

Buchbesprechungen

Ludwig-Erhard-Stiftung e. V. (Hrsg.): Eigentum als Grundrecht und Element der Ordnungspolitik. Symposium XII. Gustav Fischer Verlag, Stuttgart - New York 1984. IV, 75 S. Kart. DM 24,—.

Ihr XII. Symposium, das am 28. März 1984 stattfand, hat die *Ludwig-Erhard-Stiftung* der Eigentumstheorie gewidmet. Das Tagungsbändchen enthält neben Referaten von *Ernst Benda* und *Helmut Leipold* das Protokoll der Diskussion, an der außer den Referenten zehn Wissenschaftler und Praktiker teilnahmen.

Der ehemalige Präsident des Bundesverfassungsgerichts, *Ernst Benda*, verbindet in seinem Referat „Eigentum als Grundrecht“ auf sehr geschickte und rhetorisch ansprechende Weise Erfahrungen aus seiner Arbeit als Verfassungsrichter mit Überlegungen zur Geschichte des Eigentumsschutzes und persönlichen Stellungnahmen zu Einzelaspekten aktueller Eigentumspolitik. Er argumentiert ausschließlich vom Standpunkt der deutschen Rechtswissenschaft und Rechtsprechung aus; ökonomische Aspekte spielen hier eine untergeordnete und zweitrangige Rolle.

Die „ökonomische Analyse des Rechts“, die vor allem auf R. A. Posner (1977 und 1981) zurückgeht, aber auch im deutschsprachigen Raum schon einigen Einfluß ausgeübt hat (H.-D. Assmann, C. Kirchner, E. Schanze (Hrsg.), (1978)), findet noch nicht einmal Erwähnung in *Bendas* Referat.

Im Referat von *Helmut Leipold* über „Neuere Ansätze der ökonomischen Theorie des Eigentums“ werden demgegenüber einige Aspekte der „Ökonomie der Property Rights“ dargestellt, die geradezu als theoretische Grundlage der „ökonomischen Analyse des Rechts“ gelten kann. Bei derart verschiedenen theoretischen Ausgangspunkten ist es wenig verwunderlich, daß große Teile der Diskussion (S. 41 - 49) zunächst dem Versuch gewidmet sind, eine „gemeinsame Sprache“ zwischen Juristen und Ökonomen („Begriffliches: individuelle Handlungsrechte, Gemeinwohl und Freiheit“) zu finden und die Problemsicht des jeweils anderen („Die Unterschiede und die Bedeutung der juristischen und der ökonomischen Betrachtungsweise“) zu verstehen.

Die Diskussion und der Inhalt des Referates von *Benda* fallen daher inhaltlich weit hinter den Diskussionsstand zurück, wie er etwa in der *European Association for Law and Economics* (deren erste Jahrestagung im Juni 1985 vom Wissenschaftszentrum Berlin veranstaltet wurde) erreicht ist. Aber was aus wissenschaftlicher Sicht möglicherweise überholt oder redundant ist, kann aus praktischer und didaktischer Sicht als Brücke zwischen beiden Disziplinen sehr nützlich sein.

Zwischen beiden Referenten und den Diskussionsteilnehmern ist im Grundsatz vollkommen unstrittig, daß, wie es *Benda* formuliert, „die Garantie des Privateigentums ... der Sicherung der materiellen Existenz des einzelnen“ dient und daß „diese materielle Existenz die notwendige Voraussetzung menschlicher Freiheit“ ist. (S. 7) Ebenso unstrittig ist, daß die Ausübung von privaten Eigentumsrechten bestimmten „Sozialbindungen“ (Artikel 14, Absatz 2 Grundgesetz) zu unterliegen habe; keine Einigkeit herrscht allerdings darüber, von welcher Art derartige Sozialbindungen sein und welchen Grad sie annehmen sollen.

In der Terminologie der Ökonomie der Property Rights stellen „Sozialbindungen“ des Privateigentums „Verdünnungen“ (attenuations) des privaten Volleigentums dar, Abweichungen von der Verfügung eines einzigen Eigentümers über alle Rechte an einem Gegenstand, verdünnte Eigentumsrechte, können mehreren Berechtigten (im Extremfall: allen) zugleich oder aber bestimmte Teilrechte an einem Gegenstand können verschiedenen einzelnen zustehen. Solche Verdünnungen – oder, wenn sie sozialpolitischen Zielen dienen sollen: Sozialbindungen – des Privateigentums sind enorm vielfältig: sie reichen von Preisobergrenzen über Auflagen zum Zweck des Denkmalschutzes bis hin zur Haftungsbeschränkung für Eigentümer von Kapitalgesellschaften. Auf die Vor- und Nachteile (oder eigentlich nur: auf die Nachteile) einer ganz bestimmten Form der Sozialbindung des Eigentums konzentrierte sich die Diskussion: auf die gesetzliche Mitbestimmung der Arbeitnehmer in der Bundesrepublik Deutschland.

Diese spezifische Form der Eigentumsverdünnung sei, so *Leipold*, keine effiziente Organisationsform, was auch daran abzulesen sei, „daß sich die Mitbestimmung bisher nicht als Ergebnis freiwilliger vertraglicher Abmachungen der unmittelbar Beteiligten durchgesetzt habe, obwohl es dafür keine gesetzlichen Beschränkungen gebe“. (S. 30)

Dem Gesetzgeber wird in der Diskussion vorgeworfen, sich hier aus seiner „Totalverantwortung für die Sozialbindung“ (S. 62) geschlichen zu haben, denn es handle sich bei der Mitbestimmung erstmalig um „eine Bindung durch private Nichtinhaber gegenüber privaten Inhabern“. (S. 63)

Ernst Benda verteidigt halbherzig die Mitbestimmungsregelungen, über die er als Verfassungsrichter zu befinden hatte: „Natürlich habe ich mich hier nicht hingestellt, um die Mitbestimmungsentscheidung ... zu kritisieren. Erstens entspricht dies nicht ... meiner eigenen Beurteilung einer Sache, an der ich mitgewirkt habe. Es kommt ja vor, daß man an einer Entscheidung beteiligt ist, bei der man vom Ergebnis gar nicht so entzückt ist.“ (S. 63)

Helmut Leipold verbannt sie gar in den wirtschaftstheoretischen Orkus: wer eine effiziente Wirtschaftsordnung wünsche, müsse „sich für exklusive, teilbare, transferierbare und möglichst unverdünnte Eigentumsrechte, also für Privateigentum am Produktivvermögen entscheiden“. (S. 33) Er stützt sich bei diesem Urteil auf einige inhaltliche Argumente, die zur negativen Bewertung der Mitbestimmung „seitens der Vertreter der Property Rights-Theorie“ geführt haben (S. 29), denn die Mitbestimmung erhöhe einerseits die Transaktionskosten innerbetrieblicher Entscheidungen und setze auf der anderen Seite Verhaltensanreize, die negative allokativen Folgen haben. (S. 30)

Einige jüngere und sehr breit angelegte Untersuchungen, die durchaus auch auf dem Boden der Property Rights-Theorie stehen [J. Backhaus (1979); J. Backhaus, H. G. Nutzinger (Hrsg.) (1982); G. Schanz (1985)], kommen zu weit vorsichtigeren Einschätzungen. Den erhöhten Transaktionskosten stünden zusätzliche Nutzen gegenüber, zum Beispiel durch geregelte und nicht eskalierende Formen der Beilegung von Konflikten.

So mag denn, erzwungen durch die Kürze der Vorträge, die eine oder andere Aussage zu wenig differenziert sein. Und wahrscheinlich schadet man auch dem wissenschaftlich vielversprechenden Ansatz der Ökonomie der Property Rights, wenn man sie, wie ein einzelner Diskussionsteilnehmer vorschlug, in politische Dienste nimmt: „In den letzten Jahren hat eine Verdünnung des Eigentumsgehaltes stattgefunden. ... Dagegen muß etwas getan werden. Ich glaube, der Ansatzpunkt der nationalökonomischen Theorie für die Bekämpfung einer solchen Verdünnung ist gut.“ (S. 48)

Was vielleicht für die Mitbestimmung gilt, gilt ganz gewiß für das Buch: Gewissen Mängeln stehen große Vorzüge gegenüber. Es führt auf fachübergreifende und leicht verständliche Weise in das aktuelle Gebiet der Eigentumspolitik ein, und es stellt den modernsten Ansatz zu einer Analyse, die Ökonomie der Property Rights, kompetent vor.

Literatur

- Assmann, H.-D. / Kirchner, C. / Schanze, E. (Hrsg.) (1978), *Ökonomische Analyse des Rechts*. Kronberg.
- Backhaus, J. (1979), *Ökonomik der partizipativen Unternehmung I*. Tübingen.
- Backhaus, J. / Nutzinger, H. G. (Hrsg.) (1982), *Eigentumsrecht und Partizipation*. Frankfurt.
- Posner, R. A. (1977), *Economic Analysis of Law*. 2. A., Boston - Toronto.
- (1981), *The Economics of Justice*. Cambridge - London.
- Schanz, G. (1985), *Mitarbeiterbeteiligung*. München.

M. Tietzel, Duisburg

Teuteberg, Hans J. / Wischermann, Clemens (Hrsg.): *Wohnalltag in Deutschland 1850 - 1914. Bilder - Daten - Dokumente* (Studien zur Geschichte des Alltags, Bd. 3). F. Coppenrath Verlag, Münster 1985. 300 Fotos, 70 Tab. u. Abb., 488 S. DM 58,—.

Im Zuge der Hinwendung zu einer „Sozialgeschichte von unten“ in den letzten Jahren ist als eines der zentralen Themen auch die Geschichte des Wohnens aufgegriffen worden. Nachdem seit Ende der 1970er Jahre in rascher Folge eine beachtliche Zahl von Detailforschungsergebnissen veröffentlicht worden ist, die in erster Linie die Wohnverhältnisse der städtischen Unterschichten während der Früh- und Hochindustrialisierungsphase ins Blickfeld gerückt haben, beansprucht der nun von den beiden Münsteraner Historikern Teuteberg und Wischermann vorgelegte Quellenband, die durch die Urbanisierung im 19. Jahrhundert in Gang gekommenen radikalen Veränderungen der traditionellen Haus- und Wohnformen umfassend und „erstmalig systematisch zu dokumentieren“ (Vorwort). Die breite Palette der unter dem Oberbegriff des Wohnens subsumierbaren Einzelaspekte wird dabei in fünf Hauptkapiteln geordnet, denen die Herausgeber jeweils eine knappe Einführung, d.h. eine Erörterung der in den Quellen angesprochenen Grundprobleme sowie eine Erläuterung der jeweiligen Sachzusammenhänge und Auswahlprinzipien, voranstellen.

Um die Ausgangslage zu charakterisieren und somit eine Meßlatte für das Ausmaß der Veränderungen zu bekommen, werden im *ersten Teil* die traditionellen Wohnverhältnisse vor Beginn der Verstädterung auf dem Lande und in den Städten vorgeführt. Dabei legen die Herausgeber besonderen Wert darauf, die in der älteren Literatur vorfindbare Idyllisierung und entsprechende Verzerrung der Lebensbedingungen in der vormodernen Zeit zu widerlegen. Der *zweite Teil* dokumentiert im wesentlichen die Entstehung der großstädtischen Ballungsräume in der zweiten Hälfte des 19. Jahrhunderts, d.h. den Verstädterungsprozeß, der zwar eine Reihe von steuernden Eingriffen provozierte, die aber letztlich – vor allem unter dem Blickwinkel der Bebauung – „Anpassungsplanung“ blieben (S. 49). Gleichzeitig werden in diesem Teil grundlegende Charakteristika der Urbanisierung erörtert: die Trennung von Wohnung und Arbeitsplatz, die starke Mobilität vor allem der Unterschichten, die Entstehung eines intensiven Soges der großen Städte, die ihrerseits durch eine moderne „Leistungsverwaltung“ der neuen Probleme Herr zu werden suchten, die Herausbildung einer „ungesteuerten“ Wohnungswirtschaft sowie – als Reaktion – die Anfänge

einer konservativen Großstadtkritik. Wie die Wohnungsversorgung in den Großstädten im einzelnen aussah, belegt anschließend der *dritte Teil*, wobei von der die bürgerlichen Zeitgenossen besonders beunruhigenden ersten großen Krise der Wohnungswirtschaft in den frühen 1870er Jahren ausgegangen wird. Fragen des Mietrechts und die gesetzlichen Rahmenbedingungen des Bauens und Wohnens werden in diesem Zusammenhang ebenso angesprochen wie die langfristigen Trends der einerseits quantitativen, andererseits qualitativen Wohnungsversorgung vor dem Ersten Weltkrieg. Als besonders ins Auge fallende Wohnformen werden das Massenmietshaus als Regelfall und das Koloniehhaus, d.h. das von industriellen Unternehmern für ihre Belegschaft errichtete Wohnhaus, als Sonderfall vorgestellt. Darüber hinaus wird auch die Frage nach der Relation der Mieten zu den Einkommen, nach den vor allem hygienischen Besonderheiten der verschiedenen Wohnformen und nach den spezifischen gesundheitlichen Folgen des großstädtischen Wohnelands (z.B. die erhöhte „Sommersterblichkeit der Säuglinge“, S. 241 f.) angeschnitten.

Bewegen sich die herangezogenen Materialien in den ersten drei Teilen durchaus noch im üblichen sozial- und wirtschaftsgeschichtlichen Rahmen, so bemühen sich die Herausgeber durch ihre Quellenauswahl im *vierten Teil* um einen Schritt in ein schwer dokumentierbares historisches Neuland: in den Bereich der „Wohnerfahrung“, d.h. der Wahrnehmung des Wohnalltags durch die Betroffenen. Das Ergebnis zeigt, daß hier tatsächlich die größten Probleme einer Einschätzung des Wohnalltags im 19. Jahrhundert liegen. Zwar werden viele Indizien dafür vorgeführt, in welcher Umwelt die Menschen je nach sozialer Schicht, nach Alter und Geschlecht, nach Berufszugehörigkeit und Familienstatus lebten, wie ihre jeweilige „Wohnkultur“ beschaffen war und wo sich Konflikte entzündeten, doch bleiben hier noch viele Fragen – nicht nur quellenbedingt – offen: Die Sozialisations- und Kommunikationsstrukturen, die dauerhaften Prägungen, die sich einschleifenden Werthierarchien, die alltäglichen Handlungs- und Überlebensstrategien, die der Einzelne selektiv in seinem jeweiligen Wohnumfeld erlebte und in eigene Verhaltensweisen umsetzte bzw. aufgrund neuer Erfahrungen ergänzte oder revidierte, werden allenfalls andeutungsweise sichtbar. Dennoch ist gerade dieser Teil der farbigste des ganzen Bandes, weil hier in besonders starkem Maße autobiographische Materialien und zeitgenössische Beschreibungen herangezogen worden sind.

Der abschließende *fünfte Teil* ist der Wohnungsreformbewegung und der Wohnungspolitik gewidmet, wobei zwischen programmatischen Entwürfen zur Bewältigung der Wohnungsfrage, den Reaktionen vor allem der Kirchen und der Arbeiterbewegung auf das Wohnelend und den tatsächlich erfolgten Initiativen infolge der öffentlichen Wohnungsdebatte unterschieden wird. In diesem Teil des Bandes wird die politische Dimension des gesamten Problemspektrums, die bisher im wesentlichen unter dem Stichwort „Spekulation“ angeklungen ist, insofern in den Mittelpunkt gerückt, als hier die Interessenfronten und die unterschiedlichen Interessentengruppen vorgestellt werden und zugleich belegt wird, woran die Bemühungen um eine durchgreifende gesetzliche Regelung immer wieder scheiterten. Zwar lassen sich diverse sozialreformerische, kommunale und stadtplanerische Einzelinitiativen nachweisen, von denen die „Gartenstadtbewegung“ seit 1902 die wohl spektakulärste war, doch blieb es vor dem Ersten Weltkrieg – so zeigen die Quellen – bei „verstreuten Inseln einer neuen urbanen Lebensform“ (S. 372): Durchgreifendere Reformen hatten angesichts der Machtkonstellationen auf dem „liberalen“ Wohnungsmarkt keine Chancen. Nur durch einen beharrlichen reformerischen Alltagskleinkampf in den Kommunen konnte allmählich – vielfältig verzögert und zunächst nur in einzelnen Städten – eine Verbesserung der durchschnittlichen Wohnverhältnisse erzielt werden.

Es ist den Herausgebern ausdrücklich zu bescheinigen, daß sie tatsächlich durch die Hinzuziehung von zeitgenössischen Zeitungs- und Zeitschriftenartikeln, von autobiographischen und auch literarischen Quellen, von Polizei- und Parlamentsakten, von statistischem Material und vor allem durch eine eindrucksvolle Fülle von Abbildungen ein äußerst facettenreiches Bild der Wohnungsfrage vor dem Ersten Weltkrieg vorgelegt haben. Allerdings wirkt dennoch der Anspruch, den gesamten Wohnalltag in Deutschland repräsentativ dokumentiert zu haben, insofern etwas überzogen, als der überwiegende Teil der Quellen aus den Städten Berlin und Hamburg, z. T. noch aus Frankfurt und München stammt, was wohl auf entsprechende Vorarbeiten des Mitherausgebers Wischermann zurückzuführen ist. Wie exemplarisch waren diese Städte? Zwar werden durchaus auch verschiedene Quellen aus anderen Städten gebracht, aber bei dieser Auswahl ist keine Systematik zu erkennen. Die Verhältnisse in Städten unterschiedlichen Typs (z. B. ländliche Mittelstädte, traditionelle Handelszentren, alte und junge Industriestädte) und die entsprechend unterschiedlichen Herausforderungen und Wandlungsprozesse werden dementsprechend nicht klar sichtbar. Das erwähnte facettenreiche Bild erschließt sich also – trotz der Einführungen zu den fünf Teilen – nicht von selbst, wie auch manche der Quellen durchaus nicht für sich sprechen und erhebliche interpretatorische Fußangeln besitzen. Die Einführungen, die übrigens keinerlei Nachweise und keinen Anmerkungsapparat besitzen, liefern zwar diverse erläuternde Einzelhinweise, aber noch kein Verlaufsmodell oder gar umfassenderes Interpretationsraster, in das die Vielfalt der Erscheinungen eingeordnet werden könnte. Aus diesem Grunde darf man hinsichtlich der abständigen Deutung der vielen Teilaspekte, ihrer gewichtenden Einordnung und der Bewertung der Trends auf einen von den Herausgebern für 1986 angekündigten Darstellungsband mit dem Titel „Wohnungsnot und soziale Frage im 19. Jahrhundert“ gespannt sein.

J. Reulecke, Siegen

Meyer, Marshall W. unter Mitarbeit von William Stevenson und Steven Webster: *Limits to Bureaucratic Growth*. Walter de Gruyter & Co., Berlin - New York 1985. X, 228 S. Geb. DM 88,—.

Aus nicht nachvollziehbaren Gründen weckt der Titel dieses Buches völlig falsche Erwartungen. Von den Grenzen des bürokratischen Wachstums ist nur gegen Ende auf fünf Seiten die Rede, während im übrigen versucht wird, eine empirisch fundierte Erklärung für das in den letzten 100 Jahren in den USA zu beobachtende Wachstum der Bürokratie vor allem im öffentlichen Sektor zu geben. Dabei heißt Wachstum sowohl Vermehrung des Personals wie Vermehrung organisatorischer Einheiten. Die Daten, die die Autoren mit teilweise durchaus anspruchsvollen statistischen Methoden analysieren, beziehen sich auf die kommunale Finanzverwaltung in Chicago, Detroit und Philadelphia in der Zeit zwischen 1890 und 1975. Das Besondere der durch aufwendiges Quellenstudium konstruierten Datensätze ist, daß sie kontinuierliche Informationen nicht nur über die Veränderung des in den drei Finanzverwaltungen beschäftigten Personals, sondern auch über die jeweils zuständigen organisatorischen Einheiten – Ämter, Abteilungen und Referate – enthalten. Insgesamt 559 Organisationseinheiten bilden so die Grundlage der Untersuchung.

Was durch die qualitative, vor allem aber quantitative Analyse dieser Daten gezeigt wird, ist vielleicht nicht besonders überraschend, aber in vieler Hinsicht interessant. In qualitativer Hinsicht wird die strukturelle und prozedurale Entwicklung der kommunalen Finanzverwaltung im Spiegel von Zahlen und Dokumenten nachgezeichnet, aus denen sich die mit verschiedenen Innovationen verbundenen Absichten rekon-

struieren lassen (S. 26 - 31 und 65 - 78). Auf diesem Hintergrund wird sodann versucht, wesentliche Faktoren des fast exponential verlaufenden Größenwachstums und der etwas weniger steilen Zunahme von Organisationseinheiten in den kommunalen Finanzverwaltungen zu ermitteln. Dabei wird festgestellt, daß quantitative Indikatoren für Aufgabenvolumen nur bis 1933 hoch signifikant mit dem Größenwachstum der Finanzverwaltungen korrelieren, während einige qualitative Indikatoren (z.B. Einführung einer kommunalen Lohnsteuer oder Wechsel des Bürgermeisters) überhaupt keine deutliche Beziehung ergeben. Von den quantitativen Indikatoren ergeben die Bevölkerungszahl und das jeweilige Ausgabenvolumen die deutlichsten Zusammenhänge. Nach 1933 wächst jedoch z.B. in Philadelphia die Finanzverwaltung im Verhältnis zur Bevölkerung disproportional, während in Chicago genau das Gegenteil geschieht. Weiter wird gezeigt, daß die Wahrscheinlichkeit der Auflösung bestehender Organisationseinheiten zwar mit ihrem Alter sinkt (wobei die Auflösungswahrscheinlichkeit für Ämter um ein Vielfaches geringer ist als die für Abteilungen und Referate), daß aber die Altersabhängigkeit der „Sterberate“ von Organisationseinheiten insgesamt eher gering ist und nach dem zweiten Weltkrieg überhaupt zu verschwinden scheint. Für die Autoren ist damit bewiesen, daß weder Veränderungen in den Aufgaben der Finanzverwaltung (task demand) noch die Langlebigkeit insbesondere von älteren und größeren Ämtern das exponentiale Größenwachstum der kommunalen Finanzverwaltungen zureichend erklären können (wobei übrigens im zweiten Fall eine Hypothese wie z.B. der Ineffizienz „alter“ Organisationseinheiten nötig wäre, um einen Zusammenhang mit dem Größenwachstum zu konstruieren).

Einen wichtigen zusätzlichen Wachstumsmechanismus finden die Autoren denn auch in der von ihnen ausführlich belegten Tatsache, daß die Bildung organisatorischer Einheiten – von speziellen Ämtern für die Finanzverwaltung, von Abteilungen in diesen Ämtern und von Referaten in diesen Abteilungen – sowohl ein personelles Größenwachstum zur Folge hat wie auch die „Sterberate“ der sich unterteilenden Ämter und Abteilungen senkt. Genauer gesagt belegen die Zahlen, daß die Einheitsbildung zum Teil einem personellen Größenwachstum innerhalb bestehenden Einheiten *folgt*, zum Teil unmittelbar mit Größenwachstum *gekoppelt* ist und zum Teil umgekehrt ein Größenwachstum zu *induzieren* scheint, wobei der letztgenannte Effekt etwas ausgeprägter ist als der erste. Für die Autoren belegt das die These „growth follows structure“, womit sie einen zentralen, von der Veränderung im Aufgabenbestand unabhängigen Wachstumsmechanismus identifiziert zu haben meinen.

Was die Existenz dieses – selten so deutlich quantitativ belegten – Mechanismus angeht, wird man den Autoren ebenso zustimmen wie ihrer Meinung, daß die problematische Meßbarkeit administrativer Leistungen und die Tatsache, daß Personalvermehrung und Vervielfältigung organisatorischer Einheiten in der öffentlichen Verwaltung nicht per se als Problem angesehen werden, die Wirksamkeit dieses Mechanismus verstärken. Was dagegen kaum haltbar ist, ist der Anspruch der Autoren, mit ihren Ergebnissen eine neue Theorie bürokratischen Wachstums empirisch begründet zu haben (S. 206) und insbesondere bewiesen zu haben „that there is a preference for constructing organization as a solution to problems and that the construction of organization yields bureaucratic growth“ (S. 79). Zwar sehen die Autoren ein, daß ihre Daten allein diese These nicht belegen können. Ihr offensichtlicher Wunsch, eine an sich hinreichend interessante empirische Untersuchung mit einem allerdings eher bescheidenen theoretischen Neuigkeitswert als großen theoretischen Durchbruch erscheinen zu lassen, verführt sie immer wieder dazu, den Aussagegehalt ihrer Studie zu überschätzen. Diese Ambivalenz zwischen dem Methodenbewußtsein des Empirikers, der um die begrenzte Aussagefähigkeit seiner Daten weiß, und einem

überzogenen theoretischen Anspruch wird immer wieder deutlich (so z.B. S. 128, S. 163/164 und S. 179). Die zentrale Schwäche des Arguments ist dabei noch nicht einmal so sehr, daß die offensichtliche multifaktorielle Bestimmung administrativen Größenwachstums zugunsten des Mechanismus „growth follows structure“ interpretativ immer wieder abgeschwächt wird. Gravierender ist, daß die Daten keinerlei empirischen Beleg für die These bringen, daß eine Präferenz für Organisationsbildung als Problemlösungsstrategie im Sinne einer rationalen (oder doch als rational darstellbaren) *Reaktion auf Ungewißheit* die eigentliche Wurzel des bürokratischen Wachstums ist. Wenn die Autoren aus der Tatsache, daß formell untergliederte organisatorische Einheiten *ceteris paribus* eine geringere „Sterberate“ besitzen, auf eine solche Präferenz rückschließen, dann begehen sie genau jene Verwechslung zwischen Motiv und Konsequenz, die schon Emile Durkheim in seinen methodologischen Regeln als fundamentalen Denkfehler herausstellte. Die beigebrachten Daten jedenfalls lassen sich mindestens ebenso gut als Ergebnis eines Wachstumsmodells interpretieren, bei dem Veränderungen im Aufgabenbestand direkt oder über Personalvermehrung innerhalb bestehender Einheiten zur Neubildung von Einheiten führen, was dann einerseits die Stabilisierung und andererseits die Personalvermehrung in den betreffenden Ämtern bzw. Abteilungen zur Folge hat. Diese Erklärung für das beobachtbare Wachstum wird jedoch von den Autoren mit der „neoklassischen“ Organisationstheorie identifiziert, von der sie sich im Sinne der Orientierung von Masch und Olsen, John Meyer u. a. abzusetzen versuchen.

Wachstumsmechanismen, die jenseits einer rationalen Reaktion auf Veränderungen im Aufgabenbestand operieren, sind grundsätzlich eher in Beobachtungsstudien, also mit einem monographisch-qualitativen Ansatz zu identifizieren; das Datenmaterial dieser Studie eignete sich daher von vornherein nur begrenzt zur Untersuchung dieser Frage. Die Autoren haben gezeigt, was sich aus sorgfältig konstruierten Zeitreihen organisationsbezogener Daten herausholen läßt. Gewiß ist es erlaubt, ja erwünscht, interpretativ über das hinauszugehen, was mittels quantitativer Daten unmittelbar belegbar ist.

Im vorliegenden Fall allerdings bleibt die Verknüpfung zwischen theoretischen Behauptungen über die in einer Ideologie rationalen Verwaltungshandelns begründete Präferenz für Organisation als Strategie der Unsicherheitsabsorption auf der einen Seite und den vorgelegten Daten auf der anderen Seite allzu lose.

R. Mayntz, Köln

Arndt, Helmut: Vollbeschäftigung, Einführung in Theorie und Politik der Beschäftigung. Duncker & Humblot, Berlin 1984. 196 S. DM 28,—.

Die von Arndt vorgelegte Arbeit zur Beschäftigungstheorie und -politik will wegen der Komplexität der Problematik der Unterbeschäftigung nicht mit der Methode der isolierenden, sondern mit der Methode der variierenden Abstraktion die Gesamtheit der relevanten Zusammenhänge erfassen und damit schrittweise die Fragen einbeziehen, von denen zunächst aus Gründen der Vereinfachung abstrahiert worden ist. Demgemäß geht es Arndt auch bei der fortschreitenden Erweiterung des Ausgangsmodells nicht bloß um eine Erweiterung des Modells durch die Einführung zusätzlicher Stromgrößen. Arndt will an die Stelle von Analysen von Gleichgewichtslagen Analysen von Prozessen setzen. Damit sollen also Beschäftigungsprobleme nicht in statische Modelle analysiert werden. Arndt geht es vielmehr darum zu berücksichtigen, daß sich die Beschäftigungsprobleme mit den Marktprozessen verändern. Ebenso mußten Wirtschaftsordnung und außenwirtschaftliche Verflechtungen in ihrer

Bedeutung für die Beschäftigung *expressis verbis* in die Untersuchungen einbezogen werden. Nicht zuletzt sei der Mensch, der ja kein „individual economic agent“ sei, zu berücksichtigen (S. 21).

Von der Überlegung ausgehend, daß es nicht nur, „wie die Postkeynesianer glauben, eine einzige Art, sondern mehrere Arten von Unterbeschäftigung, die je nach ihren Ursachen unterschiedlich zu behandeln sind“ (Vorwort) gibt, stellt Arndt an den Anfang seiner Arbeit einen kurzen Abriß der Arten der Arbeitslosigkeit. Dieser Teil der Arbeit ist leider recht knapp gehalten. Außerdem verwirrt es den Leser etwas, wenn er auf den Seiten 13 und 14 sechs Arten der Arbeitslosigkeit vorgeführt bekommt; Arndt dann aber auf den Seiten 30 und 31 acht Ursachenkomplexe von Unterbeschäftigung in der Marktwirtschaft vorführt, die sich nicht oder nicht ohne weiteres bei den sechs Arten der Arbeitslosigkeit unterbringen lassen. Diese acht Ursachenkomplexe von Unterbeschäftigung sind: Die Wirkung der wirtschaftlichen Entwicklung auf die Beschäftigung, Einflüsse des Außenhandels, die Wirkung von In- und Deflation, Beschäftigungswirkungen von Produktivitätsschwankungen, die Wirkung der Distribution von Macht, die Unterbeschäftigung als Folge staatlicher Investitionen und der Einfluß menschlichen Handelns auf die Beschäftigung. Zusammen mit der Beeinflussung der Beschäftigung durch die Wirtschaftsordnung sind diese Ursachenkomplexe auch die entscheidenden Stichpunkte für die Klärung der Arbeitslosigkeit im folgenden Kapitel der Arbeit. Die Behandlung jedes dieser Ursachenkomplexe könnte – für sich genommen – eine eigene Monographie ausfüllen. Arndts Ausführungen sind dagegen zum Teil recht knapp, aber anregend geschrieben. Sie sind sehr wohl geeignet, einen ersten Überblick zu verschaffen und zu weiteren Studien anzuregen.

Diesen in Teil 1 der Veröffentlichung erarbeiteten beschäftigungstheoretischen Grundlagen stellt Arndt dann ab Seite 128 einen stärker anwendungsbezogenen Teil gegenüber, der Ausführungen zu beschäftigungspolitischen Konsequenzen bringt. Hier greift Arndt verschiedene Vorschläge der Beschäftigungslenkung auf und nimmt zu den einzelnen Vorschlägen kritisch Stellung. Auch hier folgt Arndt nicht einem sich stetig entwickelnden Gedanken, sondern er greift einzelne Fragenkomplexe wie z. B. die Wirkung von ‚deficit-spending‘ und einer Politik des billigen Geldes, den Einfluß von Beschäftigungsprogramm auf die Zinsen, die Grenzen nationaler Geldpolitik, die Wirkungen von Einkommensretributionen auf die Investitionen, Retributionswirkungen in der Weltwirtschaft und die Wirkungen von Arbeitszeitverkürzung und staatlicher Investitionslenkung auf die Beschäftigungssituation eines Landes auf. Die Zusammenfassung dieser Einzelprobleme in drei Kapiteln ist nicht immer schlüssig; wichtigen Fragen wird oft nur auf wenigen Seiten und deshalb selten erschöpfend nachgegangen. Doch wird erkennbar, daß Arndt diese Instrumente, einzeln eingesetzt, für wenig erfolgreich hält. Zum Schluß kommt der Verfasser wieder auf die Arten der Arbeitslosigkeit zurück, um deutlich zu machen, daß zu ihrer Bekämpfung artenspezifische Maßnahmen nötig sind.

Für diesen anwendungsbezogenen zweiten Teil der Arbeit hätte man sich eingehendere Darlegungen gewünscht. Die Politik der Beschäftigung wird hier beispielhaft durch die Analyse von Einzelproblemen erklärt, in ihrer Gesamtheit ist sie aber nicht ausreichend transparent geworden.

Ganz am Ende der Arbeit greift Arndt dann noch speziellere Fragen der weltwirtschaftlichen Beschäftigungspolitik, der Sozialpartnerschaft und kurz auch noch das Problem der Massenarbeitslosigkeit auf.

H. Winterstein, Erlangen

Tietzel, Manfred: Wirtschaftstheorie und Unwissen. Überlegungen zur Wirtschaftstheorie jenseits von Risiko und Unsicherheit. J. C. B. Mohr (Paul Siebeck), Tübingen 1985. VIII, 208 S. Ln. DM 68,—.

Soviel vorab: der Autor hat sich ein Gebiet vorgenommen, das an Schwierigkeitsgrad kaum zu übertreffen ist. Denn darzulegen, was man über Unwissen weiß, ist fast schon ein Widerspruch in sich selbst. Gleichwohl überzeugt aus systematischer Sicht der Ansatz: Verhaltensannahmen *jenseits* von Risiko und Unsicherheit – also jenseits von den schon „fortgeschrittenen“ stochastischen Modellkonstruktionen – sind zweifellos dringend gefragt, „denn Wirtschaftssubjekte sind oft nicht nur *unsicher* über den Eintritt von Ereignissen oder die Folgen ihrer Handlungsweisen, oft sind diese *nicht einmal der Art nach bekannt*“ (S. 3). Um keine falschen Erwartungen entstehen zu lassen, sei aber auch dies im Vorwege gesagt: Trotz systematisch überzeugenden Ausgangspunktes ist die Durchführung nicht als ebensolche zu klassifizieren. Von einer grundlegend neuen Axiomatisierung etwa der Informationstheorie o.ä. kann keine Rede sein; es handelt sich vielmehr um eine bunte Abfolge wichtiger und grundlegender Methodenprobleme der Wirtschaftswissenschaften, die mit bemerkenswerter sprachlicher und intuitiver Virtuosität präsentiert werden.

In seinem in 15 Abschnitte aufgeteilten Gedankengang beginnt Tietzel damit, das zu seinem Thema in der Wissenschaft bereits an Vorarbeit Geleistete aufzuspüren. Außer zweier wohlbekannter Abhandlungen F. A. von Hayeks¹ zur grundsätzlichen und nicht endgültig überwindbaren Begrenztheit menschlichen Wissens, scheint es danach nichts Wesentliches zu geben. Grundlegend unterscheidet T. (i) unvollständiges, (ii) unbestimmtes, (iii) unrichtiges und (iv) unsicheres Wissen, das sich hinsichtlich dieser „Dimensionen“ vom Idealkonstrukt perfektes Wissen unterscheidet. Es folgen einige Bemerkungen zum Informationsbegriff der mathematischen Kommunikationstheorie, dessen syntaktische Dimension hinter den semantischen und pragmatischen Aspekten, die für die gegebene Fragestellung relevanter sind, zurückstehen muß. Mit den nächsten beiden Abschnitten „Die ‚klassischen‘ Annahmen: vollkommene Information, Risiko, Unsicherheit und Erwartungsbildung“ sowie „Die Struktur einer Erklärung zielgerichteten individuellen Handelns“ beschreibt T. in vielfach recht anschaulicher Weise sozusagen den „Stand der Technik“ der Theoriebildung in unserem Fach einschließlich ihrer wichtigsten Prämisse des zielintendierten Rationalverhaltens. An einer Lichtenberg-Weisheit („Der Mensch schließt von sich auf den anderen, aber vermutlich oft falsch“) und einer Reihe anderer oft deftig beschriebener Alltagssituationen werden sodann die vielfältigen Probleme und Verflechtungen von Handlungs- und Beobachtungsebene erläutert. Das im Unterschied zu den Naturwissenschaften für die Sozialwissenschaften eigentümliche Phänomen, daß ihre Theorien auf den Objektbereich zurückwirken, wird von T. mit einem sehr treffenden Bild beschrieben. Man solle sich die Lage eines Chemikers vorstellen, „wenn die Objekte seines Forschungsdranges in der Lage wären, auf das, was er über sie sagt, zu reagieren: wenn die Substanzen lesen und hören könnten, was der Chemiker über sie schreibt oder sagt, und wenn sie womöglich aus ihren Behältern herauspringen und ihn verbrennen würden, weil ihnen das, was sie an der Tafel oder auf dem Notizblock sehen, nicht gefallen hat“ (S. 35; übrigens fehlt die Fußnote zu diesem Fremdzitat).

Zum Kernbestand der Methodendiskussion unseres Faches gehört natürlich die Debatte um Ziele und Werte. Diesem Thema widmet sich auch T. im fünften

¹ Gemeint sind die beiden Aufsätze „Wirtschaftstheorie und Unwissen“ und „Die Verwertung des Wissens in der Gesellschaft“, in: ders., Individualismus und wirtschaftliche Ordnung. 2. A., Salzburg 1976, S. 49 – 77 / 103 – 121 [erstmalig veröff. 1937 und 1946].

Abschnitt, einem seiner zentralen Kapitel. Eine Standortfestlegung folgt sogleich mit der Einlassung, daß Ziele und ihre Werturteile der wissenschaftlichen Behandlung keineswegs generell entzogen sind, mithin eine klare Zurückweisung des Weber'schen Postulats. In diesem Sinne sind auch Entwicklungen zu sogenannten „offenen“ Ziel- oder Nutzenfunktionen à la Alchian oder Gary S. Becker als notwendige Überschreitungen methodologisch zu enger Grenzziehungen zu sehen. Die Interdependenz von Zielfunktionen stellt eine weitere Komplikation dar, mit der eine um Realitätsnähe bemühte Theorie zu kämpfen hat; T. veranschaulicht mit großer Geschicklichkeit, daß etwa altruistische und egoistische Verhaltensweisen je nach Kombination ganz eigentümliche Ergebnisse zeitigen. Schließlich gerät die zumeist aus dem Kernbestand des Faches verbannte Präferenzbildung und die Vorstellung von der „unbefleckten Empfangnis der Indifferenzkurve“ ins Visier; soll oder muß sich die Ökonomie auch noch damit belasten, statt auf die Arbeitsteilung der Wissenschaftsdisziplinen zu vertrauen? Selbst wenn man diese Frage verneinen wird, kann man mit T. nicht daran zweifeln, daß Werte und Ziele soziale Tatsachen darstellen, die bei einer Theoriebildung, die zu gehaltvollen Aussagen gelangen will, nicht unbeachtet bleiben können. Gerade Ansätzen wie der „Theorie rationaler Erwartungen“ ist derartiges zu empfehlen.

Der sechste und siebte Abschnitt über „Die Situationswahrnehmung“ bzw. „Das Rationalitätsproblem“ enthält wiederum viel Vertrautes und im einzelnen z. T. interessante Theorieverknüpfungen. So findet man im Unterabschnitt 6.2 „Das Realisierbarkeitsproblem“ Buchanan's Reaktivierung hobbesianischen Gedankenguts und wenig später Grenzziehungen der Property Rights-Theorie hinsichtlich der Annahme unbeschränkten Volleigentums. Die Maximierungshypothese, „zum eisernen Kernbestand der Ökonomie“ (S. 86) gehörend, erfährt Kritik aus vielfältiger Richtung, muß aber in der Form einer allgemeinen Rationalitätsannahme laut T. wohl wegen der verheerenden Folgen einer gegensätzlichen Prämisse beibehalten werden.

Abschnitt 8 über „Sozialtheorie und Sozialverhalten“ knüpft an Phänomenen an, die bereits im 4. Kapitel behandelt wurden: es geht um die Rückkopplungseffekte, die sozialwissenschaftliche Erkenntnisse – oder auch nur Behauptungen – im Objektbereich haben können. Ödipus- und Pygmalion-Effekte, „self-fulfilling“ und „self-destroying prophecies“, Grünbaum-Buck-Probleme und dergleichen Kürzel beherrschen hier die Szene; T.'s Zettelkasten weist hier eine besonders erstaunliche Fülle auf. Funktion und Probleme „idealisierter Erklärungen“ (Abschnitt 9), „Aggregation, Reduktion und die Mikrofundierung der Makrotheorie“ (Abschnitt 10), Bemerkungen zum „Allgemeinen Gleichgewicht“ (Abschnitt 11) einer „Arrow-Debreu-Walras-Welt“ und die Gegenattacke der österreichischen Schule gegen die neoklassische Gleichgewichtstheorie im Abschnitt 12 über „Marktprozesse“ folgen mit einer – wie man wohl sagen muß – „Theoriedichte“, die atemberaubend ist. Trotz flüssigen Schreibstils werden nur sichere Kenner der Materie dieses Tempo mithalten können, denn immerhin handelt es sich hier um Gebiete, die seit Jahrzehnten die am heftigsten umkämpften Abschnitte der Wissenschaftsfront der Ökonomen bilden.

Der 13., ein weiterer Hauptabschnitt, mit der Überschrift „Anarchie und Organisation“ beginnt mit einer Kritik der herkömmlichen Ordnungstheorie, der zu Recht vorgeworfen wird, sie habe „im deutschen Sprachraum häufig im Entwurf theoretisch unfruchtbarer Klassifikationsschemata“ (S. 139) bestanden. Problematisch sei insbesondere gewesen, daß alle Abweichungen vom reinen Marktmodell unter der Generalüberschrift „Zentralverwaltungswirtschaft“ subsumiert wurden. T. hält es für besser, die „unabsehbare Vielfalt anderer Organisationsformen“ (S. 141) im einzelnen zu untersuchen. Transaktionskosten und die sogenannte „Verdünnung“ von Verfügungsrechten stellen dabei wesentliche Analyse Kriterien dar. Weiterhin sei ein enormer Erkenntnisgewinn zu erwarten, wenn man die Entstehung von Organisationsformen

zum Thema macht; Vertrags-, Agentur- und Normentheorien zeigen deutlich die Vielfältigkeit der Gründe *und* der Lösungen für kollektive Handlungsformen. Der Hobbes'sche Leviathan, marxistisch-leninistische Klassenkampftheorien und „odysseeische“ Verhaltensnormierungen durch Selbstbindung finden hier Erwähnung – in der Tat keine sterile Gegenüberstellung wie die der freien Verkehrswirtschaft und der schon von der Bezeichnung her furchterregenden Zentralverwaltungswirtschaft.

T. schließt seine inhaltlichen Ausführungen mit einem kurzen Abschnitt über „Unerwartete Nebenwirkungen“, ehe er noch einmal in der Zusammenfassung den roten Faden seiner Ausführung wiedergibt. Am Ende steht das sicherlich wenig überraschende Fazit: „zum Nachteil der Wirtschaftstheorie wissen wir zu wenig über das Unwissen“ (S. 177).

Wer dieses Buch zur Seite legt, ist beeindruckt von der Fülle der angesprochenen Themen, von der sicheren Kenntnis der Methodendiskussion unserer Disziplin und vor allem von der bildhaften Sprache des Autors. Für diejenigen, die gerade an der Ausarbeitung einer entsprechenden Vorlesung sitzen und an einer lebendigen Gestaltung interessiert sind, kann der Griff nach dieser Publikation insoweit zum Glücksgriff werden.

D. W. Rahmsdorf, Frankfurt a. M.

Starbatty, Joachim: Die englischen Klassiker der Nationalökonomie. Lehre und Wirkung. Wissenschaftliche Buchgesellschaft, Darmstadt 1985. 151 S. DM 22,- (Mitgliederpreis), DM 39,- (Nichtmitgliederpreis).

Die Beschäftigung mit der wirtschaftswissenschaftlichen Dogmengeschichte erfreut sich nach langer Zeit ihrer Vernachlässigung seit einigen Jahren wieder zunehmender Beliebtheit in der Nationalökonomie. Der Grund hierfür dürfte maßgeblich in dem unbefriedigenden Zustand der modernen Wirtschaftswissenschaft, insbes. auf dem Gebiet der Makroökonomie, liegen: Einer immer abstrakter werdenden, sich oft in reinem Formelfetischismus erschöpfenden Wirtschaftstheorie auf der einen Seite steht die oft erschreckende Hilflosigkeit der Ökonomie in Hinblick auf die Formulierung klarer Handlungsanweisungen an die Wirtschaftspolitik auf der anderen Seite gegenüber. So kann es nicht verwundern, daß in der Öffentlichkeit selbst belanglosen Äußerungen amtierender Politiker oder Verbandsfunktionäre gemeinhin mehr Aufmerksamkeit geschenkt wird als den Aussagen professioneller Ökonomen, welche sich nur allzuoft in ihren Elfenbeintürmen verschanzen und die unfeine Beschäftigung mit konkreter Politik lieber dem ökonomischen Fußvolk überlassen.

In dieser Hinsicht waren die englischen Klassiker des ausgehenden 18. und 19. Jahrhunderts um vieles aktiver und auch erfolgreicher. Gerade die hervorragendsten Köpfe unter ihnen – Smith, Ricardo, J. St. Mill – übten mit ihren Werken und teilweise auch persönlich in politischen Funktionen nachhaltigen Einfluß auf die englische Wirtschaftspolitik der damaligen Zeit aus; wann hätte etwa je ein Zeitungsartikel eines zeitgenössischen Ökonomen ähnliche Wirkung entfaltet wie Ricardos Artikelserie im *Morning Chronicle* über die Zusammenhänge zwischen Goldpreis und Notenausgabe, die letztlich zur Umwälzung des gesamten englischen Geldwesens führte? Es lohnt sich somit offenbar auch für den heutigen Ökonomen, bei den englischen Klassikern „in die Schule zu gehen“, wie Starbatty es ausdrückt, und daß dies ein nicht nur äußerst lehrreiches, sondern auch kurzweiliges Unterfangen sein kann, beweist er mit dem vorliegenden Buch.

Dieses gliedert sich in neun etwa gleich lange Kapitel, von denen das erste einen kurzen Überblick über Leben und Werk der vier ‚Hauptmatadore‘ der englischen

Klassik, Smith, Ricardo, Malthus und J. St. Mill gibt. Auf diese vier konzentriert sich der Autor im folgenden weitgehend, was angesichts ihrer überragenden Bedeutung sicher richtig ist (wenngleich beispielsweise F. Bastiat zumindest eine Erwähnung verdient gehabt hätte und auch Cantillon als wesentlicher Vorläufer der Klassik mit einer einzigen ihn erwähnenden Fußnote etwas kurz kommt). Die Darstellung der Lebensläufe der vier Genannten ist – wie auch die übrigen Kapitel – mit zahlreichen Zitaten und Anekdoten angereichert, welche ein sehr lebendiges Bild von der jeweiligen Persönlichkeit und den damaligen Kontroversen vermitteln.

Diesen Stil, vielfach ergänzt durch eigene originelle Formulierungen im Stile Schumpeters, behält der Verf. auch in den folgenden, jeweils nach einzelnen Sachgebieten gegliederten Kapiteln bei, ohne ihn indessen zu übertreiben. In didaktisch geschickter Weise werden zunächst die „Ordnungselemente des Systems der natürlichen Freiheit“, nämlich dezentrales Entscheidungssystem, Privateigentum und das Prinzip des trial and error erläutert (Kap. II). Das anschließende Kapitel befaßt sich mit den Auffassungen der Klassiker – insbes. Smiths – in bezug auf Aufgaben und Finanzierung des Staates, wobei sich Starbatty nachdrücklich gegen die selbst unter Ökonomen anzutreffende, gedankenlose Verknüpfung von klassischem Liberalismus und Lasalles ‚Nachtwächterstaat‘ wendet („Die Speicheldrüsen der berühmten Pawlowschen Hunde könnten nach Ertönen der Glocke nicht prompter reagieren.“, S. 47). Das vierte Kapitel ist der klassischen Wert- und Preislehre gewidmet. Hier leistet der Verf. einen wertvollen Beitrag zur Würdigung der ricardianischen Werttheorie, indem er anhand entsprechender Zitate nachweist, daß zumindest der spätere Ricardo durchaus neben der Arbeit auch die für die Produktionsumwege benötigte Zeit als eigenständigen Produktionsfaktor anerkannte und somit als Vorläufer der österreichischen Kapitaltheorie gelten kann. In der Tat ergibt sich diese Konsequenz letztlich zwingend aus der Analyse von Ricardos Gesamtsystem, dem nichts Schlimmeres passieren konnte als der Versuch des vorurteilsbeladenen Marx, es in der Zwangsjacke der reinen Arbeitswertlehre zu halten.

Die beiden folgenden Kapitel behandeln die verteilungs- und wohlfahrtstheoretischen Aussagen der englischen Klassiker einschl. ihrer zunächst naturrechtlichen, später überwiegend utilitaristischen Begründung. Recht geschickt wird dabei von den philosophischen Grundlagen des klassischen Wohlfahrtsgedankens auf die daraus resultierenden wirtschaftspolitischen Konsequenzen (Kapitalbildung und Freihandel) übergeleitet, wie überhaupt die Abfolge der einzelnen Kapitel einem klaren und sinnvollen Konzept folgt, indem zunächst die ordnungspolitischen Grundlagen, danach mikroökonomische und erst zum Abschluß makroökonomische Probleme erörtert werden. Dementsprechend steht der Problemkomplex Zins, Geld und Wirtschaftswachstum am Schluß des Buches, gefolgt von einigen abschließenden Bemerkungen zum methodischen Vorgehen der Klassiker. Kap. VII befaßt sich dabei hauptsächlich mit dem Say'schen Theorem und den Ansätzen einer monetären Konjunkturtheorie bei Malthus. Der Autor beläßt es hier im Gegensatz zu vielen anderen dogmenhistorischen Büchern nicht dabei, die konträren Positionen Ricardos bzw. Malthus' nacheinander zu referieren, sondern er stellt sie anhand einschlägiger, jeweils kommentierter Zitate – beinahe in Form eines fiktiven Streitgesprächs – einander gegenüber, was sich als sehr instruktiv erweist. Im achten Kapitel werden die geldtheoretischen Debatten der damaligen Zeit nachgezeichnet, wobei insbes. Ricardos Beitrag zur Bullion-Kontroverse eine ausführliche Würdigung erfährt. Die Darstellung der sich daran anschließenden Currency-Banking-Debatte ist mit einer knappen Seite leider etwas kurz und dadurch nur schwer verständlich geraten.

Insgesamt aber ist gerade hinsichtlich der didaktischen Präsentation des Stoffes hier uneingeschränktes Lob am Platze. Mit sicherer Hand wird der Leser durch die

gewiß nicht immer leicht verständlichen und oft auch widersprüchlichen Gedankengebäude der Klassiker geführt, wobei natürlich manche theoretische Klippe umgangen, aber niemals Zuflucht zu unzulässigen Vergrößerungen oder gar Verfälschungen genommen wird. Den vollen Wert dieser Darstellung wird vor allem derjenige erkennen und nutzen können, der sich zuvor schon intensiv mit der ökonomischen Klassik beschäftigt und z.B. durch das theoretisch anspruchsvollere, aber auch mit manch unnötigem formalen Ballast befrachtete Standardwerk M. Blaug's gekämpft hat; anhand der Lektüre von Starbattys Buch kann er den Überblick zurückgewinnen, der ihm vielleicht bei der detaillierten Analyse der vielen Einzelprobleme verlorengegangen ist. Hinzu kommt, daß Starbattys Werk ausgesprochen interessant, um nicht zu sagen unterhaltsam geschrieben ist, ohne deswegen auf genaue Argumentation und umfangreiche Literaturhinweise zu verzichten.

Kurzum: Man kann dem Autor zu diesem gelungenen Werk nur gratulieren und ihm eine möglichst weite Verbreitung wünschen. Natürlich lassen sich bei entsprechender Akribie auch einige Schwachpunkte ausmachen: So hätte man bei der Erörterung des Ertragsgesetzes einen Hinweis auf Turgot, bei der Diskussion des klassischen Wertparadoxons einen Verweis auf Gossen und beim Stichwort ‚Lagerente‘ eine Erwähnung Thürens erwartet; daß diese Namen nicht einmal in einer Fußnote auftauchen, ist in einem Buch über die – wenn auch nur englischen – Klassiker doch ein ziemliches Manko. Auch könnte man bemängeln, daß als Begründer des Utilitarismus Bentham (anstelle von Hutcheson) und als Entdecker des Goldautomatismus Ricardo (anstelle von Hume) genannt werden; dagegen wird Ricardos berühmter Beitrag zur Maschinenfrage an keiner Stelle erwähnt. Aber dies sind Marginalien bzw. Auffassungsfragen, welche den Wert von Starbattys Buch in keiner Weise beeinträchtigen.

U. van Suntum, Bochum

de Ménil, G. / Westphal, U. (eds.): Stabilization Policy in France and the Federal Republic of Germany (Contributions to Economic Analysis, Vol. 153). North Holland, Amsterdam - New York - Oxford 1985. IX, 379 S. Dfl. 190,- / US \$ 70.50.

Gegenstand des vorliegenden Bandes ist ein Vergleich der „makroökonomischen Charakteristika“ Frankreichs und der Bundesrepublik und ihrer Veränderungen im Zeitraum 1960 bis 1980 (S. 1). Von ähnlich gerichteten Arbeiten unterscheidet sich die Untersuchung dadurch, daß sie auf Simulationsergebnissen (großer) makroökonomischer Modelle fußt. Eine Vorgehensweise, von Eckstein mit Bezug auf die „New Economic History“ (NEH) als „contemporary cliometrics“ bezeichnet, die sich bei der wirtschaftspolitischen Analyse, insbesondere in den USA, durchgesetzt hat. Die Verwendung ökonometrischer Modelle ist nach Meinung der Herausgeber vor allem deshalb angezeigt, weil nur so die für ihr Anliegen entscheidende Zuordnung der Entwicklungsdeterminanten zu endogenen oder exogenen Faktoren möglich ist; genauer, weil nur die Ökonometrie die Zurückweisung von Hypothesen über Kausalbeziehungen und die Quantifizierung der Aussagen über die Wirkungen der wirtschaftspolitischen Maßnahmen gestattet (S. 3).

Bei den verwendeten Modellen handelt es sich um das im INSEE entwickelte METRIC-Modell (für die französische Volkswirtschaft) und das unter der Leitung von Hansen und Westphal entwickelte SYSIFO-Modell für die Bundesrepublik¹. Beide

¹ Vgl. *METRIC* (1979), *Modèle économétrique trimestriel de la conjoncture*. Annales de l'INSEE, no. 26 - 37 sowie G. Hansen / U. Westphal (Hrsg.) 1983, *SYSIFO* – ein vierteljährliches ökonometrisches Modell für die Bundesrepublik. Frankfurt/M.

Modelle – so wird von den Herausgebern verschiedentlich betont – weisen nicht nur eine vergleichbare empirische Basis (Stützbereich) auf, auch ihre theoretischen Grundlagen sind weitgehend kongruent. Auf eine vollständige Darstellung der beiden Modelle verzichten die Herausgeber angesichts der Veröffentlichung an anderer Stelle, stattdessen berichten sie über eine für beide Modelle repräsentative „stilisierte“ Version von etwa 34 Gleichungen („Maßstab 1 : 20“), leider ohne dem Leser viel über den Erklärungsanspruch des Modells (Kurz- oder Langfristmodell), seine Bedingtheit (exogene Variablen) oder die Qualität seiner empirischen Begründung (ex post- oder gar ex ante-Prognosegenauigkeit) mitzuteilen. – So sinnvoll der Rückgriff auf bestehende Modelle mit „ähnlichen“ Hypothesen aus Gründen der Arbeitsökonomie ist, so dürfen doch die daraus resultierenden Beschränkungen der Ergebnisse nicht übersehen werden: Der eigentliche „Test alternativer Hypothesen“ wird damit in die Konstruktionsphase der Modelle verwiesen, so daß sich die Untersuchung selbst auf eine Analyse aus der Perspektive der verwendeten Modelle bzw. deren „Theorie(n)“ reduziert; im vorliegenden Fall also der „keynesianischen“ (S. 6) bzw. „post-keynesianischen“ Theorie (S. 336). Wie bei vielen anderen ökonometrischen Untersuchungen (Leamer) bleibt auch hier für den Leser offen, ob andere Theorien bzw. Ansätze und mit welchem Ergebnis geprüft wurden, was um so bedauerlicher ist, als in dem ganzen Band kaum Versuche unternommen werden, die gefundenen Ergebnisse mit älteren, insbesondere von ökonometrischen Modellen, zu konfrontieren.

Im einzelnen ist der Aufbau des Vergleichs wie folgt. Im Teil I untersuchen *de Mènil / Sastre* bzw. *Neumann / Sander* den Zusammenhang von Transferpolitik, Einkommen und Beschäftigung in Frankreich und in der Bundesrepublik, was auf eine detaillierte Analyse des Einkommensmultiplikators hinausläuft. Anschließend gehen *Artus / Muet / Palinkas / Pauly* für beide Länder gemeinsam dem Zusammenwirken von Steuern, Geldpolitik und Investitionen, also den Akzeleratorbeziehungen nach (II). Der Einfluß der Wechselkurse, der Lohn-Preis-Mechanismus und die Leistungsbilanz sind Gegenstand einer Analyse von *Artus / Nase* (für Frankreich) bzw. von *Kröger / Pauly* (für die Bundesrepublik) (III). Im vierten Teil untersucht *Feroldi* für Frankreich den Zusammenhang von Geldpolitik und Wechselkursen, und *Schulze-Ghattas / Westphal* analysieren diese Beziehungen erweitert um den Einfluß der Staatsdefizite für die Bundesrepublik. Bei den bisher genannten Studien handelt es sich um relativ isolierte und isolierende Studien, da sowohl aus analytischen Gründen jeweils ein mehr oder weniger großer Teil der übrigen Modellbeziehungen „aus“-geschaltet wird. Erst bei der Dilemma-Analyse (den trade-offs zwischen Inflation, Arbeitslosigkeit und Leistungsbilanz) für die beiden Länder von *Bismut / Kröger* und der Untersuchung der Übertragung der internationalen Störungen auf die französische und deutsche Wirtschaft im Zeitraum 1972 bis 1980 von *de Mènil / Westphal* werden diese Vereinfachungen aufgegeben (V). Die Darstellung innerhalb der einzelnen Kapitel folgt weitgehend dem gleichen, für Simulationsstudien üblichen Muster: einer Skizzierung des Erklärungsziels schließt sich eine (knappe) Darstellung der Entwicklung im Untersuchungszeitraum (meist der Zeitraum 1975 bis 1980) an. Daraus folgt eine Darstellung der verwendeten Hypothesen bzw. Schätzergebnisse; die deutschen Autoren begnügen sich dabei in der Regel mit einer Wiedergabe der entsprechenden Elastizitäten, während die französischen Autoren lediglich die Schätzergebnisse ausweisen und auf deren Veranschaulichung verzichten. Den Abschluß bildet dann eine Analyse der Modellergebnisse. – Die Zerlegung der Multiplikatorergebnisse durch Isolierung der einzelnen Einflußfaktoren verdient dabei besonders hervorgehoben zu werden, denn zumindest hierzulande haftet Modellergebnissen noch häufig der Charakter von black-box-Resultaten an. Leider birgt eine solche Zerlegung aber auch die Gefahr, daß die Ergebnisse nur für die kleine Gemeinde der Modellbauer und -anwender von Interesse sind. Wer sonst kann schon etwas z. B. mit

Multiplikatorergebnissen einer Transfer-Erhöhung unter Ausschaltung „der Akzele-
ratoreffekte der Investitionen und der Lohn-Preis-Dynamik“ (S. 60) anfangen? Die
eingangs von den Herausgebern (auch) versprochene Analyse des Wandels der Reak-
tionsweisen kommt insgesamt etwas zu kurz, im allgemeinen beschränken sich die
Untersuchungen auf den Zeitraum 1975 - 1980, die Frage von gelegentlich behaupten-
ten Veränderungen der makroökonomischen Reaktionsweisen bzw. der (geschätzten)
Strukturen wird kaum thematisiert. So bleibt es für den Leser z.B. offen, ob der
Stützbereichsbeginn 1970 vieler Gleichungen des Außenhandels- oder des Geld-
marktteils der beiden Modelle bedeutet, daß der Übergang zu flexiblen Wechselkur-
sen oder zur Geldmengensteuerung ohne Auswirkungen auf die Reaktionsweisen der
Wirtschaftssubjekte war oder ob sich lediglich Spezifikationserfordernisse (lange
Zeitreihen) durchsetzten.

Die für die beiden Länder festgestellten Reaktionsunterschiede überzeugen und
stimmen, jedenfalls was die Resultate für die Bundesrepublik betrifft, sehr weitge-
hend mit dem heute vorherrschenden Bild überein. Hervorzuheben ist die Bestätigung
des „Elastizitätspessimismus“ der Deutschen Bundesbank, wie ohnehin die Fragen
des Außenhandelsgleichgewichts eine – angesichts „flexibler“ Wechselkurse – über-
raschend breite Behandlung erfahren. Auf eine Wiedergabe der Ergebnisse im einzel-
nen kann hier, nicht zuletzt dank der ausgezeichneten „comparative summary“ zu
den meisten Beiträgen, verzichtet werden. Zur Illustration seien nur die Resultate der
Analyse der Einkommens- und Beschäftigungswirkungen (Teil I) angeführt. Die fest-
gestellten Reaktionsunterschiede sind beachtlich, insbesondere, wenn man berück-
sichtigt, daß die Unterschiede im Pro-Kopf-Einkommen nach Ausschaltung der
wechselkursbedingten Verzerrungen weniger als 10 v.H. betragen dürften: Für
Frankreich wird für den Transfer-Multiplikator ein Wert von 0,78, für die Bundesre-
publik ein solcher von 0,60 festgestellt. Die Unterschiede werden auf strukturelle,
sektorale und institutionelle Faktoren zurückgeführt; auf die Rolle der unterschied-
lichen Erklärungsgüte der beiden Modelle wird, wenn auch in Übereinstimmung mit
den üblichen Analysen dieser Art, leider nicht eingegangen. Zu den strukturellen
Gründen gehört z.B. die größere Rolle, die die dauerhaften Güter im deutschen Kon-
sumbudget spielen und die eine Verlangsamung der Gesamtkonsum-Reaktion auf
Einkommensänderungen zur Folge hat. Sektoralbedingte Reaktionsunterschiede
sehen die Autoren in der unterschiedlichen Elastizität der Arbeitskräftenachfrage der
einzelnen Sektoren auf Produktionsänderungen und dem relativ kleineren Anteil der
Personengesellschaften in Frankreich. Als institutionelle Unterschiede schließlich
werden die in der Bundesrepublik insgesamt höhere Steuerbelastung und der sich
daraus ergebende höhere „leakage“-Effekt genannt.

Natürlich wäre es verdienstvoll gewesen, wenn die strukturellen und sektoralen
Relativierungen weiter getrieben worden wären. Aber die verfügbare Datenbasis setzt
entsprechenden Bemühungen bekanntlich enge Grenzen, und auch die vorgelegten
Ergebnisse überschreiten bereits an mehr als einer Stelle die gegenwärtigen Grenzen
der wirtschaftspolitischen Gestaltbarkeit. Als exemplarisch für das Überwiegen der
diagnostischen über die therapeutischen Möglichkeiten ist insbesondere auch an die
von den Autoren errechneten verschiedenen trade-off-Kurven zu denken, wobei es
angesichts der erheblichen Unschärfe derartiger Berechnungen freilich angemessener
wäre, von trade-off-Zonen zu sprechen (von dem fundamentalen Problem – dem
Angewiesensein auf Ausgleichs- anstelle von Planwerten – ganz zu schweigen). Dies
wird bei den Erklärungen deutlich, die *de Ménil* / *Westphal* für die unterschiedlichen
Reaktionen der beiden Länder auf die beiden Ölkrisen geben: Die vergleichsweise
geringen Inflationswirkungen dieser Schocks in der Bundesrepublik werden „struk-
turell“ auf die spezifische Wirkungsweise der automatischen Stabilisatoren zurück-

geführt. Da die „Indexierung“ in der Bundesrepublik deutlich schwächer und langsamer wirkt als in Frankreich, fiel die durch die Reduzierung der Realeinkommen bewirkte inländische Absorptionsdämpfung entsprechend stärker aus, was zu einer Dämpfung der Inflationswirkungen führte; zumal die Inflationsrate in der Bundesrepublik auf zyklische Produktionsschwankungen ohnehin sensibler reagiert als bei ihrem Nachbarn (S. 377). Darüber hinaus wird deutlich, daß die deutsche Wirtschaft sehr empfindlich auf die mit den beiden Krisen einhergehenden Veränderungen des Welthandelsvolumens reagierte, was sowohl mit dem hohen Anteil dauerhafter Güter am deutschen Export als auch mit dem hohen Exportmultiplikator zusammenhängt. Weniger überzeugend erscheinen die Schlußfolgerungen, die *de Ménil / Westphal* aus diesen Ergebnissen ziehen: So wie sie ihre Ergebnisse entwickeln, ist nicht immer zu erkennen, wo bei den institutionellen strukturellen und sektoralen Faktoren die wirtschaftspolitischen Gestaltungsmöglichkeiten liegen. Es sei denn, darunter werden auch die „Reaktionsfunktionen“ z. B. der Bundesbank oder der Tarifpartner verstanden. Über weite Teile der Arbeit ist dies nicht der Fall und geht z. B. angesichts der endogenen Tariflohnbestimmungen, d. h. stets gleicher Reaktionen in bezug auf (z. B.) Inflation oder Arbeitslosigkeit (S. 198), über die in den Modellen vorhandenen instrumentalen Möglichkeiten hinaus.

Die bisherigen Ausführungen sollten deutlich gemacht haben, daß es sich bei dem Band um einen in seiner Gesamtheit neuen und wichtigen Beitrag zur makroökonomischen Charakterisierung der beiden Länder handelt, der für „Publikum“ und „Zirkel“ gleichermaßen Richtstäbe setzt. Seine Überschrift und der explizite Bezug auf die „contemporary cliometrics“ wecken indessen vielleicht umfassendere Erwartungen, weshalb hier kurz die Grenzen dieser Methode bei der „Analyse der Stabilisierungspolitik“ in Erinnerung gerufen werden sollen². Daß sich die Analyse auf den engen ökonomischen Aspekt der Stabilisierungspolitik beschränkt, dürfte auf den ersten Blick kaum als Einschränkung empfunden werden. Vergegenwärtigt man sich indessen z. B. nur die zahlreichen politischen Restriktionen, die mit Aufwertungen der D-Mark unter den verschiedenen Wechselkurssystemen verbunden waren, so könnte sich dies leicht ändern. Eine ähnliche Relativierung ist auch bezüglich der Stabilisierungspolitik selbst zu machen. In der Bundesrepublik dürfte spätestens seit der „kontraktiven“ „Operation '82“ vom Sommer 1981 und ihrem „expansiven“ Korrelat – der „Beschäftigungsinitiative“ im Februar 1982 – deutlich geworden sein, daß die Stabilisierungspolitik gelegentlich an verschiedenen Fronten mit z. T. sich mindestens vorübergehend ausschließenden Zielen operiert. Eine dritte Einschränkung schließlich ist in der Beschränkung auf quantitative Faktoren zu sehen; im Fall ökonometrischer Modelle kommt hinzu, daß es sich bei den analysierten Faktoren (meist) nicht nur um Quantitäten, sondern um (möglichst lange) Zeitreihen handelt. „Singuläre“ Ereignisse, von Paradigmenwechsel zu schweigen, spielen in derartigen Analysen naturgemäß kaum eine Rolle – ganz im Unterschied zur praktischen Wirtschaftspolitik. Die in diesem Zusammenhang auch zu nennende Relativierung der Aussagen durch die Verwendung von Modellen, deren eigentliche Hypothesen ja schon im Vorfeld der Modellbildung getestet wurden, fand bereits oben Erwähnung. Wichtiger ist hier sich zu erinnern, daß sich die Politikanalyse mit ökonometrischen Modellen eben im wesentlichen auf die Variation von exogenen Variablen beschränkt, die Ausgangs-

² Im Grunde handelt es sich im folgenden um eine verkürzte Wiedergabe der Auseinandersetzung um die NEH (vgl. dazu z. B. R. L. *Andreano* (Ed.) (1970), *The New Economic History. Recent Papers on Methodology*. New York u. a. oder P. *Temin* (1976), *Did Monetary Forces Cause the Great Depression*. New York). Es sollte allerdings nicht übersehen werden, daß die zeitgeschichtliche Variante der NEH den unter Handlungsaspekten nicht unbeträchtlichen Vorteil hat, daß ihre Hypothesen dem ex ante-Prognosetest unterworfen werden können.

situation als zweite prinzipielle Determinante der Ergebnisse ist oft von nur geringem Einfluß. Damit soll keineswegs der Lucas-Kritik am Aussagegehalt ökonometrischer Simulationsrechnungen das Wort geredet werden, deren empirische Fundierung bekanntlich nicht sehr überzeugend ist (Gordon, Eckstein). Aber es wäre sicherlich ebenso falsch anzunehmen, daß die empirische Analyse die „Naturkonstanten“ ökonomischen Verhaltens bereits hinreichend identifiziert hätte.

U. Heilemann, Essen

Brandes, Wilhelm: Über die Grenzen der Schreibtischökonomie (Die Einheit der Gesellschaftswissenschaften 40). J. C. B. Mohr (Paul Siebeck), Tübingen 1985. XI, 254 S. Ln. DM 78,—.

In diesem Buch geht es um die grundsätzlichen Probleme ökonomischer Prognosen, die für Brandes die Grenzen der Schreibtisch-Ökonomie aufzeigen. Brandes beschäftigt sich auf drei Ebenen mit den Schwierigkeiten der Vorhersagen: im ersten Teil des Buches auf der Unternehmensebene, im zweiten Teil auf der aggregierten Ebene und im dritten Teil auf der grundlegenden wissenschaftstheoretischen Ebene. Im vierten Teil des Buches zieht Brandes einige Schlußfolgerungen für die ökonomische Lehre, Forschung und Politikberatung.

Der Verfasser führt zunächst aus, daß schon geringe Annäherungen an die Realität darstellende Modifikationen der neoklassischen Unternehmenstheorie zur Preisgabe von eindeutigen komparativ-statischen Aussagen führen. Selbst wenn man die wichtigste Prämisse – die Optimierungsannahme – beibehält und das Modell nur um z. B. die Einführung unsicherer Zukunftserwartungen, die Beschaffung und Verarbeitung von Informationen, explizite Behandlung der zeitlichen Dimension, die Berücksichtigung verschiedener Ziele erweitert, läßt sich keine eindeutige Reaktion der Unternehmen auf Datenänderungen mehr ableiten. Dies gilt erst recht, wenn die normative Unternehmenstheorie aufgegeben wird und stattdessen andere Konzepte wie die der begrenzten Rationalität, des adaptiven Man, der X-Ineffizienzen Anwendung finden, oder wenn von der verfügbaren empirischen Evidenz ausgegangen wird: In keinem Fall kann der Ökonom ohne Kenntnis der psychologischen Eigenschaften der Unternehmer deren ökonomisches Verhalten eindeutig bestimmen, weshalb Brandes von einem Theoriedefizit der Unternehmenstheorie spricht.

Im zweiten Teil fragt der Autor, ob die aggregierte, sektorale Betrachtungsweise dieses Theoriedefizit heilt, d. h. ob auf sektoraler Ebene die Abschätzung der Auswirkungen alternativer Eingriffe besser vorhergesagt werden kann als auf einzelwirtschaftlicher Ebene. Eine Antwort fällt negativ aus: Zum einen werden die bei einem unzutreffenden einzelbetrieblichen Modell entstandenen Fehler durch das Gesetz der großen Zahlen nicht a priori aufgehoben, zum anderen ist es durch die empirische Prüfung von Hypothesen nicht möglich, die sich eventuell kompensierenden Fehler der theoretischen Modellvorstellungen zu eliminieren. Empirische Tests können nicht bestimmen, welches Erklärungsmodell ‚stimmt‘, wie von Brandes ausführlich und an Beispielen erläutert und begründet wird. Das Unvermögen der Ökonomen, eindeutige Aussagen über die Wirkungen exogener Größen auf die ökonomischen Entscheidungen zu machen, bleibt also auch auf sektoraler Ebene bestehen, wenn man von einigen vagen Behauptungen absieht, die man auch durch eine theorieleere Zeitreihenanalyse gewinnen kann.

Nun stellt sich zwangsläufig die Frage nach dem Anspruch, den die Ökonomen an ihre Forschung stellen können. Dieses Problem der Leistungsfähigkeit ökonomischer Forschung untersucht Brandes in drei Abschnitten im dritten, dem wissenschafts-

theoretischen Teil seines Buches. Zunächst interessiert Brandes die Demarkationslinie zwischen Wissenschaft und Nichtwissenschaft. In einem kurzen Abriß der jüngeren wissenschaftstheoretischen Diskussion zeigt er, daß die diesbezüglichen eindeutigen Aussagen (z. B. die des kritischen Rationalismus) für die Wirtschaftswissenschaft, in der stochastische Gesetze dominieren, von geringer Bedeutung sind. Deshalb skizziert Brandes zum Abschluß dieses Abschnittes auch nur eine pragmatische Suchstrategie und gibt keinen allgemeinen Algorithmus an, der stets zu den richtigen wissenschaftlichen Lösungen führt. Im nächsten Abschnitt kritisiert Brandes die instrumentalistische Position à la Friedman. Er zeigt, daß ein solches Forschungsprogramm nicht in der Lage ist, wissenschaftliche Erklärungen zu liefern.

Im letzten Abschnitt des wissenschaftstheoretischen Teils geht es Brandes um die Möglichkeiten objektiver Erkenntnisse. Aus seinen Ausführungen zum Unterschied von wissenschaftlichen Erklärungen und Prognosen, zu den Parallelen und Unterschieden von Natur- und Sozialwissenschaften und zur Zuverlässigkeit wissenschaftlicher Theorien zieht der Autor die Konsequenz, daß es keine objektive Erkenntnis geben kann und daß deshalb den subjektiven Faktoren eine beträchtliche Bedeutung zukommt. Der Wissenschaftler müsse seine persönliche Meinung stets gebührend kenntlich machen und dürfe diese Subjektivität nicht für mit dem Streben nach wissenschaftlicher Erkenntnis unvereinbar halten.

Im abschließenden vierten Teil des Buches arbeitet Brandes zunächst Ansatzpunkte für die künftige ökonomische Forschung heraus. Er fordert die Ökonomen zu einem theoriegeleiteten Empirismus auf und verweist dabei auf die Bedeutung des ‚story telling‘ und der Wirtschaftsgeschichte für den Entdeckungszusammenhang ökonomischer Erkenntnisse, erkennt in der Systemanalyse in Form numerischer Simulationen die Integration von formalwissenschaftlichen ökonomischen Arbeiten, die die Implikationen von Annahmen ableiten, und von realwissenschaftlichen ökonomischen Arbeiten, die Aussagen über die reale Welt machen, macht Verbesserungsvorschläge für die Gestaltung ökonometrischer Analysen und plädiert für eine engere Zusammenarbeit von Ökonomen und anderen Verhaltenswissenschaftlern, um die tieferliegenden, das menschliche Handeln bestimmenden Gesetzmäßigkeiten zu erforschen. Danach untersucht Brandes, wie sich die Ökonomen in der Politikberatung verhalten sollen. Er kommt zu dem Ergebnis, daß sie stärker als bisher das subjektive Element ihrer Erkenntnisse betonen sollten, wozu insbesondere eine Offenlegung ihrer Bewertung von Zielen, Mitteln und Nebenwirkungen gehört. Die Konsequenzen, die sich aus seinen Ausführungen für die Lehre ergeben, beziehen sich nach Brandes hauptsächlich auf die Haltung, die dem Studenten vermittelt werden soll: Der Student muß akzeptieren lernen, daß es nur sehr wenige eindeutige ökonomische Erkenntnisse gibt, er muß zwischen formalen Analysen und Aussagen über Tatsachen unterscheiden können, er muß für eine Zusammenarbeit mit anderen Disziplinen offen sein, und er muß sich damit abfinden, noch eine Zeitlang mit dem (unbefriedigenden) neoklassischen Paradigma leben zu müssen, da es dazu noch keine ausgearbeitete Alternative gibt.

Brandes hat mit diesem Buch eine hervorragende Studie über die Aussagekraft und den Erklärungsgehalt der Wirtschaftswissenschaften vorgelegt. Die vielen Bezüge zur agrarökonomischen Forschung, die er in die Ausführungen der ersten beiden Teile einfließen läßt, haben lediglich Beispielcharakter und schränken nicht etwa die Gültigkeit seiner Argumente auf den Bereich der Agrarökonomie ein. In der zweiten Hälfte des Buches erfreuen vor allem die breite Diskussion der Probleme, die durch den stochastischen Charakter der ökonomischen Theorien ausgelöst werden, und die unkonventionellen aber dennoch fundierten Vorschläge für die zukünftige Forschung, Politikberatung und Lehre. Der gute Aufbau des Buches, sein flüssiger Stil und das

umfassende Literaturverzeichnis sind weitere Pluspunkte eines Buches, dessen Lektüre allen Studenten und Dozenten, die auch nur ein bißchen von dem „Unbehagen an der Art und Weise, wie Forschung in der . . . Ökonomie . . . durchgeführt wird“ (S. V), verspüren, und die dieses Unbehagen nicht verdrängen sondern verarbeiten möchten, uneingeschränkt empfohlen werden kann.

R. Marggraf, Heidelberg

Littmann, Konrad: Steuerreform statt Tarifierung (Wirtschaftspolitische Kolloquien der Adolf-Weber-Stiftung). Duncker & Humblot, Berlin 1985. 74 S. DM 29,60.

Ein zentrales Thema der Finanzpolitik ist seit Jahren die Diskussion um eine (große) Steuerreform. Während man sich weitgehend einig ist, daß – aus vielen Gründen – die steuerliche Belastung der Bürger gesenkt und dem Gebot der steuerlichen Gerechtigkeit verstärkt Genüge getan werden muß, ist der Weg dorthin umstritten. Soll man sich mit gelegentlichen Tarifierungen (vor allem bei der Einkommensteuer) zufrieden geben oder ist eine groß angelegte Steuerreform vonnöten? Dieser Frage geht die vorliegende Schrift nach. Sie ist die überarbeitete Fassung eines Vortrags, den Littmann 1984 anläßlich eines wirtschaftspolitischen Kolloquiums der Adolf-Weber-Stiftung gehalten hat. Die Arbeit wird ergänzt durch eine (gemeinsam mit Walter Leisner erstellte) Zusammenfassung der Diskussion, die sich an den damaligen Vortrag angeschlossen hat.

Der Titel verspricht weniger als die Schrift hält; denn es geht keineswegs nur um Probleme der Einkommensteuer, sondern es wird ein tour d'horizon der aktuellen Fragen der Besteuerung geboten, wie sie sich im Herbst 1984 darstellten und weitgehend auch heute (1986) noch diskutiert werden. Neben Problemen des Tarifs und der Bemessungsgrundlage der Einkommensteuer werden vor allem Fragen des Familienlastenausgleichs und der Besteuerung der Transfereinkommen, speziell der Alters-einkünfte, sowie Aspekte der Unternehmensbesteuerung erörtert.

Für all diese Themen war Littmann zweifellos der geeignete Referent, da er sich seit Jahren als Vorsitzender des Wissenschaftlichen Beirats beim Bundesministerium der Finanzen und als Mitglied der Sachverständigenkommission Alterssicherungssysteme mit zentralen Fragen des Steuersystems befaßt und dazu viel beachtete Reformvorschläge unterbreitet hat. Möglicherweise lag darin für den Autor aber auch ein besonderes Problem: Es kann ihm nicht leicht gefallen sein, seine Vorstellungen auf nur knapp fünfzig Seiten vortragen zu müssen. Allerdings hat dies wiederum zu einer präzisen und konzisen Darstellung geführt, die dem Leser einen knappen Überblick über ein nahezu schon ausuferndes Thema beschert.

Jede Steuerreform muß finanzierbar sein. Insofern stellen die gelegentlichen Tarifierungen angesichts der nur begrenzt zur Verfügung stehenden Finanzmasse sicher den einfacheren Weg dar. Allerdings werden dadurch inkonsistente Regelungen des Steuersystems nicht beseitigt, in ihren Wirkungen oft sogar noch verschärft. Infolgedessen muß – so der Autor – letzten Endes eine Reform der Bemessungsgrundlage (vor allem: durch Abbau der Sonderregelungen) angestrebt werden. Dieses Vorgehen hat zudem den Vorteil, daß damit zusätzliche Finanzmasse geschaffen wird, die für Tarifierungen genutzt werden könnte.

Hat man sich für die Einkommensteuer als die zentrale Abgabe entschieden, dann muß der Einkommensbegriff so weit gefaßt werden, daß alles, was im ökonomischen Sinn Einkommen ist, besteuert wird. Infolgedessen ist es nur konsequent, daß Litt-

mann auch die steuerliche Behandlung der Transfereinkommen und dabei vor allem die der Alterseinkünfte diskutiert. Hierbei zeigt sich, daß gegen das Gebot der steuerlichen Gerechtigkeit sowohl bei der Besteuerung der Alterseinkünfte wie auch bei der der Vorsorgeaufwendungen in eklatanter Weise verstoßen wird.

Das schwierigste Problem bei einer Steuerreform wird die Beseitigung der Sonderregelungen sein, die zu einer weitgehenden Aushöhlung der Bemessungsgrundlage oder – so Littmann – zu einem „kaum mehr durchschaubaren Knäuel von Begünstigungen und Benachteiligungen“ (S. 40) geführt haben. Am Beispiel der Bausparförderung wird gezeigt, wie eine ehemals vielleicht vertretbare Regelung mit der Zeit denaturiert ist; ihr Abbau würde aber wiederum unerwünschte Substitutionseffekte hervorrufen. Vielleicht wäre dem noch ein Punkt hinzuzufügen gewesen: Sollten aus wirtschaftspolitischen Gründen solche Regelungen erforderlich sein, so dürften sie aus steuersystematischen Gründen nicht als Abzüge von der Bemessungsgrundlage, sondern nur als Abzüge von der Steuerschuld ausgestaltet sein. Der Hinweis scheint geboten, weil bei der Neugestaltung der steuerlichen Behandlung des Wohnens im eigenen Haus mit der Vorschrift des § 10 e EStG erneut gegen dieses Gebot verstoßen worden ist. Littmann kommt zu dem Ergebnis, daß eine Steuerreform von einem klaren Einkommensbegriff ausgehen und diesen dann auch konsequent durchsetzen muß. So sehr man ihm darin zustimmen kann, es hat auch Konsequenzen für die von Littmann vorgenommene Beurteilung der steuerlichen Behandlung der Soll- (S. 24 f.) und Habenzinsen (S. 32 f.). Im ersten Fall vertritt er die Ansicht, Sollzinsen würden – soweit sie nicht Betriebsausgaben oder Werbungskosten sind – im heutigen System der Einkommensteuer doppelt belastet: Einmal beim Schuldner, der die Zinsen aus versteuertem Einkommen zahlen muß, und zum anderen beim Gläubiger, für den die Zinsen Einkommen darstellen. Dies ist aber keineswegs eine „schwere Verletzung des Gebots der steuerlichen Gleichbehandlung“ (S. 24), sondern einfach die Folge der Tatsache, daß die Einkommensteuer die Einkommensentstehung und nicht die Einkommensverwendung erfaßt. Durchaus konsequent schreibt Littmann der Einkommensteuer auch den Mangel zu, daß die Ersparnisse doppelt belastet würden, weil die Ersparnisbildung der Einkommensteuer unterliege und ebenso die auf die Ersparnis anfallenden Zinsen. Im Rahmen einer Einkommensteuer ist die damit fröhlich Urständ feiernde Doppelbelastungsthese aber falsch: Der Einkommenszufluß wird besteuert, unabhängig davon, ob die Einkommen für Konsum oder Sparen verwendet werden. Zinsen sind neue Einkommen, die infolgedessen auch besteuert werden müssen.

Im Mittelpunkt der Diskussion um eine Steuerreform steht die Forderung nach einer Reform der Unternehmensbesteuerung, konkret: die Senkung der steuerlichen Belastung der Gewinne. Beim Abwägen aller Aspekte kommt Littmann zu dem Ergebnis, daß nicht die Gewinnsteuern, sondern vielmehr die Vermögen- und die Gewerbesteuer in diesem Zusammenhang Aufmerksamkeit verdienen. Wie der Autor die gegenwärtigen Regelungen der beiden zuletzt genannten Abgaben beurteilt, wird bereits in der Überschrift „Das Elend der Vermögensteuer und der Gewerbesteuer“ (S. 45) deutlich. Bei der Vermögensteuer plädiert er für eine Abschaffung, bei der Gewerbesteuer käme nur ein Ersatz in Frage – sei es durch eine Wertschöpfungssteuer, sei es durch eine Beteiligung der Gemeinden am Umsatzsteueraufkommen.

Die Arbeit schließt mit einem Plädoyer für eine große Steuerreform. Eine systematische Neuordnung verlangt – so der Autor – Mut auf Seiten der Politiker, viel Zeit und politische Mehrheiten, die zu durchgreifenden Änderungen fähig sind. Insgesamt ist es Littmann vorzüglich gelungen, die aktuelle Diskussion auf nur begrenzt zur Verfügung stehendem Raum verständlich zu machen und die wichtigsten Kontroversen zu verdeutlichen. In Zeiten, in denen Diskussionen um eine Steuerreform vielfach von

phantastischen Vorstellungen, ideologischen Positionen und parteipolitischen Quereilen gekennzeichnet sind, tut es gut, eine seriöse, abgewogene und realistische Betrachtung zu finden. Daß diese im Sprachlichen und Stilistischen auch noch ein Genuß ist, wird der Leser – auch der nicht wirtschaftswissenschaftlich vorgebildete – dem Autor besonders hoch anrechnen.

R. Peffekoven, Mainz

Frohn, Joachim (Hrsg.): Zur Spezifizierung und Analyse ökonometrischer Modelle (Sonderhefte zum Allgemeinen Statistischen Archiv, Heft 23). Vandenhoeck & Ruprecht, Göttingen 1984. 123 S. DM 32,—.

Mit dem Tagungsband will der Herausgeber keinen Überblick über die gegenwärtig vorhandenen ökonometrischen Ansätze bieten, sondern er möchte vielmehr anhand einiger grundsätzlicher Fragestellungen und anhand einiger Spezialprobleme auf die vielfältigen Möglichkeiten eines Einsatzes ökonometrischer Konzepte hinweisen. Der Band beinhaltet sechs Vorträge, die auf der Fortbildungsveranstaltung der Deutschen Statistischen Gesellschaft im Jahre 1983 in Bielefeld gehalten wurden. Neben Arbeiten, die Fragestellungen im Zusammenhang mit der Spezifikation ökonometrischer Modelle (Einbeziehung von Erwartungsgrößen und Berücksichtigung qualitativer abhängiger Variablen) behandeln, finden sich Arbeiten zur Nutzung ökonometrischer Programmsysteme und zum Einsatz ökonometrischer Entscheidungsmodelle. Abgeschlossen wird der Tagungsband von zwei Beiträgen, die die Analyse und Prognose von Zeitreihen zum Gegenstand haben.

In der ersten Arbeit unterstreicht *J. Frohn* drei Ansätze zur Einbeziehung von Erwartungsgrößen in ökonometrische Modelle: die Verwendung von Antizipationsvariablen, adaptive Erwartungen (univariate Zeitreihenmodelle) sowie das Konzept der rationalen Erwartungen. Zur Beurteilung der drei genannten Ansätze geht der Verfasser der Frage nach, ob eine Endogenisierung der Erwartungsgrößen vorliegt und ob der gewählte Erklärungsansatz als angemessene Erfassung des Erwartungsbildungsprozesses anzusehen ist. *Frohn* zeigt, daß nur das Konzept der rationalen Erwartungen diesen Ansprüchen genügt. Zum Schluß zählt er aber auch einige Einwendungen gegen dieses Konzept auf.

In seinem Beitrag gibt *G. Ronning* einen Überblick über den gegenwärtigen Stand der wissenschaftlichen Ergebnisse auf dem Gebiet der ökonometrischen Modelle mit qualitativen abhängigen Variablen. Nach einer Darstellung der für die Ökonometrie wesentlichen Unterschiede und Gemeinsamkeiten von Modellen mit qualitativen abhängigen Variablen einerseits und Modellen zur Erklärung diskreter Auswahlmöglichkeiten andererseits werden Eingleichungsmodelle, also Modelle mit einer abhängigen qualitativen Variablen (z. B. Logit-Modelle, Probit-Modelle und das „nested logit model“), und Mehrgleichungsmodelle (z. B. Multivariate Logit- und Probit-Modelle) beschrieben. Zum Schluß behandelt er einige Probleme bei der Schätzung dieser Modelle.

H. J. Haas vermittelt einen Überblick über Programmsysteme im Bereich der Ökonometrie. Nach einer kurzen Darstellung der Entwicklungstendenzen ökonometrischer Software werden einige Programmsysteme, deren Entwicklung weiter zurückreicht und von denen angenommen werden darf, daß sie auch in Zukunft gepflegt werden, näher erläutert, und zwar TROLL, IAS, MEBA, MBS, SAS und TSP. Es werden jeweils die historische Entwicklung, die methodische Handhabung sowie teilweise die anfallenden Kosten dokumentiert. Am Beispiel des ökonometrischen Pro-

grammsystems EPS wird dem Leser ein Eindruck einer Kommandosprache verdeutlicht.

R. Friedmann befaßt sich in seinem Aufsatz „Optimale Kontrolle mit ökonometrischen Modellen: Politikintensität bei Multiplikatorunsicherheit“ mit Fragestellungen bezüglich der Festsetzung von Politikvariablen, die nicht nur das Niveau, sondern auch das Ausmaß der Unsicherheit, mit der die Realisationen dieser Zielgrößen behaftet sind, beeinflusst.

H. Lütkepohl schlägt als Alternative zu den herkömmlichen ökonometrischen Verfahren sogenannte Vektor-ARMA-(autoregressive Moving-Average-)Modelle zur Prognose vor. Nach einer formalen Darstellung dieser multiplen Zeitreihenmodelle wird die Schätzung ihrer Parameter diskutiert. Wie bei den univariaten ARMA-Modellen müssen auch bei den Vektor-ARMA-Prozessen in der Identifikationsphase die Ordnungen p und q festgelegt werden. Der Verfasser beschränkt sich dabei im wesentlichen auf AR-Prozesse, da sie nicht nur bei der Schätzung, sondern auch bei der Spezifikation leichter handhabbar sind. Die Identifikationsverfahren lassen sich in sequentielle Testprozeduren und in Verfahren, die auf der Optimierung eines Schätzkriteriums für die AR-Ordnung basieren, unterscheiden. Insgesamt kommt Lütkepohl zum Schluß, daß noch keine gesicherten Entscheidungsregeln für die Auswahl des Spezifikationsverfahrens zur Verfügung stehen.

Im letzten Beitrag befaßt sich *R. Pauly* mit der Zeitreihenzerlegung in einen glatten und in einen irregulären Teil. Gegenübergestellt werden die Bestimmung der glatten Komponente in Form von Trendpolynomen und von Glättungsverfahren, deren Regressionslösungen gleitende gewichtete Durchschnitte der Beobachtungen darstellen. Zum Schluß wendet der Verfasser ein Glättungsverfahren auf die Arbeitslosenzahlen von 1953 bis 1982 an.

Obwohl teilweise profunde mathematische Kenntnisse vom Leser verlangt werden, eignet sich der vorliegende Tagungsband sowohl für den theoretisch orientierten als auch für den praktisch arbeitenden Ökonometriker zur Lektüre. Das breite Spektrum der angesprochenen Themen ist übersichtlich dargestellt und gewährt dem Leser einen Einblick in einige wichtige Probleme aus dem Bereich der Ökonometrie und der Zeitreihenanalyse.

P. Pflaumer, Dortmund

Poscher, Axel: Ökonometrische Analysen und statistische Inferenzkonzepte (Volkswirtschaftliche Schriften, Heft 334). Duncker & Humblot, Berlin-München 1983. 207 S. DM 112,—.

Daten, die in der Ökonometrie zum Einsatz kommen, sind in der Regel nicht als Realisierungen wiederholbarer Zufallsvorgänge entstanden. Handelt es sich um Zeitreihendaten, so ist ferner – insbesondere auch unter dem Aspekt, daß die zu untersuchenden Gesetzmäßigkeiten nicht über einen beliebig langen Zeitraum hinweg als stabil angesehen werden können – der Umfang der verfügbaren Datensätze meist relativ gering, zu gering jedenfalls, um sie zu zweiteilen und einen Teil zur Modellspezifikation, den anderen zur Strukturspezifikation zu verwenden. Zu fragen ist, ob dennoch, ausgehend von einem gegebenen Datensatz, für den gesamten, im Buch unter der Bezeichnung ökonometrische Analyse zusammengefaßten Weg der Modellbildung sowie der nachfolgenden Strukturschätzung (und gegebenenfalls noch der Strukturanalyse oder der Prognose) inferenzstatistisch begründete Vorgehensweisen gefunden werden können. Welche Prinzipien statistischer Inferenz sind zugrunde zu

legen, welche Beurteilungskriterien sind anzusetzen und welche Voraussetzungen müssen erfüllt sein, um diese Frage positiv beantworten zu können?

Diese Problemstellung ist der Untersuchungsgegenstand des vorliegenden Buches. Zunächst wird nach einer kurzen Einleitung (Kapitel 1) im zweiten Kapitel viel Grundsätzliches zur ökonomischen Modellbildung sowie zur Rolle der Ökonometrie gesagt. Wichtig für die späteren Kapitel ist vor allem die Unterscheidung zwischen ökonomischen Modellen und ökonomischen Modellansätzen; bei letzteren sind im Unterschied zu den Modellen gewisse Relationen, Variablen oder Parameter noch nicht endgültig festgelegt. Der Autor geht davon aus, daß einer ökonometrischen Analyse in der Regel nur ein Modellansatz und noch kein fertiges Modell zugrunde liegt, so daß der Strukturspezifikation eine Modellspezifikation vorauszugehen hat, wobei beide ein und dasselbe Datenmaterial benutzen müssen. Beide Spezifikationen sind somit als Einheit zu sehen, weshalb sie in Kapitel 3 unter dem Begriff der ökonometrischen Spezifikation zusammengefaßt werden. Ökonometrische Spezifikation steht also – wie vorher schon die ökonometrische Analyse – für den gesamten Weg vom vorliegenden Modellansatz bis hin zur geschätzten Struktur. Der Autor unterscheidet zwischen den beiden Begriffen, indem er die ökonometrische Analyse der Praxis, die ökonometrische Spezifikation dagegen der Theorie zurechnet – eine Differenzierung, die für die weiteren Untersuchungen ohne Belang ist. In Kapitel 3 werden ferner einzelne Spezifikationsprobleme aufgelistet und diskutiert, und es wird erörtert, welche Behandlung bzw. Nicht-Behandlung das ökonometrische Spezifikationsproblem in Lehrbüchern, in der Praxis bzw. in der Forschung erfährt.

Kapitel 4 ist der Entwicklung und Beschreibung möglicher Konzepte statistischer Inferenz gewidmet, wobei diese Konzepte dargestellt werden für die Parameterpunktschätzung im linearen Regressionsmodell unter Normalverteilung; auf das ökonometrische Spezifikationsproblem wird noch nicht Bezug genommen. Unter den Stichworten klassische Inferenz (KI), statistische Entscheidungstheorie (SET), Likelihood-Inferenz (LI) und Bayessche Inferenz (BI) werden vier Konzepte unterschieden.

KI bedeutet im Rahmen einer Punktschätzung die Verwendung einer möglichst wirksamen erwartungstreuen Schätzfunktion und liefert im betrachteten Regressionsmodell den Kleinst-Quadrate-Schätzer. Beim Konzept der SET geht der Autor vom Vorliegen nicht nur einer Verlustfunktion, sondern auch einer a priori Verteilung aus, wobei beide Größen subjektive Einschätzungen widerspiegeln. Trotz der Annahme der a priori Verteilung wird zur Beurteilung von Schätzfunktionen jedoch noch der gesamte Verlauf der Risikofunktionen zu Rate gezogen und nicht allein ihr als a priori Risiko bezeichneter a priori Erwartungswert, dessen Minimierung zum Bayes-Schätzer führt. Die Begriffe Dominiertheit und Zulässigkeit sowie Minimax-Schätzer und gleichmäßig bester Schätzer bleiben somit von Interesse. Für spezielle quadratische Verlustfunktionen werden Stein-Regel-Schätzer vorgestellt, worunter Schätzer zu verstehen sind, die den Kleinst-Quadrate-Schätzer dominieren; auch ein Beispiel für zulässige Stein-Regel-Schätzer wird angegeben. Die beiden Inferenzkonzepte KI und SET werden im Unterschied zu den beiden folgenden Konzepten als stichproben theoretisch klassifiziert, was besagen soll, daß sie auf der Anwendung von Stichprobenfunktionen beruhen, wobei weitgehende Kenntnisse über die Verteilungen dieser Stichprobenfunktionen bestehen.

Das Konzept der LI wird als nächstes diskutiert. Im betrachteten linearen Regressionsmodell bei Normalverteilung führt die Maximierung der Likelihood-Funktion zum selben Schätzergebnis wie der Kleinst-Quadrate-Schätzer. Jedoch ist von der Likelihood-Funktion nicht allein die Maximalstelle von Interesse; zusätzlich informativ kann etwa auch die Angabe desjenigen Bereichs sein, in dem die Likelihood-Funktion einen vorgegebenen Mindestwert übersteigt.

Während im Abschnitt über SET der Bayes-Schätzer definiert war als der das a priori Risiko minimierende Schätzer, wird er im Konzept der BI bei Einbeziehung einer Verlustfunktion definiert durch die Minimierung des a posteriori Risikos; unerwähnt bleibt, daß beide Definitionen in der Regel zum selben Ergebnis führen. Der Autor beschränkt sich im Abschnitt über BI jedoch auf den Fall ohne Einbeziehung einer Verlustfunktion. (Wegen dieser Beschränkung ist der im Abschnitt über SET anschließend an die dortige Definition des Bayes-Schätzers formulierte Satz: „Im Bayesschen Inferenzkonzept wird der Bayes-Schätzer mit Hilfe des a posteriori Risikos definiert“ etwas mißverständlich.) Im Fall ohne Verlustfunktion, in dem auch von reiner BI gesprochen wird, wird zu gegebenem Beobachtungsvektor ein Bayes-Schätzwert als a posteriori Modus eingeführt, was methodisch eine Analogie zur Bildung des Maximum-Likelihood-Schätzers bedeutet. In einem Beispiel zeigt sich, daß der a posteriori Modus nicht eindeutig bestimmt sein muß.

In Kapitel 5 wird nun untersucht, ob bzw. inwieweit sich diese vier Inferenzkonzepte auf das Problem der ökonometrischen Spezifikation übertragen bzw. geeignet erweitern lassen. Dazu wird jedoch eine Beschränkung auf Ansätze linearer Eingleichungsmodelle mit normalverteilten Störvariablen vorgenommen. Als relevante Spezifikationsprobleme bleiben dann im wesentlichen noch die Auswahl der erklärenden Variablen sowie die Berücksichtigung von Nebenbedingungen bzw. a priori Informationen über die Modellparameter. Es wird dahingehend differenziert, ob der zu betrachtende Modellansatz mehrere konkurrierende separate Modelle umfaßt (SM-Ansatz) oder ob er aus Teilmodellen eines Gesamtmodells besteht (TGM-Ansatz). In einem TGM-Ansatz läßt sich das Ausschließen gewisser Regressoren durch eine lineare Nebenbedingung ausdrücken.

Zunächst werden Versuche diskutiert, das Problem der ökonometrischen Spezifikation mit Hilfe der beiden stichprobentheoretischen Inferenzkonzepte KI und SET in den Griff zu bekommen. Dazu wird ein TGM-Ansatz zugrunde gelegt mit einem oder mehreren jeweils durch eine lineare Restriktion beschriebenen Teilmodellen. Eine Gesamtstrategie zur Behandlung des Spezifikationsproblems besteht dann typischerweise aus drei aufeinander aufbauenden Teilverfahren, nämlich der Schätzung im Gesamtmodell, einem (oder mehreren) Test(s) zur Überprüfung der linearen Restriktion(en) sowie schließlich der Schätzung im ausgewählten Teilmodell. Der Aufbau einer solchen Gesamtstrategie ist jedoch meist zu kompliziert, als daß ihre Verteilung handhabbar bzw. ihre Risikofunktion berechenbar wäre. Bezüglich einer Beurteilung nach den Kriterien der KI ergibt sich als zusätzliche Schwierigkeit, daß die Gesamtstrategie in der Regel keine erwartungstreue Schätzung darstellt. Auch die unter den Stichworten „Regressionsstrategien“ bzw. „Alle-Teilmengen-Strategien“ beschriebenen Versuche zur Abwicklung eines Variablenauswahlproblems lassen sich, wie im Buch klar herausgestellt wird, im Rahmen der KI nicht statistisch rechtfertigen. Die Suche nach Gesamtstrategien, die entscheidungstheoretisch bewertbar sind, weil nämlich ihre Risikofunktionen im Gesamtmodell bestimmt werden können, führt im wesentlichen nur für TGM-Ansätze mit genau einem Teilmodell zum Erfolg. Zu nennen sind in dem Zusammenhang der Vortest-Schätzer, gewisse Stein-Regel-Schätzer, in welche die das Teilmodell charakterisierende lineare Restriktion eingearbeitet ist, sowie eine als „modifizierter Stein-Positiv-Regel-Schätzer“ bezeichnete Kombination aus Vortest- und Stein-Regel-Schätzer, die den Vortest-Schätzer dominiert.

Nachdem also klar ist, daß die Behandlung des ökonometrischen Spezifikationsproblems mit Hilfe stichprobentheoretischer Inferenzkonzepte sehr schnell an Grenzen stößt, werden jetzt Möglichkeiten erörtert, das Problem mit Methoden der LI oder der BI anzugehen. Zunächst zeigt sich für das Variablenauswahlproblem in einem TGM-Ansatz, daß bei ausschließlicher Berücksichtigung des Likelihood-Maximums stets

das Gesamtmodell vorzuziehen ist. Bei den anschließend vorgestellten Verfahren geschieht die Modellspezifizierung dadurch, daß ein Teilmodell mit möglichst wenigen Regressoren ausgewählt wird, welches jedoch durch seine (relative) Likelihood gegenüber dem Gesamtmodell bzw. den konkurrierenden Teilmodellen noch „hinreichend gestützt“ ist. Abgesehen davon, daß es problematisch erscheint, die in der Bevorzugung von Modellen mit wenigen Variablen bestehende zusätzliche Zielsetzung ins Likelihood-Konzept mit aufzunehmen, bleibt ferner zu beachten, daß die von einer solchen Vorgehensweise gelieferten Ergebnisse, wie an einem Beispiel gezeigt wird, nicht immer plausibel sind, sofern mehr als zwei Modelle zur Auswahl stehen. Bei Verwendung derartiger Verfahren ist darüber hinaus der Strukturspezifikation nicht mehr anzusehen, daß die Daten bereits zur Modellspezifikation benutzt wurden; im Buch wird deshalb dafür plädiert, nicht nur die letztendlich geschätzte Struktur als Ergebnis festzuhalten, sondern ergänzend auch den vorausgegangenen Ablauf der Modellspezifikation darzulegen.

Die theoretisch befriedigendsten Methoden zur Behandlung des ökonometrischen Spezifikationsproblems erhält man schließlich im Rahmen der BI. Angeboten und diskutiert werden sowohl Verfahren für SM- als auch für TGM-Ansätze; sie besitzen eine Reihe schöner Eigenschaften und Interpretationsmöglichkeiten. Ihrer Anwendbarkeit in der Praxis steht aber – wie dies auch sonst bei Bayes-Verfahren der Fall ist – als Hauptschwierigkeit wohl die erforderliche Präzisierung der a priori Verteilung entgegen, zumal die Verfahren – auch dies wieder, wie bei Bayes-Verfahren üblich – auf a priori Verteilungen beruhen, die insofern zur Likelihood-Funktion „passen“, als sie zu handhabbaren a posteriori Verteilungen führen. Wie aber soll einem Anwender klargemacht werden, daß seine subjektive Einschätzung genau durch eine solche passende a priori Verteilung wiedergegeben wird? In Anbetracht der mit der Festlegung der a priori Verteilung bestehenden Probleme sei insbesondere auf den Unterabschnitt über „Bayessche Sensitivitätsanalyse in linearen Regressionsmodellen“ hingewiesen, in dem sich anschaulich zeigt, wie mit zunehmender Kenntnis der a priori Verteilung die Menge der als Schätzergebnisse möglichen Strukturen immer mehr eingeschränkt wird; allerdings gehören auch hierbei alle zugelassenen a priori Verteilungen zu einer bestimmten Verteilungsklasse.

Insgesamt bietet das Buch einen sehr lesenswerten und auch sehr gut lesbaren Einblick in das behandelte Problem, für den gesamten Weg der Modell- sowie der Strukturspezifikation inferenzstatistisch abgesicherte Verfahren zu gewinnen. Die Lesbarkeit wird noch gefördert durch eine Reihe übersichtlicher Diagramme sowie auch dadurch, daß die Durchführung von Beweisen in einen mathematischen Anhang ausgelagert ist. Als Ergebnis bleibt festzuhalten, daß nur für relativ wenige Situationen Verfahren zur Verfügung stehen, die nicht nur theoretisch innerhalb des benutzten Inferenzkonzepts überzeugen können, sondern die darüber hinaus auch noch praktikabel sind. Praktikern sei insbesondere auch die Warnung nahegelegt, die im mit „Schlußbetrachtungen“ überschriebenen Kapitel 6 ausgesprochen wird, nämlich „die durch die EDV gegebenen Möglichkeiten beim Erproben von Modellen an den Daten nicht unter allen Umständen ‚auszureizen‘“; ein Verfahren ist eben nicht allein schon dadurch statistisch gerechtfertigt, daß für seine Durchführung ein Computer-Programm verfügbar ist. Obwohl in vielerlei Hinsicht Erweiterungen des in Kapitel 5 gesteckten Rahmens (Beschränkung auf Eingleichungsmodelle, auf lineare Modelle sowie auf normalverteilte Störvariablen) denkbar sind und obwohl bei der Darstellung der Verfahren oft auf mögliche Verallgemeinerungen verzichtet wird, erhebt der Autor den Anspruch, die mit der Problemstellung verbundenen Fragen „grundsätzlich und in gewisser Weise auch abschließend zu beantworten“. Dies kann sich somit nur darauf beziehen – und insofern besteht der Anspruch auch zurecht –, daß das

Buch die prinzipiellen Möglichkeiten, vor allem jedoch die Grenzen der Behandlung des ökonomischen Spezifikationsproblems mit Hilfe statistischer Inferenzkonzepte deutlich macht. Vielleicht darf man aber bezüglich der möglichen Anwendungsfälle, in denen sich unabhängig von den Daten nicht nur ein Modellansatz, sondern ein fertiges Modell zugrunde legen läßt, doch etwas optimistischer sein als der Autor.

F. Baur, Augsburg

Langhammer, Rolf J. / Spinanger, Dean: Wirtschaftliche Zusammenarbeit zwischen Entwicklungsländern – Chancen und Risiken (Kieler Studien 190). J. C. B. Mohr (Paul Siebecker), Tübingen 1984. 135 S. DM 52,—.

Wirtschaftliche Zusammenarbeit zwischen Entwicklungsländern wird seit langem unter unterschiedlichen Zielsetzungen diskutiert: Auf der einen Seite gilt sie Befürwortern einer verstärkten wirtschaftlichen Integration der Entwicklungsländer in die internationale Arbeitsteilung als Grundlage für eine Ankurbelung des Entwicklungsprozesses, auf der anderen Seite wird sie von Protagonisten einer Abkopplung der Entwicklungsländer von den Industrieländern als – sinnvollere – Alternative zu verzerrenden und hemmenden Nord-Süd-Beziehungen empfohlen. Für und Wider, Erfolg und Mißerfolg wirtschaftlicher Zusammenarbeit zwischen Entwicklungsländern (der Rezensent übernimmt hier den englischen Kürzel ECDC) wird bereits seit den 50er Jahren diskutiert, vorrangig unter dem Aspekt regionaler Kooperation und Integration.

Entsprechend umfangreich ist der Fundus an einschlägiger Literatur. Langhammer / Spinanger legen eine Arbeit vor, die große Bereiche dieser Diskussion summarisch zusammenfaßt und – dies ist hervorzuheben – empirisch belegt. Es besteht kein Mangel an detaillierten Studien einzelner Kooperations- und Integrationsabkommen, doch ist das Feld empirisch fundierter Übersichtsanalysen relativ dünn besetzt. Die Autoren leisten hier einen wertvollen Beitrag.

Sie beleuchten zunächst die historische Entwicklungen von ECDC, die von der Verfolgung traditioneller Integrationsmuster geprägt war (Freihandelszonen, Zollunionen, gemeinsame Märkte, Wirtschaftsgemeinschaften). Unter Verzicht auf ausgedehnte Belege gelingt es den Autoren klarzulegen, daß hierfür unterschiedliche Motive ausschlaggebend waren: Hatten vor allem in Afrika ehemalige koloniale Föderationen und später das Beispiel der Europäischen Gemeinschaft den Weg vorgezeichnet, stand in Lateinamerika mehr die Lösung von als negativ empfundenen Nord-Süd-Relationen durch Importsubstitution im Vordergrund. Die Bilanz dieser ECDC-Ansätze ist – wie die Autoren zu Recht betonen – ernüchternd, um nicht zu sagen: dürftig. Der einschlägig nicht vertiefend informierte Leser wird dabei allerdings etwas allein gelassen, wenn es um die Frage geht, weshalb die zahlreichen Integrations- und Kooperationsversuche im großen und ganzen als gescheitert anzusehen sind. Sicherlich ist es kaum möglich, die sehr heterogenen Bestimmungsfaktoren knapp und gleichzeitig umfassend darzulegen. Da dies jedoch im Hinblick auf die Prognosen zukünftiger ECDC ein zentraler Aspekt ist, hätte auch einer exemplarischen Ursachenanalyse mehr Platz eingeräumt werden können; zumindest wären ausführlichere Literaturhinweise zu den einzelnen Integrations- und Kooperationsabkommen hilfreich.

So entsteht ein gewisser Bruch, oder besser: ein Sprung in der Argumentation, wenn aus den Mißerfolgen regionaler Kooperationen, die nur einen sehr schwachen Beitrag zum Süd-Süd-Handel leisten konnten, nun die Umorientierung auf globalere, nicht regional beschränkte Kooperationsansätze behandelt wird. Von den nach Mei-

nung des Rezensenten wichtigsten Desintegrationsfaktoren – (a) stark unterschiedliches ökonomisches Entwicklungs- und Industrialisierungsniveau (inklusive infrastruktureller Probleme), (b) substitutive Wirtschaftsstrukturen und (c) politische Spannungen aufgrund der Faktoren (a) und/oder (b) zwischen den Kooperationspartnern – wird nur (a) ausführlicher diskutiert, der wohl wichtigste Punkt (c) mehr en passant behandelt, während (b) eher versteckt später im Zusammenhang mit den Erfolgswahrscheinlichkeiten globaler Präferenzabkommen zwischen Entwicklungsländern (GSTP) behandelt wird. Die Frage, weshalb dann globaler Kooperation der Vorzug vor regionaler Integration gegeben werden soll, wird somit explizit nur partiell beantwortet.

Andererseits gelingt es den Autoren hervorragend, die Bedeutung der wichtigsten Komponenten globaler ECDC herauszuarbeiten. Im Zentrum der Analyse steht dabei natürlich ein Allgemeines Präferenzsystem zwischen Entwicklungsländern (GSTP), das den Anstoß geben könnte für Handelsschaffung zwischen den Entwicklungsländern und Handelsumlenkung vom Nord-Süd- zum Süd-Süd-Handel. Dabei scheinen sich die Probleme regionaler Kooperation auf höherer Ebene zu wiederholen: Ungleich Ausgangssituationen lassen disparitätische Verteilung von Nutzen und Lasten verstärkten Süd-Süd-Handels erwarten, wodurch sich auch hier das nach bisherigen Erfahrungen ungelöste Problem der Kompensation der Verlierer durch die Gewinner stellt. Der Süd-Süd-Handelsschaffung stehen dabei wiederum und insbesondere substitutionale Wirtschaftsstrukturen der Entwicklungsländer entgegen, die einen alle Güter umfassenden Abbau handelsbeschränkender Maßnahmen wenig wahrscheinlich machen. Es ist daher eher zu erwarten, daß selektive Vereinbarungen Nord-Süd-Handelsbeziehungen zugunsten von Süd-Süd-Beziehungen umlenken.

Die Autoren versuchen, sowohl den handelsschaffenden als auch den handelsumlenkenden Effekt empirisch zu schätzen. Dabei zeigt sich erneut, wie schwierig Schätzergebnisse zu interpretieren sind, wenn sich verschiedene Einflüsse überlagern, so wie es zum Beispiel bei der LAFTA und dem GATT-Protokoll von 1971 der Fall ist. Langhammer / Spinanger vermögen jedoch die fördernden bzw. hemmenden Faktoren herauszuarbeiten, welche die Entwicklung des Süd-Süd-Handels bestimmt haben und bestimmen werden.

In ausführlichen Abschnitten werden die Implikationen von ECDC sowohl für die Entwicklungsländer als auch für die Industrieländer und insbesondere für die Bundesrepublik Deutschland behandelt, wobei allerdings eher die wirtschaftspolitischen als die entwicklungspolitischen Implikationen untersucht werden. Unter anderem wird hervorgehoben, daß sich supranationale Verteilungsprobleme zwischen den Entwicklungsländern ergeben dürften. Diese makroökonomische Ebene wird jedoch in der Arbeit durchgängig nicht verlassen, obgleich interne Verteilungs- und andere Probleme in den einzelnen Entwicklungsländern für Entwicklung und Erfolg sowohl von ECDC als auch der Nord-Süd-Entwicklungszusammenarbeit in prominenter Weise bestimmend sein dürften. Dies gilt um so mehr, als erforderliche Strukturanpassungen im Rahmen von Handelsschaffung und -umlenkung unbeschadet makroökonomisch günstiger Gesamtwirkungen bei disaggregierter Betrachtung durchaus negative Effekte ergeben können, etwa im Hinblick auf (negative) lokale Beschäftigungswirkungen oder noch ungleichmäßigere interne Einkommensverteilungen, welche die Bereitschaft oder Fähigkeit, ECDC voranzutreiben und mitzutragen, beeinträchtigen können. In diesem Sinne wird der Untertitel „Chancen und Risiken“ recht eng interpretiert, da auch andere Voraussetzungen und Folgen internationaler Kooperation wie Skaleneffekte, Monopolisierungseffekte, Faktorpreisverschiebungen etc. allenfalls am Rande, soziale oder politische Gesichtspunkte hingegen gar nicht behandelt werden. Insgesamt ergibt die Analyse von Langhammer / Spinanger jedoch

auch so, daß ECDC in der Realisierungsphase den beteiligten Ländern einiges an Kompromißbereitschaft und Solidarität abverlangen wird, wenn es nicht bei einer Beschreibung von wünschenswerten Sollzuständen bleiben soll.

Hinsichtlich der Auswirkungen von ECDC auf das Weltwirtschaftssystem sind die Autoren gedämpft pessimistisch. Dies gilt einmal für die Prognose, daß die Ablösung von Nord-Süd- durch Süd-Süd-Beziehungen umfangreiche Ursprungs- und Präferenzkontrollen nach sich ziehen muß, die auch den Süd-Süd-Handel eher behindern dürften. Zum anderen warnen Langhammer / Spinanger vor der bereits beobachtbaren Tendenz in Entwicklungs- wie Industrieländern, dem Staat mehr Eingriffe und Lenkung zuzugestehen bzw. abzuverlangen. Diese ordnungspolitische Wertung ist um so eindringlicher, als durch die Bank empirische Untersuchungen – auch wenn sie oft als ‚ökonomistisch‘ abqualifiziert werden – staatsdominierten Wirtschaftsordnungen geringere Erfolge bescheinigen als marktwirtschaftlich orientierten. Dies ist um so kritischer, als – wie die Autoren herausstreichen – ein wesentliches Element der ECDC-Strategie die verstärkte Kooperation zwischen staatlichen Handelsorganisationen ist. Probleme sehen die Autoren auch unter Berücksichtigung des internationalen Finanzsystems voraus, da einerseits eine autonome Wechselkurspolitik der einzelnen Länder (Süd-Süd-)Liberalisierungs- und Kooperationsansätze erschwert, andererseits eine harmonisierte Währungspolitik der Entwicklungsländer, angesichts sehr heterogener Voraussetzungen, einzelnen Ländern die Wechselkurspolitik als wichtigen Handlungsparameter nehmen würde. Per Saldo müssen somit alle auf ein ausschließlich Süd-bezogenes Finanzierungssystem zielenden Vorschläge als wenig erfolgsversprechend gelten.

Während Langhammer / Spinanger den Auswirkungen von ECDC auf die Industrieländer als Gruppe insgesamt eher gelassen gegenüberstehen, sehen sie hinsichtlich der auf die Bundesrepublik Deutschland bezogenen Effekte deutlich größere Probleme voraus. Dies belegen sie auch ausführlicher als den ersten Aspekt, der mehr thesenartig behandelt wird. Wichtig ist dabei vor allem die Warnung, daß zwar – gemessen am gegenwärtigen Handel – der Bundesrepublik nur relativ geringe Gefahren drohen, daß jedoch bei dynamischer Betrachtung bei nachlassender Wettbewerbsfähigkeit deutlichere Einbußen im Exportbereich zu befürchten sind. Hinzu kommt, daß der Wettbewerbsdruck der Schwellenländer nicht abnehmen wird, während weitere Süd-Süd-gestärkte Länder den deutschen Markt beliefern werden. Die Autoren verknüpfen diese vor allem in beschäftigungspolitischer Sicht wichtige Prognose mit der Forderung nach mehr Bereitschaft zu Anpassung und Strukturwandel, ohne allerdings – was thematisch nur konsequent ist – diesen Aspekt zu vertiefen.

Die Analyse von Langhammer / Spinanger wirft auf die vielfach als Lösung propagierte, aus anderer Sicht als Bedrohung empfundene verstärkte Zusammenarbeit zwischen Entwicklungsländern bei gleichzeitiger und zunehmender Ablösung von Nord-Süd-Beziehungen in mancher Hinsicht neues Licht. Während eine erfolgreiche ECDC-Strategie den Entwicklungsländern als Gruppe durchaus Vorteile zu Lasten der Industrieländer verschaffen könnte, stellten sich ihrer Verwirklichung doch so erhebliche Probleme entgegen, daß in absehbarer Zeit für eine verstärkte wirtschaftliche Zusammenarbeit zwischen Entwicklungsländern kein großer Durchbruch zu erwarten ist. Hierfür sind die Interessen und Voraussetzungen der Entwicklungsländer zu heterogen. Die Autoren kommen daher insgesamt auch zu der Überzeugung, daß das Bestehen auf Ausnahmeregelungen den ‚großen Wurf‘ verhindern wird und eher regionale und bilaterale Ansätze partieller Zusammenarbeit – wie bisher – das Bild beherrschen werden.

Die Arbeit von Langhammer / Spinanger ist ein sehr wertvoller Beitrag, einmal hinsichtlich der empirischen Absicherung von sonst in der Literatur oft anzutreffen-

den pauschalen Behauptungen, zum anderen wegen der Klarheit und Sachlichkeit der Analyse im weltweiten Kontext. Unsere insgesamt sehr positive Einschätzung wird auch nicht dadurch beeinträchtigt, daß ein Leser, der sich weniger intensiv als der Rezensent mit dem Buch auseinandersetzen möchte, in Anbetracht der komplexen und zum Teil spröden Materie eine Zusammenfassung der wichtigsten Ergebnisse im Zusammenhang mit den einzelnen Abschnitten begrüßen würde.

J. Altmann, Sigmaringen

Wagner, Antonin: Wohlfahrtsstaat Schweiz. Eine problemorientierte Einführung in die Sozialpolitik. Verlag Paul Haupt, Bern–Stuttgart 1985. 34 Darst., 49 Tab., 248 S. Kart. DM 45,—/Fr. 38,—.

Die vorliegende Arbeit stellt eine Einführung in die staatliche Sozialpolitik in der Schweiz dar.

Nach einem kurzen Überblick über „Aufgaben und Grundfragen der Sozialpolitik“ (1. Kapitel) und über „Das Sozialbudget der Schweiz“ (2. Kapitel) werden abgehandelt: im I. Teil die „Sozialpolitik im Bereich der Einkommensentstehung“, im II. Teil die „Sozialpolitik im Bereich der Einkommensumverteilung“, im III. Teil die „Sozialpolitik im Bereich der Einkommensverwendung“ und im IV. Teil die „Träger der Sozialpolitik“ sowie Probleme des Trägersystems.

Im I. Teil werden beschrieben: die Arbeitsverfassung der Schweiz (3. Kapitel), die Arbeitsmarktpolitik (4. Kapitel), die Lohnpolitik (5. Kapitel) und die Beschäftigungspolitik (6. Kapitel) sowie – als gesellschaftliche Bedingungen der Einkommensentstehung – die Bildungspolitik und die Gesundheitspolitik (7. Kapitel). Der II. Teil umfaßt zwei Kapitel, in denen der interpersonale Einkommensausgleich durch den Fiskus einschließlich der Vermögenspolitik (8. Kapitel) und der intertemporale Einkommensausgleich, d. h. hier die Politik der sozialen Sicherung (9. Kapitel), behandelt werden. Im III. Teil sind enthalten die Grundzüge des Konsumentenschutzes (10. Kapitel) und der Wohnungspolitik einschließlich des Mieterschutzes (11. Kapitel). Wie dieser Überblick über die Hauptkapitel zeigt, ist der Begriff der Sozialpolitik im Sinne einer Sozialpolitik als Gesellschaftspolitik sehr weit gefaßt. Die logische Konsequenz dieses Sozialpolitikverständnisses ist in Verbindung mit der Beschränkung auf rund 250 Buchseiten, daß die Darstellung gestrafft sein muß und einzelne Sektoren der Sozialpolitik, wie etwa die Vermögenspolitik und die Familienpolitik, nur am Rande behandelt werden konnten.

Die Gliederung der Sektoren staatlicher Sozialpolitik nach dem Ansatzpunkt der Maßnahmen und nach der Zielrichtung (Beeinflussung der Einkommensentstehung, der Einkommensverteilung und der Einkommensverwendung) ist nach meinem Urteil nicht optimal; denn zum einen verdeckt sie die Zielvielfalt in bestimmten Handlungsfeldern. Z. B. zielen die dem Bereich der Einkommensentstehung zugeordnete Ausgestaltung der Arbeitsverfassung, die Arbeitsmarktpolitik sowie die Lohnpolitik nicht nur auf die Beeinflussung der Einkommensentstehung, sondern auch auf die Beeinflussung der Arbeitszeit, der Arbeitsplatzsicherheit, der Sicherung elementarer Arbeitnehmerinteressen und der Betriebsverfassung. Ein weiterer Nachteil des gewählten Gliederungsprinzips liegt darin, daß inhaltlich Zusammengehörendes getrennt wird. Z. B. wird die Gesundheitspolitik im I. Teil unter den gesellschaftlichen Rahmenbedingungen der Einkommensentstehung dargestellt (– was übrigens der Tatsache nicht Rechnung trägt, daß Adressaten der Gesundheitspolitik nicht nur Erwerbstätige sind –), dagegen die als wesentlicher Bestandteil der Gesundheitspoli-

tik anzusehende Krankenversicherung in Teil III. Zur Konzeption des II. Teils ist anzumerken, daß die Politik der sozialen Sicherung nicht unter das Stichwort „Inter-temporaler Einkommensausgleich“ subsumiert werden sollte, weil das System der sozialen Sicherung ja auch auf interpersonalem Einkommensausgleich beruht. Alles in allem ist das Buch jedoch übersichtlich gegliedert, so daß sich der Leser gut orientieren kann.

In jenen Kapiteln, die der Darstellung sozialpolitischer Handlungsfelder dienen, werden jeweils die gesetzlichen Grundlagen, die Ziele, die institutionellen Regelungen und Maßnahmen beschrieben sowie ausgewählte, bedeutsam erscheinende Probleme erörtert. Das Buch vermittelt einen guten, wenngleich im Bedarfsfall in bezug auf Details ergänzungsbedürftigen Einblick in die staatliche Sozialpolitik der Schweiz. Für nicht-schweizerische Leser wäre die Lektüre erleichtert worden, wenn die zahlreichen, in der Regel beim erstmaligen Gebrauch erläuterten Abkürzungen (z. B. AHV, IV, EO, SUVA, OR) in einem Abkürzungsverzeichnis zusammengefaßt worden wären, denn im Laufe der Lektüre entfällt dem Leser die Bedeutung früher erläutelter Abkürzungen. Auch ein Sachverzeichnis sollte für ein Buch, das einen so großen Bereich wie die Sozialpolitik beschreibt und eine Fülle von Material aufbereitet, eine Selbstverständlichkeit sein.

Für den Fall einer weiteren Auflage wäre einerseits eine Ergänzung der Literatur um Grundlagenarbeiten zu wünschen. Das gilt für die Grundlagen der Theorie der Sozialpolitik allgemein (z. B. vermißt der Rezensent Hinweise auf Arbeiten von L. Preller und die Artikel zur Sozialpolitik im Handwörterbuch der Wirtschaftswissenschaft) wie auch für die Literatur zu einzelnen Sektoren der Sozialpolitik, die sich (z. B. zur Gesundheitspolitik, zur Verbraucherschutzpolitik und zur Wettbewerbspolitik) ganz überwiegend auf aktuelle Literatur beschränkt und grundlegende einführende Monographien nicht anführt. Andererseits würde der Wert des Buches auch durch Hinweise auf laufende Materialquellen erhöht werden können.

Der Verfasser verfolgt mit seiner Arbeit das Ziel, die nicht zuletzt nach seinen Erfahrungen in der Ausbildung von Sozialarbeitern weit verbreitete Unwissenheit über sozialpolitische Zusammenhänge durch eine allgemein verständliche systematische Darstellung der Instrumente und Träger der schweizerischen Sozialpolitik zu verringern. Man kann ihm bescheinigen, daß sich seine Arbeit als eine erste, breit angelegte Orientierungshilfe über die Sozialpolitik vor allem der Schweiz gut eignet.

H. Lampert, Augsburg

Langer, Horst Günther / Martiensen, Jörn / Quinke, Hermann (Hrsg.): Simulations-experimente mit ökonometrischen Makromodellen (Berichte der Gesellschaft für Mathematik und Datenverarbeitung, Nr. 146). R. Oldenbourg Verlag, München 1984. 439 S. DM 88,—.

Der vorliegende Tagungsband befaßt sich mit der Evaluierung großer ökonometrischer Modelle für die Bundesrepublik Deutschland. Anlässlich der Tagung „Modellforum 83“ der Gesellschaft für Mathematik und Datenverarbeitung (GMD) haben sich ökonometrische Modellbauer getroffen, um verschiedene von den Herausgebern initiierte Simulationsexperimente mit ihren Modellen durchzuführen. An dem „Wettbewerb“ waren folgende Modelle vertreten:

Universitärer Bereich

- 3 Versionen des Bonner Modells (W. Krelle)
- Frankfurter Modell (R. Hujer)

- Freiburger-Tübinger Modell (D. Lüdeke)
- Sysifo-Modell Hamburg (U. Westphal).

Außeruniversitärer Bereich

- Bundesbank Modell (W. Janke)
- Chase-Modell (R. Rau)
- DIW-Modelle (R. Zwiener / J. Blazejczak)
- IBM-Modell (W. Muth)
- IfW-Modell (T. Tewes)
- RWI-Modell (U. Heilemann).

Den Herausgebern ist es gelungen, den Tagungsband, der aufgrund seines Themenbereichs viele Einzelheiten über die ökonometrischen Modelle und deren Simulationseigenschaften enthält, durch Gliederung in zwei Hauptabschnitte sehr übersichtlich zu gestalten. Im ersten kürzeren Hauptabschnitt gibt *J. Martiensen* einen Überblick über die an der Tagung beteiligten Modelle, zeigt Probleme auf, erläutert die Aufgabenstellungen und faßt die Ergebnisse zusammen. Im zweiten längeren Hauptabschnitt werden in elf Beiträgen die ökonometrischen Modelle und die Simulationsergebnisse im einzelnen erörtert. Die Autoren der Beiträge sind *H. Sarrazin* (Bonner Modell 11), *S. Müller* und *S. Nakamura* (Bonner Vierteljahresmodell), *M. Kiy* (Disaggregiertes Bonner Prognosesystem), *R. Rau* und *E. Weiss* (Chase-Econometrics-Modell), *R. Zwiener* und *H. Goepel* (DIW-Modell), *J. Blazejczak* (DIW-Langfristmodell), *R. Hujer*, *G. Bauer* und *H. Knepel* (Frankfurter Modell), *D. Friedrich et al.* (Freiburger-Tübinger-Modell), *J. Martiensen* und *W. Muth* (IBM-Konjunkturmodell), *U. Heilemann* und *H. J. Münch* (RWI-Konjunkturmodell) und *J. Kröger*, *U. Sander* und *U. Westphal* (Sysifo-Modell). Durch die Beschreibung der ökonometrischen Modelle erhält dieser Teil des Buches einen enzyklopädischen Charakter. Leser, die sich schnell über den Stand des ökonometrischen Modellbaus in der Bundesrepublik Deutschland informieren wollen, kann die Lektüre dieses Buchs auch unter diesem Gesichtspunkt empfohlen werden.

J. Martiensen plädiert in seinem übergreifenden Beitrag für eine verstärkte Verwendung der Politiksimulation als Evaluationsmethode für ökonometrische Modelle, die hinter der Fehleranalyse und dem Prognosefehlervergleich oftmals zurücktritt. Gegenstand der Tagung war danach auch einzig und allein diese Evaluationsmethode mit dem Ziel, das Augenmerk der Modellbauer auf sie zu lenken.

Die Auswirkungen mehrerer wirtschaftlicher Maßnahmen (Änderungen der exogenen Variablen) auf die wirtschaftspolitischen Ziele (endogene Variable) reales Brutto-sozialprodukt, Arbeitslosenzahl, Preisniveau, Saldo der Leistungsbilanz und Finanzierungssaldo des Staates wurden für die Jahre 1977 und 1980 mit den ökonometrischen Modellen simuliert. Die Maßnahmen waren im einzelnen:

- Abschwächung des Welthandelswachstums
- Anstieg der Importpreise
- Verringerung des Lohnwachstums
- Erhöhung der staatlichen Investitionen
- Erhöhungen der staatlichen Transferzahlungen
- Erhöhung der staatlichen Investitionen bei gleich hoher Senkung der Transferzahlungen
- Erhöhung des Mehrwertsteuersatzes
- Verringerung des inländischen Zinsniveaus
- Erhöhung der Staatsinvestitionen und Senkung der Zinssätze.

Der Rezensent hat mit großem Interesse die übersichtlich dargestellten Simulationsergebnisse analysiert und miteinander verglichen, da er selbst viele Male Gelegenheit hatte, mit einer Version des Bonner Modells Politiksimulationen durchzuführen. Diejenigen, die bisher großen makroökonomischen Modellen mit Skepsis gegenüberstanden – nicht zuletzt wegen deren umstrittenen Prognoseleistungen – werden nach dem Studium der Simulationsergebnisse noch weniger Vertrauen in ökonomische Modelle haben. Politiker, Unternehmer und alle, die ökonomische Modelle als Entscheidungshilfe verwenden oder verwenden wollen, werden diesen Entscheidungshilfen wenig Glauben schenken, die auf eine bestimmte Frage die unterschiedlichsten Antworten geben. Hier ist nicht der Platz, die Ergebnisse im einzelnen wiederzugeben. Der Leser sei auf Martiensens Übersichtsartikel bzw. auf die Einzelbeiträge der Modellbauer verwiesen. Aber dennoch sollen einige willkürlich herausgegriffenen Ergebnisse einen ersten Eindruck über die Variationsbreite der Simulationsergebnisse vermitteln.

Die Modelle können beispielsweise keine übereinstimmende Antwort auf die Frage geben, ob eine Politik der Lohnzurückhaltung tendenziell positive Beschäftigungs- und Wachstumseffekte hat oder nicht. Eine Verringerung des Lohnwachstums um zwei Prozentpunkte pro Jahr bewirkt in 1980 eine Veränderung des realen Bruttosozialprodukts, die zwischen –19,73 Mrd. DM (Freiburger-Tübinger-Modell) und +16,12 Mrd. DM (RWI-Modell) liegt. Ebenso groß sind die Unterschiede bei den Arbeitslosenzahlen. Das Chase-Modell schätzt den Beschäftigungseffekt sehr positiv ein und projiziert eine Abnahme von 400 000 in 1980, während nach dem Frankfurter Modell mit einer Zunahme um 11 000 zu rechnen ist. Der Saldo der Leistungsbilanz schwankt zwischen +23,8 Mrd. DM (Chase-Modell) und –10,4 Mrd. DM (RWI-Modell). Ähnlich große Unterschiede bei den Resultaten sind bei Simulationen in den Bereichen Finanz-, Außenhandels- und Geldpolitik zu beobachten. So steigert eine Verringerung der inländischen Zinssätze um zwei Prozentpunkte zu Beginn der Simulationsperiode das reale Bruttosozialprodukt in 1980 beim Bonner Modell um 23,44 Mrd. DM, beim RWI-Modell um 24,8 Mrd. DM, beim DIW Vierteljahres-Modell um 15,29 Mrd. DM, beim DIW-Langfristmodell um 1,40 Mrd. DM; beim IBM-Modell bewirkt eine Zinssatzsenkung gar eine Verringerung des Sozialprodukts um 1,38 Mrd. DM.

Martiensen berichtet, daß von einigen Modellbauern die Befürchtung geäußert worden ist, daß eine Veröffentlichung der teilweise recht erheblich voneinander abweichenden Ergebnissen bei aktuellen und potentiellen Modellanwendern den Eindruck erwecken könne, als ließen die Modelle ein allzu breites Spektrum von Ergebnissen möglich erscheinen. Wie Martiensens selbst zugibt, ist dies nicht von der Hand zu weisen. An dieser Stelle kann man auch über den Grund mutmaßen, warum die *Deutsche Bundesbank* und das *Institut für Weltwirtschaft*, die beide an der Tagung beteiligt waren, ihre Ergebnisse nicht veröffentlichen wollten. Wäre das Spektrum der Ergebnisse dann womöglich noch größer geworden?

Martiensen erklärt die Variationsbreite der Ergebnisse mit der unterschiedlichen Erfassung der Verhaltensgleichungen wichtiger Sektoren in den einzelnen Modellen sowie mit der Exogenisierung von teilweise endogenen Variablen. Diese Erklärung befriedigt vielleicht den Ökonometriker, aber stellt sich auch den Benutzer von ökonomischen Modellen zufrieden, der auf eine konkrete Fragestellung nicht mehrere, teilweise höchst unterschiedliche Antworten erwartet?

Zu hoffen bleibt, daß der von den Herausgebern beschriebene Weg der Modellevaluation mit Hilfe von Simulationsvergleichen weiter verfolgt wird, da solche Vergleiche zweifellos ein wichtiges Instrument zur Verbesserung der Spezifikation ökonomischer Modelle darstellen. Insgesamt gesehen haben die Herausgeber eine Veröffent-

lichung vorgelegt, die in gleicher Weise für den Ökonometriker als auch für den Benutzer von ökonometrischen Modellen lesenswert ist. Jeder, der sich mit ökonometrischen Modellen beschäftigt, sollte neben deren Prognoseleistungen auch deren Simulationseigenschaften kennen. Daher wird dieses Buch auf ein entsprechend großes Interesse stoßen müssen.

P. Pflaumer, Dortmund

Utz, Arthur F. (Hrsg.): Das Unternehmen als Größe der Arbeitswelt – Der Arbeiter als Gesellschafter? (Hrsg. für die Internationale Stiftung Humanum, Bonn). WBV H. Weiskirch, Bonn 1984. 290 S. DM 29,—.

Die Publikationen der Int. Stiftung Humanum umfassen immer wieder aktuelle Probleme, die in einem größeren Zusammenhang analysiert und diskutiert werden. Die Erarbeitung der Publikationen gründet sich immer wieder auf intensive Diskussionen im Rahmen der Arbeitstagungen der Stiftung, die von ausgezeichneten Experten besucht werden. So geht auch die vorliegende Publikation auf ein Symposium zurück, an dem Vertreter der Wirtschaftswissenschaft, der Sozialethik, der Theologie und des Arbeitsrechts mitgewirkt haben.

Arthur F. Utz stellt sozialethische Überlegungen voran: Entscheidend ist die These, daß jeder Mensch zuerst durch das Eigeninteresse motiviert ist, daß darum alle Gemeinwohlinteressen als für das Einzelinteresse förderlich anzusehen sind, um in der Wirklichkeit effizient zu werden. Utz stellt heraus, daß eine wirklichkeitsnahe Sicht der Dinge immer wieder eine Deckung der Gemein- und der Eigeninteressen einsichtig mache. Utz kommt zum Ergebnis, daß die Eliminierung des privaten Produktionsmitteleigentümers Fehlentwicklungen mit sich bringen müsse, die eben starke Impulse für jene deckungsgleiche Interessenharmonie zunichte machen. Die Soziale Marktwirtschaft könne nicht auf das private Dispositionsrecht der Produktionsmitteleigentümer verzichten. Erst das Recht auf Eigentum an den Produktionsmitteln läßt echte Wettbewerbswirtschaft als möglich erscheinen. Im Sinne der Katholischen Soziallehre und im besonderen der Enzyklika *Laborem exercens* darf der Mensch nicht zum Objekt erniedrigt werden. Daher folgert Utz, daß in der marktwirtschaftlichen Ordnung die menschenwürdige Behandlung des Arbeitnehmers selbstverständlich sein müsse.

Utz folgt einem Grundgedanken der Unternehmerethik, wenn er in der Gewinnerzielung eine erstrangige Aufgabe des Unternehmens sieht, und zwar in jedem Wirtschaftssystem. Aus der großen Bedeutung, die dem Kapital neben der Arbeit zukommt, wendet sich Utz gegen eine undifferenzierte Umschreibung einer Vorrangstellung der Arbeit. Utz stellt klar heraus, daß die Arbeit „auf dem höchsten Niveau natürlicher Werte „stehe, das Kapital – als natürliches Gut verstanden – könne eben auf dieser Ebene mit der Arbeit nicht konkurrieren. Aber auch das Kapital kommt durch Leistungen eines „sparenden geistigen Wesens“ zustande. Es ist letztlich eine humanistische Sicht, aus der Utz gegen allzu einseitige und vordergründige Formulierungen Stellung nimmt.

Theo Mayer-Maly hat das Arbeitsverhältnis in der geltenden Rechtsordnung analysiert. Interessant ist die These, daß Freiheit und Mobilität der Arbeitskraft zur pluralistischen Parlamentsdemokratie dränge. Diese Freiheit und Mobilität der Arbeitskraft vertrage sich einfach nicht mit Diktaturen welcher Art auch immer. Trotz aller Gegensätze wirke ein starker Druck zur Kooperation der Arbeitgeber- und Arbeitnehmerorganisationen, eine Entwicklung, die sich im Sozialpartnerschaftssystem

entwickelter Industriestaaten immer deutlicher zeigt. In der Diskussion wurde Übereinstimmung darüber erzielt, daß eine gesellschaftsrechtliche Beteiligung der Arbeitnehmer am oder im Unternehmen grundsätzlich nur in Ergänzung, nicht anstelle des Arbeitsverhältnisses in Frage komme. Auch in den Fragen der Mitbestimmung geht es um mehr Flexibilität: So wurde darauf hingewiesen, daß man einen größeren Spielraum für autonome Regelungen und autonomes Handeln im Rahmen von Mitbestimmung und Mitbeteiligung brauche; zu diesem Zweck sollten Tarifverträge und Betriebsvereinbarungen in größerem Maß als bisher von zwingendem, zentralisierten Arbeitsrecht abweichen können.

Die sehr vielseitigen und interessanten Erfahrungen in der Entwicklung der Unternehmensverfassung, die in der Bundesrepublik gemacht wurden, hat Peter Hanau analysiert. Hanau weist darauf hin, daß Mitbestimmung immer auch Mitverantwortung bedeute: So müßte den Arbeitnehmern auch Gelegenheit gegeben werden, alle Fragen, die mit der Arbeit zusammenhängen, innerhalb des Betriebes zu diskutieren. Es sei dies weitgehend aber nicht der Fall. Vor allem fehle es an echtem Interesse, so auch an der Bereitschaft, gesteigerte Leistungen zu erbringen, um etwa ein Unternehmen durch Krisenzeiten durchzubringen. Es sei weithin die Regel, daß Arbeitnehmer und Gewerkschaften auch in einer das Unternehmen gefährdenden Situation auf allen Rechtsansprüchen strikt beharren; dies führe immer wieder zu Massenentlassungen. Aus österreichischer Sicht lassen sich davon abweichende Haltungen feststellen. Offensichtlich ist das flexible österreichische Sozialpartnersystem mit seiner hohen Konsensfähigkeit hier mehr geeignet, konfliktschlichtend zu wirken.

Alfred Schüller hat die unternehmensgebundenen Verfügungsrechte im Spannungsfeld zwischen marktwirtschaftlichen Funktionserfordernissen und sozialstaatlichen Bindungen untersucht. Dabei geht Schüller von den Zielsetzungen der Sozialstaatsdiskussion aus, die auf eine „Humanisierung der Arbeitswelt“ durch Beschränkung der Vertragsfreiheit im Arbeitsbereich und eine Umverteilung der unternehmensinternen Verfügungsstruktur zugunsten der Arbeitnehmer abzielen. Schüller kommt zum Ergebnis: Weil Unternehmungen einen wichtigen Teil der wirtschaftlichen Gesamtordnung bilden, müssen sie in ihrer Verfassung den Funktionsgrundsätzen der Gesamtordnung entsprechen.

Einen überaus lesenswerten Beitrag hat der angesehene frühere Präsident des Bundesarbeitsgerichtes Gerhard Müller über die Situation des deutschen Gewerkschaftswesens geboten. In einer Zeit, in der die Frage nach einer sinnerfüllten Zukunft der Gewerkschaften neu zur Diskussion gestellt wird, sind die Thesen von Gerhard Müller über die Bedeutung des gewerkschaftlichen Rechtsschutzwesens von besonderem Interesse. Müller geht aber darüber hinaus die Thematik des Verhältnisses der Gewerkschaften zum Recht schlechthin an: Ohne Zweifel kommt den Gewerkschaften im modernen Rechtsstaat, der zugleich Sozialstaat ist, eine hervorragende Rolle zu: Diese auch in der Wahrnehmung rechtlicher Ansprüche zu sehen und den Gewerkschaften besondere Rechtsschutzfunktionen zuzuweisen ist gewiß eine wichtige Konzeption. Müller stellt mit Recht den deutschen Gewerkschaften ein Zeugnis hoher Mitverantwortungsbereitschaft aus. Die Erfahrungen mit der Sozialpartnerschaft auch in anderen ändern wie in Österreich sind nicht minder eindrucksvoll. Demokratie ist heute weithin nicht nur Parteien-, sondern auch Verbändedemokratie. Diesem Grundgedanken Rechnung tragend muß die Funktion moderner Gewerkschaften im Sozial- und Rechtsstaat gerade in ihrer Rechtsschutzfunktion mit umschrieben werden.

Zusammenfassend zeigt sich, daß das vorliegende Buch einen wichtigen Beitrag zur Diskussion von Fragen der Arbeitsordnung, der Mitbestimmung wie überhaupt auch

der Wirtschaftsordnungspolitik darstellt. Nicht zuletzt kann es auch für wichtige sozioethische Fragen anregend sein.

A. Klose, Wien

Lorenzen, Gunter: Adaptive Verfahren der Input-Output-Analyse (Studien zur angewandten Wirtschaftsforschung und Statistik aus dem Institut für Statistik und Ökonometrie der Universität Hamburg, Heft 17). Vandenhoeck & Ruprecht, Göttingen 1985. VII, 12 Tab., 156 S. Brosch. DM 52,—.

Ausgangspunkt der Arbeit ist die allgemein als unzureichend empfundene Datenbasis für Zwecke der Input-Output-Analyse – unzureichend sowohl im Hinblick auf die Menge als auch die Qualität der verfügbaren Daten. Lorenzen greift den von Menges geprägten Begriff der adaptiven Statistik auf, mit dem auf die (nicht immer beachtete) Notwendigkeit verwiesen wird, im Einzelfall Methoden an die Datenlage wie an die der Problemstellung zugrunde gelegte substanzwissenschaftliche Theorie anzupassen.

Der Autor entwickelt sein Programm in der Einleitung und dem ersten Kapitel. Das zweite Kapitel mit der Darstellung einer adaptiven Vorgehensweise bezüglich der zur Verfügung stehenden Daten bildet den Schwerpunkt der Arbeit. Im dritten Kapitel bezieht sich das adaptive Vorgehen auf das zugrunde liegende Modell: die Annahme, der Multiplikatorprozeß laufe ungehindert von Lager- und Produktionsengpässen vollständig ab, wird gelockert. Insbesondere zeigt Lorenzen hier, daß Lager- und Produktionsengpässe unter bestimmten Annahmen keinen Einfluß auf die Struktur des Spaltensummen- bzw. des Zeilensummenvektors der Leontief-Inversen haben.

Im folgenden gehen wir auf einige Vorschläge Lorenzens für den Fall fehlender oder mangelhafter Daten ein.

Ausgehend von der Feststellung, daß empirische Ergebnisse der Input-Output-Rechnung, die mit Hilfe einer mechanisch (mit Hilfe von RAS oder ähnlichen Verfahren) komplettierten Inputmatrix A zustande kommen, in der Regel ungenau sind, werden im zweiten Kapitel „Verfahren der Input-Output-Analyse vorgestellt, bei denen auf die Komplettierung unvollständig bekannter Inputmatrizen unter Umständen verzichtet werden kann“ (S. 6). Im einzelnen interessiert sich Lorenzen für

- die Spaltensummen und
- die Konsequenzen einer Änderung der Endnachfrage für den Vektor der Bruttoproduktion und
- den Bedarf an primären Produktionsfaktoren.

Zum einen werden „Punktschätzungen“ dieser Größen dargestellt – Schätzungen, „die entweder auf unvollständigen Input-Output-Tabellen basieren oder mit Hilfe unzuverlässiger Daten gefunden werden“. Darüber hinaus werden „Intervallschätzungen“ angegeben – deterministische Intervalle, „die anhand des als verläßlich angesehenen Teils der Information konstruiert werden“ (S. 2). Lorenzen zeigt, daß diese Intervalle in einigen Fällen sehr informativ sein können und zur Kontrolle von Punktschätzungen herangezogen werden sollten. Für die Intervallschätzungen kann Zusatzinformation in Form von Unter- und Obergrenzen für die Inputkoeffizienten genutzt werden.

Die j -te Spaltensumme der Leontief-Inversen wird geschätzt mit Hilfe der von Burford und Katz vorgeschlagenen Formel:

$$1 + \frac{j\text{-te Spaltensumme von } A}{(1 - \bar{s})},$$

wobei $\bar{s}$ der Durchschnitt der Spaltensummen von A ist. Eine analoge Schätzformel führt Lorenzen für die Schätzung der Zeilensummen der Leontief-Inversen C aus den Zeilensummen der Transaktionsmatrix ein. Für die 56-Sektoren-Tabellen des DIW erweisen sich die Schätzungen der Spaltensummen als durchaus akzeptabel (z. B. ergibt sich 1954 ein durchschnittlicher relativer Fehler von 2.3%, für 1967 von 1.0%), während die Zeilensummen-Schätzungen erheblich schlechter ausfallen (1967: durchschnittlicher relativer Fehler 10%). In Abschnitt 2.5, der sich mit der Abschätzung der quadratischen Fehler der Punktschätzungen befaßt, wird die Begründung für diesen Unterschied gegeben: Während der quadratische Fehler für die Schätzung einer Spaltensumme von der Variabilität der Spaltensummen von A abhängt, wird der quadratische Fehler für die Schätzung der Zeilensummen durch die Variabilität des Endnachfragevektors bestimmt – und letztere ist größer.

Dabei muß allerdings Lorenzens Argumentation etwas relativiert werden: Die Obergrenze für den quadratischen Fehler einer Zeilensummenschätzung hängt zusätzlich von der Varianz der entsprechenden *Zeile* von CA ab, während die Varianz der entsprechenden *Spalte* von CA die Obergrenze für den quadratischen Fehler der Spaltensummenschätzung mitbestimmt. (Z. B. sind für die DIW-Tabelle von 1967¹ die Spaltenvarianzen bis auf zwei größer als die Zeilenvarianzen von CA – ohne daß dieser Unterschied allerdings in die Größenordnung des o. a. gegenteiligen Effektes gelangte.)

Für den Vektor der Bruttoproduktion werden zunächst zwei Schätzungen verglichen: Ein Schätzvektor b_1 , der für jeden Sektor den Wachstumsfaktor der Endnachfrage auf die Bruttoproduktion anwendet und ein Schätzvektor b_2 , der auf die Vorleistungen aller Sektoren den gleichen Wachstumsfaktor – nämlich den der gesamten Endnachfrage – anwendet und zu den so erhaltenen Vorleistungen den bekannten neuen Endnachfragevektor addiert. Keine der beiden Schätzungen erweist sich als der anderen überlegen.

Ähnliches gilt für die Schätzung des Bedarfs an primären Produktionsfaktoren: Keiner der angegebenen Schätzer kann a priori vorgezogen werden. Lorenzen benutzt für alle diese Schätzer die Matrix Q der primären Inputkoeffizienten, läßt jedoch offen, wie dieselbe zu schätzen ist. Zwei Schätzer ergeben sich direkt aus den Schätzungen b_1 und b_2 für die Bruttoproduktionswerte: Qb_1 und Qb_2 . Außerdem konstruiert Lorenzen zwei Schätzer analog zu den Schätzern der Spalten- und Zeilensummen.

Für die verschiedenen Punktschätzungen wird gezeigt, wie zusätzliche Information in Form einzelner bekannter Inputkoeffizienten genutzt werden kann. Man erwartet, daß die Nutzung zusätzlicher Information die Schätzungen verbessert, und Lorenzen demonstriert diesen Effekt an einem Beispiel: Die ungefähre Kenntnis bereits eines Elementes der wahren Inputkoeffizientenmatrix für 1967 läßt einen außergewöhnlich großen Schätzfehler in einer Spaltensumme praktisch verschwinden. Dabei gibt Lorenzen Hilfen, wie Zellen der Inputkoeffizientenmatrix zu identifizieren sind, mit deren Kenntnis die Schätzfehler klein zu halten sind. Diese Hilfen beruhen im wesentlichen auf einer Darstellung der Schätzfehler als Kovarianzen.

Damit kann die von Lorenzen empfohlene Vorgehensweise auf den Punkt gebracht werden: Man beschränke sich bei der Informationsbeschaffung auf die im o. a. Sinne wichtigen Fehler der Inputkoeffizientenmatrix und erhalte so mit möglichst kleinem Aufwand ausreichend genaue Schätzungen für die interessierenden Größen. Lorenzen

reklamiert für diese Schätzungen eine Genauigkeit, die „kaum verschieden (. . .) sein dürfte“ von der Genauigkeit der mit Hilfe von (z. B. mit RAS) komplettierten Matrizen erhaltenen Resultate (S. 125).

Während in der Arbeit insgesamt sehr eindrucksvoll gezeigt wird, mit wie wenig Information gute Schätzungen bestimmter Größen erreicht werden können, scheint an dieser Stelle die zusätzliche Nutzung weiterer Information durchaus möglich und sinnvoll zu sein. Wir setzen dabei eine Datenlage voraus, wie sie zur Anwendung des RAS-Verfahrens erforderlich ist: Die Kenntnis einer vollständigen Basismatrix und der Randsummen der Schätzperiode.

In diesem Falle erfordert die RAS-Schätzung sicher erheblich weniger Aufwand als die Beschaffung der Firmendaten für auch nur ein einziges Element der Koeffizientenmatrix. Und es scheint a priori nicht klar, wieso ein einziges genaues Element mehr Information enthalten soll als die zwar ungenaue RAS-Matrix, die aber doch zumindest – ganz unabhängig von der umstrittenen inhaltlichen Restriktivität – Informationen über *den* Rand der Transaktionsmatrix enthält, die die von Lorenzen diskutierten Schätzer nicht nutzen.

Daß dieses Argument der Grundlage nicht entbehrt, soll anhand der 14-Sektoren-Tabelle des DIW für 1972 illustriert werden. Wir vergleichen für drei Fragestellungen Lorenzens Vorschläge mit den Ergebnissen der „klassischen“ Verfahren. Wir benutzen die Tabellen für 1972 und 1967 (als Basistabelle)¹, weil diese Tabellen weitgehend auf sogenannten Originärdaten beruhen.

1. Schätzung der Spaltensummen der Leontief-Inversen

Sektor	Burford / Katz	Absolute relative Fehler in %			
		RAS, Basis 1967	Sektor	Burford / Katz	RAS
1	2,91	0,10	8	3,22	0,22
2	2,48	0,02	9	1,83	0,14
3	1,96	0,14	10	1,76	0,46
4	2,46	0,07	11	0,18	0,05
5	2,98	0,08	12	1,17	0,18
6	1,89	0,12	13	0,82	0,11
7	0,60	0,03	14	0,48	0,13
arithmetisches Mittel über alle Sektoren:				1,77	0,13

Die Spalten 3 und 6 zeigen die Fehler in den Spaltensummen der Leontief-Inversen mit der RAS-geschätzten Inputkoeffizienten-Matrix anstelle der „wahren“ Matrix A. Die Modifikation der Burford / Katz-Schätzung durch Einbeziehung aller „wahren“ Hauptdiagonalelemente reduziert den durchschnittlichen absoluten Fehler von 1.77 auf 1.04 % – damit ist auch diese Schätzung noch erheblich schlechter als die Schätzung mit Hilfe der RAS-Matrix. Dies ist um so bemerkenswerter, als die RAS-Projektion der Inputkoeffizienten gerade von 1967 auf 1972 einen relativ hohen durchschnittlichen relativen Fehler aufweist. Darüber hinaus weiß man in der Anwen-

¹ Baumgart, E. R. / R. Stäglin / J.-P. Weiß / H. Wessels und Mitarbeiter, Jährliche nominale Input-Output-Tabellen, Importmatrizen und Investitionsmatrizen für die Bundesrepublik Deutschland 1960 bis 1974. Deutsches Institut für Wirtschaftsforschung: Beiträge zur Strukturforschung Heft 54. Berlin 1979.

dungssituation nicht, ob sich einzelne Schätzungen durch die angegebene Modifikation nicht sogar verschlechtern. (Im vorliegenden Beispiel sind dies die Schätzungen für die Spalten 11, 12, 14.)

2. Schätzung der Zeilensummen der Leontief-Inversen

Sektor	Lorenzen	Absolute relative Fehler in %			
		RAS, Basis 1967	Sektor	Lorenzen	RAS
1	1,34	0,06	8	0,90	1,09
2	15,90	1,01	9	5,64	0,28
3	0,65	0,57	10	3,99	0,82
4	4,94	0,04	11	3,70	1,06
5	7,01	0,10	12	5,98	0,53
6	3,02	0,36	13	3,62	0,80
7	3,56	0,06	14	5,58	0,04
arithmetisches Mittel über alle Sektoren:				4,70	0,49

3. Konsequenzen einer Änderung der Endnachfrage für den Vektor der Bruttoproduktion

Die Basisproduktion sei wieder 1967. Als neuen Endnachfragevektor verwenden wir die Endnachfrage von 1972. Die o. a. Schätzvektoren b_1 und b_2 werden mit dem Ergebnis verglichen, das die Anwendung der Leontief-Inversen von 1967 auf den neuen Endnachfragevektor bringt:

	Anzahl beste Schätzungen	Anzahl schlechteste Schätzungen	durchschnittlicher absoluter Fehler in (%)
b_1	6	7	5,72
b_2	3	6	6,16
konstante Koeff.	5	1	4,68

Hier ist der Abstand zwischen den Verfahren bei weitem nicht so deutlich wie bei der Schätzung der Randsummen der Leontief-Inversen. Dies liegt offensichtlich daran, daß in diesem Fall keine zusätzliche Information über die aktuellen Ränder zur Verfügung steht.

In diesem Zusammenhang sei kurz auf das auch an anderen Stellen der Arbeit benutzte Mittel der Niveaurektur eingegangen. Damit soll z. B. im Falle der Schätzung der Bruttoproduktionswerte erreicht werden, daß die *Summe* der Schätzungen möglichst nahe an die richtige Summe herankommt. Benutzt werden zu diesem Zweck die Spaltensummenschätzungen der Leontief-Inversen. Es ist jedoch nicht ersichtlich, warum dieses Kriterium der Summenschätzung Kriterien für die Güte der einzelnen Schätzungen übergeordnet werden sollte, zumal die verwendeten Spaltensummenschätzungen selbst unsicher sind. Vergleicht man z. B. die Schätzungen der Bruttoproduktionswerte b_1 , b_2 , die Schätzung mit Hilfe konstanter Koeffizienten und die niveaurektierten Schätzungen zu b_1 und b_2 für das Jahr 1972, so stellt sich heraus, daß der Schätzvektor, der im Niveau am besten liegt (b_2 niveaurektiert) den

höchsten prozentualen Durchschnittsfehler aufweist (6.18%). Dies muß durchaus nicht an der Ungenauigkeit der dabei eingehenden Spaltensummenschätzungen liegen: korrigiert man mit der (in der Anwendung natürlich unbekannten) richtigen Niveaudifferenz, liefert b_1 einen größeren prozentualen Durchschnittsfehler (5.22%) als mit der geschätzten Korrektur (4.92%).

Zusammenfassend läßt sich sagen, daß Lorenzen eine Reihe bisher unbekannter Beziehungen zwischen Matrizen und Vektoren des Input-Output-Modells herleitet und für die Schätzung interessierender Größen nutzt. Es zeigt sich dabei, daß auch bei geringem Informationsumfang recht gute Ergebnisse erzielt werden können. Dies ist außerordentlich wichtig in Situationen, in denen keine zur Klassifikation der aktuellen Matrix passende Basismatrix vorliegt – insbesondere bei regionalen Input-Output-Tabellen.

Die oben aufgeführten Beispiele zeigen jedoch, wie wichtig es ist, im Sinne einer adaptiven Vorgehensweise alle zur Verfügung stehenden Informationen in die Schätzungen einzubeziehen. Insofern sind Lorenzens Vorschläge als sehr nutzbringende und notwendige Ergänzung, nicht als Konkurrenz zu den „klassischen“ Verfahren der Input-Output-Analyse anzusehen.

K. Ringwald, Duisburg

Külp, B. / Berthold, N. / Knappe, E. / Roppel, U. / Rüdell, T. / Wolters, R.: Sektorale Wirtschaftspolitik (Heidelberger Lehrtexte Wirtschaftswissenschaften). Springer-Verlag, Berlin – Heidelberg – New York – Tokyo 1984. IX, 216 S. DM 32,80.

Die Verfasser beabsichtigen, auf der Basis von Erkenntnissen der allgemeinen Wirtschaftstheorie einen Überblick über die wichtigsten Probleme der sektoralen Wirtschaftspolitik zu geben. Es handelt sich folglich nicht um den Versuch einer systematischen Darstellung der sektororientierten Strukturpolitik, wie er von Peters und anderen unternommen wurde. Gleichwohl können die als „wichtig“ erachteten Problemdarstellungen mit dem Interesse auch des Lesers rechnen, der eine andere und umfassendere Strukturierung dieses wirtschaftspolitischen Problemfeldes gewohnt ist.

Die ersten vier Abschnitte befassen sich nach einer u. a. historisch orientierten Darstellung der Entwicklung der Sektoralpolitik mit Rechtfertigungsgründen für die sektorale Strukturpolitik, die aus unbefriedigenden Allokations- und Distributionsergebnissen des Marktes hergeleitet werden. Daß die Verfasser die Gründe eines Marktversagens bzw. die Entstehung von „Marktmängeln“ aus kritischer Distanz beurteilen, dies zeigt sich u. a. in ihrem Verweis auf die Rolle des Staates für die Entstehung externer Effekte auf den Grundstücksmärkten (S. 38). Das Phänomen des „Politikversagens“ ist ihnen bewußt, die Gründe für „politische Unvollkommenheiten“ (S. 60) werden in einsichtiger Weise unter Bezugnahme auf meritorische Zielvorstellungen analysiert, wobei Elemente der politischen Ökonomie hilfreiche Verwendung finden.

Die folgenden Abschnitte befassen sich mit Wirkungsanalysen der als wichtig angesehenen Instrumente der sektorbezogenen Wirtschaftspolitik, die jeweils an Sektorbeispiele anknüpfen. Zunächst werden am Beispiel der europäischen Agrarmarktorbungen „marktteilnehmende Interventionen“ in ihrer Funktionsweise dargestellt. Daß allokationsneutrale Subventionierung niedrigere Kosten verursacht als das angewandte Interventionssystem, wird ebenso schlüssig nachgewiesen wie die mangelnde Effizienz dieses Instrumentariums auf verteilungs- und stabilisierungspolitische Ziele.

Das Beispiel der Wohnungsbauförderung dient der Erörterung einseitiger Transferzahlungen zwecks Vermittlung „angebotsbezogener finanzieller Anreize“, die sowohl an das zu subventionierende Objekt als auch an das Subjekt (Wohngeld) anknüpfen können. Die fehlenden Rationalisierungsanreize haben im allgemeinen die Folge, daß die Objektförderung – immer gleiche Zielerreichungsgrade vorausgesetzt – höhere Staatsausgaben verursacht. „Kostenmieten“ verhindern Kostensenkungen (S. 114), sie produzieren negative Wirtschaftlichkeitseffekte.

Die „konzertierte Aktion“ als spezielles Verhandlungsverfahren hat zwar auf dem Arbeitsmarkt Schiffbruch erlitten, wurde jedoch 1977 für den Gesundheitssektor neu etabliert. Zu Recht wird darauf verwiesen, daß die unrealistischen Voraussetzungen, die ihr Scheitern auf dem Arbeitsmarkt erklären, auch für den Mißerfolg der Kostendämpfungspolitik im Gesundheitssektor verantwortlich zu machen sind. Die Auseinandersetzung mit den Argumenten gegen die Selbstbeteiligung der Patienten und die Zulassung von mehr Wahlmöglichkeiten zwischen Krankenkassen und Tarifen ist ausgewogen und verweist auf erfolgversprechendere Wege der Effizienzsteigerung dieses Sektors.

Umweltschutzpolitische „Auflagen“ stellen ein weiteres Instrument dar, für dessen Analyse der Energiesektor herangezogen wird. Die sorgfältige kritische Beleuchtung des Verursacherprinzips (Marginal- oder Durchschnittsprinzip?) und der zu den Auflagen alternativ zur Verfügung stehenden Instrumente „Umweltsteuer“ und „Verhandlungen“ hätten eigentlich auch Veranlassung geben können, sich auch mit Markt-(Zertifikat-)Lösungen auseinanderzusetzen. Dies geschieht bedauerlicherweise nicht, und der Name Bonus fehlt denn auch im Literaturverzeichnis zu diesem Abschnitt.

Das in der Vergangenheit angewandte „Verstaatlichungsinstrument“ ist durch die anhaltende Reprivatisierungsdiskussion ins Zwielficht geraten. Die zur Begründung seiner Anwendung formulierten Argumente („Kollektivgut“, „ruinöse Konkurrenz“, „Verteilungs- und Stabilisierungspolitische Ziele“) finden bei den Verf. zu Recht keine Zustimmung. Als Beispiel dient hier der Verkehrssektor, dessen (ökonomisch legitimes) „Interventionspotential“ wegen des Neben- (und Gegen-)einanders von öffentlichen und privaten Wirtschaftseinheiten wohl doch differenzierter beurteilt zu werden verdiente. Auch ein Rekurs auf die Theorie der „contestable markets“ hätte hier möglicherweise zu weiteren Einsichten verholfen. Der Zurückweisung von „Nulltarif“-Lösungen ist freilich uneingeschränkt zuzustimmen.

Die Abschnitte über „Krisenkartelle“ (Beispiele: Kohle und Stahl) und „Quantitative und qualitative Zugangsbeschränkungen“ beenden den insgesamt gelungenen Versuch, einen Überblick über Teilbereiche sektoraler Strukturpolitik und der von ihnen zu lösenden Probleme zu geben. Das durchgehend angewandte Effizienzraster im Hinblick auf allokatons- (inkl. stabilisierungs-) und verteilungspolitische Ziele verbindet die einzelnen Abschnitte, die – sowohl vermutlich einzelnen (jedoch nicht näher kenntlich gemachten) Autoren zuzurechnen – sich durch einen wohlthuend einheitlichen und leicht verständlichen Darstellungsstil auszeichnen. Einfache Diagramme erleichtern auch dem Studenten, der das Grundstudium erfolgreich absolviert hat, das Verständnis dafür, „warum der politische Prozeß suboptimale Lösungen verwirklicht“.

H. St. Seidenfus, Münster

Clapham, Ronald / Kammler, Hans (Eds.): World Economic Order: Liberal Views. N. P. Engel Publisher, Kehl - Strasbourg - Arlington 1983. 432 S. DM 68,—.

Im Gegensatz zu der Wiederbelebung liberaler Grundsätze des Welthandels, die sich unter Führung der USA im Anschluß an das Ende des Zweiten Weltkrieges vollzogen hat, wird die gegenwärtige Diskussion über die Ordnung der Weltwirtschaft nahezu vollständig von entgegengesetzten Konzepten und deren unzulänglicher Abwehr beherrscht. Die Autoren dieses Bandes, aus den USA, Mexiko, Nepal und zum größeren Teil der Bundesrepublik Deutschland stammend, eint die Überzeugung, daß es sich hierbei um eine Fehlentwicklung handelt, der nicht so sehr mit dem Betonen von Werturteilen als mit nüchterner Detailanalyse beizukommen ist. Es handelt sich bei diesem Buch um einen der leider seltenen Fälle, in denen sich Vertreter der Politikwissenschaft und der Volkswirtschaftslehre gemeinsam um ein konkretes Problem bemüht haben, ohne daß die Verschiedenartigkeit der Betrachtungsweisen beider Wissenschaften zu ins Gewicht fallenden Verständigungsschwierigkeiten geführt zu haben scheint. Jedenfalls ist dies dem Endprodukt, das aus mehreren internationalen Arbeitstagen hervorgegangen ist, nur noch an wenigen Stellen anzumerken. Wer sich in den Modellkonstruktionen der modernen Außenwirtschaftstheorie einerseits oder mancher von ökonomischem Dilettantismus überquellender „politologischer“ Literatur über Weltwirtschaft und „Imperialismus“ andererseits ein wenig auskennt, wird dies zu schätzen wissen.

Liberalen Ansichten, die dieses Buch vertritt, sind nicht im Sinne der amerikanischen Wortverständnisses von „liberal“ gemeint, aber auch nicht als anarchistisches Laissez-faire oder Unempfindlichkeit gegenüber Not und Armut sowie dem Erfordernis, die Schwachen zu schützen. Es wird indessen der Nachweis geführt, daß gängige Meinungen über schädliche Wirkungen der Handelsfreiheit so gut wie ausnahmslos falsch sind und die von der Außenwirtschaftsdiplomatie angebotenen und angewandten Rezepte dirigistischer Art meist zum Gegenteil des angeblich Gewollten führen. Es stellt sich die – in den Beiträgen von *Kammler* und *Clapham* gelegentlich aufscheinende – Frage, weshalb insbesondere Entwicklungsländer immer wieder für eine sogenannte „Neue Weltwirtschaftsordnung“ eintreten, die ihren eigentlichen Interessen widerspricht: Partialinteressen, das vom Willen der Beherrschten gelöste Machtinteresse der Regierenden, aber vielfach, vor allem bei Helfenden aus entwickelten Industrieländern, schlichte Unkenntnis über volkswirtschaftliche Zusammenhänge sowie das Interesse einer wuchernden internationalen Lenkungsbürokratie, diese Unkenntnis auszunutzen und in Etats und Stellenpläne umzusetzen, wären hier zu nennen. Die Nationalökonomie ist eine weithin unbekannte oder absichtsvoll ignorierte Wissenschaft. Die Folge ist ein vorkopernikanisches Niveau, auf dem sich vor allem Diskussionen auf Gipfelkonferenzen und in der internationalen Wirtschaftsdiplomatie bewegen, vielleicht mit der rühmlichen Ausnahme der Währungs- und Notenbankzusammenarbeit.

Ronald Clapham beginnt mit einem Überblick über die tatsächlich heute bestehende Mischung von Prinzipien liberaler oder dirigistischer Art, die den internationalen Handel beherrschen, wobei der Außenhandel der sozialistischen Länder ausgeklammert bleibt. Die das GATT und den Internationalen Währungsfonds ursprünglich dominierenden Ziele der Freiheit des Handels- und Zahlungsverkehrs waren zwar von Anfang an durch vielfältige Ausnahmeklauseln durchbrochen; die Freiheit galt als ein Schönwetterprinzip, das bei sogenannten „Zahlungsbilanzstörungen“, bei angeblich ernsthaften Störungen der Produktion bestimmter nationaler Branchen, für zu entwickelnde Branchen und Länder und für regionale Zusammenschlüsse usw. durchbrochen werden konnte. Die liberale Grundmelodie blieb aber hörbar. Inzwi-

schen hat sich dies geändert, es kann von einem „Neuen Protektionismus“ gesprochen werden. Symbolhaft kommt dies, so könnte man ergänzen, an der liberalen Offenheit der ehemaligen OEEC zum Ausdruck, die durch das stärker geschlossene und bürokratisch-zentralistische Regime der EWG verdrängt worden ist. Um das Mischungsverhältnis zu kennzeichnen, unterscheidet Clapham für Branchen und Länder nach bevorzugten ordnungs- oder prozeßpolitischen Maßnahmen, für die er wieder nach makro- und mikropolitischen Methoden differenziert, aber auch nach einer systematischen und einer ad hoc eingreifenden Politik. Das Zurücktreten tarifärer Handelshemmnisse gegenüber anderen und weniger marktkonformen Handelsschranken verwirrt das Bild zusätzlich. Zwar fehlt es nicht an weiter wirksamen liberalisierenden Kräften, es haben sich aber einige damit unvereinbare Prinzipien stark verfestigt: Entwicklungsländer werden von den sonst üblichen Regeln wie Meistbegünstigung und Reziprozität sowie von Liberalisierungspflichten ausgenommen, ebenso z. B. Stahlindustrie und Landwirtschaft; man glaubt, daß sich einen freien Außenhandel nur wirtschaftlich fortgeschrittene Länder oder Branchen „leisten“ können. Im übrigen ist nach Clapham der Protektionismus insofern unsymmetrisch, als er zwischen Entwicklungsländern und bei ihren Importen aus Industrieländern anerkannt wird, nicht jedoch für Einfuhren der Industrieländer aus Entwicklungsländern. Man darf ergänzen, daß hier offenkundig unbekannt geblieben ist, was die Zahlungsbilanztheorie über den Zusammenhang von Ein- und Ausfuhren lehrt, wie ja überhaupt diese Theorie zu den Gebieten gehört, auf denen die mit Handelspolitik befaßte Wirtschaftsdiplomatie am stärksten die geistige Nahrungsaufnahme verweigert.

In einem zweiten Teil wird die Bestandsaufnahme fortgesetzt, aber in sich steigernder Intensität zugleich mit kritischer Analyse verbunden: *Atilio A. Boron* befaßt sich mit der politisch-wirtschaftlichen Entwicklung Argentiniens und Chiles bis zur großen Depression von 1929. Der in Mexiko lehrende Autor vermeidet die üblichen Klischeevorstellungen und versucht, die Wandlung dieser beiden ursprünglich wohlhabenden Länder zu Entwicklungsländern aus der inneren politischen Entwicklung zu erklären, die allerdings insofern von außen beeinflusst war, als das eigene System der ökonomischen und politischen Ordnung nicht fähig gewesen ist, die notwendigen Anpassungen an die veränderte weltwirtschaftliche Lage zu vollziehen. Wohlstand und Entwicklung beginnen eben immer zu Hause, worüber die bei den meisten Entwicklungsländern und vor allem in Südamerika endemische Schuldzuweisung an Industrieländer, den „Kapitalismus“ und das Ausland nicht hinwegtäuschen kann. Solange man selbst nicht bereit war (und ist), eine für die wirtschaftliche Entwicklung förderliche innere Ordnung herzustellen, klingen alle xenophobischen Vorwürfe eher wie lähmendes Selbstmitleid. Der Beitrag Borons ist hiervon frei; nur gelegentlich werden objektivierende Wendungen und Begriffsrealismen verwendet, die sich auch sonst in politologischen Veröffentlichungen finden und die den Eindruck einer (nicht bestehenden) Zwangsläufigkeit von Machtbedingungen und Entwicklungen erwecken. Eine angeblich bestehende koloniale Situation (S. 60) soll eine nationale Kapitalakkumulation in Argentinien und Chile verhindert haben? Es habe (S. 62) eine „privilegierte“ britische Position am internationalen Markt gegeben? Wie erklärt sich dann die erhebliche Vermögensansammlung aus Entwicklungsländern an den internationalen Finanzplätzen? Und wie konnten sich Deutschland und Japan zu modernen Industrieländern entwickeln, obwohl (oder weil?) sie von der Natur weit schlechter ausgestattet sind als viele Länder Südamerikas? War wirklich keine moderne Industrieentwicklung möglich, wo doch schon der ausländische Agrarprotektionismus, skandalös, wie er war und ist, als ein Erziehungsschutz für z. B. die argentinische Industrie wirken mußte? Die Schuld des Auslandes wiegt gewiß nicht leicht, aber für einen Peron ist es nicht verantwortlich, sondern es bleibt dabei: „liberalism, democracy and economic development begin at home“.

Der Beitrag des amerikanischen Politologen *Charles Lewis Taylor* beleuchtet im wesentlichen die außenwirtschaftlichen Bedingungen der nationalen Entwicklung, wobei die etwas zu einfach erörterte neoklassische Außenwirtschaftslehre mit dem daraus abgeleiteten Freihandelspostulat den Ausbeutungs- und Abhängigkeitslehren (von wirklich sauber abgeleiteten „Theorien“ kann man da kaum sprechen) gängiger Sprechweise vieler NichtökonomInnen gegenübergestellt werden. Der Meinung des Autors, dieser Meinungsstreit beruhe weniger auf Differenzen, die mit wissenschaftlichen Methoden ausgetragen werden können, als auf unterschiedlichen Werturteilen, muß widersprochen werden. Anfechtbar ist z. B. die These, „Materialismus“ sei der Schlüssel zu materiellem Wohlstand (S. 99), ferner die Ansicht, eine liberale oder „kapitalistische“ Entwicklung müsse zu größerer Ungleichheit führen; die meisten Entwicklungsländer beginnen wie das ancien régime Europas mit stationärer Ungleichheit, an deren Einebnung herrschende Schichten kein Interesse zeigen – was ihre Abneigung gegen Freihandel und Marktwirtschaft mitsamt der Ablösung feudaler Herrschaftseliten durch eine offene Leistungselite erklärt. Unrichtig ist im übrigen die These (S. 100), nach klassischer Ansicht seien Reichtumsunterschiede vom Außenhandel unabhängig; vielmehr gehört es zum kleinen Einmaleins der Theorie der komparativen Kosten, daß der Freihandel kleineren Ländern in höherem Maße zugute kommt als größeren Staaten, die innerhalb des eigenen Territoriums größere Möglichkeiten haben, eine wohlstandsfördernde Arbeitsteilung zu organisieren. Daran ändert sich auch bei Wachstumsvorgängen wenig.

Ein Beitrag des Politologen *Hans Kammler* räumt mit der Illusion auf, die Entwicklungsländer säßen machtpolitisch sozusagen am längeren Hebelarm und könnten außerdem das schlechte Gewissen der Industrieländer nutzen, um als „Reparation“ die von ihnen geforderte „Neue Weltwirtschaftsordnung“ zu erzwingen. Die These, die Industrieländer verdanken einst und jetzt der Ausbeutung der Entwicklungsländer ihren wirtschaftlichen Wohlstand, ist ebenso unhaltbar wie die Ansicht, die Entwicklungsländer könnten durch dirigistische Außenwirtschaftskonzepte machtpolitische Vorteile erlangen. Man muß sich überhaupt fragen, weshalb die meisten Entwicklungsländer nicht erkennen, daß ihnen der freie Weltmarkt bessere Möglichkeiten bietet als dirigistische Konzepte, bei denen sie so gut wie immer die Position des kleineren Juniorpartners einnehmen, der sich nach den Entscheidungen großer Wirtschaftsmächte richten muß. Machtpolitische und verwaltungswirtschaftliche Konzepte bedeuten im Gegensatz zum freien Markt auf die Dauer immer ungleiches Recht zugunsten des Stärkeren. Der folgende Beitrag der beiden Ökonomen *Stanley W. Black* (USA) und *Pradumna Rana* (Nepal) zeigt dies in aller Deutlichkeit, und zwar bei Marktanteilen ebenso wie privaten Kapitalströmen und monetärer Instabilität. Allerdings hätte die Analyse der monetären Phänomene eine genauere Darstellung erfordert, die den Umfang des ohnehin umfangreichen Bandes gesprengt hätte. So bleibt die Darstellung des Wechselkursproblems, der Währungsreserven und der Bedingungen des Internationalen Währungsfonds trotz des verdienstvollen Beitrages *Starbattys* im Endteil unvollständig, während das zentrale Problem von Inflation und Devisenbewirtschaftung in Entwicklungsländern und Industrieländern so gut wie überhaupt nicht erörtert wird. Es stellt sich doch auf die Dauer die Frage, ob währungspolitische Disziplinlosigkeit ein geeignetes Mittel zur Ausbeutung der eigenen Bevölkerung und ausländischer Gläubiger ist und ob die Abwehrstrategien beider Gruppen hinreichend durch „Zahlungsbilanzhilfen“ ausländischer Regierungen und supranationaler Institutionen wettgemacht werden können. Besser gesagt: Diese Frage stellt sich schon nicht mehr, sie ist eindeutig mit „nein“ zu beantworten. *Josef Molsberger* schließt den zweiten Teil mit einem systematischen Überblick über die Erosion liberaler Prinzipien der Weltwirtschaft und die Folgen für das jeweilige nationale Interesse ab: Was die Entwicklungsländer an der herrschenden Weltwirt-

schaftsordnung beklagen, beruht so gut wie ausschließlich auf Verstößen gegen liberale Grundsätze, vor allem Diskriminierungen aller Art, dem Überwuchern von Ausnahmeregelungen, Präferenzen und auch einem sich abkapselnden Regionalismus nach dem schlechten Beispiel der EG.

Der dritte Teil stellt die miteinander konkurrierenden weltwirtschaftlichen Konzeptionen gegenüber. *Clapham* macht in allen Einzelheiten deutlich, daß die wachsende weltwirtschaftliche Bedeutung der Entwicklungsländer und der internationalen Arbeitsteilung das ordnungspolitische Grundproblem verschärft haben: Sollen allgemeine Regeln (die ex definitione nur liberal sein können) oder pragmatisch-nationalistische ad hoc-Regulierungen mit ihren kurzlebigen und punktuellen Interventionen dominieren? Die Zahl der Entwicklungsländer, die ihren Aufstieg der noch bestehenden Restfreiheit des Welthandels verdanken, hat stark zugenommen, sie könnten zu den „Neuen Liberalen“ der Weltwirtschaft werden und die teilweise wenig sinnvolle Politik der drei großen Blöcke Amerika, Japan und Westeuropa als einer dirigistischen Oligarchie auflockern. Vorläufig erwecken die – etwa in der Gruppe der 77 agierenden Entwicklungsländer noch den Eindruck, sie seien einem einheitlichen, wenn auch in sich widersprüchlichen Konzept verpflichtet. Aber der supranationale Dirigismus als Planwirtschaft ist schon deshalb zum Scheitern verurteilt, weil er dem nationalen Souveränitätsanspruch widerspricht, den auch sozialistische Länder betonen. Die daraus folgende Unmöglichkeit eines internationalen Sozialismus ist schon vor Jahrzehnten von Wilhelm Röpke betont worden. *Kammler* nimmt diesen Faden noch einmal auf und betont den illiberalen Charakter von Entwicklungshilfe dann, wenn sie dazu dient, herrschende Schichten von der Zustimmung der Beherrschten unabhängiger zu machen. Dies sollte keine Absage an Entwicklungshilfe bedeuten, wohl aber ein Plädoyer für eine Hilfe, die sich selbst liquidiert. Es wäre interessant, der Frage weiter nachzugehen, inwieweit das Umsichgreifen des nationalen Wohlfahrtsstaates mit seinem internationalen Pendant in Konflikt gerät: Die umfassende Fremdfürsorge der modernen Sozialpolitik ist auf die Dauer nicht ohne Kontrolle des Verhaltens der Betreuten und ohne ihre massive Besteuerung aufrechtzuerhalten; über die Landesgrenze hinweg aber fehlt es an einer solchen Möglichkeit, es sei denn, der internationale Wohlfahrtsstaat wolle in einen handfesten Imperialismus ausarten. *Rolf Hasse* dringt nun anhand eines umfänglichen und kaum ein Detail auslassenden Beitrages in die konkreten Ausgestaltungen des internationalen Wohlfahrtsstaates ein, wie er sich jetzt in dem Integrierten Warenprogramm (Corea-Plan der UNCTAD) niedergeschlagen hat. Internationale Warenlager für Grundstoffe, als deren Lieferanten – teilweise fälschlich – in erster Linie Entwicklungsländer gelten, Indexierungen als Mittel der Erlösstabilisierung, der Stabilisierungsfonds nach dem Abkommen von Lomé und Ausgleichszahlungen des Internationalen Währungsfonds werden aufs Korn genommen. Wer sich die Mühe macht, dem Autor auf seinem Weg in das Gruselkabinett des für Volkswirte, Juristen und Mathematiker beschäftigungsfördernden internationalen Dirigismus zu folgen – der EG-Agrardirigismus hat dazu schon reichlich Anschauung gebracht – wird (neben einigen Druckfehlern in Anhang A) das Fürchten kennen lernen. Neben dem entwicklungsfeindlichen Unfugpotential, das sich hier unter Produktion von interventionistischem Herrschaftswissen breit macht, ist es vor allem die sich anbahnende Dominanz von Subalternbeamten, die (wie bei jedem Dirigismus) imponiert. Wer als Ungläubiger (allzu) genau wissen will, wie der papierene Alltag dieser „Neuen Weltwirtschaftsordnung“ mit seinen Anträgen, Formularen, Ermessensentscheidungen, Korruptionen, scheinexakten Berechnungsformeln und zur Methode erhobenem weltwirtschaftlichem Vergeudungssystem aussehen wird, der möge sich mit Geduld (und wegen der zu klein gedruckten Bezeichnungen in den Figuren mit einer Lupe) bewaffnen und ins-

besondere die Anhänge durcharbeiten. Ist er dann noch Anhänger der „Neuen Wirtschaftsordnung“, so ist ihm nicht zu helfen.

Der abschließende vierte Teil, von Joachim Starbatty und Rolf Hasse bestritten, zieht die wirtschaftspolitischen Folgerungen. *Starbatty* betont die Notwendigkeit monetärer Stabilität und prüft mehrere Konzepte (Warenreservewährung, Goldstandard, eine Weltzentralbank, die Entnationalisierung des Geldes und die Bindung an feste Geldmengenwachstumsraten). Er schlägt eine internationale Stabilitätsgemeinschaft mit Stabilitätsverpflichtung, unbeschränkter Konvertierbarkeit, Interventionspflicht allein durch Defizitländer mit Hilfe nichtinflationärer Finanzierungsformen und Paritätsänderung zu Stabilitätszwecken vor. Insbesondere die Technik, mit der monetäre Stabilität als Verhaltensregel wirksam gemacht werden soll, bedarf noch weiterer Prüfung; auch scheint es mir problematisch, Wechselkursänderungen auch dann zuzulassen, wenn das Stabilisierungsziel wirklich ernst genommen wird. Die Erfahrungen, die seit 1980 in vielen Ländern mit Stabilisierungsmaßnahmen gemacht werden konnten, relativieren allerdings – und hierin ist Starbatty voll zuzustimmen – die jeweils angewandten Techniken, sofern nur der entschlossene Wille besteht, die Geldmengenerweiterung in Schach zu halten. Den Abschluß des Buches bildet ein eindringliches Plädoyer *Rolf Hasses*, das sich an die entwickelten Länder richtet, zu ihren früheren liberalen Handelsprinzipien zurückzukehren, aber auch an die Entwicklungsländer, ihr wirkliches Interesse zu erkennen; dieses Interesse liegt nicht in einer dirigistischen „Neuen Wirtschaftsordnung“, wie dieser Band im einzelnen bewiesen hat.

Solche eindrucksvollen und lehrreichen Bücher bewegen nur dann etwas, wenn ihnen die politischen Kräfte Einfluß auf praktisches Handeln eröffnen. In einigen Beiträgen wurde auf die politischen Faktoren hingewiesen, die dem freien Handels- und Zahlungsverkehr unter Stabilitätsbedingungen scheinbar wenig Raum geben. Aber im Bereich der Politik herrscht keine unentrinnbare Mechanik; der Weg in den Abgrund ist zwar leichter als der Rückweg nach aufwärts, wie an ehemals prosperierenden Ländern, etwa dem früheren Belgisch-Kongo (heute Zaire) oder dem ehemaligen Rhodesien (heute Zimbabwe) abzulesen ist. Die Frage, welches Schicksal einheimische Eliten nicht nur der Freiheit ihrer Länder und der Freiheit ihrer Landsleute, sondern auch der Freiheit ihrer Wirtschaft und dem wirtschaftlichen Wohlergehen von Millionen bereitet haben, ist grausam und notwendig zugleich. Auf der anderen Seite wächst die Zahl der Einsichtigen, denen die praktische Anschauung von der Produktivität der Freiheit massiv nachhilft, verbunden mit den Lehren des Niederganges, den ein aus Industrieländern importierter geistiger Kolonialismus sozialistischer Machart hervorgerufen hat.

H. Willgerodt, Köln

Shams, Rasul: Internationale Währungsbeziehungen und die Entwicklung der Weltwirtschaft. Weltforum Verlag, München-Köln-London 1983. 342 S. Brosch. DM 45,—.

Das Buch versucht in fünf Kapiteln eine „Grundlegung einer erfahrungswissenschaftlichen Theorie internationaler Währungsbeziehungen“ zu leisten: Aufbauend auf der Charakterisierung der internationalen Währungsbeziehungen im Zeitablauf und der Darlegung der in der Literatur hierzu diskutierten Erklärungsansätze, präsentiert *Shams* in den Kapiteln III und IV seine alternative Sicht des Zusammenhangs von Strukturmerkmalen der Weltwirtschaft und des vorherrschenden Typus der internationalen Währungsbeziehungen („Ableitung weltgeldtheoretischer Aussagen“,

d. h. Erklärungsansätze zum internationalen Währungssystem); schließlich wird im Schlußkapitel versucht, die aktuellen weltwirtschaftlichen Probleme mittels der verschiedenen Erklärungsansätze aufzuarbeiten. Der Autor vermag der selbstgestellten Aufgabe grundsätzlich gerecht zu werden, läßt aber trotz reichen Literaturfundus manche Wünsche im Detail, aber auch in der Ausarbeitung einer systematischen Pro-blemperspektive offen.

Kapitel I behandelt die Entwicklung des Weltwährungssystems seit Ende des letzten Jahrhunderts: die Herausbildung des Gold-Standards, des Gold-Devisen-Standards (Bretton-Woods-System) und des gegenwärtigen multiplen Devisen-Standards. Diese Entwicklung des Weltwährungssystems wird hierbei als diskontinuierlicher, von Strukturbrüchen gekennzeichneter Prozeß aufgefaßt; zugleich seien zyklische Entwicklungsphasen beobachtbar. Zu Recht werden Parallelen zwischen gegenwärtigen und vergangenen Phasen gezogen, z. B. zwischen dem managed floating der 20er Jahre nach Ablösung des Gold-Standards und dem managed floating der 70er Jahre nach dem Zusammenbruch des Bretton-Woods-Systems. Angesprochen werden hier auch Verschiebungen im weltwirtschaftlichen Kräftefeld, insbesondere die Verdrängung des britischen Pfunds durch den US-Dollar und die spätere Rivalität zwischen Dollar, Yen und D-Mark als Reservewährung: Diese weltwirtschaftliche Kräfteverschiebung wird erst wieder im fünften Kapitel aufgenommen, was thematisch problematisch scheint, zumal die von Shams betonte Problematik der Politisierung der Währungsbeziehungen hier zu einer unmittelbar vertiefenden Analyse Gelegenheit bietet. Insgesamt begreift der Autor das Weltwährungssystem als charakterisiert durch unterschiedliche Währungsräume mit untereinander divergierenden Graden an Wechselkursflexibilität und ökonomischer und politischer Anpassungsfähigkeit.

Kapitel II behandelt vier Analyseansätze der internationalen Währungsbeziehungen:

- Wahl- bzw. Optimierungsansätze, die als Probleme vor allem ökonomische Effizienz, Förderung des internationalen Handelsaustauschs, Vertrauen in die Beständigkeit der internationalen Spielregeln und Harmonisierbarkeit nationaler Wirtschaftspolitiken nennen (*Zippel-, Cooper-, Grubel-Ansätze*).
- Machtansätze: Verteilungskonflikte aus dem Seigniorage eines Weltwährungssystems werden hier angesprochen; die Asymmetrie der Weltwirtschaft mit ihren Gegensätzen von armen und reichen, kleinen und großen Volkswirtschaften wird problematisiert.
- Der Monetarismus, der als „interner Monetarismus“ flexible Kurse fordert, während der „global monetarism“ aus Effizienzgründen zu einem Fixkurssystem tendiert.
- Werttheoretische Ansätze neomarxistischer Prägung, deren Erklärungspotential für die Weltwährungskrisen der 70er Jahre als gering eingeschätzt wird.

Bedauerlicherweise hält der Autor die normative Ebene und die Erklärungsebene der Positiven Ökonomie kaum auseinander und erschwert dem Leser somit das Verständnis der Problembereiche.

Kapitel III ist der weltwirtschaftlichen Struktur- und Entwicklungsdynamik gewidmet. Zunächst steht das langfristige Wachstum des Welthandels im Vordergrund der Analyse; anschließend untersucht der Autor die zyklische Entwicklung dieses Wachstumsprozesses als Ausdruck einer Zentrum-Peripherie-Dynamik und die sich wandelnde internationale Arbeitsteilung in einem Vier-Regionen-Ansatz. Das *Lewis*-Modell zur Erklärung des Welthandels in Abhängigkeit von der Industrieproduktion des Zentrums wird ebenso referiert wie der Ansatz von *Weisskopf* zur Erklärung der Instabilität und Profitabilität der Produktion. Die Theorie der Wachs-

tumspole von *Perroux*, das Konzept der „Zentrischen Weltwirtschaft“ von *Predöhl* und die Analyse der räumlichen Strukturdynamik nach *Lemper* (Betonung von komplementären Produktionen, sogenannte Industriekomplexe) werden behandelt, desgleichen *Cornwall's* Engine-of-growth-Modell des Innovationsaufholprozesses. Zwar trägt der Autor auch hier eine Fülle von Einzelansätzen und -aspekten vor, jedoch gelingt es nicht, realwirtschaftliche und monetäre Internationalisierungstendenzen systematisch zu verknüpfen, ihre wechselseitige Bedingtheit aufzuzeigen und die Partialmodelle auf eine integrierte Problemaufarbeitung hin zu verdichten.

Kapitel IV behandelt die „Weltgeldtheorie“, welche die Notwendigkeit und Entwicklung internationaler Währungen und Währungssysteme auf der Basis nationaler Währungen untersucht (*Swoboda, Cohen, Chrystal, Krugman*). Währungswettbewerb und Wechselkursvariabilität sind zwei Problemfelder, die hier aufgearbeitet werden sollen. Dies gelingt jedoch nur in Ansätzen, weil wiederum die Verbindung von realwirtschaftlichen und monetären Phänomenen nicht systematisch hergestellt wird.

Das abschließende Kapitel V behandelt Krisenerscheinungen der Weltwirtschaft und den Zusammenhang von Weltwirtschaftspolitik und internationalen Währungsbeziehungen. Hier werden einige Problembereiche der 70er Jahre aufgegriffen, so die Weltwirtschaftsrezessionen, die unerwartet hohe Variabilität der Wechselkurse, die „Hochzinspolitik“, der neue Protektionismus und die Verschuldungskrise der Dritten Welt. Der Autor fordert im Resümee seiner Arbeit die Ergänzung der Weltwährungspolitik durch eine Weltwirtschaftspolitik, die beide den internationalen politisch-ökonomischen Strukturen gerecht werden sollten; unklar bleibt jedoch die konkrete inhaltliche Auffüllung solcher Forderungen. Insgesamt reißt der Autor viele Problembereiche an und vermag auch wichtige Analysebausteine zusammenzutragen. Doch bleiben manche konzeptionelle und inhaltliche Wünsche des Lesers – trotz guter Einzeldarstellungen – zum Fragenkomplex internationale Währungsbeziehungen und Entwicklung der Weltwirtschaft offen.

Hier bietet sich vor allem an, die von der Weltbank veröffentlichten Weltentwicklungsberichte, den vom Internationalen Währungsfond publizierten *World Economic Outlook* sowie die Jahresberichte der Bank für Internationalen Zahlungsausgleich systematisch aufzuarbeiten. In diesen Berichten finden sich reiches Datenmaterial und theoretisch wichtige Erörterungen zur Problemverknüpfung von Weltgeld-, Weltkapital- und Weltgütermarkt, so daß sich Möglichkeiten und Grenzen in der Ausgestaltung des Weltwährungssystems aus einer mehrdimensionalen Sichtweise erschließen.

P. J. J. Welfens, Duisburg

Jurgensen, Philippe / Müller, Bruno / Neumann, Manfred J. M. / Rieke, Wolfgang / Schäfer-Jäckel, Elke: Devisenmarktinterventionen der Zentralbanken (Schriften des Vereins für Socialpolitik, N. F. 139, Hrsg. von W. Ehrlicher und R. Richter). Duncker & Humblot, Berlin-München 1984. 113 S. DM 44,60.

Interventionen sind in Perioden fixer Wechselkurse mehr oder weniger alltäglich und im reinen System flexibler Wechselkurse undenkbar, werden jedoch im „managed float“ zu weitgehend unvorhersehbaren und fallweisen Eingriffen von Zentralbanken in den Devisenmarkt. Dem theoretisch wie wirtschaftspolitisch gleichermaßen interessanten Fragenkomplex nach Zielen und Wirksamkeit von Devisenmarktinterventionen war die Tagung des Ausschusses für Geldtheorie und Geldpolitik des Vereins für Socialpolitik am 4. und 5. November 1983 in Frankfurt/Main gewidmet,

deren Ergebnisse in der vorliegenden Schrift (herausgegeben von Werner Ehrlicher und Rudolf Richter) zusammengefaßt sind.

Die drei Referate von Manfred J. M. Neumann (Bonn), Wolfgang Rieke (Deutsche Bundesbank, Frankfurt) und Bruno Müller (Schweizerische Nationalbank, Zürich), Kurzfassungen der anschließenden Diskussionen (von Elke Schäfer-Jäckel, Saarbrücken), und Bemerkungen bzw. Stellungnahmen von Jörg Niehans (Bern) und Helmut Schlesinger (Frankfurt) werden durch den „Bericht der Arbeitstagung über Interventionen an den Devisenmärkten“ von Philippe Jurgensen (Paris) ergänzt. Während die Beiträge von Rieke und Müller unmittelbar Bezug auf den Jurgensen-Bericht nehmen, markieren die Ausführungen von Neumann zwar einen thematisch verwandten, aber dennoch inhaltlich und analytisch-qualitativ völlig anderen Teilbereich des Tagungsgegenstandes. Seine anspruchsvolle Studie beschäftigt sich mit der „Suche nach der Interventionsfunktion der Deutschen Bundesbank“ und ist gegenüber den anderen erwähnten Beiträgen eine innovative theoretische und ökonomistische Untersuchung.

Der sog. Jurgensen-Bericht, der im vorliegenden Konferenzband in der deutschen Übersetzung aus der Deutschen Bundesbank vorliegt, faßt die Ergebnisse des von einer internationalen Arbeitsgruppe erstellten Erfahrungsberichtes über Interventionen der Zentralbanken an den Devisenmärkten zusammen. Die Staats- und Regierungschefs von sieben Ländern (USA, Japan, Bundesrepublik Deutschland, Frankreich, Großbritannien, Italien und Kanada) beschlossen anläßlich der Gipfelkonferenz in Versailles vom 4. bis 6. Juni 1982, „eine gründliche Analyse der Erfahrungen der beteiligten Länder mit Devisenmarktinterventionen in Auftrag zu geben“ (S. 83). Die politischen Motive, die für das Zustandekommen dieser Arbeitsgruppe verantwortlich waren, resultierten zum Teil aus dem Spannungsverhältnis zwischen den interventionsfreudigen Franzosen und den interventionsaversen Amerikanern. So ist das primäre Ziel der Arbeitsgruppe, „das Verständnis der Motive, der Methoden und der Auswirkungen von Interventionen am Devisenmarkt zu verbessern“ (S. 85), auch recht vage und unverbindlich gehalten. Der erste Teil des Jurgensen-Berichts untersucht verschiedene Definitionen der Intervention und scheint diejenige zu favorisieren, die Interventionen als „Veränderungen der Netto-Fremdwährungsaktiva der Währungsbehörden (ohne bewertungsbedingte Veränderungen der SZR-Zuteilungen)“ (S. 86/87) versteht. Wichtig im praktischen und theoretischen Sinne ist die weitere Unterscheidung in neutralisierte (unveränderte Geldbasis) und nicht neutralisierte Interventionen. Bei der Erörterung der Ziele der Interventionen (zweiter Hauptteil des Jurgensen-Berichts) wird kurzfristig primär die Aufgabe gesehen, „ungeordneten Devisenmarktbedingungen“ (S. 88) entgegenzuwirken. Einschränkung und entschuldigend wird jedoch sofort zugegeben, daß es keine spezielle Definition der Marktbedingungen gibt, die ungeordnete Verhältnisse anzeigen (S. 88). Ähnlich schwierig scheint es, die Zielsetzungen zu operationalisieren, die das Wechselkursniveau auf mittlere und auf lange Sicht beeinflussen sollen. Zu ersteren gehört das bekannte „sich gegen den Wind lehnen“ und zum letzteren der „Widerstand gegen Wechselkursbewegungen, die keine Beziehung zu den wirtschaftlichen Grundtatbeständen aufweisen“ (S. 90). Genauso unverbindlich und allgemein gehalten sind auch die Ausführungen des Jurgensen-Berichts zu den Auswirkungen der Interventionen (dritter Hauptteil). Bruno Müller führt die vorsichtige Formulierung, die häufig unterschiedliche Interpretationen zuläßt, auf die Uneinigkeit der einzelnen Autoren und Diskussionsteilnehmer des Jurgensen-Berichts zurück (S. 65). Trotz aller Mehrdeutigkeiten scheint der Jurgensen-Bericht Interventionen von Zentralbanken an den Devisenmärkten für wirksam zu halten, zumindest was die kurze oder mittlere Frist angeht.

Die Referate von Wolfgang Rieke und Bruno Müller, sowie die Diskussionen im Rahmen der Tagung des Vereins für Socialpolitik befassen sich kritisch mit den Ausführungen des Jurgensen-Berichts. Einigkeit scheint bei den Referenten und den Diskussionsteilnehmern darüber zu bestehen, daß man den Jurgensen-Bericht „eher als einen Beitrag zur kurzfristigen Diplomatie als zur währungspolitischen Erkenntnis werten muß“ (Niehans, S. 64) und aufgrund der vage formulierten Untersuchungsergebnisse die Aussagekraft der Studie in Frage zu stellen ist (so Schelbert-Syfrig, S. 59). Die Diskussionsrunde des Vereins für Socialpolitik hat m. E. zu Recht darauf hingewiesen, daß der Jurgensen-Bericht seine eigentliche primäre wirtschaftspolitische Aufgabenstellung durch Unverbindlichkeiten in der Aussage nicht gelöst hat. Diese Hauptprobleme sind erstens in der Frage nach der Möglichkeit der einzelnen Zentralbank zu sehen, die kurzfristigen Wechselkursabweichungen vom Trend zu dämpfen, ohne den langfristigen Trend selbst zu beeinflussen (Niehans, S. 63) und zweitens mit der Frage nach den Koordinierungsmöglichkeiten bei Devisenmarktinterventionen der Zentralbanken untereinander befaßt. Beide Fragestellungen werden im Jurgensen-Bericht und zum Teil auch in der Diskussionsrunde des Vereins für Socialpolitik in der Sitzung vom 4. und 5. November 1983 zugunsten der Erörterung von Devisenmarkteffizienz und der Erörterung der Profitabilität stabilisierender Interventionen vernachlässigt. Zu diesen beiden sekundären Fragen und ihrem Stellenwert im angesprochenen Problemrahmen hat Jörg Niehans in seinen Bemerkungen zum Vortrag von Wolfgang Rieke (S. 62-64) hinreichend Stellung bezogen.

Der erste Beitrag, von Manfred J. M. Neumann, unterscheidet sich – wie bereits erwähnt – wesentlich von den nachfolgenden und oben skizzierten Arbeiten zum Jurgensen-Bericht. Um „eine Reaktionsfunktion des Intervenierens am D-Mark/Dollar-Markt für den Zeitraum 1974 bis 1981 empirisch zu identifizieren“ (S. 10) postuliert der Verfasser eine Verlustfunktion, die additiv aus den quadrierten Abweichungen von Wechselkurs- und Geldmengenziel besteht. Aus der Minimierung dieser Verlustfunktion resultiert unter Beachtung bestimmter Nebenbedingungen und Annahmen ein Grundmodell des Interventionsverhaltens in Form einer Gleichung. Neumann legt besonderen Wert auf die „im Vergleich zur bisherigen Literatur (Arbeiten von Artus, von Branson, Haltunen und Masson und von Dornbusch) als nicht konstant angenommenen Reaktionskoeffizienten der Interventionsfunktion (S. 16). Insbesondere die Varianz der nichtantizipierten Änderung des Wechselkurses wird als zeitvariabel unterstellt. Darüber hinaus postuliert Neumann alternative Hypothesen über den Einfluß von Wechselkursunsicherheit auf die Zielgewichte bzw. den trade-off zwischen Wechselkurs- und Geldmengenkontrolle (S. 16). Zur wenig interessanten konventionellen Hypothese C konstanter Gewichte werden zwei weitere alternative Hypothesen formuliert und getestet. Hypothese A postuliert eine stärkere Hinwendung der Zentralbank zum Wechselkursziel, wenn die Wechselkursunsicherheit zunimmt. Auch dies kann als eher konventionell bzw. populär interpretiert werden. Hypothese B, nach der Zentralbanken verstärkt ihr Geldmengenziel verfolgen, wenn die Wechselkursunsicherheit zunimmt, ist neu. Begründet wird diese Verhaltensweise mit Hinweis auf die höhere „Produktivität“ des Intervenierens in Zeiten relativ hoher Wechselkursunsicherheit aufgrund niedriger notwendiger Zusatznachfrage nach bzw. Zusatzangebot an D-Mark im betrachteten D-Mark/Dollar-Markt, um eine gewünschte Änderung des Wechselkurses der D-Mark zu erreichen (S. 17 und Gleichungen 5a bzw. 5b S. 13).

Die aus dem Optimierungskalkül resultierende Interventionsfunktion wird durch alternative Formulierungen des Wechselkurszieles ergänzt und empirisch mit Hilfe nichtlinearer Schätzverfahren untersucht. Die Ergebnisse erkennen dem jeweiligen Grad der Wechselkursunsicherheit einen maßgeblichen Einfluß zu und favorisieren

die oben skizzierte Hypothese B der Interventionsstrategie. Als wichtigste Erkenntnis dieser Studie ist hervorzuheben, „daß die Devisenmarktinterventionen der Deutschen Bundesbank mit ihrem geldpolitischen Gesamtkonzept abgestimmt sind“ (Neumann, S. 36).

Die Untersuchung von Neumann weist gegenüber den anderen Tagungsbeiträgen, die gezwungenermaßen am unverbindlichen Jurgensen-Bericht orientiert sind, ein analytisch wesentlich höheres Anspruchsniveau auf. Auch im Vergleich zu ähnlichen Studien sind die vielfältigen Neuerungen und teilweise unkonventionellen Ansätze hervorzuheben und besonders zu beachten. Sie stellen einen Fundus an interessanten Hinweisen und Hypothesen dar, die nachfolgende Untersuchungen zum Gegenstand der Interventionsfunktionen dankbar verwenden können.

Die Diskussionsrunde des Ausschusses für Geldtheorie und Geldpolitik des Vereins für Socialpolitik hat sich intensiv mit dem Referat von Neumann beschäftigt. Es ist hier nicht Aufgabe, diese Diskussion wiederzugeben. Das ist im vorliegenden Beitrag mit der Zusammenfassung durch Frau Schäfer-Jäckel geschehen. Vielmehr seien ergänzend einige wenige zusätzliche Aspekte angeführt, die insbesondere für einen Forscher, der an denselben oder ähnlichen Fragestellungen arbeitet, auffallend bzw. von Interesse sind.

In der vorliegenden Studie wird besonderes Gewicht auf nicht konstante Reaktionsparameter in der Interventionsfunktion (Gleichung (7), S. 15) gelegt (z. B. S. 16 und S. 35). Obwohl die Varianz der nicht antizipierten Änderung des Wechselkurses (im Beitrag mit V bezeichnet) als zeitvariabel bei der Interpretation und empirischen Schätzung der Interventionsfunktion (7) angesehen wird, ist die Gleichung (7) selbst als Ergebnis der Minimierung einer Verlustfunktion unter Nebenbedingungen unter der Annahme eines konstanten V erfolgt. Dies ist zumindest inkonsistent. Desweiteren gehen die weiter oben diskutierten Hypothesen der Interventionsstrategien der Zentralbank (außer der konventionellen Hypothese C) von zeitvariablen Zielgewichten (in Abhängigkeit von V_t) aus. Auch dies ist nicht explizit in der Ableitung von (7) berücksichtigt. Schließlich ist auch zu fragen, warum im Rahmen des Wechselkursziels das dem Terminkurs zugewiesene Gewicht (δ) (S. 29 und Tabelle 4 S. 20) nicht ebenfalls als variabel interpretiert wird.

Als Zugeständnisse an die übrigen Tagungsbeiträge sind wohl einige Teile der Einleitung zu interpretieren, denn die eigentliche theoretische und empirische Studie beschäftigt sich nicht mit Devisenmarkteffizienz, auf die Teile der einleitenden Bemerkungen abzielen. Auch ist die Begründung für die neue Hypothese B mit Hinweis auf die Produktivität des Intervenierens nicht ohne weiteres einleuchtend. Zumindest ist ihre Charakterisierung als „rational“ (S. 17) interpretationsbedürftig.

Für einen Ökonometriker wäre es wünschenswert gewesen, wenn der Verfasser der vorliegenden Untersuchung angegeben hätte, welches nichtlineare Schätzverfahren er für die empirische Überprüfung der Interventionsfunktion angewendet hat. Da es mehrere solcher Verfahren gibt, wäre diese Information für einen Forscher, der die Ergebnisse nachtesten oder ähnliche Hypothesen überprüfen möchte, durchaus wichtig.

Dieser letzte Einwand wird jedoch sicherlich dadurch relativiert, daß die Schätzwerte unterschiedlicher nichtlinearer Schätzverfahren in der Regel nicht zu divergierenden Ergebnissen führen. Dieser Kritikpunkt scheint mir dennoch erwähnenswert, weil den Möglichkeiten der Forschung auf dem hier interessierenden Gebiet der Interventionsfunktion von einer ganz anderen Seite her wesentlich gravierendere Erschwernisse entgegenstehen, die der Verfasser der vorliegenden Studie allerdings nicht zu verantworten hat.

Die Bundesbank (wie auch andere Zentralbanken) betrachtet ihre Interventionsdaten aus unerfindlichen Gründen als eine datenschutzwürdige Information, die der Geheimhaltung zu unterliegen hat und nicht jedermann zugänglich gemacht werden sollte. Es ist äußerst schwer, wenn nicht gar unmöglich, verlässliche Interventionsdaten zu gewinnen. Um so mehr sind hier die Forschungsaktivitäten von Neumann zu bewundern, dem es offensichtlich gelungen ist, die Informationssperre zu durchbrechen. Leider stehen andere Forscher weiterhin vor diesem Datenbeschaffungsproblem. Es wäre dringend zu wünschen, daß die Bundesbank ihre diesbezügliche Informationspolitik ändert, zumal m.E. kein wichtiges Argument ihre Informationsautarkie zu unterstützen vermag.

Als allgemeiner Eindruck dieses Konferenzbandes der Tagung des Ausschusses für Geldtheorie und Geldpolitik des Vereins für Socialpolitik über Devisenmarktinterventionen der Zentralbanken scheint ein Teil des Titels des Neumannschen Referates insgesamt zutreffend zu sein: Auf der Suche nach der Interventionsfunktion. Im Lichte vielfältiger Mutmaßungen, unvollständig veröffentlichter Zeitreihen über Interventionen, widersprüchlicher Äußerungen von Notenbankpolitikern und undeutlich und verschwommenen oder gar nicht formulierten Wechselkurszielen und nicht eindeutig identifizierbaren Interventionswirkungen ist die Suche nach der Interventionsfunktion noch nicht abgeschlossen. Sie wird im theoretischen, empirischen und wirtschaftspolitischen Rahmen wohl fortgesetzt werden.

H.-E. Loef, Siegen

Vilks, Arnis: Aggregation und Kausalität im Modell des allgemeinen Konkurrenzgleichgewichts. Vandenhoeck & Ruprecht, Göttingen 1984. 141 S. Kart. DM 49,—.

Vilks geht in seinem Buch von der Hypothese aus, daß das *Arrow-Debreu*-Modell der Allgemeinen Gleichgewichtstheorie als Grundlage für eine mikroökonomische Fundierung der makroökonomischen Theorie geeignet ist. Er setzt diese Annahme nicht, weil er an die Realitätsnähe dieses Modells glaubt, sondern weil die Allgemeine Gleichgewichtstheorie das heute allgemein anerkannte Paradigma der mikroökonomischen Theorie darstellt. Für die Zwecke seiner Analyse wird vom Autor weiter unterstellt, daß sich die herrschende mikroökonomische Theorie auch kausal interpretieren läßt. Dies heißt insbesondere, daß sich die Argumente (wie etwa die Preise) in einer Angebots- oder Nachfragefunktion als die Ursache des Niveaus der angebotenen oder nachgefragten Menge auffassen lassen. Das soll sowohl für die Angebots- oder Nachfragefunktionen von Individuen, als auch für diejenigen eines ganzen Marktes gelten.

Die Frage, die *Vilks* stellt und beantwortet, lautet: Unter welchen Bedingungen läßt sich ein mikroökonomisches Gleichgewichtsmodell oder ein Ausschnitt davon (beispielsweise das Modell eines einzelnen Marktes) so in ein makroökonomisches Modell überführen, daß das Makromodell in seiner Struktur eine gewisse Analogie zum Mikromodell aufweist und daß auch die in der Makrotheorie verwendeten Relationen kausal interpretierbar sind. Zu diesem Zweck studiert *Vilks* nochmals die in der Literatur der sechziger Jahre schon bewiesenen Sätze über konsistente und approximative Aggregation. Die Kernaussagen über konsistente Aggregationen sind bekanntlich weitgehend „Unmöglichkeitstheoreme“. Sie besagen, daß eine konsistente Aggregation eines mikroökonomischen Gleichgewichtsmodells zu einem Makromodell nur in wenigen Spezialfällen möglich, im allgemeinen aber unmöglich ist. Hält man an der Forderung einer konsistenten Aggregation fest, so kann man aus der Mikrotheorie also auch kein Makromodell ableiten, das sich kausal interpretieren läßt. Allerdings

wird bei konsistenter Aggregation immer vorausgesetzt, daß in der Makrotheorie nur Funktionen verwendet werden dürfen. Läßt man in der Makrotheorie hingegen auch Korrespondenzen zu, so ist eine konsistente Aggregation fast immer möglich und *Vilks* zeigt, daß in diesem Fall das Makromodell auch kausal interpretierbar wird. Im Prinzip zum gleichen Ergebnis kommt man bei approximativer Aggregation. *Vilks* weist nach, daß auch hier die Makrorelationen als kausale Erklärungen aufgefaßt werden können, wenn man nur die Aggregate geeignet wählt.

Die Ergänzungen, die *Vilks* am bisherigen Stand der Aggregationstheorie vornimmt, sind zweifellos interessant. Dennoch stellt sich die Frage, ob das Thema in der bisherigen Form nicht allmählich ausgereizt ist. Einigkeit dürfte unter den Ökonomen darüber herrschen, daß jede makroökonomische Theorie auf dem Verhalten von Individuen aufbauen muß und insofern einer mikroökonomischen Begründung bedarf. Dies muß aber keineswegs heißen, daß die gerade herrschende mikroökonomische Theorie eine solche Begründung liefern könnte. Die neoklassische Mikrotheorie ist zwar als theoretisches Konstrukt zur Beschreibung des Wahlproblems eines Konsumenten sehr illustrativ. Es dürfte aber schwerfallen, sie empirisch-deskriptiv zu interpretieren. Der prognostische Wert einer mikroökonomischen Nachfragefunktion, ist – wenn sie sich empirisch überhaupt feststellen läßt – zur Beschreibung des tatsächlichen Verhaltens eines einzelnen Käufers völlig ungeeignet. Dagegen weiß man, daß eine makroökonomische Konsumfunktion, die mit a priori konstruierten Preis- und Mengenindizes arbeitet, sehr wohl den Konsum einer großen Menge von Individuen einigermaßen sicher vorhersagen kann. Wäre es dann nicht sinnvoller, diese Tatsache als Herausforderung an die mikroökonomische Theorie aufzufassen? Das Aggregationsproblem würde dann lauten: Man suche eine mikroökonomische Theorie, die einigermaßen gesicherte statistische Zusammenhänge zwischen makroökonomischen Aggregaten zu erklären vermag. Aus dem Verlauf der bisherigen Diskussion wissen wir schon, daß die herrschende mikroökonomische Theorie dies nicht zu leisten vermag.

A. Wenig, Hagen

Gholamreza, Nakhaeizadeh: Überprüfung der permanenten Einkommenshypothese mit Hilfe der Bayes-Statistik. Athenäum, Königstein 1985. 216 S. DM 56,—.

Milton Friedmans heute allgemein akzeptierte ‚permanente Einkommenshypothese‘ (PIH) hat seit ihrer Einführung eine Vielzahl von Untersuchungen angeregt. In empirischen Modellen wird ihrem Aspekt, daß nicht nur das laufende, sondern auch das für die Zukunft erwartete Einkommen eine Rolle für die laufenden Konsumausgaben spielt, durch die Modellierung der privaten Konsumausgaben als Distributed-Lag des verfügbaren Einkommens berücksichtigt.

Diese Monographie verfolgt zwei Ziele: zum einen soll eine neuerliche Überprüfung der PIH für die Bundesrepublik Deutschland ausgehend von Friedmans ursprünglichem Modellansatz unter Verwendung der Bayes-Statistik im Gegensatz und im Vergleich zur klassischen Statistik vorgenommen werden, um zum anderen damit die generelle Anwendbarkeit und Flexibilität der Bayes-Statistik auch für die empirische Ökonometrie zu demonstrieren. Schätzungen werden dabei unter Verwendung von Jahres- und Quartalswerten des Konsums und des verfügbaren Einkommens der privaten Haushalte in der Bundesrepublik innerhalb des Zeitbereichs 1957 bis 1977 erstellt.

Das erste Kapitel enthält nach einem kurzen Abriß der PIH eine Untersuchung von jeweils 8 Jahres- und Quartalsmodellen innerhalb der klassischen Statistik mit Hilfe

der Schätzmethode von Friedman. Die verschiedenen Modelle ergeben sich aus der ursprünglichen Friedmanschen Konsumfunktion durch die Aufnahme autoregressiver Störterme, durch eine Proportionalitätsannahme bzgl. der transistorischen Komponenten und durch die Beachtung eines Homogenitätsfaktors.

Im zweiten Kapitel werden diese Modelle im Rahmen der Bayes-Statistik behandelt. Dazu werden zu Beginn die Grundlagen der Bayes-Methode beschrieben und die Vorteile des Bayes-Ansatzes (Berücksichtigung zusätzlicher Information, Elimination nichtinteressierender Parameter, Beachtung von Bereichsrestriktionen) vorgestellt. Die empirischen Untersuchungen dieses wie auch des nächsten Kapitels gehen von diffusen („nicht-informativen“) a priori Verteilungen aus, die jedoch die Bereichsrestriktionen für die verschiedenen Parameter berücksichtigen.

Das dritte Kapitel beschäftigt sich mit den beiden Modellansätzen, die sich aus dem ursprünglichen Modell mit Hilfe der Koycktransformation und der Methode von Klein gewinnen lassen. Unter verschiedenen Annahmen über die Störterme werden innerhalb dieser umformulierten Modelle wiederum die Proportionalitätsannahme, die Unabhängigkeit der transistorischen Komponenten und im Klein-Modell einige Ansätze zur Behandlung des ‚truncated remainder‘ überprüft.

Im vierten Kapitel wird gezeigt, wie vorliegende Schätzergebnisse mit Hilfe von Zellners ‚Maximal Data Information Priors‘ in der Bayes-Statistik Berücksichtigung finden können. Die Technik wird an Hand von 5 Modellen des zweiten Kapitels demonstriert.

Das fünfte Kapitel greift die PIH als Modell mit Fehlern in den Variablen auf. Es wird eine Erweiterung der Grundlagen von Zellner und Attfield zur Behandlung dieses Modellansatzes im Rahmen der Bayes-Statistik vorgestellt, die eine Überprüfung aller Annahmen über die PIH sowohl mit Zeitreihen- als auch mit Querschnittsdaten ermöglicht. Eine empirische Anwendung dieser Methoden erfolgt nicht.

Die Inhaltsangabe macht deutlich, daß der Leser mit einer Fülle von theoretischen und praktischen Ergebnissen über die ökonometrische Behandlung der PIH als auch über die Anwendung der Bayes-Methode bekannt gemacht wird. Dabei werden die empirischen Resultate in tabellarischer Form übersichtlich präsentiert und jeweils gesondert als auch vergleichend ausgewertet. Daß der Leser dennoch in Gefahr gerät, aufgrund der großen Anzahl der Ergebnisse, die sich wegen der verschiedenen Annahmen, Modellansätze und Zeitbereiche ergeben, den Überblick über die Gesamtheit der Resultate zu verlieren, zumal diese kein einheitliches Bild aufweisen, ist daher kaum dem Autor anzulasten. Dennoch kann als generelles Ergebnis festgehalten werden, daß für die Bundesrepublik Deutschland die PIH sich deutlich von der allgemeinen Einkommenshypothese unterscheidet und daß die Homogenitätsannahme der PIH wie auch die Unabhängigkeit der transistorischen Komponenten abzulehnen ist.

Wichtig erscheint es mir zu erwähnen, daß auf eine empirische Untersuchung von Modellen mit mehr als drei interessierenden Parametern verzichtet wurde, da die zugehörigen numerischen Verfahren einen zu großen Rechenaufwand erfordern. Diese Einschränkung läßt ein Schlaglicht auf die Problematik der Bayes-Methode hinsichtlich ihrer praktischen Anwendbarkeit fallen. Es ist daher höchst zweifelhaft, ob dieses Buch eines der beiden gesetzten Ziele erreicht, nämlich die generelle Anwendbarkeit der Bayes-Statistik innerhalb der empirischen Ökonometrie zu zeigen.

Die zumeist anspruchsvollen mathematischen Ableitungen sind souverän und klar geführt und, soweit sie technische Einzelheiten und Nebenbemerkungen betreffen, jeweils in den Anhang eines Kapitels ausgegliedert. Vorbildlich ist die Angabe des

verwendeten Datenmaterials und der numerischen Integrationsverfahren. Kleine Schwächen (Verwendung des Bestimmtheitsmaßes an Stelle des korrigierten R^2 beim Modellvergleich, Anwendung des gewöhnlichen Durbin-Watson-Tests im Falle autoregressiver Modelle) trüben in keiner Weise den Wert dieser umfangreichen theoretischen und praktischen Arbeit.

Das Buch wendet sich wegen seiner nicht unwesentlichen mathematischen Ansprüche mehr an den mathematisch ausgerichteten Ökonometriker, es kann aber wegen seiner zahlreichen empirischen Ergebnisse auch dem Ökonomen empfohlen werden.

M. Lösch, Bochum

Karmann, Alexander J.: Die permanente Einkommenshypothese – Kritische Analyse einer monetaristischen Position mit Hilfe ökonometrischer Methoden (Untersuchungen über das Spar-, Giro- und Kreditwesen, Bd. 121). Duncker & Humblot, Berlin 1985. 142 S. DM 64,-.

In letzter Zeit rückt nach der vorhergehenden schwerpunktmäßigen Betrachtung der Angebotsseite wieder die Nachfrageseite in das Interessensfeld ökonomischer Betrachtung; und hier kommt neben der Investitionsnachfrage auch der Konsumnachfrage wachsende Bedeutung zu, wie die Vielzahl von hauptsächlich empirischen Arbeiten zur Ermittlung der Bestimmungsgründe der Konsumnachfrage zeigt.

Auch der Autor dieses Buches beschäftigt sich mit der Frage, von welchen Faktoren die Konsumnachfrage bestimmt wird und wie sie am besten prognostiziert werden kann. Ausgangspunkt seiner Analyse ist hierbei die von Milton Friedman aufgestellte Hypothese vom permanenten Einkommen (permanente Einkommenshypothese), die mit Hilfe von verschiedenen Schätzverfahren getestet wird. Anschließend erfolgt, und dies ist das Neue und Besondere an dieser Arbeit im Vergleich zu zahlreichen anderen Veröffentlichungen zu diesem Thema, die Überprüfung der Schätzer hinsichtlich ihrer Validität und Prognosegüte mit Hilfe einer Monte-Carlo-Studie, die auch zu einer Aussage der Überlegenheit bestimmter Schätzverfahren über andere führen soll.

In seinem einleitenden Kapitel motiviert der Autor seine Arbeit damit, daß mit Hilfe der keynesianischen Konsumfunktion die Konsumnachfrage, insbesondere in den letzten zwanzig Jahren nicht zufriedenstellend prognostiziert werden konnte. Er verweist in diesem Zusammenhang u. a. darauf, daß die keynesianische Konsumhypothese den Anstieg der durchschnittlichen Sparquote in der ersten bedeutenden Rezession 1974 - 75 nicht erklären kann. Allerdings vermag auch die permanente Einkommenshypothese dies nur unter Einschränkungen zu erklären. Gehen wir davon aus, daß die Wirtschaftssubjekte ihre Einkommenserwartungen langfristig bilden und den rezessiven Einbruch als vorübergehend begreifen, so führt auch eine Orientierung am permanenten Einkommen ebenso wie die keynesianische Konsumhypothese zu einem kurzfristig antizyklischen Verhalten der Konsumquote, nämlich zu ihrem Anstieg. Nur wenn man wie der Autor argumentiert, daß eine drastische Rezession bei Unterstellung rationaler Erwartungen über eine Korrektur der Beschäftigungserwartungen auch das erwartete zukünftige Einkommen senkt, kann man eine erhöhte Sparbereitschaft aus Vorsorgemotiven ableiten.

In seinem zweiten Kapitel diskutiert der Autor vergleichend die keynesianische Konsumhypothese, die relative Einkommenshypothese und die permanente Einkommenshypothese, wobei er der letzteren besonderes Augenmerk widmet. Nach einer

zunächst klaren und übersichtlichen Darstellung kommt er jedoch zu einer nicht unbedingt einleuchtenden Interpretation der permanenten Einkommenshypothese. Ausgangspunkt seiner Überlegungen ist hierbei, daß in der Bevölkerung eine ungleiche Einkommensverteilung besteht und Bezieher höherer Einkommen eine höhere Sparneigung aufweisen als Bezieher niedrigerer Einkommen. Die permanente Einkommenshypothese fordere dagegen die Gleichheit der durchschnittlichen Konsumquote aus permanenten Einkommen, da Einkommensschichten, die über dem durchschnittlichen permanenten Einkommen liegen, ihre höheren transitorischen Einkünfte voll dem Sparen zuführen, wohingegen Bezieher von unter dem Durchschnitt liegenden Einkommen entsparen, was bei der Annahme einer normalverteilten Einkommensgruppierung zu einem Ausgleich beim durchschnittlichen permanenten Einkommen führen soll. Wie sich aus der Betrachtung typischer Einkommensverteilungen (linkssteil) zeigt, ist die Annahme einer normalverteilten Einkommensgruppierung unrealistisch, außerdem erscheint es nicht möglich auf diese Weise eine Aggregation zwischen unterschiedlichen Einkommensgruppen vorzunehmen. Zusätzlich behauptet Karmann noch, daß die marginale Konsumquote „bei der Gruppe der Selbständigen („independent business“) höher als bei derjenigen der Lohnabhängigen („non-business, non farm“)“ sei. Allerdings widerspricht diese Aussage sowohl dem Vorhergehenden als auch seiner Graphik, sowie der folgenden Aussage: „Da zudem das permanente Einkommen der Selbständigen in der Regel über dem Durchschnittseinkommen liegt, vermag die PEH (Permanente Einkommenshypothese) den empirischen Sachverhalt zu erklären, wonach beobachtete Konsumquote c/y und gemessenes Einkommen y negativ korreliert sind“, so daß es sich wahrscheinlich um einen Flüchtigkeitsfehler handelt. Im letzten Teil des zweiten Kapitels erfolgt schließlich eine formale Operationalisierung des permanenten Einkommens, sowie der daraus abgeleiteten Konsumfunktionen.

Im folgenden dritten Kapitel wird die permanente Einkommenshypothese unter besonderer Berücksichtigung der Proportionalitätshypothese (der permanente Konsum ist proportional zum permanenten Einkommen), der Unkorreliertheithypothese (der transitorische Konsum ist unabhängig vom transitorischen Einkommen), der Bedeutung des Absolutgliedes in der Konsumfunktion für die Schätzqualität und der Erwartungsbildung kritisch diskutiert. Besonders interessant ist hier der Vergleich zwischen adaptivem Erwartungsmodell und rationalen Erwartungen. Schade ist, daß die Betrachtungen zu den rationalen Erwartungen keinen Einfluß in die Schätzverfahren des 4. Kapitels finden. Schließlich erfolgt in diesem Kapitel noch eine Kurzbeschreibung ausgewählter bisheriger empirischer Arbeiten zur permanenten Einkommenshypothese.

Im 4. Kapitel folgt nun die Analyse und übersichtliche Beschreibung der vom Autor zur Überprüfung der permanenten Einkommenshypothese verwendeten fünf Schätzverfahren, die auf der reduzierten Form, nach der Notation des Autors Koyck – I, Koyck – II, Koyck – III, da sie aus einer Koyck-Transformation hervorgehen, bzw. der finalen Form, Klein-Verfahren, Dhrymes-Verfahren, basieren. Die Eigenschaften dieser Schätzfunktionen sind das Erkenntnisinteresse der später folgenden Monte-Carlo-Studie.

Das fünfte Kapitel stellt im Zusammenhang mit dem Appendix A.3 den wichtigsten Teil dieser Arbeit dar. In ihm erfolgt die empirische Überprüfung der permanenten Einkommenshypothese für die BRD im Zeitraum 1960 - 1981, sowie die Überprüfung der verwendeten Schätzverfahren mit Hilfe des Monte-Carlo-Experiments (Appendix).

Für den relevanten Untersuchungszeitraum wird einmal in seiner Gesamtheit und sodann unterteilt in die Teilabschnitte 1960 - 1971 sowie 1970 - 1981 auf der Basis von

Vierteljahresdaten bzw. Jahresdaten mit Hilfe der in Kapitel 4 vorgestellten Schätzverfahren eine Konsumfunktion geschätzt und sodann auf ihre Übereinstimmung mit der permanenten Einkommenshypothese untersucht. Anschließend erfolgt eine Überprüfung der Schätzverfahren hinsichtlich ihrer Validität und Prognosegüte mit Hilfe der Monte-Carlo-Studie. Das verwendete Datenmaterial besteht aus mit dem Preisindex für die Lebenshaltung aller privaten Haushalte preisbereinigten und mit der Entwicklung des Bevölkerungswachstums bevölkerungsbereinigten Reihen für privaten Verbrauch und verfügbares Einkommen.

Als grundsätzliche Ergebnisse, die sich bei allen verwendeten Schätzverfahren übereinstimmend ergeben, lassen sich festhalten:

- Für die Beobachtungszeiträume 1960 - 1971 und 1960 - 1981 ist der Einfluß eines Absolutgliedes als gesichert anzusehen, wohingegen seine Bedeutung für den Untersuchungszeitraum 1970 - 1981 nicht gegen Null gesichert ist.
- Die Schätzung der Konsumquote ist bei Jahres- und Quartalsdaten gleich.
- Für den Zeitraum 1970 - 1981 versagt die keynesianische Konsumfunktion als Erklärungsansatz.
- Die Anpassungen der Zeitreihen an die Friedmansche Konsumfunktion sind relativ ungenau, obwohl sie für den Untersuchungszeitraum 1970 - 1981 besser sind als an die Keynesianische.

Zusammenfassend läßt sich somit sagen, daß die Bedeutung des permanenten Einkommens für die Konsumnachfrage der privaten Haushalte im Beobachtungszeitraum zugenommen hat, obwohl es bei weitem nicht die Bedeutung hat, die ihm in den USA zur Erklärung des Konsums zukommt. Letzteres läßt sich einleuchtenderweise nach Meinung des Autors durch institutionelle Unterschiede im Bildungswesen und Sozialversicherungssystem zwischen der BRD und den USA erklären. In der BRD besteht nämlich im Gegensatz zu den USA ein weitgehend kostenloses Bildungssystem sowie ein umfangreiches soziales Netz, insbesondere auch für die Alterssicherung, so daß die Vermögensdisposition und somit auch die Konsumnachfrage in der BRD stärker durch kurzfristige Aspekte beeinflusst werden kann. Die zunehmende Bedeutung des permanenten Einkommens für die Konsumnachfrage läßt sich in Übereinstimmung mit den Beobachtungen des Sachverständigenrats durch die Verschiebung des privaten Verbrauchs von lebensnotwendigen Gütern zu langlebigen Gebrauchsgütern erklären. Beim Vergleich der verwendeten Schätzverfahren hinsichtlich ihrer Eignung zur Überprüfung der permanenten Einkommenshypothese mit Hilfe der Monte-Carlo-Studie läßt sich keine eindeutige Rangfolge der einzelnen Verfahren aufstellen. Generelles Ergebnis ist, daß fehlspezifizierte den richtig spezifizierten Modellen unterlegen sind. Dies ist ein naheliegendes Ergebnis, da von ökonomischen Modellen schon bei ihrer Spezifizierung eine möglichst adäquate Abbildung der Realität verlangt wird, weil sie sonst zu falschen Ergebnissen führen. Weiterhin wird durch das Monte-Carlo-Experiment bestätigt, daß eine Vergrößerung des Stichprobenumfangs zu einer Verbesserung der Schätzqualität und die Einführung von Autokorrelation zu ihrer Verschlechterung führt, was sich jedoch auch theoretisch zeigen läßt.

In einer abschließenden Würdigung dieser Arbeit kann festgestellt werden, daß der Autor mit der Einbringung der Monte-Carlo-Studie zur empirischen Überprüfung der permanenten Einkommenshypothese einen wichtigen Schritt zur ökonomischen Begründung der Bestimmungsgründe der Konsumnachfrage unternommen hat. Gerade ökonomische Fragestellungen eignen sich besonders für Simulationsmodelle, da sie sich häufig nicht auf einfach strukturierte lineare oder nichtlineare Systeme

reduzieren lassen. Dies ist insbesondere dann wichtig, wenn es sich um stochastische Modelle handelt oder um Hypothesen, die vom unbekannten Verhalten der Marktteilnehmer abhängen. Es ist deshalb konsequent, wenn der Autor zur Überprüfung der permanenten Einkommenshypothese auf die Monte-Carlo-Simulation zurückgreift. Leider sind die Ergebnisse seiner Studie nicht eindeutig, da sich weder eine Rangfolge bezüglich der verwendeten Schätzverfahren aufstellen läßt, noch eine eindeutige Aussage über die Gültigkeit der permanenten Einkommenshypothese möglich ist.

Ein sinnvoller weiterer Schritt zur Überprüfung der Bestimmungsgründe der Konsumnachfrage wäre somit, wie auch vom Autor angesprochen, eine weitergehende Spezifizierung des ökonomischen und stochastischen Modells.

J. Reichart, Heidelberg

Pohmer, Karlheinz: Mikroökonomische Theorie der personellen Einkommens- und Vermögensverteilung. Allokation und Distribution als Ergebnis intertemporaler Wahlhandlungen (Studies in Contemporary Economics, Vol. 16). Springer-Verlag, Berlin - Heidelberg - New York - Tokyo 1985. IX, 214 S. Brosch. DM 38,—.

Im Verhältnis zur ausgebauten und ausgefeilten Theorie der funktionellen Einkommensverteilung bieten die zahlreichen Ansätze zu einer Theorie der personellen Verteilung des Volkseinkommens ein eher bescheidenes Bild. Setzt man als Anspruchsnorm, daß eine solche Theorie (1) die individuellen Arbeits- und Kapitaleinkommen bei gegebenen Lohn- und Zinssätzen aus den Arbeits- und Kapitalangebots- und den Güternachfragedispositionen der Individuen und (2) dieses Marktverhalten aus individuellen Optimierungskalkülen ableiten müßte, und daß sie (3) mit der Theorie der funktionellen Verteilung in der Weise zu verknüpfen wäre, daß die Faktorpreise und Faktormengen als Gleichgewichtswerte der Arbeits-, Kapital- und Gütermärkte bestimmt werden, was wiederum nur gelingt, wenn außer den Arbeits- und Kapitalangebots- und den Güternachfragedispositionen der Haushalte die Arbeits- und Kapitalnachfrage- und die Güterangebotsdispositionen der Unternehmungen aus repräsentativen individuellen Optimierungskalkülen erklärt werden, dann gibt es bislang überhaupt keine Theorie der personellen Einkommensverteilung. Die vorliegenden Versuche zur Erklärung der personellen Verteilung – ganz gleich, ob stochastische Ansätze, die die Ungleichheit in der personellen Einkommensverteilung als Ergebnis von Zufallsprozessen (Gibrat, Champnowne) erklären oder deterministische Ansätze, die auf die Ungleichverteilung der geerbten oder erworbenen Einkommenserzielungschancen oder auf die nicht-lineare Umsetzung gleichverteilter Einkommenserzielungschancen abstellen (Roy, Lydall, Mincer, Becker, Blinder, Friedman, um nur die wichtigsten Namen zu nennen) – werden dem eben formulierten Anspruch nicht gerecht. Beurteilt man die Theorien der funktionellen Einkommensverteilung danach, ob und wie sie die empirisch verbürgte langfristige Konstanz der funktionellen Einkommensquoten erklären, so wäre ein Prüfstein für Theorien der personellen Verteilung, ob und wie sie die empirisch belegte linkssteile, näherungsweise lognormale Verteilung der individuellen Periodeneinkommen erklären. Auch in dieser Hinsicht schneiden die genannten Theorien der personellen Einkommensverteilung anders als die der funktionellen nicht gut ab. Man ist darum gespannt, ob dem Autor des vorliegenden Buches Fortschritte auf diesem Terrain geglückt sind.

Der Autor verknüpft, kurz erklärt, die Ansätze von Becker, Mincer und Blinder mit eigenen Elementen. Er bestimmt die personelle Verteilung der Perioden- ebenso wie die der Lebenseinkommen im Rahmen eines neoklassischen Modells der Nutzenmaximierung über die gesamte Lebensspanne des repräsentativen Individuums. Im Rah-

men solcher Lebens-Optimierungskalküle entscheidet das Individuum für jede Lebensperiode (1) über die optimale Aufteilung der verfügbaren Zeit auf die Aktivitäten Arbeit, Ausbildung und Freizeit und (2) über die optimale Aufteilung des Periodeneinkommens auf Konsum und Ersparnis. Elemente der Nutzenfunktion sind der Konsum, die Freizeit, das Humanvermögen (dieses ist also nicht nur Mittel zur Erzielung höherer Einkommen; es stiftet nicht nur mittelbar sondern auch unmittelbar Nutzen) und die Höhe des Endvermögens, das das Individuum seinen Erben hinterläßt. In die Budgetrestriktion des Individuums gehen die Anfangsausstattung mit Human- und Geldvermögen, die Ausstattung mit angeborenen Fähigkeiten, die Faktorpreise der einzelnen Perioden und die Zeitpräferenzrate ein. Die Nutzenfunktion ist konkav, additiv und isoelastisch. Die Produktionsfunktion für Humanvermögen ist vom Cobb-Douglas-Typ: Als Input wird das bereits verfügbare Humanvermögen und die Ausbildungszeit erfaßt. Das Humanvermögen wird durch Vergessen und Veralten mit einer konstanten Rate entwertet. Das Individuum hat die Wahl, die Nicht-Freizeit beliebig auf Ausbildungs- und Arbeitszeit aufzuteilen. Ausbildungszeit kostet den Verzicht auf Arbeitseinkommen. Die Erstaussstattung mit Geldvermögen umfaßt nicht nur das Erbe, sondern sämtliche monetären und naturalen Transferleistungen der Eltern während der ersten Lebensphase. Die geplante Lebensdauer des repräsentativen Individuums beträgt 75 Jahre. Der Grenznutzen des Humanvermögens anders als der des Geldvermögens ist am Ende des individuellen Lebens gleich Null, weil es nicht vererbt werden kann. Im Nutzenmaximum sind die mit den Kehrwerten ihrer Preise gewogenen Grenznutzen der einzelnen Aktivitäten in jeder Periode und über die Perioden gleich. Das rationale repräsentative Individuum entwirft derart einen optimalen Lebensplan, und dieser impliziert, daß das Nutzenniveau durch intra- oder intertemporale Substitutionen nicht mehr erhöht werden kann.

Das beschriebene Modell ist nach Erklärung des Verfassers analytisch nicht mehr lösbar. Nach numerischer Spezifikation der Parameter des Optimierungskalküls führt eine Simulation zu den folgenden Ergebnissen. (1) Das repräsentative Individuum dieser Modellwelt wählt eine Schulphase bis zu 17.92 Jahren, eine Arbeitsphase mit ständiger Weiterbildung bis zu 56.46 Jahren, eine Arbeitsphase ohne Weiterbildung bis zu 64.68 Jahren und eine Ruhestandsphase bis zu 75 Jahren. Das geplante Leben zerfällt also in vier klar getrennte Phasen. (2) Das Konsumprofil steigt vom Beginn der Arbeits- bis zum Ende der Ruhestandsphase stetig an, das Arbeitsprofil steigt in der frühen und sinkt in der späten Arbeitsphase, und das Ausbildungsprofil sinkt im Verlauf der Arbeitsphase mit Weiterbildung. (3) Das Arbeitseinkommen je Periode steigt bis zu 40.55 Jahren, und es sinkt dann bis zum Ende der Arbeitsphase. Die Arbeitszeit je Periode dagegen erreicht ihr Maximum mit 21.45 Jahren, der Lohnsatz mit 56.46 Jahren, also am Ende der Arbeitsphase. (4) Das repräsentative Individuum spart in der Schulphase und in der frühen Arbeitsphase negativ, in der späten Arbeitsphase positiv. Die Ersparnis erreicht mit 45.08 Jahren ihr Maximum, und im Alter von 61.91 Jahren ist das Geldvermögen maximal. Das Modell generiert also bei der gegebenen numerischen Spezifikation Einkommens-, Konsum- und Vermögenprofile, die mit den Ergebnissen einschlägiger empirischer Untersuchungen im wesentlichen übereinstimmen.

Der Verfasser untersucht in einem zweiten Schritt, wie sich die nutzenmaximalen Werte der Aktivitäten ändern, wenn sich ein Wirtschaftssubjekt unter sonst gleichen Annahmen darin vom repräsentativen Individuum unterscheidet, daß es eine höhere angeborene Fähigkeit zur Aneignung von Humanvermögen, eine höhere Erstaussattung mit Geldvermögen oder eine niedrigere Präferenz für Freizeit besitzt. Die Ergebnisse: (1) Ein höherer Fähigkeitsindex impliziert unter den getroffenen Annahmen, daß das Individuum eine längere Schulphase, eine höhere durchschnittliche Arbeits-

zeit und einen späteren Beginn des Ruhestands wählt. Das Lebenseinkommen, der Lebenskonsum und das Endvermögen sind höher als beim repräsentativen Individuum. (2) Eine höhere Erstausrüstung mit Geldvermögen impliziert, daß das Individuum eine längere Schulphase, eine niedrigere durchschnittliche Arbeitszeit und einen früheren Beginn des Ruhestandes wählt. Das Lebenseinkommen ist kleiner, der Konsum größer und das Endvermögen kleiner als bei einem repräsentativen Individuum. (3) Eine höhere Freizeitpräferenz impliziert eine kürzere Schulphase, eine niedrigere durchschnittliche Arbeitszeit und einen früheren Beginn des Ruhestandes. Das Lebenseinkommen ist ebenso wie der Lebenskonsum kleiner als beim repräsentativen Individuum. Alle diese Ergebnisse entsprechen Plausibilitätsüberlegungen.

In einem dritten Schritt benutzt der Verfasser das beschriebene Modell zur Simulation der personellen Einkommens- und Vermögensverteilung einer Modellbevölkerung, in der (1) die Fähigkeit zur Aneignung von Humanvermögen und die Freizeitpräferenz normal und die Erstausrüstung mit Geldvermögen lognormal verteilt sind. Damit sind drei Faktoren, die gemeinhin als Ursachen der Ungleichheit in der personellen Verteilung angesehen werden, explizit erfaßt. Für die Modellbevölkerung wählt der Verfasser eine von ihm als realistisch bezeichnete Altersstruktur, und die Individuen werden anhand bestimmter Kriterien zu Zwei-Personen-Haushalten zusammengefaßt. Der Verfasser unterstellt, daß Fähigkeiten, Präferenzen und Erstausrüstung mit Geldvermögen stochastisch unabhängig voneinander verteilt sind. Untersucht werden zunächst Streuung, Schiefe und Wölbung der Periodeneinkommen. Es zeigt sich eine linkssteile Verteilung der Periodeneinkommen mit der gewohnten Reihenfolge und Lage der verschiedenen Mittelwerte. Die Lorenzkurven der simulierten und der empirischen personellen Verteilung der Periodeneinkommen sind fast deckungsgleich. Die Lebenseinkommen – das sind die Barwerte der Periodeneinkommen – sind ebenfalls linkssteil, aber gleichmäßiger als die Periodeneinkommen verteilt. Die Vermögensverteilung ist ungleichmäßiger als die Einkommensverteilung. Dies beruht unter den Modellbedingungen nicht primär auf der Ungleichverteilung der Erstausrüstung mit Geldvermögen, sondern auf der Tatsache, daß sich die Individuen im Alter unterscheiden und sich darum auf verschiedenen Punkten ihres Vermögensprofils befinden. Eine Alternativrechnung hat zum Ergebnis, daß Altersunterschiede 56.3%, Unterschiede in der Erstausrüstung mit Geldvermögen 19.4%, unterschiedliche angeborene Fähigkeiten 14.6% und unterschiedliche Präferenzen 9.7% der Konzentration der Arbeitseinkommen der einzelnen Perioden erklären. Anders bei der Verteilung der Lebenseinkommen. Hier rühren 56.1% der Konzentration aus Unterschieden in der Erstausrüstung mit Geldvermögen, 22.2% aus Unterschieden in den angeborenen Fähigkeiten und 21.7% aus unterschiedlichen Präferenzen. Dies einfach darum, weil die konstante Altersstruktur der Modellbevölkerung unter den getroffenen Annahmen keinen Einfluß auf die Verteilung der Lebenseinkommen hat.

In einem fünften und letzten Schritt untersucht der Verfasser im Rahmen des beschriebenen Modells den Einfluß einer proportionalen Lohn-, Zins-, Konsum- und Vermögenssteuer auf die nutzenmaximalen intra- und intertemporalen Dispositionen der repräsentativen Individuen. Aufkommensgleiche Steuern unterscheiden sich bei gleichem Einkommenseffekt je nach Bemessungsgrundlage durch ihren Substitutionseffekt. Alle genannten Steuern beeinflussen die Allokation von Arbeit und Kapital und damit die personelle Einkommens- und Vermögensverteilung.

Hat der Verfasser also den im Titel des Buchs formulierten Anspruch, eine mikroökonomische Theorie der personellen Einkommens- und Vermögensverteilung vorzulegen, eingelöst? Sicherlich nicht, wenn man den Text an den zu Beginn dieser Rezension formulierten Anforderungen mißt, die an eine allgemeine Theorie der personellen

Verteilung zu stellen wären. Denn diese müßte nicht nur die nutzenmaximalen Dispositionen der Haushalte, sondern auch die gewinnmaximalen Dispositionen der Unternehmungen und das Zusammenwirken beider auf Arbeits-, Güter- und Kapitalmarkt erklären. Eine solche Theorie hätte personelle und funktionelle Verteilung zugleich zu bestimmen. Im beschriebenen Modell dagegen wird allein der Optimierungskalkül der Haushalte beschrieben. Die Ergebnisse der Simulationen sind darum nur vorläufiger Natur. Sie gelten unter der Annahme, daß sich die Optimalpläne im Markt durchsetzen lassen. Es wird also keine komplette Theorie der personellen Einkommens- und Vermögensverteilung, sondern eine Theorie der für die personelle Verteilung relevanten Haushaltsdispositionen vorgestellt und damit nur einer von mehreren Bausteinen einer entsprechenden Verteilungstheorie. Dies räumt der Verfasser freilich in seinen Schlußbemerkungen selbst ein, und darum sollte man nicht allzu sehr auf diesem Punkt herumreiten. Die Auffassung des Verfassers, der gewählte Modellrahmen sei so komplex, daß eine analytische Lösung ausscheide, vermag der Rezensent nicht zu teilen. Die in den letzten Jahren entwickelte und im vorliegenden Text zur Gänze ignorierte Theorie temporärer Gleichgewichte demonstriert, daß Mehr-Perioden-Optimierungskalküle von Haushalten wie Unternehmungen und ihre Koordination auf Arbeits-, Güter- und Kapitalmarkt durchaus analytisch bewältigt werden können. Die Simulationen des Verfassers liefern freilich völlig unabhängig davon hochinteressante Ergebnisse, ob ein anderer methodischer Weg gangbar war oder nicht. Jedenfalls beeindruckt die Übereinstimmung der meisten Simulationsergebnisse mit denen einschlägiger empirischer Untersuchungen auch dann noch, wenn man weiß, daß die numerischen Werte einem gewissen Tuning unterworfen wurden. Die Lektüre dieses Buches vermittelt jedem, der sich für verteilungstheoretische und -politische Zusammenhänge interessiert, mit Sicherheit Gewinn. Dies auch darum, weil es flüssig, leicht lesbar und ohne verbale und analytische Schnörkel geschrieben ist.

G. Schmitt-Rink, Bochum