

Das ifo Beschäftigungsbarometer: Ein Druckmesser für den deutschen Arbeitsmarkt

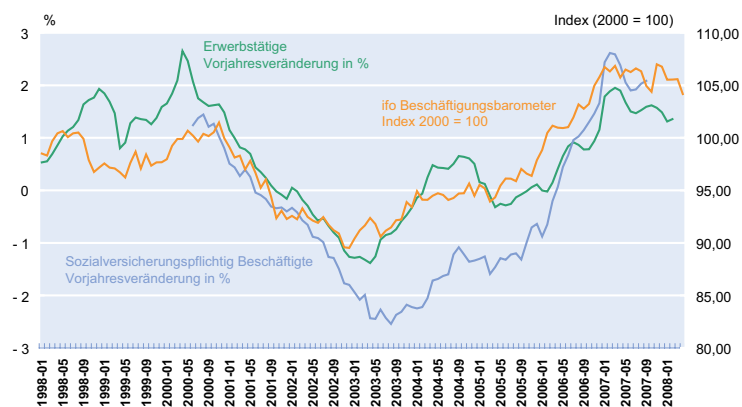
Seit dem Jahr 2006 berechnet und veröffentlicht das ifo Institut monatlich das ifo Beschäftigungsbarometer als Indikator für die Entwicklung am deutschen Arbeitsmarkt. Es basiert auf den Befragungsergebnissen des monatlichen ifo Konjunkturtests, der seit 1949 durchgeführt und aus dem auch das ifo Geschäftsklima berechnet wird. Das ifo Beschäftigungsbarometer hat frühzeitig signalisiert, dass der Arbeitsmarkt im Jahr 2003 seinen konjunkturellen Tiefpunkt erreicht hatte. In den folgenden Monaten stieg das Barometer zunehmend und zeigte damit die positive Arbeitsmarktentwicklung der vergangenen Jahre frühzeitig und zuverlässig an. Aktuell steht das ifo Beschäftigungsbarometer weiterhin auf »Hoch«. Daher dürfte sich der Arbeitsmarkt auch in diesem Frühjahr günstig entwickeln.

Das ifo Beschäftigungsbarometer ist ein Indikator für die konjunkturelle Entwicklung am Arbeitsmarkt. Es basiert auf der monatlichen Umfrage »ifo Konjunkturtest«, aus der auch das ifo Geschäftsklima berechnet wird. Der Fragebogen des ifo Konjunkturtests enthält neben den Fragen zur aktuellen Geschäftslage und zur erwarteten Geschäftsentwicklung unter anderem auch eine Frage zur Personalplanung der Unternehmen. Die Befragungsteilnehmer werden gebeten anzugeben, ob sie in den nächsten drei Monaten beabsichtigen, die Zahl ihrer Beschäftigten zu erhöhen, nicht zu verändern oder zu reduzieren. Aus den Antworten zu dieser Frage berechnet das ifo Institut sein Beschäftigungsbarometer. Die Unternehmensmeldungen werden dazu wie beim ifo Geschäftsklima gewichtet und auf die Wirtschaftsbereiche verarbeitendes Gewerbe, Bauhauptgewerbe, Einzelhandel und Großhandel aggregiert. Die Ergebnisse dieser vier Bereiche werden dann mit Beschäftigungsanteilen zu einem Gesamtindikator zusammengesetzt.¹ Der so berechnete Indikator wird dann als Index unter dem Namen ifo Beschäftigungsbarometer veröffentlicht.

Ziel des ifo Beschäftigungsbarometers ist es, die konjunkturelle Entwicklung am

Arbeitsmarkt frühzeitig anzuzeigen. Es sollte daher im Einklang mit den amtlichen Daten zur Beschäftigungsentwicklung stehen. Ein Vergleich mit den Daten zu der Zahl der Erwerbstätigen und den sozialversicherungspflichtig Beschäftigten sollte deshalb ein ähnliches Muster erkennen lassen. Vergleicht man die prozentuale Veränderung der Anzahl Erwerbstätigen gegenüber Vorjahr und die prozentuale Vorjahresveränderung der sozialversicherungspflichtig Beschäftigten mit dem ifo Beschäftigungsbarometer, so ist ein grundsätzlich ähnlicher Verlauf erkennbar (vgl. Abb. 1), wenngleich in den Details sich erhebliche Abweichungen zwischen den drei Zeitreihen ergeben. Ein Vergleich der drei Zeitreihen setzt voraus, dass zum einen die verschiedenen zugrunde liegenden Messgrößen abgegrenzt werden und zum anderen, dass die Wirkungen verschiedener Arbeitsmarktreformen Berücksichtigung finden.

Abb. 1
Erwerbstätige und sozialversicherungspflichtige Beschäftigte (Vorjahresveränderung) sowie ifo Beschäftigungsbarometer (saisonbereinigt)



Quelle: Statistisches Bundesamt; Bundesagentur für Arbeit; ifo Institut, Berechnungen des ifo Instituts.

¹ Das ifo Institut führt darüber hinaus auch einen monatlichen Konjunkturtest im Dienstleistungsbereich durch. Auch aus den Meldungen in diesem Bereich wird ein ifo Geschäftsklima berechnet. Die Teilnehmer an dieser Umfrage werden ebenfalls nach ihren Beschäftigungsplanungen befragt. Die im Dienstleistungsbereich durchgeführte Erhebung ist daher kompatibel mit denen in den übrigen Bereichen. Aufgrund der deutlich kürzeren vorliegenden Zeitreihen erfolgt aber momentan keine Integration der Dienstleistungsergebnisse in das veröffentlichte ifo Beschäftigungsbarometer.

Zunächst zu den verschiedenen Messgrößen: Im ifo Konjunkturtest werden Unternehmen nach ihren Planungen zur Anzahl des Personals befragt. Eine genaue Untergliederung der Stellen, etwa nach Vollzeit- oder Teilzeitbeschäftigung oder ob die Stelle mit einem sozialversicherungspflichtig Vollzeitbeschäftigten oder mit einem geringfügig Beschäftigten besetzt werden soll, wird nicht abgefragt. Da es sich beim ifo Konjunkturtest um eine freiwillige Umfrage handelt, die im Monatsrhythmus stattfindet, ist der Fragebogen so einfach wie möglich gehalten. Zu den *Erwerbstätigen in den Volkswirtschaftlichen Gesamtrechnungen* zählen dagegen alle Personen, die als Arbeitnehmer (Arbeiter, Angestellte, Beamte, geringfügig Beschäftigte, Soldaten) oder als Selbständige beziehungsweise als mithelfende Familienangehörige eine auf wirtschaftlichen Erwerb gerichtete Tätigkeit ausüben, unabhängig vom Umfang dieser Tätigkeit. Personen mit mehreren gleichzeitigen Beschäftigungsverhältnissen werden nur einmal mit ihrer Haupterwerbstätigkeit erfasst. Mit dieser Abgrenzung der Erwerbstätigen ergeben sich inhaltlich bedeutsame Unterschiede zur Messgröße des ifo Beschäftigungsbarometers. Letztere enthält etwa weder Selbständige noch Beamte. Dafür können Unternehmen aber Mitarbeiter einstellen, die schon in einer andern Stelle erwerbstätig sind.

Unterschiede ergeben sich aber auch zu den sozialversicherungspflichtig Beschäftigten. Diese sind wie folgt definiert: »Zu den sozialversicherungspflichtig Beschäftigten zählen alle Arbeitnehmer einschließlich der Auszubildenden, die kranken-, renten-, pflegeversicherungspflichtig und/oder beitragspflichtig sind oder für die von den Arbeitgebern Beitragsanteile zu entrichten sind. Aus dieser Abgrenzung ergibt sich, dass in der Regel alle Arbeiter und Angestellten von der Sozialversicherungspflicht erfasst werden. In wenigen Fällen besteht auch für Selbständige eine Versicherungspflicht. Unbezahlt mithelfende Familienangehörige und Beamte zählen grundsätzlich nicht zu dieser Gruppe. Ausschließlich geringfügig entlohnte Personen, die nur wegen der gesetzlichen Neuregelung in den Kreis der sozialversicherungspflichtig Beschäftigten gelangt sind, werden bei den sozialversicherungspflichtig beschäftigten Arbeitnehmern nicht nachgewiesen.« (DESTATIS 2008) Darüber hinaus stellt die Bundesagentur für Arbeit auch Zahlen zu den ausschließlich geringfügig Beschäftigten zur Verfügung. Die Statistik der sozialversicherungspflichtig Beschäftigten scheint näher an dem Messkonzept des ifo Beschäftigungsbarometers zu liegen als die Statistik der Erwerbstätigen. Doch ergeben sich auch hier Abweichungen, da beispielsweise die Unternehmen in ihren Personalplanungen durchaus geringfügige Beschäftigungsverhältnisse einbeziehen können. Arbeitnehmer können solche Stellen auch als Nebentätigkeit annehmen. Nach einer im Monatsbericht März 2008 veröffentlichten Hochrechnung der Bundesagentur für Arbeit übten im Januar 2,15 Mill. sozialversicherungspflichtig Beschäftigte einen geringfügig entlohnenden Nebenjob aus.

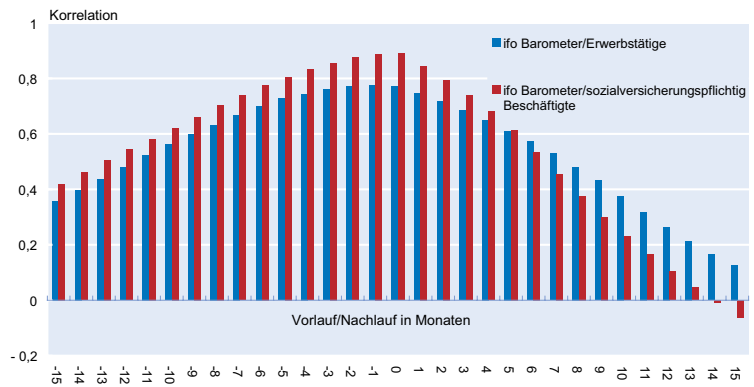
Trotz der konzeptionellen Abweichungen zwischen den verschiedenen Statistiken erkennt man aber, dass die konjunkturelle Grunddynamik in allen drei Zeitreihen ihren Durchschlag findet. Das ifo Beschäftigungsbarometer soll auch keinesfalls eine zahlenmäßige Erfassung von Erwerbstätigen oder Beschäftigten ersetzen. Es soll vielmehr die auch in diesen amtlichen Daten enthaltene konjunkturelle Dynamik sichtbar machen und frühzeitig anzeigen. Dieses Ziel erreicht das ifo Beschäftigungsbarometer. Die Wendepunkte in der Arbeitsmarktentwicklung werden von ihm deutlich signalisiert. Tabelle 1 enthält die Wendepunkte der drei Zeitreihen.² Ein Vergleich der Reihen wird allerdings durch Sonderentwicklungen aufgrund von Effekten der Arbeitsmarktpolitik erschwert. Die Zeitreihe der Vorjahresveränderung der Erwerbstätigenzahl weist einen ersten Hochpunkt im April 2000 auf. Die Zeitreihe der sozialversicherungspflichtig Beschäftigten ist zu kurz, um diesen Zeitbereich zu untersuchen, und das ifo Beschäftigungsbarometer besitzt ein Maximum im November 2000. Dieses im Vergleich zur Erwerbstätigenstatistik verzögerte Signal des ifo Barometers resultiert aus einer Sonderentwicklung, die nicht konjunktureller Natur ist. Die starke Zunahme bei den Erwerbstätigen im Frühjahr 2000 beschränkte sich im Wesentlichen auf ausschließlich geringfügig Beschäftigte. Infolge der damaligen gesetzlichen Neuregelung solcher Beschäftigungsverhältnisse wurden Zweitjobs auf 630-DM-Basis finanziell unattraktiver, so dass Erwerbstätige mit solchen – in der Statistik nicht gesondert erfassten – Zweitjobs durch ausschließlich geringfügig Beschäftigte ersetzt wurden. Dies erhöhte die Erwerbstätigkeit spürbar. Die konjunkturelle Grunddynamik wurde dagegen vom ifo Beschäftigungsbarometer recht gut beschrieben. Denn im Herbst 2000 gingen die Zuwächse bei der Erwerbstätigkeit und bei den sozialversicherungspflichtig Beschäftigten rasch zurück und kehrten sich schließlich ins Minus. Der Tiefpunkt dieser Entwicklung wurde im Jahr 2003 erreicht. Bei den Erwerbstätigen drehte sich das Bild im April 2003, und die sozialversicherungspflichtig Beschäftigten folgten im August 2003. Das ifo Beschäftigungsbarometer hatte diese Wende damals längst angezeigt. Es erreichte seinen Tiefpunkt bereits im Dezember 2002 und stieg in der Folge. Im weiteren Verlauf erkennt das eingesetzte Datierungsverfahren in den Daten zu den Erwerbstätigen und zu den sozialversicherungspflichtig Beschäftigten einen Zyklus mit oberem Wendepunkt im September 2004 und unterem Wendepunkt im April bzw. März 2005. Das ifo Beschäftigungsbarometer verläuft in dieser Zeitspanne flach. Ein Zyklus mit Wendepunkten wird vom Datierungsverfahren jedoch nicht markiert. Allerdings war die Entwicklung auf dem Arbeitsmarkt 2004 ebenfalls stark von Auswirkungen der Arbeitsmarkt-

² Die Datierung der Wendepunkte erfolgt hier mit dem Bry-Boschan Verfahren. Dabei handelt es sich um einen Algorithmus mit festgelegten Eigenschaften. Die Wendepunkte wurden somit mechanistisch und nicht subjektiv datiert. Zur Anwendung kam das Programm Grocer von Éric Dubois und Emmanuel Michaux. Zum Bry-Boschan Verfahren siehe etwa Bry und Boschan (1971).

politik geprägt. So beruhte der Anstieg der Zahl der Erwerbstätigen allein auf der kräftigen Zunahme von Minijobs und Ich-AGs, im letzten Jahresdrittel auch von gemeinnützigen Arbeitsgelegenheiten (»Zusatzjobs«). Nach dieser besonderen Phase wirkten wieder die konjunkturellen Auftriebskräfte, und die Vorjahresraten der Erwerbstätigen und später auch die Vorjahresraten der sozialversicherungspflichtig Beschäftigten stiegen in den positiven Bereich. Im Vergleich zum Vorjahr wurde wieder Beschäftigung aufgebaut. Diese Entwicklung hält bis dato an. Zwar ist nach dem Datierungsverfahren der Gipfel der Entwicklung zu Jahresbeginn zunächst einmal überschritten worden, doch steht das ifo Beschäftigungsbarometer weiterhin auf »Hoch«. Es tendiert auf hohem Niveau seitwärts. Daher ist auch in diesem Frühjahr weiterhin mit einem Beschäftigungsaufbau zu rechnen.

Aber nicht nur direkt an den Wendepunkten ist der Zusammenhang zwischen den Zeitreihen der Vorjahresveränderung der Erwerbstätigen bzw. der Vorjahresveränderung der sozialversicherungspflichtig Beschäftigten und dem ifo Beschäftigungsbarometer erkennbar. Mit Hilfe der Kreuzkorrelationsanalyse lässt sich der lineare Zusammenhang zwischen den Zeitreihen im Durchschnitt über den gesamten Beobachtungszeitraum messen. Die Korrelation als Maß für einen linearen Zusammenhang kann Werte zwischen 0 und 1 annehmen. Wobei sich die Extremwerte bei perfekt linearen Zusammenhängen einstellen. Bei der Kreuzkorrelationsanalyse werden zusätzlich die untersuchten Zeitreihen zeitlich gegeneinander verschoben, um Vor- bzw. Nachläufe zwischen den Zeitreihen zu erkennen. Abbildung 2 enthält die für die hier untersuchten Zeitreihen errechneten Kreuzkorrelationen.³ Zwischen dem ifo Beschäftigungsbarometer und den Vorjahresveränderungen der Erwerbstätigen ergibt sich eine bemerkenswert hohe maximale Korrelation von 0,77. Wobei dieses Maximum sich einstellt, wenn man das ifo Beschäftigungsbarometer der Erwerbstätigenreihe um einen Monat vorlaufen lässt. Dieser recht hohe Wert

Abb. 2
Kreuzkorrelationen des ifo Beschäftigungsbarometers mit den Vorjahresveränderungen der Erwerbstätigen und der sozialversicherungspflichtig Beschäftigten



Quelle: Berechnungen des ifo Instituts.

ist insbesondere aufgrund der oben beschriebenen begründeten temporären Abweichungen zwischen den Zeitreihen sehr beachtlich. Ein noch höherer Wert ergibt sich, wenn das ifo Beschäftigungsbarometer mit den Vorjahresveränderungen der sozialversicherungspflichtig Beschäftigten korreliert wird. Der maximale Wert ist hier 0,89 und resultiert, wenn die beiden Reihen zeitgleich betrachtet werden. Wobei die Korrelation, die sich berechnet, wenn das ifo Beschäftigungsbarometer einen Monat Vorlauf erhält, nur minimal unter dem zeitgleichen Wert liegt. Die Kreuzkorrelationsanalyse bestätigt somit, dass im Durchschnitt über den ganzen Zeitbereich eine enge lineare Beziehung zwischen dem ifo Beschäftigungsbarometer und den beiden amtlichen Datenreihen besteht. Dabei besitzt das ifo Barometer tendenziell leichte Vorlaufeigenschaften.

Ein großer Pluspunkt für das ifo Beschäftigungsbarometer ist, dass es nicht nur einen statistischen Vorlauf besitzt. Es wird zudem sehr zeitnah veröffentlicht und im Nachhinein auch nicht mehr revidiert. Die ifo Konjunkturtestbefragung wird während des Monats, der betrachtet wird, durchge-

³ Eine weitergehende statistisch-ökonomische Untersuchung wird in Abberger (2007) beschrieben.

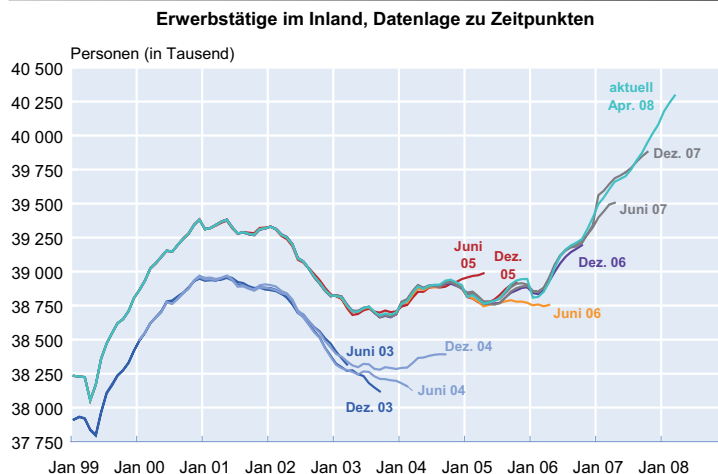
Tab. 1
Wendepunkte in den Zeitreihen der Vorjahresveränderung der Erwerbstätigen und der sozialversicherungspflichtig Beschäftigten sowie im ifo Beschäftigungsbarometer (Datierung mit Bry-Boschan Verfahren)

Wendepunkte seit 2000				
Erwerbstätige	Oberer Wendepunkt	April 2000	September 2004	März 2007
	Unterer Wendepunkt	April 2003	April 2006	
Sozialversicherungspflichtig Beschäftigte	Oberer Wendepunkt	September 2004	September 2004	Februar 2007
	Unterer Wendepunkt	August 2003	März 2005	
ifo Beschäftigungsbarometer	Oberer Wendepunkt	November 2000		März 2007
	Unterer Wendepunkt	Dezember 2002		

Quelle: Berechnungen des ifo Instituts.

führt und die Ergebnisse bereits am Monatsende desselben Monats veröffentlicht. Diese zeitnahe Vorgehensweise ist möglich, weil die Fragebögen des ifo Instituts möglichst einfach gehalten sind und weil nicht tatsächliche Zahlen, sondern qualitative Einschätzungen, d.h. der Personalbestand soll steigen/gleich bleiben/sinken, von den Teilnehmern abverlangt werden. Eine Erhebung des zahlenmäßigen Bestands an Erwerbstätigen oder sozialversicherungspflichtig Beschäftigten, wie es Aufgabe der amtlichen Statistik ist, erfordert einen erheblichen Aufwand. Daher werden beispielsweise die Erwerbstätigenzahlen erst etwa 30 Tage nach dem Ende des Monats veröffentlicht. Der Bestand an sozialversicherungspflichtig Beschäftigten wird vierteljährlich mit rund sechs Monaten Wartezeit ermittelt. Darüber hinaus veröffentlicht die Bundesagentur für Arbeit (2008b) monatliche Schätzwerte mit einer Verzögerung von etwa zwei bis drei Monaten. Das ifo Beschäftigungsbarometer besitzt somit einen deutlichen Vorsprung beim Veröffentlichungszeitpunkt. Hinzu kommt, dass die amtlichen Daten auch nach der Erstveröffentlichung, bei Vorliegen neuer Informationen, revidiert und damit präzisiert werden. Diese nachträglichen Revisionen können beträchtlich ausfallen. Abbildung 3 enthält die vom Statistischen Bundesamt zu verschiedenen Zeitpunkten⁴ publizierten Erwerbstätigenzahlen. Aus der Graphik ist ersichtlich, dass die Daten vom Statistischen Bundesamt im Jahr 2005 sehr stark korrigiert wurden, was eine Niveausprung der Zeitreihe zur Folge hatte. Das Amt hatte eine Neuberechnung der Erwerbstätigenzahlen durchgeführt, die auch rückwirkend zu Änderungen führte. Zwar ergab sich dadurch eine Niveauerhöhung bei den Daten, doch blieb der Verlauf der Erwerbstätigkeit im Wesentlichen unverändert. Für den Vergleich mit dem ifo Beschäftigungsbarometer ist nur dieser Verlauf interessant, da die ifo-Befragung, wie oben beschrieben, von ihrer Konzeption her keine Erhebung der genauen Anzahl der Beschäftigten sein kann. Wie wichtig ein Instrument wie das ifo Beschäftigungsbarometer dennoch ist, wird ersichtlich, wenn die laufenden Revisionen in der Zeitreihe der Erwerbstätigen in den Fokus genommen werden. Gerade bei Wendepunkten ergeben sich oftmals noch mit deutlichen Verzögerungen erhebliche Korrekturen. So zeigten etwa die im Juni 2004 veröffentlichten Erwerbstätigenzahlen einen Fortgang des Beschäftigungsabbaus an. In den im Dezember desselben Jahres veröffentlichten Daten ist dann dagegen ersichtlich, dass der Rückgang bei den Erwerbstätigen bereits im Jahr 2003 sein Ende gefunden hatte. Gerade in solchen Phasen erweisen sich Instrumente, wie das ifo Beschäftigungsba-

Abb. 3
Revisionen der Erwerbstätigenzahlen (saisonbereinigt)



rometer, als wichtige Hilfsmittel, um die konjunkturellen Entwicklungen frühzeitig erkennen zu können. Es liefert zeitnah und zuverlässig Signale, wie sich die Dynamik am Arbeitsmarkt darstellt. Damit ergänzt es die quantitativen amtlichen Daten mit sehr wertvollen zusätzlichen Informationen.

Fazit

Das ifo Beschäftigungsbarometer ist ein Instrument, um die konjunkturelle Entwicklung am Arbeitsmarkt zu analysieren. Beim Vergleich mit amtlichen Daten zum Arbeitsmarkt bestätigt sich, dass das ifo Beschäftigungsbarometer die konjunkturelle Dynamik am Arbeitsmarkt sehr gut abgreift. Besonders wertvoll wird das Barometer dadurch, dass es sehr zeitnah veröffentlicht wird und keinen nachträglichen Revisionen unterliegt. Somit können mit seiner Hilfe sehr rasch Klimaveränderungen am Arbeitsmarkt erkannt werden.

Literatur

- Abberger, K. (2007), »Qualitative Business Surveys and the Assessment of Employment – A Case Study for Germany«, *International Journal of Forecasting* 23, 249–258.
- Bry, G. und C. Boschan (1971), »Cyclical Analysis of Time Series: Selected Procedures and Computer Programs«, NBER Technical Paper n°20.
- Bundesagentur für Arbeit (2008a), »Der Arbeits- und Ausbildungsmarkt in Deutschland«, *Monatsbericht*, März.
- Bundesagentur für Arbeit (2008b), *Qualitätsbericht: Statistik der sozialversicherungspflichtigen Beschäftigung und geringfügig entlohnten Beschäftigung*, Nürnberg.
- DESTATIS (2008), *STATmagazin*, www.destatis.de.
- Hott, Chr. und A. Kunkel (2004), »Ein ifo Beschäftigungsindikator«, *ifo Schnelldienst* 57 (6), 53–57.

⁴ Diese Abbildung wurde dem Autor freundlicherweise durch Herrn Meister, ifo Institut, zur Verfügung gestellt, der die Datenstände gesammelt und archiviert hat.