

FORSCHUNGSBERICHTE DES LANDES NORDRHEIN-WESTFALEN

Nr. 2002

Herausgegeben im Auftrage des Ministerpräsidenten Heinz Kühn
von Staatssekretär Professor Dr. h. c. Dr. E. h. Leo Brandt

DK 338.972.3

Dr. rer. pol. Dieter Smolinski

*Stiftung Institut für Mittelstandsforschung
an den Universitäten zu Köln und Bonn, Konjunkturabteilung
Direktor : Prof. Dr. M. Ernst Kamp*

**Bedeutung eines Diagnose- und Prognosemodells
(MIDI-Verfahren)
für Wirtschafts- und Finanzpolitik**



WESTDEUTSCHER VERLAG · KÖLN UND OPLADEN 1968

ISBN 978-3-663-00428-8 ISBN 978-3-663-02341-8 (eBook)
DOI 10.1007/978-3-663-02341-8

Verlags-Nr. 012002

© 1968 by Westdeutscher Verlag GmbH, Köln und Opladen

Gesamtherstellung: Westdeutscher Verlag

Vorwort

Die vorliegende Arbeit ist im Rahmen eines von mir geleiteten Forschungsvorhabens entstanden, das die »Untersuchung und Analyse der wirtschaftlichen Entwicklungsproblematik mit dem Ziel einer Erweiterung der Einsicht in die Grundsätze und Richtlinien für die praktische Wirtschafts- und Finanzpolitik« zum Gegenstand hat. Die Aufgabe der Arbeit war es, das gleichfalls unter meiner Leitung und Verantwortung entstandene univariable Diagnose- und Prognosemodell (MIDI-Verfahren) ökonomisch zu interpretieren, seine Anwendung als Instrument der Wirtschafts- und Finanzpolitik darzulegen und seine instrumentelle Bedeutung grundsätzlich abzuwägen. Damit erfüllt diese Arbeit nicht nur den Zweck, meine abschließende Ergebnisberichterstattung über das Forschungsvorhaben zu erleichtern, indem ein abgeschlossener Teil vorab publiziert wird, sondern sie ergänzt eine gleichfalls als Teilergebnis vorgelegte Arbeit von B. KORTE und W. OBERHOFER (Ein univariablen ökonomisches Analyse- und Prognosemodell) über den mathematischen Gehalt des MIDI-Verfahrens im ökonomischen Problem-bereich. Beide Teilergebnisse aus meiner mehrjährigen Forschungsarbeit übergebe ich in der zweiten Jahreshälfte 1968 zur Veröffentlichung.

Ferner möchte ich anmerken, daß die vorliegende Arbeit der Rechts- und Staatswissenschaftlichen Fakultät der Rheinischen Friedrich-Wilhelms-Universität, Bonn, als Dissertation eingereicht und mit »summa cum laude«, d. h. mit der höchsten überhaupt zu vergebenden Note bewertet werden konnte. Die Arbeit ist von ihrem Verfasser unter meiner Leitung angelegt und durchgeführt worden; für die in ihr enthaltenen wissenschaftlichen Aussagen und Ergebnisse kann ich meine voll verantwortliche Zustimmung geben.

Abschließend bleibt mir die angenehme Pflicht, dem Ministerpräsidenten des Landes Nordrhein-Westfalen – Landesamt für Forschung – für die Förderung meines Forschungsvorhabens und die finanzielle Unterstützung bei der Publikation der bisherigen Ergebnisse zu danken.

Bonn, im August 1968

M. E. KAMP

Inhalt

Vorbemerkungen zur Entwicklung eines univariablen ökonomischen Diagnose- und Prognosemodells (MIDI-Verfahren)	7
<i>1. Teil</i>	
Das univariable Diagnose- und Prognosemodell (MIDI-Verfahren) und die Grund- anliegen der Wirtschafts- und Finanzpolitik mit gesamtwirtschaftlichen Zielsetzungen in einer marktwirtschaftlich organisierten Volkswirtschaft	12
A. Das diagnostische und prognostische Informationsbedürfnis einer Wirtschafts- und Finanzpolitik mit gesamtwirtschaftlichen Zielsetzungen in einer markt- wirtschaftlich organisierten Volkswirtschaft	12
I. Die Problematik von Entwicklungsprognosen in einer marktwirtschaftlich organisierten Volkswirtschaft	12
a) Der Prognosebegriff in den Wirtschaftswissenschaften	12
b) Prognosen als Voraussetzung wirtschafts- und finanzpolitischen Han- delns	15
II. Die grundsätzlichen Aufgabenbereiche von Wirtschafts- und Finanzpolitik in einer marktwirtschaftlich organisierten Volkswirtschaft	20
a) Der Zusammenhang von Wirtschafts- und Finanzpolitik	20
b) Die allgemeine Zielsetzung der funktionsfähigen Marktwirtschaft im Modell und in der Wirklichkeit	21
c) Die Aufgabenbereiche der Konjunktur-, Wachstums- und Struktur- politik	23
1. Die grundsätzlichen Aufgaben der Konjunkturpolitik	23
2. Die grundsätzlichen Aufgaben der Wachstumspolitik	25
3. Die grundsätzlichen Aufgaben der Strukturpolitik	28
III. Zusammenfassung	30
B. Die grundsätzlichen diagnostischen und prognostischen Informationsmöglich- keiten durch ein univariablen ökonomisches Diagnose- und Prognosemodell (MIDI-Verfahren)	31
I. Diagnose und Prognose der Entwicklung ökonomischer Größen – Grund- lagen und Verfahren	31
a) Überblick über methodische Ansätze von Verfahren zur Diagnose und Prognose der konjunkturellen Entwicklung ökonomischer Größen. . . .	31
1. Die intuitive Methode	32
2. Die Methode der Übertragung von Verlaufsbildern	32
3. Der Konjunkturtest	33
4. Die ökonometrischen Prognosemodelle (multivariable Prognose- modelle)	34

b) Der methodische Ansatz eines univariablen ökonomischen Diagnose- und Prognosemodells (MIDI-Verfahren)	35
1. Die Zeitreihenanalyse als Instrument einer empirischen Realanalyse des Entwicklungsverlaufes ökonomischer Größen	35
2. Die Grundhypothesen über die Struktur des Entwicklungsablaufs ökonomischer Größen und seiner Komponenten	36
(A) Die konjunkturelle Komponente	36
(B) Die Wachstums- und Saisonkomponente	38
(C) Die Zufallskomponente	41
3. Die Prognose des Entwicklungsverlaufs ökonomischer Größen nach dem MIDI-Verfahren	42
II. Diagnose und Prognose der Entwicklung ökonomischer Größen – wirtschafts- und finanzpolitische Bedeutung	44
a) Die allgemeine Bedeutung einer dreijährigen Entwicklungsprognose für die Wirtschafts- und Finanzpolitik	44
b) Die Bestimmung der Struktur des Entwicklungsablaufs ökonomischer Größen	46
1. Das Verhältnis der Komponenten in der Diagnose und Prognose des MIDI-Verfahrens	46
2. Schwingungssystematik und Zufallsverkettung in der konjunkturellen Komponente	47
Exkurs: Der Yule-Prozeß 2. Ordnung	48
c) Die Informationshilfen durch das MIDI-Verfahren im konjunktur-, wachstums- und strukturpolitischen Aufgabenbereich	50

2. Teil

Die Anwendung eines univariablen Diagnose- und Prognosemodells (MIDI-Verfahren) im Rahmen einer praktischen Untersuchung der industriellen Entwicklung in der Bundesrepublik Deutschland zwischen 1950 und 1967	53
A. Vorbemerkungen zum statistischen Untersuchungsmaterial	53
B. Die numerische Prognosegüte bei Zeitreihen der industriellen Nettoproduktion für Industriebereiche der Bundesrepublik Deutschland	54
I. Darstellung der numerischen Prognosegüte an vier ausgewählten Beispielen (Dreißig-Monate-Prognosen)	54
II. Darstellung der numerischen Prognosegüte für die Industriebereiche in der Bundesrepublik Deutschland	75
C. Die Diagnose der Entwicklung der industriellen Produktion in der Bundesrepublik Deutschland zwischen 1950 und 1967 nach Industriegruppen und ausgewählten Strukturproblemen	78
I. Die Komponenten der Entwicklung der industriellen Produktion in der Bundesrepublik Deutschland nach Industriegruppen	78
a) Die Betrachtung des Gesamtverlaufs der Zeitreihen	78

Exkurs: Der Modellansatz des MIDI-Verfahrens zur Darstellung der Saisonkomponente	78
b) Die Strukturkomponenten der stationären Zeitreihe	101
1. Die quantitative Bestimmung von Zyklus, Saison und Zufallseinfluß (Restkomponente)	101
2. Die konjunkturellen Schwankungen	108
c) Das Wachstum (der Trend)	116
1. Analyse der Wachstumsraten	116
2. Die Untersuchung der relativen Wachstumsentwicklung	123
II. Untersuchung ausgewählter Strukturprobleme mit Hilfe des MIDI-Ver- fahrens	130
a) Vorbemerkungen zur Problemauswahl	130
b) Beispiel einer Verflechtungsanalyse	130
c) Beispiel einer betriebsgrößenbezogenen Strukturanalyse	135
1. Grundzüge einer betriebsgrößenbezogenen Wirtschaftsbeobachtung	135
2. Analyse der Beschäftigtenstruktur nach Betriebsgrößenklassen für die Industriegruppe Stahlverformung des Landes Nordrhein-West- falen	138
D. Die Prognose der Entwicklung der industriellen Produktion in der Bundes- republik Deutschland bis Juni 1970 nach Industriegruppen	152
 <i>3. Teil</i>	
Zusammenfassung und abschließende Beurteilung	161
 <i>Anhang</i>	164
Verzeichnis der Abbildungen	167
Verzeichnis der Tabellen	170
Literaturverzeichnis	173

Vorbemerkungen

zur Entwicklung eines univariablen ökonomischen Diagnose- und Prognosemodells (MIDI-Verfahren)

Die hier vorgelegte Arbeit steht im sachlichen Zusammenhang mit Grundlagenforschungen über die gesamtwirtschaftliche Entwicklungsproblematik unter besonderer Berücksichtigung des Konjunkturphänomens¹. Das im Mittelpunkt dieser Arbeit stehende univariable Diagnose- und Prognosemodell² ist aus diesen Forschungen heraus in zwei Stufen aufgestellt worden. Auf der ersten Stufe wurden durch die Analyse der Struktur von Ablaufprozessen ökonomischer Größen die im Bewegungsverlauf auftretenden Strukturkomponenten und ihre Bewegungsformen fixiert³. Daran anschließend ist die mathematische Formulierung der Verfahrenstechnik zur Diagnose und Prognose des Entwicklungsprozesses von ökonomischen Größen durchgeführt worden⁴. Die vorliegende Arbeit baut insofern auf den beiden genannten Forschungsabschnitten auf, als in ihr die Aufgabe gestellt ist, das MIDI-Verfahren auf seine instrumentelle Brauchbarkeit unter bestimmten wirtschafts- und finanzpolitischen Aspekten zu überprüfen.

Der dargestellte Zusammenhang zwischen den einzelnen Forschungsarbeiten macht es erforderlich, in knapper Form auf die ihnen zugrunde liegende Konzeption des Gesamtvorhabens – speziell im Hinblick auf die Untersuchungsmethodik – einzugehen, um die in dieser Arbeit eingehaltenen Grenzen bei der Aufnahme von Problemstellungen besser verständlich zu machen.

Das primäre Anliegen zu Beginn der Forschungsarbeiten, die »Herausforderung zur Erklärung«, war das Konjunkturphänomen. »Die Konjunkturschwankungen«, so beginnt WALTER ADOLF JÖHR das Vorwort seiner als Standardwerk anzusehenden Arbeit über die Konjunkturschwankungen, »die während der letzten anderthalb Jahrhunderte die Menschheit einem fast ununterbrochenen Wechsel von Jahren der Blüte und Jahren der Not ausgesetzt haben, stellten nicht nur die Staatsmänner, sondern auch die Nationalökonomien vor große Rätsel«⁵. Die Gültigkeit von zwei Aussagen dieses Satzes, und zwar (1) die behauptete Existenz von Schwankungen und (2) ihre Rätselhaftigkeit, besteht auch und gerade heute noch und wird auch weder im nationalökonomischen Schrifttum noch in der wirtschaftspolitischen Praxis ernsthaft bestritten. Die Periode des in der Bundesrepublik Deutschland besonders augenfälligen expansiven Wachstums, das etwa Mitte der fünfziger Jahre einsetzte und alle überkommenen Vorstellungen vom äußeren Bild des Konjunkturverlaufes außer Kraft zu setzen schien, fächerte die wissenschaftliche Diskussion weit auf, ohne aber definitive Antworten geben zu können. Von diesem Zustand gibt das stenographische Protokoll der mündlichen Verhandlungen

¹ Diese Forschungsarbeiten wurden von M. E. KAMP, Bonn, mit Unterstützung und im Auftrage des Landes Nordrhein-Westfalen bereits im Jahre 1954 begonnen.

² Im weiteren nur noch mit seinem Programmnamen – MIDI-Verfahren (Minimal-Differenzgleichungs-Verfahren) – genannt.

³ Die Ergebnisse sind veröffentlicht in: M. E. KAMP, D. SMOLINSKI und H. J. WILD, Untersuchungen zur endogenen Prozesssystematik der marktwirtschaftlichen Entwicklung im 20. Jahrhundert, in: M. E. KAMP (Hrsg.), Beiträge zur Erforschung der wirtschaftlichen Entwicklung, Heft 9, Stuttgart 1964.

⁴ Die Ergebnisse sind in einer Manuskriptfassung (im Eigenverlag vervielfältigt) veröffentlicht: B. KORTE und W. OBERHOFER, Ein unvariables ökonomisches Analyse- und Prognosemodell, Bonn 1967, i. f. z. a.: Prognosemodell. Die Arbeit wurde als Teilbericht des Gesamtforschungsvorhabens im Oktober 1967 dem Ministerpräsidenten des Landes Nordrhein-Westfalen – Landesamt für Forschung – übergeben.

⁵ W. A. JÖHR, Theoretische Grundlagen der Wirtschaftspolitik, Bd. II, Die Konjunkturschwankungen, Tübingen-Zürich 1952, S. VII.

während der Tagung des Vereins für Socialpolitik in Garmisch-Partenkirchen im Jahre 1961 ein recht gutes Bild⁶. Da wird von EDGAR SALIN die grundsätzliche Frage aufgeworfen, ob es überhaupt noch wirtschaftliche Wechsellagen gibt und anschließend verneint⁷. Man erkennt die Existenz von Schwankungen in wichtigen volkswirtschaftlichen Globalgrößen und speziell im industriellen Sektor an, doch spricht man ihnen das Merkmal des Zyklischen ab, wie ERWIN VON BECKERATH darlegt⁸. Doch trotzdem will WILHELM KRELLE den Terminus Konjunktur für diese Schwankungen beibehalten⁹. Dann findet sich in dem Protokoll ein sehr interessanter Hinweis von HELMUT SCHLESINGER, der zu überlegen gibt, ob man zwischen alten »Konjunkturzyklen« und neuen »Konjunkturschwankungen« überhaupt unterscheiden dürfe, da die Konjunkturforschung – etwa zur Zeit ARTHUR SPIETHOFFS und ERNST WAGEMANNS – sich doch offensichtlich nur auf wenige informative Statistiken stützen konnte¹⁰. Dieser Meinung ist HANS RITSCHL nicht¹¹, und es wird an verschiedenen Stellen über den Kitchin-Zyklus und den Juglar-Zyklus diskutiert, als stünde zweifelsfrei fest, daß es derartige Überlagerungen von Konjunkturzyklen unterschiedlicher Frequenz tatsächlich gegeben habe. KRELLE argumentiert dagegen völlig zu Recht, daß die Aufspaltung von Zeitreihen nach der sogenannten harmonischen Analyse eine Vielzahl von Zyklen zutage fördern kann, was durch die Verfahrenstechnik begründet ist und nicht im Phänomen selbst zu liegen braucht¹².

Versucht man, die Fülle der in diesem Protokoll niedergelegten Meinungen zu ordnen, käme man etwa zu dem Schema: In »früheren Zeiten« hat es den Konjunkturzyklus gegeben und unter Umständen sogar in doppelter und sich überlagernder Ausgabe der Kitchin- und Juglar-Zyklen. Der »heutige« Zustand ist gekennzeichnet durch unregelmäßige Schwankungen, die man gewillt ist, Konjunkturen zu nennen, da sie durch Auf- und Abschwünge und Wendepunkte charakterisiert sind¹³. Übereinstimmend ist die Hervorhebung des Zyklus als Wesensmerkmal. Diese Septembertagung des Vereins für Socialpolitik im Jahre 1961 – das sei wiederholt – spiegelt wirklich den Stand des Wissens und Meinens der Wirtschaftswissenschaft über ein wesentliches Teilphänomen des Prozesses, den man wirtschaftliche Entwicklung nennen kann, wider. Der Ausdruck »Meinen« wird gebraucht, weil »Erklärung« schon auf Grund der Vielfalt der gleich einleuchtend belegten Meinungen ausgeschlossen wird. Die Situation, in der sich die wissenschaftlich-theoretische, auf der Erkenntnis vom Objekt aufbauende Erklärung befindet, charakterisierte auf der Tagung GOTTFRIED BOMBACH mit den Worten, daß es »wie in der Medizin, wo man viele Krankheiten zwar noch nicht versteht, aber schon mit einigem Erfolg heilen könne, in der Ökonomie Dinge (gebe), die wir nicht verstehen – und dennoch funktioniert das Modell«¹⁴. Dieser Satz drückt aus, daß man die Entsprechung der Hypothesen, auf denen die theoretischen Erklärungsschemata beruhen, in der Wirklichkeit nicht beweisbar, faktisch überprüfbar machen kann und nur auf Grund einer sich zeigenden Adaption der Realität durch das theoretische Modell diese Entsprechung vermutet.

⁶ Vgl. H. GIERSCH und K. BORCHARDT (Hrsg.), *Diagnose und Prognose als wirtschaftswissenschaftliche Methodenprobleme*, Schriften des Vereins für Socialpolitik, NF Bd. 25, Berlin 1962, S. 463ff.; i. f. z. a.: *Diagnose und Prognose*.

⁷ Vgl. *Diagnose und Prognose*, a. a. O., S. 465f.

⁸ Vgl. *Diagnose und Prognose*, a. a. O., S. 468.

⁹ Vgl. *Diagnose und Prognose*, a. a. O., S. 468.

¹⁰ Vgl. *Diagnose und Prognose*, a. a. O., S. 478.

¹¹ Vgl. *Diagnose und Prognose*, a. a. O., S. 477.

¹² Vgl. *Diagnose und Prognose*, a. a. O., S. 481.

¹³ Vgl. *Diagnose und Prognose*, a. a. O., S. 489.

¹⁴ *Diagnose und Prognose*, a. a. O., S. 483f.

In den Jahren nach 1961 bis 1966 hat sich im wissenschaftlichen Raum kaum eine Veränderung des an Hand der genannten Tagung aufgestellten Bildes ergeben. Dann aber, im Jahre 1966, in dem die Wirtschaft der Bundesrepublik das erlebte, was man – vergleichend mit Geschäftslagen in der amerikanischen Wirtschaft – als Rezession bezeichnet, findet man im Schrifttum eine Wiederbelebung des Zyklus-Gedankens. So beginnt z. B. das Jahresgutachten 1966/67 des Sachverständigenrates zur Begutachtung der gesamtwirtschaftlichen Entwicklung mit dem Satz: »Die Wirtschaft der Bundesrepublik befindet sich in der Abschwungsphase des vierten Wachstumszyklus in der Nachkriegszeit«¹⁵. Eine Vielzahl von Angaben in diesem Gutachten beweisen, daß der Begriff Zyklus wirklich im Sinne eines sich reproduzierenden Geschehens verstanden ist¹⁶. Das Gutachten ist u. a. von WILHELM BAUER und HERBERT GIERSCH erstellt worden, die auf der Septembertagung des Vereins für Socialpolitik im Jahre 1961 zum engeren Diskussionskreis gehörten, in dem THEODOR PÜTZ unwidersprochen erklärte, »der Ausdruck ‚antizyklische Finanzpolitik‘ lege ja leider immer noch die Fehlinterpretation nahe, es gibt einen Zyklus«¹⁷. Damit soll nur gezeigt werden, daß also derzeit wieder alle Interpretationsmöglichkeiten der sich abwechselnden guten und schlechten Geschäftslagen in der Wirtschaft zur Auswahl stehen.

Mit der Ausrichtung der Forschungsarbeiten auf das Konjunkturphänomen verband sich die zentrale Aufgabenstellung – und die Berechtigung dieser Aufgabenstellung sollten die bisherigen Ausführungen darlegen –, die Entwicklungsschwankungen ökonomischer Größen auf ihre zyklische Eigenschaft hin zu analysieren. Die Untersuchungsmethode ergab sich aus der strengen Bindung an die Forderung, informative Ergebnisse zu erarbeiten, d. h. faktisch überprüfbar – quantitative – Aussagen vorzulegen. Die praktische Arbeit mußte also die Analyse der statistischen Reihen sein, in denen die zeitliche Entwicklung ökonomischer Größen quantitativ festgehalten ist. Die Zahlenangaben werden dabei als Endresultat aller ursächlich auf das Zustandekommen dieser Werte wirkenden Faktoren angesehen. Die Aufgabe sah daher so aus, wie der Statistiker OSKAR ANDERSON es auf der erwähnten Tagung des Vereins für Socialpolitik an einer Stelle der mündlichen Diskussion formuliert hat, indem er sagte, »man stehe vor einer Zeitreihe mit Monatsdaten, die viele Schwankungen hat, regelmäßige und unregelmäßige. Was sei nun hier Konjunktur?«¹⁸.

Die Zeitreihenanalyse ist als Untersuchungsmethode nicht unumstritten. Man subsumiert unter diesen Begriff auch heute noch vielfach die Bemühungen der frühen sogenannten empirischen Konjunkturforschung¹⁹, in der Materialanalyse – mehr oder weniger – mit Materialbetrachtung identisch war. Über eine derartige Untersuchungsmethodik und die aus ihr erwachsenden wissenschaftlichen Aussagen urteilt z. B. PAUL A. SAMUELSON: »Zahlreiche Erwachsene, die es doch eigentlich besser wissen sollten, ruinieren ihr Augenlicht dadurch, daß sie wie gebannt auf graphische Darstellungen starren . . . Sie hoffen, daraus eine magische Einsicht in die Zukunft zu gewinnen«²⁰. Dieses Urteil – diese Verurteilung – besteht zu Recht, denn das äußere Bild der »ge-

¹⁵ Expansion und Stabilität, Jahresgutachten 1966/67, Stuttgart–Mainz 1966, S. 1.

¹⁶ Vgl. Expansion und Stabilität, a. a. O., Nr. 45 auf S. 26, Nr. 50 auf S. 29, Nr. 85 auf S. 52 (u. a. m.).

¹⁷ Diagnose und Prognose, a. a. O., S. 489.

¹⁸ Diagnose und Prognose, a. a. O., S. 489.

¹⁹ Als typisches Beispiel sei hier hingewiesen auf: A. SPIETHOFF, Krisen, in: Handwörterbuch der Staatswissenschaften, 4. Aufl., Bd. 6, Jena 1925, S. 38ff. Vgl. hierzu auch H. SCHLEGEL und H. LANGELÜTGE, Wirtschaftsforschung, empirische, in: Handwörterbuch der Sozialwissenschaften, Bd. 12, Stuttgart–Tübingen–Göttingen 1962, S. 103ff.

²⁰ P. A. SAMUELSON, Volkswirtschaftslehre – Eine Einführung, 2. Aufl., Köln-Deutz 1955, S. 345.

reihenden Daten« verdeckt ein aus dem »Bild« gewiß nicht ablesbares Gesamtgeschehen, in dem unter Umständen viele Wirkkräfte in unterschiedlicher Wirkungsweise zusammengelaufen sind. Aus den konkreten Daten die wirkenden Kräfte und die Wirkungsweisen zu analysieren, kann allein Ziel und Aufgabe der Zeitreihenanalyse sein. Da die experimentellen Möglichkeiten der Naturwissenschaften in der Nationalökonomie so gut wie ausgeschlossen sind, ist nur der Weg des Rückschlusses, d. h. des Hypothesentests gangbar. Dabei ist die größte Mühe und Sorgfalt darauf zu verwenden, daß die Begründung der Hypothese durch das Kausalschema, welches die Entstehung der Zeitreihe gesteuert hat, eindeutig ist, d. h. es muß gesichert sein, daß nur dieses Schema und kein zweites zu der vorliegenden Datenkonkretisierung führt. Hierin liegt, wie die Forschungsarbeiten zeigten, ein großes Problem, denn es ist nicht zu schwierig, ein Schema zu entwickeln, das die Entwicklungsbewegungen ökonomischer Größen adaptiert, was aber nicht besagt, daß es auch zugleich Erklärungsschema ist.

Eine weitere Gefährdung der Zeitreihenanalyse ist zweifellos in der Tatsache gegeben, daß man durch die analytischen Instrumente, die mathematisch-statistischen Verfahren, mit denen die Hypothesen getestet werden bzw. das statistische Material für den Test aufbereitet wird, das Untersuchungsobjekt substantiell verändert. Als typisches Beispiel sei auf den Slutsky-Effekt²¹ hingewiesen, der immer dann auftreten kann, wenn – wie das im MIDI-Verfahren geschieht – Glättungsoperatoren Verwendung finden. Dieser Effekt besteht im Kern darin, daß durch Glättungsoperationen die Glieder einer Zeitreihe miteinander verknüpft werden, so daß eine nach der Glättung vorgenommene Analyse auch dann eine Bildungsgesetzlichkeit der Zeitreihe finden muß, wenn diese tatsächlich gar nicht vorliegt. Die Forschungsarbeiten erstreckten sich daher nicht nur auf die Anwendung von Testverfahren, sondern auch auf deren Entwicklung selbst, um die – wie am Slutsky-Effekt geschilderten – Gefahren einer substantiellen Veränderung des Untersuchungsobjektes durch die Verfahren zu vermeiden²².

Die Untersuchungsmethodik, die Zeitreihenanalyse, führte im Verlaufe der Forschungsarbeit nicht nur zur Lösung der gestellten Aufgabe, zur eindeutigen Beantwortung der Frage nach der zyklischen Natur des Konjunkturphänomens, sondern sie ermöglichte auch eine vollständige Zurückführung der Zeitreihenwerte auf die am Zustandekommen der einzelnen Werte mitwirkenden Komponenten oder Kräfte. Die Analyse der Wirkungsweisen dieser Komponenten ergab ferner, daß der Entwicklungsverlauf ökonomischer Größen in einem solchen Umfang systemgebunden ist, daß aus der Kenntnis dieser Bewegungsdeterminationen die Entwicklung der betreffenden ökonomischen Größe auch vorhergesagt werden kann. Die Möglichkeit der auf einer Analyse bzw. Diagnose aufbauenden Prognose wurde im ersten Abschnitt der Forschungen nachgewiesen und im zweiten Forschungsabschnitt zu einem praktischen Prognoseverfahren entwickelt.

Ein System von Aussagen zur Erklärung von Realphänomenen, von Teilen der Wirklichkeit, ist natürlich nicht deshalb falsch, weil aus ihm keine Prognosen abgeleitet werden können. Ein solcher Fall ist z. B. gegeben, wenn durch fehlende Spezifizierung des Anwendungsbereiches das System gegen Fakten immunisiert ist²³. Dagegen müssen Aussagen, die aus einer Faktenanalyse gewonnen werden, sich einer Überprüfung durch

²¹ E. SLUTSKY, The Summation of Random Causes as the Source of Cyclic Processes, in: *Econometrica*, Vol. 5 (1937), S. 105.

²² Vgl. hierzu auch die Ausführungen von B. KORTE und W. OBERHOFER, in: *Prognosemodell*, a. a. O., S. 30 ff.

²³ Vgl. H. ALBERT, Probleme der Theoriebildung, Entwicklung, Struktur und Anwendung sozialwissenschaftlicher Theorien, in: H. ALBERT (Hrsg.), *Theorie und Realität. Ausgewählte Aufsätze zur Wissenschaftslehre der Sozialwissenschaften*, Tübingen 1964, S. 33; i. f. z. a.: Probleme der Theoriebildung.

Anwendung – und d. h. auch Überprüfung durch Prognose – stellen²⁴. Aus diesem Grunde ist die Entwicklung eines Prognoseverfahrens, durch das eine Überprüfung der analytisch gewonnenen Aussagen über den Bewegungsablauf ökonomischer Größen möglich gemacht wird, kein »technologischer Abweg«, sondern Teil der wissenschaftlichen Aufgabe. Darüber hinaus besitzt ein solches Diagnose- und Prognoseverfahren natürlich auch einen in sich selbst liegenden Wert, weil seine Anwendung Ergebnisse liefert, die zur Grundlage von Überlegungen und Entscheidungen gemacht werden können. Ein solcher Fall ist z. B. mit der Thematik der vorliegenden Arbeit gegeben, in der die Frage gestellt ist, ob und wie durch das MIDI-Verfahren diagnostische und prognostische Informationen für die Wirtschafts- und Finanzpolitik der Bundesrepublik Deutschland über die Entwicklung ökonomischer Größen geliefert werden können, die dem tatsächlichen Informationsbedürfnis entsprechen.

Durch die Schilderung der Genesis, der Entstehung des MIDI-Verfahrens sollte deutlich gemacht werden, daß sich die Untersuchung der Anwendungsproblematik des Verfahrens an die Stufung des generellen Forschungsvorhabens anzupassen hat. Unter diesem Aspekt muß sich daher der Schwerpunkt der vorliegenden Überlegungen auf die Darstellung und Wertung des instrumentellen Charakters dieses ganz bestimmten Diagnose- und Prognoseverfahrens richten.

²⁴ Vgl. hierzu die Ausführungen über »Gedankenexperiment« und »Realexperiment« von H. ALBERT, in: Theorie und Prognose in den Sozialwissenschaften, in: E. TOPITSCH (Hrsg.), Logik der Sozialwissenschaften, Köln-Berlin 1965, S. 128; i. f. z. a.: Theorie und Prognose in den Sozialwissenschaften.

1. Teil

Das univariable Diagnose- und Prognosemodell (MIDI-Verfahren) und die Grundanliegen der Wirtschafts- und Finanzpolitik mit gesamtwirtschaftlichen Zielsetzungen in einer marktwirtschaftlich organisierten Volkswirtschaft

A. Das diagnostische und prognostische Informationsbedürfnis einer Wirtschafts- und Finanzpolitik mit gesamtwirtschaftlichen Zielsetzungen in einer marktwirtschaftlich organisierten Volkswirtschaft

I. *Die Problematik von Entwicklungsprognosen in einer marktwirtschaftlich organisierten Volkswirtschaft*

a) Der Prognosebegriff in den Wirtschaftswissenschaften

Die ersten Überlegungen dieses Teils der Arbeit gelten dem Prognosebegriff, da – im Gegensatz zu den Begriffen Diagnose oder Analyse – über ihn keine so allgemein verbreitete Übereinstimmung besteht, daß man mit dem Begriff Prognose ohne Gefahr des Mißverständnisses operieren könnte. In der wirtschaftswissenschaftlichen Literatur wird u. a. Prognose konkurrierend mit den Begriffen Projektion und Voraussage verwendet, wobei gleich anzumerken ist, daß hier »Voraussage« keine Übersetzung des Fremdwortes Prognose ist, sondern einen durchaus eigenständigen und zur Prognose differierenden Begriffsinhalt anbietet. Auf der bereits mehrfach genannten Tagung des Vereins für Socialpolitik im Jahre 1961²⁵ ist die Vielfalt der Verwendungsmöglichkeiten der oben genannten drei Begriffe geradezu exemplarisch demonstriert worden.

Relativ einfach sind die Anwendungsbereiche von »Prognose« und »Voraussage« abzuklären. Der synonyme Gebrauch beider Ausdrücke findet sich (1) in der Literatur durchgängig dort, wo die Autoren nicht »Projektion« als einen zur »Prognose« auf gleicher Ebene stehenden Begriff einführen²⁶. Für einige Autoren ist das Wort »Prognose« so sehr mit dem Odium der Prophetie belastet, daß sie, um die Wissenschaftlichkeit der Aussagen darzulegen, den Ausdruck »Prognose« aus diesem Grunde nicht verwenden²⁷. Eine nicht-synonyme Verwendung von »Prognose« und »Voraussage« erscheint nun dort sinnvoll, wo man zwischen Prognose und Projektion differenziert und für beide Arten der Zukunftsaussage einen Oberbegriff in dem Wort »Voraussage« finden kann²⁸.

Durch die Einführung des Begriffes »Projektion« wird es möglich, qualitative Unterschiede der Voraussagen zu erfassen. Allerdings ist die Verwendung nicht einheitlich, denn es werden mit »Projektion« unterschiedliche Qualitätsmerkmale der Voraussagen abgedeckt. Wesentlich sind zwei unterschiedliche Anwendungen des Projektionsbegriff-

²⁵ Arbeitstagung des Vereins für Socialpolitik in Garmisch-Partenkirchen 1961 mit dem Generalthema: Diagnose und Prognose als wirtschaftswissenschaftliche Methodenprobleme.

²⁶ Als Beispiele seien hier angeführt: F. A. LUTZ, Das Problem der Wirtschaftsprognosen, in: Recht und Staat in Geschichte und Gegenwart, Bd. 185, Tübingen 1955, S. 8; i. f. z. a.: Das Problem der Wirtschaftsprognosen; und: O. MORGENSTERN, Methoden und Grenzen der Konjunkturpolitik, in: Mitteilungen des RWI, 7. Jg. (1956), S. 232.

²⁷ So z. B. K. CH. KUHLO, Die Wachstumsprognose, insbesondere auch die Prognose der Produktivitätsentwicklung, in: Diagnose und Prognose, a. a. O., S. 215.

²⁸ So z. B. H. GIERSCH im stenographischen Protokoll der mündlichen Verhandlungen der Tagung des Vereins für Socialpolitik 1961, in: Diagnose und Prognose, a. a. O., S. 496.

fes zur Differenzierung nach (1) der Fristigkeit und (2) der Bedingtheit der Voraussagen. »Im Sprachgebrauch«, so schreibt BAUER, »scheint es sich allmählich einzubürgern, langfristige Voraussagen auf dem Gebiet des wirtschaftlichen Geschehens als *Projektionen*²⁹ (oder langfristige Projektionen) zu bezeichnen, um sie klar von methodisch zum großen Teil völlig anders gelagerten (kurzfristigen) Konjunkturprognosen abzuheben ...«³⁰.

Der Begriff Projektion wird, wie das Zitat zeigt, dem Begriff Prognose gegenübergestellt. Der Sprachgebrauch, auf den BAUER hier hinweist, findet sich besonders bei politischen Institutionen. Im politischen Bereich angewendet, ist dabei gar nicht zu übersehen, daß der Einteilung »Projektion« und »Prognose« nach der Fristigkeit insofern ein etwas vordergründiger Aspekt unterliegt, als das wirkliche Bedürfnis darin besteht, sich im Hinblick auf die Treffsicherheit der Voraussage abzusichern. Da nun aus der praktischen Erfahrung eine hinreichende Korrelation zwischen Voraussagesicherheit und Fristigkeit bekannt ist, bringt der im allgemeinen Sprachgebrauch weniger gebräuchliche Terminus »Projektion« mit der Fristigkeitsangabe zugleich auch einen Bedingtheitsgrad der Voraussage, und zwar einen schwächeren, zum Ausdruck, obwohl das nur selten direkt gesagt wird. An diesem Beispiel zeigt sich erneut, wie sehr bereits mit dem Wort »Prognose« ein psychologisches Moment ins Spiel kommt. Dort jedoch, wo man tatsächlich *nur* auf die Unterscheidung der Vorhersagefrist abstellen will, ist ein Ersatz der Adjektive »lang- und kurzfristig« durch einen Spezialausdruck sachlich nicht notwendig.

Das Problem ist dagegen ganz anders gelagert, wenn das qualitative Merkmal der Bedingtheit von Voraussagen in den Begriff aufgenommen werden soll³¹. Aussagen über künftige Ereignisse, über künftiges Geschehen, müssen den Anspruch stellen, wahr zu sein, d. h. der Eintritt der Ereignisse wird als *sicher* behauptet. Der Gültigkeitsanspruch kann nun aber an Voraussetzungen gebunden werden, und diese Bindung bzw. Nicht-Bindung soll durch den Begriff »Projektion« und »Prognose« unterschieden werden, wobei GIERSCH der Prognose, der nicht an Voraussetzungen gebundenen Vorhersage zubilligt, daß Totalstörungen wie Weltuntergang und Kriege ausgeschlossen werden dürfen³². Nun unterstellt GIERSCH, daß Prognosen auf Grund der an sie gestellten strengen Anforderungen kaum informativ sein können: es sind »schwache Vorhersagen«³³. So kommt er zu einer weiteren Konsequenz der Prognose, der die Projektion als einer auf Bedingungen beruhenden, aber informativen oder »starken« Vorhersage gegenübersteht.

Im Zusammenhang mit diesen Begriffsbestimmungen kommt nun einer Erörterung der Gültigkeitsproblematik von Vorhersagen, die ja hierbei im Mittelpunkt steht, eine entscheidende Bedeutung zu. Wenn man untersucht, worin sich wissenschaftliche Vorhersagen von unwissenschaftlichen wie Vermutungen, Spekulationen, Prophezeiungen usw. unterscheiden, so ist das kardinale Kriterium die theoretische Fundierung der

²⁹ Hervorhebung im Original.

³⁰ W. BAUER, Probleme der langfristigen Strukturprognose und der Branchenprognosen, in: Diagnose und Prognose, a.a.O., S. 343.

³¹ Den weiteren Erörterungen liegt die Systematisierung von H. GIERSCH zugrunde (vgl. Stenographisches Protokoll der mündlichen Verhandlungen der Tagung des Vereins für Socialpolitik 1961, in: Diagnose und Prognose, a.a.O., S. 496f.), der auch im neueren Schrifttum gefolgt wird. Vgl. z. B. K. KÄSTNER, Gesamtwirtschaftliche Planung in einer gemischten Wirtschaftsordnung, in: Wirtschaftspolitische Studien 5, Göttingen 1966, S. 12ff.

³² Vgl. H. GIERSCH, in: Stenographisches Protokoll der mündlichen Verhandlungen der Tagung des Vereins für Socialpolitik 1961, in: Diagnose und Prognose, a.a.O., S. 496f.

³³ H. GIERSCH, in: Stenographisches Protokoll der mündlichen Verhandlungen der Tagung des Vereins für Socialpolitik 1961, in: Diagnose und Prognose, a.a.O., S. 496.

wissenschaftlichen Vorhersage. Es widerspricht nicht der Logik, wenn auch im umgekehrten Sinne gefolgert wird, daß die Theorie bzw. theoretische Sätze für Vorhersagen benutzt werden können³⁴. Die von dem theoretischen Fundament her abgeleiteten Vorhersagen können ihren Gültigkeitsanspruch, reale Ereignisse der Zukunft auszusagen, nur in dem Umfang behaupten, wie die theoretischen Sätze gültige Erklärungen der Wirklichkeit, zu der die künftigen Ereignisse natürlich substantiell gehören müssen, sind. Der »Erklärungskraft« der Theorie entspricht der Wahrscheinlichkeitsgrad des Eintretens eines vorhergesagten Ereignisses. Diese Wahrscheinlichkeit ist allerdings nicht die (subjektive) Wahrscheinlichkeit, die der Prognostiker seiner Aussage selbst zuschreibt. Wäre der Grad, mit welchem der Prognostiker vom Eintreten seiner Vorhersage überzeugt ist, qualifizierend für die Prognose – ihr muß eine hohe subjektive Wahrscheinlichkeit zukommen³⁵ –, gäbe es keine Unterscheidung zwischen wissenschaftlicher Vorhersage und Prophetie, denn der Prophet ist sicherlich in hohem Grade von der »Treffsicherheit« seiner Prophezeiung überzeugt. Es ist nicht ganz verständlich, warum die wissenschaftliche Literatur auch dort, wo der Zusammenhang von Voraussage und theoretischem Fundament erkannt ist, keine konsequente Aussage gewinnt. Als Beispiel sei – etwas ausführlicher – KLAUS KÄSTNER zitiert: »Eine Prognose stellt also gegenüber der einfachen Projektion gewissermaßen eine höhere Entwicklungsstufe dar, da der Wahrscheinlichkeitsgrad ihres Eintreffens berücksichtigt werden muß, etwa in der Form, daß die Prognose als ‚sehr wahrscheinlich‘, ‚wahrscheinlich‘ oder ‚unwahrscheinlich‘ qualifiziert wird. Das bedeutet aber gleichzeitig, daß eine Prognose – im Gegensatz zur Projektion – nicht streng wissenschaftlich bewiesen werden kann, weil mehr oder weniger große Abweichungen der Wirtschaftstheorie von der Realität immer bestehen bleiben müssen und infolgedessen das Ausmaß, in dem die theoretisch erarbeiteten Aussagen Geltung für die Wirklichkeit beanspruchen können, immer nur *geschätzt*³⁶ werden können«³⁷. Die »Unklarheiten« in diesem Zitat sind augenfällig. Wenn man sagt, daß die Theorie nicht mit der Wirklichkeit übereinstimmt, bzw. wenn man diese Möglichkeit einräumt, sind abgeleitete Vorhersagen »Projektionen« und wissenschaftlich beweisbar. Wenn man die Wahrscheinlichkeit abschätzt, mit der die Projektionen eintreffen können, sind es »Prognosen«, die nicht streng wissenschaftlich beweisbar sind. Die Frage nach der »Wissenschaftlichkeit« einer Vorhersage, das sei wiederholt, ist eine Frage nach ihrer theoretischen Fundierung, und der Wahrscheinlichkeitsgrad ihrer Realisierung ist vom nomologischen Gehalt des theoretischen Fundamentes abhängig. Der Argumentation von GIERSCH, daß Prognosen – im Sinne seiner Definition – immer »vage«³⁸ sein *müssen*, kann auf Grund dieser Überlegungen nicht zugestimmt werden. Im Hinblick auf die Brauchbarkeit einer Prognose als Informationsinstrument darf der Satz von HANS ALBERT gelten: »Mit steigendem Informationsgehalt pflegt auch die prognostische Brauchbarkeit einer Theorie zu steigen, denn gehaltvollere Theorien enthalten stärkere Einschränkungen für zukünftiges Geschehen«³⁹. Ein Prognoseirrtum, das ist aus dem dargestellten Zusammenhang zwischen Vorhersage und

³⁴ Vgl. F. A. LUTZ, Das Problem der Wirtschaftsprognosen, a. a. O., S. 8.

³⁵ So H. GIERSCH, in: Stenographisches Protokoll der Tagung des Vereins für Socialpolitik 1961, in: Diagnose und Prognose, a. a. O., S. 496.

³⁶ Hervorhebung im Original.

³⁷ K. KÄSTNER, a. a. O., S. 13f.; vgl. hierzu auch: W. A. JÖHR, Schätzungsurteil und Werturteil, in: N. KLOTEN u. a. (Hrsg.), Systeme und Methoden in den Wirtschafts- und Sozialwissenschaften, Festschrift für ERWIN VON BECKERATH zum 75. Geburtstag, Tübingen 1964, S. 155ff.

³⁸ Fundstelle wie unter Fußnote 35.

³⁹ H. ALBERT, Probleme der Theoriebildung, a. a. O., S. 61, und H. ALBERT, Theorie und Prognose in den Sozialwissenschaften, a. a. O., S. 128.

theoretischer Fundierung schließlich abzuleiten, kann nur dann eintreten, und zwar auch unter der Voraussetzung, daß die theoretischen Sätze Gesetzeskraft und empirischen Gehalt haben, wenn der Prognostiker dem praktischen Anwendungsfall eine für speziell diesen Fall irrelevante Theorie unterlegt.

Eine Differenzierung nach »Prognose« und »Projektion« bleibt jedoch sinnvoll, wenn man nicht nach Voraussetzungslosigkeit und Voraussetzungen zuordnet, sondern mit dem Begriff »Projektion« zum Ausdruck bringen will, daß die zur Erstellung der Projektion herangezogene theoretische Basis gegenüber der Wirklichkeit ganz oder teilweise fiktiv und nicht mit Gesetzeskraft ausgestattet ist bzw. ein nomologischer Gehalt nur vermutet wird, aber nicht nachgewiesen werden kann. Das Aufstellen von Projektionen ist wissenschaftliches Vorgehen und kann von großem praktischen Nutzen sein, wenn auch die Information eine »es wird geschehen, wenn« Einschränkung enthält⁴⁰.

Im Rahmen der vorliegenden Arbeit wird ein Prognoseverfahren untersucht, das als Modell charakterisiert ist, wodurch gesagt sein soll, daß die Verfahrenstechnik – und selbstverständlich auch die prognostische Aussage – auf einer hypothetischen Basis aufbaut, die den Anspruch erhebt, eine Wirklichkeitserklärung zu geben. Wie diese Wirklichkeitserklärung konkret aussieht, wird an einer anderen Stelle dieses Abschnittes dargestellt, und die Frage der Brauchbarkeit ist direkt Gegenstand dieser Arbeit.

b) Prognosen als Voraussetzung wirtschafts- und finanzpolitischen Handelns

Wirtschaftspolitisches Handeln wird durch wirtschaftspolitische Probleme notwendig, d. h. es liegt die Voraussetzung vor, daß die Probleme nicht nur wirtschaftlicher Natur sind, sondern auch auf Grund der für die staatliche Aktivität geltenden Ordnungsnormen in den Zuständigkeitsbereich der Wirtschaftspolitik fallen. JÖHR und auch andere Nationalökonomien haben in vollgültiger Weise dargelegt, daß der Charakter eines wirtschaftspolitischen Problems darin zu sehen ist, daß in einem bestimmten Sachbereich zwischen erwünschtem oder vorgestelltem Zustand und dem tatsächlichen Zustand (Zielsetzung und aktueller Lage) keine Übereinstimmung besteht⁴¹. Durch geeignete Maßnahmen Ziel und Lage in Übereinstimmung zu bringen, ist die wirtschaftspolitische Aufgabe. Da die Beziehung zwischen Ziel und Lage immer eine Gegenwart-Zukunft-Beziehung ist, wobei in der Gegenwart Maßnahmen zu treffen sind, deren Wirkungen sich in der Zukunft zeigen, kann die bestehende Spannung ohne prognostisches Denken seitens des handelnden Wirtschaftspolitikers nicht rational aufgelöst werden. »Ob die Prognosen«, so stellen JÖHR und FRANCESCO KNESCHAUREK fest, »gut oder schlecht, fundiert oder unfundiert sind, sie bilden ein nicht wegzudenkendes Element der Wirtschaftspolitik«⁴². Diese aus den Elementen Gegenwart, Zukunft und Rationalität des Handelns hervorgehende Notwendigkeit der Prognose als Voraussetzung wirtschaftspolitischen Handelns bringt auch OSKAR MORGENSTERN zum Ausdruck: »Zunächst ist jedoch festzuhalten, daß wir um Prognosen nicht herumkommen, so schwer es auch sachlich sein mag, sie aufzustellen und zu

⁴⁰ Es darf an dieser Stelle angemerkt werden, daß eine Erörterung der Probleme im Zusammenhang mit dem Prognosebegriff in den Wirtschaftswissenschaften nur mit der dieser Arbeit angemessenen Kürze vorgenommen werden konnte. Die zu diesem Sachverhalt vorliegende Literatur bietet die Möglichkeit zu einer selbständigen größeren Abhandlung.

⁴¹ Vgl. W. A. JÖHR und H. W. SINGER, Die Nationalökonomie im Dienste der Wirtschaftspolitik, 2., erweiterte Auflage, Göttingen 1964, S. 40f.; i. f. z. a.: Die Nationalökonomie im Dienste.

⁴² W. A. JÖHR und F. KNESCHAUREK, Die Prognose als Basis der Wirtschaftspolitik, in: Diagnose und Prognose, a. a. O., S. 418; i. f. z. a.: Die Prognose als Basis.

begründen, und so groß manche Mißerfolge auch gewesen sein mögen. Jedes Individuum, jede Firma, jedes Land handelt in die Zukunft gerichtet«⁴³.

Die Frage nach der generellen Bedeutung von Prognosen im Rahmen wirtschaftspolitischen Handelns mußte deshalb gestellt werden, weil es Stimmen aus der Wissenschaft und der wirtschaftspolitischen Praxis gibt, die Prognosen als Informationsmittel für die Wirtschaftspolitik aus grundsätzlichen Erwägungen heraus ablehnen und nicht nur deshalb, weil ihnen die derzeit möglichen Prognosen zu unsicher erscheinen. So stellt z. B. FRIEDRICH A. LUTZ die These auf, daß für die Einzelwirtschaften wie für die Wirtschaftspolitik die Unsicherheit der zukünftigen Entwicklung sogar *erhalten* werden muß, um z. B. den Unternehmern die Chancen, Gewinne zu machen, und der Wirtschaftspolitik die Unbefangenheit des Handelns zu erhalten⁴⁴. Die Tatsache, daß diese Einstellung gegenüber Prognosen die Wirtschaftspolitik in der Bundesrepublik noch bis in jüngere Zeiten beeinflußt hat, zwingt doch wohl zu einer ausführlicheren Antwort, als sie etwa BOMBACH⁴⁵ gibt, der die Frage nach einer Existenzberechtigung von Prognosen in einer sich selbst steuernden Wirtschaft, in einer marktwirtschaftlich organisierten Wirtschaft, als eine unfruchtbare Fragestellung bezeichnet.

Aus den Darlegungen sowohl von LUTZ als auch von ALBERT HAHN geht hervor, daß auch für sie Prognosen unumgänglich sind, sofern sich die Situation ergibt, wo Gegenwart und Zukunft durch Handlung verknüpft sind. Das kann kaum deutlicher gesagt werden, als es LUTZ tut, der z. B. die Ablehnung von Prognosen durch den Unternehmer damit begründet, daß der Unternehmer seine Gewinnchance darin sieht, daß er die Zukunft besser voraussieht als seine Konkurrenten. Das heißt aber, daß ein oder mehrere Unternehmer sehr an Prognosen interessiert sind⁴⁶. Eine Begründung, warum es in der Wirtschaftsdynamik erforderlich ist, daß andere Unternehmer nicht informiert sein müssen, findet sich nicht, und es ist auch schwer einsichtig, warum das so sein sollte⁴⁷. Bei der durch LUTZ und HAHN formulierten Ablehnung von Wirtschaftsprognosen geht es im Grunde um den Widerstand gegen die Behauptungen, daß der Wirtschaftsprozess in der Art physikalischer Gesetze der Mechanik determiniert ist. In dieser Frontstellung – z. B. gegenüber den Lehren des Marxismus – besteht die Gefahr, daß die Diskussion ideologisiert wird⁴⁸. Ob und in welchem Umfange die wirtschaftliche Entwicklung Ablaufgesetzmäßigkeiten unterliegt, sollte als Fragestellung der wissenschaftlichen ökonomischen Forschung und nicht der Philosophie überlassen werden.

Größere praktische Bedeutung hat ein anderes Argument gegen die Prognose, das gleichfalls unter dem Gesichtspunkt der Inkompatibilität zum System der sich selbst steuernden Wirtschaft vorgetragen wird. Kurz- und mittelfristige Prognosen, so sagt man, führen allein durch ihr Bekanntwerden zur sogenannten Selbsterfüllung, weil alle am Wirtschaftsprozess Beteiligten auf die prognostische Aussage entsprechend reagieren müssen. Solche Prognosen würden den Reaktionen der privaten Wirtschaftseinheiten die »Unbefangenheit« der Einstellung zum *gegenwärtigen* Marktgeschehen nehmen. Es sind hier speziell die Konjunkturprognosen Gegenstand der Diskussion. Es gibt fast so gut wie keine Publikation zum Problem der Konjunkturprognose, in der nicht dieser

⁴³ O. MORGENSTERN, a. a. O., S. 230.

⁴⁴ Vgl. F. A. LUTZ, Das Problem der Wirtschaftsprognosen, a. a. O., S. 18ff.

⁴⁵ Vgl. G. BOMBACH, Über die Möglichkeit wirtschaftlicher Voraussagen, in: *Kyklos*, Vol. XV (1962), S. 29; i. f. z. a.: Über die Möglichkeit.

⁴⁶ Vgl. F. A. LUTZ, Das Problem der Wirtschaftsprognosen, a. a. O., S. 20.

⁴⁷ Vgl. E. GUTENBERG, Grundlagen der Betriebswirtschaftslehre, Bd. 2, Der Absatz, 10. Aufl. Berlin-Heidelberg-New York 1967, S. 8ff.

⁴⁸ Vgl. G. BOMBACH, Über die Möglichkeit, a. a. O., S. 29.

Selbsterfüllungseffekt der Prognose abgehandelt wird. Diese Annahme des antizipativen Reagierens⁴⁹ der Wirtschaftseinheiten führt sogar dahin, daß solche Prognosen hinsichtlich ihrer Zweckmäßigkeit als Instrument der sogenannten moral suasion beleuchtet werden.

Es darf zu dieser Problematik zunächst festgestellt werden, daß der Selbsterfüllungseffekt allgemein bekannt gemachter kurz- und mittelfristiger Entwicklungsprognosen überwiegend in Denkmodellen abgehandelt wird und es keine Beispiele – sieht man von der Börse ab – aus der Realität mit Angaben über die quantitativen Wirkungen gibt. Dabei hat man einen exemplarischen Konjunkturzyklus gefunden, der gerade für diesen Zweck hervorragend geeignet ist: den Schweinezyklus⁵⁰. Dieser Schweinezyklus wird auch praktisch mit Angabe des Bestandes zum Marktangebot prognostiziert und die Prognose wird für jedermann zugänglich publiziert⁵¹. ARTHUR HANAU und EGON WÖHLKEN stellen fest, »daß die Produktionsentscheidungen der Schweinehalter . . . mit einer fast an eine Gesetzmäßigkeit grenzenden Wahrscheinlichkeit vorgenommen werden«⁵². Die relativ einfach gelagerten Kausalitätsbeziehungen würden es durchaus möglich machen, die im Denkmodell so einfach sich darbietenden »antizipativen Reaktionen« experimentell auszuführen. Die unleugbare Tatsache, daß es nicht gelingt, den Schweinezyklus zum Erliegen zu bringen, was »theoretisch« denkbar wäre, sollte ein Hinweis darauf sein, daß man solche Modellreaktionen nicht als selbstverständlich in der Wirklichkeit unterstellen darf.

Diese Überlegung sollte grundsätzlich auch gegenüber den ablehnenden Argumenten im Hinblick auf Entwicklungsprognosen gelten, die aus der Struktur des »Modells« Marktwirtschaft heraus abgeleitet werden. Gäbe es die – im Modell konstruierbare – sich selbst steuernde Marktwirtschaft in der Wirklichkeit, so würde es auch zwangsläufig keine Entwicklungsschwankungen geben, die als Konjunkturschwankungen oder – strenger gefaßt – Konjunkturzyklen den Wirtschaftswissenschaften seit weit über hundert Jahren so große Erklärungsschwierigkeiten machen.

Es darf bei der Kontroverse über die Nichtzulässigkeit von Entwicklungsprognosen an die vorangegangenen Ausführungen über die Begriffsbestimmung »Prognose« erinnert werden, die es erlauben, eine klare Position zu beziehen. Wenn Prognosen gestellt werden, die für einen bestimmten Zeitraum die gesamtwirtschaftliche oder die Entwicklung einzelner ökonomischer Größen angeben, dann sind es im wissenschaftlichen Sinne Prognosen, sofern sie auf einer theoretischen Basis beruhen, die ihrerseits eine wirklichkeits-erklärende Natur hat⁵³. Ist ein »feed-back-Effekt« real möglich, dann muß die prognostische Aussage so formuliert sein, daß sie in der Bestimmung des zukünftigen Geschehens diese Entwicklung bzw. Entwicklungsmöglichkeit auch enthält. Immer von der Voraussetzung ausgehend, daß diese hypothetische Fundierung der Prognose der Wirklichkeit ökonomischer Zusammenhänge entspricht, kann eben in den Prognosen nicht mehr Wirklichkeitsaussage enthalten sein als in den Hypothesen, von denen man sie ableitet.

Mit diesen Überlegungen muß auch die Fragestellung, ob für den Wirtschaftspolitiker

⁴⁹ Die theoretische Ableitung »antizipativer Reaktionen« findet sich auch immer wieder in der Weltliteratur; so u. a. bei E. A. POE in seiner Erzählung »Der entwendete Brief« (E. A. POE, Erzählungen, München 1959, S. 469f.).

⁵⁰ Vgl. A. HANAU, Schweinezyklus, in: Handwörterbuch der Sozialwissenschaften, Bd. 9, Stuttgart–Tübingen–Göttingen 1956, S. 171 ff.

⁵¹ Zum Beispiel in der Nachkriegszeit in der vierteljährlich erscheinenden Zeitschrift »Agrarwirtschaft«, Hannover, A. Strothe-Verlag.

⁵² A. HANAU und E. WÖHLKEN, Probleme der langfristigen Strukturprognose und der Branchenprognosen im Agrarsektor, in: Diagnose und Prognose, a. a. O., S. 398.

⁵³ Vgl. S. 14.

und Wirtschaftspraktiker »bedingte« oder »unbedingte« Prognosen von Wert sind, konfrontiert werden⁵⁴. Nach der hier getroffenen Definition der Prognose stellt sich die Frage nicht in dieser Form, sondern ist nur in der Alternative »Prognose« oder »Projektion« zulässig⁵⁵. Die recht viel zitierten Sätze von HAHN sind in vielfacher Hinsicht bemerkenswert: »Wirklich rein hypothetische Aussagen darüber, daß aus der Tatsachenkonstellation *X* die Wirkung *Y* folgen muß, sind in der Tat ‚wissenschaftlich‘. Aber solche Aussagen sind nicht das, was man von Prognosen verlangt und verlangen muß. Sie sind nicht Wirtschaftsprognosen, sondern Wirtschaftstheorie«⁵⁶. Prognostizieren hieße also das Abenteuer zu bestehen, ob die Datenkonstellation richtig erkannt worden ist, und es scheint, als ob einer Diagnose der – doch empirisch feststellbaren – Tatsachenkonstellation mit Hilfe der »Theorie« wenig Chancen eingeräumt werden. Es könnte eine wahrhaft klärende Wirkung für eine Diskussion um die Prognose mit all den verschiedensten Aspekten haben, wenn man das Prognostizieren als Anwendung der Theorie verstehen würde.

Schließlich ist im Zusammenhang mit der gestellten Frage nach der Notwendigkeit von Prognosen für das wirtschaftspolitische Handeln ein Argument zu untersuchen, daß sich gegen die Erstellung von Prognosen durch oder im Auftrag für wirtschaftspolitische Instanzen richtet⁵⁷. Es besagt im Kern, daß der Prognostiker nicht sein eigenes Handeln in der Zukunft »prognostizieren« kann. Auch dieses Argument ist implizite bereits durch die Definition der Prognose abgehandelt, wenn man ausschließen darf, daß der Staat auf Grund der ihm zur Verfügung stehenden Zwangsgewalt z. B. ganze Produktionszweige stilllegt oder in anderer Art und Weise die ihm durch die marktwirtschaftliche Organisation der Wirtschaft gesetzten Schranken überschreitet. BOMBACH deckt in einer Fußnote die Problematik auf: »Natürlich könnte man auch annehmen, daß es bestimmte Gesetzmäßigkeiten gibt, die über alle Eingriffe dominieren, ‚natürliche Zuwachsraten‘ oder was auch immer. Die Erfahrung der Nachkriegszeit aber spricht eindeutig dagegen«⁵⁸. Dieses Zitat offenbart symptomatisch, wie sehr in den Wirtschaftswissenschaften die Realanalyse im Sinne empirischer Forschung fehlt, denn der Hinweis auf »Erfahrungen« ist zwar ein immer ernst zu nehmendes Indiz, doch sollte das einer Wissenschaft, die auch um den »Erfahrungssirrtum« weiß, nicht genügen. Man muß also sagen, daß diese Forderung nach Unzulässigkeit »eigener« Prognosen wirtschaftspolitischer Instanzen gültig ist, sofern den im Rahmen der Ordnungsregeln möglichen wirtschaftspolitischen Handlungen die Gestaltungskraft zukommt, die den logischen Widerspruch, daß der Handelnde seine eigenen Handlungen prognostizieren könne, bestätigt. Die Erfahrung zeigt aber in diesem Fall eher die Unzulänglichkeit, in einem eng gezogenen marktwirtschaftlichen Ordnungsrahmen wirtschaftspolitisch auf die zukünftige Entwicklung der Wirtschaft zielorientiert einzuwirken. Vom derzeitigen Stand des Wissens her muß wohl ein definitives Urteil zumindest ungesprochen bleiben. Nachdem die bisherigen Überlegungen dazu geführt haben, daß man alle wesentlichen Einwände, die eine grundsätzliche Ablehnung der Prognose als Voraussetzung wirtschaftspolitischen Handelns beinhalten, als nicht stichhaltig oder als nicht beweisbare Annahmen ansehen kann, sollen die anfänglichen Darlegungen, die den Gedanken von

⁵⁴ Diese Problemstellung spielt z. B. bei W. A. JÖHR und F. KNESCHAUREK, Die Prognose als Basis, a. a. O., S. 421 ff., eine wesentliche Rolle.

⁵⁵ Vgl. S. 14f.

⁵⁶ A. HAHN, a. a. O., S. 410, zitiert auch in W. A. JÖHR und F. KNESCHAUREK, a. a. O., S. 422, und bei K. KÄSTNER, a. a. O., S. 11.

⁵⁷ Vgl. H. GERFIN, Langfristige Wirtschaftsprognosen, Tübingen–Zürich 1964, S. 193 und G. BOMBACH, Über die Möglichkeit, a. a. O., S. 36f.

⁵⁸ G. BOMBACH, Über die Möglichkeit, a. a. O., S. 37, Fußnote 10.

JÖHR und SINGER gefolgt sind⁵⁹, etwas konkretisiert werden. Auch für diesen Zweck geben die beiden genannten Autoren verbindliche Hinweise. Jede empirische Untersuchung wird leicht nachweisen können, daß wirtschaftspolitische Ziele nicht autonom, d. h. nicht ohne Berücksichtigung von gegenwärtigem Zustand und Wirkungseffekt der möglichen Maßnahmen, die zur Veränderung der aktuellen Lage zur Verfügung stehen, gesetzt werden können. Dieser Zusammenhang wird meist deswegen mehr oder weniger vernachlässigt, weil in der Wirtschaftspolitik gerne abstrakte Ziele formuliert werden wie: ausreichendes Wachstum oder verbesserte Versorgung usw. Der angedeutete Bedingungs-zusammenhang zeigt sich, sobald man zu einer numerischen Darstellung übergeht. Dann wird offensichtlich, in welchem Ausmaß die prognostischen Überlegungen – als Voraussetzungen – notwendig sind⁶⁰. Zwangsläufig ergibt sich daraus für die Beschaffenheit der Prognose, daß sie numerische Aussagen liefern muß. Hierin liegt das entscheidende Problem für die zum Handeln gezwungenen politischen Instanzen.

Grundsätzlich ist die Möglichkeit für numerische Prognosen von dem Umstand abhängig, inwieweit das reale ökonomische Geschehen meßbar, d. h. für einen Maßstab überhaupt zugänglich ist⁶¹. Diese Frage ist wiederum nur durch eine Realanalyse abzuklären. Geht aus einer solchen Analyse hervor, daß als »Prognosen« nur qualitative Aussagen gemacht werden können, bleibt der Wirtschaftspolitik nur der Rückgriff auf Projektionen, bei denen es dann allerdings klar ist, daß ihre numerischen Aussagen von ad-hoc-Hypothesen abgeleitet werden. Projektionen, in alternativer Auswahl entwickelt, können für das praktisch-politische Handeln wertvoller sein – trotz der Unsicherheit ihrer hypothetischen Grundlage, aber wegen ihrer numerischen Aussage – als qualitativ formulierte Prognosen; die Entscheidung darüber ist im Hinblick auf den »praktischen Fall« zu treffen.

Nach der Klärung der Bedeutung einer numerisch formulierten Prognose für die Zusammenführung der für ein wirtschaftspolitisches Problem konstitutiven Elemente von Ziel, Lage und Maßnahme bleibt der Hinweis zu erörtern, daß der Prognose eine unterschiedliche Aufgabe gestellt sei, wenn sie einerseits nach der zukünftigen Entwicklung auf Grund der bestehenden Lage und andererseits nach den zukünftigen Auswirkungen auf die Entwicklung bei Einsatz von zur Auswahl stehenden wirtschaftspolitischen Maßnahmen »befragt« wird. Man unterscheidet diese beiden Aufgabenstellungen in der Literatur auch vielfach terminologisch, indem man nach Problem- und Wirkungsprognosen unterteilt⁶². Aus dieser Differenzierung der prognostischen Aufgabenstellung müssen sich erneut Zweifel an der Geltung jener Prognosen bemerkbar machen, die hier mit Problemprognosen bezeichnet werden. Die zugestandene Einwirkungsmöglichkeit wirtschaftspolitischer Maßnahmen auf die Entwicklung der Gesamtwirtschaft oder einzelner ökonomischer Größen scheint es auszuschließen, daß Entwicklungsprognosen, die ohne Berücksichtigung der Wirkungen wirtschaftspolitischer Maßnahmen aufgestellt werden, »richtig« sind. Der Gedankengang spitzt sich auf die Alternative zu, daß entweder die Entwicklungsprognosen (Problemprognosen) richtig sind, dann sind wirtschaftspolitische Maßnahmen sinnlos, oder daß wirtschaftspolitische Maßnahmen

⁵⁹ Vgl. S. 15.

⁶⁰ W. A. JÖHR und H. W. SINGER haben speziell diesen Zusammenhang in der ersten Auflage ihres Werkes (Die Nationalökonomie im Dienste, a. a. O., S. 77) ausführlicher behandelt, als es in der überarbeiteten zweiten Auflage geschehen ist.

⁶¹ Vgl. S. 9.

⁶² Der Terminus »Problemprognose« ist von A. WISSLER in seiner Untersuchung über die Möglichkeiten von Konjunkturprognosen herausgestellt worden: »Konjunkturprognose ist also, wenn sie wissenschaftlich ist, Problemprognose«; A. WISSLER, Empirische Forschung als »exakte« Wissenschaft, in: Wirtschaftsforschung und Wirtschaftsführung, Festgabe für FERDINAND FRIEDENSBURG, Berlin 1956, S. 93 (Hervorhebung im Original).

eben jenen gewünschten Erfolg der Anpassung von Lage und Ziel erreichen können, und dann sind bzw. müssen die Entwicklungsprognosen »falsch« sein⁶³. Derartige Alternativen entstehen, wenn man den Prognosen, und zwar den numerischen Prognosen, die Eigenschaft zuschreibt bzw. stillschweigend unterstellt, den exakten Wert ohne Fehlerbereich vorherzusagen; der Statistiker nennt diese Prognosen »Punktprognosen«. Die Definition der Prognose⁶⁴, wie sie hier getroffen wurde, impliziert in keiner Weise, daß eine Prognose nur dann eine »Prognose« ist, wenn sie in der Angabe eines bestimmten numerischen Wertes besteht, der in der Entwicklung einer ökonomischen Größe im vorausgesetzten Zeitpunkt erreicht werden muß. Aus der Definition leitet sich nur ab, daß solche Punktprognosen dann möglich sind, wenn die Entwicklung ökonomischer Größen auch in der Wirklichkeit so streng determiniert ist. In diesem Falle allein träfe der erste Teil der genannten Alternative zu. Kommen wirtschaftspolitischen Maßnahmen *reale* Gestaltungsmöglichkeiten zu, kann es auch keine Punktprognosen geben. Wenn die Prognosen (Problemprognosen) über ihre theoretische Basis in voller Kommunikation zur Wirklichkeit stehen, werden sie nicht mehr aussagen, als was an Aussagemöglichkeit vorhanden ist.

II. Die grundsätzlichen Aufgabenbereiche von Wirtschafts- und Finanzpolitik in einer marktwirtschaftlich organisierten Volkswirtschaft

a) Der Zusammenhang von Wirtschafts- und Finanzpolitik

Wenn es auch im Rahmen der vorliegenden Arbeit weder zulässig noch möglich ist, eine Wesensbestimmung von Wirtschaftspolitik einerseits und Finanzpolitik andererseits durchzuführen, um zeigen zu können, wie weit eine faktische Identität ihrer Problem-bereiche in der Wirklichkeit besteht, so sollen doch wenigstens einige Grundzüge skizziert werden.

In der Finanzwissenschaft ist eine definitorische Bestimmung der Finanzpolitik als Politik der monetären Mittelbeschaffung seit geraumer Zeit nicht mehr gültig, weil – so darf man sagen – die Gewalt der Fakten dieses Begriffskonzept gesprengt hat. Diese faktische Veränderung bestand in der Expansion der öffentlichen Finanzwirtschaft. »Aus einem kleinen Anhängsel des privaten Wirtschaftssektors war nun ein zentraler Bereich der Volkswirtschaft geworden, der Richtung und Ergebnis des Geschehens weitgehend bestimmte«⁶⁵. Den historischen Verlauf dieser Entwicklung beschreibt WERNER EHR- LICHNER, und er weist nach, daß das wachsende Volumen des Staatshaushaltes seit dem Ersten Weltkrieg die Integration der Finanzpolitik in die Wirtschaftspolitik erzwungen hat⁶⁶. Nachdem einmal erkannt wurde, daß es eine Neutralität des Staatshaushaltes – sowohl in seinem Zustandekommen als auch in seiner Verausgabung – gegenüber der Privatwirtschaft nicht mehr gibt, setzten folgerichtig Überlegungen ein, wie die von der gesamten Staatstätigkeit her ausgehenden ökonomischen Wirkungen zur Steigerung der Funktions- und Leistungsfähigkeit der gesamten Volkswirtschaft ausgenutzt werden könnten. Die Begriffe »Fiscal Theory« und »Fiscal Policy« kennzeichnen das Ergebnis

⁶³ Vgl. E. TUCHTFELD, Die Prognose als Basis der Wirtschaftspolitik, Diskussionsbeitrag, in: Diagnose und Prognose, a.a.O., S. 455.

⁶⁴ Vgl. S. 14.

⁶⁵ H. HALLER, Finanzpolitik – Grundlagen und Hauptprobleme, 4., durchgesehene und verbesserte Aufl., Tübingen–Zürich 1968, i.f.z.a.: Finanzpolitik.

⁶⁶ Vgl. W. EHR LICHNER, Die Bedeutung der Theorie der konjunkturverändernden Momente für die Weiterentwicklung der Finanzwissenschaft, in: F. VOIGT (Hrsg.), Beiträge zur Finanzwissenschaft und zur Geldtheorie, Festschrift für RUDOLF STUCKEN, Göttingen 1953, S. 265 ff.