

Inhaltsverzeichnis

1. Zielstellung und Vorgehensweise	1
2. Einführung und Motivation	5
3. Gemischte simultane Modelle des Typs 1	21
3.1 Modellgleichungen und Modellannahmen	21
3.2 Identifikation der Strukturparameter	28
3.3 Zweistufige Parameterschätzung	49
3.3.1 Amemiya Prinzip und Minimum Distance Schätzung	52
3.3.2 Alternative Schätzverfahren	60
4. Ein allgemeines Mehrgleichungsmodell des Typs 2	67
4.1 Modellspezifikation und Konsistenzbedingungen	67
4.2 Parameteridentifikation	93
4.2.1 Das Argument von Maddala	94
4.2.2 Modifikation der Rangbedingung an die Regressormatrix	101
4.2.3 Konsequenzen der eingeschränkten Beobachtbarkeit	104
4.3 Schätzung der semi-reduzierten Form	117
4.3.1 Probleme verschiedener Eingleichungsansätze	120
a) Ersetzen der endogenen Dummyvariablen durch ihren Erwartungswert	121
b) Bedingung auf die endogenen Dummyvariablen	123
c) Bedingung auf die Störgrößen der endogenen Dummyvariablen	130
d) GMM Schätzung	132
4.3.2 Simulated Maximum Likelihood (SML)	135
a) Simulation der gemeinsamen Wahrscheinlichkeiten mit Hilfe des GHK Simulators	136
b) Asymptotische Resultate	147

4.3.3 Alternative Simulationsverfahren	159
a) Method of Simulated Moments (MSM)	162
b) Method of Simulated Scores (MSS)	171
4.4 Schätzung der Strukturparameter	181
5. Zusammenfassung und Ausblick	189
Anhang	197
Anhang 1: Nachweis des vollen Spaltenranges der theoretischen Regressormatrix beim Amemiya Ansatz im GS1 Modell	197
Anhang 2: Die Konsistenzbedingung von Gourieroux/ Laffont/ Monfort (1980)	199
Anhang 3: Ableitungen der Loglikelihoodfunktion eines GS2 Zweigleichungsmodells ohne exogene Variablen	206
Anhang 4: Anwendung des Hauptsatzes für implizite Funktionen auf das Identifikationsproblem im GS2 Zweigleichungsmodell ohne exogene Variablen	212
Anhang 5: Darstellung des Integrals über eine multivariate Normalverteilung auf der Basis von unabhängig identisch $N(0, 1)$ -verteilten Zufallsvariablen	219
Anhang 6: Ableitungen der logarithmierten Normalverteilungsdichte im GS2 Modell	224
Anhang 7: Auswirkung der Symmetrie auf die Ableitung der logarith- mierten Normalverteilungsdichte nach den Kovarianzparametern	229
Anhang 8: Nachweis des vollen Spaltenranges der theoretischen Regressormatrix beim Amemiya Ansatz im GS2 Modell	231
Abkürzungsverzeichnis	235
Symbolverzeichnis	237
Literaturverzeichnis	245