

Stefan Sauer

ifo Konjunkturmfragen: Ein Überblick über die verfügbaren Zeitreihen

Seit 1949 befragt das ifo Institut in seinen monatlichen Konjunkturmfragen Unternehmen aus ganz Deutschland zu ihrer aktuellen konjunkturellen Situation sowie Plänen und Erwartungen für die nahe Zukunft. Aus den Befragungsergebnissen wird unter anderem der ifo Geschäftsklimaindex Deutschland berechnet, der als wichtigster Frühindikator für die Entwicklung der deutschen Wirtschaft gilt. Darüber hinaus veröffentlicht das ifo Institut aber noch viele weitere Konjunkturindikatoren, wie etwa die Exporterwartungen im Verarbeitenden Gewerbe oder das Beschäftigungsbarometer, und bietet Zeitreihen für zahlreiche Wirtschaftsbereiche an, die aus den verschiedenen erhobenen Fragestellungen gebildet werden. Dieser Artikel gibt einen Überblick über die verfügbaren Umfrageergebnisse und Zeitreihen. Der Fokus liegt dabei vor allem auf neu entwickelten Indikatoren sowie länger zurückreichenden Zeitreihen für Westdeutschland vor der Wiedervereinigung.

DER ZEITREIHENKATALOG DER IFO KONJUNKTURUMFRAGEN: ÜBERBLICK UND NEUHEITEN

Jeden Monat befragt das ifo Institut für die ifo Konjunkturmfragen rund 9 000 Unternehmen in Deutschland zu ihrer Geschäftslage und anderen Aspekten ihrer Geschäftstätigkeit. Der Hauptteil des regelmäßig erhobenen Frageprogramms fokussiert sich zum einen auf die Beurteilung der aktuellen Situation und zum anderen auf die Erwartungen und Pläne der Unternehmen für die folgenden drei bis sechs Monate.

Mit gewichteten Aggregationsverfahren werden die Antworten der Unternehmen zu Zeitreihen und aussagekräftigen Konjunkturindikatoren zusammengefasst. Hierbei sticht insbesondere der ifo Geschäftsklimaindex Deutschland als meistbeachteter Indikator heraus. Aber auch darüber hinaus liefern die weiteren Indikatoren und Zeitreihen wichtige Informationen zu konjunkturellen Entwicklungen; diese sind nicht nur für die Gesamtwirtschaft, sondern auch auf Sektorebene und für über 400 Wirtschaftszweige und Einzelsparten des Verarbeitenden Gewerbes, des Dienstleistungssektors, des Bauhauptgewerbes und des Groß- und Einzelhandels verfügbar.

Die ifo Konjunkturmfragen wurden ursprünglich als Ergänzung zu den Daten der amtlichen Statistik konzipiert. Sie liefern Informationen über zahlreiche Sachverhalte, die von der amtlichen Statistik nicht erfasst oder erst mit zeitlicher Verzögerung veröffentlicht werden. Die aus den ifo Konjunkturmfragen

berechneten Zeitreihen kommen deshalb insbesondere in der Konjunkturanalyse, d.h. der Diagnose und Prognose der gesamtwirtschaftlichen Entwicklung, zur Anwendung. Zahlreiche Konjunkturindikatoren aus den Befragungen sind dafür von großer Bedeutung. Die regelmäßig erhobenen Daten fließen aber nicht nur in die ifo Konjunkturprognose ein, sie bilden beispielsweise auch eine wichtige Grundlage für branchenspezifische und gesamtwirtschaftliche Analysen von Unternehmen, Verbänden und staatlichen Stellen. Die Umfrageergebnisse werden zudem jeden Monat ausführlich in vielen Medien diskutiert und interpretiert.

Die Zeitreihen zum Geschäftsklima, zur aktuellen Lage und zu den Erwartungen für die kommenden Monate stehen für die Gesamtwirtschaft sowie die einzelnen Sektoren auf der ifo Website kostenlos zum Download zur Verfügung (<https://www.ifo.de/umfragen/zeitreihen>). Das Gleiche gilt für die ifo Exporterwartungen, das Beschäftigungsbarometer und das regionale Geschäftsklima für die neuen Bundesländer. Die zahlreichen weiteren aus den ifo Konjunkturmfragen berechneten Zeitreihen und Indikatoren können per E-Mail an: »umfragedaten@ifo.de« bestellt werden. Sämtliche Bestellinformationen sowie eine Übersicht über alle bestellbaren Zeitreihen finden sich ebenfalls auf der ifo Website (<https://www.ifo.de/umfragen/zeitreihen-bestellen>).

Tabelle 1 zeigt am Beispiel des Verarbeitenden Gewerbes eine Übersicht über alle Themenbereiche, für die in diesem Sektor Zeitreihen verfügbar sind, und in welcher Frequenz die einzelnen Fragen

Tab. 1

Themenübersicht der Zeitreihen für das Verarbeitende Gewerbe

Themen	Frequenz	Zeitreihen seit
Aktuelle Situation		
Geschäftsklima	monatlich	01/1991
Beurteilung der Geschäftslage	monatlich	01/1991
Beurteilung der Lagerbestände	monatlich	01/1991
Beurteilung des Auftragsbestands	monatlich	01/1991
Beurteilung des Auftragsbestands im Exportgeschäft	monatlich	01/1991
Entwicklung im Vormonat		
Veränderung der Nachfragesituation	monatlich	01/1991
Veränderung des Auftragsbestands	monatlich	01/1991
Veränderung der Produktionstätigkeit	monatlich	01/1991
Preisänderungen	monatlich	01/1991
Veränderung der Beschäftigtenzahl	monatlich	07/2018
Pläne und Erwartungen für die nächsten drei Monate		
Exportserwartungen	monatlich	01/1991
Produktionspläne	monatlich	01/1991
Preiserwartungen	monatlich	01/1991
Beschäftigtenpläne	monatlich	07/1997
Erwartungen für die nächsten sechs Monate		
Geschäftserwartungen	monatlich	01/1991
Unsicherheit der Unternehmen	monatlich	07/2017
Produktionsbehinderungen		
zu wenig Aufträge	vierteljährlich	01/1991
Mangel an Arbeitskräften insgesamt	vierteljährlich	07/2018
Mangel an Fachkräften	vierteljährlich	01/1991
Finanzierungsengpässe	vierteljährlich	01/1991
Mangel an Rohstoffen/Vormaterialien	vierteljährlich	01/1991
zu geringe technische Kapazitäten	vierteljährlich	01/1991
Behinderungen durch sonstige Faktoren	vierteljährlich	01/1991
Kapazität		
Kapazitätsauslastung in %	vierteljährlich	01/1991
Beurteilung der technischen Kapazität	vierteljährlich	01/1991
Investitionen		
Investitionen insgesamt	halbjährlich	05/2015
Ausrüstungsinvestitionen	halbjährlich	05/2015
Bauinvestitionen	halbjährlich	05/2015
Investitionen in Software/Datenbanken	halbjährlich	05/2018
Weitere Themen		
Kreditvergabeverhalten der Banken	vierteljährlich	03/2017
Kurzarbeit	vierteljährlich	01/1991
Überstunden	vierteljährlich	01/1991
Wettbewerbsposition	vierteljährlich	07/1994
Auftragsbestand in Monaten	vierteljährlich	01/1991
Ertragslage	halbjährlich	06/2002

Quelle: ifo Konjunkturumfragen.

erhoben werden. Dies gilt nicht nur für das gesamte Verarbeitende Gewerbe, sondern auch für die einzelnen Unterbereiche, wie etwa den Maschinenbau, den Fahrzeugbau oder die chemische Industrie, und zahlreiche noch tiefer gegliederte Industriezweige.

Die abgefragten Themengebiete gehen deutlich über die meistbeachteten Indikatoren, wie Klima, Lage und Erwartungen oder auch Exporte und Beschäftigungsentwicklung, hinaus. Neben monatlich abgefragten Themen, wie Produktionstätigkeit, Lagerbestände und Preisänderungen, liefern auch in geringerer Frequenz abgefragte Variablen, wie die Kapazitätsauslastung und Produktionsbehinderungen (z.B. Fachkräftemangel oder Auftragsmangel), wichtige Informationen zu aktuellen konjunkturellen Entwicklungen. Im Zuge der seit dem vergange-

nen Jahr wieder verstärkt von Unternehmen in Anspruch genommenen Kurzarbeit sind auch die Zeitreihen zu diesem Thema wieder von einem erhöhten Interesse (vgl. Link und Wollmershäuser 2019).

Wie die in Tabelle 1 ebenfalls dargestellten Startzeitpunkte der Zeitreihen erkennen lassen, wird das Frageprogramm der ifo Konjunkturumfragen kontinuierlich evaluiert, um bei Bedarf Fragen zu verändern oder neue Variablen hinzuzufügen. Aktuelle Beispiele hierfür sind die Fragen zum Kreditvergabeverhalten der Banken, deren Formulierung im Jahr 2017 angepasst wurde (vgl. Marjenko et al. 2019), oder die seit 2015 in allen Umfragebereichen eingeführte Abfrage der Investitionen, aufgeteilt nach Ausrüstungen, Bauten und Datenbanken und Software. Die Investitionserwartungen für das laufende und nächste Jahr ergeben einen neuen Frühindikator für die Investitionstätigkeit der deutschen Unternehmen (vgl. Wollmershäuser 2018). Die Unsicherheit der Unternehmen bezüglich der künftigen Geschäftsentwicklung hat sich in den vergangenen Jahren ebenfalls zu einem wichtigen Feld in der Konjunkturbeobachtung herauskristallisiert (vgl. Grimme 2017). Dazu erhebt das ifo Institut

in den Konjunkturumfragen gleich mehrere Variablen, zu denen ebenfalls bereits Zeitreihen erhältlich sind.

Die Zeitreihen beziehen sich in der Regel auf ganz Deutschland. Bei genügend großer Teilnehmerzahl sind darüber hinaus aber auch Auswertungen für einzelne Bundesländer möglich (vgl. Lehmann et al. 2019). Aus diesen Regionalauswertungen ergeben sich wichtige Informationen für die regionale Konjunkturanalyse.

Umfangreiche Informationen zum kompletten Frageprogramm in allen Umfragebereichen inklusive der genauen Formulierungen der verschiedenen Fragen finden sich in Sauer und Wohlrabe (2020). Dort wird auch ausführlich auf die zur Berechnung der Zeitreihen verwendete Methodik (gewichtete Aggregationen, Saisonbereinigung etc.) sowie die Interpre-

tation und Anwendungen der verschiedenen Indikatoren eingegangen.

ZEITREIHEN VOR 1990

Die zuvor beschriebenen Zeitreihen für Gesamtdeutschland starten zum größten Teil im Jahr 1991.¹ Für (konjunktur-)historische Analysen ist es darüber hinaus auch oft hilfreich, länger zurückliegende Reihen zur Verfügung zu haben. Da die ifo Konjunkturumfragen bereits seit 1949 durchgeführt werden, stehen verschiedene Zeitreihen über einen länger zurückliegenden Zeitraum für Westdeutschland zur Verfügung (vgl. Sommer und Wohlrabe 2016). Da die Befragungsergebnisse aus den Anfangsjahren der Konjunkturumfragen nicht in digitalisierter Form vorliegen, ist der Anfangszeitpunkt der meisten Reihen dabei im Januar 1960.

Sie umfassen das komplette Frageprogramm der Sektoren Verarbeitendes Gewerbe, Bauhauptgewerbe sowie Groß- und Einzelhandel. Neben den Hauptreihen Geschäftsklima, Geschäftslagebeurteilung sowie Geschäftserwartungen sind dies monatlich erhobene Fragen zu Entwicklungen im Vormonat (z.B. Umsätze, Preise, Nachfrage, Auftragsbestand), aktuelle Einschätzungen (z.B. Lagerbestand, Kapazitätsauslastung, Produktionsbehinderungen) sowie

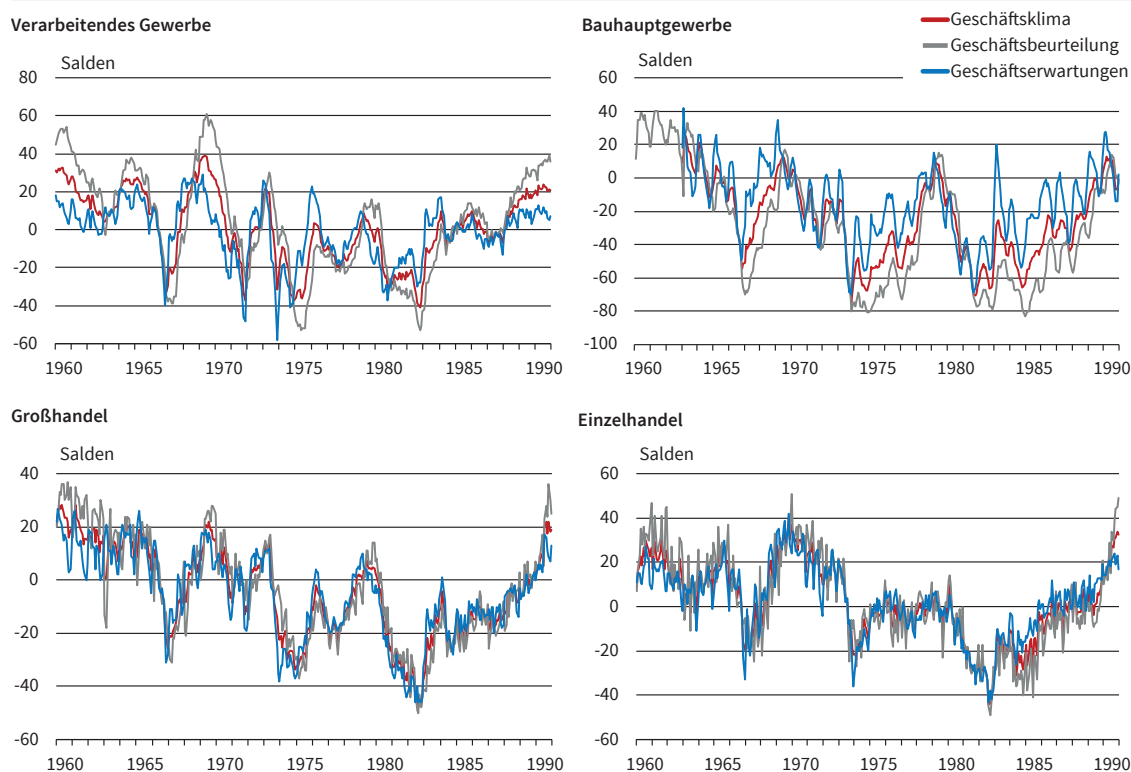
Erwartungen und Pläne für die kommenden Monate (z.B. Exporte, Beschäftigte, Bestellungen) oder behindernde Faktoren für die Unternehmen (z.B. Fachkräftemangel). Alle verfügbaren Zeitreihen auf Sektorebene aus dem Zeitraum vor der Wiedervereinigung sind auf der Website des ifo Instituts kostenlos abrufbar (<https://www.ifo.de/umfragen/zeitreihen>). Abbildung 1 zeigt das Geschäftsklima, Lage und Erwartungen für die Sektoren. Diese Zeitreihen für Westdeutschland wurden nach der zum jeweiligen Erhebungszeitpunkt gültigen Wirtschaftszweigklassifikation berechnet und sind nicht saisonbereinigt. Insbesondere beim Bauhauptgewerbe sowie beim Einzelhandel sind deshalb zum Teil deutliche saisonale Muster erkennbar. Zeitreihen für manche Untergruppen der Sektoren (z.B. Maschinenbau, Hochbau und Tiefbau etc.) sind ebenfalls vereinzelt vorhanden und gegebenenfalls auf Nachfrage per E-Mail unter: »umfragedaten@ifo.de« erhältlich.

UMFASSENDES SPEKTRUM VON INDIKATOREN UND ZEITREIHEN

Aus den ifo Konjunkturumfragen entsteht ein umfassendes Spektrum an verschiedenen Indikatoren und Zeitreihen, die relevant für Konjunkturbeobachtungen und -prognosen sind. Das Fragenprogramm und die zur Bildung der Zeitreihen verwendete Methodik werden durch kontinuierliche Evaluierung einer fortwährenden Qualitätskontrolle unterzogen. Durch das Hinzufügen neuer Fragen oder das Berechnen

¹ Die Konjunkturumfrage im Dienstleistungssektor startete erst im Januar 2005. Daher ist dies der Beginn der Zeitreihen dieses Bereichs sowie der Gesamtindikatoren für Deutschland, die den Dienstleistungssektor beinhalten.

Abb. 1
Geschäftsklima, -lage und -erwartungen in den Sektoren von 1960 bis 1990



Quelle: ifo Konjunkturumfragen.

© ifo Institut

nen neuer Aggregate arbeitet das ifo Institut zudem regelmäßig an der Ausweitung des Angebots an Konjunkturindikatoren.

Die Zeitreihen sind zum Teil direkt kostenlos auf der ifo Website abrufbar; zahlreiche weitere Zeitreihen können auf Anfrage bestellt werden. Darüber hinaus sind die Umfrageergebnisse für Forscher auch auf der disaggregierten Mikrodatenebene vor Ort im ifo Institut am LMU-ifo Economics & Business Data Center (EBDC) kostenlos für Forschungsprojekte zugänglich (vgl. Seiler 2012).

LITERATUR

- Grimme, C. (2017), »Messung der Unternehmensunsicherheit in Deutschland – das ifo Streuungsmaß«, *ifo Schnelldienst* 70(15), 19–25.
- Lehmann, R., F. Leiss, S. Litsche, S. Sauer, M. Weber, A. Weichselberger und K. Wohlrabe (2019), »Mit den ifo-Umfragen regionale Konjunktur verstehen«, *ifo Schnelldienst* 72(9), 45–49.
- Link, S. und T. Wollmershäuser (2019), »Zur Bedeutung der Kurzarbeit als wirtschaftspolitisches Instrument in Deutschland«, *ifo Schnelldienst* 72(18), 21–23.
- Marjenko, A., S. Sauer und K. Wohlrabe (2019), »Die neue Kredithürde: Hintergründe und Ergebnisse«, *ifo Schnelldienst* 72(18), 46–48.
- Sauer, S. und K. Wohlrabe (2020), *ifo Handbuch der Konjunkturumfragen*, ifo Beiträge zur Wirtschaftsforschung 88, ifo Institut, München.
- Seiler, C. (2012), »The Data Sets of the LMU-ifo Business & Economics Data Center – A Guide for Researchers«, *Journal of Applied Social Science Studies* 132(4), 609–618.
- Sommer, V. und K. Wohlrabe (2016), »Historische ifo-Konjunkturzeitreihen«, *ifo Schnelldienst* 69(14), 36–37.
- Wollmershäuser, T. (2018), »Die ifo Investitionserwartungen – ein neuer Frühindikator für die Investitionstätigkeit deutscher Unternehmen«, *ifo Schnelldienst* 71(23), 32–35.