

Gesellschaft für Wirtschafts- und Sozialwissenschaften
— Verein für Socialpolitik —

Vorsitzender: Prof. Dr. Ernst Helmstädter, Universität Münster

Stellvertr. Vorsitzender: Prof. Dr. Herbert Hax, Universität Köln

Schatzmeister: Dr. Dr. h. c. Leonhard Gleske, Deutsche Bundesbank, Frankfurt/M.

Schriftführer/Geschäftsführer: Dipl.-Vw. Friedrich Aumann, Universität Münster

Geschäftsstelle: Alter Fischmarkt 21, D-4400 Münster, T (02 51) 83 29 44

Berichte aus der Arbeit der Gesellschaft

Ausschuß für Bildungsökonomie

Der Ausschuß hat seine jährliche Ausschußsitzung vom 18. bis 20. September 1985 an der Universität Trier abgehalten. Mit dieser Sitzung wurde die Thematik „Bildung und Arbeitsmarkt“ aufgenommen, die bei der Ausschußsitzung 1986 in Wien (22. - 24. September) fortgeführt werden soll.

Es wurden folgende Referate gehalten und ausführlich diskutiert:

Prof. Dr. *Dieter Timmermann* (Universität Bielefeld): Die Abstimmung von Bildungs- und Beschäftigungssystem: eine Systematisierung von Hypothesen

Prof. Dr. *Gerhard Brinkmann* (Universität Siegen): Arbeitsteilung und die Verwertung von Qualifikationen im Beschäftigungssystem

Prof. Dr. *Christof Helberger* (Technische Universität Berlin): Ungleichgewichte auf dem Arbeitsmarkt? — Eine Überprüfung der Linearitätsannahme der Humankapitaltheorie

PD Dr. *Michael Wagner* / Dr. *Karl Pichelmann* (Institut für Höhere Studien Wien): Entwertet wiederholte Arbeitslosigkeit individuelles Humankapital?

Prof. Dr. *Wolfgang Rippe* (Universität Bamberg): Zur Ausbildungsadäquanz der Arbeitsplätze von Hochschulabsolventen: Konzeptionen und Indikatoren, Erfahrungen und Erwartungen

Prof. Dr. *Horst Albach* (Universität Bonn): Fondsfinanzierung der Berufsbildung — Reconsidered

Prof. Dr. H.-J. Bodenhöfer, Klagenfurt

Wirtschaftspolitischer Ausschuß

WL. Die diesjährige Sitzung fand vom 18. bis 20. März 1986 in Straßburg statt. Das Generalthema war die „Deregulierung“. Zum Thema „Ordnungstheoretische Grundlagen der Deregulierung“ hielten Prof. Dr. *Jörn Kruse*, Universität Hamburg, ein einleitendes Referat und Prof. Dr. *Helmut Gröner*, Universität Bayreuth, ein Korreferat. Die Deregulierung auf einzelnen Gebieten war Gegenstand von drei Kurzreferaten. Prof. Dr. *Hans Karl Schneider*, Universität Köln: „Deregulierung im Energiesektor“; Prof. Dr. *Helmut Stefan Seidenfus*, Universität Münster: „Deregulierung im Verkehr“; Prof. Dr. *Walter Hamm*, Universität Marburg: „Deregulierung im Gesundheitssektor“. Die Mitglieder des Ausschusses beschlossen, das Thema auch auf der nächsten Sitzung, die Anfang April 1986 stattfinden soll, zu behandeln.

Ihr besonderes Gepräge erhielt die Sitzung durch eine Gedenkstunde zum 30jährigen Bestehen des Wirtschaftspolitischen Ausschusses. Prof. Dr. *Theodor Pütz*, Universität Wien, der zu den wenigen noch lebenden Gründungsmitgliedern gehört, referierte „Zur Geschichte des Wirtschaftspolitischen Ausschusses“. Dieses Referat ergänzte Prof. Dr. *Burkhardt Röper*, Technische Hochschule Aachen, durch das Korreferat „Die Arbeitsgruppe Wettbewerb im besonderen“. Diese Arbeitsgruppe — eine Besonderheit des Wirtschaftspolitischen Ausschusses — besteht seit zwanzig Jahren.

Als Gäste nahmen der Vorsitzende des Vereins, Prof. Dr. *Helmstädter*, Universität Münster, und Prof. Dr. *Bilger*, Universität Straßburg, teil. Der Präsident der Université Louis Pasteur und der Dekan der Wirtschaftswissenschaftlichen Fakultät gaben einen Empfang.

Ökonometrie-Ausschuß

Unter der wissenschaftlichen Leitung von Prof. Dr. *Horst Rinne* (Universität Gießen) fand vom Mittwoch, den 5. März, bis Freitag, den 7. März 1986, eine Arbeitstagung des Ökonometrie-Ausschusses in Schloß Rauschholzhäusern bei Marburg statt. Schloß Rauschholzhäusern ist Tagungsstätte der Jutus-Liebig-Universität Gießen. Von den 43 Ausschußmitgliedern nahmen 22 an der diesjährigen Sitzung teil.

Wie in diesem Ausschuß üblich, stand die Sitzung nicht unter einem Generalthema. Die acht gehaltenen Referate deckten die gesamte Breite der angewandten Ökonometrie — von der Mikro- zur Makroökonomie — und der theoretischen Ökonometrie einschließlich der EDV-mäßigen Implementation ab.

Prof. Dr. *Dietrich Lüdeke* (Universität Freiburg) befaßte sich in seinem Referat „Eine Möglichkeit zur Berücksichtigung und Schätzung variabler Strukturparameter in ökonometrischen Gleichungen“ mit der Strukturkonstanz ökonometrischer Modelle, insbesondere der zeitlichen Konstanz der Parameter in Verhaltensgleichungen. Nach einem Überblick über die in diesem Zusammenhang in der Literatur diskutierten Ansätze (Kalman-Filter-Approach, stochastische Koeffizienten, switching-regression) setzte er sich mit der Möglichkeit auseinander, stochastische und nicht-stochastische Koeffizienten zu schätzen, die durch andere Variablen (i. e. solche außerhalb der diskutierten Regressionsfunktion) systematisch gesteuert werden. Als

Demonstrationsbeispiele dienten die Konsumfunktion und die Ausrüstungs-investitionsfunktion in der Bundesrepublik zwischen 1964 und 1984 (Quartalsdaten).

Prof. Dr. *Franz Palm* (Rijksuniversiteit Limburg/Niederlande) stellte in seinem Referat „Ein empirisches Modell für die Nachfrage nach Kaffee auf dem Weltmarkt“ ein ökonometrisches Kurzfristmodell vor. Die Verhaltensgleichungen der Akteure (Produzenten, Händler, Spekulanten und Konsumenten) werden unter Optimierungsannahmen bei Unsicherheit hergeleitet. Das Modell enthält Spot- und Terminpreise, die sich so verändern, daß der Spot- und der Terminmarkt in jeder Periode geräumt werden. Der Zeithorizont umfaßt zwei Perioden (= Jahre), die Produktionsbedingungen sind daher konstant. Die empirische Evidenz stützte die aufgestellte Hypothese eines hochaggregierten Modells und ist konsistent mit Gewinnmaximierung unter Unsicherheit.

Prof. Dr. *Gerhard Gehrig* (Universität Frankfurt) referierte über „Ökonometrische Modellanwendungen mit CUE, demonstriert an einem Energiemodell für Thailand“. Dieses Modell, das nunmehr in dritter Version vorliegt, soll die Energienachfrage in Thailand erklären und prognostizieren, ist aber ansonsten ein komplettes makroökonomisches Modell. Im Vordergrund des Referates standen Aspekte der EDV-mäßigen Realisierung ökonomischer Modelle. Prof. Gehrig hat mit seinen Mitarbeitern seit Mitte der siebziger Jahre ein System bestehend aus Daten-, Hypothesen- und Methodenbank geschaffen, das unter dem Namen CUE (concise utilities of econometrics) steht, und sehr flexibel ist und sogar über Datenfernübertragung (auch von Thailand aus) von Dritten zu nutzen ist. In seinem kompletteren Referat „Ein Quellengenerator für Makro-Modelle — Eine Anwendung auf das Frankfurter Thailand-Modell“ stellte Prof. Dr. *Götz Uebe* (Universität der Bundeswehr Hamburg) einen Ansatz vor, mit dem es u. a. möglich ist, die explizite (nicht-numerische) Ableitung der Modellgleichungen für die Newton-Raphson-Methode zu gewinnen. Diese führt i. d. R. zu einer schnelleren Konvergenz als das Gauß-Seidel-Verfahren bei der Erstellung von ex-post- und ex-ante-Prognosen mit einem interdependenten ökonometrischen Modell. Die Entwicklung am Quellengenerator ist noch nicht abgeschlossen, soll jedoch ab Herbst Interessenten zur Verfügung stehen.

Als Gäste referierten Prof. Dr. *Helmut Lütkepohl* (Universität Hamburg) und Prof. Dr. *Gerhard Arminger* (Bergische Universität/Gesamtschule Wuppertal). Herr Lütkepohl behandelte unter dem Titel „Prognosetests für Strukturstabilität“ drei Gruppen von Teststatistiken, die alle auf den Prognosen univariater Zeitreihen basieren. Die erste Gruppe ignoriert die aus der Spezifikation und Schätzung herrührende Variabilität, die zweite Gruppe nur die mit der Spezifikation verbundene Unsicherheit, während die dritte Gruppe beide Ursachenkomplexe der Variabilität berücksichtigt. Obwohl korrespondierende Statistiken in den drei Gruppen identische asymptotische Verteilungen besitzen, differieren die Kleinstichprobeneigenschaften beträchtlich. Vorgeschlagen wird daher die Verwendung von Statistiken aus der dritten Gruppe. Herr Arminger ging in seinem mikroökonomisch ausgerichteten Referat „Strukturgleichungsmodelle in latenten Variablen mit Indikatoren beliebigen Meßniveaus“ auf die noch zu schließenden Lücken bei diesen Modelltypen ein. Künftig werden wir es in ökonometrischen Anwendungen in der Bundesrepublik nach der Zurverfügungstellung der Daten aus dem

Sozioökonomischen Panel verstärkt mit Querschnittsdaten und Indikatormodellen zu tun haben, so daß die theoretische und numerische Behandlung solcher Modelle mit den verschiedensten Indikatorvariablentypen (stetig, zensiert, dichotom, polytom, ordinal, diskret) geklärt sein muß.

Prof. Dr. Dr. *Josef Gruber* (Fernuniversität Hagen) lieferte einen Beitrag mit dem Titel „Kombinierte Wirkungsflächenregression zur Analyse der Ergebnisse von Monte-Carlo-Studien über Kleinstichprobeneigenschaften von Schätzern“. Im allgemeinen sind die asymptotischen Eigenschaften (große Stichproben) von Schätzern ökonometrischer Modelle bei den verschiedensten Spezifikationsmerkmalen dieser Modelle bekannt, nicht jedoch bei den in der Praxis vorherrschenden kleinen Stichproben. Analytische Ergebnisse sind kaum zu gewinnen, so daß man sich auf Simulationsergebnisse stützen muß. Da jedoch die auf die Schätzeigenschaften einwirkenden Spezifikationsmerkmale sehr zahlreich sind und ferner viele Ausprägungen aufweisen, ist eine Planungs- und Auswertungsstrategie der erforderlichen Monte-Carlo-Studien gefragt. Herr Gruber schlug dazu eine spezielle Regressionsrechnung vor.

Prof. Dr. *Klaus Conrad* (Universität Mannheim) entwickelte in seinem Referat „Ex-post Tests auf kurz- und langfristige Optimierung“ Prüfungsverfahren für langfristige Gleichgewichtsmodelle, wobei letztere dadurch definiert sind, daß die beobachteten Niveaus von Output und Kapital mit einem Optimierungsverhalten konsistent sind. Ein Satz von Parameterrestriktionen für das verwendete Translog-System der Kostenfunktionen wurde eingeführt, um in Form einer Serie getesteter Hypothesen zu prüfen, ob die beobachteten Werte von Kapital und/oder Output einer Firma mit dem langfristig optimalen Niveau übereinstimmen, welches von der Firma gewählt wird, wenn die kurzfristige Fixheit von Kapital und Output als nicht-restriktiv für deren optimale Ressourcenaufteilung angesehen wird. Getestet wurde an den Jahresdaten (1960 - 1981) für 28 Wirtschaftszweige der Bundesrepublik. Das Ergebnis war, daß die Realität nicht mit dem Optimierungsverhalten kompatibel ist.

In der Mitgliederversammlung wurde ausführlich von den anwesenden Teilnehmern über ihre Ausstattung mit Hard- und Software zur ökonometrischen Arbeit berichtet. Eine Erhebung über diesen Gegenstand bei allen Ausschußmitgliedern ist geplant. Im Vordergrund soll die Verfügbarkeit von PCs und gekaufter sowie selbst entwickelter statistisch-ökonomischer Software stehen. Auch deren Einsatz und Verfügbarkeit im Unterricht soll erhoben werden. Die Befragungsergebnisse sollen dem Austausch von Programmen dienen und zeit- sowie kostenaufwendige Doppelentwicklungen vermeiden helfen.

Prof. Dr. H. Rinne, Gießen