

# Inhaltsverzeichnis

<b>Vorwort</b>	<b>V</b>
<b>1 Aufgabe und Prinzip der empirischen Wirtschaftsforschung</b>	<b>1</b>
1.1 Ziele empirischer Wirtschaftsforschung . . . . .	1
1.2 Prinzip der empirischen Wirtschaftsforschung . . . . .	2
1.3 Literatúrauswahl . . . . .	5
<b>2 Datenbasis der empirischen Wirtschaftsforschung</b>	<b>7</b>
2.1 Arten von Daten . . . . .	10
2.2 Amtliche Statistik . . . . .	12
2.3 Nicht amtliche Statistik . . . . .	16
2.4 Internationale Statistik . . . . .	20
2.5 Zugang zu verfügbaren Daten . . . . .	20
2.6 Datenqualität . . . . .	23
2.7 Literatúrauswahl . . . . .	25
<b>3 Datenaufbereitung</b>	<b>27</b>
3.1 Informationsverdichtung . . . . .	28
3.1.1 Graphische Darstellung von Daten . . . . .	28
3.1.2 Einfache Transformationen von Daten . . . . .	28
3.1.3 Einige statistische Maßzahlen . . . . .	36
3.1.4 Preis- und Mengenindizes . . . . .	38
3.1.5 Aggregation von Zeitreihen . . . . .	46
3.2 Ausreißer und Meßfehler . . . . .	48
3.3 Trend- und Saisonbereinigung . . . . .	50
3.3.1 Arbeitstägliche Bereinigung . . . . .	51
3.3.2 Trendbereinigung . . . . .	51
3.3.3 Saisonbereinigung . . . . .	54
3.4 Literatúrauswahl . . . . .	66
<b>4 Wirtschaftsindikatoren</b>	<b>67</b>
4.1 Einteilung von Konjunkturindikatoren . . . . .	67
4.2 Geschichte des Einsatzes von Konjunkturindikatoren . . . . .	69

4.3	Stabilitätsgesetz und Indikatoren . . . . .	74
4.3.1	Indikatoren für das Preisniveau . . . . .	75
4.3.2	Indikatoren für den Beschäftigungsstand . . . . .	75
4.3.3	Indikatoren für das außenwirtschaftliche Gleichgewicht . . . . .	78
4.3.4	Wachstumsindikatoren . . . . .	82
4.3.5	Verteilungsindikatoren . . . . .	83
4.3.6	Weitere Indikatoren . . . . .	88
4.4	Komplexe Indikatoren . . . . .	90
4.4.1	Gesamtindikatoren aus Umfragedaten . . . . .	91
4.4.2	Das gesamtwirtschaftliche Produktionspotential . . . . .	93
4.5	Literaturauswahl . . . . .	97
<b>5</b>	<b>Input–Output–Analyse</b>	<b>99</b>
5.1	Geschichte der Input–Output–Analyse . . . . .	101
5.2	Die Input–Output–Tabelle . . . . .	103
5.2.1	Herleitung von Input–Output–Tabellen . . . . .	103
5.2.2	Konzeptionelle Aspekte und Probleme . . . . .	108
5.3	Die Input–Output–Analyse . . . . .	113
5.4	Literaturauswahl . . . . .	119
<b>6</b>	<b>Das ökonometrische Modell</b>	<b>121</b>
6.1	Spezifikation eines ökonometrischen Modells . . . . .	122
6.2	Schätzung . . . . .	125
6.3	Prüfung der Schätzung . . . . .	126
6.4	Bewertung der Ergebnisse . . . . .	126
6.5	Vorgehen der ökonometrischen Analyse . . . . .	127
<b>7</b>	<b>Das lineare Regressionsmodell</b>	<b>129</b>
7.1	Einige Beispiele . . . . .	129
7.2	Das Kleinste–Quadrate Prinzip . . . . .	130
7.3	Inferenz für Kleinste–Quadrate Schätzer . . . . .	139
7.3.1	Der $t$ –Test . . . . .	141
7.3.2	Der $F$ –Test . . . . .	145
7.4	Ein Anwendungsbeispiel . . . . .	147
7.5	Literaturauswahl . . . . .	150
7.6	Anhang: Kritische Werte der $t$ –Verteilung . . . . .	152
<b>8</b>	<b>Residuenanalyse und Überprüfung der Modellannahmen</b>	<b>153</b>
8.1	Multikollinearität . . . . .	153
8.2	Fehlende Variablen . . . . .	158
8.3	Heteroskedastie . . . . .	159
8.4	Autokorrelation . . . . .	163
8.5	Simultanität und Endogenität . . . . .	168
8.5.1	Fehler in Variablen . . . . .	168
8.5.2	Endogenität . . . . .	169

8.5.3	Simultaneität	170
8.6	Strukturbrüche	171
8.7	Robuste Verfahren	175
8.7.1	Minimierung der absoluten Fehler	175
8.8	Nicht parametrische Verfahren	178
8.8.1	Kerndichteschätzer	178
8.8.2	Bootstrap	179
8.9	Literaturauswahl	180
<b>9</b>	<b>Qualitative Variablen</b>	<b>183</b>
9.1	Qualitative erklärende Variablen	183
9.1.1	Saisondummies	187
9.1.2	Kategoriale Variablen	189
9.1.3	Interaktion von Dummyvariablen	193
9.1.4	Dummyvariablen und Strukturbruchtest	194
9.2	Abhängige qualitative Variablen	196
9.3	Literaturauswahl	202
<b>10</b>	<b>Dynamische Modelle</b>	<b>205</b>
10.1	Verteilte Verzögerungen	206
10.1.1	Geometrische Verzögerungsstruktur	208
10.1.2	Polynomiale Verzögerungsstruktur	209
10.1.3	Ein Anwendungsbeispiel	210
10.2	Fehlerkorrekturmodelle	213
10.3	Stochastische Zeitreihenmodelle	219
10.3.1	ARMA-Prozesse	220
10.3.2	Stationarität und Kointegration	220
10.4	Literaturauswahl	227
<b>11</b>	<b>Diagnose und Prognose</b>	<b>229</b>
11.1	Wozu werden Prognosen benötigt?	229
11.2	Klassifikation von Prognosen	230
11.3	Grenzen des Einsatzes von Prognosen	232
11.4	Konjunkturprognose	233
11.4.1	Diagnose der gegenwärtigen Lage	235
11.4.2	Entwicklung exogener Größen	236
11.4.3	Prognose	236
11.5	Bewertung der Prognosegüte	241
11.6	Simulation makroökonomischer Modelle	246
11.6.1	Prognosemodellselektion	246
11.6.2	Politiksimulationen	247
11.7	Literaturhinweise	248
	<b>Literaturverzeichnis</b>	<b>249</b>

<b>Abbildungsverzeichnis</b>	<b>257</b>
<b>Tabellenverzeichnis</b>	<b>261</b>
<b>Verzeichnis der Fallbeispiele</b>	<b>263</b>
<b>Sachverzeichnis</b>	<b>265</b>