

Erläuterungen

Konjunkturindikatoren

Als Konjunkturindikatoren sind solche Größen geeignet, deren statistische Zeitreihen in ihrem Verlauf die mehrjährigen, mit gewisser Regelmäßigkeit wiederkehrenden Schwankungen der wirtschaftlichen Aktivitäten einer Volkswirtschaft erfahrungsgemäß gut widerspiegeln. Entsprechend ihrem zeitlichen Verhalten im Konjunkturablauf wird zwischen voraus-, gleich- und nachlaufenden Indikatoren (Früh-, Präsenz- und Spätindikatoren) unterschieden.

Frühindikatoren: z.B. Auftragseingänge, Baugenehmigungen

Präsenzindikatoren: z.B. Umsatz, Preise

Spätindikatoren: z.B. Arbeitslose, Insolvenzen

Mangels eines Produktionsindex für das sächsische Produzierende Gewerbe, dem erfahrungsgemäß geeignetsten kurzfristigen Präsenzindikator, wird im Konjunkturbericht ersatzweise auf monatliche Umsatzgrößen (Grundzahlen bzw. Indizes) zurückgegriffen, um das gegenwärtige wirtschaftliche Geschehen beurteilen und damit eine Standortbestimmung im jeweiligen Zyklus vornehmen zu können.

Zeitreihenanalyse

Sachgerechte Zeitreihenanalysen sind heute von immenser Bedeutung für die Konjunkturbeobachtung. Mit ihrer Hilfe soll die mittel- bis langfristige Entwicklungsrichtung in ökonomischen Zeitreihen deutlicher sichtbar gemacht werden. Nur so ist es möglich, die Situation am aktuellen Rand von Zeitreihen besser in deren Verlauf einzuordnen und präziser auf die konjunkturelle Situation zu schließen. Häufig ist dazu die Zerlegung einer Zeitreihe in einzelne Bewegungskomponenten (z.B. Trend-, Konjunktur- oder Saisonkomponente) angebracht, um die in den Originaldaten enthaltenen störenden Einflüsse zu eliminieren. Bei der Konjunkturbeobachtung wird vor allem die **Trend-Konjunktur-Komponente** (eine zusammengefasste Bewegungskomponente einer statistischen Zeitreihe) genutzt. Sie verläuft glatt und verdeutlicht die mittel- bis langfristige Entwicklungsrichtung der Reihe. In ihr sind saisonal bedingte Einflüsse, Kalenderunregelmäßigkeiten sowie Extremwerte nicht mehr enthalten.

Die Zeitreihenanalyse erfolgt nach dem **Berliner Verfahren, Version 4.1 (kurz BV4.1)**. Diese Version wird vom **Statistischen Bundesamt** seit Mitte 2004 angewandt. Seit Mitte Februar 2006 ist eine Überarbeitung dieser Version verfügbar. Die Version 4 hatte sich in der Praxis gut bewährt, in der Version 4.1 wurden Verbesserungen bei der Analyse von Zeitreihen vorgenommen. Nach einer möglichen Extremwert- und/oder Kalenderbereinigung erfolgt die Schätzung der Trend-Konjunktur-Komponente. Diese wird unter Berücksichtigung der Existenz der Saisonkomponente aus den Originalwerten herausgelöst. Die Trend-Konjunktur-Komponente wird mit Hilfe von geeigneten Filtern - Folgen von Elementen, mit denen die Ausgangswerte einzeln multipliziert und zusammengefasst werden - geschätzt. Für den mittleren Bereich der Zeitreihe wird ein Mittelfilter eingesetzt, am Ende der Zeitreihe kommen mehrere Randfilter zum Einsatz. Stützbereiche für den Mittelfilter der Trend-Konjunktur-Komponente sind eine Spanne von 27 Monaten. BV4.1 bietet außerdem die Möglichkeit, Sprungstellen zu definieren.

Subjektive Beeinflussungen der Analyse werden bei BV4.1 dadurch vermieden, dass alle statistischen Monatsreihen mit einem je Komponente einheitlichen Satz von Filtern analysiert werden können. Diese Filterauswahl ist durch langjährige Tests in der Praxis des Statistischen Bundesamtes aus methodischer Sicht optimiert. Iterative Rechengänge entfallen. Vom Bearbeiter beeinflusst werden kann, ob eine Extremwertbereinigung bzw. Kalenderbereinigung vorgenommen wird oder nicht. Derzeit wird allen zu analysierenden Reihen eine Extremwertbereinigung vorgeschaltet. Eine arbeitstägliche Kalenderbereinigung erfolgt für die Auftragseingangs- und Umsatzindizes im Verarbeitenden Gewerbe sowie die Auftragseingangsindizes und den Umsatz im Baugewerbe. Für den Einzelhandelsumsatz wird eine werktägliche Bereinigung angewandt, für die Aus- und Einfuhr eine wochentägliche Bereinigung.

Zur Zeitreihenanalyse wird das vom Statistischen Bundesamt zur Verfügung gestellte MS-DOS-/Java-Programm verwendet. Ein am Statistischen Landesamt des Freistaates Sachsen erstelltes Makro in der Programmiersprache Visual Basic for Application (in Excel) erlaubt die menügestützte Handhabung des Zeitreihenanalyseprogramms. Das Makro (einschließlich Dokumentation) können wir Ihnen für nichtgewerbliche Zwecke bereitstellen.