

IFO-INSTITUT FÜR WIRTSCHAFTSFORSCHUNG

Handbuch der Ifo-Umfragen

Vierzig Jahre Unternehmensbefragungen
des Ifo-Instituts für Wirtschaftsforschung, München

herausgegeben von

Karl Heinrich Oppenländer
Günter Poser



DUNCKER & HUMBLLOT / BERLIN MÜNCHEN

INHALTSVERZEICHNIS

	Seite
Kapitel 1	
<i>Von der Idee zur weltweiten Verbreitung</i>	1
1. Zielsetzung der Ifo-Umfragen	3
2. Die Entwicklung der Ifo-Umfragen seit 1949	6
2.1 Zur Vorgeschichte	6
2.2 Die Umfragen des Ifo-Instituts	6
3. Andere Konjunkturumfragen im In- und Ausland	14
3.1 Befragungen im Inland	14
3.2 Befragungen im Ausland	16
4. CIRET - Ein internationaler Erfahrungsaustausch	21
4.1 Entstehung und Geschichte	21
4.2 Die Konferenzen und Workshops	22
4.3 Das CIRET-Archiv	25
<i>Literatur zu Kapitel 1</i>	27
Kapitel 2	
<i>Unternehmerische Urteile und Antizipationen in der Wirtschaftswissenschaft</i>	33
1. Einführung	35
2. Urteile, Erwartungen und Pläne von Unternehmen	
in der ökonomischen Theorie	37
2.1 Einleitung	37
2.2 Die Rolle der Erwartungen in der Wirtschaftstheorie	38
2.2.1 Autoregressive Erwartungsmodelle	39
2.2.2 Konzept der rationalen Erwartungen	40
2.2.3 Implikationen alternativer Erwartungsmodelle am Beispiel des Unternehmerverhaltens	42
2.3 Urteile, Erwartungen und Pläne in Unternehmensbe- fragungen und deren Relevanz für die empirische Wirtschaftsforschung	46

Inhaltsverzeichnis

	Seite
2.4 Ein Anwendungsbeispiel: Die Analyse von Preis- und Produktionsplänen im Verarbeitenden Gewerbe	51
2.4.1 Die kurzfristigen Prognoseeigenschaften quantifizierter Preispläne und Produktionspläne	51
2.4.2 Die ökonomische Analyse der Diskrepanzen zwischen geplanten und tatsächlichen Preis- und Produktionsanpassungen	54
2.5 Zusammenfassung	59
3. Zum Aussagewert unternehmerischer Antizipationen	60
3.1 Bedeutung	60
3.2 Zum Planungshorizont in der Industrie	62
3.3 Erfahrungen mit kurzfristigen Antizipationen	63
3.4 Erfahrungen mit einjährigen Investitionsplänen	66
3.5 Erfahrungen mit längerfristigen Antizipationen	69
3.6 Fazit	70
4. Analysen des Unternehmerverhaltens mit qualitativen Daten	72
4.1 Sind Erwartungen rational?	72
4.2 Reaktionen auf unerwartete Nachfrageschwankungen	73
4.3 Einflüsse des sozialen Umfeldes auf Unternehmensstrategien	75
4.4 Investitionsmotive und Investitionstätigkeit	76
4.5 Vorschlag für einen neuen Forschungsansatz	77
5. Quantifizierung qualitativer Informationen	82
5.1 Problemstellung	82
5.2 Quantifizierung ohne Verteilungsannahmen	83
5.3 Quantifizierung mit der Normalverteilung	83
5.4 Quantifizierung mit stabilen Verteilungen	86
5.5 Quantifizierung mit der Poissonverteilung	87
5.6 Empirischer Vergleich der Quantifizierungsverfahren	89
6. Mathematisch-statistische Methoden zur Analyse nichtmetrischer Informationen	94
6.1 Einleitung	94
6.2 Modelle für kategoriale Zeitreihen	95
6.3 Diskrete Beobachtungen aus Normal Verteilungen	96
6.4 Untersuchungen zum Indifferenzintervall	97
6.5 Ein allgemeines ökonometrisches Modell	100

	Seite
6.6 Logit-Ansätze für Ifo-Konjunkturtest-Daten	103
6.7 Homogenitätsannahmen	104
6.8 Ausblick	105
<i>Literatur zu Kapitel 2</i>	107
 Kapitel 3	
<i>Die Umfragen des Ifo-Instituts:</i>	
<i>Fragestellung, Datenerfassung und Auswertung</i>	117
1. Einführung	121
2. Konjunkturtest	122
2.1 Gesetzte Ziele, gewählte Mittel	122
2.2 Konjunkturtest Industrie	131
2.2.1 Frageprogramm	131
2.2.2 Regionen, Aggregation, Beteiligung	136
2.2.3 Erkenntnisse und Erfahrungen	140
2.3 Konjunkturtest Handel	155
2.3.1 Frageprogramm	155
2.3.2 Regionen, Aggregation, Beteiligung	156
2.3.3 Erkenntnisse und Erfahrungen	161
2.4 Konjunkturtest Bauhauptgewerbe	171
2.4.1 Teilbereiche und Frageprogramm	171
2.4.2 Regionen, Aggregate, Beteiligung	176
2.4.3 Erkenntnisse und Erfahrungen	178
2.5 Abschließende Bemerkungen	186
3. Investitionstest	187
3.1 Vorbemerkungen	187
3.2 Entwicklung des Erhebungskreises	188
3.3 Beteiligung und Repräsentation	191
3.4 Erfassung und Aufbereitung der Erhebungsergebnisse, dargestellt am Beispiel der Industrie	195
3.4.1 Vorbemerkungen	195
3.4.2 Frageprogramm und Erhebungsrhythmus	196
3.4.3 Aufbereitung der Erhebungsergebnisse	206
3.4.4 Hochrechnung der Bruttoanlageinvestitionen	207
3.4.5 Prognose der Investitionsausgaben	210
3.4.6 Berichterstattung	216

	Seite
3.5 Investitionstest Baugewerbe	221
3.6 Investitionstest Handel	222
3.7 Investitionstest Öffentliche Versorgungsbereiche	227
3.8 Aussagekraft der Ergebnisse und Möglichkeiten der Verwendung	229
4. Erhebungen zur Mittelfristprognose	231
4.1 Prognose 100	231
4.1.1 Das Ziel der Erhebung	231
4.1.2 Erhebungsrhythmus und Frageprogramm	232
4.1.3 Beteiligung und Repräsentation	238
4.1.4 Aufbereitung der Ergebnisse	239
4.1.5 Berichterstattung	240
4.1.6 Aussagewert und Treffsicherheit der Ergebnisse	241
4.2 Graphoskopie	242
4.2.1 Zur Entwicklungsgeschichte des neuen Instruments	242
4.2.2 Der graphoskopische Fragebogen	244
4.2.3 Berichtskreis	245
4.2.4 Das Frageprogramm	247
4.2.5 Die Aufbereitung der Ergebnisse	247
4.2.6 Berichterstattung	250
4.2.7 Treffsicherheitsanalysen	251
4.2.8 Zusammenfassung und Bewertung	258
5. Konjunkturtest International - Economic Survey International	259
5.1 Zielsetzung und Entwicklung der Befragung	259
5.2 Beteiligung und Repräsentation	259
5.3 Frageprogramm und Aufbereitung der Ergebnisse	260
5.4 Berichte für beteiligte Unternehmen und Veröffentlichung der Ergebnisse	263
6. Innovationstest	263
6.1 Konzeptionelle Vorarbeiten	265
6.2 Ziel der Erhebung	266
6.3 Repräsentation und Periodizität	267
6.4 Frageprogramm	268
6.5 Aggregation und Veröffentlichung der Ergebnisse	275
6.6 Verwendung der Befragungsergebnisse	277

	Seite
7. Befragungen in ausgewählten Dienstleistungsbereichen	279
7.1 Leasing	279
7.2 Architektenumfrage	287
7.2.1 Zielsetzung, Entwicklung	287
7.2.2 Beteiligung, Repräsentation	289
7.2.3 Frageprogramm, Aufbereitung	290
7.2.4 Berichte an Unternehmen und Veröffentlichung	294
7.2.5 Erkenntnisse aus der Anwendung	294
7.3 Grenzüberschreitender Güterkraftverkehr	296
7.3.1 Entwicklung, Stand und Durchführung der Befragung	296
7.3.2 Ergebnisse	298
8. Sondererhebungen	301
8.1 Sonderumfragen zum Ausbildungsplatzangebot	301
8.1.1 Zweck der Erhebung	301
8.1.2 Analyse des Ausbildungsverhaltens von Betrieben aufgrund repräsentativer Befragungen	302
8.1.3 Zusammenfassung	307
8.2 Sonderumfragen zur Arbeitsmarktforschung	309
8.2.1 Mögliche Beschäftigungswirkungen alternativer Ruhestandsregelungen	309
8.2.2 Voraussichtliche Reaktionen der Unternehmen auf eine Verkürzung der tariflichen Wochenarbeitszeit	310
8.2.3 Überstunden-Entwicklung, Strukturen und Bestimmungsgrößen	311
8.2.4 Beschäftigung und Arbeitsproduktivität - Tendenzen und betriebliche Maßnahmen	312
8.3 Sonderumfragen über Auswirkungen wirtschafts-politischer Maßnahmen auf die Investitionstätigkeit der Unternehmen	319
8.3.1 Vorbemerkungen	319
8.3.2 Wirksamkeit verschiedener Maßnahmen zur Beeinflussung der privaten Investitionstätigkeit	320
8.4 Themen sonstiger wichtiger Sonderumfragen zum Investitions- und Planungsverhalten der Unternehmen	332
9. Synopse der Ifo-Umfragen	334

	Seite
<i>Literatur zu Kapitel 3</i>	344
 Kapitel 4 <i>Indikatoren für die Konjunkturanalyse und Konjunkturprognose</i>	 353
1. Einführung	355
2. Gesamtindikatoren	356
2.1 Zusammengesetzte Indikatoren und Indikatorensysteme	 356
2.2 Nationale Gesamtindikatoren auf der Basis von Konjunkturumfragen	 358
2.2.1 Der Ifo-Geschäftsklima-Indikator	359
2.2.2 Der Indikator "Ifo-Wirtschaftsklima"	363
2.2.3 Indikatorkombinationen aus verschiedenen Ifo-Umfragen	 369
2.3 Internationale Gesamtindikatoren	372
2.3.1 Erfahrungen mildem US-amerikanischen Frühindikator "Index of leading indicators"	 375
2.3.2 Wirtschaftlicher Gesamtindikator der EG-Kommission	 377
2.3.3 Gesamtindikator für das Welt-Sozialprodukt	378
3. Einzelindikatoren	378
3.1 Lagerindikatoren	378
3.2 Investitionsindikatoren	384
3.3 Konsumindikatoren	393
3.3.1 Der Indikator "Konsumklima" oder "Konsumentenstimmung"	 395
3.3.2 Konsumindikatoren aus dem Ifo- Konjunkturtest	 397
3.4 Arbeitsmarktindikatoren	398
 <i>Literatur zu Kapitel 4</i>	 402

Kapitel 5	
<i>Indikatoren für die Strukturanalyse und Wachstumsanalyse</i>	405
1. Einführung	407
2. Investoren- und Anlagevermögen nach dem Benutzerkonzept	407
3. Umfrageergebnisse im Dienste der Schätzung des Produktions- und Arbeitsplatzpotentials	410
4. Umfrageergebnisse im Dienste der Analyse der Produktivitätsentwicklung	415
5. Innovation und Wachstum	417
5.1 Zusammenhang: Innovation, Investition, Wachstum	417
5.2 Eckdaten für die Innovationsplanung der Unternehmen	422
5.3 Ansatzpunkte für forschungs-, technologie- und wirtschaftspolitische Maßnahmen	426
5.4 Empirische Grundlagen für die Wirtschaftsforschung	433
<i>Literatur zu Kapitel 5</i>	436
 Kapitel 6	
<i>Nutzung der Befragungsergebnisse in Wirtschaft, Politik und Wissenschaft</i>	439
1. Einführung	441
2. Nutzung der Befragungsergebnisse für die Konjunkturanalyse und Konjunkturprognose im Ifo-Institut	443
2.1 Konjunkturanalyse	443
2.2 Konjunkturprognose	444
2.2.1 Der Einbau qualitativer Indikatoren in die iterativ-analytische Konjunkturprognose	446
2.2.2 Aussagen über Tempowechsel und Wendepunkte mit Hilfe qualitativer Indikatoren	450

	Seite
2.2.3 Grenzen des Beitrags qualitativer Indikatoren zur Prognose	451
2.3 Zusammenfassung	452
3. Nutzung der Befragungsergebnisse für die betriebliche Marktbeobachtung	452
3.1 Einführung	452
3.2 Anwendung von Konjunkturtestdaten für Mittelfristprognosen im Investitionsgüter- bereich: Erfahrungen in der Praxis	453
3.2.1 Befund und Vorhaben	453
3.2.2 Instrumentarium und Methode	455
3.2.3 Ergebnisse	457
3.2.4 Zusammenfassung und Ausblick	462
4. Nutzung der Befragungsergebnisse für die Wirtschaftspolitik	464
4.1 Nutzung durch Industrieverbände	464
4.1.1 Verband Deutscher Maschinen- und Anlagen- bau (VDMA)	464
4.1.2 Zentralverband der Elektrotechnischen Industrie (ZVEI)	465
4.1.3 Hauptverband der Deutschen Bauindustrie	466
4.1.4 Gesamtverband der metallindustriellen Arbeitgeberverbände (Gesamtmetall)	467
4.2 Nutzung durch das Bundeswirtschaftsministerium und die Deutsche Bundesbank	467
4.2.1 Das Bundeswirtschaftsministerium	468
4.2.2 Die Deutsche Bundesbank	468
5. Verwendung der Befragungsergebnisse in ökonometrischen Modellen	469
5.1 Verwendung im Prognosemodell von Naggl	469
5.1.1 Einleitung und Zusammenfassung	469
5.1.2 Der prognostische Wert von A-Variablen	471
5.1.3 Konstruktion eines Konjunkturmodells mit A-Variablen	473
5.1.4 Prognosen mit dem A-Modell	477
5.2 Verwendung im Ifo-Konjunkturmodell	478
5.2.1 Kapazitätsauslastung	479

	Seite
5.2.2 Reichweite des Auftragsbestands im Wohnungsbau	481
5.2.3 Lagerurteil	484
5.2.4 Geschäftserwartungen	485
5.2.5 Ergebnis	490
6. Befragungsergebnisse als Bestandteil der Ifo-Datenbank	490
6.1 Inhalt der Ifo-Datenbank	491
6.2 Analysemethoden	491
6.3 Nutzungsmöglichkeiten	494
<i>Literatur zu Kapitel 6</i>	496
<i>Anhang:</i>	
Veröffentlichungen aus dem Gebiet der Unternehmensbefragungen	499
Personenregister	515
Sachregister	525
Autoren	543