

## Vorwort des Herausgebers

**Hans Wolfgang Brachinger**

Online publiziert: 22. April 2011  
© Springer 2011

Zur Reduktion der Dauer der Arbeitslosigkeit und zur Reintegration von Arbeitslosen in den Arbeitsmarkt werden von Arbeitsmarkt- und Sozialpolitikern immer wieder Maßnahmen und Strategien vorgeschlagen, von denen man hofft, dass sie die gewünschten Wirkungen erzielen. Inwieweit diese Maßnahmen tatsächlich wirken, ist zunächst meist unsicher und muss empirisch überprüft werden.

Das vorliegende erste Heft des Jahrgangs 2011 des *Wirtschafts- und Sozialstatistischen Archivs (WiSoStA)* beginnt mit einem Überblick von Reinhard Hujer zum Thema „*Mikroökonomie und Kausalität: Zur Bedeutung arbeitsmarktpolitischer Evaluationsstudien*“ (Hujer 2011). Evaluationsstudien spielen heute in der Politikberatung eine wichtige Rolle. Sie sind eine wichtige Grundlage für politische Entscheidungen in der Arbeitsmarkt- und Sozialpolitik. Hujer beschreibt zunächst die Methodik der mikroökonomischen Evaluation und weist dabei auf das zentrale Problem der Selektionsverzerrung aufgrund unbeobachteter Faktoren hin. Er stellt die wichtigsten Methoden zur Behandlung dieses Problems dar und zeigt deren Anwendung und ihre empirische Umsetzung anhand ausgewählter Studien aus der Arbeitsmarktpolitik. Hujer macht deutlich, dass die konzeptionellen und methodischen Grundlagen der Evaluationsanalysen, insbesondere für nicht-experimentelle Daten, auch in anderen inhaltlichen Forschungsfeldern anwendbar sind.

Ab 2005 wird der Mikrozensus bekanntlich auf eine kontinuierliche Erhebung mit gleitender Berichtswoche umgestellt. Damit sind Quartalsauswertungen und die Berechnung von Jahresdurchschnittsergebnissen möglich geworden. In seiner

---

H.W. Brachinger (✉)

Departement für Quantitative Wirtschaftsforschung, Universität Freiburg, Péroles 90, 1700 Freiburg, Schweiz

e-mail: [editor-asta@unifr.ch](mailto:editor-asta@unifr.ch)

Arbeit „*Schätzung des Stichprobenfehlers in Mikrozensus Scientific Use Files ab 2005*“ stellt Bernhard Schimpl-Neimanns das Stichprobendesign des Mikrozensus dar (Schimpl-Neimanns 2011). Er beschreibt die Ziehung der Scientific Use Files und verdeutlicht, wie mit den Scientific Use Files des Mikrozensus ab 2005 der Stichprobenfehler für Gesamt- und Anteilswerte geschätzt werden kann. Schimpl-Neimanns skizziert, wie beim Mikrozensus ab 2005 Varianzschätzungen bei gebundener Hochrechnung mittels Regressionsschätzung bzw. mittels Kalibrierung durchgeführt werden können. Sein Beitrag schließt mit Überlegungen, wie künftig das Analysepotenzial des Mikrozensus durch die Bereitstellung zusätzlicher Designmerkmale besser ausgeschöpft werden kann.

Die beiden weiteren Aufsätze in diesem Heft haben spezielle statistische Probleme im Zusammenhang mit Krediten zum Gegenstand. In ihrem Aufsatz „*Probleme des Qualitätsvergleichs von Kreditausfallprognosen*“ befassen sich Walter Krämer und Michael Bücker mit Aussagen zur Wahrscheinlichkeit, dass ein Kunde innerhalb einer bestimmten Periode seinen Kreditverbindlichkeiten nicht in vollem Maße nachkommt (Krämer and Bücker 2011). Solche Wahrscheinlichkeitsprognosen sind offensichtlich von großem praktischem Interesse. Ihre statistische Qualität lässt sich auf verschiedene Weise messen und vergleichen. In ihrem Übersichtsartikel fassen Krämer und Bücker die in der Literatur gemachten Vorschläge zusammen und diskutieren deren Eignung für Kreditausfallprognosen im Privatkundengeschäft. Sie weisen darauf hin, dass nicht alle Qualitätskriterien gleichermaßen sinnvoll sind. Insbesondere vertreten sie die Auffassung, dass die in der Meteorologie beliebten Brier Scores und verwandte Kriterien für diese Anwendungen eher schlecht geeignet sind.

Im Zentrum der Finanzkrise der Jahre 2007–2009 standen so genannte strukturierte Kreditprodukte, also Finanzinstrumente, die im Wesentlichen auf tranchierten Kreditportfolios basieren. Zur Bewertung der Tranchen eines Portfolios existiert eine Vielzahl von Maßzahlen. Ausgangspunkt des Aufsatzes „*Risikomaßzahlen für Kreditportfoliotranchen*“ von Daniel Tillich ist die Tatsache, dass sich für die einzelnen Konzepte noch keine einheitliche Bezeichnung herausgebildet hat und gleiche Bezeichnungen teilweise für unterschiedliche Maßzahlen stehen (Tillich 2011). In seinem Aufsatz katalogisiert Tillich die verwendeten Begriffe und schlägt für jede Maßzahl eine einheitliche, unverwechselbare Bezeichnung vor. Für jede Maßzahl werden ihre charakteristischen Eigenschaften zusammengetragen. Tillich macht deutlich, dass im Prinzip zwei Maßzahlen zur Bewertung der Tranchen eines Portfolios genügen.

Der Herausgeber freut sich in diesem Heft des *Wirtschafts- und Sozialstatistischen Archivs (WiSoStA)* eine Reihe von Aufsätzen präsentieren zu können, die besonders aktuelle und wichtige statistische Themen behandeln. Ich wünsche diesem Heft viele interessierte Leser!

Herausgeber

## Literatur

Hujer R (2011) Mikroökometrie und Kausalität: Zur Bedeutung arbeitsmarktpolitischer Evaluationsstudien. *AStA Wirtsch Sozialstat Arch* 5(1). doi:[10.1007/s11943-011-0094-2](https://doi.org/10.1007/s11943-011-0094-2)

- Schimpl-Neimanns B (2011). Schätzung des Stichprobenfehlers in Mikrozensus Scientific Use Files ab 2005. *AStA Wirtsch Sozialstat Arch* 5(1). doi:[10.1007/s11943-011-0092-4](https://doi.org/10.1007/s11943-011-0092-4)
- Krämer W, Bücker M (2011) Probleme des Qualitätsvergleichs von Kreditausfallprognosen. *AStA Wirtsch Sozialstat Arch* 5(1). doi:[10.1007/s11943-011-0096-0](https://doi.org/10.1007/s11943-011-0096-0)
- Tillich D (2011) Risikomaßzahlen für Kreditportfoliotranchen. *AStA Wirtsch Sozialstat Arch* 5(1). doi:[10.1007/s11943-011-0095-1](https://doi.org/10.1007/s11943-011-0095-1)