

Inhaltsverzeichnis

1.	<i>Allgemeine Probleme der Vorhersage</i>	1
2.	<i>Modelle der linearen Regression</i>	4
2.1.	Begriffe und Definitionen der Ökonometrie	4
2.2.	Das ökonometrische Modell	9
2.3.	Die reduzierte Form	14
2.4.	Das multivariate lineare Regressionsmodell	16
2.5.	Das klassische multivariate lineare Regressionsmodell	19
2.6.	Das verallgemeinerte lineare Regressionsmodell	21
3.	<i>Das klassische lineare Regressionsmodell</i>	23
3.1.	Deskriptive lineare Regression	23
3.2.	Prinzip der kleinsten Quadrate	24
3.3.	Geometrische Eigenschaften der Kleinste-Quadrat-Schätzung (KQ-Schätzung)	27
3.4.	Beste lineare erwartungstreue Schätzung	34
3.5.	Multikollinearität	40
3.6.	Klassische Normalregression	45
3.7.	Prüfen von linearen Hypothesen	47
4.	<i>Das verallgemeinerte lineare Regressionsmodell</i>	55
4.1.	Optimale lineare Schätzungen von β	55
4.2.	AITKEN-Schätzung	60
4.3.	Fehlspezifikation der Kovarianzmatrix	62
4.4.	Heteroskedastie und Autoregression	64
5.	<i>Optimale Punktvorhersagen im verallgemeinerten linearen Regressionsmodell</i>	67
5.1.	Das Vorhersagemodell	67
5.2.	Optimale inhomogene Vorhersage	69
5.3.	Optimale homogene Vorhersagen	71
5.4.	Zusammenhang Schätzung-Vorhersage	73
5.5.	Zusatzinformation in Gestalt von Abschätzungen	75
6.	<i>Optimale Vorhersagen unter linearen Restriktionen</i>	86
6.1.	Restriktionen und Zusatzinformation	86
6.2.	Stochastische Restriktionen	89
6.3.	Zusatzinformation über σ^2	93
6.4.	Exakte Restriktionen	97
6.5.	Zusatzschätzung und schrittweise Regression	100
6.6.	Prüfen linearer Hypothesen	105
7.	<i>Vorhersage und Modellwahl</i>	109
7.1.	Restriktionen im nichtrestriktiven Modell	109
7.2.	Die Vergleichskriterien	112

7.3.	Das Entscheidungsproblem	117
7.4.	Schätzung und Modellwahl	121
8.	<i>Optimale Bereichsvorhersagen</i>	123
8.1.	Begriffe und Definitionen	123
8.2.	q -Vorhersageintervalle	125
8.3.	q -Bereiche im Regressionsmodell	128
8.4.	(p, q) -Vorhersageintervalle	130
8.5.	Lineare Nützlichkeitsfunktionen	133
8.6.	Maximale Nützlichkeit und optimale Tests	139
9.	<i>Vorhersage in ökonomischen Modellen</i>	141
9.1.	Optimale Vorhersagen im Modell der unabhängigen stochastischen Regression	141
9.2.	Vorhersage im multivariaten Regressionsmodell	145
9.3.	Das multivariate (klassische) gleichzeitig unkorrelierte Regressionsmodell	149
9.4.	Reduzierte Form und Vorhersage	153
Tabellen	157
Anhang	160
Literaturverzeichnis	171
Sachverzeichnis	175