

Wann und wie instrumentalisieren Menschen die Unbedachtheit ihrer Mitmenschen und die Möglichkeit, Entscheidungen auf Mittelsleute zu delegieren, für eigennützige Zwecke? Die Studien der vorliegenden Dissertation untersuchen diese Frage in drei verschiedenen Kontexten: Für Karriereentscheidungen juristischer Nachwuchswissenschaftler in Deutschland, für wirtschaftliche Führungsentscheidungen mit ökologischen Auswirkungen in Deutschland und den USA, und für die Zusammenarbeit zwischen weißen und schwarzen Studenten im Südafrika nach Ende der Apartheid.



ISBN 978-3-00-051495-1



HAMANN Behavioral Second-Order Strategies

Hanjo Hamann

Behavioral Second-Order Strategies

Hanjo Hamann

Behavioral Second-Order Strategies

Exploiting Market Myopia and Agent Delegation
in Economic Decision-Making

Dissertation zur Erlangung des akademischen Grades doctor rerum
politicarum (Dr. rer. pol.), vorgelegt dem Rat der Wirtschaftswissenschaftlichen
Fakultät der Friedrich-Schiller-Universität Jena am 28. Oktober 2015 von
Dr. iur. Hanjo Hamann, geb. am 7. Februar 1987 in Dresden



Gutachter:

1. Professor Dr. Oliver Kirchkamp, Friedrich-Schiller-Universität Jena
2. Professor Dr. Christoph Engel, Rheinische Friedrich-Wilhelms-Universität Bonn

Datum der Verteidigung: 8. Januar 2016

ISBN 978-3-00-051495-1

Die Deutsche Nationalbibliothek verzeichnet diese Publikation in der Deutschen Nationalbibliografie; detaillierte bibliografische Daten sind im Internet über <http://dnb.dnb.de> abrufbar.

© Raspberry SciPress 2016.

Logogestaltung: Luis Prado (www.behance.net/luisprado), Fruit Picking, veröffentlicht per CC-BY-3.0-US unter www.thenounproject.com (ID 4147).

Meinem Bruder, der vielleicht
genauso gespannt ist wie ich
wo ihn sein Weg hinführt.

Vorwort

Die vorliegende Arbeit ist ein Projekt, das ich mir vor einigen Jahren noch nicht hätte träumen lassen. Als ich 2010 am Bonner Max-Planck-Institut eine juristische Dissertation begann, hatte ich zwar durchaus vor, über die Grenzen meines eigenen Fachs hinauszublicken. Dass ich dabei aber gleich mit beiden Beinen in einem ganz anderen Land landen könnte, hätte ich damals nie vermutet.

Und doch kam es so: Parallel zu meiner juristischen Dissertation, die 2014 unter dem Titel „Evidenzbasierte Jurisprudenz“ als Buch erschien und erfreulich wohlwollend aufgenommen wurde, entstanden mehrere empirische Studien zum menschlichen Verhalten in sozialen Interaktionen bei Ressourcenknappheit – jenem Forschungsgebiet, das als „Verhaltensökonomik“ (*behavioral economics*) in den letzten Jahren rasante Fortschritte gemacht hat.

Diese verhaltensökonomischen Studien waren durch juristische Fragen inspiriert, entfernten sich schließlich aber so weit von meinem ursprünglichen Fach, dass einer meiner Gutachter den Versuch, eine dieser Studien in meine juristische Doktorarbeit zu integrieren, mit den Worten quittierte:

„Ich empfehle für den Druck der Arbeit, die 25 Seiten des § 5 abzuspalten und in einer sozialwissenschaftlichen Zeitschrift zu veröffentlichen. Dieser § 5 ist eine Art Appendix, im Gesamtgefüge der Arbeit nicht notwendig.“

Was der Gutachter vielleicht nicht wusste: Wiewohl jene 25 Seiten im Vergleich zu den anderen 389 Seiten meiner juristischen Doktorarbeit ganz unwesentlich erscheinen mussten, hatten sie den mit Abstand größten Aufwand verursacht. Zu jenem Zeitpunkt hatten meine beiden Koautoren und ich bereits zwei Jahre Arbeit investiert, 17 Durchgänge unseres Experiments durchgeführt, ich hatte die Studie bei Konferenzen und Seminaren in Deutschland, China und den USA vorgestellt – und entsprechend oft überarbeitet. Dass das alles „im Gesamtgefüge ... nicht notwendig“ gewesen sein sollte, wollte ich nicht wahrhaben – und setzte prompt den Vorschlag des Zweitgutachters in die Tat um: Die Studie erschien Anfang 2015 in der sozialwissenschaftlichen Zeitschrift *Review of Law & Economics* und bildet nun den einen Teil der vorliegenden Arbeit.

Andere Studien folgten, und nun liegen drei davon abgeschlossen vor. Sie erscheinen hier chronologisch in der Reihenfolge, in der sie durchgeführt wurden. Damit spiegelt diese Reihenfolge zugleich die Dramaturgie meiner Grenzüberschreitung: War die erste Studie noch durch intensive Beobachtung des juristischen Fachdiskurses geprägt (wenn auch „von außen“ mittels ökonomischer Forschungsmethoden), nutzte bereits die zweite Studie ihre juristische Ausgangsfrage nur noch als Anregung zur

Erforschung allgemeiner mikroökonomischer Konzepte – für reine Rechtswissenschaftler eben „eine Art Appendix“. Die dritte Studie schließlich vollzog den Übergang zur „reinen“ mikroökonomischen Grundlagenforschung, für die sich zwar durchaus juristische Anwendungen denken lassen (die wir in den Schlussbemerkungen auch andeuten), ebenso gut aber ethische, politische oder andere für die Gestaltung des gesellschaftlichen Miteinanders relevante.

Mit dieser knappen Kontextualisierung soll es hier bewenden; eine genauere Darstellung und Einordnung der drei Studien findet sich in der Einführung.

Für Unterstützung bei der vorliegenden Arbeit ist vielen Menschen zu danken. Allen voran meinen Koautoren Christoph Engel, Sven Fischer, Sebastian Goerg und Nicky Nicholls, von denen ich so vieles lernen durfte und mit denen das Arbeiten großen Spaß gemacht hat. Daneben danke ich – auch im Namen dieser Koautoren – den Freunden und Kollegen, die unsere Studien durch ihre Diskussionsbereitschaft und Kritik bereicherten und deshalb an prominenterer Stelle erwähnt werden sollten als in den kleingedruckten „Sternchen-Fußnoten“: Eckart Büren, Michael Dorff, Andreas Engert, Kristoffel Grechenig, Ioanna Grypari, Yoan Hermstrüwer, Oliver Himmler, Jonathan Klick, Mishwell Mathebula, Klaus-Ulrich Schmolke und Alexander Zimmer.

Ihnen danke ich zugleich stellvertretend für die Namenlosen: 748 Proband(inne)n meiner vier Verhaltensexperimente in Bonn und Pretoria, von denen ich nur noch ihre Unterschrift auf einer Quittung kenne, ebenso wie ungezählten aufmerksamen Teilnehmern verschiedener Konferenzen (insb. CELS Chicago 2011, APESA Xiamen 2011, WELS Los Angeles 2012, IMEBE Madrid 2013, EALE Warschau 2013), denen ich meine Studien vorstellte und oft genug wertvolle Verbesserungsvorschläge verdanke. Mindestens eine Person fällt in beide Kategorien: Elina K., die als Studentin in Bonn an einem meiner Experimente teilnahm und zwei Jahre später als Kollegin auf einer Konferenz das von mir geschilderte Experiment wiedererkannte. Sie versicherte mir glaubwürdig, dass ihr die Teilnahme an meinem Experiment keinen Spaß bereitet hatte – umso besser bleibt mir deshalb jener während der Konferenz in Erinnerung.

Niemand aber hat an dieser Arbeit so großen Anteil wie Professor Oliver Kirchkamp, der mich und meine Kollegen in den Jahren 2010–2012 durch die jährlichen Jenaer Sommerschulen unserer Graduiertenschule führte und meinen Plan, die vorliegende Arbeit in Angriff zu nehmen, mit Wohlwollen und Ermutigung bedachte, sowie Professor Christoph Engel, der meine Studien aus Mitteln der Max-Planck-Gesellschaft großzügig finanziert und mich stets auch ideell gefördert und gefordert hat.

Nicht vergessen will ich auch diejenigen, die unermüdlich hinter den Kulissen tätig waren, damit meine Arbeit an der Dissertation in jedem Schritt reibungslos verlaufen konnte: Heidi Morgenstern und Regina Goldschmitt samt ihrer jeweiligen Mitarbeiter vom Max-Planck-Institut für Gemeinschaftsgüter in Bonn, Tobias Uske, Susanne Büchner und den Hilfskräften der internationalen Max-Planck-Graduiertenschule (IMPRS) *on Adapting Behavior in a Fundamentally Uncertain World* ebenso wie Holger Gerhardt vom Laboratorium für experimentelle Wirtschaftsforschung der Universität

Bonn (*BonnEconLab*) und Kristina von Rhein als Fakultätsgeschäftsführerin der Wirtschaftswissenschaftlichen Fakultät an der Friedrich-Schiller-Universität Jena.

Mein letzter Dank gilt – wieder einmal – meinen Eltern und nun auch meinem Bruder, der mir bei der Datencodierung für eine Studie half, die es leider nicht in die vorliegende Auswahl geschafft hat. Ihm ist diese Arbeit gewidmet.

Tübingen, im Oktober 2015

Hanjo Hamann

PS: Dem Dank bei Helfern folgt in sozialwissenschaftlichen Studien oft die Übernahme der Restfehlerverantwortung durch den demütigen Nachsatz: *All remaining errors are mine*. (Google Scholar fand diesen Satz am 18. Oktober 2015 über 6.000 Mal.) Wenn ich das nicht tue, so allein deshalb, weil ich es mit Billy Joel für selbstverständlich halte:

*„You’re not the only one who’s made mistakes
But they’re the only things that you can truly call your own.“*

(You’re Only Human – Second Wind 1985).

Inhaltsverzeichnis

Vorwort	V
Einführung	1
1. Aufbau der Arbeit.....	1
2. Einordnung der Forschungsthemen	1
3. Wichtigste Erkenntnisse	3
4. Würdigung der Autorenbeiträge	4
Studie 1: The Hog-Cycle of Law Professors	7
1. Introduction.....	9
2. Theory and Hypothesis	11
3. Data	14
4. Pure Autocorrelation.....	17
5. Adding Control Variables	18
a) Time Trend	19
b) Birth Cohort	20
c) Student Cohort.....	22
d) Alternative Career Options	24
e) Available Positions in Academia	26
f) Robustness of Our Preferred Model	28
6. Conclusions	31
Literature.....	35
Studie 2: Cui Bono, Benefit Corporation?	37
1. Introduction.....	38
2. Design	41
2.1 Treatments.....	43
2.2 Experimental procedure.....	46
3. Hypotheses.....	47
4. Results.....	49
5. Summary and Discussion.....	55
Appendix	58
Instructions Part 1	61
Instructions Part 2 (Control)	63
Instructions Part 2 (NoComp**)	64
Instructions Part 2 (Comp**)	66
References	67

Studie 3: Gumáshtas in Our Midst	71
1. Introduction.....	73
2. Literature	74
2.1 Economics of Group Identity.....	74
2.2 Economics of Delegated Agency	74
2.3 Trust in South Africa	75
2.4 Synthesis	76
3. Design	77
3.1 Workhorse: Trust Game	77
3.2 Experimental Factors: Intermediation, Identity, Knowledge	77
3.3 Treatment Variation: 2x2x2 Within Subjects	78
3.4 Experimental Protocol	78
4. Hypotheses.....	80
5. Results.....	81
5.1 Demographics.....	81
5.2 Descriptives: Trust and race in South Africa	81
5.3 Hypotheses: Identity and In-group bias	82
5.4 Hypotheses: Expectations and Delegation	84
5.5 Hypotheses: Strategic Use of Identity in Delegation.....	85
6. Concluding Remarks.....	88
Literature	89
Zusammenfassung	93
Sachregister	97
Erklärung nach § 4 Abs. 1 PromO.....	102

Sachregister

- Abitur 22
- academia 26 ff., 32
 - see also* post-doctoral position
- affluence 21
- Africa 75 *see also* South Africa
- agency costs 56
- agent, definition of 75
- agricultural economics 11
- anti-cyclical investment 32, 94
- apartheid 73, 82, 95
- applied research 89
- apprentice system 12
- Arbeitsmarktprognose 4
- Arrelano Bond model 30
- attorney 18 *see also* law firm
- autocorrelation 10, 17 ff., 29

- backward induction 77
- bargaining 42, 89
- beauty contest 2, 32
- benefit corporation 38 ff., 57
- Ben & Jerry's 40
- Bengali textile industry 73
- Berle-Means paradigm 44, 76, 88 f.
- birth cohort 20 ff.
- Black Econ. Empowerment (BEE) 73
- blame shifting 75, 88
- Bonn Constitution *see* Grundgesetz
- BonnEconLab 46
- British Columbia (Canada) 39
- Bucerius Law School (Hamburg) 13

- Cape Town, University of 74
- career options (lawyers) 24 ff. *see also*
 - academia, attorney, judge
- Central Institute for Social Issues (Germany) 47
- charitable organization 42, 43, 46 f.
- chi square test *see* X² test
- Chicago, Universität 1
- Click-UP 78
- clustered standard errors 79
- cobweb theorem 3, 12, 31
- cognitive bias 75
- Communism 14
- competition, among managers 44 *see also* entrenched manager
- Corporate Governance Code (Germany) 41, 42 f., 45 f., 48, 52, 56
- corporate greed 39, 58
- corporate social responsibility (CSR) 39, 42, 58
- corporation, theory of 88
- corruption 75
- criminal law professors 15
- Cronbach's alpha 54
- culture 75

- Delaware (United States) 39
- delegation 74 f., 77
- demographic information 47, 79
- detrending 29
- dictator game 41 ff., 47, 55, 76, 81 f.
- difference-in-differences 41
- differentiation, social 74
- Dr. juris 12, 24
- dual mission 40
- DZI *see* Central Institute for Social Issues (Germany)

- East India Company 73
- education revolution 22
- EBS University (Wiesbaden) 13
- enabling function 40

endogenous institutional choice 58
 endowment effect 75
 enforcement 42, 73
 entrenched manager 48, 49 *see also*
 competition, among managers
 Ethikrichtlinien 5
 ethnicity 76
 exogenous shock 12, 26, 28
 experimental economics 42
 see also laboratory experimentation
 expropriation of funds 47
 external validity 89

 face validity 88
 family planning 21
 Federal Bureau of Statistics (Germany)
 20, 22, 27
 Federal Ministry of Justice (Germany)
 24
 feedback 79
 field research 41
 first differences 29
 focal points 42
 framing 42 ff., 47, 89
 frustration 54

 game theory 77
 general public 40, 43, 56
 German Democratic Republic (GDR) 14
 generalized least squares (GLS) regres-
 sion 53, 60 f.
 globalization 73
 Gordon Gekko 39
 Great Britain *see* United Kingdom
 gross national product (GNP) 25 f.
 Grundgesetz 40
 gumashta 73

 habilitation 9, 31, 33, 93
 Hanseatic University (Rostock) 13
 Harvard University 76
 Hatfield *see* Pretoria, University of
 heritage 73
 hog cycle 8 ff., 94

 homo oeconomicus 1
 honorary professor 15
 Huber-White robustness 17

 identity economics 2, 74
 see also social identity
 image awareness 54
 incentives, effect of 56
 India 73
 indirect agency 75
 inequality aversion 48, 78
 in-group 74, 80, 88, 95
 instrumentation 30
 interaction effect 54, 79
 investment game 75, 89

 Jackson's indifference 76
 judge / judiciary 18, 24, 25
 Jura 1, 93
 justice sensitivity 47, 54

 Kürschners Gelehrtenkalender 14 f.

 laboratory experimentation 41, 78
 law firm 24, 25
 learning dynamics 88
 level-k reasoning 33
 Likert items 55
 logistic regression (logit) 51, 60, 80
 lying 75

 manager market 44
 Mann-Whitney U test 52, 54
 Markt(wirtschaft) 1, 3
 meta-analysis 75, 77
 Mikroökonomik 1 f.
 minimal firm 77, 88 f.
 minimal group paradigm 74
 mixed effects 51, 60
 moral psychology 75
 multinomial *see* logistic regression

 Nachhaltigkeit 94
 National Library (Germany) 4, 14

nature, move of 77
 Nazi era 21, 41 *see also* World War II
 non-agricultural sector (South Africa)
 80
 norm / ~ative expectation 42 f., 56
 nurses, job market for 11
 Nutzenkalkül 1, 2

 oil, market for 11
 Ökonometrie 1, 94
 one-shot gameplay 77, 88
 Online-Experiment 4
 ORSEE 46
 other people's money 76
 other-regarding behavior 38, 42, 44,
 56 f., 75, 86
 out-group 74, 88

 panel regression 54
 partial correlation 29
 partner matching 44, 55
 Patagonia 40
 perishable commodity 13, 31
 PHP: Hypertext Preprocessor 5, 78
 policy implications 56
 political negotiation 89
 Politisierung 1
 positional order protocol 45
 post-doctoral position (law) 9, 12 f., 18,
 24, 26, 31
 potato, market for 11
 Pretoria, University of 5, 78, 81
 principal agent relationship 2, 47 f.,
 74 f., 88
 Privatdozent 9, 13
 private law professors 15
 private law schools in Germany 13
 Promotion 93
 public law professors 15

 random effects 53, 60 f.
 Rassentrennung 95
 rational choice 77
 reactance theory 81

 real estate (realty), market for 11, 89
 Realwirtschaft 93
 Rechtswissenschaft 1, 3, 93
 reciprocity 77
 repeated gameplay 88
 Replikation 3
 residual claimant 77
 restraining function 40
 retirement age 26
 reunion (Germany) 14
 revenge 54
 Robbers Cave experiment 74
 RUBEN group 74

 sampling 82
 Schönheitswettbewerb 2
 Schweinepreise in Berlin 11
 Schweinezyklus 3, 93 f.
 Scientific Council (Germany) 20
 second-generation investors 57
 segregation, racial 73
 selfishness 88
 separation of ownership and control
 see Berle-Means paradigm
 shock *see* exogenous shock
 social enterprise 38 ff., 57
 social identity 72 ff.
 social identity theory 74
 social psychology 4, 42, 74, 81
 socio-demographic information
 see demographic information
 South Africa 72 ff.
 Soziologie („soziale Physik“) 2
 Spearman's rank correlation 54
 Spendebereitschaft 3
 stakeholders 40, 42 f., 45 f., 48, 52 ff.,
 55, 94 *see also* general public
 Stata (Software) 4, 5
 Statistisches Bundesamt 4
 stochastic uncertainty 33
 Stock Corporation Act (Germany) 41
 Strategie zweiter Ordnung 3, 93
 strategy method 45, 79
 stress test 40

structural break 20
 student cohort 22 ff.
 subgame perfect equilibrium 77
 Südafrika 1, 3, 95
 Supreme Court (Germany) 24
 surname, as racial clue 79
 SurveyMonkey 5
 swine flu 12

tenure-track 33
 Third Reich *see* Nazi era
 time trend 19 f.
 time series research 29
 Tobit regression 79, 80
 transparency without consequence 56
 tribal identity 76
 trust, societal 73, 75 f., 88
 trust game 72 ff., 75, 76, 77, 81 f., 88
 trustworthiness 77

Überangebot 93
 ultimatum game 42
 United Kingdom 39, 73

United States 38 ff.
 unpacking decisions 42
 u-shape 52
 see also Mann-Whitney U test

Vergemeinschaftung 1
 Verhaltensökonomik 1, 93
 Vernetztheit 2, 3

Wald test 51
 Weimar Constitution 40
 WEIRD bias 74
 Wertschöpfung 94
 Wilcoxon signed-rank test 82 ff.
 worker effort 76
 World Values Survey 75
 World War I 41
 World War II 15, 20 *see also* Nazi era

X² test 85

Zeitreihenanalyse 1, 94
 z-Tree 46