

Inhaltsverzeichnis

Vorwort	V
----------------------	----------

Teil I Einleitung

1 Aufgabe und Prinzip der empirischen Wirtschaftsforschung	3
1.1 Ziele empirischer Wirtschaftsforschung	3
1.2 Prinzip der empirischen Wirtschaftsforschung	4
1.3 Literatúrauswahl	7

Teil II Daten

2 Datenbasis der empirischen Wirtschaftsforschung	11
2.1 Arten von Daten	17
2.2 Amtliche Statistik	19
2.3 Nicht amtliche Statistik	23
2.4 Internationale Statistik	26
2.5 Zugang zu verfügbaren Daten	29
2.6 Datenqualität	29
2.7 Literatúrauswahl	33
3 Datenaufbereitung	35
3.1 Grafische Darstellung von Daten	36
3.2 Einfache Transformationen von Daten	37
3.2.1 Quotientenbildung	37
3.2.2 Wachstumsraten	38
3.2.3 Maßzahlen	41
3.2.4 Preisbereinigung	41
3.2.5 Elastizitäten	43
3.2.6 Inter- und Extrapolation	44

X Inhaltsverzeichnis

3.3	Einige statistische Kenngrößen	45
3.4	Preis- und Mengenindizes	50
3.5	Saldierung von Tendenzindikatoren	61
3.6	Aggregation von Zeitreihen	64
3.7	Ausreißer und Messfehler	65
3.8	Literaturauswahl	67
4	Wirtschaftsindikatoren	69
4.1	Einteilung von Konjunkturindikatoren	69
4.2	Geschichte des Einsatzes von Konjunkturindikatoren	73
4.3	Stabilitätsgesetz und Indikatoren	76
4.3.1	Indikatoren für das Preisniveau	77
4.3.2	Indikatoren für den Beschäftigungsstand	78
4.3.3	Indikatoren für das außenwirtschaftliche Gleichgewicht	80
4.3.4	Wachstumsindikatoren	85
4.3.5	Verteilungsindikatoren	87
4.3.6	Weitere gesamtwirtschaftliche Indikatoren	93
4.4	Komplexe Indikatoren	95
4.4.1	Gesamtindikatoren aus Umfragedaten	96
4.4.2	Das gesamtwirtschaftliche Produktionspotenzial	98
4.5	Literaturauswahl	102
5	Input-Output-Analyse	103
5.1	Geschichte der Input-Output-Analyse	104
5.2	Die Input-Output-Tabelle	107
5.2.1	Herleitung von Input-Output-Tabellen	107
5.2.2	Konzeptionelle Aspekte und Probleme	115
5.3	Die Input-Output-Analyse	117
5.4	Literaturauswahl	124

Teil III Ökonometrische Grundlagen

6	Das ökonometrische Modell	129
6.1	Spezifikation eines ökonometrischen Modells	130
6.2	Schätzung	133
6.3	Überprüfung der Schätzung	134
6.4	Bewertung der Ergebnisse	135
7	Das lineare Regressionsmodell	137
7.1	Einige Beispiele	137
7.2	Das Kleinste-Quadrate-Prinzip	138
7.3	Inferenz für Kleinste-Quadrate-Schätzer	147
7.3.1	Der t -Test	149
7.3.2	Der F -Test	154

7.4	Ein Anwendungsbeispiel	156
7.5	Literaturauswahl	160
7.6	Anhang: Kritische Werte der t -Verteilung	161
8	Residuenanalyse und Überprüfung der Modellannahmen	163
8.1	Multikollinearität	163
8.2	Fehlende Variablen	169
8.3	Heteroskedastie	170
8.4	Normalverteilung	174
8.5	Autokorrelation	176
8.6	Endogenität und Simultanität	182
8.6.1	Fehler in Variablen	182
8.6.2	Endogenität	183
8.6.3	Simultanität	183
8.7	Strukturbrüche	184
8.8	Robuste und nicht parametrische Verfahren	190
8.8.1	Minimierung der absoluten Fehler	190
8.8.2	Nicht parametrische Verfahren	192
8.9	Literaturauswahl	195
9	Qualitative Variablen	197
9.1	Qualitative erklärende Variablen	197
9.1.1	Dummyvariablen	198
9.1.2	Kategoriale Variablen	202
9.1.3	Interaktion von Dummyvariablen	206
9.1.4	Dummyvariablen und Strukturbruchtest	209
9.2	Abhängige qualitative Variablen	211
9.3	Literaturauswahl	218

Teil IV Spezifische Anwendungen

10	Trend- und Saisonbereinigung	221
10.1	Das additive Zeitreihenmodell	221
10.2	Arbeitstägliche Bereinigung	223
10.3	Trendbestimmung und Trendbereinigung	225
10.3.1	Deterministische Trendterme	225
10.3.2	HP-Filter	226
10.4	Bestimmung der zyklischen Komponente	228
10.5	Saisonbereinigung	230
10.5.1	Gleitende Durchschnitte und Jahreswachstumsraten	230
10.5.2	Census-Verfahren	231
10.5.3	Das Berliner Verfahren	233
10.5.4	Saisondummies	238
10.6	Risiken und Nebenwirkungen	244

10.7	Literaturauswahl	247
11	Dynamische Modelle	249
11.1	Verteilte Verzögerungen	250
11.1.1	Geometrische Verzögerungsstruktur	252
11.1.2	Polynomiale Verzögerungsstruktur	254
11.1.3	Ein Anwendungsbeispiel	255
11.2	Fehlerkorrekturmodelle	259
11.3	Stochastische Zeitreihenmodelle	264
11.3.1	Zeitreihenmodelle als reduzierte Form	265
11.3.2	ARMA-Prozesse	266
11.4	Literaturauswahl	266
12	Nichtstationarität und Kointegration	267
12.1	Nichtstationarität	267
12.1.1	Deterministische und stochastische Trends	267
12.1.2	Scheinregressionen	268
12.1.3	Kovarianz-Stationarität und I(1)-Prozesse	270
12.2	Unit-Root-Tests	272
12.2.1	Dickey-Fuller-Test	273
12.2.2	Augmented Dickey-Fuller-Test	275
12.2.3	KPSS-Test	277
12.2.4	HEGY-Test	279
12.3	Kointegration	280
12.3.1	Engle-Granger-Verfahren	281
12.3.2	Kointegration im Fehlerkorrekturmodell	284
12.4	Literaturauswahl	285
12.5	Anhang: Kritische Werte für das Engle-Granger-Verfahren	287
12.6	Anhang: Kritische Werte für Fehlerkorrekturtest auf Kointegration ..	288
13	Diagnose und Prognose	289
13.1	Wozu werden Prognosen benötigt?	289
13.2	Klassifikation von Prognosen	291
13.3	Grenzen des Einsatzes von Prognosen	292
13.4	Konjunkturprognose	293
13.4.1	Diagnose der gegenwärtigen Lage	295
13.4.2	Entwicklung exogener Größen	296
13.4.3	Prognose	297
13.5	Prognose mit ökonometrischen Modellen	301
13.6	Bewertung der Prognosegüte	304
13.6.1	Mittlerer und mittlerer absoluter Prognosefehler	305
13.6.2	Mittlerer quadratischer Prognosefehler	307
13.6.3	Theils Ungleichheitskoeffizient	308
13.6.4	Tests für den Vergleich von Prognosen	309
13.6.5	Bewertung qualitativer Prognosen	311

13.7 Simulation mit ökonometrischen Modellen	313
13.7.1 Arten der Simulation	314
13.7.2 Prognosemodellselektion.....	315
13.7.3 Politiksimulationen	316
13.8 Literaturhinweise.....	317
Abbildungsverzeichnis	319
Tabellenverzeichnis	323
Verzeichnis der Fallbeispiele	325
Sachverzeichnis	327
Literaturverzeichnis	333