

Vertrauen in den/die Wirtschaftswissenschaften

Ich freue mich, jetzt aus der Perspektive des Wirtschaftswissenschaftlers zu sprechen. Wir Ökonomen haben seit der Krise sehr an Ansehen verloren, und ich denke, dass falsche Erwartungen dies erklären. Vielfach wurden und werden die Möglichkeiten ökonomischer Erkenntnis überschätzt, und das passt gut zu den Beiträgen meiner Vorredner. Dort wurde schon einiges an Kritik geäußert; das muss man sicherlich verstärkt für die Wirtschaftswissenschaften, vielleicht für die Sozialwissenschaften insgesamt akzeptieren. Lassen Sie mich das kurz an drei Facetten klar machen. Es gibt in der Wirtschaftswissenschaft eine umfangreiche theoretische Forschung, eine umfangreiche empirische Forschung und dann natürlich auch das Thema „Beratung“.

Ich fange mit der *theoretischen* Forschung an. Unsere Modelle gehen von bestimmten Annahmen aus, daraus werden Schlussfolgerungen abgeleitet. Das sind häufig mathematische Modelle. Daher lässt sich schnell prüfen, ob die Schlussfolgerungen korrekt abgeleitet sind. Gibt es hier ein Vertrauensproblem? Nun, sicherlich nicht in Bezug auf die Ableitung der Schlussfolgerungen, aber das Vertrauensproblem stellt sich bei den gesetzten Annahmen. Oft werden die Annahmen so gewählt, dass es nette mathematische Resultate gibt. Hier haben wir dann das Thema: „Ist es *l'art pour l'art*?“ Viel gravierender wird es, wenn der Forscher behauptet, dass die Modellergebnisse für die Lösung von praktischen Problemen geeignet sind. Hier ist zu prüfen, ob die relevanten Teile des praktischen Problems im Modell zutreffend abgebildet werden oder nicht. Und darüber wird häufig gestritten. Dazu muss man allerdings sagen, dass jedes saubere Denken Modell-Denken ist, basierend auf sauber definierten Annahmen. Daher ist jedes Denken der möglichen Kritik ausgesetzt, dass die Annahmen nicht sinnvoll gewählt wurden.

Kommen wir zur *empirischen* Forschung. Hier gibt es triviale Hypothesen, über die streitet man nicht. Die wissenschaftlich interessanten Hypothesen dagegen sind die kontroversen: A priori gibt es dann Argumente, die die eine Wirkungsrichtung stützen, und andere Argumente, die die umgekehrte Wirkungsrichtung stützen. Eine Klärung kann dann nur durch die Empirie herbeigeführt werden. Wenn wir nach Popper vorgehen, dann müssen wir eine Hypothese verwerfen, wenn sie einmal

falsifiziert ist. Das ist aber, denke ich, völlig abwegig. Denn wenn wir von Bestätigungsgraden bei unseren Hypothesen sprechen, dann von solchen, die vielleicht bei 60 oder 70% liegen, aber sehr selten an 100% herankommen. Das ist auch nicht erstaunlich, denn die interessanten Hypothesen versuchen, die Realität mit relativ einfachen Konstrukten abzubilden. Das heißt, es werden von vornherein Faktoren, die in der Realität vermutlich nur eine Nebenrolle spielen, gar nicht berücksichtigt. Wollten wir nämlich eine komplizierte Hypothese, die auf vielen Faktoren beruht, testen, wäre 1. die Testproblematik sehr ausgeprägt und 2. wäre das auch keine schöne Hypothese, weil ihre Prognosekraft von vornherein sehr stark eingeschränkt wäre. Daher haben wir es oft mit Bestätigungsgraden von 60, 70, 80% zu tun – damit ist natürlich das Vertrauen in diese Hypothese angezweifelt, und das ist wahrscheinlich notwendigerweise so.

Kommen wir 3. zur *Beratungsseite*: Ökonomen werden nicht selten zur Beratung herangezogen. Wir verwenden ökonomische Modelle für die Steuerung von Unternehmen. Sie kennen alle mein erstes Beispiel: In der Risikosteuerung von Banken haben wir in den letzten 20, 30 Jahren eine Reihe von Modellen entwickelt, Wahrscheinlichkeitsmodelle, die bestimmte Risikokennzahlen auswerfen. Diese sollen den Vorstand der Bank in die Lage versetzen, die Bank so zu steuern, dass sie nicht in eine Schiefelage hineinrutscht. Wir wissen, dass diese Modelle in der Finanzkrise versagt haben. Damit stellt sich die Frage: Warum? Zweites Beispiel: Der Ausbruch der Finanzkrise hat in zahlreichen Staaten über diverse Wirkungsmechanismen zu einer Verschuldungskrise der Staaten geführt. Diese hat ein doppeltes Problem ausgelöst: Wir haben 1. das Problem, die Verschuldung von Staaten wieder herunterzufahren, 2. aber wollen wir die unangenehmen Folgen dieses Herunterfahrens vermeiden. Das führt zu sehr kontroversen Empfehlungen. Viele Ökonomen in den USA sagen: „Pumpt Geld in die Wirtschaft, immer mehr, um die Arbeitslosigkeit zu senken.“ Hier in Europa, besonders in Nordeuropa, setzen viele Ökonomen auf Austeritätspolitik, also zuerst die Staatsverschuldung herunterfahren, um den Staat wieder glaubwürdig und langfristig handlungsfähig zu machen. Die Standpunkte der Ökonomen stehen sich unversöhnlich gegenüber, und auch hier ist die Frage: Warum können wir die Kontroverse nicht lösen? Die Politiker wissen um die Kontroversen der Ökonomen und nutzen die daraus für sie entstehende Freiheit: „Wir suchen erst einmal ein parteipolitisch gutes Konzept, und dann finden wir schon den Ökonomen, der wissenschaftlich untermauert, dass das Konzept richtig ist.“

Wie kommt es zu dem Mangel an Vertrauen in die Ökonomie? Nicht selten stellen mir naturwissenschaftliche Kollegen die Frage: „Wieso

sind eure Prognosen so viel schlechter als Prognosen in der Naturwissenschaft?“ Wir haben es vorhin schon von Herrn Klein und Frau Grüters-Kieslich gehört, auch in der Naturwissenschaft sind die Prognosen keineswegs immer gut. Wenn wir in der klassischen Newton'schen Welt leben, dann ist alles sehr einfach. Aber wenn wir an die von Herrn Grötschel angesprochene Erdbeben-Prognose denken, haben wir es schon mit erheblichen Problemen zu tun. Und ein biomedizinischer Kollege sagte mir kürzlich: „Immer, wenn wir neue Wirkstoffe ausprobieren, folgen wir einem reinen Trial-and-Error-Verfahren. Wir probieren tausend Substanzen aus und hoffen, dass irgendeine Substanz ein ganz gutes Ergebnis bringt.“

Trotzdem ist die naturwissenschaftliche Prognose im Ansatz viel einfacher als die Prognose bei uns oder auch bei den anderen Sozialwissenschaften. Ich stelle das hier auf simple Art und Weise dar. In der Naturwissenschaft prognostizieren wir die Zukunft ausgehend von einem Zustand heute, den wir hoffentlich sauber beobachten können. Und dann ist es das gewesen. Das funktioniert in der Ökonomie nicht. Wir hörten heute morgen in unserer Klasse einen schönen Vortrag über CO₂-Emissionen, und da tauchte unter anderem dieses Beispiel auf: Als 2003 die Bundesregierung anfang, alle möglichen Subventionen im „Erneuerbare-Energien-Gesetz“ für Solarenergie zu versprechen, haben viele deutsche Firmen gedacht, „das ist wunderbar, da können wir viel Geld verdienen“. Dementsprechend wurden hier in Deutschland große Kapazitäten aufgebaut, schließlich auch in den USA. Das war zunächst auch völlig verständlich, denn man hat zu Recht eine hohe Nachfrage prognostiziert. Man hat aber in diesem Prognose-Modell nicht berücksichtigt, dass es in China eine Regierung und auch Unternehmen gibt, die auch nach attraktiven Möglichkeiten suchen, Geld zu verdienen. Sie haben damals schnell erkannt, dass im Solarbereich durch Regierungsunterstützung ein profitables Geschäftsfeld entsteht. Und so kam zu einem enormen Kapazitätsaufbau bei der Erzeugung von Photovoltaik-Zellen. Das Ergebnis kennen wir alle. Es ist eine enorme Überkapazität im Markt vorhanden – was damals als profitables Geschäftsmodell wahrgenommen wurde, ist ein Verlustmodell geworden. Die deutschen Solarfirmen sind zu einem großen Teil insolvent geworden, selbst die großen chinesischen Firmen schreiben rote Zahlen.

Warum hat das Prognose-Modell versagt? In einem ersten Schritt prognostizieren wir wie in der Naturwissenschaft. Wir gehen von einem gegebenen, postulierten Zustand heute aus und machen Wahrscheinlichkeitsaussagen über die Zukunft. Aber das Entscheidende ist nun, dass diese Prognosen Rückwirkungen auf das Verhalten von anderen Spielern haben, und diese Rückwirkungen machen unseren postulierten

Ausgangszustand zunichte. Er sieht nun anders aus. Dann entwickeln wir im zweiten Schritt eine neue Prognose; diese hat wiederum Rückwirkungen auf das Verhalten von anderen Spielern, sodass wir sozusagen einen Prognose-Kreislauf bekommen. Wenn wir Glück in der Ökonomie haben, dann gibt es ein Gleichgewicht, dann können wir sagen: „Ja, wohl, das Ganze konvergiert auf eine endgültige Prognose zu.“ Häufig können wir keine eindeutige Gleichgewichtsprognose machen, und wenn wir Pech haben, haben wir es mit einem infiniten Regress zu tun. Und in diesem Fall funktioniert die Prognose überhaupt nicht mehr.

Das erklärt, warum wir im sozialwissenschaftlichen Bereich viel größere Probleme mit Prognosen als im klassischen naturwissenschaftlichen Bereich haben. Interessanterweise geht auch die empirische Forschung in der Ökonomie jetzt von einfachen Kausalitätskonzepten etwas weg. Wir wissen, dass viele Faktoren zusammenwirken und dass wir in Modellen diese zahlreichen Faktoren nicht sauber abbilden können. Jetzt versuchen wir, die möglichen Wechselwirkungen gleichzeitig in mehreren Gleichungen empirisch zu schätzen und daraus eine bessere Prognose der Wirkungen von Schocks auf ökonomische Variablen abzuleiten – damit ist das klassische Kausalitätskonzept zugunsten eines Prognosekonzepts weitgehend aus dem Blickfeld geraten.

Um zur Beratung zurückzukommen: Wenn wir mit Banken über Wahrscheinlichkeitsmodelle sprechen, wissen wir, dass diese auf restriktiven Annahmen beruhen. Sind diese nicht (mehr) erfüllt, dann ist es nicht erstaunlich, dass die Modellprognose zusammenbricht. Oder in der Politik das Beispiel Austeritätspolitik versus Keynesianische Stützung durch expansive Staatsausgaben: All die Ökonomen, die das eine oder andere fordern, machen das durchaus „faithful“, also in gutem Treu und Glauben, weil sie überzeugt sind, dass das richtig ist. Aber keiner weiß, ob es wirklich das Richtige ist. Wir haben einfach keine ausreichend guten Prognose-Modelle, um verlässlich sagen zu können: „Das ist jetzt die richtige Politik.“ Prognosen zu den Wirkungen von Politik können oft nicht als „richtig“ oder „falsch“ klassifiziert werden. Deswegen überrascht es nicht, dass die Politiker wenig Vertrauen in diese Aussagen haben; sie achten wieder stärker auf ihr Bauchgefühl. Auch in den Banken sagen wir den Managern: „Achtet wieder stärker auf euer Bauchgefühl.“ Das heißt nicht, dass man die quantitativen Modelle vergessen soll, aber wir haben die Rolle der quantitativen Modelle deutlich redimensioniert, sie spielen heute eine kleinere Rolle. Also lautet unsere Schlussfolgerung: Vertrauen in das, was wir empfehlen, in das, was wir als Steuerungsinstrumente benutzen, dieses Vertrauen muss einer gesunden Skepsis unterliegen; nur dann haben wir eine Chance, mit solchen Konzepten sinnvoll zu arbeiten.