

Walther Otremba, Berend Diekmann

Was erwartet die Politik von den Ökonomen?

Mit ungewohnter Heftigkeit wird zur Zeit in Deutschland um die Ausrichtung der Volkswirtschaftslehre an den Universitäten gerungen. Die Verteidiger der traditionellen Lehre von der Wirtschaftspolitik an den deutschen Universitäten befürchten, dass die Ordnungspolitik durch mathematische Methoden abgelöst wird. Die interdisziplinären Bezüge etwa der ordoliberalen Freiburger Schule zur Rechtswissenschaft und zur praktischen Philosophie würden durch interdisziplinäre Bezüge zur Mathematik und zur angewandten Statistik ersetzt. Die Verfeinerung des mathematischen Instrumentariums würde in der Wirtschaftswissenschaft immer mehr zum Selbstzweck. Die Wirtschaftswissenschaften würden zu einer Art sozialer Physik weiterentwickelt. In anderen Worten: Eine Verdrängung von Adam Smith durch Adam Riese mit sehr nachteiligen Konsequenzen. Hieraus resultiert die Forderung, aus der Formelwelt in die reale Welt zurückzukehren.

83 Professoren der Volkswirtschaftslehre sahen sich sogar veranlasst, einen Aufruf zur Rettung der Wirtschaftspolitik zu veröffentlichen. Sie bemängeln, dass die Formalisierung dazu führe, dass das jeweilige Ergebnis bereits vollständig in den Annahmen enthalten sei. Die Wirtschaftspolitik versage aber deshalb, weil sie die Wirkungen ihrer Instrumente falsch einschätze, weil die Institution falsche Anreize setzten oder weil die Verhaltensweisen der Menschen nicht mit der reinen Theorie übereinstimmen würden. Auf diese Probleme habe die formalisierte Ökonomie aber keine Antworten.

Diesem Aufruf ist nun ein Gegenaufruf von 188 Professoren und Forschern der Volkswirtschaftslehre gefolgt, die davor warnen, international nicht wettbewerbsfähige Strukturen an deutschen wirtschaftswissenschaftlichen Fakultäten zu zementieren. Diese Gruppe wendet sich insbesondere gegen die strikte Trennung zwischen Wirtschaftstheorie und Wirtschaftspolitik und befürwortet den Einsatz quantitativer Instrumente. Sie verweist zusätzlich darauf, dass Ökonomen, die modelltheoretisch-quantitative Untersuchungen geleistet haben, zugleich an prominenter Stelle in der amerikanischen Wirtschaftspolitik positioniert seien. Vergleichbar führende Ökonomen würde man in der Bundesregierung kaum finden.

Wer die Diskussion mit dem Hinweis abtut, dass es sich um eine typisch deutsche Phantomdiskussion um Grundsätze handele, die an den realen Problemen vorbeigehe, macht es sich zu einfach. Der Ideen- und Methodenwettstreit ist ein wesentliches Element, um gerade wissenschaftliche Methoden weiterzuentwickeln. Es scheint, dass nicht nur die Unternehmenslenker und die Wirtschaftsverfassung, sondern auch die Wirtschaftswissenschaften selbst mittlerweile in einer Vertrauenskrise stecken. Möglicherweise brauchen auch die Ökonomen wie die Finanzmarktakteure ein „Rettungspaket“. Das kann die Politik sicher nicht so liefern, aber sie sollte sich deshalb positionieren, weil sie letztendlich Adressat der wirtschaftswissenschaftlichen Forschung ist.

Zur Rolle der Mathematik in der Ökonomie können drei Thesen aufgestellt werden:

- Keine Richtung der Wirtschaftswissenschaften hat dezidiert vor den Problemen auf den Finanzmärkten und deren weitreichenden Folgen gewarnt.
- Die Wirtschaftswissenschaften sollen dazu beitragen, politische Entscheidungen durch empirisch und theoretisch fundierte Überlegungen zu verbessern.
- Die Mathematik kann dabei ein nützliches Instrument sein, das die verbale Argumentation ergänzt.

Krisenvorhersage

Mit Blick auf die aktuelle Wirtschaftskrise hat sich keine Richtung der Wirtschaftswissenschaften mit Ruhm bekleckert.

Kaum jemand hat die Zwangsläufigkeit der Bereinigungskrise beschrieben. Die meisten Ökonomen haben einen engen Zusammenhang zwischen Finanzwelt und Realwirtschaft abgestritten. Zudem wurde der Fortbestand der weltwirtschaftlichen Dominanz der US-Ökonomie in Frage gestellt.

Die mathematisch geprägten Risikosteuerungsmodelle der Banken haben mit Blick auf ihre Leistungsfähigkeit für die Geschäftsstrategien versagt. Das liegt insbesondere daran, dass solche Modelle letztendlich nur Verhaltensmuster für die Vergangenheit unter Rahmenbedingungen der Vergangenheit abbilden und in die Zukunft fortschreiben können. Bei Innovationen und/oder bei Extremereignissen müssen sie also versagen. Man kann auch sagen, die Modelle sind

kollabiert, weil sie nur mit Daten aus der Zeit der Euphorie gefüttert wurden. Auch die vielen empirischen Untersuchungen zur Tragbarkeit und zu den Grenzen globaler Ungleichgewichte, z.B. mit Hilfe der Schätzung von Vektorautoregressionsansätzen oder mehrvariabler Zeitreihenanalyse haben nicht zum Erkenntnisfortschritt im Sinne einer Frühwarnfunktion geführt. Sollte es einen Anspruch gegeben haben, menschliches Verhalten vollständig mathematisch beschreiben zu wollen oder zu können, hat die aktuelle Bankenkrise – jedenfalls fürs Erste – das Gegenteil belegt.

Freilich haben sich in der gleichen Zeit viele Ordnungspolitiker hier zu Lande an der Ökonomisierung des Kartellrechts, an der Reform des EU-Vertrags oder an der Frage, ob die Marktwirtschaft um das Tribut „sozial“ überhaupt sinnvoll ergänzt werden könne, abgearbeitet. Das sind wichtige Themen, aber eine vernehmbare Warnung mit Blick auf Fehlsteuerungen an den Finanzmärkten gab es auch von dieser Seite nicht.

Mathematik als Instrument

Es ist lohnend, sich zu vergegenwärtigen, was Mathematik und Statistik eigentlich sind: keine Weltanschauungen, sondern Methoden und Instrumente. Wer sich mit einem Wirtschaftswissenschaftler über seine mathematischen Methoden unterhält, weiß noch nichts über seine Weltanschauung. Die Methodenwahl ist also unabhängig vom inhaltlichen Standpunkt. Alle Sachverhalte, die in der wirtschaftswissenschaftlichen Analyse mathematisch ausgedrückt werden, kann man auch verbal beschreiben. Umgekehrt gilt das nicht. Als Instrument hat die Mathematik hier aber drei Vorteile: Man kann Zusammenhänge zum einen kürzer ausdrücken. Man kann zum zweiten die Prämissen der Analyse vollständig offen legen

und logische Brüche aufdecken. Damit ist die Vorgehensweise offen für eine zielgenaue Kritik. Man kann zum dritten nicht experimentell erhobenes Datenmaterial so auswerten, dass wissenschaftliche Antworten dem Ideal eines Labor-experiments zumindest in der Auswertungsmethodik nahe kommen können. Damit kann die Mathematik den Nachteil ausgleichen, dass Wirtschaftswissenschaftler Argumente für ihre Thesen nicht im Labor sammeln können.

Das alles hat nichts damit zu tun, dass die Mathematik die Komplexität der realen Welt ausblenden würde. Es wird im Gegenteil deutlich, was die Analyse ausblendet. Damit treten die Grenzen der Methode klar zu Tage. Beides sind Eigenschaften, die einer verbalen politischen Argumentation oft fehlen.

Dies spricht den Wirtschaftswissenschaftler freilich nicht davon frei, mit dem Instrumentarium verständlich umzugehen: Dazu gehört, nicht vorschnell aus statistischen Zusammenhängen Ursachen abzulesen oder Ergebnisse vorschnell zu verallgemeinern. Die mathematische Methodik darf folglich die verbale Kommunikation und das Denken in großen Zusammenhängen nicht verdrängen, sondern sie soll sie ergänzen.

Politikberatung

Es ist richtig, dass die Wirtschaftswissenschaften den politischen Entscheidern helfen sollen, die Wirkung ihrer Instrumente einzuschätzen, richtige Anreize zu geben und Verhaltensweisen zu verstehen. Gerade um zu testen, ob solche Anreize mit der Theorie übereinstimmen, kann es hilfreich sein, Hypothesen mit empirischen Methoden zu überprüfen. Dabei zeigt schon der Instrumentenkasten selber, dass quantitative Methoden nicht exakt sein können: So

gibt es in der Ökonometrie Konfidenzintervalle, Fehlerabschätzungen oder Bestimmtheitsmaße, die die Beschränktheit der Datenmodelle verdeutlichen.

Ein konkretes Beispiel für den ergänzenden Nutzen quantitativer Methoden ist z.B. die Diskussion um den Mindestlohn. Ordnungspolitisch ist die Antwort intuitiv klar: Mindestlöhne schaden gerade denjenigen, denen sie nützen sollen, da ein wirksamer Mindestlohn unter dem Strich Arbeitsplätze vernichtet, die Lohnfindung politisiert und etablierten Unternehmen hilft, sich gegen Neueinsteiger abzuschotten. Befürworter halten dem aber entgegen, dass es in anderen Ländern mit besserer Beschäftigungslage als in Deutschland Mindestlöhne gibt. An dieser Stelle ist die empirische Forschung hilfreich, denn sie weist anhand vieler verschiedener, umfangreicher Datenreihen nach, dass höhere Mindestlöhne keine vorteilhaften Verteilungseffekte für die Zielgruppe der Geringverdiener bringen, sondern sie im Gegenteil alles in allem schlechter stellen.¹

Ein weiteres Beispiel liefert die Erweiterung der Entscheidungspraxis in der europäischen Wettbewerbspolitik durch den „ökonomischeren Ansatz“ (more economic approach). Die EU-Kommission hat dieses zusätzliche Analyseinstrumentarium eingeführt, indem sie neben der strukturellen, qualitativen Analyse quantitative ökonomische Methoden einsetzt. Auf diese Weise wertet sie umfangreiche Marktdaten aus und versucht, Änderungen der Konsumentenwohl-fahrt z.B. durch Preissenkungen zu quantifizieren, bevor sie wettbewerbspolitische Entscheidungen z.B. über eine Fusion trifft. Auch

¹ Vgl. D. Neumark: Alternative Labor Market Policies to Increase Economic Self-Sufficiency: Mandating Higher Wages, Subsidizing Employment and Raising Productivity, IZA Discussion Paper Nr. 3355, 2008.

das Bundeskartellamt bezieht inzwischen in den üblichen Marktbeherrschungstest sowohl neue spieltheoretische Erkenntnisse als auch dynamische Wirkungen ein, wenn es Zusammenschlüsse wettbewerbspolitisch beurteilen will.

Dabei sind sich die Wettbewerbschützer durchaus bewusst, dass quantitative Ergebnisse eine Scheinpräzision vermitteln können, da die Prognosegenauigkeit von Simulationsmodellen immer unsicher ist. Dennoch kann es sich um ein wertvolles Zusatzkriterium im Abwägungsprozess handeln. Allerdings muss bei diesem Abwägungsprozess unverändert im Vordergrund stehen, dass es nicht allein um quantifizierbare Marktergebnisse gehen kann. Die Einschränkung des Wettbewerbs gefährdet immer auch die Freiheit der Märkte und damit des Individuums. Das kann kaum gegen unsicher belegte „Performance“-Vorteile aufgewogen werden.

Die Erweiterung der Methodik in der wirtschaftspolitischen Analyse birgt also Chancen und Gefahren.

Gespür für relevante Untersuchungsgegenstände

Aus Sicht der Politik ist es deshalb wichtig, dass Wirtschaftswissenschaftler nicht nur ihr Instrumentarium virtuos beherrschen, sondern auch ein Gespür für relevante Untersuchungsgegenstände entwickeln und in der Lage sind, Vorgehen und Ergebnisse für den Laien verständlich zu kommunizieren. Das ist nicht immer sichergestellt. Wenn man etwa die Vorträge im offenen Teil der Jahrestagung des Vereins für Socialpolitik besucht, so erlebt man einige bedenkliche Tendenzen. Wer sich Zeitreihen so zurechtbastelt, dass sie für eine bestimmte Untersuchungsmethode passen, kann damit möglicherweise die Kenntnis des formalen Instrumentariums un-

ter Beweis stellen, bietet aber aus Sicht der Politik nichts an.

Wenn prominente Ökonomen in Deutschland sich über eine Beratungsresistenz der Politik beklagen, so gibt es an dieser Stelle einen Ansatzpunkt, ein von der Wirtschaftswissenschaft so empfundenes Defizit abzubauen. Denn in jedem Fall ist ein politisch relevanter Standpunkt, der mit Zahlen, gern auch eingeschränkt durch Konfidenzintervalle oder Ähnliches plausibel untermauert werden kann, für politische Entscheidungsträger eindrucksvoll. Balzac, der große französische Romancier, hat dieses Verhalten gut umschrieben: „Obwohl die Statistik die Kinder der modernen Staatsmänner ist, die glauben, dass die Zahlen die Rechnung seien, so muss man sich doch der Zahlen bedienen, um zu rechnen.“

Ideenwettbewerb

Ein weiteres Argument ergibt sich aus der internationalen Entwicklung. Der Ideenwettbewerb bringt jede Wissenschaft, so auch die Wirtschaftswissenschaften voran. Absonderungen oder Sonderwege sollten aber nicht mit diesem Ideenwettbewerb gleichgesetzt werden. Das ist in der Geschichte der Wirtschaftswissenschaften in Deutschland sehr plausibel belegt worden.² Wie der Begriff „Nationalökonomie“ schon sagt, waren die Wirtschaftswissenschaften in Deutschland im 19. Jahrhundert sehr stark auf das Werden der Nation hin orientiert. Das Wesenhafte des Staates (Hegel) und ein Korporatismus im nationalstaatlichen Interesse spielten eine große Rolle dort, wo die angloamerikanische Tradition ganz nüchtern Wirtschaftlichkeit allgemein und speziell beim internationalen Handel in den Mittelpunkt rückte.

Die deutsche Ordnungsökonomik war nach 1945 besonders erfolgreich darin, ein neues liberales Weltbild, das die Fixierung auf Nation und nationale Champions überwinden sollte, der Bevölkerung und den Politikern in Deutschland nahe zu bringen. Die Ordnungspolitik kann somit – in den Worten Ritschls – als „der Pfad für die verspätete Modernisierung des ökonomischen Denkens in Deutschland“ aufgefasst werden. Walter Eucken, Friedrich August von Hayek, Ludwig Erhard und ihre Mitstreiter haben also gut daran getan, diesen Weg zu beschreiten. Denn es wäre ja auch anders gegangen: Irving Fisher verfeinerte die Quantitätsgleichung 1911, Ronald Coase verfasste sein Werk „The Nature of a Firm“ 1937, John Richard Hicks veröffentlichte das IS/LM-Schema ebenfalls 1937 zum ersten Mal und Roy Harrod entwickelte sein formales Wachstumsmodell 1939. Diese wirtschaftswissenschaftliche Basis hätte nach 1945 Deutschland zur Übernahme zur Verfügung gestanden. Ob sie akzeptiert worden wäre, kann man bezweifeln.

Ein Blick auf die Ideengeschichte in den Wirtschaftswissenschaften zeigt, dass es ohnehin keine Einbahnstraßen gibt. Robert Lucas hat mit seiner *Econometric Policy Evaluation Critique*³ 1976 die Modewelle ökonometrischer Großmodelle zum Einsturz gebracht, indem er darauf hinwies, dass die ökonometrischen Strukturparameter von wirtschaftspolitischen Eingriffen nicht unabhängig seien und sich die Modelle daher nicht zur Politiksimulation eignen würden. Davon haben sich die Empiriker wiederum nicht einschüchtern lassen. Seit den 80er Jahren hat die Ökonometrie mit Vektorautoregressionsmodellen und Kausalitätsuntersu-

² Vgl. A. Ritschl: Ordnungsökonomik war ein Sonderweg, <http://agbs.fazjob.net>.

³ Vgl. R. E. Lucas: *Econometric Policy Evaluation: A Critique*, in: *Journal of Monetary Economics*, 2. Supplement, Vol. 1 (1976).

chungen bei der Betrachtung von Zeitreihen erneut einen Siegeszug in der ökonomischen Analyse angetreten. Auch das wird keine Einbahnstraße werden: Wer die angebliche Dominanz der Ökonometrie beklagt, übersieht, dass sich parallel dazu z.B. die Neue Institutionenökonomik ebenfalls dynamisch weiterentwickelt hat, was mit den Namen der Ökonomie-Nobelpreisträger James Buchanan, Ronald Coase und Douglass North verbunden ist. Jede Theorie, die sich neuen Ansätzen nicht öffnet, verkümmert.

Ökonomische Analyse und „Wirklichkeit“

Die ökonomische Analyse an die „Wirklichkeit“ anzupassen wird eine Daueraufgabe der Wirtschaftswissenschaften bleiben. Es bleibt abzuwarten, inwieweit es der Verhaltensökonomik gelingt, Probleme, die das angeblich oder tatsächlich irrationale Verhalten der Menschen aufwirft, aufzufangen und in die Analyse zu integrieren. Man mag die Verhaltensökonomik als einen Versuch betrachten, den Ansatz einer formalen Beschreibung menschlichen Verhaltens zu retten. Es sind Zweifel daran erlaubt, ob das gelingen wird.

Auf alle Fälle müssen Forschung und Lehre in Deutschland den Anschluss halten. Eine Rückkehr zu einer strikten Aufteilung der Volkswirtschaftslehre in Wirtschaftstheorie und Wirtschaftspolitik hätte keine Zukunft und wird auch nicht ernsthaft gefordert. Es ist vielmehr sehr zu begrüßen, dass deutsche Wirtschaftswissenschaftler seit den 90er Jahren in die internationale Forschung und damit auch in die internationale Wahrnehmung deutlich besser eingebunden sind. Sie stehen allerdings vor der Aufgabe, den Bezug zu ökonomischen Problemen in Deutschland und Europa zu behalten.

Erwartungen der Politik

Die Politik erwartet Wirtschaftswissenschaftler, die alle drei Komponenten beherrschen: anspruchsvolle Theorien allgemeinverständlich zu formulieren, das analytische Instrumentarium anzuwenden und politische Schlussfolgerungen zu ziehen. Niemand fordert dabei abgeschlossene Projektionen gesellschaftlicher Zustände, die eine perfekte Planung ermöglichen könnten. Was die Politik aber erwartet, sind Tendenzaussagen darüber, in welche Richtung es laufen könnte. Die Kenntnis typischer menschlicher Reaktionsmuster – ganz im Sinne der Beobachtungen Hayeks oder Euckens – ist dabei eine unentbehrliche Voraussetzung. Denn die Gestaltung der Rahmenbedingungen in einer marktwirtschaftlichen Ordnung sollte nicht Juristen, Soziologen und Politikwissenschaftlern allein überlassen bleiben, sondern von wirtschaftswissenschaftlichen Erkenntnissen profitieren können. Dies gilt umso mehr, als 60 Jahre Wohlstandswachstum in West- und 20 Jahre in Ostdeutschland die marktwirtschaftliche Ordnung zu einer unauffälligen Selbstverständlichkeit haben werden lassen. Das Bekenntnis zu dieser Ordnung ebenso wie zu der damit verbundenen Freiheit und Verantwortung hat an Bedeutung im Bewusstsein der Bevölkerung verloren. Deshalb sollten ökonomische Zusammenhänge stärker als bisher Bestandteil der Allgemeinbildung werden. Die Wirtschaftswissenschaften sollten dabei weder Mathematikreservate noch Gralshüter einer ordnungspolitischen Tradition werden, sondern stets offen für neue Entwicklungen bleiben. Um den Austausch zwischen Wissenschaft und Praxis zu fördern, ist z.B. zu überlegen, ob beim Finanz- und beim Wirtschaftsministerium Arbeitseinheiten eingerichtet werden könnten, innerhalb derer – von

Firmen und Verbänden unabhängige – Wissenschaftler befristet forschen und zugleich in die tägliche Arbeit eingebunden werden. Die entsprechende Einheit bei der Bundesbank könnte hier als Vorbild dienen.

Der unter deutschen Wirtschaftswissenschaftlern nun neu aufgeflamnte Konflikt ist im Übrigen sehr alt. Der englische Philosoph Francis Bacon hat ihn bereits vor knapp 400 Jahren treffend umschrieben:⁴ „Diejenigen, die sich mit der Wissenschaft beschäftigen, waren entweder Empiriker oder Dogmatiker. Die Empiriker ähneln Ameisen, die etwas sammeln und verwenden. Die Dogmatiker ähneln Spinnen, die aus sich heraus Gewebe spinnen. Die Bienen aber nehmen eine Zwischenstellung ein. Sie sammeln Stoffe von den Blumen des Gartens und des Feldes. Durch ihre eigenen Fähigkeiten verändern und verdauen sie diese Stoffe. Im Kern ist die Arbeit des Wissenschaftlers ähnlich; diese hängt nicht vollständig oder nicht einmal hauptsächlich von der Schärfe seines Verstandes ab; auch beschränkt er sich nicht auf das Sammeln von Stoffen, die ihm die Naturgeschichte und die mechanischen Experimente liefern, sondern er verändert und verdaut mit Hilfe seines Verstandes. Und so können von der engeren und heiligen Verbindung dieser Fähigkeiten – dem Einsatz von Experiment und Vernunft – die zuvor nicht verbundenen waren – gute Fortschritte erwartet werden.“

Setzt man die Ökonometrie mit den Ameisen und die Ordnungspolitik mit den Spinnen gleich, so ist die Rolle der Bienen das, was die Wirtschaftspolitik sich von den Wirtschaftswissenschaften erhofft.

⁴ Vgl. F. Bacon: *Novum Organum*, 1620, zitiert nach M. Perlman: Was bestimmt das wirtschaftswissenschaftliche Denken?, in: Ifo-Schnelldienst 25-26/98, S. 30.