

Thomas von Lingen
Marktgleichgewicht oder Marktprozeß
Perspektiven der Mikroökonomie

Thomas von Lingen

Marktgleichgewicht oder Marktprozeß

Perspektiven der Mikroökonomie



Springer Fachmedien Wiesbaden GmbH

Die Deutsche Bibliothek — CIP-Einheitsaufnahme

Lingen, Thomas von:
Marktgleichgewicht oder Marktprozeß : Perspektiven der
Mikroökonomie / Thomas von Lingen.

(DUV : Wirtschaftswissenschaft)
Zugl.: Frankfurt (Main), Univ., Diss., 1991
ISBN 978-3-8244-0140-6 ISBN 978-3-322-96172-3 (eBook)
DOI 10.1007/978-3-322-96172-3

© Springer Fachmedien Wiesbaden 1993

Ursprünglich erschienen bei Deutscher Universitäts-Verlag GmbH, Wiesbaden 1993



Das Werk einschließlich aller seiner Teile ist urheberrechtlich geschützt. Jede Verwertung außerhalb der engen Grenzen des Urheberrechtsgesetzes ist ohne Zustimmung des Verlags unzulässig und strafbar. Das gilt insbesondere für Vervielfältigungen, Übersetzungen, Mikroverfilmungen und die Einspeicherung und Verarbeitung in elektronischen Systemen.

Gedruckt auf chlorarm gebleichtem und säurefreiem Papier

ISBN 978-3-8244-0140-6

*Für meine Frau Gabriele
und Theresa Nastasia*

*So schauet mit bescheidnem Blick
Der ewigen Weberin Meisterstück,
Wie ein Tritt tausend Fäden regt,
Die Schifflin hinüber herüber schießen,
Die Fäden sich beegnend fließen,
Ein Schlag tausend Verbindungen schlägt.*

("Bedenken und Ergeben" aus
J.W.v.Goethes Schriften zur
Wissenschaftslehre)

Geleitwort

In diesem Jahrhundert bestand die historische Aufgabe der Theorie des Marktgleichgewichts wohl darin zu zeigen, daß Koordination über Märkte nicht notwendigerweise Chaos schaffen müsse. Dieses aber befürchteten jene, deren Credo im Alleinvertretungsanspruch einer zentral planenden Instanz gipfelte. Im ideologischen Wettrüsten führte die Vision des Pluralismus einer offenen Gesellschaft immer mehr in die Frage hinein, wie denn der Markt als Koordinationsinstrument funktioniere und worin seine chaosvermeidenden Effekte bestehen könnten. Diese Fragestellung machte eine Auseinandersetzung mit den *Prozessen des zu Markte gehens* notwendig. Deren Eigenschaften bzw. jene der Menschen, die sie gestalten waren einer genaueren Analyse zu unterziehen. Die berühmte "*Could it be* - Frage" in der Theorie des Marktgleichgewichts bedurfte einer solchen Ergänzung.

Die Betriebswirtschaftslehre war in den letzten Jahrzehnten eher durch eine Rezeption und Integration von Ergebnissen der Gleichgewichtstheorie, insbesondere der partiellen, gekennzeichnet. In ihren Wurzeln, vor allem den deskriptiv orientierten, stand sie gedanklich vielleicht der Theorie des Marktprozesses näher, dies aber relativ unspezifiziert.

Vor diesem Hintergrund ist die Konzeption des Verfassers anzusiedeln: Auf der Basis der strukturalistischen Wissenschaftstheorie werden synoptische Rechenschaftsberichte zur Gleichgewichts- und zur Prozeßtheorie entwickelt und mögliche Ansatzpunkte einer Evolution von Theorien aufgezeigt, die der primär einzelwirtschaftlichen Ausrichtung in der Betriebswirtschaftslehre eher entsprechen, als dies typischerweise in der Vergangenheit zu beobachten war.

Rudolf Gümbel

Vorwort

Das zentrale Problem ökonomischer Koordination ist die jeweilige historisch-konkrete Ausgestaltung der institutionellen Ordnung der Produktion und Verteilung von knappen Gütern. Eine in anthropologischer Sicht bemerkenswerte Kulturleistung im Rahmen der Ordnung menschlicher Austauschprozesse stellt dabei die Entdeckung des *Marktes* als eine Hierarchien ergänzende Koordinationsinstitution dar. Märkte, wie sie sich z.B. in der Gestalt von Markt-, Messe- und Börsenplätzen in den Zentren von Städten auch räumlich vergegenwärtigen, sind als wichtige Kulminationspunkte zivilisatorischer Evolution von Produktions- und Verteilungsformen anzusehen.

Nun sind Märkte aber nicht direkt beobachtbar, wie man das vielleicht angesichts eines Besuchs von Wochenmärkten oder Messen anzunehmen geneigt ist. Viele Dinge bleiben dabei verborgen. All diese Phänomene zu erhellen ist eine zentrale Forschungsaufgabe der *Mikroökonomik*. Mikroökonomische Theorien entstehen - das ist der Ausgangspunkt der Argumentation dieser Arbeit - nicht voraussetzungslos. Theorienbildung und Theorienbegründung werden durch einen theoretischen Bezugsrahmen vorstrukturiert. Dieser beeinflusst Weltbild, Fragestellungen und Problemlösungsmuster eines Forschers bzw. einer wissenschaftlichen Denkstilgemeinschaft. T.S. Kuhn prägt für diesen Zusammenhang den Begriff *Paradigma*. Auf der Grundlage des von W. Stegmüller präzisierten strukturalistischen Paradigmakonzepts werden in dieser Arbeit das die neoklassische Mikroökonomik prägende *Marktgleichgewichtsdenken* und das durch die neuere österreichische Schule der Nationalökonomie geprägte *Marktprozeßdenken* als konkurrierende Paradigmata für die Analyse mikroökonomischer Phänomene identifiziert und eine Verbindung zwischen erkenntnispsychologischen und erkenntnislogischen Aspekten mikroökonomischer Theorien hergestellt.

Durch ein gleichberechtigtes Zusammenführen der im Ideenwettbewerb stehenden Paradigmata möchte diese Arbeit zum einen ein vertiefendes Verständnis für die mikroökonomische Fokussierung der Ebenen, Strukturen und Strukturelemente kommerzieller Interaktionen und ihrer 'Teilnehmer' eröffnen, zum anderen für die jeweiligen Qualitäten rivalisierender mikroökonomischer Erklärungsmodelle der Marktökonomie sensibilisieren und damit zu einer Überwindung der auch in der Mikroökonomik beobachtbaren erkenntnispsychologischen Isolation von wissenschaftlichen Denkstilgemeinschaften beitragen, die wissenschaftlichen Fortschritt behindern kann.

Die vorliegende Arbeit, eingereicht unter dem Titel "Marktgleichgewicht vs. Marktprozeß - Eine Kritik der zentralen Paradigmata mikroökonomischer Theo-

rienbildung" wurde 1992 vom Fachbereich Wirtschaftswissenschaften der Johann Wolfgang Goethe-Universität in Frankfurt am Main als Dissertation angenommen. Herrn Prof. Dr. Dr. h.c. Rudolf Gümbel in seiner Eigenschaft als Doktorvater gilt mein besonderer Dank - nicht nur für die Erstellung des Erstgutachtens und den wohlwollenden akademischen Freiraum für meine eigene Interpretation und Ausgestaltung, sondern auch für das bereits während des Studiums erfahrene tiefgründige Heranführen an die mit dieser Arbeit verbundene, gemeinhin der Volkswirtschaftslehre zugeordnete Thematik. Seine Forschungs- und Lehrinhalte, in denen er häufig die Zusammenhänge nur scheinbar nebeneinander stehender ökonomischer Problemstrukturen aufzeigt, sind mir schon als Student der Betriebswirtschaftslehre zu einer fruchtbaren Orientierungshilfe geworden.

Herrn Prof. Dr. Reinhard H. Schmidt danke ich für die Bereitschaft, als Zweitgutachter zu fungieren, darüber hinaus für eine konstruktive Diskussion und seine inhaltlichen Anregungen. Meinen Kolleginnen und Kollegen am Seminar für Handelsbetriebslehre verdanke ich eine angenehme Arbeitsatmosphäre. Für die kritische Lektüre des Manuskripts durch meine Lehrstuhlmitarbeiter Diplom Volkswirt Joachim Böhler und Dr. Herbert Woratschek, die mir sehr wertvolle Impulse gaben, bedanke ich mich ebenso, wie bei Herrn Bernd Mendritzki und Herrn Günter Trippe für die Hilfe bei der Erstellung der graphischen Abbildungen.

Was die Unterstützung durch meine Frau Gabriele anbetrifft, so können Worte allein ihren Beitrag zum Gelingen dieser Arbeit nicht ausdrücken. Trotzdem - Dank für die mir gegebene Kraft.

Thomas von Lingen

Inhaltsverzeichnis

I. Einleitung	1
1. Problemstellung und Terminologie	1
2. Struktur und Vorgehensweise	7
II. Methodologische Ordnungsprinzipien mikroökonomischer Theorienbildung	8
1. Vorbemerkung	8
2. Erfahrungswissenschaft und Entwicklung	9
2.1 Wissen, Wissenschaftstheorie und das Sprachspiel Wissenschaft	11
2.2 Das Transformationsproblem zwischen Theorie und Realität	14
3. Ordnungsprinzipien der Transformation	16
3.1 Der kritische Rationalismus	19
3.1.1 Begriffssysteme und das Universalienproblem (Exkurs)	19
3.1.2 Beschreibungssysteme und das Empirismusproblem (Exkurs)	21
3.1.3 Die Perspektive: Erklärungssysteme und das Bewährungsproblem	23
3.1.3.1 Der empirische Informationsgehalt einer Hypothese	26
3.1.3.2 Bewährung von Theorien	27
3.1.3.3 Experimente als Bewährungsinstanz	29
3.1.3.4 Experimentum crucis: Das Design für den Theorienvergleich	31
3.1.3.5 Postulate und Beurteilungskriterien	34
3.1.3.6 Das Aussagenkonzept von Theorien	35
3.2 Der praxeologische Apriorismus	39
3.2.1 Die Perspektive	39
3.2.2 Theorienbewährung	39
3.3 Die modelltheoretisch gestützten Erkenntnistheorien	41
3.3.1 Die Perspektive	41
3.3.2 Analytisch-deduktive Modelle der ökonomischen Disziplin und ihr Bewährungsbezug	42
3.4 Die Kaleidoskopik	45
3.4.1 Die Perspektive	45
3.4.2 Theorien im kaleidoskopischen Weltbild	46

4.	Bemerkungen jenseits der Ordnungsprinzipien	48
4.1	Methodischer Monismus oder methodischer Dualismus in den Erfahrungswissenschaften	48
4.2	Die verstehende Wissenschaftsfunktion	49
4.3	Deutungsansätze des Kriteriums empirischer Informationsgehalt	55
5.	Erkenntnispsychologie und Erkenntnislogik.....	58
5.1	Überblick	58
5.2	Das Paradigma-Konzept.....	59
5.2.1	Die Rekonstruktion des Paradigma-Konzepts und das strukturalistische Theoriekonzept.....	61
5.2.2	Paradigma-Konzept und ökonomische Disziplin	65
5.2.2.1	Zur grundsätzlichen Frage der Übertragbarkeit auf die Ökonomik.....	65
5.2.2.2	Zur Frage der Anwendbarkeit auf koexistierende Paradigmata in der Mikroökonomik	66
III.	Theorien im Rahmen der Paradigmata: Eine Synopse.....	69
1.	Vorbemerkung	69
2.	Grundzüge des Marktgleichgewichts-Paradigmas	70
2.1	Der Strukturkern des Marktgleichgewichts-Paradigmas.....	70
2.1.1	Die logische Struktur des Gleichgewichts-Konzepts.....	70
2.1.2	Der homo oeconomicus.....	72
2.2	Das paradigmatische Anwendungsbeispiel: Elemente der allgemeinen Gleichgewichtstheorie	74
2.2.1	Individualanalyse	74
2.2.1.1	Theorie des privaten Haushalts	74
2.2.1.2	Theorie der Firma	85
2.2.2	Totalanalyse	90
2.2.2.1	Existenz	91
2.2.2.2	Eindeutigkeit.....	95
2.2.2.3	Stabilität.....	96
2.2.2.4	Optimalität	97
2.2.2.5	Aspekte der Geldtheorie in der allgemeinen Gleichgewichtstheorie.....	100
2.3	Hauptspezialisierungen des Basiselements.....	102
2.3.1	Spezialisierungen zur Marktstruktur	104

2.3.1.1	Grundprobleme der Marktstrukturanalyse.....	104
2.3.1.2	Informations- und Property-Rights-Struktur, (Un-)Sicherheit und Transaktionskosten.....	108
2.3.1.3	Marktformen und Marktphasen.....	111
2.3.1.4	Markt(re)aktionsfunktion und Elastizität.....	114
2.3.2	Spezialisierungen zum Marktverhalten.....	120
2.3.2.1	Der ökonomische Ansatz.....	120
2.3.2.2	Wettbewerb und Aktionsparameter (Exkurs).....	121
2.3.2.3	Marktverhalten und Sicherheit.....	124
2.3.2.4	Marktverhalten und technische Unsicherheit.....	126
2.3.2.5	Marktverhalten und Marktunsicherheit.....	130
2.3.3	Spezialisierungen zum Marktergebnis.....	133
2.3.3.1	Marktgleichgewicht und Sicherheit.....	133
2.3.3.1.1	'Law of indifference' und ausgewählte Probleme der vollkommenen Konkurrenz.....	133
2.3.3.1.2	Elementare Preisbildungshypothesen in unterschiedlichen Strukturen unvollkommener Konkurrenz.....	141
2.3.3.2	Konkurrenz als strategisches Spiel.....	151
2.3.3.3	Allgemeines Gleichgewicht und technische Unsicherheit: Das first-best-design.....	156
2.3.3.4	Marktergebnis und Marktunsicherheit: Das second-best-design.....	158
2.3.3.4.1	Marktversagen.....	159
2.3.3.4.2	Markt und Hierarchie.....	163
3.	Grundzüge des Marktprozeß-Paradigmas.....	168
3.1	Der Strukturkern des Marktprozeß-Paradigmas.....	168
3.1.1	Die logische Struktur des Prozeß-Konzepts.....	169
3.1.2	Der homo agens.....	172
3.2	Das paradigmatische Anwendungsbeispiel: Sichtweisen des Marktprozesses.....	174
3.2.1	Individualanalyse.....	174
3.2.1.1	Theorie des Handelns.....	174
3.2.1.2	Unternehmertum.....	178
3.2.2	Totalanalyse.....	181
3.2.2.1	Ordnungstheorie und Marktprozeß.....	182

3.2.2.2	Marktprozeß, Gleichgewicht und Gleichgewichtstendenz	188
3.2.2.3	Der kaleidoskopische Marktprozeß.....	192
3.2.2.4	Aspekte der Geldtheorie im Rahmen des Marktprozeß-Paradigmas	194
3.3	Hauptspezialisierungen des Basiselements.....	197
3.3.1	Spezialisierungen zur Marktstruktur	198
3.3.1.1	Marktsystem und Systemgrenzen.....	198
3.3.1.2	Die Daten	201
3.3.1.2.1	Zeit, Wissen und Erwartung	201
3.3.1.2.2	Verhaltensregeln	203
3.3.1.2.3	Erfahrung, Lernfähigkeit und Motivation.....	205
3.3.1.3	Koordinationslücken, Produktqualitäten und Präferenzen	207
3.3.2	Spezialisierungen zum Marktverhalten	208
3.3.2.1	Die Handlungsperspektive des Wettbewerbsbegriffs ...	208
3.3.2.2	Wettbewerbsparameter	211
3.3.2.3	Erwartung, Unsicherheit und Entscheidung.....	215
3.3.2.3.1	Die Theorie der potentiellen Überraschung.....	216
3.3.2.3.2	Der Ansatz von Shackle im Lichte des Prozeß-Konzepts.....	221
3.3.3	Spezialisierungen zum Marktergebnis	223
3.3.3.1	Preisbildungshypothesen	223
3.3.3.2	Wohlfahrt	230
3.3.3.2.1	Wissenserschließung und Koordination	230
3.3.3.2.2	Zur Effizienz von Preisen und Institutionen.....	233
3.3.3.3	Marktsystem und Evolution	237
IV.	Marktgleichgewicht oder Marktprozeß: Gehalt und Kompatibilität der Paradigmata.....	244
1.	Der wissenschaftstheoretische Gehaltvergleich	246
1.1	Zur Unmöglichkeit des Experimentum crucis	246
1.2	Der relationale Gehaltvergleich	251
1.2.1	Prüfsteine des relationalen Gehaltvergleichs.....	251
1.2.2	Erfahrungswissenschaftlichkeit im Kontext der Basiselemente.	252

1.2.2.1	Marktgleichgewicht und modelltheoretisch gestützte Erkenntnistheorien.....	252
1.2.2.2	Marktprozeß und praxeologischer Apriorismus	259
1.2.2.3	Marktprozeß und kritischer Rationalismus	262
1.2.2.4	Marktprozeß und Kaleidoskopik.....	265
1.2.3	Zu den Spezialisierungen	269
1.2.3.1	Marktstruktur	269
1.2.3.2	Marktverhalten	273
1.2.3.3	Marktergebnis	278
2.	Zur Kompatibilität	285
2.1	These: Die Paradigmata sind kompatibel	285
2.2	Antithese: Die Paradigmata sind inkompatibel	285
2.3	Ansätze zu einer Synthese	287
2.3.1	Vorüberlegungen.....	287
2.3.2	Institutionen und Unternehmertum	288
2.3.2.1	Determinanten von Institutionen und Unternehmertum	290
2.3.2.2	Organisation und Selbstorganisation	297
2.3.3	Unternehmertum und Absatzwirtschaft.....	303
2.3.3.1	Strukturvariable potentieller Marktmodelle	304
2.3.3.2	Entwicklung und Entdeckung von Koordinationslücken	311
2.3.3.2.1	Koordinationslücken und Marktprozeß.....	311
2.3.3.2.2	Ein psychologisches Marktmodell	314
2.3.3.3	Marktorientierte Input-Output-Relationen und Kosten .	320
2.3.4	Zur Koevolution von Markt und Marktmodellen	325
2.3.4.1	Der Markt: System, Struktur und Prozeß	326
2.3.4.1.1	Das Grundmodell der Chaos-Theorie (Exkurs)	328
2.3.4.1.2	Basisaspekte des Systembegriffs (Exkurs)	331
2.3.4.2	Betrachtungen zum Marktsystem als Prozeßstruktur....	334
	Schlußbetrachtung	343
	Literaturverzeichnis	347