

# Inhaltsverzeichnis

<b>Problemstellung und Aufbau der Arbeit</b> .....	19
--	----

## Teil I

### Theoretische Grundlagen und definitorische Abgrenzungen

<b>A. Planwirtschaft</b> .....	21
1. <i>Das idealtypische Modell vollkommener zentraler Planung</i> .....	21
2. <i>Aufhebung der Annahme vollkommener Information</i> .....	23
2.1. Berücksichtigung von vier Quellen der Ungewißheit .....	23
2.1.1. Unbestimmtheit .....	24
2.1.1.1. Stochastisches Umweltverhalten .....	24
2.1.1.2. Prinzipielle Unvorhersehbarkeit bestimmter Ereignisse .....	25
2.1.2. Komplexität .....	26
2.1.3. Beschränkte Rationalität .....	29
2.1.3.1. Neurophysiologische Grenzen der menschlichen Informationsverarbeitungsfähigkeit .....	30
2.1.3.2. Linguistisch bedingte Grenzen der Informationsvermittlung .....	31
2.1.3.3. Irrationalität in Form von Emotionalität .....	33
2.1.4. Opportunismus (= strategisches Verhalten) .....	34
2.2. Konsequenzen .....	36
2.2.1. Aufhebung des einheitlichen Modellrahmens .....	36
2.2.2. Ansatzpunkte für Instrumente zur Bewältigung von U & R .....	37
3. <i>Das reale sowjetische Wirtschaftssystem</i> .....	37
<b>B. Ungewißheit und Risiko</b> .....	38
1. <i>Definition</i> .....	38
1.1. Die Abgrenzung von Knight .....	39
1.2. Die entscheidungsorientierte Definition von Mag .....	40
1.2.1. Ungewißheit .....	40
1.2.1.1. Der Begriff .....	40
1.2.1.2. Das Grundmodell der Entscheidungstheorie .....	41
1.2.1.3. Verschiedene Ausprägungen der Ungewißheit .....	42
1.2.2. Entscheidung .....	44
1.2.3. Risiko .....	44
2. <i>Der Doppelcharakter des Risikos: Reine versus spekulative Risiken</i> .....	45
3. <i>Arten von U &amp; R</i> .....	51

3.1. Vorbemerkungen .....	51
3.2. Primäre (natürliche) versus sekundäre U & R .....	52
3.3. Systemunabhängige versus systemabhängige U & R .....	52
3.4. Plan- versus Markt-U & R .....	53
3.4.1. Plan-U & R .....	53
3.4.2. Markt-U & R .....	54
3.5. Inputrisiko .....	55

Teil II

Die Bedeutung von U & R für eine Planwirtschaft

<b>A. Theoretische Argumente .....</b>	<b>57</b>
1. <i>Argumente, wonach U &amp; R in planwirtschaftlichen Systemen nur geringe Bedeutung zukommt .....</i>	<i>57</i>
1.1. U & R als spezifisch kapitalistische Phänomene .....	58
1.2. Planung als Möglichkeit einer gesamtwirtschaftlichen Problemsicht .....	58
1.2.1. Gesamtwirtschaftliche Informationszentralisation .....	59
1.2.2. Gesamtwirtschaftliche Zielorientierung .....	59
1.3. Weitreichende Möglichkeiten zur Umweltbeeinflussung durch den Zentralplaner .....	60
2. <i>U &amp; R als besonders problematische Einflüsse in einer Planwirtschaft: das Argument der Systeminflexibilität .....</i>	<i>61</i>
<b>B. Argumente, bezogen auf die gegenwärtige, konkrete Entwicklungsphase des Systems .....</b>	<b>62</b>
1. <i>Höherer Entwicklungsstand des Systems .....</i>	<i>62</i>
2. <i>Übergang zur intensiven Strategie .....</i>	<i>63</i>
3. <i>Gestiegene Rolle von Marktelementen .....</i>	<i>64</i>
3.1. Konsumgütermarkt .....	64
3.2. Arbeitsmarkt .....	65
3.3. Außenhandel .....	66
4. <i>Der Einfluß von Reformen .....</i>	<i>67</i>

Teil III

Instrumente zur Bewältigung von U & R

<b>A. Theoretische Grundlagen .....</b>	<b>69</b>
1. <i>Einleitung .....</i>	<i>69</i>
2. <i>Das Klassifikationsschema .....</i>	<i>69</i>
3. <i>Adaption an U &amp; R versus Reduktion von U &amp; R .....</i>	<i>74</i>
4. <i>Instrumente zur Bewältigung von U &amp; R und der „Doppelcharakter“ des Risikos ....</i>	<i>75</i>
5. <i>Zur Frage des effizienten Einsatzes der Instrumente .....</i>	<i>76</i>

6. Zentrale Aspekte der Instrumentalanalyse .....	77
6.1. Systembezug und -bedingtheit .....	77
6.2. Abhängigkeit von der Entscheidungsebene .....	78
<b>B. Informationsbezogene Instrumente .....</b>	<b>79</b>
0. Vorbemerkungen zu informationsbezogenen Instrumenten .....	79
0.1. Definition von Information .....	79
0.2. Empfangene versus gesendete Informationen .....	79
0.3. Information für verschiedene Hierarchieebenen .....	80
1. Statistik .....	82
1.1. Instrumentcharakterisierung .....	82
1.2. Die Organisation: Geschichte, Struktur und das Prinzip der Zentralisation .....	83
1.3. Mängel und Problembereiche .....	84
1.3.1. Falsche Primärangaben .....	85
1.3.2. Beschränkte Zugänglichkeit .....	86
1.3.3. Mangelnde Aussagefähigkeit .....	88
2. Computer .....	89
2.1. Instrumenteinordnung .....	89
2.2. Das gesamtwirtschaftliche Computersystem in der UdSSR .....	91
2.2.1. Geschichte und Struktur .....	91
2.2.2. Mängel und Probleme .....	93
3. Incentives zur Übermittlung wahrheitsgetreuer Informationen .....	95
3.1. Problemstellung .....	95
3.2. Ex ante Information über Produktionskapazitäten .....	96
3.2.1. Das traditionelle System .....	96
3.2.2. Das Weitzman Modell .....	97
3.2.2.1. Das Grundmodell .....	97
3.2.2.2. Die Informationseigenschaften des Modells .....	98
3.2.2.2.1. Die einfachst mögliche Situation .....	98
3.2.2.2.2. Einbeziehung von produktionstechnisch bedingter Ungewißheit .....	99
3.2.2.2.3. Einbeziehung von Anstrengung .....	100
3.3. Ex post Information über erzielte Ergebnisse .....	103
3.3.1. Übertreibung der erzielten Ergebnisse .....	103
3.3.2. Untertreibung der erzielten Ergebnisse .....	105
4. Preise .....	106
4.1. Informationsfunktion .....	106
4.2. Zentrale versus Betriebe als Informationsempfänger .....	107
4.3. Preise als Informationsträger im sowjetischen planwirtschaftlichen System .....	110
4.3.1. Kosteninformation .....	111
4.3.2. Nachfrage- und Präferenzinformation .....	112
4.4. Perspektiven einer Preisreform .....	113

<b>C. Entscheidungsbezogene Instrumente</b>	114
0. Vorbemerkungen zu entscheidungsbezogenen Instrumenten	114
1. Modifikation der Entscheidungsregeln	115
1.1. Vorüberlegungen zum Instrumentcharakter	115
1.2. Deterministische Modelle	115
1.2.1. Der „certainty equivalent“ Ansatz	116
1.2.2. Sensitivitätsanalyse und parametrische Programmierung	117
1.2.3. Erstellung einer Entscheidungsmatrix	118
1.3. Stochastische Modelle	120
2. Flexibilisierung der Planentscheidungen	121
2.1. Instrumenteinordnung und Abgrenzung	121
2.2. Unterschiedliche Formen der Planflexibilisierung	122
2.2.1. Das Strategiekonzept als Oberbegriff	122
2.2.2. Der theoretische Extremfall: Kontingenzplanung	123
2.2.3. Rollende Planung	126
2.2.3.1. Theorie	126
2.2.3.2. Praxis in der Sowjetunion	128
2.2.4. Ereignisplanung	128
2.3. Gegenüberstellung der Vor- und Nachteile	131
3. Leitung	133
3.1. Definition und Kennzeichen	133
3.2. Einordnung als Instrument	135
3.3. Bedeutung innerhalb des sowjetischen, planwirtschaftlichen Systems	137
3.4. Exkurs: Leitung als Ursache von U&R	138
<b>D. Ergebnisbezogene Instrumente</b>	139
0. Vorbemerkungen zu ergebnisbezogenen Instrumenten	139
1. Reserven	140
1.1. Allgemeine Vorüberlegungen	140
1.1.1. Instrumenteinordnung und Funktionen	140
1.1.2. Allgemeine Effizienzüberlegungen	142
1.1.2.1. Kosten	143
1.1.2.2. Horizontale Effizienzaspekte	144
1.1.2.3. Vertikale Effizienzaspekte	146
1.1.2.4. Abwägung zu anderen Instrumenten	146
1.1.2.5. Exkurs: Das Phänomen der „angespannten Pläne“ als „negative“ Form der Reservehaltung	147
1.2. Unterschiedliche Reservetypen	148
1.2.1. Materielle Reserven	148
1.2.1.1. Reserven an Arbeitsgegenständen	149
1.2.1.1.1. Formen	149
1.2.1.1.2. Ebenen der Reservehaltung	149
1.2.1.1.3. Empirische Daten	152

1.2.1.2. Kapazitätsreserven .....	153
1.2.1.3. Arbeitskräftereserven .....	154
1.2.2. Monetäre Reserven .....	156
1.2.2.1. Formen und Anwendungsebenen .....	156
1.2.2.2. Funktionen und Voraussetzungen .....	161
2. Versicherung .....	164
2.1. Thematische Eingrenzung .....	164
2.2. Instrumenteinordnung .....	165
2.3. Kurzer historischer Überblick .....	166
2.4. Versicherung in einer „reinen“ Planwirtschaft .....	167
2.4.1. Keine Versicherbarkeit des Gesamtkollektivs .....	167
2.4.2. Das Argument der Dominanz der Realsphäre .....	168
2.4.3. Zentrale Einzelfallentscheidungen .....	169
2.4.4. Das Argument der Organisationskosten .....	169
2.5. Versicherung und Chozrascet .....	171
2.5.1. Entstehung einzelwirtschaftlicher Einheiten .....	171
2.5.2. Das Argument der korrekten Abrechnung .....	171
2.5.3. Das Argument der Unabhängigkeit von administrativen Einzelentscheidungen .....	172
2.5.4. Das Argument der Anreizwirkungen .....	173
2.5.5. Notwendige Ergänzung: Flexible Bezugsmöglichkeiten materieller Ressourcen .....	173
2.5.6. Ein Präzedenzfall: Die Versicherung der Sovchosen .....	174
2.6. Versicherung genossenschaftlichen Eigentums .....	175
2.6.1. Argumente zur Begründung der Versicherung genossenschaftlichen Eigentums .....	175
2.6.2. Die sowjetische Praxis .....	175
2.7. Zur Frage der Entscheidungskompetenz .....	176
3. Prioritätsrationierung .....	177
3.1. Darstellung und Einordnung des Instruments .....	177
3.1.1. Definition .....	177
3.1.2. Verhältnis zu anderen Instrumenten .....	178
3.1.3. Zur Frage der Hierarchieebene .....	179
3.2. Theoretische Modelle .....	179
3.2.1. Grundlagen .....	179
3.2.2. Das Modell von Dolan .....	181
3.2.2.1. Vorbereitungsphase .....	181
3.2.2.2. Reaktionsphase .....	182
3.2.2.3. Wirksamkeit als ergebnisbezogenes Instrument zur Risikobewältigung ..	182
3.2.2.4. Kritische Würdigung des Modells .....	182
3.2.3. Das Modell von Manove .....	183
3.2.3.1. Vorbereitungsphase .....	184
3.2.3.2. Reaktionsphase .....	189
3.2.3.3. Kritische Würdigung des Modells .....	190
3.3. Die sowjetische Realität .....	191

4. Technologische Flexibilisierung .....	192
4.1. Auf der Inputseite .....	193
4.1.1. Relevante Risikoart .....	193
4.1.2. Bezogen auf ein Produkt und mehrere Faktoren .....	193
4.1.2.1. Das „reine“ Modell .....	193
4.1.2.2. Einbeziehung von Reserven .....	196
4.1.3. Bezogen auf mehrere Produkte und einen Faktor .....	198
4.2. Auf der Outputseite .....	199
4.2.1. Relevante Risikoart .....	199
4.2.2. Praktische Umsetzung und Messung .....	200
4.3. Effizienzüberlegungen .....	200
<b>E. Instrumente zur Veränderung der Rahmenbedingungen .....</b>	<b>202</b>
0. Vorbemerkungen zu Instrumenten zur Veränderung der Rahmenbedingungen .....	202
1. Prioritätsplanung .....	203
1.1. Definition .....	203
1.2. Instrumenteinordnung .....	204
1.3. Die Praxis in der Sowjetunion .....	205
2. Vertikale Integration .....	206
2.1. Definition .....	206
2.2. Verschiedene Begründungen vertikaler Integration .....	207
2.2.1. Produktionstechnische Gründe und Kosteneinsparungen .....	207
2.2.2. Reduktion von U & R .....	208
2.2.2.1. Statische U & R .....	208
2.2.2.2. Dynamische U & R .....	208
2.3. Instrumenteinordnung .....	209
2.3.1. Aus der Sicht der Organisationstheorie bzw. des Principal-Agent Ansatzes ..	209
2.3.2. Aus der Sicht des Klassifikationsschemas der vorliegenden Arbeit .....	210
2.4. Vertikale Integration auf Betriebsebene .....	211
2.4.1. Statische und dynamische U & R als Auslösefaktoren .....	211
2.4.2. Anwendungsbereiche und Ausmaß .....	213
2.4.3. Kosten der betrieblichen vertikalen Integration .....	213
2.4.3.1. Alternativkosten in Form von Effizienzverlusten .....	214
2.4.3.2. Einzelwirtschaftliche Kosten .....	214
2.4.4. Eine Neuentwicklung: Konzerne .....	216
2.5. Vertikale Integration durch administrative Entscheidungen auf mittlerer und höchster Ebene .....	217
2.5.1. „Vermischung“ der Branchenstruktur bei Ministerien .....	217
2.5.2. Formen der vertikalen Integration mit Billigung der Zentrale .....	218
3. Direkte Beziehungen und Kontrakte .....	220
3.1. Die Rolle von direkten Beziehungen und Kontrakten im sowjetischen planwirtschaftlichen System .....	220
3.2. Wirkungsweise .....	221
3.2.1. Informationsfunktion .....	221

3.2.2. Incentivefunktion .....	222
3.2.2.1. Koppelung an Kennziffern .....	224
3.2.2.2. Vertraglich vereinbarte Sanktionen .....	225
3.3. Entscheidung über den Instrumenteneinsatz .....	226

## Teil IV

### Risikoallokation

<b>A. Theoretische Vorüberlegungen zur Risikoallokation .....</b>	<b>229</b>
1. Versuch einer Definition .....	229
2. Verschiedene Konstellationen für Risikoallokation und Risikotransfer .....	231
2.1. Risikoallokation bei „privaten Risiken“ .....	232
2.1.1. Fälle des reinen „Risk-Sharing“ .....	232
2.1.2. Principal-Agent-Konstellationen .....	233
2.2. Risikotransfer bei „öffentlichen Risiken“ .....	234
2.2.1. Kompensierende Variation anderer Variablen .....	234
2.2.2. Ausklammerung relevanter Variablen .....	236
3. Effiziente Risikoallokation .....	237
3.1. Konzept der allokativen Effizienz .....	237
3.2. Konzept der X-Effizienz .....	240
4. Risikoallokation und Risikoumfang .....	242
4.1. Ineffizient geringe Risikobelastung .....	242
4.2. Ineffizient hohe Risikobelastung .....	243
4.3. Die zentrale Bedeutung der Risikoallokation .....	244
<b>B. Besonderheiten und Probleme der Risikoallokation im sowjetischen planwirtschaftlichen System .....</b>	<b>244</b>
1. Risikoallokation im reinen zentralistischen Idealmodell .....	244
1.1. Der staatliche geplante Sektor .....	244
1.2. Nicht geplante Bereiche .....	245
2. Dezentralisation und Risikoallokation .....	246
3. Alternative Mechanismen zur Risikoallokation und ihre Problematik im sowjetischen planwirtschaftlichen System .....	248
3.1. Administrative Risikoallokation .....	248
3.1.1. Entlohnungssystem .....	250
3.1.2. Rechtssystem .....	250
3.1.3. Rationierungsmechanismus .....	253
3.1.4. Zwangsversicherung .....	254
3.2. Individuelle, marktmäßige Risikoallokation .....	254
3.2.1. Freiwillige Versicherung .....	255
3.2.2. Kontrakte .....	255
3.2.3. Investitionsbanken .....	257

<b>C. Spezielle Bereiche der Risikoallokation</b>	257
1. <i>Staatliche Betriebe</i>	258
1.1. Das Lohn- und Prämiensystem	258
1.1.1. Fixe Entlohnung	258
1.1.2. Das traditionelle Lohn- und Prämiensystem	259
1.1.3. Das zweite Modell des Chozrasçet	261
1.2. Vertikale Risikoallokation	262
1.3. Horizontale Risikoallokation	264
2. <i>Landwirtschaftlicher Sektor</i>	266
2.1. Vorgehensweise und These	266
2.2. Das theoretische Modell	267
2.2.1. Die Konstellation der Risikoallokation	267
2.2.2. Alternative Kontraktformen	268
2.2.3. Effiziente Risikoallokationen	270
2.3. Anwendung des Modells auf den Kolchos: Varianten der Risikoallokation	271
2.3.1. Naturalablieferungen und Procurement-Preise	272
2.3.2. Privates Hofland	273
2.3.3. Garantierter Mindestlohn	274
2.3.4. Versicherung	274
2.3.5. Steuer	276
2.4. Sovchos	277
2.5. Schlußfolgerungen aus dem Modell	277
<b>Schlußbetrachtung</b>	279

## Anhänge

### Anhang A zu Teil III, Abschnitt A

<b>Zahlenbeispiel zur Wirkungsweise der vier Instrumentgruppen</b>	281
1. <i>Einleitung</i>	281
1.1. Modellrahmen	281
1.2. Ausgangssituation	283
1.2.1. Wahre Situation	283
1.2.2. Einschätzung durch den Betrieb	284
2. <i>Instrumente</i>	284
2.1. Anlegen von Reserven	284
2.1.1. Wahre Situation	285
2.1.2. Einschätzung durch den Betrieb	286
2.2. Information als Instrument	286
2.3. Entscheidungsbezogene Instrumente	288
2.3.1. Verlagerung der Entscheidung	288
2.3.2. Verbesserung der Entscheidungsregel	289
2.4. Veränderung der Rahmensituation	291



3. Mögliche Erweiterungen und Modifikationen des Beispiels .....	291
3.1. Die Planzentrale als Entscheider .....	292
3.2. Verschiedene Ausprägungen der „wahren“ Situation .....	292
3.3. Zusammenhänge zwischen der Matrixdarstellung und der Risikoertragsfunktion .....	293

#### **Anhang B zu Teil III, Abschnitt B.3.2.2.2.**

<b>Mathematische Herleitung zum Weitzman Modell .....</b>	<b>296</b>
---	------------

#### **Anhang C zu Teil III, Abschnitt D.1.2.2.**

<b>Entwicklung der Spareinlagen in der UdSSR .....</b>	<b>298</b>
--	------------

#### **Anhang D zu Teil III, Abschnitt D.3.2.3.**

<b>Zahlenbeispiel zum Rationierungsmodell von Manove .....</b>	<b>299</b>
--	------------

<b>Quellenverzeichnis .....</b>	<b>302</b>
---------------------------------	------------