

WARUM PROGNOSEN IN DER WIRTSCHAFT SCHEITERN¹

Karl-Heinz Brodbeck



Prof. Dr. Karl-Heinz Brodbeck

Professor für Statistik, Volkswirtschaftslehre und Volkswirtschaftspolitik am Fachbereich Betriebswirtschaft, Abteilung Würzburg der Fachhochschule Würzburg-Schweinfurt; Herausgeber der *praxis perspektiven*

1 Vorbemerkung

Es gibt eine sichere Prognose in der Wirtschaft, nämlich die, daß Prognosen fast immer scheitern. Nimmt man ein Lehrbuch der Ökonomie zur Hand, so wird man darin viel Mathematik finden, eine Mathematik, die bei genauerer Prüfung durchaus der Physik vergleichbar ist. Wir stehen also vor der Paradoxie, daß eine exakt formulierte Wissenschaft – die Ökonomie – in ihrer praktischen Anwendung alles andere als exakte Ergebnisse erzielt.

Dieser Paradoxie möchte ich die nachfolgenden Überlegungen widmen. Und ich möchte dafür eine Erklärung anbieten, die für die Ökonomie nicht unbedingt schmeichelhaft sein wird. Meine grundlegende These wird sein: Die Ökonomen leiden daran, ihre eigene Theorie mißzuverstehen. Sie glauben, exakte Wissenschaft zu betreiben, während sie in Wahrheit eine *Ethik* formulieren. Die Grundlagen der Ökonomie als Wissenschaft sind also fragwürdig – im doppelten Wortsinn: Es lohnt sich, diese Grundlagen zu diskutieren, und es zeigt sich, daß sie einer kritischen Prüfung nicht standhalten. Ich habe meinen Vortrag in vier Hauptpunkte eingeteilt:

- 1) Zunächst möchte ich anhand einiger Presse-Stimmen zeigen, daß die Kritik an den Ökonomen und ihren Prognosen allgegenwärtig ist.
- 2) Als zweiten Punkt möchte ich dann einige Bemerkungen über die Struktur von Prognosen und die dabei verwendeten Modelle machen.
- 3) In einem dritten Punkt, dem Hauptpunkt, versuche ich Ihnen zu zeigen, weshalb die von den Ökonomen verwendeten Denkmodelle in sich widersprüchlich sind und deshalb gleichsam notwendig zu Fehlprognosen führen müssen. Hierbei wird die Freiheit der Ent-

scheidung und die Kreativität eine wichtige Rolle spielen.

- 4) Im vierten, letzten Punkt stelle ich dann die Frage: Weshalb werden eigentlich immer wieder Prognosen in der Wirtschaft und für die Wirtschaft erstellt, wenn doch die Erfahrung fast täglich zeigt, daß die Modelle als Prognoseinstrumente nicht funktionieren. Wie kann die Paradoxie erklärt werden, daß eine Wissenschaft hohes Ansehen genießt, die unaufhörlich daran scheitert, ihre Hausaufgaben ordentlich zu machen.

2 Die Ökonomen und ihre Prognosen

Da ich selbst einige Jahre für das Ifo-Institut für Wirtschaftsforschung in München tätig war, möchte ich sozusagen vor der eigenen Tür kehren und zunächst ein Beispiel einer Prognose des Ifo-Instituts wählen. Da konnte man in der Presse lesen: „Ifo Institut korrigiert Wachstumsprognose. Nach Einschätzung des Münchner Ifo Instituts wird sich die Konjunktur in Deutschland im nächsten Jahr stärker abschwächen als bisher erwartet.“ Nun, Ähnliches haben in den letzten Wochen viele Institute und internationale Organisationen festgestellt. Das fragliche Zitat stammt aber vom 18. Dezember 1998. Offenbar gehört die Revision von Prognosen in der Wirtschaft zur Tagesordnung.

Wir beobachten heute wieder etwas ganz ähnliches. Die Meldungen überschlagen sich, wonach Prognosen korrigiert werden – unerfreulicherweise sämtliche nach unten. Der IWF hat seine Prognose für das Weltwirtschaftswachstum bereits von 4,8 auf 3,4 Prozent reduziert; die Wirtschaftsforschungsinstitute senken ihre Herbstprognose von 2,7 auf 2,1 Prozent; die Bundesregierung paßt ihre Prognose widerwillig an und korrigiert sie nach

¹ Vortrag am 10. Mai 2001 bei der Philosophischen Gesellschaft, Bremerhaven.

unten; auch die OECD hat ihre Prognose für Deutschland von 3,3 auf gut 2 Prozentpunkte verändert. Man beachte: Es handelt sich hierbei um Prognosen für das Wachstum des realen BIP in *diesem Jahr* 2001. Von diesem Jahr ist schon ein Viertel des prognostizierten Zeitraums vergangen. Und: Es handelt sich hier um relative Prognosefehler in der Größenordnung von (am Beispiel der OECD-Prognose) 44 Prozent!

Es wäre gewiß nicht schwierig, den Rest dieses Vortrags mit weiteren Beispielen zu füllen. Und dabei habe ich bislang darauf verzichtet, Börsen-Prognosen heranzuziehen. Sie kennen sicher alle die würdigen Herren in einschlägigen Fernsehsendungen zur Börse; sie nennen sich „Chart-Analysten“. Es werden dann Abbildungen von Kursbewegungen der Aktienindizes, also „Charts“, gezeigt, in die diese Analysten bunte Linien malen, die sie „untere Unterstützungslinie“ oder „Korridor“ usw. nennen. Ihre wortreichen Analysen erwecken den Eindruck wissenschaftlicher Seriosität, denn Kurven und Trendlinien gehören nun einmal zum Instrumentarium der Wissenschaftler. Doch besonders seriös kann dieses Geschäft nicht sein. Ein einfaches ökonomisches Argument spricht dagegen: Angenommen, die Chart-Analysen wären erfolgreich aufgrund einer bestimmten Methode. Wäre es dann nicht zu erwarten, daß die Wissenschaftler selbst durch diese Methoden *Reichtum erwerben*? F. A. Hayek sagte einmal zutreffend: „Kein Ökonom war jemals darin erfolgreich, Waren auf der Basis von wissenschaftlich prognostizierten Zukunftspreisen zu kaufen oder zu verkaufen (obgleich einige wenigstens darin erfolgreich waren, solche Prognosen zu verkaufen).“¹

Es ist also kein Geheimnis: Prognosen scheitern, immer wieder. Und es ist offenbar keine Frage, die vor den höchsten Rängen der Ökonomie halt macht. Im September 1998 machte der Beinahe-Zusammenbruch eines Hedge-Fonds – Long Term Capital Management (LTCM) –, einer Wall Street Firma, Schlagzeilen. Nur durch eine großzügige Kreditaktion auch von der

Federal Reserve Bank of New York konnte ein geschätztes Brutto-Vermögen von ca. 30 Mrd. US-Dollar gerettet werden. Die Pointe hierbei: Dieser Hedge-Fond wendet ein ausgeklügeltes mathematisches Modell für Kursbewegungen an, das ein Jahr zuvor mit dem Nobelpreis für ihre Erfinder geehrt wurde. Und die beiden Nobelpreisträger Robert Merton und Myron Scholes standen auch an der Spitze von LTCM. Die Kritik der Wirtschaftspresse ist deshalb auch nicht zu überhören. „Die Ökonomie ist bankrott. Die einzigen, die es noch nicht wissen, sind offenbar die Ökonomen“, schrieb Stefan Baron bereits 1984 im SPIEGEL. Prognosen seien eher so etwas wie „Desinformation“.² Als späterer Chefredakteur der Wirtschaftswoche hat er seine frühe Kritik allerdings scheinbar vergessen. Immerhin titelte 1992 eben diese Wirtschaftswoche: „Völlig bedeutungslos. Der Unmut über die Ökonomen wächst. Ihre Modelle sind immer komplexer, ihre Prognosen jedoch kaum treffsicherer geworden.“³ Und Hendrik Munsberg schreibt in der Süddeutschen Zeitung: „Die noch junge Disziplin Ökonomie verzeichnet vergleichsweise bescheidene Prognoseerfolge; man denke nur an die Konjunkturvorhersagen der ‚Fünf Weisen‘ oder der ‚führenden Forschungsinstitute‘. Von naturwissenschaftlicher Exaktheit sind diese Experten Lichtjahre entfernt.“⁴ Im Herbst des vergangenen Jahres machte ein von französischen Studenten verfaßtes Thesenpapier Schlagzeilen, in dem sie ihre Professoren aufforderten, endlich Abschied zu nehmen von unrealistischen Theorien. So ist es eigentlich nicht verwunderlich, wenn – trotz wachsender Bedeutung globaler und gesamtwirtschaftlicher Probleme – die Zahl der Studierenden und die der Hochschullehrer im Bereich Volkswirtschaftslehre sinkt. Nikolaus Piper hat jüngst in der Süddeutschen Zeitung von einer „Ökonomie ohne Ökonomen“ gesprochen.⁵

² S. Baron, Das Elend der Ökonomie, DER SPIEGEL 43, 38 Jg. (1984), 22. Oktober, S. 66.

³ M. Kessler, M. Sauga, Völlig bedeutungslos, Wirtschaftswoche Nr. 21/15.5.1992, S. 50-56.

⁴ Hendrik Munsberg, Dreiste Ökonomen, Süddeutsche Zeitung vom 3. August 1996.

⁵ N. Piper, Ökonomie ohne Ökonomen, Süddeutsche Zeitung vom 14.-16. April 2001.

3 Das Maschinen-Modell der Ökonomie⁶

Angesichts dieser Situation scheint es notwendig, eine grundsätzliche Frage zu stellen: Welchen Charakter besitzt eigentlich die Ökonomie als Wissenschaft, wenn sie einerseits den Anspruch erhebt, exakte Prognosen für wirtschaftliche Verläufe erstellen zu können – mit Wachstumsraten auf Zehntelpunkte genau –, andererseits aber gerade darin immer wieder scheitert? Ich konzentriere mich hier auf die „Mainstream-Ökonomie“, d. h. auf das, was fast allen Gutachten der Wirtschaftsforschungsinstitute und der verschiedenen Beratungsgremien in der Politik zugrunde liegt. Es handelt sich hier um eine Theorie, die in ihren Grundzügen bereits von Adam Smith formuliert worden ist. Was sich im Verlauf von 225 Jahren daraus entwickelt hat (wenn man das Erscheinungsdatum von „Wealth of Nations“ 1776 zugrundelegt), läßt sich im Kern als zunehmende Verfeinerung der Methoden und vor allem als ausgiebige Mathematisierung der Ökonomie beschreiben. Tatsächlich ist die Volkswirtschaftslehre (ein heute reichlich antiquierter Begriff für diese Disziplin – aber vielleicht ist nicht nur der Name antiquiert) unter den Sozialwissenschaften rein äußerlich betrachtet die formal ausgefeilteste Theorie, deren mathematische Eleganz weder von irgendeinem soziologischen, sozialpsychologischen noch von einem betriebswirtschaftlichen Modell erreicht wird.

Welche Erklärungsaufgabe hat sich eigentlich die Ökonomie vorgenommen? In der Wissenschaft versucht man, nicht einfach einen Gegenstand zu „erklären“, man versucht, *Probleme* zu lösen und *Fragen* zu beantworten. Welche Frage will eigentlich die Ökonomie (ich verwende diesen allgemeinen Ausdruck)

⁶ Vgl. ausführlich hierzu: K.-H. Brodbeck, Die fragwürdigen Grundlagen der Ökonomie. Eine philosophische Kritik der modernen Wirtschaftswissenschaften, 2. Auflage, Darmstadt 2000; K.-H. Brodbeck, Die Macht des Scheins in der Wirtschaft; in: C. Urban, J. Engelhardt (Hrsg.), Wirklichkeit im Zeitalter ihres Verschwindens, Münster Hamburg London 2000, S. 129-147; K.-H. Brodbeck, Umriss einer postmechanischen Ökonomie; in: R. Benedikter (Hg.), Postmaterialismus, Band 1: Einführung in das postmaterialistische Denken, Wien 2001, S. 117-142; K.-H. Brodbeck, Die fragwürdigen Grundlagen des Neoliberalismus. Wirtschaftsordnung und Markt in Hayeks Theorie der Regelselektion, Zeitschrift für Politik 48 (2001), S. 49-71.

beantworten? Jeder Frage geht eine Situationsbeschreibung voraus. Und es war eine Gruppe von schottischen Ökonomen, von denen Adam Smith nur der bekannteste ist, die diese Situationsbeschreibung zuerst klar formuliert hat. Das hat historische Gründe. Mit der Geburt der modernen Wirtschaftswissenschaften begann auch die Entfaltung der kapitalistischen Dynamik. Während die traditionellen Wirtschaftsformen eingebunden waren in eine umfassende soziale und religiöse Ordnung, die im Mittelalter ihren Höhepunkt erreichte, dann aber mit der Renaissance und der wachsenden Bedeutung des Kaufmannsstandes nach und nach aufgelöst wurde, zeigt der Kapitalismus ein ganz anderes Bild. Ich kann diese Entwicklung hier nicht noch einmal skizzieren und möchte nur das Resultat festhalten: Charakteristisch für die kapitalistische Wirtschaftsform wurden vor allem zwei neue soziale Tatsachen. *Erstens* wurden persönliche Bindungen durch Familie, Zünfte, Dorfgemeinschaft usw. schrittweise aufgelöst. An ihre Stelle trat das freie Individuum, das – im günstigeren Fall – zugleich *Privateigentümer* war. *Zweitens* trat an die Stelle einer religiös-staatlichen Ordnung der *Markt*, weshalb man diese Wirtschaftsweise auch zutreffend als „Marktwirtschaft“ bezeichnen kann.

Eine Vielzahl von Privateigentümern oder Arbeitskräften stehen zueinander im Wettbewerb. Das verbindende Glied ist – so scheint es – ganz überwiegend der Markt. Die vielen privaten Handlungen werden durch Marktprozesse koordiniert. Und angesichts dieser Situationsbeschreibung sah sich Adam Smith vor die Frage gestellt: Wie ist es möglich, daß eine Vielzahl von Individuen, von Privateigentümern, die alle egoistisch ihren Nutzen, ihren Gewinn maximieren, überhaupt zu so etwas wie einer geordneten Gesellschaft führen kann? Ist es nicht viel eher zu erwarten, daß im Kampf aller gegen alle, im *bellum omnium contra omnes*, das Thomas Hobbes als Erster diagnostiziert hat, das reine Chaos hervorgeht? Hobbes war dieser Auffassung – er glaubte, daß nur ein starker Staat die Anarchie des Wettbewerbs aufheben könne. Diese Hobbes'sche Auffassung erlebte im Sozialismus ihre Wiedergeburt.

Dagegen nun entwickelte Adam Smith seine Theorie, deren Kerngedanke – die

invisible hand – heute zum Gemeingut des Wissens über die Marktwirtschaft gehört. Wie kann man diesen Gedanken kurz charakterisieren? Adam Smith ging davon aus, daß die Menschen egoistisch handeln und nur bestrebt sind, ihre privaten Ziele zu maximieren. Er hat – in einem anderen Buch, der *Theory of Moral Sentiments* – diese Haltung angeprangert und für eine Ethik der Rücksichtnahme und des Einfühlens in andere plädiert; doch gleichzeitig war Smith davon überzeugt, daß die Menschen kaum verbessert werden könnten, daß also ihre Beschreibung als konkurrierende Egoisten nicht sehr weit von der Realität entfernt sein würde.

Adam Smith machte eine wichtige Beobachtung: Er sagte, daß zwar alle Individuen egoistisch handeln, daß sie aber zugleich im Wettbewerb zueinander stehen. Der Wettbewerb ist offenbar ein reines Massenphänomen. Die Preise reagieren mechanisch auf die Marktkräfte des Angebots und der Nachfrage, und es sind wiederum die Preise, die den einzelnen Entscheidungen der egoistischen Konkurrenten zugrunde liegen. Und hier nun hat Adam Smith ein Gesetz der Preise vermutet, das sozusagen den individuellen Absichten zuwiderläuft und für die gesamte Wirtschaft dazu führt, daß gerade *durch den Wettbewerb* bestmögliche Resultate für alle erzielt werden.

Der Gedanke ist im Grunde einfach: Zwar versucht jeder individuell einen maximalen Preis oder Lohn zu fordern, doch die Wettbewerber hindern ihn daran, dieses Ziel auch zu erreichen. So bilden sich Preise, die früher oder später Angebot und Nachfrage ins Gleichgewicht bringen und damit die Handlungen der Anbieter und Nachfrager genau aufeinander abstimmen, ohne daß sich diese abgesprochen hätten. Der Marktwettbewerb schafft durch den Preismechanismus das Wunder, egoistische Privatinteressen so in einen Ausgleich zu bringen, daß damit die millionenfachen Handlungen einer komplexen Gesellschaft koordiniert werden und somit das *bellum omnium contra omnes* nicht in einem Chaos, sondern im Marktgleichgewicht endet. Der Staat spielt hier nur die Rolle des Schiedsrichters, d. h. er überwacht die Einhaltung bestimmter Regeln, wie die Achtung der Eigentumsrechte, Vertragsbindungen usw.

Das war die großartige Antwort von Adam Smith auf die Frage: Wie ist eine Gesellschaft egoistischer Wettbewerber überhaupt *möglich*? Und die moderne Ökonomie hat diese Antwort eigentlich nur mathematisch formuliert – sehr elegant formuliert – und zu zeigen versucht, wie und warum Marktgleichgewichte zustandekommen. Die klassische Theorie wurde mit neuen Bausteinen ergänzt (wie der Lehre vom Grenznutzen), und die daraus entstandene *neoklassische Theorie* darf heute als fast unangefochten herrschendes Paradigma der Wirtschaftswissenschaften gelten. Es dürfte Ihnen aufgefallen sein, daß ich in meiner Beschreibung bislang jeden kritischen Unterton vermieden habe. Ich wollte den Grundgedanken so rein wie möglich herausarbeiten. Und dieser Grundgedanke wurde von der modernen Ökonomie in der Sprache der Mechanik so ausgedrückt: Die Marktkräfte des Angebots und der Nachfrage bestimmen die Bewegung der Preise auf eine mathematisch beschreibbare Weise. Wenn man von Ausnahmen absieht, für die in der Ökonomie wirtschaftspolitische Lösungen entwickelt wurden, dann „funktioniert“ der Preismechanismus und übernimmt die Aufgabe, so etwas wie „Gesellschaft“ über Märkte immer wieder *herzustellen*. Mehr denn je ist die Gegenwart von dem Gedanken bestimmt, daß „Märkte nicht lügen“; sie bilden die eigentliche Grundlage. Und gegen Marktgesetze zu verstoßen, das ist heute beinahe so etwas wie die Ketzerei im Mittelalter geworden.

Wenn man ein Lehrbuch der ökonomischen Theorie aufschlägt, dann wird man darin sehr rasch – meine Studenten beklagen das immer wieder – sehr viel Mathematik entdecken. In der Ökonomie wird tatsächlich gerechnet. Dort werden Gleichgewichtspreise für Märkte ermittelt, Anpassungsprozesse simuliert und sogar langfristige Wachstumsprozesse ganzer Volkswirtschaften in einer „Mechanik der ökonomischen Entwicklung“ modelliert – ich verwende den Titel eines bekannten Aufsatzes von R. Lucas, der für seine Forschungen auch den Wirtschaftsnobelpreis erhielt.⁷

⁷ R. E. Lucas, On the Mechanics of Economic Development, Journal of Monetary Economics 22 (1988), S. 3-42.

Die Ökonomie ist, so scheint es, eine formal ebenso geschlossene Theorie wie die Mechanik. Mehr noch: Die Gleichungen ähneln sich nicht nur, sie sind formal mit der Mechanik *identisch*. Was heißt das? Das heißt, daß die Ökonomen in der überwiegenden Mehrheit der Auffassung sind, daß die Wirtschaft wie eine riesige Maschine funktioniere, deren Mechanismus zwar reichlich komplex, insgesamt aber *berechenbar* sei.

Das war es, was schon Adam Smith vorschwebte. Adam Smith macht zwei wichtige Voraussetzungen, die im Grunde heute immer noch uneingeschränkt gelten, auch wenn die formale, mathematische Struktur heute weitaus komplexer und eleganter geworden ist:

Erstens sagt Adam Smith, daß die Wirtschaft ein System darstellt – er nennt es „System der Freiheit“, meint aber damit die Freiheit des Wettbewerbs: „Die Vervollkommnung der Verwaltung, die Ausbreitung des Handels und der Manufaktur (...) bilden einen Teil des großen Systems der Regierung, und die Räder der Staatsmaschine scheinen mit ihrer Hilfe sich in größerer Harmonie und größerer Leichtigkeit zu bewegen. Es macht uns Vergnügen, die Vervollkommnung eines so schönen und großartigen Systems zu betrachten, und wir sind nicht ruhig, bis wir jedes Hindernis, das auch nur im mindesten die Regelmäßigkeit seiner Bewegungen stören oder hemmen kann, beseitigt haben.“⁸

Zweitens setzt Smith den Begriff „System“ dem der „Maschine“ gleich. In seiner *History of Astronomy* sagt Smith: „Systeme entsprechen in vielerlei Hinsicht Maschinen. Eine Maschine ist ein kleines System, das dazu erschaffen wurde, die verschiedenen Bewegungen und Effekte auszuführen und zu verbinden, die der Techniker beabsichtigte. Ein System ist eine imaginäre Maschine, die in der Vorstellung jene verschiedenen Bewegungen und Effekte verbindet, die in der Wirklichkeit ohnehin verbunden sind.“⁹

Daß dies keine bloß historische Metapher ist, sondern immer noch das Leit-

bild der Ökonomie, möchte ich mit einem kleinen Zitat illustrieren, das aus dem Buch „Kaltstart“ der Münchner Ökonomen Hans Werner und Gerlinde Sinn zum Problem der Wiedervereinigung Deutschlands verfaßt haben. Dort sagen die beiden Autoren: „Daß der Wirtschaftsmotor des Ostens nicht mit gleichmäßigem Schwung in Gang kommen konnte, war klar. Niemand darf sich wundern, wenn ein Kaltstart unter extremen Witterungsbedingungen mehrfache Anlaßversuche verlangt und wenn sich der Motor dann auch nur ruckelnd und zuckelnd in Bewegung setzt. Das volle Ausmaß der Startschwierigkeiten übersteigt aber wohl doch die allgemeinen Erwartungen.“¹⁰

Das muß man sich auf der Zunge zergehen lassen: Da lebt ein ganzes Volk unter einer völlig anderen Wirtschaftsform, dem Preußischen Sozialismus der DDR, ohne Privateigentum, ohne Kapitalmarkt, ohne eine Geldwirtschaft im westlichen Sinn. Dieses Volk erhebt sich und möchte eine ganz andere Wirtschaftsweise, die Marktwirtschaft einführen. Und da schreiben Ökonomen – aus deren Zunft übrigens kein einziger den Zusammenbruch des Sozialismus vorhergesagt hat – ein Buch zum Aufbau dieser völlig neuen Wirtschaftsform. Doch *wie* schreiben sie darüber? Sie gehen davon aus, es handle sich um eine Maschine, die unter etwas kühleren Verhältnissen unter Startschwierigkeiten leide.

Die einfache Frage: *Gibt es denn diese Maschine überhaupt schon?* stellen sie gar nicht. Ökonomen können offenbar nur im Maschinen-Modell denken, auch dann, wenn die Vorstellung, die alten Fabriken der DDR, die fehlenden Märkte, die fehlenden Gewohnheiten im Umgang mit Geld, Zins und Kredit, seien ein fertiges System, absurd ist – all dies wird vergessen, und man vermutet, die Maschine sei schon fertig vorhanden und leide nur unter Startschwierigkeiten. Daß Beratungen für den Aufbau Ost, die auf solchen Gedanken fußen, sträflich leichtsinnig sind, daß sie Schiffbruch erleiden müssen, dürfte eigentlich auch ohne ausführliche Kritik einleuchten.

4 Warum Prognosen scheitern müssen

Damit komme ich zu meinem Hauptpunkt. Ich möchte zunächst aus den vorhergehenden Überlegungen *zwei Ergebnisse* zusammenfassen:

Erstens zeigt sich, daß für die Gesamtwirtschaft, aber auch für einzelne Märkte immer wieder Prognosen formuliert werden, die sich mehr oder weniger gravierend vom *tatsächlichen* Verlauf unterscheiden.

Zweitens zeigt sich aber, daß die Ökonomen Modelle verwenden und ihre Gültigkeit behaupten, die in ihrer Form streng mechanischen Gesetzen gehorchen, also wenigstens den Anschein einer ganz exakten Wissenschaft erheben, die Prognosen präzise formulieren kann. Die wohl einflußreichste ökonomische Schule innerhalb der gesamten Ökonomie ist die Chicago-Schule. Sie hat in den 80er und 90er Jahren des vorigen Jahrhunderts wohl die meisten Nobelpreisträger hervorgebracht. Einflußreichster Kopf dieser Schule ist Milton Friedman. Und Milton Friedman ist durch seine besondere Interpretation der ökonomischen Theorie bekannt geworden. Er nennt seine Variante „Positive Ökonomie“ (*positive economics*).

Darin knüpft Friedman an Überlegungen an, die letztlich auf Auguste Comte zurückgehen. Comte definierte eine *positive* Wissenschaft als eine, die fähig ist, *gültige Prognosen* zu formulieren. Friedman übernimmt diesen Gedanken und geht sogar soweit zu sagen, daß die *Annahmen der Ökonomen* keineswegs realistisch sein müssen; worauf es *einzig ankomme*, sei, überprüfbare Prognosen zu formulieren. Ein ähnliches Prinzip für die Wissenschaftstheorie hat Karl Popper formuliert. Legt man diesen Maßstab an, dann offenbart sich allerdings ein Fiasko der ökonomischen Theorie: Irgendetwas muß falsch sein, wenn auf dieser methodischen Basis unentwegt Prognosen formuliert werden, die *scheitern*. Nach Friedman spielen die Annahmen der Theorie keine Rolle; sie können sogar, nach seiner Auffassung, unmittelbar den Tatsachen widersprechen.

Wenn aber Prognosen eher scheitern als gelingen, dann muß in dieser Auffassung, in diesen *philosophischen Grundlagen der Ökonomie*, die von der Ökonomie selbst als Wissenschaft nicht re-

⁸ A. Smith, *Theorie der ethischen Gefühle*, Hamburg 1977, S. 318.

⁹ A. Smith, *History of Astronomy*; in: *Essays on Philosophical Subjects*, London 1795, S. 44.

¹⁰ G. und H.-W. Sinn, *Kaltstart*, Tübingen 1991, S. VII.

flektiert werden, der Fehler zu suchen sein. Und exakt das ist meine These. Heidegger hat einmal in einem provokativen Satz gesagt: „Die Wissenschaft denkt nicht.“ Dieser Satz ist so zu verstehen: Die Wissenschaft denkt in einem Rahmen, der *als dieser Rahmen* stillschweigend vorausgesetzt wird. Man hinterfragt ihn nicht. Thomas S. Kuhn nennt solch einen Rahmen „Paradigma“; ich habe mehrfach zu zeigen versucht, daß sich tatsächlich metaphysische Voraussetzungen hinter diesem Rahmen verbergen. Doch wie immer man diesen Rahmen auch äußerlich beschreibt: Es gibt ihn. Er lenkt das Denken der Ökonomen auf eine Weise, die sie einerseits veranlaßt, unentwegt mit mathematisch exakten Modellen zu rechnen und Prognosen zu erstellen, andererseits aber mit ebensolcher Regelmäßigkeit sich den Vorwurf gefallen lassen muß, daß die aus diesen Modellen entwickelten Prognosen *falsch* sind. Dieser Rahmen, der nicht hinterfragt wird, ist die *Mechanik*. Ökonomische Modelle sind – in einem weiteren Sinn – *mechanische* Modelle.

Und tatsächlich funktioniert diese Maschinentheorie als physikalisch-technische Theorie. Hier zeigt sich auch sofort der entscheidende Unterschied zur Ökonomie: Stellen Sie sich bitte vor, ein Brückenbauer habe eine Brücke entworfen, Belastungen ermittelt usw. Nachdem die Brücke gebaut wurde, stellt sich nach kurzer Zeit heraus, daß sie den Belastungen nicht standhält und zusammenbricht. Oder wählen wir ein noch naheliegenderes Beispiel: Ein Chefarzt einer Klinik stellt eine Diagnose; Behandlungen werden eingeleitet, doch der Patient trägt schwere Schäden davon, weil eine Fehldiagnose vorlag oder bestimmte Faktoren nicht berücksichtigt wurden. Was wird geschehen? Es wird jeweils zu einem Prozeß mit erheblichen Schadensersatzsummen kommen. Architekten und Ärzte haften für „Kunstfehler“.

Und die Ökonomen? Sie prognostizieren Wirtschaftsverläufe, beraten Regierungen oder lenken indirekt die Maßnahmen der Geldpolitik. Am Ende erweisen sich Prognosen nachweisbar als falsch; verkehrte Maßnahmen wurden ergriffen, vielleicht gehen Firmen in Konkurs und viele Menschen stehen auf der Straße. Käme jemand auf den Gedanken, die Ökonomen auf Schadensersatz zu ver-

klagen? Ich habe mehrfach, sozusagen in der Höhle des Löwen, vor Kollegen die Forderung erhoben, daß man Wirtschaftsforschungsinstitute, Zentralbankräte, Beratungsgremien der Regierung, die Prognosen erstellen, *wenigstens* in ihrer Entlohnung vom Prognoseerfolg abhängig machen sollte. Können Sie sich vorstellen, wie die Reaktion war? „Nestbeschmutzer“ war noch die harmloseste Vokabel, die ich zu hören bekam. Doch was spricht eigentlich dagegen? Die Ökonomen sind *Gläubige*. Sie glauben an den Markt. Weshalb sollte man den Marktmechanismus ausgerechnet bei Prognosen außer Kraft setzen?

Ich weiß, daß ich mit meinem Vorschlag kaum durchdringen werde. Die Ökonomen wissen nämlich sehr genau, daß die Voraussetzung ihrer mechanischen Modelle gar nicht zutreffen. Die Wirtschaft verändert sich offenbar auf *unvorhersehbare* Weise. Sogar Wetterprognosen, die eigentlich zu unrecht einen schlechten Ruf haben, weil sie oft sehr gut funktionieren, sind verglichen mit der Wirtschaft einfach. Das Klima ist sicher keine *einfache* Maschine, aber es sind letztlich immer noch physikalisch-chemische Prozesse, die exakten Gesetzen gehorchen. Deshalb ist die Hoffnung, immer bessere Klima-Modelle zu entwickeln, durchaus begründet. Dasselbe gilt für ein solch komplexes System wie den menschlichen Körper. Gewiß gibt es hier vielfache Wechselwirkungen mit der Psyche; sehr viele Krankheitsphänomene kann die moderne Medizin aber erklären und erfolgreich bekämpfen. (Alle Esoteriker, die sonst Wochenendkurse für Geistesheilung veranstalten, gehen bei einer Blinddarmentzündung ganz brav in eine traditionelle Klinik.) Kurz: Auch sehr komplexe Systeme können, wenn auch unter erheblichen Schwierigkeiten, teilweise recht gut prognostiziert werden.

Ist nicht die Wirtschaft auch „nur ein komplexes System“? Viele Soziologen und Ökonomen behaupten das. Und ich will das nicht bestreiten. Dennoch wird hier die Pointe vergessen. Und ich möchte diese Pointe zuerst durch ein Beispiel verdeutlichen. Denken Sie sich bitte, ein kluges Team von Ökonomen, bewaffnet mit den umfangreichsten Statistiken und den besten Computern, ausgestattet mit den neuesten Modellen einschlägiger Fachzeitschriften, entwickeln ein ausgeklügeltes Modell zur Prognose

eines Preises, vielleicht für einen Rohstoff oder für ein Wertpapier. Es gibt nun zwei Möglichkeiten: Die Ökonomen formulieren ein Modell und prognostizieren den Verlauf des Preises für das kommende Jahr – behalten aber das Ergebnis für sich. Es ist klar, daß das Modell dann keinerlei Bedeutung hat; es bleibt eine Elfenbeinturmspielerei, wovon es in zahllosen ungelesenen Aufsätzen und Dissertationen (oder Gutachten) genug gibt. Wichtiger ist die zweite Möglichkeit. Nehmen wir an, das Experten-Team aus Ökonomen habe einen hohen Bekanntheitsgrad; große Wirtschaftszeitungen berichten über ihre Arbeit, sie treten in Talk-Shows auf und werden von Politikern zitiert.

Was denken Sie: Wenn diese Experten für Juni bei einem Wertpapier einen gesunkenen Kurswert auf 80 DM, für August aber einen gestiegenen Wert von 120 DM vorhersagen, was wird geschehen, wenn die Prognose Ende Mai veröffentlicht wird? Es ist nicht schwer, diese Frage zu beantworten: Die Anleger, die den Experten (wie wir annehmen wollen) vertrauen, werden dieses Wertpapier Ende Mai massiv einkaufen. Mit welchem Effekt? Der Kurswert wird im Juni keineswegs 80 DM pro Stück betragen, sondern vielleicht sogar höher liegen als die für August prognostizierten 120 DM. Das Veröffentlichen der Prognose hat sie falsch gemacht. Oder, wie ich in der Sprache der Wissenschaftstheorie sagen möchte: Veröffentlichte Prognosen haben die Tendenz, sich selbst zu *falsifizieren*. Entweder werden die Werte überboten und unterschritten, kaum aber getroffen.

Ein weiterer Punkt – den ich hier nur anreißen kann – kommt hinzu. Wenn jemand eine Prognose hört, die sich auf *Handlungen* bezieht, dann kann ein freier Mensch immer „Nein!“ zur Prognose sagen. Deshalb führt die konsequente Anwendung der ökonomischen Modelle auch zu Paradoxien: Sagt man ein Ereignis voraus und macht es bekannt, so können die Marktteilnehmer sich *anders* verhalten. Verhalten sie sich aber anders, dann wurde das Ereignis gar nicht vorhergesagt. Menschen sind *frei und kreativ*. Sie reagieren auf Umweltänderung, sie reagieren aber auch auf *Kommunikationsprozesse*. Prognosen sind Teil eines Kommunikationsprozesses. Man kann aber kreative Prozesse nicht vorhersagen: Ein Ökonom mag

für ein Produkt sinkende Preise prognostizieren, aber er kann nicht prognostizieren, ob nicht eine Firma aufgrund dieser Tatsache *ein neues Produkt* entwickelt, das das alte verdrängt und damit das gesamte Modell obsolet macht.

Vergleichen wir diese Situation in der Wirtschaft mit einer Wetterprognose oder der Prognose für die Flugbahn eines Planeten. Wie viele Menschen auch immer davon wissen mögen, die Veröffentlichung der Vorhersage hat keinen Einfluß auf das Wetter oder den Umlauf des Mondes um die Erde. Deshalb *funktionieren mechanische Theorien* in der Natur. Zwischen dem Beobachter, dem Theoretiker, und seinem Gegenstand gibt es keine Wechselwirkung. Ganz anders bei den Sozialwissenschaften. Die Wissenschaftler sind *Teil* der Gesellschaft, Teil eines Kommunikationsprozesses. Es ist einfach nicht wahr, daß die Vergesellschaftung der Menschen nur durch Kauf und Verkauf erfolgt: Menschen sprechen miteinander, streiten oder sie verlieben sich, sie gründen Vereine und bekennen sich zu gemeinsamen Religionen. Kurz: Die Menschen sind auf vielfältige Weise „vergesellschaftet“, voneinander abhängig. Der Markt ist nur *eine Form* unter vielen, in denen sich die verschiedenen Individuen aufeinander beziehen.

Die Ökonomie als Wissenschaft ist *Teil* der Gesellschaft. Deshalb gibt es bei Prognosen nur *zwei* Möglichkeiten: Entweder sie sind *nutzlos*, weil sie unbekannt bleiben, viel zu kompliziert sind oder einfach nicht beachtet werden; oder aber sie werden beachtet, tauchen in den Medien auf, man spricht darüber. *Dann* beeinflusst die Prognose die Handlungen, die Entscheidungen, keineswegs nur in der Politik, auch in der Privatwirtschaft. Und deshalb hebt die Veröffentlichung der Prognose ihre eigene Voraussetzung auf.

Hinzu kommt, daß wir selbst dann, wenn es gelingen würde, bestimmte wirtschaftliche Tatsachen exakt vorherzusagen, nie wissen können, wie Menschen darauf *reagieren*. Sicher gibt es gewohnheitsmäßige Reaktionen, die in der Marktforschung teilweise recht gut vorhergesehen werden, z. B. beim Kaufverhalten. Menschen reagieren aber auch *kreativ*. Und kreative Handlungen kann man nicht prognostizie-

ren; das ist ein logischer Widerspruch: Wenn man für das nächste Jahr in diesem Jahr ein neues Produkt prognostiziert, dann ist das Produkt ja schon bekannt. Der Prognostiker wäre selbst der Erfinder. Wir wissen einfach nicht, ob die Leit-Technik von morgen das Internet und der Mobilfunk, die Biotechnik, eine neue Form der Medizin oder vielleicht auch nur eine Seuchen-Prävention sein wird.

Wenn wir ein Lexikon aufschlagen – ich wähle Gablers Wirtschaftslexikon so lesen wir unter dem Stichwort Prognose: „Grundlage jeder Prognose ist eine allgemeine Stabilitätshypothese, die besagt, daß gewisse Grundstrukturen in der Vergangenheit und Zukunft unverändert wirken.“¹¹ Das ist völlig richtig. Man kann eine Mondfinsternis prognostizieren, weil die Gravitationsgesetze unverändert gelten. In der Wirtschaft verschwinden jedoch alte Produkte und neue tauchen auf, weil die Menschen kreativ sind – die „Stabilitätshypothese“ ist für menschliches Handeln nur bei starren Gewohnheiten geeignet. Vor allem werden Naturgesetze durch die Wissenschaftler in keiner Weise beeinflusst. Aber Prognosen von Banken für den Aktienmarkt, Prognosen der Bundesregierung, der Zentralbank oder der Fünf Weisen für die Gesamtwirtschaft *beeinflussen Handlungen*. Und das ist sogar die *Absicht* der Prognostiker.

Im Jahresgutachten 1994/95 hat sich der Sachverständigenrat einmal grundsätzlich zu Prognosen geäußert und in der Ziffer 189 gesagt: „Auch dann, wenn Prognosen durch die Entwicklung im nachhinein nicht bestätigt werden, folgt daraus nicht, daß sie von Anfang an wertlos waren.“ Das ist eine seltsame Vorstellung von „Prognose“. Eine Prognose soll einen *faktischen Verlauf* vorhersagen. Wie kann eine *Fehlprognose* nützlich sein? Das Rätsel löst sich, wenn wir weiter lesen. Trotz Fehlprognose, sagt der Rat, habe die Prognose etwas Gutes bewirkt, denn: „Insofern hat die Prognose vielleicht etwas bewirkt und mit dazu beigetragen, daß die Entwicklung besser verlaufen ist.“¹² Diese Bemerkung

¹¹ Gablers Wirtschaftslexikon, 12. Auflage, Wiesbaden 1988, S. 1043.

¹² Jahresgutachten 1994/95 des Sachverständigenrates zur Begutachtung der gesamtwirtschaftlichen Entwicklung, Ziffer 189.

dient mir als Überleitung zu meinem letzten Punkt.

5 Warum werden falsche Prognosen dennoch erstellt?

Die Ökonomen geben sich den Anschein, sie könnten den Verlauf der Wirtschaft wie eine etwas komplexere Maschine berechnen. Das *gelingt* ihnen aber nicht. Dennoch werden weiterhin Prognosen erstellt. Der zitierte Satz aus dem Sachverständigenratsgutachten kann hier einen Aufschluß geben: Prognosen *sollen* gar nicht die tatsächliche Entwicklung vorhersagen, sie sollen vielmehr *Einfluß* nehmen auf den wirtschaftlichen Verlauf. Sie sollen eine gute Stimmung verbreiten. Insofern haben Politiker den Sinn von Wirtschaftsprognosen oft besser verstanden als Ökonomen. Politiker halten an Prognosen fest, wie sie an einem Wahlprogramm festhalten. Die Prognose dient nicht der Vorhersage eines *tatsächlichen Verlaufs*, die Prognose soll *Handlungen* auf eine bestimmte Weise verändern oder Veränderungen verhindern.

Eine Aussage, die aber nicht *erklären*, also Faktoren prognostizieren möchte, sondern die darauf abzielt, *Handlungen* in eine bestimmte Richtung zu lenken, hört auf, eine *positive Wissenschaft* zu sein. Eine sog. Prognose, die Handlungsmotive beeinflussen möchte, ist keine wissenschaftliche Vorhersage, sondern eine *Moral*. Deshalb lautet meine Kernaussage: Die moderne Ökonomie ist keine Wissenschaft, sondern eine *implizite Ethik*.¹³ Sie ist eine Ethik, weil sie Prognosen formulieren möchte, die Handlungen verändern. Aber sie sagt das nicht ehrlich und offen. Sie versteckt sich hinter einem Nebel aus Mathematik und führt die Öffentlichkeit in die Irre. John Maynard Keynes, der an den Hochschulen leider viel zu wenig im Original gründlich gelesen und studiert wird, sagte einmal (ich übersetze frei):

¹³ Vgl. K.-H. Brodbeck, Ökonomie ist Ethik! Ethik Letter 1/1998, S. 69 (Interview; Fragen von Norbert Copray); K.-H. Brodbeck, Verborgene Werte in der globalen Ökonomie. Aspekte impliziter Ethik, Ethik Letter 3/1999, S. 411; K.-H. Brodbeck, Die Nivellierung der Zeit in der Ökonomie; in: J. Manemann (Hrsg.), Befristete Zeit, Jahrbuch Politische Theologie, Band 3 (1999), S. 135-150.

„Ein zu großer Teil der neuen ‚mathematischen‘ Ökonomie ist nur ein Gebräu, ebenso ungenau wie die getroffenen Annahmen auf denen sie beruht. Sie erlaubt dem Autor, in einer Masse aufgeblasener und nutzloser mathematischer Symbole den Blick für die Komplexität und Interdependenz der wirklichen Welt zu verlieren.“¹⁴

Dieser Satz steht nicht irgendwo, er steht im *Hauptwerk* von Keynes: *The General Theory of Employment, Interest and Money*, das 1936 erschienen ist und zwar viel zitiert, aber – nach meiner Erfahrung – auch von Fachkollegen selten wirklich gelesen wird. Keynes war es auch, der gesagt hat: „Economics is essentially a moral science and not a natural science.“¹⁵ Wenn Prognosen ohnehin nur *implizite Ethik* sind, dann – so lautet meine Forderung an die Verantwortungen der Wirtschaftswissenschaften – sollten die Ökonomen das auch laut sagen. Sie sollten zugeben, daß man, wie ich es in der Praxis häufig erlebt habe, nachdem man mit großem Aufwand eine Prognose erstellt hat, in der abschließenden Sitzung, bevor eine Institution diese Zahl veröffentlicht, solange daran herumdreht, bis sie „in die Landschaft“ paßt und mit den allgemeinen politischen und den Überzeugungen anderer Institutionen oder Meinungsführer übereinstimmt.

Ich fordere die Ökonomen eigentlich nur auf, *ehrlich* zu sein und zuzugeben, daß sie häufig nur Luftnummern veranstalten, mit beeindruckenden Zahlenkolonnen und mathematischen Anhängen (die außer einigen jungen Doktoranden doch niemand liest), aber dennoch ihre Prognosen als *implizite Ethik* meinen. Ernst Helmstädter, von 1983 bis 1988 Mitglied im Sachverständigenrat, hat mit aller nur erdenklichen Deutlichkeit das zugegeben, wenn er einen Artikel wie folgt überschreibt: „Zur Warnung vor Fehlentwicklungen eben schon mal eine Fehlprognose!“¹⁶ Hier wird unge-

schminkt der ethisch-politische Charakter der Prognose ausgesprochen.

Wenn das aber wahr ist, dann ist es unredlich, so zu tun, als verfüge die Ökonomie über ein ausgefeiltes wissenschaftliches Instrumentarium zur Vorhersage des Verlaufs der „Wirtschaftsmaschine“, bei der man nur an bestimmten Rädchen drehen müsse, um Wohlstand für alle zu produzieren.

6 Schlussbemerkung

Ich komme zum Schluss. In der vergangenen Stunde habe ich vorwiegend Kritik geübt an der traditionellen Form, Wirtschaftswissenschaft zu betreiben. Meine Kernaussage war, daß die Vorstellung, die Wirtschaft sei eine Maschine, deren Funktion man berechnen und vorhersagen könne, unhaltbar ist. Erstens führt sie zu inneren Widersprüchen (ich erinnere an die Prognose des Verlaufs eines Aktienkurses), zweitens haben auch nach dem Eingeständnis führender Ökonomen Prognosen nicht eine erklärende, sondern eine *ethische* Funktion. Ökonomie ist Ethik geblieben, d.h. der Versuch, Handlungen zu beeinflussen, zu steuern, in erwünschte Bahnen zu lenken.

Ich möchte gegen diesen Versuch gar nichts prinzipiell einwenden. Viele ökologische Fragen z. B. machen es unabdingbar, daß wir alle unser Verhalten ändern, und hier ist ein weites Feld für Überlegungen, wie dies am sinnvollsten und möglichst schmerzfrei geschehen kann. Doch man muß ganz klar sagen: All dies sind keine *positivwissenschaftlichen* Aussagen wie die Erklärung einer chemischen Reaktion oder der Flugbahn einer Rakete. Es wäre der Öffentlichkeit gegenüber ein Gebot der *Fairness*, wenn die Ökonomen ausdrücklich *sagen würden*, daß sie eigentlich *Ethiker*, nicht aber wertneutral erklärende Wissenschaftler sind. Ökonomen sollten *Gesprächspartner* der Öffentlichkeit, der Wirtschaft, der Verbände, der Staatsorgane

sein und nicht so tun, als würden sie aus der Vogelperspektive die Gesamtheit dieser Prozesse wie ein ferner Beobachter „erklären“. Die Wirtschaft ist eben keine Maschine. Und Ökonomen sind keine Physiker oder Chemiker. Sie *erklären* nicht einen leblosen Gegenstand, sie sprechen zu *lebendigen Menschen*.

¹⁴ J.M. Keynes, *The General Theory of Employment, Interest and Money*, Collected Writings Vol. VII, London-Basingstoke 1973, S. 297/98.

¹⁵ J. M. Keynes, *The General Theory and After*, Part II, Collected Writings Vol. XIV, London-Basingstoke 1973, S. 297.

¹⁶ Handelsblatt vom 23. Januar 1995.