sarà $\varepsilon = (1 + \beta) > 1$. In tal caso, un aumento del PIL reale pro capite provoca un aumento più che proporzionale nella spesa statale come asserito dalla legge di Wagner.

Nella Tabella 3.2 vengono presentati i risultati della cointegrazione deterministica sull'intero periodo quando vengono considerate diverse voci in spesa in relazione al PIL pro capite.

Tab. 3.2. Analisi di cointegrazione di Engle e Granger (OLS): 1862-2009

Voci di spesa	Cointegrazione	P-value
Categorie economiche della spesa statale		
Spesa corrente	NO	0.21
Spesa in conto capitale	SI	0.00
Spesa totale	NO	0.15
Spesa per il personale	SI	0.00
Spesa per interessi	NO	0.75
Categorie funzionali della spesa statale		
Difesa nazionale	NO	0.33
Giustizia e pubblica sicurezza	SI	0.00
Interventi in campo economico	NO	0.11
Interventi in campo sociale	NO	0.70
Istruzione e cultura	NO	0.58

Note: Il p-value asintotico come in MacKinnon (1996). Variabili in logs.

Data la scarsa significatività dei risultati della cointegrazione deterministica, si cercherà di rendere l'analisi meno "stringente" consentendo alle variabili di avere un trend stocastico comune, ma diversi trend deterministici. Questo implica un comovimento delle serie solo in relazione alla loro varianza; questo è quindi un caso più favorevole al risultato di comovimento di lungo periodo.

La Tabella B.1 in Appendice riporta l'esito della *cointegrazione stocastica*. Aver allentato il concetto di comovimento non aiuta l'esito di cointegrazione, giacché l'analisi di cointegrazione stocastica conduce agli stessi risultati di quella deterministica. Il fatto che le variabili non comuovano nel lungo periodo (cointegrazione deterministica) può essere dovuto all'omissione di variabili rilevanti per la definizione del loro sentiero comune di crescita. Una di queste, considerata ad esempio da Durevall e Henrekson (2011), è il *dependency ratio*, definito come il rapporto tra la popolazione passiva e quella attiva. Riformulando l'analisi di cointegrazione deterministica aggiungendo il *dependency ratio* (definizione nella Tabella 3.1), la relazione di cointegrazione diventa

$$\ln \left(\frac{G}{PIL} \right)_t = \alpha + \beta \ln \left(\frac{PIL_{reale}}{POP} \right)_t + \phi DR_t + u_t \quad (3)$$

Il *dependency ratio* viene considerato anche da Shelton (2007), che dopo aver analizzato un panel per diversi paesi dal 1970 al 2000 ipotizza che la legge di Wagner sia influenzata dai cambiamenti nella struttura di età della popolazione ed in particolare dalla porzione con età superiore a 65 anni. Questa nuova variabile dovrebbe catturare la spesa sanitaria per l'assistenza all'infanzia, quella per l'istruzione e per le pensioni ed altre voci ancora. L'idea è che legge di Wagner a lungo andare possa essere minata dalla sua stessa dinamica, nella misura in cui le società sono portate a costruire un sistema di *welfare* nel quale un peso preponderante viene assunto dalla erogazione di servizi pubblici legati all'età dei beneficiari, come l'istruzione obbligatoria gratuita per i bambini, gli assegni familiari e le pensioni agli anziani. Anche la spesa sanitaria, pur in presenza di un sistema sanitario nazionale universalistico, tende a crescere proporzionalmente all'aumento della popolazione anziana. Si ipotizza, insomma, che l'incidenza della spesa statale sul PIL cresca in relazione al rapporto tra la popolazione passiva e quella attiva, e non alla crescita del PIL pro capite³.

³ A meno che, naturalmente, non si dimostri – come sostenuto da Caldwell (1976) – che la struttura per età della popolazione non sia a sua volta funzione del PIL pro capite. Tuttavia,

La Tabella B.1 in Appendice mostra i risultati anche per il caso di cointegrazione deterministica aumentata dal *dependency ratio*. I risultati sono gli stessi rispetto alla cointegrazione deterministica, suggerendo che il *dependency ratio* non sembra essere rilevante per definire un sentiero di crescita comune tra spesa pubblica e PIL. Questo risultato è in contrasto con quanto ottenuto da Durevall e Henrekson (2011). Il motivo potrebbe essere legato alla costruzione del *dependency ratio*. Questi due autori, infatti, considerano come popolazione attiva la classe di età 20-64 anni; di conseguenza la popolazione passiva è formata dalla classe di età maggiore di 65 anni e dalla classe 0-14 anni⁴. Nel caso italiano considerare la popolazione attiva (19-64 anni) non sembra corretto visto che l'obbligo scolastico solo dal 2001 è stato innalzato a dieci anni e, in ogni caso, fino al sedicesimo anno di età, differentemente dal Regno Unito e Svezia dove esso è invece in uso da molto più tempo.

Il risultato di assenza di comovimento delle serie della spesa statale totale in rapporto al PIL nominale e della serie del PIL reale pro capite non sorprende in quanto già l'ispezione visiva offerta dalle Figure 3.1, 3.2 e 3.3 evidenziava un comovimento tra le due variabili nei soli sotto-periodi 1862-1895 e 1980-2009, mentre forti divergenze si avevano, per ragioni diverse, nella parte restante dell'arco temporale analizzato. Invece, la spesa in conto capitale, la spesa per il personale e la spesa per la giustizia cointegrano col PIL reale pro capite per l'intero periodo 1862-2009.

Poiché né l'utilizzo della cointegrazione stocastica né l'aggiunta nella relazione di cointegrazione del *dependency ratio* portano a risultati più favorevoli all'esistenza di un sentiero di crescita comune tra le due variabili, si considera la possibilità che l'esito di non cointegrazione sia dovuto alla presenza di cambiamenti di regime. La non cointegrazione tra due serie dovuta a breaks può accadere se un cambiamento strutturale colpisce le serie in momenti diversi del tempo portandole a deviare in modo permanente dal sentiero comune di crescita. Esiste un caso invece in cui anche se si assiste ad un cambiamento di regime di tipo permanente, esso è comune. Nel caso di co-breaks a seguito dei quali le variabili si spostano su un nuovo, ma comune, sentiero di crescita, la cointegrazione può ancora essere possibile.

anche in questo caso il meccanismo che genera l'aumento della spesa pubblica rispetto al reddito sarebbe più complesso e più indiretto di quello ipotizzato originariamente da Wagner.

⁴ I due autori controllano per alcuni sottoperiodi anche per il *dependency ratio* con popolazione attiva più ampia (15-64), ma in quel caso trovano che l'impatto del *dependency ratio* è molto minore.

Quindi, l'assenza di cointegrazione sull'intero periodo tra molte categorie della spesa pubblica e PIL è compatibile con l'assenza di un co-break nel 1946 come documentato nell'Appendice C.

Dato il debole risultato di cointegrazione relativo all'intero periodo 1862-2009 e l'evidenza di un break nel 1946, l'analisi viene disaggregata per due sotto-periodi, 1862-1939 e 1948-2009, omettendo gli anni relativi alla seconda guerra mondiale. Nella Tabella 3.3 vengono presentati i risultati relativi alle voci di spesa distinte per categorie economiche, mentre la Tabella 3.4 riporta i risultati per le voci di spesa definite per categorie funzionali. I periodi considerati sono gli anni 1862-1939 e 1946-2009. Qualora non si trovi la cointegrazione per questi due sotto-periodi, viene riportato l'esito di cointegrazione relativo all'intervallo temporale che endogenamente emerge dai dati⁵.

La Tabella 3.2 suggerisce che l'analisi di cointegrazione per il periodo 1862-1939 relativo alle componenti della spesa statale definite in base alle categorie economiche porta a risultati soddisfacenti: tutte le variabili cointegrano con il PIL. Coerentemente con l'analisi presentata nella sezione precedente relativa all'intero periodo 1862-2009, la spesa totale comuove con il PIL solo fino al 1897 e, successivamente, negli anni 1980-2009. Ciò è dovuto al comportamento della spesa corrente e della spesa per interessi che cointegrano con il PIL solo fino all'inizio del XX secolo. Invece, la spesa in conto capitale cointegra con il PIL sull'intero arco temporale 1862-2009.

Dalla Tabella 3.3 si evince che tutte le categorie funzionali della spesa cointegrano con il PIL sull'intero periodo 1862-1939 eccetto la spesa per la difesa nazionale che cointegra solo fino al 1913, a causa dell'esplosione delle spese militari durante la prima guerra mondiale e alla loro rapida riduzione negli anni immediatamente successivi, che porta questa serie a divergere sensibilmente da quella del PIL reale pro capite. Si segnala il comovimento della serie degli interventi in campo economico e sociale che, seppur non cointegrando sull'intero arco temporale 1862-2009, comuovono con il PIL dal 1862 al 1939 e, successivamente, dagli anni sessanta all'inizio degli anni novanta del novecento.

⁵ Nelle Tabelle 3.3 e 3.4 sono riportati, per ragioni di chiarezza espositiva, solo i casi in cui l'esito dei test è favorevole alla cointegrazione deterministica. I risultati dei test relativi a differenti sottoperiodi e/o ai casi di assenza di cointegrazione deterministica vengono riportati in Pistoresi, Rinaldi e Salsano (2015: Appendice F). Si sottolinea che, come per l'analisi sull'intero campione, l'esito di assenza di comovimento non cambia se si usa il concetto di *cointegrazione stocastica* o si considera nella relazione di cointegrazione il *dependency ratio*. Per il dettaglio dei test di cointegrazione deterministica e stocastica nei vari sottoperiodi considerati, si rimanda a Pistoresi, Rinaldi e Salsano (2015: Appendice F).

Tab.3.3. Esito dell'analisi di cointegrazione tra le componenti della spesa statale (quota del PIL) e il PIL reale pro capite distinte per categorie economiche

Categorie di spesa	Sottoperiodi	Cointegrazione	P-value
1862-1939			
Spesa corrente	1862-1901	SI	0,09
Spesa conto capitale	1862-1939	SI	0,0001
Spesa totale	1862-1897	SI	0,027
Spesa personale	1862-1939	SI	0,02
Spesa interessi	1862-1901	SI	0,03
1948-2009			
Spesa conto capitale	1948-2009	SI	0,09
Spesa totale	1980-2009	SI	0,01

Nota: I p-value si basano su MacKinnon (1996).

Tab. 3.4. Esito dell'analisi di cointegrazione tra le componenti della spesa statale (quota del PIL) e il PIL reale pro capite distinte per categorie funzionali

Categorie di spesa	Sottoperiodi	Cointegrazione	P-value
1862-1939			
Difesa nazionale	1862-1913	SI	0,02
Giustizia e pubblica sicurezza	1862-1939	SI	0,05
Interventi in campo economico	1862-1939	SI	0,02
Interventi in campo sociale	1862-1939	SI	0,08
Istruzione e cultura	1862-1939	SI	0,01
1948-2009			
Giustizia e pubblica sicurezza	1980-2009	SI	0,03
Interventi in campo economico	1957-1987	SI	0,06
Interventi in campo sociale	1960-1992	SI	0,07
Istruzione e cultura	1980-2009	SI	0,06

Nota: I p-value si basano su MacKinnon (1996).

Questi risultati sembrano la conseguenza di un cambiamento nella struttura della spesa statale intervenuta nei centocinquanta anni considerati. L'abbandono della politica di potenza da parte dell'Italia dopo la seconda guerra mondiale e la drastica riduzione delle spese militari sono probabilmente l'elemento alla base dell'assenza di comovimento della spesa statale totale rispetto al PIL reale pro capite. Allo stesso tempo, l'esito di cointegrazione della spesa per il personale e di quella in conto capitale sembrano indicativi di un accresciuto peso di altre forme dell'intervento statale.

Per quanto riguarda la spesa per il personale, essa costituisce un indicatore di notevole importanza, seppur parziale, delle dimensioni del settore pubblico, giacché la quantità di beni e servizi pubblici prodotti dipende dal numero dei dipendenti pubblici e dalla loro produttività⁶. Inoltre, secondo la teoria economica della burocrazia di Niskanen (1975), l'obiettivo principale dei dirigenti pubblici è la crescita dimensionale dei loro uffici e dei loro staff⁷.

La crescita della dimensione del settore pubblico sembra sia stata indirizzata innanzitutto verso l'amministrazione della giustizia e la sicurezza pubblica, la spesa per i quali cointegra con il PIL anche per l'intero periodo 1862-2009. Si tratta dei servizi fondamentali richiesti allo Stato, la cui espansione è legata alla crescente domanda di regolazione e di tutela dell'applicazione dei contratti che si palesa man mano che la società diventa più complessa ed aumenta la divisione del lavoro (Kuznets 1967; North e Wallis 1982). Nel secondo dopoguerra, l'adesione all'Alleanza Atlantica e l'esistenza nel paese del più grande partito comunista dell'Occidente – con il timore che esso potesse promuovere un'azione rivoluzionaria – indussero le classi dirigenti italiane a destinare una porzione proporzionalmente crescente del bilancio pubblico alla sicurezza interna. Negli anni settanta, questa categoria di spesa fu ulteriormente accresciuta di fronte alle lotte sociali

⁶ Gli addetti alla pubblica amministrazione sono cresciuti ininterrottamente dall'Unità nazionale all'inizio del XXI secolo. Essi, che erano 289 mila nel 1881, sono aumentati progressivamente a 366 mila nel 1911, 689 mila nel 1936, 1.352 mila nel 1961, per poi balzare a 2.630 mila nel 1981 e a 3.209 mila nel 2001. Solo nel primo decennio del secolo attuale hanno registrato una lieve diminuzione, scendendo a 2.841 mila nel 2011 (Zamagni 1987; Istat 2011).

⁷ Il potere delle burocrazia si regge e rafforza attraverso alcuni fattori: la forza elettorale dei dipendenti pubblici, che rappresentano una percentuale elevata della popolazione attiva; il potere di monopolio sull'informazione circa la propria attività da parte dei burocrati e, infine, la capacità di interdizione al ridimensionamento del proprio potere grazie alla propria indipendenza dal potere politico tipica di alcuni paesi dell'Europa occidentale, tra cui l'Italia (Brosio e Marchese 1986).

iniziate con l'“autunno caldo” del 1969 e per la necessità di combattere il terrorismo politico (Ginsborg 1989).

La spesa in conto capitale implica un intervento dello Stato nell'economia molto più incisivo di quello realizzato con i trasferimenti. Questi ultimi, che consistono di redistribuzioni di risorse monetarie tra i soggetti, non incidono sulle dimensioni relative del settore pubblico e di quello privato in termini di produzione effettuata. L'intervento dello Stato italiano si manifestò in modo preponderante dopo la prima guerra mondiale per culminare negli anni trenta con la nascita dell'IRI (Istituto per la Ricostruzione Industriale) e del sistema delle imprese a partecipazione statale e, nel secondo dopoguerra, con di massicci programmi di erogazione di credito agevolato alle imprese che si protrassero sino all'inizio degli anni novanta (Spadavecchia 2003).

Infatti, il salvataggio da parte dello Stato nel 1933 delle banche miste con il trasferimento della loro proprietà e di quella delle società da esse partecipate nella neo-costituita holding pubblica IRI portò alla nascita in Italia di un settore dell'economia di proprietà statale di dimensioni sconosciute negli altri paesi occidentali⁸. Di fronte alla debolezza dell'impresa privata, le imprese pubbliche – all'IRI si aggiunsero nel 1953 la super-holding ENI nel settore energetico e nel 1961 l'EFIM nella meccanica – svolsero un ruolo fondamentale nel consentire lo sviluppo di quei settori di elevata intensità di capitale – siderurgia, meccanica pesante, energia, autostrade, telefonia – nei quali l'investimento richiesto era troppo elevato e a redditività eccessivamente differita per essere alla portata degli investitori privati, fungendo così da “fattore sostitutivo” di tipo gerschenkroniano dei prerequisiti mancanti dell'industrializzazione del paese (Gerschenkron 1962; Amatori 2000; Toninelli 2004). Come risultato, il peso dell'impresa pubblica in Italia si accrebbe costantemente, e si ridusse solo con le privatizzazioni degli anni novanta⁹.

L'assenza di cointegrazione non è in conflitto con l'assenza della relazione ipotizzata da Wagner, ma può essere dovuta al fatto che la crescita

⁸ Al momento della costituzione dell'ente, le imprese facenti capo all'IRI annoveravano l'83% del capitale azionario delle società per azioni operanti in Italia nella telefonia, il 56% nella navigazione, il 39% nel settore bancario, il 38% nella metallurgia, il 29% del settore elettrico e il 21% della meccanica (Cianci 1977). L'IRI controllava l'80% della produzione cantieristica, il 45% di quella siderurgica, il 39% dell'elettromeccanica, il 23% della meccanica (Amatori e Colli 1999).

⁹ La quota di IRI, ENI ed EFIM sul totale del capitale azionario delle società italiane per azioni salì dal 12,5% nel 1936 al 22,7% nel 1952, al 32,1% nel 1972 e al 40,2% nel 1983 (Toninelli e Vasta 2010).

della spesa non è legata alla crescita del reddito pro capite di lungo periodo, ma comuove con questo nel breve-medio periodo per ragioni di tipo macropolitico. Questo risultato può, infatti, essere dovuto alla presenza del *ratchet effect*¹⁰, secondo il quale durante una crisi economica la spesa pubblica diminuisce più lentamente rispetto al reddito pro capite, in modo che il rapporto G/Y aumenta, mentre avviene il contrario nei periodi di ripresa dell'economia.

La logica alla base di questo effetto è simile alla interpretazione data da Duesenberry (1949) per spiegare la maggiore stabilità del consumo rispetto al reddito nei periodi di crisi. Buchanan e Wagner (1978) sostengono che il *ratchet effect* può essere spiegato come conseguenza della prescrizione keynesiana in favore di una politica fiscale anticiclica. In teoria, il bilancio pubblico dovrebbe essere in pareggio nel corso del ciclo economico, ma in pratica nelle democrazie si riscontrano deficit secolari, dovuti alla mancanza di una costituzione fiscale vincolante (*commitment*), che richieda che i surplus nei periodi di boom siano grandi come i deficit durante le recessioni.

In effetti, i politici cercano in tutti i modi di essere rieletti, ed utilizzano il bilancio pubblico per questo scopo in quanto i benefici diretti della spesa statale sono facilmente identificati dagli elettori, mentre i costi indiretti di finanziamento del deficit sono molto più diffusi e non si avvertono facilmente.

3.4. Relazione di lungo periodo tra spesa statale e PIL

L'esito di cointegrazione stabilisce che esiste un sentiero comune di crescita di lungo periodo in cui una variabile è endogena e l'altra è esogena. A fronte di shock esogeni che perturbano l'equilibrio di lungo periodo, è la variabile endogena ad aggiustarsi allo *steady state*. Ora è necessario valutare quale delle due variabili sia endogena all'interno della relazione di lungo pe-

¹⁰ Il *ratchet effect* può essere interpretato come una versione generalizzata del cosiddetto *displacement effect* di Peacock e Wiseman (1961). Secondo questi autori, il peso della spesa pubblica subisce un "salto" verso l'alto in corrispondenza di eventi eccezionali (guerre, depressioni gravi, catastrofi naturali) che giustificano l'accettazione, da parte dei cittadini di una democrazia, di un corrispondente forte aumento della pressione fiscale. Quando l'evento eccezionale – ad esempio, una 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.

riodo che è stata trovata tra spesa pubblica e PIL. Questo equivale a stabilire la direzione di causalità, ovvero verificare se sia il PIL a causare “nel senso di Granger” la spesa pubblica o se non sia piuttosto la spesa pubblica a causare “nel senso di Granger” il PIL¹¹. L’ esito dei test di Granger causazione vengono presentati nell’Appendice D nelle Tabelle D.1 e D.2. Il risultato è univoco: esiste *causazione unidirezionale* dal PIL reale pro capite alle varie categorie della spesa statale. Questo conferma che, per i periodi in cui esiste un comovimento di lungo periodo delle variabili, la rappresentazione nella forma della legge di Wagner prevale sulla rappresentazione keynesiana della spesa pubblica come determinante della crescita economica.

In quanto segue verrà presentata la stima consistente del parametro di cointegrazione β (DOLS, *Dynamic Ordinary Least Squared*), dovuto a Stock e Watson (1993), per le diverse categorie della spesa statale e il PIL. Nelle Tabelle 3.5 e 3.6 viene riportata la stima di β per le voci di spesa distinte rispettivamente in categorie economiche e funzionali. Ciascuna tabella riporta le stime relative ai sottoperiodi risultati rilevanti nell’analisi di cointegrazione. In entrambe le tabelle viene riportato nella colonna 3 il test di significatività su β prevede $H_0 : \beta^{dols} = 0$ vs $H1 : \beta^{dols} \neq 0$. Nell’ultima colonna viene invece riportato l’esito del test unilaterale per sottoporre a verifica che $\beta > 0$ che prevede $H_0 : \beta^{dols} = 0$ vs $H1 : \beta^{dols} > 0$ e l’esito del test per $\beta > 1$ che prevede $H_0 : \beta^{dols} = 1$ vs $H1 : \beta^{dols} > 1$. Si ricordi che la condizione teorica affinché la legge di Wagner sia verificata è $\beta > 0$. In tal caso, l’elasticità di lungo periodo risulterà maggiore di 1, ovvero $\varepsilon = (1 + \beta) > 1$. Ciò implica che un aumento del PIL reale pro capite provochi un aumento più che proporzionale nella spesa statale. Il test unilaterale è, quindi, utile sia per sottoporre a verifica la teoria implicita nella legge di Wagner, ovvero che statisticamente sia valida la condizione $\beta > 0$, sia per stabilire la forza della relazione dal punto di vista statistico quindi discriminare tra $\beta > 0$ e $\beta > 1$.

La Tabella 3.5 mostra che nel periodo 1862-1939 ci sono molte categorie di spesa (categorie economiche) per le quali la legge di Wagner risulta verificata con valori di β superiori a quelli riscontrati nel successivo periodo 1946-2009. Per questo secondo periodo, la legge di Wagner vale per la sola spesa in conto capitale. Nel periodo 1980-2009 per la spesa totale si stima addirittura un parametro β di lungo periodo negativo e statisticamente significativo, che implica una elasticità della spesa statale rispetto al PIL

¹¹ Ossia, è possibile sottoporre a verifica la visione wagneriana rispetto alla visione keynesiana della relazione tra spesa pubblica e PIL.

inferiore all'unità. In altre parole, in quegli anni la spesa totale crebbe meno che proporzionalmente rispetto al reddito.

Questo risultato appare in linea con quanto accaduto negli altri paesi sviluppati, dove la relazione tra crescita del reddito pro capite e crescita della spesa statale si è indebolita quando essi hanno raggiunto uno stadio di sviluppo più avanzato e livelli più elevati del reddito pro capite (Kuckuck 2014). Come si è visto nel Capitolo 1, la letteratura ha sottolineato che questo deriva probabilmente dal fatto che la domanda di beni pubblici la cui elasticità era molto elevata in corrispondenza e di livelli del reddito pro capite relativamente bassi anche se in forte crescita è diminuita man mano che il reddito disponibile è aumentato e si è indirizzato verso nuovi bisogni. Va inoltre osservato che lo stesso Wagner (1911) aveva rilevato che la sua “legge” operava nella misura in cui nella società esistevano «cultural and economic progress». È plausibile che i valori, la cultura e le attitudini presenti nella società nella seconda metà dell'ottocento e all'inizio del novecento vedessero con maggiore favore il soddisfacimento dei bisogni sociali (assistenza, sanità, istruzione) attraverso la gestione diretta di questi servizi da parte di agenzie statali. Di converso, negli anni più recenti, la crisi del keynesismo e del socialismo ed il riaffermarsi dell'economia neoclassica quale paradigma dominante nel pensiero economico, sembrano configurare un nuovo cambiamento culturale contraddistinto dall'affermarsi di attitudini critiche verso una presenza pervasiva dello Stato nell'economia e maggiormente favorevoli ad una privatizzazione della gestione dei servizi pubblici, in molti casi sotto il controllo di agenzie di vigilanza¹². Nella stessa direzione agì la spinta verso un alleggerimento della pressione fiscale dovuta al nuovo ambiente competitivo creatosi con la crescente globalizzazione dei mercati, dove i paesi con un elevato rapporto tra spesa statale e reddito si trovarono a fronteggiare la concorrenza sempre più agguerrita dei paesi emergenti che praticavano un trattamento fiscale molto più favorevole nei confronti delle imprese e degli investitori internazionali (Durevall e Henrekson 2011).

Il caso dell'Italia presenta alcuni tratti peculiari. Innanzitutto, l'evidenza molto forte in favore della legge di Wagner nel primo quarantennio post-unitario appare soprattutto come una conseguenza della costruzione stessa del nuovo Stato, che dovette sostenere spese ingenti per strutturarsi come

¹² Lo stesso Wagner (1911) osservò che «there not exist the same need for uniformity, concentration and centralization of the provision of services by public authorities; in this sphere partly the opposite is true. Here, other public bodies are providing services jointly with or instead of the state» (trad. in Biehl 1998: 108-109).

organizzazione con un proprio apparato amministrativo ramificato su tutto il territorio nazionale, per dotare la penisola di adeguate infrastrutture e perseguire una politica di potenza onde affermarsi nella geopolitica europea dell'epoca. Il caso dell'Italia sembra così riconducibile principalmente alla teoria dell'azione autonoma dello Stato, definita in base ad obiettivi di politica interna ed internazionale autonomamente concepiti dal decisore pubblico e non come risposta a presunte "logiche del capitalismo", alla domanda di particolari categorie di beni da parte dei cittadini o all'azione di *lobby* di particolari gruppi di interesse (Mann 1984). Questa circostanza sembra differenziare l'Italia dagli altri principali paesi europei, per i quali la letteratura ha legato l'aumento della spesa pubblica rispetto al reddito nelle fasi iniziali dell'industrializzazione all'allargamento del suffragio elettorale anche agli elettori a basso reddito, sino a giungere al suffragio universale. Questo spinse l'elettore mediano a preferire un innalzamento del prelievo fiscale – che avrebbe colpito principalmente le fasce dell'elettorato con un reddito più elevato del suo – per il reperimento di risorse che potessero essere utilizzate per finanziare nuovi programmi sociali a forte contenuto redistributivo (Meltzer e Richard 1981; Persson e Tabellini 1990; Lindert 1994)¹³. In Italia, invece, la legge di Wagner risulta verificata in presenza di un suffragio ristrettissimo, che, pari al 2% della popolazione nel 1861, fu esteso al 7% nel 1880, per rimanere su quel livello sino alla riforma elettorale del 1913, che lo portò al 23% (Ballini 1988), più di dieci anni dopo che l'evidenza a favore della legge di Wagner sia per la spesa totale che per la spesa corrente era venuta meno.

La perdurante validità della legge di Wagner per la spesa in conto capitale anche nel periodo 1946-2009 sembra, invece, coerente con un ruolo degli investimenti statali reso più incisivo dalla relativa debolezza della grande impresa privata e dall'esistenza in Italia, tra l'inizio degli anni trenta e l'inizio degli anni novanta del novecento, di un settore di proprietà statale dell'economia di dimensioni più ampie che negli altri paesi capitalistici dell'Occidente.

Nella Tabella 3.6 si mostrano i valori di β per le voci di spesa distinte per categorie funzionali. La relazione risulta statisticamente rilevante per tutte le voci di spesa nel periodo 1862-1939, mentre risulta verificata più

¹³ Inoltre, quello stesso periodo vide un forte rafforzamento della capacità fiscale (e, quindi, di spesa) degli stati, che si dotarono di un sistema tributario più moderno basato sull'imposta sul reddito e su quella sul valore aggiunto, i cui proventi soppiantarono progressivamente quelli derivanti dalle accise e dai diritti doganali (Tilly 1990; Besley, Ilzetzki e Persson 2013).

sporadicamente nel secondo dopoguerra. Inoltre, nel periodo 1862-1939 per molte categorie di spesa la legge di Wagner risulta verificata con valori di β superiori a quelli riscontrati nel periodo 1946-2009 come accadeva per la spesa definita per categorie economiche. Ad esempio, le spese per gli interventi in campo sociale hanno $\beta = 7,09$ nel periodo 1862-1939, che scende a 1,57 nel periodo 1946-2009, mentre le spese per l'istruzione nel primo periodo hanno $\beta = 3,24$, che perde totalmente di rilevanza nel periodo 1946-2009 passando a 0,22.

La caratteristica saliente di queste due voci di spesa – comune anche alla spesa in conto capitale – è la loro ridotta incidenza iniziale complessiva (poco più del 15%) sul totale della spesa statale. Proprio per questo non fu difficile aumentarle notevolmente (portandole al 40% dopo ottant'anni) corrispondendo così alle probabili domande dei cittadini. Va, inoltre, osservato, che la costruzione di un sistema scolastico nazionale e di un sistema di welfare pubblico (che assorbe gran parte delle spese per interventi in campo sociale) si configurarono come tratti della stessa politica di edificazione del nuovo Stato.

L'unica eccezione alla tendenza sopra descritta riguarda la spesa per gli interventi in campo economico, il cui β aumenta dal primo a secondo sotto-periodo, passando da un valore pari ad a 1,03 dal 1862 al 1939 ad uno pari a 1,08 dal 1946 al 2009. Anche questo risultato appare collegato all'elevata incidenza delle imprese a partecipazione statale per gran parte del secondo dopoguerra e, più in generale, alla rilevanza degli investimenti pubblici in un paese in cui il peso della grande impresa era sensibilmente inferiore agli altri maggiori paesi industrializzati¹⁴.

L'evidenza a favore della legge di Wagner della spesa pubblica disaggregata per categorie funzionali è, invece, meno robusta per gli anni successivi alla seconda guerra mondiale. Quattro delle cinque componenti della spesa disaggregate per categorie funzionali cointegrano col PIL, ma solo per sotto-periodi non omogenei.

L'unica componente per la quale questa relazione adesso non è mai verificata è la difesa nazionale, la cui quota sul PIL si riduce progressivamente con il venir meno del ruolo di potenza dell'Italia.

Le variabili con il comovimento temporale più lungo rispetto al PIL – che si estende dal 1957-60 al 1987-92 – sono le serie degli interventi in campo economico e degli interventi in campo sociale, ossia quelle voci che

¹⁴ Nel 2001 la quota degli addetti all'industria manifatturiera occupati nelle grandi imprese con più di 500 addetti era pari al 48,8% negli Stati Uniti, al 43,4% in Germania, al 36,3% in Francia, al 32,6% nel Regno Unito e ad appena il 16,4% in Italia (OECD 2005).

maggiormente riflettono le accresciute spese statali per la realizzazione di opere pubbliche, l'erogazione di sussidi alle imprese e la costruzione di un sistema di protezione sociale esteso ad una platea sempre più vasta di beneficiari.

Questi risultati sembrano riflettere il particolare percorso dell'Italia, che si dotò di un sistema di welfare universalistico solo nel 1978, molto in ritardo rispetto agli altri principali paesi europei (Kuckuck 2014), e il ruolo centrale svolto dall'impresa pubblica nell'economia nazionale. Le politiche di rientro della spesa statale adottate per ottenere l'ammissione alla moneta unica europea possono spiegare il venir meno del comovimento per alcune serie della spesa per categorie funzionali riscontrato a partire dagli anni novanta.

Da sottolineare è pure il valore di $\beta > 1$ per la spesa per gli interventi in campo sociale dal 1960 al 1992. Questo dato sembra conformarsi maggiormente alle ipotesi presentate in letteratura. Esso fa seguito – anche se con alcuni anni di ritardo – all'introduzione del suffragio universale in Italia nel 1946 e alla crescente domanda di welfare dei cittadini conseguente all'aumento del reddito disponibile negli anni del “miracolo economico” e alle lotte sociali degli anni sessanta e settanta. Sembra, tuttavia, che l'aumento della quota della spesa pubblica destinata al welfare rispetto al reddito sia legata non solo (e forse non in misura prevalente) all'allargamento del diritto di voto, quanto alla *voice* della società, ossia alla sua capacità di esprimere un'accresciuta domanda di welfare attraverso un accresciuto conflitto sociale.

Il risultato del massiccio investimento dell'Italia nel welfare e nella spesa sociale può essere bene esemplificato dall'andamento della speranza di vita alla nascita, l'indicatore usato dall'Organizzazione Mondiale della Sanità per misurare la longevità e che indica il numero di anni che un individuo può aspettarsi di vivere mediamente al momento della nascita. I dati diffusi nel 2010 collocavano l'Italia al quarto posto, alle spalle di Giappone, Svizzera e Australia, in una lista che contava oltre duecento paesi, con una vita media di 82 anni, rispetto ai 29 anni del 1861. Dopo centocinquante anni di storia unitaria, l'Italia, che partiva da condizioni sensibilmente più svantaggiate, aveva conseguito una speranza di vita più elevata di quella di molti altri paesi – come gli Stati Uniti, la Germania e la Svezia (il paese più generoso dal punto di vista dell'assistenza sanitaria) – che avevano un PIL pro capite più elevato. Il sorpasso avvenne tra gli anni sessanta e settanta del novecento, proprio quando più elevata fu domanda di welfare espressa dalla società attraverso un accresciuto conflitto sociale (Atella, Francisci e Vecchi 2011).

Tab. 3.5. Stima consistente della relazione di lungo periodo (DOLS) per le diverse voci di spesa – categorie economiche

Voci di spesa	Sottoperiodi	β^{dols}	Test unilaterale
1862-1939			
Spesa corrente	1862-1901	1,77*** (0,425)	$\beta > 1^{**}$
Spesa in conto capitale	1862-1939	1,85*** (0,366)	$\beta > 1^{***}$
Spesa totale	1862-1897	1,90*** (0,27)	$\beta > 1^{**}$
Spesa per il personale	1862-1939	0,49*** (0,157)	$\beta > 0^{***}$
Spesa per interessi	1862-1901	1,13** (0,474)	$\beta > 0^{***}$
1946-2009			
Spesa in conto capitale	1948-2009	0,253** (0,125)	$\beta > 0^{**}$
Spesa totale	1980-2009	-0.46** (0,17)	$\beta < 0^{**}$

Note: *** Livello di significatività al 1%; ** Livello di significatività al 5%; * Livello di significatività al 10% per entrambi i tipi di test. Quello che cambia sono i valori critici nei due casi (Stock e Watson 2012). s.e. HAC = errori standard robusti per l'eteroschedasticità e l'autocorrelazione dei residui.

Tab. 3.6. Stima consistente della relazione di lungo periodo (DOLS) per le diverse voci di spesa – categorie funzionali

Voci di spesa	Sottoperiodi	β^{dols}	Test unilaterale
1862-1939			
Difesa nazionale	1862-1913	0,904*** (0,330)	$\beta > 0$ ***
Giustizia e pubblica sicurezza	1862-1939	0,268 (0,203)	$\beta > 0$ *
Interventi in campo economico	1862-1939	1,03*** (0,268)	$\beta > 0$ ***
Interventi in campo sociale	1862-1939	7,09*** (0,522)	$\beta > 1$ ***
Istruzione e cultura	1862-1939	3,24*** (0,187)	$\beta > 1$ ***
1946-2009			
Giustizia e pubblica sicurezza	1980-2009	0,636*** (0,093)	$\beta > 0$ ***
Interventi in campo economico	1957-1987	1,08*** (0,157)	$\beta > 0$ ***
Interventi in campo sociale	1960-1992	1,57*** (0,163)	$\beta > 1$ ***
Istruzione e cultura	1980-2009	0,225** (0,09)	$\beta > 0$ ***

Note: *** Livello di significatività al 1%; ** Livello di significatività al 5%; * Livello di significatività al 10% per entrambi i tipi di test. Quello che cambia sono i valori critici nei due casi (Stock e Watson 2012). s.e. HAC = errori standard robusti per l'eteroschedasticità e l'autocorrelazione dei residui.

4. LA SPESA STATALE IN ISTRUZIONE

Questo paragrafo analizza l'evoluzione di lungo periodo della spesa statale in istruzione in Italia. La teoria economica dalla metà degli anni cinquanta (modello di crescita di Solow-Swan¹) ha mostrato che la crescita del lavoro e del capitale fisico è in grado di spiegare solo una parte della crescita osservata del PIL reale pro capite. La frazione non spiegata dalla crescita degli input produttivi (lavoro e capitale) prende il nome di “residuo” e rappresenta l'incremento della produttività totale dei fattori ed è spesso considerata come una misura del progresso tecnico. Negli anni successivi, la teoria economica si è concentrata nel trovare una spiegazione esogena per il progresso tecnico.

Questa interpretazione ha suggerito di considerare con più attenzione il concetto di capitale rilevante per la crescita economica, suddividendolo in due grandezze: capitale fisico e capitale umano. L'introduzione del capitale umano consente un'interessante interpretazione del progresso tecnologico: infatti se il residuo contiene anche il tasso al quale viene accumulato il capitale umano, quanto più grande è l'accumulazione di capitale umano tanto maggiore è il tasso di crescita dell'economia².

Il capitale umano è rappresentato dal patrimonio di conoscenze di cui si dispone, pertanto esso è dato dalla carriera scolastica, dall'addestramento e dall'esperienza professionale acquisita dagli individui³.

¹ Solow (1956) e Swan (1956).

² Per un approfondimento sulla rilevanza del capitale umano sulla crescita economica si vedano Barro e Sala-i-Martin (1995) e Hanushek e Woessmann (2010).

³ Sebbene istruzione e capitale umano siano strettamente correlati, essi non sono equivalenti: «l'istruzione permette l'accumulazione di capitale umano, ma quest'ultimo è anche fatto di

Da quanto detto, appare evidente che lo studio delle politiche e della spesa pubblica in istruzione risulta rilevante per analizzare il processo di formazione del capitale umano di un paese. Sin dall'Unità, l'offerta di un buon sistema scolastico fu percepita dalla classe dirigente italiana come uno dei compiti essenziali del nuovo Stato. Già al tempo era chiaro che l'istruzione poteva svolgere un duplice ruolo, sia nel formare lavoratori che partecipassero al processo di sviluppo economico, sia cittadini in modo da garantire una maggiore coesione sociale e politica⁴.

I paesi europei iniziarono a fornire gratuitamente l'istruzione primaria intorno alla metà del XIX secolo, sebbene in molti di questi la parte della popolazione che veramente frequentava tali scuole fosse molto minore di quella potenziale, e molti rimanevano analfabeti.

4.1. Il sistema scolastico italiano dall'Unità ai giorni nostri

Seguendo A' Hearn, Auria e Vecchi (2011) e Capelli (2017) si possono individuare tre fasi distinte nell'evoluzione dell'ordinamento scolastico italiano: il periodo liberale (1861-1922); il periodo fascista (1923-1945); il periodo repubblicano (dal 1946 fino ai nostri giorni).

La legge che regolamentava il sistema scolastico italiano al momento della sua nascita era la legge Casati del 1859 del Regno di Sardegna, estesa con l'unificazione a tutta l'Italia.

Questa legge prevedeva la gratuità dell'istruzione elementare suddivisa in due cicli biennali: uno inferiore ed uno superiore. Il ciclo inferiore obbligatorio iniziava a sei anni. Il costo dell'istruzione elementare era demandata ai comuni italiani; ogni comune avrebbe dovuto garantire la presenza di almeno un ciclo inferiore, mentre il ciclo superiore era limitato solo ai comuni con più alti tassi di urbanizzazione e a quelli dove erano presenti scuole d'istruzione secondaria. La legge prevedeva sanzioni penali per i genitori che non facevano frequentare ai propri figli il ciclo inferiore.

Terminata la scuola elementare, i ragazzi che decidevano di proseguire l'istruzione secondaria si trovano di fronte a due opzioni: scegliere l'istruzione secondaria classica che constava di un ginnasio di cinque anni a carico dei comuni, a cui faceva seguito il liceo di durata triennale, finanzia-

esperienze dirette – sul lavoro o in altri campi – che esulano da quello che si può apprendere a scuola o all'università» (Cappelli 2017: 78).

⁴ Nonostante l'obiettivo fosse chiaro, le susseguenti scelte legislative sembrarono in parte andare in controtendenza per raggiungerlo (Cappelli 2017).

riamente a carico dello Stato centrale, che permetteva l'accesso a tutte le facoltà universitarie o, in alternativa, l'istruzione secondaria tecnica organizzata in tre anni di scuola tecnica, il cui costo era a carico dei comuni, seguita dall'istituto tecnico, sempre di durata triennale, il cui costo era finanziato dallo Stato centrale. L'istituto tecnico permetteva l'accesso all'università per le sole facoltà scientifiche.

L'aver affidato ai comuni il compito della gestione della scuola primaria, sia in termini di finanziamento che di selezione del corpo docente, rappresentava il punto debole della legge Casati. Infatti, molti comuni erano privi di adeguate risorse finanziarie per ottemperare a tale compito, inoltre spesso venivano selezionati docenti con scarsa preparazione, che non disponevano neppure dell'abilitazione all'insegnamento primario.

Si aggiunga poi che, benché la legge minacciasse sanzioni a carico di coloro che trasgredissero l'obbligo scolastico, queste non furono mai esplicitate da un punto di vista legislativo, con la diretta conseguenza che l'obbligo fu ampiamente disatteso soprattutto nelle regioni meridionali, dove nel settore agricolo c'era una forte necessità di manodopera minorile.

Tutto questo rafforzò le disparità enormi nella qualità e nella esistenza stessa delle scuole primarie tra il Nord ed il Sud del paese. La scelta della Destra storica di affidare allo Stato centrale il solo compito dell'istruzione secondaria e terziaria al fine di preparare la futura classe dirigente del paese, non curandosi della scuola primaria, che nel XIX secolo rappresentava il pilastro per la formazione delle masse, fu una decisione in «controtendenza rispetto al crescente fabbisogno di capitale umano provocato dal diffondersi in Europa della Seconda Rivoluzione Industriale» (Cappelli 2017: 93-94).

Le indagini ministeriali sulla scuola primaria, effettuate tra il 1865 ed il 1922, evidenziarono la situazione disastrosa del sistema scolastico italiano, sia in termini di risultati che di finanziamenti. La risposta dei governi dell'età liberale fu una serie di interventi legislativi. Nel 1877, la legge Coppino aumentò a tre anni l'istruzione obbligatoria, con provvedimenti per farla rispettare e sanzioni pecuniarie per i genitori inadempienti, ed introdusse un curriculum di cinque anni per la scuola elementare (Bertola e Sestito 2013). Tuttavia, il finanziamento della scuola primaria fu lasciato ai comuni. Nel 1903 la legge Nasi istituì la figura del direttore didattico e ridusse la discrezionalità dei comuni in materia di assunzione e licenziamento dei maestri, disciplinò il numero massimo di alunni che componevano una classe, eliminò la disparità di genere tra lo stipendio delle maestre e quello dei maestri. La legge Orlando del 1904 portò l'obbligo scolastico al dodicesimo anno di età e creò la sesta elementare, che con la quinta elementare veniva a costituire il corso popolare. Inoltre, molto importante fu,

nel 1906, la promulgazione della legge speciale per il Mezzogiorno, che finanziava la costruzione di nuove scuole elementari nel Italia meridionale (A' Hearn, Auria e Vecchi 2011). Fu però la legge Daneo-Credaro del 1911 ad assegnare allo Stato l'onere dell'intero costo del personale e dei materiali per la scuola primaria, lasciando ai comuni il solo compito di fornire gli edifici scolastici; purtroppo la sua applicazione fu problematica anche per lo scoppio della prima guerra mondiale (Vasta 1999).

Con l'avvento al potere del partito fascista, il ministro della Pubblica Istruzione Giovanni Gentile nel 1923 varò una radicale riforma dell'ordinamento scolastico⁵. Venne istituita la scuola elementare a ciclo unico di cinque anni ed innalzato l'obbligo scolastico a 14 anni di età. Terminata l'istruzione primaria, lo studente poteva seguire quattro percorsi differenti per la scuola secondaria: il ginnasio di durata quinquennale seguito dal liceo classico di tre anni o liceo scientifico, di nuova creazione, di quattro anni, entrambi permettevano l'accesso all'Università; l'istituto tecnico, articolato in un corso inferiore, quadriennale, seguito dal corso superiore quadriennale; l'istituto magistrale, articolato in un corso inferiore quadriennale, ed in un corso superiore triennale, destinato alla formazione dei maestri elementari; infine, la scuola complementare di avviamento professionale, di durata triennale, al termine della quale non era possibile iscriversi ad alcuna altra scuola.

Con la riforma Gentile il ruolo dello Stato centrale venne messo al centro del sistema educativo, oltre che con il finanziamento statale, anche con un forte accentramento amministrativo e l'adozione di un programma comune ministeriale. Furono elevati i livelli qualitativi di tutti i percorsi di studio, non solo di quelli che permettevano l'accesso all'università, con esami di profitto durante il ciclo delle scuole elementari, della scuola secondaria inferiore e di quella superiore (Bertola e Sestito 2013).

Nel corso del tempo, divenuto il fascismo un regime totalitario, l'impianto scolastico gentiliano di stampo elitario risultò inadeguato rispetto alle esigenze del regime di una scuola di massa, che coinvolgesse anche i ceti meno abbienti, promuovendo la mobilità sociale. Questo portò alla carta della scuola del 1939 proposta dal ministro dell'Educazione Nazionale Giuseppe Bottai ed approvata dal Gran Consiglio del Fascismo. La riforma Bottai dava un forte impulso allo studio delle materie scientifiche e delle attività pratiche, ponendole sullo stesso piano delle materie umanistiche, al fine di supportare le esigenze dell'economia italiana. A causa dello scoppio

⁵ La riforma Gentile fu definita da Benito Mussolini, ex maestro elementare, «la più fascista delle riforme».

della seconda guerra mondiale la riforma rimase però lettera morta ad eccezione della creazione della scuola media inferiore, triennale, che unificava i corsi inferiori dei licei, degli istituti magistrali e tecnici, mentre continuava in alternativa alla scuola media il canale professionale, costituito dalla scuola di avviamento.

Terminata la guerra, l'istruzione divenne un diritto sancito dalla Costituzione Repubblicana del 1948⁶. Tuttavia, l'impianto scolastico rimaneva quello precedente: scuola elementare quinquennale ed i tre anni successivi o di scuola media, con lo studio del latino che permetteva di proseguire gli studi superiori, o di avviamento professionale, senza lo studio del latino, che non permetteva la prosecuzione degli studi superiori.

La prima riforma dell'ordinamento scolastico nell'Italia repubblicana fu attuata nel 1962 dal primo governo di centro-sinistra presieduto da Amintore Fanfani. La riforma stabiliva che tutte le scuole, dopo le elementari, venissero unificate in una sola⁷: la scuola media unica che permetteva l'accesso a tutte le scuole superiori. La riforma interveniva pure sulle materie di studio stabilendo che lo studio del latino diventasse del tutto facoltativo. Venivano introdotte le classi miste. Infine, le scuole private non ottenevano i finanziamenti dello Stato.

La nuova scuola media aprì le porte a tanti ragazzi figli di braccianti, operai, piccoli artigiani che fino a quel momento non erano andati oltre la quinta elementare o l'avviamento professionale. La riforma fece fare un grande salto alla società italiana (Rossi-Doria 2013).

Nel 1969, sulla spinta dei movimenti studenteschi dell'anno precedente, la legge Codignola introdusse la liberalizzazione degli accessi universitari e dei piani di studio, senza alcuna distinzione tra le tipologie di diploma⁸. Nacque in questo modo l'università di massa, fenomeno che interessò gran

⁶ In particolare, l'articolo 33 afferma che «l'arte e la scienza sono libere e libero ne è l'insegnamento. La Repubblica detta le norme generali sull'istruzione ed istituisce scuole statali per tutti gli ordini e gradi. Enti e privati hanno il diritto di istituire scuole ed istituti di educazione, senza oneri per lo Stato. La legge, nel fissare i diritti e gli obblighi delle scuole non statali che chiedono la parità, deve assicurare ad esse piena libertà e ai loro alunni un trattamento scolastico equipollente a quello degli alunni di scuole statali. [...]». Il successivo articolo 34 aggiunge che «la scuola è aperta a tutti. L'istruzione inferiore, impartita per almeno otto anni, è obbligatoria e gratuita. I capaci e meritevoli, anche se privi di mezzi, hanno diritto di raggiungere i gradi più alti degli studi. La Repubblica rende effettivo questo diritto con borse di studio, assegni alle famiglie ed altre provvidenze, che devono essere attribuite per concorso».

⁷ In tal modo, essa aboliva la scuola di avviamento.

⁸ Fino a quel momento l'accesso a tutte le facoltà universitarie era consentito solo agli studenti provenienti dai licei.

parte del mondo occidentale e che vide aumentare negli anni il numero degli studenti universitari.

Negli anni settanta intervennero altri provvedimenti, seppure di natura non organica, come l'introduzione della scuola a tempo pieno, degli insegnanti di sostegno per le classi che accolgono alunni portatori di handicap e degli organi collegiali, con la rappresentanza dei genitori, del personale non docente e degli studenti.

Negli anni ottanta la scuola elementare venne interessata da una riforma che ne modificò il percorso assegnando più insegnati ad ogni classe. Nel decennio successivo, i governi di centro-sinistra, con la riforma Berlinguer, attuarono una modifica in senso organico dell'ordinamento scolastico. Questa riforma si articolava in tre punti: 1) il riordino dei cicli: ad un primo ciclo primario che prevedeva l'accorpamento della scuola elementare e media seguiva un ciclo di scuola secondaria che prevedeva un biennio obbligatorio (con l'innalzamento dell'obbligo scolastico a 15 anni di età) ed un triennio che specificava l'indirizzo intrapreso dallo studente; 2) l'introduzione dell'autonomia scolastica, sia amministrativa che gestionale-didattica; 3) la selezione del corpo docente. Parallelamente venne modificato anche il percorso universitario con l'introduzione del modello del 3+2, che prevedeva una laurea triennale di primo livello seguita da una laurea specialistica biennale di secondo livello.

Il nuovo governo di centro-destra insediatosi nel 2001 modificò la riforma Berlinguer con l'abolizione dei cicli ed un ritorno ad un sistema duale caratterizzato dal primato dei licei sulle scuole tecniche. La successiva riforma Gelmini del 2008 modificò i metodi di valutazione degli studenti sia della scuola primaria che di quella secondaria e reintrodusse in parte il maestro unico nella scuola elementare.

Infine, la recente riforma del governo Renzi del 2015 – denominata “Buona scuola” – ha rafforzato l'autonomia scolastica aumentando i poteri del dirigente scolastico; al tempo stesso ha diminuito il monte ore per l'insegnamento delle materie generaliste e ha ampliato gli spazi per i percorsi di alternanza scuola-lavoro.

4.2. La spesa statale italiana in istruzione: un'analisi di lungo periodo

Alla nascita del Regno d'Italia soltanto il 27% della popolazione adulta del nuovo Stato sapeva leggere, un valore molto distante da quelli dei paesi più alfabetizzati del tempo – la Svezia e la Prussia, che avevano un tasso di

alfabetizzazione, rispettivamente, del 90 e dell'80% – ma anche di Inghilterra e la Francia, che si attestavano sul 65 e 55%. Inoltre, l'Italia mostrava enormi disparità territoriali, con il Piemonte e la Lombardia che avevano un tasso di alfabetismo di circa il 50%, a fronte di alcune regioni meridionali – come la Basilicata e la Calabria – dove esso era di poco superiore al 10% (A' Hearn, Auria e Vecchi 2011).

Nonostante che alla classe dirigente dell'epoca fosse chiara la necessità di colmare sia il divario con i paesi europei più avanzati, sia di eliminare il divario regionale esistente, questa esigenza non si tradusse in elevati investimenti pubblici immediati nel settore dell'istruzione. Infatti, nei primi dieci anni successivi all'unificazione (1862-72), la spesa pubblica in istruzione non superò mai l'1,8% delle spese totali, e si mantenne addirittura notevolmente al di sotto della Lista civile, che rappresentava le spese per il mantenimento della famiglia Reale addossate al bilancio pubblico (Tanzi 2012).

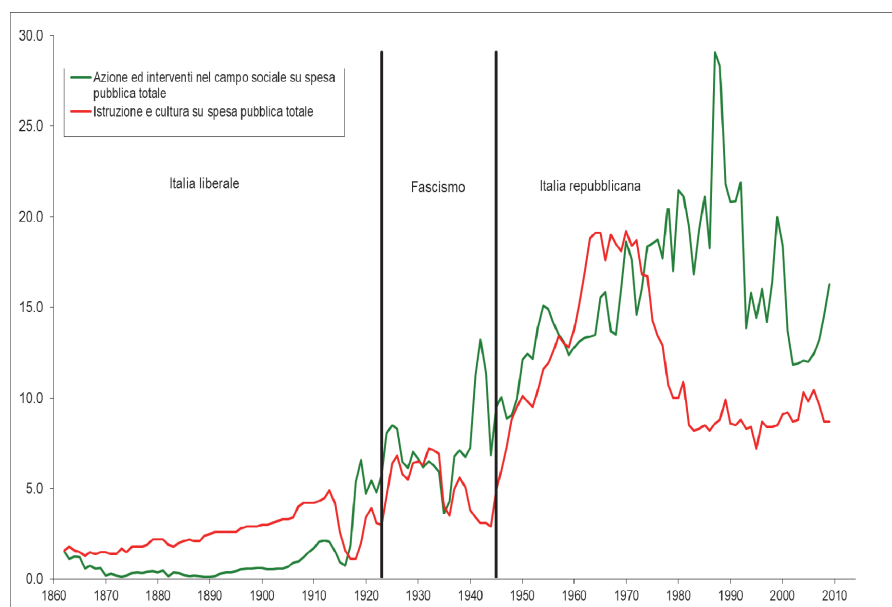
All'indomani dell'Unità nazionale i fondi destinati al pagamento degli interessi sul debito pubblico e per la difesa nazionale assorbivano una considerevole fetta della spesa complessiva. La spesa in istruzione insieme alla spesa sociale rappresentavano le due voci del bilancio più esigue, nel 1862 erano rispettivamente pari al 1,6 ed al 1,5% della spesa complessiva.

Visto lo stesso livello di partenza, appare utile un confronto tra l'andamento delle due categorie di spesa nel corso del centocinquantesimo post-unitario. Questo esercizio – riportato nella Figura 4.1 – rappresenta un modo, seppure parziale, di analizzare la distribuzione dei pesi tra giovani ed anziani nella società italiana e, quindi, una maniera di vedere quanto l'investimento in capitale umano sia stato un obiettivo perseguito dalle classi dirigenti italiane.

Durante il periodo dell'Italia liberale (1861-1922) la spesa per istruzione fu sempre al di sopra della spesa sociale, eccettuato l'ultimo quinquennio (1917-1922), ossia negli anni a cavallo della fine della prima guerra mondiale. Il tasso di crescita medio annuo composto della spesa in istruzione nei sei decenni dell'Italia liberale fu sempre positivo tranne nel primo e nell'ultimo decennio, quando si registrano valori negativi pari, rispettivamente, a -0,9 e -7,2%. Come si ricorderà, solo dal 1911 (legge Daneo-Credaro), la scuola elementare venne finanziata interamente dal governo centrale, mentre in precedenza essa era di competenza dei comuni.

Nel ventennio fascista (1923-1945) la spesa in istruzione risultò sempre inferiore alla spesa sociale, tranne nel periodo 1931-1935. Il tasso di crescita medio annuo composto della spesa in istruzione nel primo decennio del fascismo fu positivo e pari al 12,2%, mentre nel secondo decennio esso fu negativo e pari a -2,5%.

Fig. 4.1. Spesa in istruzione e cultura e spesa in campo sociale (quota della spesa statale totale)



Nel periodo repubblicano (dal 1946 ai giorni nostri) la spesa in istruzione è sempre stata al di sotto della spesa sociale, tranne nel periodo 1959-1973. La crescita della spesa in istruzione media annua composta decennale fu positiva fino alla fine degli anni sessanta, per poi diventare negativa nei tre decenni successivi, con valori pari a -5,8% tra il 1970 ed il 1979, a -0,1% tra il 1980 ed il 1989 e a -1,5% tra il 1990 e il 1999. Solo nel primo decennio del nuovo secolo si ebbe un'inversione di tendenza, con un incremento medio annuo pari allo 0,2% dal 2000 al 2009.

Se si considera invece il valore medio per l'intero periodo (1862-2009) la spesa in istruzione è inferiore alla spesa sociale, rispettivamente il 6,3% contro l'8,5%.

I dati esaminati sembrano far emergere un paese che ha finanziato il settore istruzione in maniera molto inferiore rispetto ad altre voci di spesa pubblica. In particolare, seppure condizionate dal trend demografico, non si può negare che le politiche di spesa attuate in Italia negli ultimi cinquant'anni abbiano privilegiato gli anziani, che hanno beneficiato di un'elevata spesa sociale, anziché i giovani, penalizzati da una bassa spesa in istruzione.

4.3. Un confronto europeo della spesa pubblica in istruzione

Un confronto con i principali paesi europei per quanto riguarda la spesa pubblica in istruzione in rapporto al PIL evidenzia risultati univoci per il nostro paese (Tabella 4.1.). Dal 1870 al primo decennio del XXI secolo, il finanziamento pubblico nel settore istruzione rispetto al PIL in Italia risulta sistematicamente inferiore ai maggiori paesi europei (Regno Unito, Germania e Francia) e alla media europea; solo la Spagna registra risultati peggiori.

Tab. 4.1. Spese delle amministrazioni pubbliche per l'istruzione in alcuni paesi europei (quota del PIL) (1870-2007)

Paesi	Intorno 1870	1913	1937	1960	1980	1993	2000	2007
Francia	0,3	1,5	1,3	2,4	5,0	5,8	6,0	5,6
Germania	2,3	2,7	...	2,9	4,7	4,8	4,4	4,5
Italia	0,1	0,6	1,6	3,6	4,4	5,2	4,5	4,3
Regno Unito	0,1	1,1	4,0	4,0	5,6	5,6	4,6	5,3
Spagna	...	0,4	1,6	1,3	2,6	4,7	4,3	4,3
Svezia	...	...	...	5,1	9,0	8,4	7,2	6,6

Fonti: Tanzi e Schuknecht (2007) e Eurostat, *Government finance statistics* (gennaio 2018).

La Figura 4.2 offre una prospettiva comparativa, per il periodo 1861-2001, sul rapporto fra il numero di alunni iscritti ed il personale insegnante per la scuola primaria, tra l'Italia e alcuni paesi dell'Europa occidentale.

Nel caso dell'Italia per i primi anni dopo l'Unità a ciascun maestro erano assegnati mediamente 36 bambini, fino a raggiungere un massimo di 47 bambini nel 1907. Si tratta di un valore che si riscontra in paesi che denotano condizioni di sottosviluppo; attualmente i paesi dell'Africa centrale mostrano valori simili. Il valore si mantiene alto e più o meno costante (circa 42 bambini) fino agli inizi della seconda guerra mondiale. Questo può essere dovuto al fatto che, una volta sostenuto il costo iniziale per strutturare il servizio scolastico, nel momento in cui incomincia a crescere il tasso di frequenza dei bambini alla scuola, il costo fisso iniziale di assunzione degli insegnanti sia stato distribuito su di una platea più ampia di alunni. È interessante notare, per lo stesso periodo, il caso diametralmente opposto del Regno Unito che, partito alla metà del XIX secolo con un rapporto alunni insegnanti altissimo, pari circa a 100, lo diminuì poi progressivamente sino a scendere a 27 bambini all'inizio della seconda guerra mondiale.

Fig. 4.2. Numero di alunni per insegnante in alcuni paesi europei (1861-2001)



Fonte: Mitchell (2007).

Altrettanto elevata per l'Italia fu la discesa del rapporto alunni insegnati dopo la seconda guerra mondiale. Questo indica che ci fu anche un aumento nella qualità del sistema scolastico italiano?

Seguendo A' Hearn, Auria e Vecchi (2011), sebbene questo indicatore può essere considerato sia come una misura dell'investimento di risorse in istruzione sia come un indicatore della qualità dell'istruzione, il caso dell'Italia sembra contraddire questa ultima interpretazione. I dati OCSE (2010) nel periodo 2007-2008 mostrano che l'Italia ha un numero di insegnanti superiore rispetto alla media dei paesi OCSE, sia per la scuola primaria che secondaria⁹, ciononostante i risultati degli studenti italiani risultano in generale peggiori rispetto a quelli dei loro colleghi europei, nelle valutazioni internazionali (Cipollone, Montanaro e Sestito 2012).

⁹ Il rapporto è 10,6 alunni per insegnante nella scuola elementare contro il 16,4 della media OCSE, mentre è 10,8 alunni per insegnante nella scuola secondaria contro il 16,4 media OCSE. A' Hearn, Auria e Vecchi (2011).

5. CONCLUSIONI

Il presente lavoro ha analizzato la legge di Wagner per l'Italia dal 1862 al 2009. Si è riscontrata un'evidenza molto forte in favore di detta legge negli anni immediatamente successivi all'Unità nazionale, dal 1862 alla fine del XIX secolo; qui la legge di Wagner risulta verificata sia per la spesa totale che per tutte le categorie di spesa, sia economiche che funzionali. Si tratta di un risultato in linea con quelli di altri paesi che pure riscontrano un'evidenza più forte a favore della legge di Wagner in corrispondenza delle fasi iniziali dell'industrializzazione. Il reddito nazionale, e quindi il processo di sviluppo, sembrano avere giocato in Italia un ruolo fondamentale nella costituzione di uno Stato centrale più evoluto e moderno.

Un'interpretazione che si può considerare per questo risultato è quella utilizzata da Douglass North per spiegare nello stesso periodo la crescita della spesa pubblica per gli USA, che connette la domanda di maggiore 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» (North 1985: 392).

Diversa è la situazione nel secondo dopoguerra. In questo periodo la legge di Wagner vale non più per la spesa statale totale. Essa vale, invece, per spe-

cifiche categorie di spesa del bilancio dello Stato: spesa in conto capitale, spesa per il personale, e spesa per la giustizia e la sicurezza interna. L'evidenza a favore della spesa in conto capitale sembra esprimere il ruolo centrale nel lungo periodo svolto dagli investimenti pubblici, reso più rilevante dalla relativa debolezza della grande impresa privata e dall'esistenza in Italia di un settore di proprietà statale dell'economia di dimensioni più ampie che negli altri paesi capitalistici dell'Occidente. La spesa per il personale riflette direttamente l'espansione dell'amministrazione statale. Giustizia e sicurezza interna sono servizi fondamentali richiesti allo Stato, la cui espansione è legata alla crescente domanda di regolazione e di tutela dell'applicazione dei contratti che si palesa man mano che la società diventa più complessa ed aumenta la divisione del lavoro (Kuznets 1967; North e Wallis 1982).

Nel secondo dopoguerra la legge di Wagner risulta poi verificata, tra la fine degli anni cinquanta all'inizio degli anni novanta, per la spesa per gli interventi in campo economico e per gli interventi in campo sociale.

Così, l'evidenza del secondo dopoguerra sembra riflettere un sostanziale cambiamento nella composizione della spesa pubblica. Infatti, a seguito della sconfitta nella seconda guerra mondiale, l'Italia non poté più perseguire una politica di potenza e dovette ridurre drasticamente le spese militari. Questa circostanza probabilmente spiega perché la legge di Wagner non sia verificata per la spesa totale. Di converso, crebbero le componenti economiche e sociali della spesa: infrastrutture, welfare e azione redistributrice. Sotto la pressione dell'allargamento del suffragio (nel 1946 fu introdotto nel paese il suffragio universale) e, a partire dalla fine degli anni sessanta, di un'ondata di lotte sociali senza precedenti, si ebbe in Italia l'edificazione di un sistema di welfare universalistico, con la progressiva estensione dell'intervento a nuove categorie sociali e il miglioramento dei trattamenti erogati. Di qui l'evidenza, per gran parte del periodo considerato, a favore della legge di Wagner nelle categorie della spesa per interventi in campo economico e sociale.

La legge di Wagner risulta invece non più verificata negli anni recenti. Dal 1980 al 2009 la spesa totale cresce addirittura meno che proporzionalmente rispetto al PIL. A partire dall'inizio degli anni novanta – il periodo del rientro dai disavanzi di bilancio nella prospettiva dell'adesione alla moneta unica europea – la legge di Wagner cessa di essere verificata anche per la spesa per interventi in campo economico e sociale. Continua, invece, ad essere verificata per la sola spesa in conto capitale.

In conclusione, questo lavoro evidenzia come, nel primo quarantennio post-unitario, l'evidenza a favore della legge di Wagner sia per la spesa totale che per tutte le categorie di spesa economiche e funzionali considerate può essere identificata come la conseguenza di un processo di crescita istituziona-

le, di formazione delle strutture statali necessarie al buon funzionamento di un paese. Diversamente, nel secondo dopoguerra si assiste ad una crescita della domanda di beni pubblici “superiori”, quali beni relativi al *welfare state*, da parte dei cittadini.

Nel lungo periodo, l'Italia sembra avere investito in maniera significativa nella realizzazione di infrastrutture, nell'allargamento dell'apparato statale, nella giustizia e sicurezza nazionale, di una ramificata rete di welfare (per le quali la legge di Wagner si applica per gran parte del centocinquantesimo post-unitario), ma meno in istruzione e cultura, dove l'evidenza a favore della legge di Wagner si ferma al 1939. Se da un lato questa configurazione della spesa è servita a rafforzare il ruolo dello Stato nella società italiana e ad accomodare una domanda crescente di protezione sociale da parte dei cittadini, dall'altro lato è dubbio che essa sia stata funzionale a promuovere al meglio la crescita economica. Infatti, è tema controverso che la spesa per il welfare abbia un effetto espansivo sull'economia (Atkinson 1995), mentre l'investimento in capitale umano è uno dei determinanti fondamentali della crescita economica (Visco 2014).

Alla luce dell'analisi condotta, si possono suggerire alcune implicazioni di politica economica. La spesa pubblica italiana sembra innanzitutto squilibrata. La spesa sociale (in particolare sanità e pensioni) è cresciuta enormemente sulla scia delle lotte sociali degli anni sessanta e settanta ed è molto alta in rapporto alla spesa per l'istruzione e la ricerca scientifica. Come risultato, se l'Italia ha superato quasi tutti i paesi con un PIL pro capite più alto del suo riguardo alla speranza di vita alla nascita, non è riuscita a colmare il gap nella dotazione di capitale umano, che permane significativo riguardo sia all'educazione secondaria che a quella terziaria (Sestito 2014).

Lo Stato italiano dovrebbe definire una strategia di investimenti pubblici finalizzata a rigenerare la capacità di crescita di lungo periodo del paese. Massicci investimenti in istruzione, ricerca e formazione del capitale umano, unitamente alla creazione di un “sistema di innovazione istituzionale” che promuova un più stretto collegamento tra la scienza e l'industria, dovrebbero avere un ruolo centrale in essa (Mazzucato 2013). Queste misure dovrebbero essere accompagnate dall'introduzione di una serie di incentivi premiali per il merito dei docenti e degli studenti, dall'affinamento di un sistema di valutazione e verifica continue dei risultati al quale legare l'allocazione dei finanziamenti, dall'adattamento dei curricula e dei percorsi formativi alle esigenze del mondo del lavoro (Visco 2014).

APPENDICE

A. Analisi di integrazione: i risultati dell'analisi di stazionarietà delle variabili

Per stimare qualunque relazione economica e valutarne la significatività è necessario porsi la questione se le variabili coinvolte nell'indagine siano o meno stazionarie. Per testare la non stazionarietà delle serie storiche oggetto si sono usati i seguenti test: ADF (OLS): test di non stazionarietà di Dickey-Fuller ottenuto con stimatore OLS, proposto da Dickey e Fuller (1979); ADF (GLS): test di non stazionarietà di Dickey-Fuller ottenuto con stimatore GLS, proposto da Elliot, Rothemberg e Stock (1996); KPSS: test di stazionarietà stimato OLS, dovuto a Kwiatkowski, Philips, Schimidt e Shin (1992). I risultati dei *test di integrazione* che sono stati condotti riguardano sia le variabili considerate nell'intero periodo 1862-2009 che nei due sotto-periodi 1862-1939 e 1946-2009. Essi confermano che i livelli delle variabili oggetto del nostri studio sono I(1)¹.

B. Analisi di cointegrazione

Una volta stabilito l'ordine di integrazione delle variabili si può procedere con l'analisi di cointegrazione. Con la cointegrazione si valuta se due serie storiche, benché singolarmente non stazionarie in varianza (mostrano una evoluzione stocastica e possibilmente deterministica che le contraddistingue) possono comuovere insieme nel lungo periodo.

Usando la procedura di cointegrazione a due stadi di Engle e Granger.

1. Si stima OLS la regressione di cointegrazione (con o senza trend deterministico T a seconda che siamo in un contesto di cointegrazione deterministica o stocastica):

$$\ln\left(\frac{G}{PIL}\right)_t = \alpha + \beta \ln\left(\frac{PIL_{reale}}{POP}\right)_t + \dots + u_t$$

¹ I risultati di questi test sono presentati in Pistoresi, Rinaldi e Salsano (2015: Appendice E).

2. Si verifica che i residui di cointegrazione u siano stazionari $I(0)$.

Se i residui della regressione sono stazionari si può affermare che c'è cointegrazione: esiste quindi una relazione di lungo periodo tra le due variabili che comuovono insieme in modo più o meno stretto a seconda del valore del coefficiente β .

Il risultato in favore della cointegrazione si ha quando si rigetta l'ipotesi nulla di residui di cointegrazione non stazionari, in particolare $I(1)$. Al riguardo viene presentato il p-value asintotico proposto da MacKinnon (1996). Si rigetta l'ipotesi nulla se il p-value è minore del valore a cui è fissato il livello di significatività del test. Ad esempio, se questo è del 5%, si rigetta l'ipotesi nulla di assenza di cointegrazione se il p-value $< 0,05$.

Tab. B.1. Analisi di cointegrazione di Engle e Granger (OLS): 1862-2009

Voci di spesa	Cointegr. stocastica	P-value	Cointegr. determin. con Dependency ratio	P-value
Categorie economiche della spesa statale				
Spesa corrente	No	0,21	No	0,21
Spesa in conto capitale	Sì	0,00	Sì	0,00
Spesa totale	No	0,30	No	0,28
Spesa per il personale	Sì	0,01	Sì	0,00
Spesa per interessi	No	0,76	No	0,88
Categorie funzionali della spesa statale				
Difesa nazionale	No	0,21	No	0,52
Giustizia e pubblica sicurezza	Sì	0,01	Sì	0,00
Interventi in campo economico	No	0,30	No	0,24
Interventi in campo sociale	No	0,13	No	0,85
Istruzione e cultura	No	0,64	No	0,76

Note: I pvalue per questo test si basano su MacKinnon (1996).

C. Cambiamenti strutturali

Nella tabella che segue si riportano i valori del test QLR (*Quant Likelihood Ratio*) per la ricerca di un break a data non nota. Il test conferma che il 1946 rappresenta un momento di svolta statisticamente significativo per la serie del PIL reale pro capite.

Tab. C.1. Test QLR per la verifica di un break a data ignota nella serie del PIL

AR(p)	Periodo	QLR Test	Break
AR(1)	1862-2009	$F(2, 143)=36,97^{***}$	1946
AR(2)	1862-2009	$F(3,140)=24,14^{***}$	1946
AR(4)	1862-2009	$F(5, 134)=20,67^{***}$	1946

Nota: *** livello di significatività all’1%; valore critico all’1% = 7.73. Questa statistica non segue la distribuzione F standard; i valori critici sono in Stock e Watson (2012).

Anche il test di Chow a data nota conferma che il 1946 è un break significativo nella serie del PIL reale pro capite, così come lo è per la spesa in conto capitale, per le spese per il personale e per giustizia e pubblica sicurezza (Tabella C.2).²

Tab. C.2. Test di Chow a data nota: 1946

Rappresentazione AR(1)	Periodo	QLR Test	Break esogeno
Spesa in conto capitale	1862-2009	$F(2, 143) = 6.41,$ $p\text{-value} = 0.0022$	Break: 1946
Spesa per il personale	1862-2009	$F(2,146) = 9.55,$ $p\text{-value} = 0.0001$	Break: 1946
Giustizia e pubblica sicurezza	1862-2009	$F(2, 146) = 4.38,$ $p\text{-value} = 0.014$	Break: 1946

Note: Questa statistica segue la distribuzione F standard i valori critici sono quelli usuali.

Questi risultati sono compatibili con l’assenza di cointegrazione sull’intero periodo per molte voci di spesa e il PIL, in altre parole con l’assenza l’assenza di un co-break nel 1946 (si veda la Tabella 3.2 nel testo).

² Si veda Stock e Watson (2012) per una descrizione di questi test.

D. Modelli ECM e analisi della causalità di Granger

L'esito di cointegrazione stabilisce che esiste un sentiero comune di crescita di lungo periodo in cui una variabile è endogena e l'altra è esogena. A fronte di shock esogeni che perturbano l'equilibrio di lungo periodo, è la variabile endogena ad aggiustarsi allo *steady state*. Il passo successivo è valutare quale delle due variabili sia endogena all'interno della relazione di lungo periodo che è stata trovata tra spesa pubblica e PIL. Questo equivale a stabilire la direzione di causalità, ovvero verificare se sia il PIL a causare “nel senso di Granger” la spesa pubblica o se non sia piuttosto la spesa pubblica a causare “nel senso di Granger” il PIL³.

Se esiste cointegrazione, solo uno dei due modelli ECM mostrati sotto dovrebbe emergere come preferito: il modello ECM in cui la spesa pubblica è la variabile endogena.

$$\Delta \ln \left(\frac{G}{PIL} \right)_t = \sum_{i=1}^m a_i \Delta \ln \left(\frac{G}{PIL} \right)_{t-i} + \sum_{j=1}^n b_j \Delta \ln \left(\frac{PIL_{reale}}{POP} \right)_{t-j} + \delta ECT_{t-1} + \varepsilon_t$$

$$\Delta \ln \left(\frac{PIL_{reale}}{POP} \right)_t = \sum_{i=1}^m a_i \Delta \ln \left(\frac{G}{PIL} \right)_{t-i} + \sum_{j=1}^n b_j \Delta \ln \left(\frac{PIL}{POP} \right)_{t-j} + \tilde{\delta} ECT_{t-1} + \eta_t$$

Nelle Tabelle D.1 e D.2 vengono riportati i risultati di *causalità unilaterale* per le voci di spesa (per categorie economiche e funzionali) e i periodi che hanno portato a risultati favorevoli alla cointegrazione⁴. Le due tabelle suggeriscono un risultato univoco: *causazione unidirezionale* dal PIL reale pro capite alle varie voci della spesa statale. Questo conferma che per i periodi in cui esiste un comovimento di lungo periodo delle variabili, la rappresentazione nella forma della legge di Wagner prevale sulla rappresentazione keynesiana della spesa pubblica come determinante della crescita economica.

³ Ossia, è possibile sottoporre a verifica la visione wagneriana verso la visione keynesiana della relazione tra spesa pubblica e PIL.

⁴ Per i dettagli dei test sui due termini *ECT* (*Error Correction Term*) che hanno portato alle conclusioni sulla causalità che si riportano di seguito, si rimanda a Pistoresi, Rinaldi e Salsano (2015: Appendice F).

Tab. D.1. Causalità di Granger per voci di spesa - categorie economiche

Periodo rilevante	Voci di spesa	Direz. causalità unilaterale
1862-1939		
1864-1901	Spesa corrente	PIL → G
1864-1939	Spesa in conto capitale	PIL → G
1864-1897	Spesa totale	PIL → G
1864-1939	Spesa per il personale	PIL → G
1948-2009		
1949-2009	Spesa in conto capitale	PIL → G
1981-2009	Spesa totale	PIL → G

Tab. D.2. Causalità di Granger per le diverse voci di spesa – categorie funzionali

Periodo rilevante	Voci di spesa	Direz. causalità unilaterale
1862-1939		
1862-1913	Difesa nazionale	PIL → G
1862-1939	Giustizia e pubblica sicurezza	PIL → G
1862-1939	Interventi in campo economico	PIL → G
1862-1939	Interventi in campo sociale	PIL → G
1862-1939	Istruzione e cultura	PIL → G
1948-2009		
1980-2009	Giustizia e pubblica sicurezza	PIL → G
1957-1987	Interventi in campo economico	PIL → G
1960-1992	Interventi in campo sociale	PIL → G
1980-2009	Istruzione e cultura	PIL → G

E. Stima della relazione di lungo periodo: DOLS

Si supponga di aver verificato la direzione di causalità e che emerga l'esistenza di uno *steady state* in cui la spesa pubblica si aggiusta al PIL, come ipotizzato dalla legge di Wagner. Occorre, a questo punto, valutare l'entità del legame di lungo periodo tra le due variabili. Si noti che non è possibile fare inferenza sul parametro β della regressione di cointegrazione stimata OLS con la procedura di Engle e Granger. Questo stimatore, infatti, è consistente, ma in genere ha una distribuzione non normale e l'inferenza basata sulla statistica t può portare a risultati erronei indipendentemente dall'utilizzo o meno di errori standard HAC (Heteroskedasticity and

Autocorrelation Error). Per questo motivo si utilizza, in alternativa, lo stimatore OLS dinamico (DOLS, *Dynamic Ordinary Least Squared*), dovuto a Stock e Watson (1993). Lo stimatore DOLS si basa su una versione modificata della regressione di cointegrazione (1); essa include valori passati, presenti e futuri della variazione di $\ln(PIL_{reale}/POP)$ come segue:

$$\ln\left(\frac{G}{PIL}\right)_t = \alpha + \beta \ln\left(\frac{PIL}{POP}\right)_t + \sum_{j=-p}^p \kappa \Delta\left(\frac{PIL_{reale}}{POP}\right)_{t-j} + u_t$$

Se il campione è ampio, allora lo stimatore DOLS è efficiente e l'inferenza sul parametro di interesse β basata su errori standard HAC è valida⁵. Usando DOLS verrà, quindi, stimata l'entità della relazione tra spesa pubblica e PIL su cui sarà possibile fare inferenza statistica stabilendo se, come previsto dalla legge di Wagner, si ha $\beta > 0$ o, in alcuni periodi, addirittura $\beta > 1$.

⁵ Ad esempio, la statistica t costruita usando lo stimatore DOLS ha una distribuzione normale per grandi campioni.

BIBLIOGRAFIA

- Acemouglu D. e Robinson J. (2013), *Perché le nazioni falliscono*, Il Saggiatore, Milano.
- Afxentiou P. (1980), "Government revenue and expenditure and developing countries: A Survey", *The Developing Economies*, XVIII(1), pp. 116-139.
- A'Hearn B., Auria C. e Vecchi G. (2011), "Istruzione", in Vecchi G. (a cura di), *In ricchezza e in povertà. Il benessere degli italiani dall'Unità ed oggi*, Il Mulino, Bologna, pp. 159-206.
- Alesina A. e Ardagna S. (2010), "Large Changes in Fiscal Policy: Taxes versus Spending", in Brown J.R. (a cura di), *Tax Policy and the Economy*, XXIV(1), pp. 35-68.
- Alesina A., Favero C. e Giavazzi F. (2015), "The Output Effect of Fiscal Consolidation Plans", *Journal of International Economics*, XCVI, pp. S19-S42.
- Amatori F. (1997), "L'Italia. Il tormentato sviluppo delle capacità organizzative tra Stato e famiglie", in C
- Chandler, Jr., A.D., Amatori F. e Hikino T. (a cura di), *Grande impresa e ricchezza delle nazioni 1880-1990*, Il Mulino, Bologna, pp. 341-375.
- Amatori F. (2000), "Beyond State and Market: Italy's Futile Search for a Third Way", in Toninelli P.A. (a cura di), *The Rise and Fall of State-Owned Enterprises in the Western World*, Cambridge University Press, Cambridge, pp. 128-156.
- Amatori F. e Colli A. (1999), *Impresa e industria in Italia dall'Unità a oggi*, Marsilio, Venezia.
- Amendola N., Brandolini A. e Vecchi, G. (2011), "Disuguaglianza", in Vecchi G. (a cura di), *In ricchezza e in povertà. Il benessere degli italiani dall'Unità ed oggi*, Il Mulino, Bologna, pp. 235-269.
- Amendola N., Salsano F. e Vecchi, G. (2011), "Povertà", in Vecchi G. (a cura di), *In ricchezza e in povertà. Il benessere degli italiani dall'Unità ed oggi*, Il Mulino, Bologna, pp. 271-317.

- Atella V., Francisci S. e Vecchi G. (2011), “Salute”, in Vecchi G. (a cura di), *In ricchezza e in povertà. Il benessere degli italiani dall'Unità ed oggi*, Il Mulino, Bologna, pp. 73-129.
- Atkinson A.B., “Is the welfare state necessarily an obstacle to economic growth?”, *European Economic Review*, XXXIX(3-4), pp. 723-730.
- Atkinson A.B. e Stiglitz J.E. (1980), *Lectures on public economics*, McGraw-Hill, New York.
- Baffigi A. (2011), “Italian national accounts, 1861-2011”, Quaderni di Storia Economica. Economic History Working Papers n. 18, Banca d'Italia, Roma.
- Ballini P.L. (1988), *Le elezioni nella storia d'Italia dall'Unità al fascismo. Profilo storico-statistico*, Il Mulino, Bologna.
- Barro R. e Sala-i-Martin X. (1995), *Economic Growth*, 1st ed., McGraw-Hill, New York.
- Battilani P. e Fauri F. (2008), *Mezzo secolo di economia italiana. 1945-2008*, Il Mulino, Bologna.
- Battilossi S. (1998), *Storia economica d'Italia*, Vol. 2: *Annali*, Laterza, Roma-Bari.
- Bergh A. e Karlson M. (2010), “Government size and growth: accounting for economic freedom and globalization”, *Public Choice*, CXXXII(1-2), pp. 195-213.
- Bertola G. e Sestito P. (2013), “Il capitale umano”, in Toniolo G. (a cura di), *L'Italia e l'economia mondiale. Dall'Unità a oggi*, Marsilio, Venezia, pp. 343-374.
- Besley T. e Persson T. (2009), “The origins of state capacity: Property rights, taxation, and policy”, *American Economic Review*, IC(4), 1218-1244.
- Besley T. e Persson T. (2013), “Taxation and Development”, in Auerbach A., Chetty R., Feldstein M. e Saez E. (a cura di), *Handbook of Public Economics*, vol. 5, Elsevier, Amsterdam, pp. 51-110.
- Besley T., Ilzetzki E., e Persson T. (2013), “Weak states and steady states: The dynamics of fiscal capacity”, *American Economic Journal: Macroeconomics*, V(4), pp. 205-235.
- Bianchi P. (2002), *La rincorsa frenata. L'industria italiana dall'unità nazionale all'unificazione europea*, Il Mulino, Bologna.
- Bird R. (1970), “The Growth of Government Spending in Canada”, Canadian Tax Papers No. 51, Canadian Tax Foundation, Toronto.
- Bonelli F. (1978), “Il capitalismo italiano. Linee generali di interpretazione”, in Romano R. e Vivanti C. (a cura di), *Storia d'Italia. Annali I: Dal feudalesimo al capitalismo*, Einaudi, Torino, pp. 1195-1255.
- Brosio G. e Marchese C. (1986), *Il potere di spendere: economia e storia della spesa pubblica dall'unificazione ad oggi*, Il Mulino, Bologna.
- Buchanan J.M. e Wagner R.E. (1978), “The political biases of Keynesian economics”, in Tullock G. (a cura di), *Fiscal Responsibility in Constitutional Democracy*, Martinus Nijhoff, Leiden and Boston, pp. 79-117.
- Caldwell J.C. (1976), “A restatement of demographic transition theory”, *Population and Development Review*, II(3/4), pp. 321-366.

- Cappelli G. (2017), “Capitale umano e crescita economica: l’evoluzione del sistema educativo italiano”, in Di Martino P. e Vasta M. (a cura di), *Ricchi per caso. La parabola dello sviluppo economico italiano*, Bologna, il Mulino, pp. 75-127.
- Castellino O. (1976), *Il labirinto delle pensioni*, Il Mulino, Bologna.
- Castronovo V. (1995), *Storia economica d’Italia. Dall’Ottocento ai giorni nostri*, Einaudi, Torino.
- Cianci E. (1977), *Nascita dello Stato Imprenditore in Italia*, Mursia, Milano.
- Ciocca P. (2007), *Ricchi per sempre? Una storia economica d’Italia (1796-2005)*, Bollati Boringhieri, Torino.
- Cipollone P., Montanaro P. e Sestito P. (2012), “Il capitale umano nella crescita economica: possibili percorsi per il miglioramento del sistema d’istruzione in Italia”, *Questioni di Economia e Finanza (Occasional Papers)* n. 122, Banca d’Italia, Roma.
- Cohen J. e Federico G. (2001), *Lo sviluppo economico italiano. 1820-1960*, Il Mulino, Bologna.
- De Cecco, M. (2003), “L’Italia grande potenza: la realtà del mito”, in Ciocca P. e Toniolo G. (a cura di), *Storia economica d’Italia*, vol. 3: *Industrie, mercati, istituzioni*, t. 2: *I vincoli e le opportunità*, Laterza, Roma-Bari, pp. 3-36.
- Dickey D.A. e Fuller W.A. (1979), “Distribution of the Estimators for Autoregressive Series with Unit Root”, *Journal of the American Statistical Association*, LXXIV(366), pp. 427-431.
- Durevall D. e Henrekson M. (2011), “The futile quest for a grand explanation of long-run government expenditure”, *Journal of Public Economics*, XCV(7-8), pp. 708-722.
- Duesenberry, J.S. (1949), *Income, Saving and the Theory of Consumer Behaviour*, Harvard University Press, Cambridge, MA.
- Elliott G., Rothenberg T.J. e Stock J. H. (1996), “Efficient tests for an autoregressive unit root”, *Econometrica*, LXIV(4), pp. 813-836.
- Federico G. (1999), “Harmful or Irrelevant? Italian Industrial Policy, 1945-1973”, in Miyajima H., Kikkawa T. e Hikino T. (a cura di), *Policies for Competitiveness. Comparing Business-Government Relationships in the ‘Golden Age of Capitalism’*, Oxford University Press, Oxford, pp. 309-335.
- Felice E. (2015), *Ascesa e declino. Storia economica d’Italia*, Il Mulino, Bologna.
- Francese M. e Pace A. (2008), “Il debito pubblico italiano dall’Unità a oggi. Una ricostruzione della serie storica”, *Questioni di Economia e Finanza (Occasional Papers)* No. 31, Banca d’Italia, Roma.
- Franco D. (1993), *L’espansione della spesa pubblica in Italia. Un’analisi rigorosa e sistematica dello sviluppo della spesa pubblica in Italia dal 1960 al 1990, nelle sue interne articolazioni*, Il Mulino, Bologna.
- Gerschenkron A. (1962), *Economic Backwardness in Historical Perspective: A Book of Essays*, Boston, Harvard University Press.
- Giannetti R. e Vasta M. (2005), *Storia dell’impresa industriale italiana*, Il Mulino, Bologna.

- Ginsborg P. (1989), *Storia d'Italia dal dopoguerra a oggi. Società e politica 1943-1988*, Einaudi, Torino.
- Goffman I.J. (1968), "On the empirical testing of Wagner's Law: a technical note", *Public Finance*, XXIII (3), pp. 359-364.
- Granger C.W.J. (1986), "Developments in the Study of Cointegrated Economic Variables", *Oxford Bulletin of Economics and Statistics*, XLVIII (3), pp. 213-228.
- Gualerni G. (1994), *Storia dell'Italia industriale. Dall'Unità alla Seconda Repubblica*, Etas Libri, Milano.
- Gupta S.P. (1961), "Public expenditure and economic growth: a time series analysis" *Public Finance*, II, pp. 423-66.
- Hanuschek E.A. e Woessmann L. (2010), "Education and economic growth", in Peterson P. (a cura di), *International Encyclopedia of Education*, Elsevier, Oxford, pp. 245-252.
- Istat (2011), *9° Censimento industria, servizi e istituzioni non profit*, Istat, Roma.
- Istat (2012), "Ricostruzione della popolazione residente e del bilancio demografico" (https://www.seriestoriche.istat.it/Tavola_2.3.1.xls).
- Kolluri B.R., Panik M.J. e Wahab M.S. (2000), "Government expenditure and economic growth: evidence from G7 countries", *Applied Economics*, XXXII(8), pp. 1059-1068.
- Kuckuck J. (2014), "Testing Wagner's Law at Different Stages of Economic Development", *FinanzArchiv / Public Finance Analysis*, LXX (1), pp. 128-168.
- Kuznets S.S. (1967), *Modern Economic Growth*, Yale University Press, New Haven.
- Kwiatkowski D., Phillips P.C.B., Schmidt P. e Shin Y. (1992), "Testing the null hypothesis of stationarity against the alternative of a unit root: How sure are we that economic time series have a unit root?", *Journal of Econometrics*, LIV (1-3), pp. 159-178.
- Levi M. (1988), *Of Rule and Revenue*, University of California Press, Berkeley, CA.
- Lindert P.H. (1994), "The rise of social spending, 1880-1930", *Explorations in Economic History*, XXXIII (1), pp. 1-34.
- Lindert P.H. (1996), "What limits social spending?", *Explorations in Economic History*, XXXV (1), pp. 1-34.
- Lindert P.H. (2004a), *Growing Public: Volume 1, The Story: Social Spending and Economic Growth since the Eighteenth Century*. Cambridge University Press, Cambridge and New York.
- Lindert P.H. (2004b), *Growing public: Volume 2, Further evidence: Social Spending and Economic Growth since the Eighteens century*, Cambridge University Press, Cambridge and New York.
- MacKinnon J.G. (1996), "Numerical distribution functions for unit root and cointegration tests", *Journal of Applied Econometrics*, XI (6), pp. 601-618.
- Magazzino C. (2012a), "Wagner's Law and augmented Wagner's Law in EU-27. A time series analysis on stationarity, cointegration and causality", *International Research Journal of Finance and Economics*, VII (89), pp. 205-220.

- Magazzino C. (2012b), “Wagner versus Keynes: public spending and national income in Italy”, *Journal of policy modeling*, XXXIV (6), pp. 890-905.
- Mann A.S. (1980), “Wagner’s Law: an econometric test for Mexico”, *National Tax Journal*, XXXIII (2), pp. 189-201.
- Mann M. (1984), “The autonomous power of the state: its sources, mechanisms and results”, *European Journal of Sociology*, XXV (2), pp. 18-213.
- Mastromatteo G. (1984), “La “legge di Wagner” e i determinanti della crescita della spesa pubblica”, *Rivista di Diritto Finanziario e Scienza delle Finanze*, XLIII (1), pp. 54-77.
- Mazzucato M. (2013), *Lo Stato innovatore*, Laterza, Roma-Bari.
- Meltzer A.H. e Richard S.F. (1981), “A rational theory of the size of the government”, *Journal of Political Economy*, LXXXIX(5), pp. 914-927.
- Meltzer A.H. e Richard S.F. (1983), “Tests of a rational theory of the size of government”, *Public Choice*, XLI (3), pp. 403-418.
- Michas N. (1975), “Wagner’s Law of public expenditure studies”, *FinanzArchiv / Public Finance Analysis*, XXXII, pp. 295-304.
- Mitchell B.R. (2007), *International Historical Statistics 1750-2005: Europe*, Palgrave Macmillan, London.
- Musgrave R.A. (1969), *Fiscal Systems*, Yale University Press, New Haven and London.
- Niskanen W.A. (1975), “Bureaucrats and Politicians”, *Journal of Law and Economics*, XVIII (3), pp. 617-643.
- North D.C. (1985), “The growth of government in the United States: An economic historian’s perspective”, *Journal of Public Economics*, XXVIII, pp. 383-399.
- North D.C. e Wallis J.J. (1982), “American government expenditures: a historical perspective”, *American Economic Review*, LXXII (2), pp. 336-340.
- OECD (2005), *SME and Entrepreneurship Outlook*, Oecd, Paris.
- Paparas D., Richter C. e Avloniti, A. (2012), “The validity of Wagner’s Law in United Kingdom for the period 1850-2010”, Working Paper, International Network for economic Research, Bonn.
- Paparas D. e Richter C. (2013), “The validity of Wagner’s Law in Greece during the last two centuries”, *Applied Economics Quarterly*, ILX (4), pp. 331-360.
- Peacock A.T. e Wiseman, I. (1961), *The growth of public expenditure in the United Kingdom*, Princeton University Press, Princeton.
- Pennacchi L. (1997), *Lo stato sociale del futuro. Pensioni, equità, cittadinanza*, Donzelli, Roma.
- Persson T. e Tabellini G. (1990), *Macroeconomics Policy, Credibility and Politics*, London, Harwood Academic.
- Pistoresi B., Rinaldi A. e Salsano F., “La spesa pubblica in Italia: una crescita senza limiti?”, DEMB Working Papers Series n. 59, Dipartimento di Economia “Marco Biagi”, Università di Modena e Reggio Emilia, Luglio 2015 (www.merlino.unimo.it/campusone/web_dep/wpdemb/0059.pdf);
- Pryor F.L. (1968), *Public expenditures in communist and capitalist nations*, George Allen and Unwin, London.

- Ragioneria Generale dello Stato (RGS) (2011), *La spesa dello Stato dall'Unità d'Italia. Anni 1862-2009*, Ragioneria Generale dello Stato, Roma.
- Ram R. (1987), "Wagner's hypothesis in time series and cross section perspectives: evidence from real data for 115 countries", *The Review of Economics and Statistics*, LXIX (2), pp. 194-204.
- Ranci P. (1987), "Italy the Weak State", in Duchene F. e Shepherd G. (a cura di), *Managing Industrial Change in Western Europe*, Pinter, London, pp. 110-143.
- R&S (2001), *Le privatizzazioni in Italia dal 1992*, Studio predisposto ai fini dell'indagine conoscitiva sulla competitività del sistema paese di fronte alle sfide della moneta unica e della globalizzazione dell'economia condotta dalla Commissione bilancio della Camera dei Deputati, Camera dei Deputati, Roma.
- Rossi-Doria M. (2013), "La scuola media unica mise in moto l'Italia", Marcorossidoria.blogspot.
- Schram A. (1997), *Railways and the formation of the Italian State in the Nineteenth Century*, Cambridge University Press, Cambridge.
- Sestito P. (2014), *La scuola imperfetta*, Il Mulino, Bologna.
- Shelton C.A. (2007), "The size and composition of government expenditure", *Journal of Public Economics*, CMLXXXI (11-12), pp. 2230-2260.
- Sinn H.W. (1998), "European integration and the future of the welfare state", *Swedish Economic Policy Review*, V (1), pp. 113-132.
- Solow R. (1956) "A contribution to the theory of economic growth", *The Quarterly Journal of Economics*, LXX (1), pp. 65-94.
- Spadavecchia A. (2003), *State subsidies and the sources of company finance in Italian industrial districts 1951-1991*, Unpublished PhD thesis, LSE, London.
- Stock J.H. e Watson M.W. (1993), "A simple estimator of cointegrating vectors in higher-order integrated system", *Econometrica* LXI (4), pp. 783-820.
- Stock, J.H. e Watson M.W. (2012), *Introduction to Econometrics*, Pearson, New York.
- Swan T. (1956), "Economic Growth and Capital Accumulation", *The Economic Record*, XXXII (2), pp. 334-361.
- Tanzi V. (2012), *Centocinquant'anni di Finanza Pubblica in Italia*, Torino: Istituto Bruno Leoni Libri, Torino.
- Tanzi V. e Schuknecht L. (2007), *La spesa pubblica nel XX secolo. Una prospettiva globale*, Firenze University Press, Firenze.
- Tilly C. (1990), *Coercion, Capital and European States, AD 990-1992*, Cambridge, MA, Blackwells.
- Toninelli, P.A. (2004), "Between State and Market. The Parabola of Italian Public Enterprise in the 20th Century", *Entreprises et histoire* 37, 53-74.
- Toninelli P.A. e Vasta M. (2010), "State-owned enterprises (1936-1983)", in Colli A. e Vasta M. (a cura di), *Forms of Enterprises in 20th Century Italy. Boundaries, Structures and Strategies*, Edward Elgar, Cheltenham, UK-Northampton, MA, pp. 52-86.

- Wagner A. (1883), *Finanzwissenschaft*, 3a edizione, Leipzig. Partly reprinted in *Classics in the Theory of Public Finance*, a cura di R.A. Musgrave and A.T. Peacock (1958), Macmillan, London.
- Wagner A. (1911), “Der Staat in Nationalökonomischer Hinsicht”, in Conrad J., Ester L, Lexis, W. e Loenig E. (a cura di), *Handwörterbuch der Staatswissenschaften*, 3a edizione completamente rivista, vol. 7, Jena.
- Vasta M. (1999), “Capitale umano e ricerca scientifica e tecnologica”, in Amatori F., Bigazzi D., Giannetti R. e Segreto L. (a cura di), *Storia d'Italia. Annali 15. L'industria*, Einaudi, Torino, pp. 1041-1124.
- Zamagni V. (1987), “A century of change: Trends in the composition of the Italian labour force, 1881-1981”, *Historical Social Research*, XII, pp. 36-97.
- Zamagni V. (1990), *Dalla periferia al centro. La seconda rinascita economica dell'Italia / 1861-1981*, Il Mulino, Bologna.
- Zamagni, V. (2012), “Il ruolo dello Stato”, *Rivista di storia economica*, n.s., XXVIII (1), pp. 85-99.

Nell'ultimo decennio, nei paesi occidentali la sostenibilità dei debiti sovrani dovuta alla dimensione ed al finanziamento dei disavanzi pubblici ha posto al centro del dibattito politico-economico il livello e la crescita della spesa pubblica. È così ritornata di attualità la legge di Wagner, che prende il nome dallo studioso tedesco Adolf Wagner, il quale, alla fine dell'ottocento, aveva individuato una regolarità empirica, secondo cui, con lo sviluppo economico, aumenta la quota della spesa pubblica sul reddito nazionale. Questo volume analizza l'evoluzione della spesa pubblica e sottopone a verifica la legge di Wagner in Italia lungo l'intera storia post-unitaria. Si trova un'evidenza molto forte in favore di detta legge dall'Unità nazionale alla fine del XIX secolo, quando essa è verificata sia per la spesa totale che per tutte le singole categorie di spesa. Diversa è la situazione nel secondo dopoguerra, quando la legge di Wagner vale non più per la spesa totale, ma solo per sue alcune categorie: infrastrutture, welfare e azione redistributrice, ma non per la spesa in istruzione. Così, se da un lato questa configurazione della spesa è servita a rafforzare il ruolo dello Stato nella società italiana e ad accomodare una domanda crescente di protezione sociale da parte dei cittadini, dall'altro lato è dubbio che essa sia stata funzionale a promuovere al meglio la crescita economica.

Barbara Pistoresi è professore associato di Economia politica all'Università di Modena e Reggio Emilia. Ha pubblicato su riviste internazionali quali *Economic Modelling*, *Explorations in Economic History*, *International Journal of Economics and Finance* e *Journal of Policy Modeling*.

Alberto Rinaldi è professore associato di Storia economica all'Università di Modena e Reggio Emilia. Ha pubblicato su riviste internazionali quali *Business History*, *Cliometrica*, *Explorations in Economic History* e *Journal of Policy Modeling*.

Francesco Salsano è ricercatore confermato di Economia politica all'Università di Milano. Ha pubblicato su riviste internazionali quali *Applied Economics Letters*, *International Journal of Finance & Economics*, *International Review of Economics* e *Journal of Policy Modeling*.