

Inhalt

1	ERHEBUNGSVERFAHREN, ANALYSEMETHODEN UND MIKROSIMULATION – GRUNDLAGEN MIKROANALYTISCHER ANALYSEN DER GESELLSCHAFTSPOLITIK	1
	<i>Richard Hauser, Notburga Ott und Gert Wagner</i>	
1.1	Überblick	1
1.2	Datenbeschaffung, Datenerhebung und Datenschutz	2
1.2.1	Datenaufbereitung und integrierte Mikrodatenfiles	2
1.2.2	Surveys des Sonderforschungsbereichs 3	3
1.2.3	Methodische Entwicklungen	5
1.2.4	Datenschutz	5
1.3	Analysemethoden und Methoden der Wohlmessung	6
1.3.1	„Qualitative“ Analysen und Datenaufbereitung	6
1.3.2	Mikroökonomie	7
1.3.3	Wohlmessung	8
1.4	Mikrosimulation	8
1.5	Informationstransfer	9
	Literatur	10
2	ERHEBUNGSMETHODEN	13
2.1	Gesellschaftliche Dauerbeobachtung – Wohlmessung: Instrument der Sozialberichterstattung	13
	<i>Roland Habich und Wolfgang Zapf</i>	
2.1.1	Problemaufriß	13
2.1.2	Ausgangspunkt und Ziele der Sozialberichterstattung	14
2.1.3	Das Instrument Wohlmessung: Erweiterung objektiver Indikatoren durch die Perspektive des einzelnen Bürgers – individuelle Wohlmessung als zentrale Kategorie	18
2.1.3.1	Pragmatische Operationalisierung des Zieles	19
2.1.3.2	Implementierung	20
2.1.4	Ansätze der Sozialberichterstattung	33
	Literatur	35

2.2	Erhebung ereignisorientierter Lebensverläufe als retrospektive Längsschnittrekonstruktion	38
	<i>Erika Brückner</i>	
2.2.1	Einleitung	38
2.2.2	Probleme der Operationalisierung und Instrumentenkonstruktion	39
2.2.2.1	Forschungstradition und Erhebungsmethoden	39
2.2.2.1.1	Forschungsstand	39
2.2.2.1.2	Erhebungsmethoden	40
2.2.2.2	Besondere methodische Probleme der Rekonstruktion von Lebensverläufen	42
2.2.2.3	Ordnungskriterien der zeitlichen Rekonstruktion: das Verlaufsdatendesign (sequentielle Fragenmodule)	43
2.2.2.4	Personenbezogene Datenverknüpfungen: Fragenmodule zur Struktur familialer Bezugsgruppen	46
2.2.2.5	Probleme der Filterführung	47
2.2.2.5.1	Operationalisierung der Sukzession im „Papier“-Fragebogen	47
2.2.2.5.2	Automatische Fragensteuerung durch ein Computerinstrument	48
2.2.2.6	Anpassungen an historische und institutionelle Rahmenbedingungen: kohortenspezifische Instrumente	49
2.2.3	Feldprobleme	51
2.2.3.1	Akteure und Problemschwerpunkte	51
2.2.3.2	Befragtenabhängige Erhebungsprobleme	53
2.2.3.2.1	Akzeptanz der Thematik und Teilnahmebereitschaft	53
2.2.3.2.2	Kooperation im Interview	54
2.2.3.2.3	Risiko der „Katharsis“: Gewinn oder Gefahr durch „Erinnerungsarbeit“?	55
2.2.4	Probleme der Erfassung, Aufbereitung und Validierung der Lebensverlaufsdaten	56
2.2.4.1	Erfassung und Aufbereitung der Verlaufsdaten	56
2.2.4.2	Datenedition als Ergänzung der Erhebung	57
2.2.4.3	Probleme der Datenvalidität	60
2.2.4.3.1	Externe Validierung der Stichprobengenauigkeit und Repräsentativität der Daten	60
2.2.4.3.2	Reliabilität und Güte retrospektiver Lebensverlaufsdaten	61
2.2.4.3.3	Datenvalidität telefonischer Erhebungen	63
2.2.5	Zusammenfassende Schlußbetrachtungen	65
	Literatur	67
2.3	Das Sozio-oekonomische Panel (SOEP) – Methoden der Datenproduktion und -aufbereitung im Längsschnitt	70
	<i>Gert Wagner, Jürgen Schupp und Ulrich Rendtel</i>	
2.3.1	Ziel	71
2.3.1.1	Lebenslagen und mikroökonomischer Ansatz	71
2.3.1.2	Fragenprogramm	72
2.3.1.3	Repräsentativität im Längs- und Querschnitt	73
2.3.1.4	Gang der weiteren Darstellung	74

Inhalt

2.3.2	Stichprobenziehung und Feldarbeit der ersten Wellen	75
2.3.2.1	Grundgesamtheit und Befragungspersonen	75
2.3.2.1.1	Stichprobe A „Deutsche in der BRD“	76
2.3.2.1.2	Stichprobe B „Ausländer in der BRD“	76
2.3.2.1.3	Stichprobe C „Deutsche in der DDR“	77
2.3.2.2	Adressenbrutto und qualitätsneutrale Ausfälle der ersten Wellen	78
2.3.2.2.1	Stichproben A und B	78
2.3.2.2.2	Stichprobe C	83
2.3.2.3	Interviewer-Stichprobe	84
2.3.3	Panel-spezifische Konstruktion der Erhebungsinstrumente und Sicherung der Teilnahmebereitschaft	85
2.3.3.1	Weiterverfolgungskonzept	85
2.3.3.2	Verlaufsbeobachtung und Nacherhebung	87
2.3.3.2.1	Nacherhebung von Längsschnittmerkmalen bei lückenhaften Verläufen	87
2.3.3.2.2	Nacherhebung von biographischen Angaben	88
2.3.3.3	Methodenmix der Erhebung	88
2.3.3.4	Panelpflege	90
2.3.3.4.1	Instrumente	90
2.3.3.4.2	Kontinuität Haushalt – Interviewer	91
2.3.3.5	Adressenverfolgung und Paneldatei	91
2.3.4	Entwicklung der Stichproben A, B und C	92
2.3.4.1	Stichproben A und B	92
2.3.4.1.1	Determinanten der Entwicklung	92
2.3.4.1.2	Stichprobenentwicklung	94
2.3.4.2	Stichprobe C	98
2.3.4.3	Interviewer-Stichproben	99
2.3.5	Gewichtung und Hochrechnung	100
2.3.6	Datenaufbereitung	104
2.3.6.1	Ablauf der Datenerfassung, -prüfung und -bereinigung	104
2.3.6.2	Datenstrukturen	105
2.3.6.2.1	Konzept der Datenaufbereitung	105
2.3.6.2.2	Logische Struktur der Variablen	105
2.3.6.3	Datenweitergabe und Datenschutz	108
2.3.7	Perspektiven	109
	Literatur	110
2.4	Rekrutierung von Befragungspersonen bei qualitativen Untersuchungen	113
	<i>Susanne Bisson, Gisela Maag und Edeltraud Roller</i>	
2.4.1	Zielsetzung	113
2.4.2	Überlegungen zur Befragtenauswahl	116
2.4.3	Stichprobenkonzeption	117
2.4.4	Rekrutierung der Befragten	118
2.4.4.1	Vorbereitungsarbeiten	118
2.4.4.2	Durchführung und Ergebnisse	120

2.4.4.3	Aufwand der Rekrutierung und Ausschöpfung	122
2.4.5	Bewertung	126
	Literatur	130
2.5	Methodische Untersuchungen zur Verteilung der Einkommen in der Bundesrepublik Deutschland mit der Transferumfrage 1981	131
	<i>Bernhard Engel</i>	
2.5.1	Erkenntnisziele	131
2.5.2	Forschungs- und Fragebogenprogramm der Transferumfrage 1981	132
2.5.3	Reliabilität und Validität der Ergebnisse	133
2.5.3.1	Reliabilität der Fragebogen-Fragen	133
2.5.3.2	Validität der Ergebnisse	135
2.5.3.2.1	Klassische Indikatoren der Einkommensverteilung	135
2.5.3.2.2	Indikatoren aus dem Bereich der explorativen Datenanalyse	136
2.5.3.2.3	Probleme der Berechnung des Haushaltsnettoeinkommens	136
2.5.3.2.4	Errechnetes Haushaltsnettoeinkommen versus Income-Screener	141
2.5.3.2.5	Interne Validierung von Daten aus dem Bereich der Alterssicherung	143
2.5.3.2.6	Vergleich von Interviewangabe und prozeßproduzierten Daten am Beispiel von beitragspflichtigem Entgelt und Bruttoeinkommen aus unselbständiger Tätigkeit	147
2.5.4	Zusammenfassung und Ausblick	151
	Literatur	152
2.6	Ein Verknüpfungsalgorithmus zur Zusammenführung von Steuerprozeßdaten und Umfragedaten	153
	<i>Thomas Kassella</i>	
2.6.1	Einleitung	153
2.6.2	Verfügbare Datenquellen	154
2.6.2.1	Stichprobe der Oberfinanzdirektionen Karlsruhe und Freiburg	154
2.6.2.2	Haushaltsbefragungen	155
2.6.3	Verfahren zur Zusammenführung von Mikrodaten	156
2.6.3.1	Exakte Verknüpfung	157
2.6.3.2	Regressionsansätze	157
2.6.3.3	Statistische Verknüpfung	158
2.6.4	Verknüpfungsalgorithmus für die Steuerdaten	159
2.6.4.1	Auswahl der Mergevariablen	159
2.6.4.2	Bildung von Zellen	161
2.6.4.3	Zusammenführung innerhalb der Zellen	162
2.6.4.3.1	Verknüpfungskriterium	162
2.6.4.3.2	Wahl der Distanzfunktion	163
2.6.4.3.3	Berücksichtigung der Hochrechnungsfaktoren	165
2.6.4.3.4	Mathematische Verknüpfungsmodelle	167
2.6.4.3.5	Wahl des Verknüpfungsmodells	168
2.6.5	Verknüpfungsalgorithmus für die Verbrauchsangaben	169

2.6.6	Validierung des Verknüpfungsalgorithmus	169
2.6.6.1	Abbildung der Steuerdaten	169
2.6.6.2	Abbildung der Verbrauchsstrukturen	171
2.6.7	Zusammenfassung und Schlußfolgerungen	176
	Literatur	177
2.7	Prozeßproduzierte Daten als Grundlage für sozial- und verteilungspolitische Analysen – Erfahrungen mit Daten der Rentenversicherungsträger für Längsschnittanalysen	179
	<i>Winfried Schmähl und Uwe Fachinger</i>	
2.7.1	Vorbemerkungen	179
2.7.2	Prozeßproduzierte Daten als Grundlage für Längsschnitt- analysen	180
2.7.3	„ASK-Stichprobe“	184
2.7.3.1	Beschreibung	184
2.7.3.2	Möglichkeiten und Grenzen der Aussagekraft dieser Daten	186
2.7.4	Zwei ausgewählte Ergebnisse	190
2.7.4.1	Alters-Lohn-Profile	191
2.7.4.2	Ungleichheitsentwicklung	194
2.7.5	Schlußbemerkungen	196
	Literatur	197
2.8	Die Nebenerwerbstätigkeitsumfrage des Sonderforschungs- bereichs 3 zur Analyse markt- und nichtmarktmäßiger Aktivitäten privater Haushalte	201
	<i>Joachim Merz und Klaus Wolff</i>	
2.8.1	Markt- und nichtmarktmäßige Aktivitäten privater Haushalte	201
2.8.2	Die Nebenerwerbstätigkeitsumfrage, erweitert um individuelle Steuerinformationen und regionale Arbeitsmarkt- und Wirtschaftsdaten	202
2.8.2.1	Die Nebenerwerbstätigkeitsumfrage 1984	203
2.8.2.2	Erweiterung um individuelle Steuerinformationen aus den Daten des Sozio-ökonomischen Panels	207
2.8.2.3	Erweiterung um Informationen zum regionalen Arbeitsmarkt und der wirtschaftlichen Lage der Region	208
2.8.2.3.1	Mesoökonomie als Ergänzung der Mikroökonomie	208
2.8.2.3.2	Auswahl des Aggregationsniveaus von Regionaldaten	209
2.8.2.3.3	Mergeverfahren mit den Regionaldaten aus der laufenden Raumbeobachtung der BfLR	210
2.8.3	Ergebnisse der Mikroanalysen markt- und nichtmarktmäßiger Aktivitäten privater Haushalte	211
2.8.3.1	Verbreitung von Haupterwerb, Nebenerwerb, Schwarzarbeit und Eigenarbeit	212
2.8.3.2	Wohlfahrtssteigerungen durch Nebenerwerb und Eigenarbeit	213
2.8.3.3	Bewertung nichtmarktmäßiger Aktivitäten	216
2.8.3.4	Individuelle Schwarzarbeit	217
2.8.3.5	Informelle Ökonomie: Schwarzarbeit und Eigenarbeit	218

2.8.3.6	Multiples Arbeitsangebot in markt- und nichtmarktmäßigen Aktivitäten	219
2.8.3.7	Mikrosimulation der Steuerreform 1990 und deren Auswirkungen auf die Zeitallokation in markt- und nichtmarktmäßigen Aktivitäten	220
2.8.3.8	Weiterentwicklung der Mikrosimulation: MICSIM – ein PC-Mikrosimulationsmodell für Forschung und Lehre	221
2.8.4	Schlußbemerkungen und Ausblick	221
	Literatur	222
3	ANALYSEMETHODEN UND METHODEN DER WOHLSTANDSMESSUNG	227
3.1	Die Frankfurter Sozio-ökonomische Wissensbasis	227
	<i>Gerriet P. Müller</i>	
3.1.1	Aufgabenstellung	227
3.1.2	Faktenwissen: Abbildung der Fragebogenstruktur im Relationenmodell	229
3.1.2.1	Basisbegriffe	232
3.1.2.2	Abgeleitete Begriffe	235
3.1.2.3	Begriffstaxonomien	240
3.1.3	Objektorientierte Komplexbildung	244
3.1.3.1	Konstruktion von Objekten	244
3.1.3.2	Simulation von Objekten	247
3.1.4	Ausblick	249
	Literatur	250
3.2	Verbindung qualitativer und quantitativer Forschungsverfahren in der empirischen Sozialforschung	251
	<i>Bettina Westle</i>	
3.2.1	Gründe und Ziele der quantitativen Analyse qualitativer Daten	252
3.2.2	Analysemethoden qualitativer Daten	253
3.2.3	Hermeneutisch-klassifikatorische Inhaltsanalyse	255
3.2.3.1	Textaufbereitung	255
3.2.3.2	Hermeneutische Klassifikation	257
3.2.3.3	Netzwerk-Kategorienschema – ein Beispiel	259
3.2.4	Quantitative Datenanalyse	266
3.2.4.1	Theoretische und meßtheoretische Probleme	266
3.2.4.2	Probleme der Struktur des Klassifikationssystems	269
3.2.4.3	Technische Probleme	271
3.2.5	Fazit	273
	Literatur	275
3.3	Einkommen und Bedarf im Haushaltszusammenhang – Äquivalenzskalen als Instrument der Wohlfahrtsmessung	278
	<i>Thomas Klein</i>	

3.3.1	Einleitung	278
3.3.2	Grundlegende Probleme	279
3.3.3	Hauptansätze der Ermittlung wohlfahrtsäquivalenter Einkommensabstufungen	280
3.3.3.1	Definition von Warenkorbunterschieden	281
3.3.3.2	Ausgabenorientierte Ansätze	281
3.3.3.3	Subjektive Äquivalenzskalen	285
3.3.4	Empirische Ergebnisse	288
3.3.5	Schlußfolgerungen und offene Probleme	292
	Literatur	293
3.4	Zur Messung allokativer und distributiver Effekte wohl- fahrtsstaatlicher Maßnahmen – Theorie und Methodik am Beispiel der Steuerpolitik	296
	<i>Helmut Kaiser</i>	
3.4.1	Zielsetzung	296
3.4.2	Theorie wohlfahrtsökonomischer Nutzen-Kosten-Analysen (NKA)	297
3.4.2.1	Individuelle Nutzenmaße	298
3.4.2.1.1	Konsumentenrente nach Dupuit/Marshall	298
3.4.2.1.2	Hickssche Wohlfahrtsmaße	300
3.4.2.1.3	Geldmetrische Nutzenfunktion („money metric utility“)	303
3.4.2.1.4	Relative Wohlfahrtsmaße: Indexzahlen	304
3.4.2.1.5	Duale Maße	305
3.4.2.2	Soziale Wohlfahrtsmaße	306
3.4.2.2.1	Aggregationsproblem	306
3.4.2.2.2	Aggregierte Hickssche Maße und aggregierte Geldmetrik	307
3.4.2.2.3	Berücksichtigung von Verteilungsaspekten	309
3.4.2.2.4	Bestimmung der Verteilungsgewichte	309
3.4.2.3	Wohlfahrtsmaße – ordinales oder kardinales Nutzenkonzept?	314
3.4.3	Empirische Wohlfahrtsmessung	315
3.4.3.1	Operationalisierung der Wohlfahrtsmaße	315
3.4.3.2	Verfahren zur Lösung des Integrabilitätsproblems	318
3.4.3.2.1	Systematisierung der Verfahren	318
3.4.3.3	Wahl der Funktionsform	319
3.4.3.3.1	Vorgabe einer (in-)direkten Nutzenfunktion bzw. Ausgabenfunktion	319
3.4.3.3.2	Selektionskriterien und Anwendungsbeispiele	320
3.4.4	Schlußfolgerungen	321
	Literatur	323
3.5	Spezifikation und Schätzung von zeitabhängigen Übergangsratenmodellen – methodische Aspekte und ihre Anwendung in der Arbeitsmarktforschung	325
	<i>Reinhard Hujer und Hilmar Schneider</i>	
3.5.1	Problemstellung	325
3.5.2	Methodisches Konzept des Übergangsratenansatzes	326

3.5.2.1	Parametrischer Übergangsratenansatz	327
3.5.2.2	Schätzung von parametrischen Übergangsratenmodellen	328
3.5.2.3	Berücksichtigung unbeobachteter Heterogenität im Rahmen von parametrischen Übergangsratenmodellen	329
3.5.3	Empirische Analyse: der Prozeß des Ausscheidens aus der Arbeitslosigkeit	332
3.5.3.1	Beschreibung der Datenbasis	333
3.5.3.2	Modell einer homogenen Population	333
3.5.3.3	Einfluß von Kovariaten	334
3.5.3.4	Berücksichtigung von unbeobachteter Heterogenität	336
3.5.4	Zusammenfassung	338
	Literatur	339
3.6	Nichteheliche Lebensgemeinschaften – methodische Probleme bei der Verlaufsanalyse im Haushaltskontext	341
	<i>Notburga Ott und Ulrich Pötter</i>	
3.6.1	Einleitung	341
3.6.2	Demographische Daten im Sozio-ökonomischen Panel	341
3.6.3	Haushalts- und Familienentwicklung im Zeitverlauf	343
3.6.4	Analyse von Haushalten und Familien im Längsschnitt	346
3.6.4.1	Theoretische Konzeption	346
3.6.4.2	Analysebereiche der empirischen Untersuchung	348
3.6.5	Probleme bei der Datenaufbereitung	349
3.6.5.1	Datenmanagement	349
3.6.5.2	Fehlende Angaben	349
3.6.5.3	Inkonsistenzen	351
3.6.6	Methodische Probleme bei der Analyse	352
3.6.6.1	Problembereiche: Beginn und Ende	353
3.6.6.1.1	Zeitpunkt des Beginns einer Lebensgemeinschaft	353
3.6.6.1.2	Endzeitpunkt der Lebensgemeinschaft	355
3.6.6.2	Analyse der Dauern anhand eines Cox-Modells	356
3.6.6.2.1	Erste Schätzergebnisse	359
3.6.6.2.2	Sensitivität des Cox-Modells	360
3.6.7	Schlußbemerkungen	366
	Literatur	367
4	MIKROSIMULATION	369
4.1	Mikrosimulationsmodelle in der Forschungsstrategie des Sonderforschungsbereichs 3	369
	<i>Heinz P. Galler</i>	
4.1.1	Mikrosimulationsmodelle als Instrument der Politikanalyse	369
4.1.2	Anwendungsbereiche alternativer Mikrosimulationsansätze	371
4.1.3	Mikrosimulationsansätze des Sonderforschungsbereichs 3 im Überblick	374
	Literatur	378

4.2	Statisches Sonderforschungsbereich 3-Mikrosimulationsmodell – Mainframe- und PC-Version	380
	<i>Joachim Merz</i>	
4.2.1	Einleitung und Übersicht	380
4.2.2	Charakteristika statischer Mikrosimulationsmodelle	381
4.2.3	Anforderungsprofil an ein statisches Mikrosimulationsmodell	382
4.2.4	Konzeption und Realisierung des statischen Sonderforschungsbereich 3-Mikrosimulationsmodells	384
4.2.4.1	Mikrodaten und allgemeine Realisierungsprinzipien des statischen Sonderforschungsbereich 3-Mikrosimulationsmodells auf der Basis relationaler Datenbanksysteme	384
4.2.4.2	Mainframe-Version: FORTRAN77 und das relationale Datenbanksystem 1022	385
4.2.4.3	PC-Version MICSIM: C und das relationale Datenbanksystem ORACLE	386
4.2.5	Aufbau und Wirkungsweise des statischen Sonderforschungsbereich 3-Mikrosimulationsmodells – Mainframe- und PC-Version	387
4.2.5.1	Überblick und zentrale Bereiche des Simulators	387
4.2.5.2	Simulation alternativer Politiken	388
4.2.5.3	Hochrechnung der Mikrodaten	391
4.2.5.4	Auswertung von Mikrodaten	393
4.2.6	Das statische Sonderforschungsbereich 3-Mikrosimulationsmodell – Erweiterungen als generelles Instrument von Mikrodaten	394
4.2.7	Anwendungen und Ausblick	395
	Literatur	396
4.3	Das dynamische Mikrosimulationsmodell des Sonderforschungsbereichs 3	399
	<i>Heinz P. Galler und Notburga Ott</i>	
4.3.1	Konzeption des dynamischen Mikrosimulationsmodells	399
4.3.1.1	Forschungsziele und Modellansatz	401
4.3.1.2	Simulationsansatz	402
4.3.1.3	Theoretisches Grundmodell	405
4.3.2	Struktur des dynamischen Mikrosimulationsmodells	405
4.3.2.1	Modellstruktur im Überblick	407
4.3.2.2	Simulation der Bevölkerungsdynamik	414
4.3.2.3	Modellierung der übrigen sozio-ökonomischen Merkmale	420
4.3.2.4	Ausgangsdatenbasis der Simulation	423
4.3.3	Erfahrungen mit dem Modell	425
	Literatur	428
4.4	Prognoseeigenschaften dynamischer Mikrosimulationsmodelle	428
	<i>Heinz P. Galler</i>	
4.4.1	Stochastische Grundlagen	428
4.4.2	Eigenschaften der Monte-Carlo-Simulation	431

Inhalt

4.4.3	Exemplarische Fehlerabschätzungen	436
4.4.4	Schlußfolgerungen	441
	Literatur	442
4.5	Die Längsschnitt-Version des Sonderforschungsbereich 3- Mikrosimulationsmodells	443
	<i>Christof Helberger und Gert Wagner</i>	
4.5.1	Einführung	443
4.5.2	Konzeption und Aufbau des Sonderforschungsbereich 3- Längsschnitt-Mikrosimulators	444
4.5.3	Längsschnittmodule des Sonderforschungsbereich 3- Mikrosimulators	446
4.5.3.1	Simulationssequenz	446
4.5.3.2	Retrospektive Längsschnittsimulation	447
4.5.3.2.1	Retrospektive demographische Simulation	448
4.5.3.2.2	Retrospektive sozio-ökonomische Simulation	449
4.5.4	Ausblick: ein Längsschnittsimulator für die Gesetzesplanung und -kontrolle	450
	Literatur	451
5	DOKUMENTATION	453
5.1	Sprecher und stellvertretende Sprecher	453
5.2	Mitglieder	453
5.3	Beteiligte Institute	460
5.4	Teilprojekte und Dauer der Finanzierung	460
5.5	Gastwissenschaftler	461
5.6	Angenommene Rufe an Hochschulen und wissenschaftliche Einrichtungen (einschließlich ehemaliger Mitglieder)	463
5.7	Förderung des wissenschaftlichen Nachwuchses	464
5.8	Ausgewählte Veröffentlichungen von Mitgliedern des Sonderforschungsbereichs 3	468
5.9	Datenbestände	507
5.10	Gesamtförderungssumme	510