

Volkswirtschaftliche Schriften

Heft 446

**Der methodologische
Status der Rationalitätsannahme
in der Ökonomie**

Von

Stefan Zundel



Duncker & Humblot · Berlin

STEFAN ZUNDEL

**Der methodologische Status der Rationalitätsannahme
in der Ökonomie**

Volkswirtschaftliche Schriften

Begründet von Prof. Dr. Dr. h. c. J. Broermann †

Heft 446

Der methodologische Status der Rationalitätsannahme in der Ökonomie

Von

Stefan Zundel



Duncker & Humblot · Berlin

Die Deutsche Bibliothek – CIP-Einheitsaufnahme

Zundel, Stefan:

Der methodologische Status der Rationalitätsannahme
in der Ökonomie / von Stefan Zundel. –

Berlin : Duncker und Humblot, 1995

(Volkswirtschaftliche Schriften ; H. 446)

Zugl.: Berlin, Freie Univ., Diss., 1993

ISBN 3-428-08205-2

NE: GT

D 188

Alle Rechte vorbehalten

© 1995 Duncker & Humblot GmbH, Berlin

Fotoprint: Berliner Buchdruckerei Union GmbH, Berlin

Printed in Germany

ISSN 0505-9372

ISBN 3-428-08205-2

Gedruckt auf alterungsbeständigem (säurefreiem) Papier
gemäß der ANSI-Norm für Bibliotheken

Vorwort

Das Interesse, das mich zu dieser Arbeit bewogen hat, hat wohl jeder Student der Wirtschaftswissenschaften während seines Studiums einmal empfunden: Was ist das Besondere an dieser Rationalitätsannahme, die die Ökonomen wie einen Dietrich zur Entschlüsselung jedweden menschlichen Verhaltens benutzen? Selbst der Humor in der Ökonomie basiert zum Gutteil auf einer Denkfigur, bei der auch die absonderlichsten menschlichen Verhaltensweisen als Ausfluß ökonomischer Rationalität gedeutet werden können.

Wie es wohl im Rahmen jeder wissenschaftlichen Arbeit geschieht, so mußte auch in dieser Arbeit das forschungsleitende Interesse letztlich auf einen bestimmten Teilbereich eingegrenzt werden, um zu einem greifbaren Forschungsergebnis zu führen. Diese Engführung ist im Titel durch das Stichwort "methodologischer Status" angezeigt. Mir ging es um den wissenschaftlichen Umgang, den Ökonomen mit der Rationalitätsannahme pflegen.

Ob mein Umgang mit den Ökonomen und ihrem Tun immer fair geblieben ist, muß ich dem Urteil des Lesers überlassen. Die Fehler und Versäumnisse, die in dieser Arbeit enthalten sind, gehen jedenfalls - wie immer in solchen Fällen - zu meinen Lasten.

Daß diese Fehler und Versäumnisse womöglich selten sind, verdanke ich insbesondere meinem Doktorvater Prof. Michael Küttner, dessen präzise Kritik stets hilfreich war. Darüber hinaus möchte ich den Kollegen Jochen Breinlinger-O'Reilly, Hansrudi Lenz und Carsten Georgi für die zahlreichen wertvollen Hinweise danken.

Bei der technischen Erstellung dieser Arbeit bin ich Angelika Wnuk, die das zweifelhafte Vergnügen hatte, meine Handschrift zu lesen, Jürgen Meyerhoff, der das Tohuwabohu der verwendeten Sonderzeichen auf dem PC lichtete, und Simone Leinkauf, die so manchen mir entgangenen Tippfehler beseitigte, zu großem Dank verpflichtet.

Berlin, den 15.12.1994

Stefan Zundel

Inhaltsverzeichnis

A.	Einleitung	11
-----------	-------------------------	----

Erster Teil

B.	Die Familie ökonomischer Rationalitätsbegriffe	21
	I. Ökonomische Rationalität - ein schillernder Begriff.....	21
	II. Zur Systematik ökonomischer Rationalitätsbegriffe	24
	III. Zum Rationalitätsbegriff in der Theorie der Haushalte.....	41
	IV. Zum Rationalitätsbegriff bei Entscheidungen unter Risiko	49
	V. Zum Überprüfungsproblem.....	56

Zweiter Teil

C.	Ökonomische Rationalitätsannahmen aus der Perspektive ausgewählter Positionen des Kritischen Rationalismus	60
	I. Rationalitätsannahmen - eine wissenschaftstheoretische Anomalie	60
	II. Einige Grundzüge und Probleme der Logik der Forschung	62
	III. Poppers Rekonstruktion des methodologischen Status der Rationalitätsannahme.....	71
	IV. Schmidts Rekonstruktion des methodologischen Status der Rationalitätsannahme.....	77

Dritter Teil

D.	Die Rationalitätsannahme aus der Sicht eines geläuterten Empirismus	85
I.	Rationalität als Dispositionsprädikat	87
II.	Die Rationalitätsannahme als metaphysische Aussage.....	98

Vierter Teil

E.	Rationalitätsannahmen als konzeptionelle Aussagen	111
I.	Empirische Anforderungen an die Rekonstruktion von Rationalitätsannahmen	111
II.	Zur Kritik einiger empiristischer Grundannahmen über erfahrungswissenschaftliche Erkenntnis	114
III.	Rationalitätsannahmen als konzeptionelle Aussagen	122
IV.	Rekonstruktion ökonomischer Rationalitätsannahmen als konzeptionelle Aussagen.....	127

Fünfter Teil

F.	Zur Leistungsfähigkeit des ökonomischen Ansatzes bei der Erklärung und Prognose menschlichen Verhaltens.....	130
I.	Der ökonomische Ansatz und seine Gegenstandsbereiche	130
II.	Der ökonomische Ansatz und das Problem der ad hoc-Annahmen.....	134
III.	Präferenzordnungen und vollkommene Information - zwei Probleme des ökonomischen Ansatzes	137

Sechster Teil

G.	Die Rationalitätsannahme und das Werturteilsproblem.....	143
-----------	---	------------

Siebenter Teil

H. Zusammenfassung und Ausblick	149
Anhang	156
Literaturverzeichnis	158

Verzeichnis der verwendeten Symbole

RB_i	i-ter Rationalitätsbegriff
z_i	i-te Zielvariable
x_i	i-te Instrumentvariable
y_i	i-te Datenvariable
z_i	numerischer Wert der i-ten Zielvariablen
x_i	numerischer Wert der i-ten Instrumentvariablen
y_i	numerischer Wert der i-ten Datenvariablen
Z_i^i	i-tes Ergebnis
X_i^i	i-tes Instrument
Y^i	i-ter Umweltzustand
Z_i^i	i-tes Ergebnis in der i-ten Entscheidungssituation
Z_i	i-tes Gesamtergebnis
X_i	i-te Kombination von Alternativen bzw. i-te Gesamalternative
U, U^i, U_j	Nutzenindizes
P^i, P^j	Präferenzindizes
\succsim	mindestens so gut wie
\sim	Indifferenzrelation
$>$	mehr als
t	Zeit, Zeitpunkt
I	Indifferenzmenge
p	Wahrscheinlichkeit
x, y, \dots	Individuenvariablen
a, b, \dots	Individuenkonstanten
Λx	Für alle x gilt:
$\forall x$	Es gibt ein x , für das gilt:
\neg	nicht
\wedge	und
\vee	oder
\rightarrow	wenn..., dann...
\Rightarrow	folgt logisch
P, Q, P_k, P_s	Eigenschaften
R	die Eigenschaft "Rational-Sein"
w, f	Wahrheitswerte: wahr, falsch
S, S_i	Entscheidungssituationen, Problemsituationen eines bestimmten Typs
H, H_i	Handlung eines bestimmten Typs

A. Einleitung

Jene eigentümliche Mischung von erfahrungswissenschaftlicher und methodologischer, von deskriptiver und normativer Diskussion um die Rationalitätsannahme ist mindestens so alt wie die Politische Ökonomie, die die rationale Verfolgung eigener Ziele zum Ausgangspunkt ökonomischen Raisonierens gewählt hat. Ein Beispiel mag das illustrieren. Vielfach wird die Rationalitätsannahme dergestalt mit einer egoistischen Entscheidung identifiziert, daß behauptet wird: Alle Menschen treffen egoistische oder selbstsüchtige Entscheidungen¹. Einer der berühmtesten Vertreter dieser Auffassung, die man in Anlehnung an Birnbacher die These vom "psychologischen Egoismus"² nennen könnte, ist Hobbes, der die fragliche Behauptung in die folgenden Worte kleidet: "Das erste Gut ist für jeden die Selbsterhaltung. Denn die Natur hat es so eingerichtet, daß alle ihr eigenes Wohlergehen wünschen."³

Die Identifikation von Selbsterhaltung mit dem Wunsch nach dem eigenen Wohlergehen, die Hobbes hier unter dem Titel Egoismus vornimmt, ist keineswegs selbstverständlich. Jenen Extrembergsteigern beispielsweise, die um einer Grenzerfahrung willen i.e. ihr eigenes Wohlergehen, ihr Leben immer wieder in Gefahr bringen, kann nur schwerlich unterstellt werden, daß für sie das erste Gut die Selbsterhaltung sei. Joseph Butler argumentierte deshalb, daß der Behauptung, alle Menschen seien letztlich selbstsüchtig, möglicherweise ein Mangel an begrifflicher Differenzierung zugrundeliegen könnte, denn nicht alle Taten, die im eigenen Interesse unternommen werden, lassen sich als Mittel zum Zweck der Selbsterhaltung interpretieren. Programmatisch formuliert er:

"Bei vielen findet sich eine sonderbare Vorliebe dafür, alle besonderen Neigungen hinwegzuinterpretieren und das ganze Leben als eine einzige fortwährende Betätigung der Selbstliebe erscheinen zu lassen. So konnte es zu jener erstaunlichen Verwechslung und Verwirrung kommen, die sich bei den alten Epikuräern, bei Hobbes, bei dem Autor der 'Reflexions ou sentences et maximes morales' (La Rochefoucauld) und allen diesen Schriftstellern findet: die Verwech-

¹ Die Verknüpfung von rationalem Entscheiden und rationalem Handeln ist eine unter mehreren möglichen und auch gebräuchlichen Interpretationen der Rationalitätsannahme; sie ist nicht zwingend und daher auch nicht die einzig mögliche. Vgl. dazu das Kapitel B dieser Arbeit.

² Vgl. Birnbacher 1987, S.165 u. 166

³ Hobbes 1959, S. 24, erstmalig veröffentlicht 1658

lung, Handlungen eigennützig zu nennen, die zu jederlei Eigennutz nachweislich im Widerspruch stehen und lediglich um der Befriedigung einer flüchtigen Leidenschaft willen getan werden. Diese Verwechslung wäre leicht zu vermeiden gewesen, hätte man sich klar gemacht, worin die Selbstliebe ihrem allgemeinen Begriff nach besteht und wie sie sich von den besonderen, auf bestimmte äußere Dinge gehenden Motiven wie den sinnlichen Begierden, dem Zorn, dem Mitleid, der Neugier, dem Ehrgeiz und dergleichen unterscheidet.“⁴

Butler läßt bereits zwei Motive anklingen, die die Diskussion um die Rationalitätsannahme fortan immer begleiten werden. Erstens: die Frage nach dem "richtigen" Begriff für die Rationalitätsannahme. Butler möchte im Gegensatz zu Hobbes einen Unterschied ziehen zwischen der "Selbstliebe" und dem "Eigennutz" einerseits, die wir in Anlehnung an Hobbes als Wunsch nach Selbsterhaltung interpretieren, und den "flüchtigen Leidenschaften", den "sinnlichen Begierden" andererseits. Nur ersteres darf aus seiner Sicht als Egoismus bezeichnet werden, wohingegen Hobbes den "Eigennutz" und die "flüchtigen Leidenschaften" in der Kategorie des Egoismus zusammenfaßt. Die Konsequenz sind zwei unterschiedliche Rationalitätsauffassungen.⁵ Das wird noch einmal deutlich, wenn wir uns dem zweiten Motiv zuwenden, nämlich der Frage, ob die Rationalitätsannahme relativ zu dem gewählten Begriff auch empirisch zutreffend sei. Für Butler ist offensichtlich "das ganze Leben" keine "einzige fortwährende Bestätigung der Selbstliebe". Vielmehr verhalten sich die Menschen häufig irrational, soweit sie jenen "flüchtigen Leidenschaften" nachgehen, "die zu jederlei Eigennutz nachweislich im Widerspruch stehen". Kurz: Er wirft Hobbes vor, daß dessen Menschenbild empirisch unzutreffend sei.

Von dieser sehr alten Debatte um die Bedeutung der Rationalitätsannahme, speziell der Annahme egoistischen Verhaltens, läßt sich mühelos ein Bogen schlagen zu der modernen Diskussion um die Rationalitätsannahme. Daß es mit diesem Begriff auch in der zeitgenössischen Ökonomie eine besondere Bewandnis hat, illustrieren die folgenden Ausführungen von Sen:

"Die Reduzierung des Menschen zu einem selbststüchtigen Tier hängt in diesem Ansatz von einer vorsichtigen Definition ab. Wenn man dich beobachtet, wie du x wählst und y ablehnst, spricht man davon, daß du deine Präferenz für x gegenüber y 'gezeigt' hast. Dein persönlicher Nutzen wird dann einfach als eine numerische Repräsentation dieser 'Präferenz' definiert, indem ein höherer Nutzen der 'vorgezogenen' Präferenz zugeordnet wird. Mit dieser Reihe von Definitionen kannst du kaum umhin, deinen Nutzen zu maximieren, außer durch Inkonsistenz. (...) Aber wenn man nicht widersprüchlich oder inkonsistent ist, dann ist es gleich, ob man ein ver-

⁴ Butler 1896, S. 21 u. 22, erstmalig veröffentlicht 1726

⁵ Die Kontroverse, die hier zwischen Hobbes und Butler skizziert wurde, gibt es auch in der zeitgenössischen Ökonomie, allerdings in modifizierter Form. Die moderne Fragestellung lautet: Ist der Mensch ein lokaler oder ein globaler Nutzenmaximierer? Und es wird darüber gestritten, welche Zeiträume typischerweise einem individuellem Nutzenmaximierungskalkül unterlegt werden dürfen. Vgl. dazu beispielsweise Elster 1987, Seite 33-59.

bissener Egoist, ein wilder Altruist oder ein klassenbewußter Militanter ist, man wird immer so dastehen, als maximiere man den eigenen Nutzen in dieser Zauberwelt der Definitionen.“⁶

Diese karrierende Charakterisierung des Nutzenmaximierungspostulats in der Theorie der Haushalte weist auf eine neuerliche Veränderung der Egoismusannahme und damit auch der Rationalitätsannahme hin. Traditionell wurde in der Ökonomie die Unterscheidung Egoismus/Altruismus an der inhaltlichen Charakterisierung der Wünsche der Individuen, modern gesprochen: an ihren Präferenzen, festgemacht. Aus der Perspektive, die Sen dem Leser nahelegt, kommt es für die Zuschreibung des Egoismus auf die Art dieser Wünsche überhaupt nicht mehr an. Entscheidend ist ausschließlich, ob die Individuen als Nutzenmaximierer dargestellt werden können, und das hängt wesentlich von der Vollständigkeit und Transitivität ihrer Präferenzordnung ab, nicht aber von den Präferenzen selbst.

Entgegen dem häufig geäußerten Verdacht, daß diese Egoismusannahme tautologisch sei, kann heftig darüber gestritten werden, ob die Individuen wenigstens im Regelfall unter noch zu spezifizierenden Bedingungen wie etwa eines Zeitintervalles, in dem sie ihre Präferenzen bekunden, über eine vollständige und transitive Präferenzordnung tatsächlich verfügen. Diese Egoismusannahme - und die damit verknüpfte Rationalitätsannahme - kann empirisch scheitern, aber sie scheitert offensichtlich aus gänzlich anderen Gründen als die Egoismusannahme von Hobbes.

Diese Beispiele signalisieren, daß die Rationalitätsannahme entgegen dem Eindruck, den manche Standardlehrbücher hinterlassen, in der Ökonomie recht unterschiedlich gedeutet wird. Ohne sich einer allzu großen Übertreibung schuldig zu machen, kann man behaupten, daß es in der Ökonomie vermutlich annähernd so viele Bedeutungen der Rationalitätsannahme gibt, wie Autoren, die über sie schreiben.⁷ Es ist daher zweckmäßig, sich einen Überblick über die verschiedenen Rationalitätsbegriffe und deren Beziehungen zueinander zu verschaffen. In Kapitel B werde ich deshalb die aus meiner Sicht bedeutsamen Rationalitätsannahmen in der Ökonomie vorstellen. Mit Hilfe einer Reihe einschlägiger Unterscheidungsmerkmale wird dort den ökonomischen Rationalitätsbegriffen eine Ordnung unterlegt.

⁶ Sen 1984, S.205

⁷ Lenk differenziert beispielsweise für die Sozialwissenschaften 21 Rationalitätstypen und stellt fest, daß diese Liste noch unvollständig sei. Vgl. Lenk 1986, S. 106 ff. Für den engeren Bereich der Entscheidungs- und Handlungstheorie kommt Elster auf etwa ebensoviele Unterscheidungen. Vgl. Elster 1982, S. 111-131. Cohen bedient sich zwar einer größeren Unterscheidung in traditionalistische und nicht-traditionalistische Rationalitätsbegriffe; aber auch diese Unterscheidung läßt sich mühelos zu einer Vielzahl weiter Rationalitätsbegriffe ausdifferenzieren. Vgl. Cohen 1980, S. 531-537.