Inhaltsverzeichnis

Vorwort V

Abbildungsverzeichnis IX

Tabellenverzeichnis XI

Abkürzungsverzeichnis XIII

1 Einleitung 1

2 Anpassungskostenmodelle 5
- 2.1 Ursachen und Formen von Anpassungskosten . . . 6
- 2.2 Modellierung von Anpassungskosten . . . 8
  - 2.2.1 Symmetrisch konvexer Verlauf . . . 11
  - 2.2.2 Asymmetrische konvexe Kosten . . . 14
  - 2.2.3 Asymmetrische lineare Kosten . . . 15
  - 2.2.4 Asymmetrische fixe Kosten . . . 17
  - 2.2.5 Ausdehnung auf mehrere Faktoren . . . 18
- 2.3 Der Übergang zur Empirie . . . 19
- 2.4 Zusammenfassung . . . 24

3 Matchingmodell 27
- 3.1 Matchingmodelle und Literaturüberblick . . . 27
  - 3.1.1 Grundlagen zu Such- und Matchingmodellen . . . 27
  - 3.1.2 Verwandte Literatur zu Entlassungskosten und heterogenen Arbeitskräften . . . 32
- 3.2 Modellaufbau und das langfristige Gleichgewicht . . . 43
  - 3.2.1 Grundstruktur des Modells . . . 43
  - 3.2.2 Der Arbeitsmarkt für Qualifizierte . . . 47
  - 3.2.3 Der Arbeitsmarkt für Geringqualifizierte . . . 55
- 3.3 Die Einführung von Entlassungskosten . . . 58
- 3.4 Konjunkturschwankungen . . . 65
- 3.5 Zusammenfassung . . . 70

4 Empirische Evidenz 73
- 4.1 Ergebnisse bisheriger Studien . . . 73

4.2 Asymmetrie in aggregierten Arbeitslosendaten 83
4.2.1 Ein Klassifizierungsschema für Asymmetrie 85
4.2.2 Datenbasis und -eigenschaften 87
4.2.3 Neftçis Test mit Markovprozessen 91
4.2.4 Schiefetest 94
4.2.5 Zeitumkehrtest 99
4.2.6 Zusammenfassung zu den Asymmetrietests 106
4.3 Asymmetrische Dynamik in Deutschland 106
4.3.1 Motivation und Ergebnisse bisheriger Studien 106
4.3.2 Datenbasis 109
4.3.3 Asymmetrietests für die Arbeitnehmerreihen 115
4.3.4 Schätzung asymmetrischer Fehlerkorrekturmodelle 117
4.4 Zusammenfassung 138

5 Schlußbemerkungen 141

A Datenquellen 143
A.1 Daten zur Beveridgekurve (Abbildung 3.1) 143
A.2 Daten zur Asymmetrieanalyse (Abschnitt 4.2) 143
A.3 Daten zum verarbeitenden Gewerbe (Abschnitt 4.3) 144

B Herleitungen 147
B.1 Herleitungen zu Kapitel 3 147
B.1.1 Der Arbeitsmarkt für Qualifizierte im Steady-State 147
B.1.2 Das Arbeitsmarktsegment für Geringqualifizierte 149
B.1.3 Einführung von Entlassungskosten 153
B.1.4 Konjunkturschwankungen 156
B.2 Herleitungen zu Kapitel 4 158
B.2.1 Asymmetrietest mit Markovprozessen für $n = 2$ 158
B.2.2 Langfristbeziehungen für das asymmetrische Fehlerkorrekturmodell 160

C Ergänzende Tabellen zu Kapitel 4 163
C.1 Asymmetrietests für Arbeitslosendaten 163
C.2 Analyse des verarbeitenden Gewerbes 166

Literaturverzeichnis 178

Abbildungsverzeichnis

2.1 Stilisierter Verlauf von Anpassungskostenfunktionen 10
2.2 Stilisierte Beschäftigungsdynamik bei unterschiedlichen Anpassungskostenfunktionen 13
2.3 Beschäftigungsentwicklung bei einem unantizipierten, expansiven transitorischen Schock auf N^* 16

3.1 Beveridgekurve für das frühere Bundesgebiet 29
3.2 Beveridge- und KG-Kurve 54
3.3 Stilisierte Dynamik der Arbeitslosigkeit bei Konjunkturschwankungen 69

4.1 Deutsche Arbeitslosenquoten aufgegliedert nach dem höchsten Schulabschluß 77
4.2 Beispiel einer querlaufend asymmetrischen Reihe z_t 85
4.3 Beispiel einer längslaufend asymmetrischen Reihe z_t 86
4.4 Arbeitslosenquoten in Deutschland, Großbritannien und den USA 89
4.5 Arbeitslosenzahlen in Deutschland, Großbritannien und den USA (in Tausend) 90
4.6 Dichtefunktion einer Zufallsvariablen z mit einer rechtsschiefen Verteilung 96
4.7 Reihen zum verarbeitenden Gewerbe in Deutschland, 1970–1994 . 111

Tabellenverzeichnis

4.1 Arbeitslosenquoten des Jahres 2000 nach Qualifikation im internationalen Vergleich . . . 74
4.2 Erwerbsquoten des Jahres 2000 nach Qualifikation im internationalen Vergleich . . . 75
4.3 Statistische Kennzahlen der qualifikationsspezifischen deutschen Arbeitslosenquoten . . . 77
4.4 ADF-Test der Arbeitslosendaten . . . 91
4.5 Neftçis Asymmetrietest mit Markovprozessen erster und zweiter Ordnung für die Arbeitslosendaten . . . 95
4.6 Schiefetest für die ersten Differenzen der Arbeitslosendaten (ohne vorherige Trendbereinigung) . . . 98
4.7 Schiefetest für die ersten Differenzen der Arbeitslosendaten (mit vorheriger Trendbereinigung) . . . 98
4.8 Schiefetest für die Niveaus der Arbeitslosendaten . . . 98
4.9 Zeitumkehrtest für die Niveaus der Arbeitslosendaten . . . 103
4.10 Zeitumkehrtest für die ersten Differenzen der Arbeitslosendaten . 105
4.11 ADF-Test für die logarithmierten Daten des verarbeitenden Gewerbes. . . . 114
4.12 Neftçis Asymmetrietest mit Markovprozessen erster und zweiter Ordnung für Beschäftigte, Arbeiter und Angestellte . . . 116
4.13 Schiefetests für Beschäftigte, Arbeiter und Angestellte . . . 117
4.14 Zeitumkehrtest für die Niveaus von Beschäftigten, Arbeitern und Angestellten . . . 118
4.15 Zeitumkehrtest für die ersten Differenzen von Beschäftigten, Arbeitern und Angestellten . . . 119
4.16 Kointegrationstests nach dem Engle-Granger Verfahren . . . 126
4.17 Kointegrationsanalyse mit den logarithmierten Daten . . . 128
4.18 Ausgewählte kritische Werte für den Johansentest . . . 129
4.19 Kointegrationsanalyse mit den mittelwertbereinigten Daten . . . 131
4.20 Fehlerkorrekturmodelle für die logarithmierten und die mittelwertbereinigten Daten . . . 132
4.21 Kointegrationsanalyse für Arbeiter und Angestellte . . . 135
4.22 Fehlerkorrekturmodelle für Arbeiter und Angestellte . . . 137

C.1 ARMA-Spezifikationen für die Arbeitslosendaten sowie ihre ersten Differenzen 163
C.2 Zeitumkehrtest für die Niveaus der Arbeitslosendaten 164
C.3 Zeitumkehrtest für die ersten Differenzen der Arbeitslosendaten . 165
C.4 ADF-Test für die Daten des verarbeitenden Gewerbes 166
C.5 ARMA-Spezifikationen für die Arbeitnehmerzahlen des verarbeitenden Gewerbes 167