

# Inhaltsübersicht

---

|                                                                      |     |
|----------------------------------------------------------------------|-----|
| <b>Vorwort</b> .....                                                 | 19  |
| <b>1 Einführung</b> .....                                            | 21  |
| <b>Teil I:</b>                                                       |     |
| <b>Lineare Regressionsmodelle</b> .....                              | 27  |
| <b>2 Das klassische Regressionsmodell</b> .....                      | 29  |
| <b>3 Lineare Regression: Schätzverfahren</b> .....                   | 43  |
| <b>4 Annahmen des linearen Regressionsmodells</b> .....              | 57  |
| <b>5 Statistische Bewertung von<br/>Regressionsbeziehungen</b> ..... | 67  |
| <b>6 Variablenauswahl und Missspezifikation</b> .....                | 89  |
| <b>7 Lineare Restriktionen</b> .....                                 | 109 |
| <b>8 Prognose und Prognosequalität</b> .....                         | 125 |
| <b>Teil II:</b>                                                      |     |
| <b>Methodische Erweiterungen</b> .....                               | 137 |
| <b>9 Analyse der Modellstruktur</b> .....                            | 139 |
| <b>10 Multikollinearität</b> .....                                   | 159 |
| <b>11 Heteroskedastizität</b> .....                                  | 173 |
| <b>12 Autokorrelation</b> .....                                      | 191 |
| <b>13 Zeitreihen und Zeitreihen-Modelle</b> .....                    | 213 |
| <b>14 Trends und <i>Unit-root</i>-Tests</b> .....                    | 229 |
| <b>15 Instrumentvariablen- Schätzung</b> .....                       | 251 |

|                                                            |     |
|------------------------------------------------------------|-----|
| <b>Teil III: Modellierung in der Ökonometrie</b> .....     | 265 |
| <b>16 Ökonometrische Modelle</b> .....                     | 267 |
| <b>17 Dynamische Modelle: Konzepte</b> .....               | 277 |
| <b>18 Dynamische Modelle: Schätzen der Parameter</b> ..... | 299 |
| <b>19 Kointegration</b> .....                              | 315 |
| <b>20 Mehrgleichungs-Modelle: Konzepte</b> .....           | 327 |
| <b>21 Mehrgleichungs-Modelle: Schätzverfahren</b> .....    | 349 |
| <b>22 VAR-Prozesse und VEC-Modelle</b> .....               | 367 |
| <b>Anhang</b> .....                                        | 381 |
| <b>A Das Area-Wide-Modell</b> .....                        | 383 |
| <b>B Datensätze</b> .....                                  | 389 |
| <b>C Wahrscheinlichkeitsverteilungen</b> .....             | 395 |
| <b>D Statistik</b> .....                                   | 399 |
| <b>E Matrixalgebra</b> .....                               | 413 |
| <b>F Einführung in EViews</b> .....                        | 421 |
| <b>G Tabellen</b> .....                                    | 433 |
| <b>Literatur</b> .....                                     | 437 |
| <b>Register</b> .....                                      | 441 |