

Schips, Bernd

**Working Paper**

## Empirische Wirtschaftsforschung im Spannungsfeld zwischen Theorie und Politik

KOF Working Papers, No. 57

**Provided in Cooperation with:**

KOF Swiss Economic Institute, ETH Zurich

*Suggested Citation:* Schips, Bernd (2002) : Empirische Wirtschaftsforschung im Spannungsfeld zwischen Theorie und Politik, KOF Working Papers, No. 57, ETH Zurich, KOF Swiss Economic Institute, Zurich

This Version is available at:

<https://hdl.handle.net/10419/50868>

**Standard-Nutzungsbedingungen:**

Die Dokumente auf EconStor dürfen zu eigenen wissenschaftlichen Zwecken und zum Privatgebrauch gespeichert und kopiert werden.

Sie dürfen die Dokumente nicht für öffentliche oder kommerzielle Zwecke vervielfältigen, öffentlich ausstellen, öffentlich zugänglich machen, vertreiben oder anderweitig nutzen.

Sofern die Verfasser die Dokumente unter Open-Content-Lizenzen (insbesondere CC-Lizenzen) zur Verfügung gestellt haben sollten, gelten abweichend von diesen Nutzungsbedingungen die in der dort genannten Lizenz gewährten Nutzungsrechte.

**Terms of use:**

*Documents in EconStor may be saved and copied for your personal and scholarly purposes.*

*You are not to copy documents for public or commercial purposes, to exhibit the documents publicly, to make them publicly available on the internet, or to distribute or otherwise use the documents in public.*

*If the documents have been made available under an Open Content Licence (especially Creative Commons Licences), you may exercise further usage rights as specified in the indicated licence.*

**K O F**

Konjunkturforschungsstelle  
Swiss Institute for  
Business Cycle Research

# Arbeitspapiere/ Working Papers

Bernd Schips

Empirische Wirtschaftsforschung  
im Spannungsfeld zwischen Theorie  
und Politik

Nr. 57, Juni 2002

**ETH**

Eidgenössische Technische Hochschule Zürich  
Swiss Federal Institute of Technology Zurich



# Empirische Wirtschaftsforschung im Spannungsfeld zwischen Theorie und Politik <sup>1</sup>

Bernd Schips

Konjunkturforschungsstelle der  
Eidgenössischen Technischen Hochschule Zürich  
(KOF ETH)

---

<sup>1</sup> Vorläufiges Manuskript zu einem Vortrag an der Jahrestagung der Schweizerischen Gesellschaft für Volkswirtschaft und Statistik am 31.5./1.6.2002 in Neuenburg. Jochen Hartwig und Michael Graff haben den Text kritisch gelesen und eine Reihe von Verbesserungsvorschlägen eingebracht. Eine allfällige Kritik an den Ausführungen sollte aber allein an den Autor gerichtet werden.



## Empirische Wirtschaftsforschung im Spannungsfeld zwischen Theorie und Politik<sup>2</sup>

Praktisch jeden Tag trifft die Politik Entscheidungen mit - häufig sogar weitreichenden - direkten oder indirekten wirtschaftlichen Konsequenzen, ohne jedoch wissenschaftlich arbeitende Ökonomen - die man doch gemeinhin als die Speerspitze des wirtschaftswissenschaftlichen Sachverständigen betrachtet - in die Entscheidungsvorbereitung und -findung wirklich einzubeziehen. Entweder werden diese Ökonomen gar nicht mehr gefragt oder ihre Meinung wird nur dann noch zur Kenntnis genommen, wenn damit die bereits vorab eingenommenen Positionen der politischen Entscheidungsträger und Interessensgruppen im Prinzip bestätigt werden können. Äussern sich die Ökonomen dann und wann einmal ungefragt zu (gesamt-)wirtschaftlichen Problemen, dann werden ihre Stellungnahmen nicht selten als mehr oder weniger weltfremd etikettiert und damit für die anstehenden Entscheidungen als irrelevant betrachtet.

Die im universitären Bereich wirkenden Ökonomen haben natürlich diese Entwicklung registriert und - zumindest teilweise - mit einer kritischen Selbstreflexion begonnen. So hat z.B. Bruno S. Frey vor knapp zwei Jahren in einem Beitrag die Frage nach dem tatsächlichen Einfluss der Volkswirtschaftslehre auf Wirtschaft und Gesellschaft aufgeworfen<sup>3</sup>. Frey sieht die Hauptursache dieser unerfreulichen Tendenz in Form einer zunehmenden Geringschätzung der wirtschaftswissenschaftlichen Sachkompetenz durch die Politik vor allem darin, dass sich die als Wissenschaftler verstehenden Ökonomen - und dabei insbesondere die Vertreter der Teildisziplin "Volkswirtschaftslehre" - immer mehr auf eine Analyse formaler und selbst-definierter Probleme zurückziehen. Die aus einer solchen "Selbstbeschränkung" resultierenden Arbeiten seien daher mehrheitlich nicht mehr für die von der Politik und Gesellschaft tatsächlich gestellten ökonomischen Fragen relevant. Die Forschungsarbeiten müssten nur noch den im bestehenden Wissenschaftsdiskurs üblichen

---

<sup>2</sup> Vorläufiges Manuskript zu einem Vortrag an der Jahrestagung der Schweizerischen Gesellschaft für Volkswirtschaft und Statistik am 31.5./1.6.2002 in Neuenburg. Jochen Hartwig und Michael Graff haben den Text kritisch gelesen und eine Reihe von Verbesserungsvorschlägen eingebracht. Eine allfällige Kritik an den Ausführungen sollte aber allein an den Autor gerichtet werden.

<sup>3</sup> Vgl. B.S. Frey, Was bewirkt die Volkswirtschaftslehre?, in: Perspektiven der Wirtschaftspolitik, 1 (2000), S. 5-33.

intellektuellen Standards genügen, um so nachzuweisen, dass die Verfasser die Fähigkeit für die Lehre und Forschung im universitären Bereich besitzen. Bei einem Festhalten an dieser grundsätzlichen Orientierung sei deshalb sogar ein noch weiter zunehmender Bedeutungsverlust der Ökonomen im wirtschaftspolitischen - aber auch im allgemeinen gesellschaftlichen - Diskurs nicht auszuschliessen.

In Anmerkungen zu dem genannten Beitrag von Frey hat L. Wilhelm Weber<sup>4</sup>, aus Sicht eines lange Jahre in die Wirtschaftspolitik der Bundesrepublik Deutschland (BRD) eingebundenen Ministerialbeamten, allerdings eine Reihe von Beispielen genannt, bei denen sich wissenschaftlich arbeitende Ökonomen trotz dieser tendenziellen Entwicklung doch noch den wirtschaftspolitischen Herausforderungen gestellt haben und es zu fruchtbaren Interaktionen zwischen Wissenschaft und Politik gekommen ist. Auch für die Schweiz lassen sich m.E. durchaus einige, wenn gleich wenige Beispiele für die Einbeziehung nicht selbst politisch aktiver Ökonomen in die wirtschaftspolitische Entscheidungsfindung benennen.

Weber weist aufgrund seiner Erfahrungen aber auch auf einige Ansatzpunkte für eine "Besserung" des Verhältnisses zwischen Volkswirtschaftslehre und Politik hin. Auf der Seite der nach Problemlösungen fragenden Politik sollte die Bereitschaft zur Sachdiskussion unbedingt wieder gestärkt werden. Eine unzureichende bzw. gänzlich fehlende Sachdiskussion vermindert nicht nur das intellektuelle Niveau der politischen Entscheidungsfindung, sondern bietet auch den potentiellen Anbietern volkswirtschaftlicher Beratung keinen besonderen Anreiz, sich bei der Suche nach einer Problemlösung besonders anzustrengen. Wenn etablierte Gremien mit ökonomischem Sachverstand - man denke dabei z.B. an die Kommission für Konjunkturfragen (KfK) in diesem Lande - bei der Suche nach Lösungen für gesamtwirtschaftliche Probleme von Regierung und Parlament regelmässig übergangen werden, darf man sich auch nicht wundern, dass sich die Begeisterung für die Mitarbeit in solchen Gremien seitens der wissenschaftlich arbeitenden Ökonomen in Grenzen hält.

Die wirtschaftswissenschaftlichen Fakultäten andererseits sollten nach Weber bereits im Studium die Fähigkeiten für eine umfassende ökonomische Lageanalyse vermitteln. Dazu

---

<sup>4</sup> Vgl. L. W. Weber, Anmerkungen aus wirtschaftspolitischer Praxis zu Bruno S. Frey "Was bewirkt die Volkswirtschaftslehre?", in: Perspektiven der Wirtschaftspolitik, 3 (2002), S. 117-123.

gehört neben dem Transfer des erforderlichen methodischen Wissens vor allem auch die Offenlegung der Grenzen der in der Ausbildung und in der Forschung gegenwärtig hauptsächlich verwendeten Modelle der Wirtschaftstheorie. Ein Anliegen, das an und für sich selbstverständlich sein sollte, aber erfahrungsgemäss vielfach nicht gebührend Beachtung findet.

Wolfgang Franz, der selbst einige Jahre dem Sachverständigenrat zur Begutachtung der gesamtwirtschaftlichen Entwicklung in der BRD angehörte und heute eines der angesehensten Wirtschaftsforschungsinstitute in Deutschland präsidiert, ist in Bezug auf die Erfolge in der Beratung der Politik durch die Wirtschaftswissenschaft ebenfalls weniger skeptisch als Frey, benennt aber doch einige Punkte, die einer höheren Akzeptanz des ökonomischen Sachverständes in wirtschaftspolitischen Entscheidungsprozessen entgegenstehen<sup>5</sup>. Dazu gehört vor allem die auf beiden Seiten, d.h. von Politik und Wirtschaftswissenschaft, häufig mangelnde Wahrnehmung des ständigen und unvermeidlichen Konfliktes zwischen den - trotz aller Fortschritte in der Modellierungstechnik - notwendigen Vereinfachungen in der ökonomischen Theorie und der für die Erarbeitung einer problemgerechten Lösung erforderlichen Berücksichtigung der wirtschaftlichen Fakten und institutionellen Gegebenheiten<sup>6</sup>.

In der wirtschaftswissenschaftlichen Literatur, aber leider auch in der Lehre, erhalten, mit sehr speziellen Annahmen operierende Modelle - deren praktische Relevanz meistens nicht sonderlich bedeutsam ist - ein viel zu grosses Gewicht. Franz nennt dazu als ein Beispiel die vielfach - und mit an sich auf einen ersten Blick recht überzeugenden Argumenten - eingeforderte konsequente Mikrofundierung makroökonomischer Beziehungen. Er weist zu Recht darauf hin, dass es schwierig ist, eine fallende aggregierte Nachfrage aus möglichst allgemeinen Annahmen ohne einschränkende Restriktionen über die individuellen Präferenzstrukturen und deren Verteilung herzuleiten. Aber diese grundsätzliche Schwierig-

---

<sup>5</sup> Vgl. W. Franz, Wirtschaftspolitische Beratung: Reminiszenzen und Reflexionen, in: Perspektiven der Wirtschaftspolitik, 1 (2000), S. 53-71.

<sup>6</sup> Wolfgang Franz weist in diesem Zusammenhang auf einen Beitrag von Anne O. Krueger hin; Vgl. A.O. Krueger, The use and misuse of theory in the transfer process, in: E. Mohr (Hrsg.), The transfer of economic knowledge, Cheltenham 1999, S. 32-44, hin.



keit schliesst beileibe nicht aus, dass in gesamtwirtschaftlichen Analysen mit einer derartigen Hypothese operiert werden kann. Konsumenten kaufen bei steigenden Preisen weniger von einem bestimmten Gut, zumindest ist diese Feststellung, trotz einer Reihe von hinlänglich bekannten Ausnahmen, in der Mehrheit der Fälle beobachtungsäquivalent. Die entscheidende Frage ist daher immer die nach dem Ausmass der jeweils notwendigen theoretischen Klärung und ausreichenden empirischen Fundierung. "Solange ausgeschlossen werden kann, dass ökonomische Prozesse vornehmlich rein stochastischer Natur sind oder von chaotischem Verhalten dominiert werden, können eine Reihe beobachteter Regelmässigkeiten, selbst wenn sie theoretisch nicht (oder noch nicht) befriedigend erklärt sind, durchaus als vernünftige Grundlage für wirtschaftspolitische Entscheidungen dienen"<sup>7</sup>.

Dieser dezidierten Aussage von Franz ist höchstens noch hinzufügen, dass auf sehr speziellen Modellannahmen beruhende Ergebnisse nicht unbesehen zur Grundlage wirtschaftspolitischer Entscheidungen gemacht werden dürfen, auch wenn diese Modellkonstruktionen dem in der ökonomischen Literatur gerade dominierenden Zeitgeist (mainstream economics) entsprechen sollten. Dies gilt heutzutage insbesondere für viele der sogenannten mikrofundierten Makromodelle (New classical macroeconomics), bei denen (konzeptionell bedingt) die real existierenden Probleme per Definition weitgehend ausgeschlossen sind.

Diese kritische Selbstreflexion der Ökonomen ist aber nicht auf den deutschsprachigen Raum beschränkt. So erschien z.B. unter dem bezeichnenden Titel "The decline of economics" bereits 1996 ein Beitrag von John Cassidy<sup>8</sup>, in dem namhafte Ökonomen, wie z.B. Alan Blinder, Robert E. Lucas, Joseph Stiglitz, Greg Mankiw u.a. eine äusserst kritische Haltung zum gegenwärtigen Zustand der eigenen Disziplin erkennen liessen. William Vickrey brachte diese Einschätzungen zur Relevanz der Ökonomie für die Lösung (gesamt-)wirtschaftlicher Probleme folgendermassen auf den Punkt: "... a good deal of modern economic theory, even the kind that wins Nobel Prizes, simply doesn't matter much"<sup>9</sup>.

---

<sup>7</sup> Vgl. W. Franz, Wirtschaftspolitische Beratung: Reminiszenzen und Reflexionen, a.a.O., S. 62.

<sup>8</sup> Vgl. J. Cassidy, The decline of economics, in: The New Yorker, December 2, 1996, S. 50-60.

<sup>9</sup> Zitiert nach J. Cassidy, The decline of economics, a.a.O., S.50.

Die Gründe für den abnehmenden Einfluss der Wirtschaftswissenschaft in den wirtschaftspolitischen Entscheidungsprozessen sind zugegebenermassen äusserst vielschichtig. Nicht so bedeutend, wie oft unterstellt, ist allerdings der viel zitierte und auch ebenso oft strapazierte Hinweis darauf, dass zwei oder mehr Ökonomen auf ein und dieselbe Frage selten eine eindeutige Antwort geben. In der Regel differieren die Antworten auf die Fragen der Politik und die Lösungsvorschläge für korrekt erfasste wirtschaftliche Probleme gar nicht so sehr, wie häufig der Anschein erweckt wird. Der vermeintliche Dissens der Ökonomen bezieht sich in den meisten Fällen nur auf unterschiedliche Einschätzungen bezüglich der quantitativen Grössenordnungen und deren Fristigkeit<sup>10</sup>.

Das Hauptproblem für die relativ geringe Beachtung des wirtschaftswissenschaftlichen Sachverstandes in den wirtschaftspolitischen Entscheidungsprozessen ist m.E. die mangelnde empirische Analyse der zu lösenden Probleme und die häufig unzureichende empirische Fundierung der von den Ökonomen vorgetragenen Lösungsansätze. Die Politik stellt in der Regel höchst komplexe Fragen, erwartet aber meist einfache Antworten, die zudem möglichst rasch erarbeitet werden sollten. Die ökonomische Theorie gibt oft vor, solche einfache Antworten zu kennen. Die Realitätsferne der den erteilten Ratschlägen zugrundegelegten Modelle wird dabei jedoch nicht immer ausreichend beachtet.

Die intellektuelle Faszination, die von den immer raffinierter werdenden Modellkonstrukten ausgeht, lässt die Ökonomen oft die notwendige kritische Reflexion der empirischen Relevanz der gemachten Annahmen vergessen. Die rasanten Fortschritte in der Leistungsfähigkeit der Rechner, die Entwicklung von Optimierungsverfahren für intertemporale Fragestellungen und die Verfügbarkeit numerischer Methoden für die nicht oder nicht ohne weiteres analytisch (d.h. geschlossen) zu lösenden Probleme usw. verführen zur Suche nach noch nicht bearbeiteten Konstellationen, meist in Form einer Kombination von realitätsfernen Annahmen. Hinzu kommt nicht selten auch ein gewisser ideologischer "Bias".

Die Ergebnisse solcher Arbeiten finden aber dennoch oft Anklang, insbesondere wenn diese mit einer als "empirisch" deklarierten Untersuchung ergänzt werden und dazu dienen können, die aufgrund politischer Positionsbezüge bereits vorgefassten Meinungen zu bestätigen. Dies gilt z.Zt. insbesondere für die Resultate, die aus makroökonomischen

---

<sup>10</sup> Vgl. auch W. Franz, Wirtschaftspolitische Beratung: Reminiszenzen und Reflexionen, a.a.O., S. 61.

Modellen mit permanenter Markträumung, exogen vorgegebenem Wachstumspfad, usw. abgeleitet werden (z.B. Real business cycle-Modelle, Berechenbare Gleichgewichtsmodelle). Da hier die Anpassungsreaktionen auf Politikentscheide natürlich praktisch keinen Einfluss auf die längerfristige Entwicklung haben, dienen solche Modellanalysen zur Rechtfertigung aller möglichen wirtschafts-, finanz- und sozialpolitischer Eingriffe in das Wirtschaftsgeschehen und erfreuen sich deshalb besonderer Beliebtheit bei den Entscheidungsträgern auf beiden Seiten des politischen Spektrums, wenn auch aus unterschiedlichen Interessenslagen. Spätere Enttäuschungen bleiben aber dann nicht aus, und die Ökonomie wird so in der Politik weiter an Reputation verlieren.

In diesem Zusammenhang ist noch anzumerken, dass erstaunlicherweise die aus wirtschaftspolitischer Sicht an sich viel interessanteren Ergebnisse von konsequent dynamisch konzipierten Gleichgewichtsmodellen, bei denen der langfristige Wachstumspfad nicht vorgegeben, sondern z.B. vom durch die Ausgestaltung des Steuersystems beeinflussten Verhalten der Konsumenten und Investoren abhängig gemacht wird, noch kaum beachtet werden<sup>11</sup>. Grundsätzliche Überlegungen zur Abhängigkeit des Wirtschaftswachstums von der Wahl der Steuerbasis - Einkommen oder Konsum - oder zu den Effizienzverlusten aufgrund einer via Steuerpolitik vorgenommenen Umverteilung anstelle einer ausgaben-seitigen Verfolgung der jeweiligen sozialpolitischen Ziele usw. bleiben weitgehend auf die wissenschaftsinterne Diskussion beschränkt und bilden nur selten die Ausgangsbasis für einschlägige Untersuchungen bzw. Kernpunkte empirisch fundierter wirtschaftspolitischer Empfehlungen.

Immer wieder muss man feststellen, dass ein auf den zwangsläufig äusserst vereinfachenden Modellen der ökonomischen Theorie basierendes Vorverständnis ohne ausreichende empirische Fundierung die Ratschläge der Ökonomen an die (Wirtschafts-)Politik dominiert. Um möglichen Einwänden zu dieser Feststellung gleich vorzubeugen, ist daran zu erinnern, dass z.B. die Schätzung von "geeignet" gewählten Regressionsbeziehungen noch nicht zwangsläufig eine empirische Fundierung bedeutet. Zu denken ist in diesem Kontext etwa an die sogenannte Signifikanztestfalle. In aller Regel wird ein geschätztes Modell nur dann präsentiert, wenn es den gängigen statistischen Prüfkriterien genügt. Dazu gehört ins-

---

<sup>11</sup> Vgl. z.B. D.W. Jorgenson, K.-Y. Yun, Lifting the burden: fundamental tax reform and economic growth, in: National Bank of Belgium, Working papers. Research series, No. 21, 2002.

besondere, dass die geschätzten Koeffizienten auf einem bestimmten Testniveau als von Null verschieden betrachtet werden dürfen. Nicht-signifikante Ergebnisse werden üblicherweise gar nicht veröffentlicht. Übersehen wird dabei aber häufig, dass das letzten Endes für die Ableitung der ökonomischen Befunde verwendete und präsentierte Modell in den meisten Fällen das Resultat eines oft langwierigen "Trial and error"-Prozesses ist und damit die Wahrscheinlichkeit, einen Fehler zweiter Art zu begehen - d.h. eine zu überprüfende Hypothese zu akzeptieren, obwohl diese falsch ist - schon bei wenigen aufeinanderfolgenden Signifanztests gegen Eins geht.

Anschauliche Beispiele für den Verzicht auf detaillierte empirische Abklärungen finden sich in der jüngeren schweizerischen Wirtschaftsgeschichte genügend. Viele Jahre war z.B. die Geldpolitik auf das Ziel einer am Landesindex der Konsumentenpreise (LIK) gemessenen Null-Teuerung fixiert. Einwände, dass mit diesem Verständnis von Geldwertstabilität der tatsächlichen Preisentwicklung nicht entsprochen werden kann, weil der sogenannte Laspeyres-Effekt zu einer systematischen Überschätzung der mit dem LIK gemessenen Preisniveauperänderungen führt, wurden nicht zur Kenntnis genommen. (Laspeyres-Effekt: Bei Preisänderungen passen die Konsumenten ihren Warenkorb den veränderten relativen Preisen rasch an, aber die Gewichtung der einzelnen Ausgabenpositionen im Preisindex bleibt über lange Zeit unverändert.) Auch Vorschläge zur Ausklammerung nur temporär wirkender Sonderfaktoren, wie z.B. MwSt.-Saterhöhungen usw., bei der Ermittlung des für die Geldpolitik relevanten Preisanstiegs - d.h. die Berechnung einer sogenannten Kerninflationrate - fanden keine Beachtung. Die Geldpolitik war daher nicht selten über längere Zeitspannen zu restriktiv und führte zu beträchtlichen realwirtschaftlichen Einbussen. Es brauchte den Bericht der Senatskommission unter der Leitung von Michael Boskin in den USA, bis die Probleme bei der Messung von Preisniveauperänderungen bei der Formulierung des geldpolitischen Ziels wieder zur Kenntnis genommen und adäquat berücksichtigt wurden.

Die staatliche Kreditaufnahme wurde - der einschlägigen Literatur unbesehen folgend - lange Zeit mit einem "Crowding-out" privater Investitionen gleichgesetzt, ohne zu berücksichtigen, dass in der Schweiz - im Gegensatz zu den Verhältnissen in den USA - der private Sektor einen chronischen Sparüberhang ausweist, der sich in einem anhaltend hohen Nettokapitalexport niederschlägt. Eine Staatsverschuldung führt natürlich u.U. noch zu ganz anderen Problemen - z.B. zu der Frage nach den Auswirkungen eines damit verbundenen

intergenerationellen Verteilungskonfliktes - aber die Fehleinschätzung der Relevanz des "Crowding out"-Argumentes war nicht selten eine von der Wirtschaftswissenschaft gelieferte Argumentationshilfe für die politische Durchsetzung prozyklisch wirkender Massnahmen zur Konsolidierung der öffentlichen Haushalte. Allzu oft wird leider einfach übersehen, dass sich die Ergebnisse von empirischen Studien nicht ohne zusätzliche Abklärungen von einem Land zu einem anderen übertragen lassen.

Ein weiteres Beispiel für eine nicht ausreichende Auseinandersetzung mit der wirtschaftspolitisch relevanten Fragestellung sind die Vorschläge zur Lösung der Arbeitsmarktprobleme in den neunziger Jahren. Der gängigen ökonomischen Theorie folgend, wurde die Lösung der Beschäftigungsprobleme - nicht nur in der Schweiz - vor allem bzw. allein auf dem Arbeitsmarkt gesucht. Institutionelle Regelungen und eine mangelnde Flexibilität wurden als (Haupt-)Ursachen der Arbeitslosigkeit genannt, obwohl die Zahl und die Qualifikationsstruktur der offenen Stellen und der Stellensuchenden ausreichend Hinweise auf gewichtigere Bestimmungsfaktoren gaben. Aber die vorherrschende Meinung war und ist teilweise immer noch, dass die Unterbeschäftigung ein Phänomen des Arbeitsmarktes ist und die Lösung dieses Problems deshalb auch auf dem Arbeitsmarkt gesucht werden muss. In einem Vortrag im September 1999 am ifo-Institut in München verglich Robert Solow ein solches Bemühen mit der doch recht abwegigen Vorstellung, dass bei einem defekten Autoreifen das Loch immer unten an der flachsten Stelle zu finden sei<sup>12</sup>. Ganz abgesehen davon, dass ein empirischer Nachweis eines Einflusses der Arbeitsmarktregulierung auf die Höhe der Arbeitslosigkeit prinzipiell mit erheblichen Schwierigkeiten behaftet ist, weil diese institutionellen Bedingungen meist auch schon zu Zeiten noch niedriger Arbeitslosigkeit bestanden, zeigen entsprechende aktuelle Untersuchungen, dass zumindest für die Schweiz eine Erklärung der hohen Arbeitslosigkeit in der Mitte der neunziger Jahre mit den bestehenden Arbeitsmarktregelungen praktisch ausgeschlossen werden kann<sup>13</sup>.

Die Dominanz gängigen Lehrbuchwissens in der wirtschaftspolitischen Beratung unter

---

<sup>12</sup> Vgl. dazu auch R. Solow, Unemployment in the United States and in Europe: A contrast and the reasons, in: CESifo Forum, Spring 2000, S. 3-5.

<sup>13</sup> Vgl. S. Nickell, L. Nunziata, W. Ochel und G. Quintini, Why do jobless rates differ?, in: CESifo Forum, Spring 2002, S. 50-59.

Verzicht auf eine eingehende empirische Abklärung ist weit verbreitet und nicht zuletzt auf den häufig grossen Zeitaufwand bei der Erarbeitung einschlägiger Analysen zurückzuführen. Zudem sind die Ergebnisse gründlicher empirischer Arbeiten meist sehr differenziert. Die Politik hat aber oft nicht die Geduld, um eine fundierte Antwort abzuwarten und schätzt in der Regel auch keine Stellungnahmen, die Entscheidungen eher komplizieren, statt zu vereinfachen.

Auch in den USA beginnt man z.B. erst jetzt mit der Aufarbeitung der Beiträge der einzelnen Politikbereiche zu der wirtschaftlichen Blüte in den neunziger Jahren<sup>14</sup>, obwohl nicht wenige ökonomisch-theoretische ad-hoc-Erklärungen schon lange angeboten werden und auch sicherlich bereits einen Einfluss auf wirtschaftspolitische Entscheidungen ausgeübt haben. Noch sind aber eine Reihe von Fragen zu dieser Entwicklung noch weitgehend ungeklärt. Welche Rolle spielte dabei die Konsolidierung des Bundeshaushaltes? Welchen Einfluss hatte die Geldpolitik? Wurde die Haushaltskonsolidierung erst eingeleitet, nachdem eine zinspolitische Honorierung zugesichert worden war? Wie kam es dazu, dass die für die Geldpolitik Verantwortung tragenden Personen und Gremien die damals noch von der Wissenschaft prominent vertretenen NAIRU-Relationen (inflationneutrale Arbeitslosigkeit) ignorierten? Welche Bedeutung hatten exogene Faktoren? usw.

Wissenschaftliches Arbeiten beinhaltet immer auch ein ständiges Infragestellen der bereits bekannten Forschungsergebnisse. Ein Test auf die Robustheit der Aussagen im Popperschen Sinne ist daher ein konstitutives Merkmal einer jeden Wissenschaft mit empirischem Gehalt. Für die wirtschaftspolitische Beratung bedeutet dieser Grundsatz die Notwendigkeit eines sorgfältigen Abwägens aller bekannten Positionen und Aussagen zu einer bestimmten Fragestellung aufgrund von nachvollziehbaren Kriterien<sup>15</sup>. Für die Wirtschaftswissenschaft müsste diese Aufgabe vor allem von der empirischen Wirtschaftsforschung übernommen werden.

---

<sup>14</sup> Vgl. dazu die Literaturangaben in dem Beitrag von Ulrich Heilemann, Wahlen, Wirtschaftspolitik und Glück - Ursachen und Lektionen des Clinton-Aufschwungs 1993 bis 2000, vorläufige Fassung eines Vortrages bei der Jahrestagung des Wirtschaftspolitischen Ausschusses des Vereins für Socialpolitik am 13. März 2002 in Linz.

<sup>15</sup> Vgl. W. Franz, Wirtschaftspolitische Beratung: Reminiszenzen und Reflexionen, a.a.O., S. 68f.

Die empirische Wirtschaftsforschung hat es aber bisher noch nicht einmal geschafft, auf die Problematik einer Verwendung methodenspezifischer Befunde in der theoretischen Diskussion und damit auch in der wirtschaftspolitischen Beratung deutlich hinzuweisen. So wurde z.B. der Beitrag von Granger und Newbold über "Spurious regressions" dankbar aufgegriffen<sup>16</sup>, um mit Hilfe von in ersten Differenzen spezifizierten Schätzansätzen den aus monetaristischer Sicht erwünschten Nachweis der nicht nur lang-, sondern auch kurzfristigen Neutralität von Geldmengenänderungen zu führen. Die realen Effekte von Geldmengenänderungen mussten aber bei solchen Modellspezifikationen zwangsläufig ausbleiben, weil eine derartige Datentransformation ein Filter ist, mit dem die niedrigen Frequenzen, d.h. - im Komponentenmodell gedacht - die Trend- und Zykluskomponente praktisch eliminiert und die kürzerfristigen Bewegungskomponenten, insbesondere die Noise-Komponente, in den dann für die Schätzungen verwendeten Zeitreihen verstärkt wird<sup>17</sup>.

Statt auf derartige methodenbedingte Probleme nachdrücklich hinzuweisen, werden bestimmte Modellkonzeptionen sogar noch begeistert aufgenommen, weil man dadurch neue Betätigungsfelder erhält. Diese Orientierung der empirischen Arbeiten an gerade gängigen Modellkonzeptionen gilt z.B. auch für die Entwicklung einer auf die empirische Analyse allgemeiner Gleichgewichtsmodelle zugeschnittenen numerischen Konkretisierung der Modellparameter. Die Modelle werden dabei so kalibriert, dass die vom Modell erzeugten und die beobachteten Datensätze in den Momenten (Erwartungswerte, Varianzen, usw.) übereinstimmen. Da sich die quantitative Bewertung dieser Modelle auf einen Vergleich der Momente von simulierten und historischen Zeitreihen beschränkt, wird die notwendige "Überprüfung" der "Güte" eines Modells dann aber anhand recht "milder" Maßstäbe vorgenommen. Obwohl eine solche Vorgehensweise schon eine recht lange Tradition hat, - die dynamischen Eigenschaften des Klein-Goldberger-Modells wurden bereits vor vielen

---

<sup>16</sup> Vgl. C.W.J. Granger, P. Newbold, Spurious regressions in econometrics, in: Journal of Econometrics, 2 (1974), S. 111-120.

<sup>17</sup> Vgl. dazu auch B. Schips, Konjunkturforschung heute - Theorie und Empirie: Einige Probleme der empirischen Wirtschaftsforschung - dargestellt am Beispiel der Konjunkturanalyse und -prognose, in: Statistisches Bundesamt, Forum der Bundesstatistik, Bd. 35, Wiesbaden 2000, S. 62-71.

Jahren damit untersucht<sup>18</sup> - bietet diese Methode keine Möglichkeit zur Durchführung formaler statistischer Tests, um zwischen konkurrierenden Modellspezifikationen diskriminieren zu können.

Ein Vergleich von Momenten sagt nur relativ wenig über die Übereinstimmung der zugrundeliegenden Zeitreihen aus. Damit liefert diese Art von "Überprüfung" auch nur einen sehr begrenzten Aufschluss über die "Güte" dieser Modellansätze. Erschwerend kommt hinzu, dass die Vergleiche der geschätzten Momente in der Regel erst nach einer "Trendbereinigung" vorgenommen werden können, welche wiederum Entscheide bezüglich der "Natur" des zu bestimmenden Trends - stochastisch oder deterministisch - und des zu verwendenden Trendfilters voraussetzt. Der Haupteinwand ist jedoch, dass diese Modellansätze keine Störvariablen mit bekannten oder als bekannt unterstellten Verteilungen beinhalten und damit die Möglichkeit zur Konstruktion von geeigneten Signifikanztests entfällt<sup>19</sup>. Man kann lediglich untersuchen, ob die vom Modell erzeugten Daten Eigenschaften aufweisen, die aufgrund der angenommenen Modellstruktur zu erwarten sind<sup>20</sup>.

Was muss man tun, um die Rolle der empirischen Wirtschaftsforschung in Lehre, Forschung und Politikberatung zu stärken? Der wichtigste Ansatzpunkt ist die universitäre Ausbildung. Es gilt vor allem, das Verständnis für die allgegenwärtige Mess- und Aufbereitungsproblematik zu wecken. Der Stellenwert einer Fähigkeit zur detaillierten Deskription der

---

<sup>18</sup> Vgl. I. Adelman, F. Adelman, The dynamic properties of the Klein-Goldberger model, in: *Econometrica*, 27 (1959), S. 596-625.

<sup>19</sup> Angesichts dieser statistisch-methodisch bedingten Schwierigkeiten bei der "Überprüfung" der "Güte" solcher Modelle wird auch vorgeschlagen, die Parameter dieser Modelle mit Hilfe der "General method of moments (GMM)" zu schätzen und dann die Momente der vom so numerisch konkretisierten Modell erzeugten Zeitreihen mit denen der beobachteten Reihen zu vergleichen. Da die Verteilung der GMM-Schätzer approximativ bekannt ist, sind auf dieser Basis zwar approximative Signifikanztests möglich, aber die Macht dieser Tests ist dann relativ gering. Vgl. dazu z.B. L.J. Christiano, M. Eichenbaum, Current real-business-cycle theories and aggregate labor-market fluctuations, in: *American Economic Review*, 82 (1992), S. 346-353.

<sup>20</sup> Vgl. R.G. King, C.I. Plosser, J.H. Stock und M.W. Watson, Stochastic trends and economic fluctuations, in: *American Economic Review*, 81 (1991), S. 819-840.



wirtschaftlichen Abläufe und der zu beobachtenden Zusammenhänge sollte wieder gesehen werden. Die Vermittlung der in den wirtschaftstheoretischen Diskussionen gebrauchten Modelle muss unbedingt mit einer Diskussion des Realitätsbezuges der dabei jeweils zugrundegelegten Annahmen, sowie des empirischen und ideologischen Gehalts, ergänzt werden. Die Gewichtung von Theorie und Empirie in der Ausbildung sollte wieder den Anforderungen einer empirischen Disziplin, wie der Wirtschaftswissenschaft, entsprechen.

Kenntnisse in den Modellierungstechniken und in statistischen Methoden sind dabei die eine Seite, die inhärenten Grenzen eines Modells und das Wissen um die Voraussetzungen zur Anwendung eines bestimmten statistischen Verfahrens bilden die andere - zumindest ebenso wichtige - Seite im Programm zur Ausbildung von Ökonomen. Ohne detaillierte Kenntnisse der bei der Erstellung wirtschaftsstatistischer Konstrukte zur Anwendung kommenden Abgrenzungen, Messkonzepte und Berechnungssystematiken ist eine fundierte Analyse des wirtschaftlichen Geschehens nicht vorstellbar.

Es ist auch nicht unbedingt zielführend, wenn in der Statistikausbildung praktisch nur Schätz- und Testverfahren behandelt werden, die auf Zufallsstichproben basieren und die für die Praxis weit wichtigeren Verfahren, die keine solchen (restriktiven) Voraussetzungen erfordern, ein Schattendasein fristen, wenn sie überhaupt zur Sprache kommen. Ähnliches gilt für die Vermittlung ökonometrischer Methoden. Asymptotisch gerechtfertigte Schätz- und Testverfahren beanspruchen den meisten Raum, obwohl der Nachweis der gewünschten asymptotischen Eigenschaften (z.B. Konsistenz) immer die Identifizierbarkeit und damit die Kenntnis der "wahren" Struktur des abzubildenden Phänomens voraussetzt. Aber auch die ausgeklügeltesten Modelle sind nur mehr oder weniger gute Approximationen des realen Geschehens, mit denen versucht wird, ganz bestimmte und gerade interessierende Charakteristika zu erfassen.

Lineare (strukturelle) Modelle werden intensiv behandelt, in der Praxis sind die meisten Modelle aber nicht linear usw. Dafür wird über die Eigenschaften gebräuchlicher Datentransformationen - z.B. die Berechnung von Differenzen oder von Zuwachsraten usw. - oft kein Wort verloren. Die immer wieder zu beobachtende weitgehend unkritische Reflexion statistischer Daten bei der Kommentierung des Wirtschaftsgeschehens - auch durch Wirtschaftswissenschaftler und nicht nur durch Medienvertreter oder Politiker - weist auf die diesbezüglich bestehenden Defizite deutlich hin. Über die Qualität der offerierten Daten

macht man sich nur selten Gedanken.

Es wird z.B. nicht registriert, dass die Zeitreihe der saisonbereinigten Ausrüstungsinvestitionen der Quartalsschätzungen des Staatssekretariats für Wirtschaft (seco) noch ein ausgeprägtes Saisonmuster ausweist, obwohl diese Daten ständig für eine Beurteilung der wirtschaftlichen Lage verwendet und entsprechend kommentiert werden. Auch die aus ökonomischer Sicht praktisch nicht zu erklärende zunehmende Divergenz zwischen sachlich korrespondierenden, aber von verschiedenen Datenproduzenten - Oberzolldirektion (OZD) und Bundesamt für Statistik (BFS) - stammenden Zeitreihen von Exportmittelwert- und Produzentenpreisindizes bleibt unbeachtet usw.

Gerade in den letzten Jahren haben mancherorts weitgehend unkritisch vorgenommene Vergleiche und Interpretationen von gesamtwirtschaftlichen Wachstumsraten zu vorschnell getroffenen Folgerungen und wirtschaftspolitischen Empfehlungen geführt. Die möglichen Auswirkungen von Unterschieden in den Systemen für die Volkswirtschaftliche Gesamtrechnung (VGR), abweichende Deflationierungspraktiken usw. wurden oft zunächst nicht beachtet. Kaum registriert wurde, dass die Verwendung hedonischer Modelle zur Erfassung von qualitativen Veränderungen anstelle eines "Matched-model"-Ansatzes nicht nur bei Preisindizes, sondern auch bei Vergleichen von Kaufkraftparitäten und Produktivitätsentwicklungen u.U. eine wesentliche Rolle spielt. Selbst bekannte strukturelle Unterschiede bei den zu vergleichenden Volkswirtschaften oder bestehende Segmentierungen in binnen- und exportorientierte Bereiche bleiben nicht selten unbeachtet. Generelle Produktivitätsdefizite der Schweiz werden beklagt, obwohl die Exporte von Waren und Dienstleistungen absolut und anteilmässig von Jahr zu Jahr zulegen. Dies ist ein Befund, der doch eindeutig auf die Wettbewerbs- und damit auch Produktivitätsvorteile der exportierenden Unternehmen hinweist. Auf der anderen Seite nimmt die internationale Wettbewerbsfähigkeit der Unternehmen in den USA, trotz der für die letzten Jahre statistisch ausgewiesenen aussergewöhnlich hohen Produktivitätsfortschritte, laufend ab. Die USA exportieren anteilmässig immer weniger und importieren immer mehr hochwertige Güter, insbesondere aus Ländern mit vergleichsweise höheren Arbeitskosten. Dieses Beispiel zeigt noch einmal auf, wie differenziert in der Regel gesamtwirtschaftliche Befunde zu betrachten sind und wie zurückhaltend die Wirtschaftswissenschaftler bei der theoretischen Erklärung der meist nur impressionistisch gewonnenen Eindrücke vom realen ökonomischen Geschehen sein sollten.

Um den Wirtschaftswissenschaften wieder den diesen an und für sich zukommenden Platz in der Politikberatung zu ermöglichen, muss daher vor allem mehr für die Sicherung der Kontinuität in der empirischen Forschung getan werden. Es darf nicht erst mit einer Lageanalyse begonnen werden, wenn ein Problem bereits zur Entscheidung ansteht. Eine laufende Beobachtung des wirtschaftlichen Geschehens, eingebettet in eine (möglichst) vorurteilsfreie Reflexion der theoretischen Erklärungsversuche, sollte zur Selbstverständlichkeit werden. Die dafür verfügbaren Ressourcen sollten gebündelt und Synergien gesucht werden. Dazu gehört auch eine verstärkte Kooperation der Datenproduzenten. Es braucht nicht unbedingt mehr Wirtschaftsstatistik, aber eine Überprüfung der Prioritäten und eine Verbesserung der Nutzung der bereits bestehenden Erhebungen. Wer mit öffentlichen Mitteln Daten erhebt und/oder aufbereitet, sollte verpflichtet werden, diese Datensätze auch anderen Anwendern zur Verfügung zu stellen, was natürlich das Vorhandensein geeigneter Metadaten voraussetzt. Doppelspurigkeiten, Inkonsistenzen zwischen verschiedenen Erhebungen bzw. Aufbereitungen usw. lassen sich nur so weitgehend vermeiden.

Es gibt also eine Reihe von Ansatzpunkten, um die Rolle der Wirtschaftswissenschaft in der Wirtschaftspolitik wieder zu stärken. Viel wird jedoch davon abhängen, welche Bedeutung der empirischen Wirtschaftsforschung im strengen Sinne - vor allem in der Lehre, aber auch in der Forschung - in Zukunft dabei zugemessen und zugestanden wird.

Zürich, den 30.5.2002