

Inhaltsverzeichnis

Verzeichnis der Übersichten	5
Verzeichnis der Abbildungen	7
Verzeichnis der Tabellen	7
Verzeichnis der Variablenbezeichnungen für das 5. Kapitel	8
Abkürzungsverzeichnis	9
1. Einleitung	11
1.1 Kointegration und Kausalität in der Ökonometrie	11
1.2 Zielsetzung und Aufbau der Arbeit	14
2. Statistische Grundlagen aus der univariaten Zeitreihenanalyse	17
2.1 ARMA- und ARIMA-Prozesse	17
2.1.1 ARMA(p, q)-Prozesse	17
2.1.2 ARIMA(p, d, q)-Prozesse	23
2.2 Tests auf Einheitswurzel	24
2.3 Tests auf Stationarität	32
3. Kointegration	51
3.1 Einige Darstellungsmöglichkeiten kointegrierter Zeitreihen	53
3.2 Parameterschätzungen und Tests	67
3.2.1 Das zweistufige Verfahren von Engle/Granger (1987)	67
3.2.2 Der nichtlineare Ansatz von Stock (1987)	76
3.2.3 Die Maximum-Likelihood-Schätzung von Johansen (1988)	78
3.3 Punktprognose	96

4. Granger-Kausalität	99
4.1 Das Kausalitätskonzept von Granger	99
4.2 Granger-Kausalität und integrierte Systeme	103
4.3 Granger-Kausalität und kointegrierte Systeme	107
5. Eine empirische Untersuchung zur Entwicklung der tariflichen Löhne und Gehälter in der Bundesrepublik Deutschland	122
5.1 Analyse der Einkommensentwicklung ausgewählter Tarifbranchen	127
5.2 Kointegrations- und Kausalanalyse	138
5.2.1 Öffentlicher Dienst und Einzelhandel	139
5.2.2 Privates Bankgewerbe und Einzelhandel	147
5.2.3 Privates Bankgewerbe und Öffentlicher Dienst	149
5.2.4 Der Dienstleistungsbereich	152
5.2.5 Der Bereich Industrie	158
5.2.6 Das Gesamtsystem	164
5.3 Zusammenfassung der Ergebnisse	173
6. Zusammenfassung und Ausblick	175
Literaturverzeichnis	177