

Zum Geleit

Winfried Stier

Dass eine Analyse von Zeitreihen mit inadäquaten statistischen Methoden zu solch dramatischen Konsequenzen führt wie im Fall von N. D. Kondratieff, der in einem Stalinschen Gulag endete, dürfte wohl einmalig sein. Seine „Entdeckung“ und Interpretation langer Konjunkturwellen stand im scharfen Kontrast zur herrschenden Sowjet-Ideologie. Inadäquat war die Vorgehensweise von Kondratieff insofern, als er seine Reihen auf eine sehr einfache Weise trendbereinigte mittels Polynomen der Zeit, wobei er ohne nähere Begründung Polynome vom Grad 1 bis zum Grad 3 verwendete. Einer der ersten Kritiker dieser simplen Trendbestimmung war Oskar Anderson, der zeigte, dass man je nach gewähltem Polynomgrad zu anderen Resultaten kam als Kondratieff. „Mit Rücksicht auf das traurige Schicksal, das Kondratieff nach Beendigung der NEP-Periode in Sowjet-Rußland widerfuhr, habe ich die Ergebnisse meiner Berechnungen seinerzeit nicht veröffentlicht. Ich möchte übrigens bemerken, daß ich nicht die Existenz von langen Wellen der Konjunktur überhaupt beanstande, sondern mich nur gegen jene Methode wende, mit Hilfe welcher Kondratieff deren Existenz nachzuweisen glaubte“ (O. Anderson: Probleme der statistischen Methodenlehre, Physika - Verlag, Würzburg 1957, S. 176).

Trotz dieser berechtigten Methodenkritik hat die Idee langer Konjunkturwellen bis heute nichts von ihrer Faszination eingebüßt, obgleich es während der nach dem Ende des 2. Weltkrieges einsetzenden langen Wachstumsperiode relativ still um die „Langen Wellen“ wurde. Nicht Konjunktur- sondern Wachstumstheorien standen im Zentrum des wissenschaftlichen Interesses. Das änderte sich aber etwa ab Mitte der 70er Jahre des letzten Jahrhunderts, nachdem vermehrt rezessive Entwicklungen vor allem in den westlichen Volkswirtschaften zu beobachten waren. Handelte es sich dabei vielleicht um die Abschwungsphase eines Kondratieff-Zyklus? Diese Frage hat damals Ökonomen und Wirtschaftshistoriker in gleichem Maße beschäftigt. Man sah sich – einmal abgesehen von der theoretischen Erklärung des Phänomens – nicht nur mit genuin wirtschaftshistorischen Problemen konfrontiert, sondern auch mit der Unzulänglichkeit der damals zur Verfügung stehenden Werkzeuge der Zeitreihenanalyse. Unter den Wirtschaftshistorikern hat sich Rainer Metz um eine Synthese von Wirtschaftstheorie, Statistik und Geschichte in besonderer Weise verdient gemacht. Insbesondere hat er konsequent und gründlich die beiden

alternativen Forschungsansätze „Filter-Design“ und „Model-based approach“ auf ihre Tauglichkeit für empirische Überprüfungen von „Langer-Welle-Hypothesen“ untersucht.

Wer sich generell mit diesem Themenkreis beschäftigt, findet in den von Rainer Metz (teilweise mit Koautoren) verfassten Schriften, die in dem vorliegenden Sammelband erstmalig geschlossen publiziert werden, nicht nur den „state of the art“ in einer auch für Nicht-Statistiker verständlichen Weise dargestellt, sondern auch die Forschungskontroversen der vergangenen 25 Jahre. Methodisch-statistische, ökonomisch-theoretische und wirtschaftshistorische Forschungen standen dabei in einem sich wechselseitig bedingenden, teilweise kontroversen aber insgesamt fruchtbaren Verhältnis, ohne das wissenschaftlicher Fortschritt nicht möglich gewesen wäre. Dieser spiegelt sich in den hier versammelten Schriften exemplarisch wider, weshalb sie auch einen wichtigen Beitrag zur Geschichte der Forschung auf diesem Gebiet darstellen.

Das „letzte Wort“ im Hinblick auf die Existenz „Langer Wellen“ scheint noch nicht gesprochen zu sein. Noch stehen sich insbesondere „Filter-approach“ und „Model-based approach“ mit teilweise kontroversen Resultaten gegenüber. Es bleibt also spannend! Dem Sammelband ist alleine schon deshalb eine weite Verbreitung und Beachtung zu wünschen.

Winfried Stier

St. Gallen, im April 2008

Vorwort

Dieser Band vereinigt 12 Beiträge zum Thema „Lange Wellen der Konjunktur“. Ihr generelles Anliegen ist es, Aussagen über die Existenz langfristiger Konjunkturzyklen in ausgewählten ökonomischen Reihen mit Hilfe zeitreihenanalytischer Verfahren abzuleiten. Sie sind meist aus Vorträgen nationaler und internationaler Tagungen entstanden und deshalb weit verstreut publiziert und nicht immer leicht zugänglich.

Die Aufsätze sind im Verlauf von 25 Jahren entstanden und besonders in ihren Anfängen eng mit den Arbeiten von Winfried Stier verknüpft. Er war es, der bereits Ende der 1970er Jahre die Konstruktion und Verwendung idealer Filter forderte, allerdings nicht primär für die Untersuchung Langer Wellen, sondern für die Saisonbereinigung. Die von ihm und seinen Schülern entwickelten Filter können im Rückblick als bedeutende Pionierleistung auf diesem Gebiet angesehen werden. Es war nahe liegend, diese idealen Filter auch für die Identifikation langfristiger Konjunkturzyklen einzusetzen, zumal die traditionellen Verfahren dafür völlig ungeeignet waren. So beschäftigen sich die Aufsätze des ersten Teils in diesem Band mit dem Einsatz idealer Filter zur Analyse Langer Wellen.

Eine völlige Neuorientierung in der Zeitreihenanalyse setzte Ende der 1980er, Anfang der 1990er Jahre mit der Diskussion um die sog. Unit Root Prozesse ein. Nicht mehr ideale Filter galten als adäquates Mittel bei der Analyse Langer Wellen, sondern stochastische Modelle, die maßgeschneidert für jede Zeitreihe deren Eigenschaften in stochastischen Trend- und Zykluskomponenten erfassen sollten. Diese Neuorientierung war grundstürzend, und Gegenstand der Habilitationsschrift des Verfassers an der Universität St. Gallen. Generelles Ergebnis dieser Forschungen war, dass die bislang mit idealen Filtern nachgewiesenen Langer Wellen unter Umständen auf eine falsche Trendbereinigung stochastischer Prozesse zurückgeführt werden müssen und damit statistische Artefakte darstellen würden. Die Aufsätze des zweiten Teils in diesem Band beschäftigen sich mit diesem Problem. Eine abermalige Neuorientierung hat nun vor einigen Jahren eingesetzt, bei der es erneut um die Konstruktion idealer Filter geht, wobei nun Filter entwickelt werden, die explizit auch für stochastische Trendprozesse als geeignet angesehen werden. Eine Verwendung dieser Filter für die Analyse Langer Wellen hat bislang nicht stattgefunden.

So ist diese neuerliche Auseinandersetzung mit idealen Filtern der Anlass gewesen, ausgewählte Arbeiten zu diesem Thema in einem eigenen Band zu veröffentlichen. Den Beiträgen ist ein Rückblick und Ausblick vorangestellt, der die Bemühungen um ein ideales Verfahren zur Analyse Langer Wellen vor dem Hintergrund der bisherigen Forschungen Revue passieren lässt und gleichzeitig den Brückenschlag zu den neueren Filter-Design-Ansätzen versucht.

Danken möchte ich dem Steiner Verlag in Stuttgart, insbesondere Herrn Dr. Thomas Schaber, für die verlegerische Betreuung und Herausgabe des Bandes. Herrn Gräff-Mazalla (Hundt Druck GmbH, Köln) danke ich für die Aufbereitung der Druckvorlage. Mein besonderer Dank gilt schließlich Herrn Dr. cand. Thomas Schlösser (Köln), der mich bei der Vorbereitung und Drucklegung des Bandes in vielfältiger Weise überaus tatkräftig unterstützt hat.

Köln, im April 2008