

Inhaltsverzeichnis

Seite

	Einleitung	1
1.	Spezifikation im klassischen linearen Regressionsmodell	4
1.1.	Das Gesamtmodell und die alternativen Teilmodelle	4
1.2.	Die Elemente des Auswahlproblems	7
1.3.	Reine Schätzstrategien	10
1.3.1.	Die alternativen Schätzmodelle	10
1.3.2.	Formulierung der Verlustfunktion und Effizienzvergleich	11
1.3.2.1.	Mean-Square-Error-Kriterium 1	11
1.3.2.2.	Mean-Square-Error-Kriterium 2	14
1.3.2.3.	Mean-Square-Error-Kriterium 3	16
1.3.2.4.	Effizienzvergleich von Gesamt- und Teilmodell	17
1.4.	Gemischte Schätzstrategien	20
1.4.1.	Die Problematik gemischter Strategien - ein einfaches Beispiel	20
1.4.2.	Auswahlverfahren	27
1.4.2.1.	Überblick	27
1.4.2.2.	Auswahlverfahren maximales korrigiertes Bestimmtheitsmaß \bar{R}^2	29
1.4.2.3.	Das Auswahlverfahren von Mallows	32
1.4.2.4.	Stufenweise Regressionsverfahren	34
1.4.2.5.	Ridge-Regression	40
1.4.2.6.	Modellauswahl durch Spezifikationsfehler tests	43
1.4.3.	Der Einfluß der Multikollinearität auf die Modellwahl	48
2.	Die Auswahl eines Prognosemodells	49
2.1.	Das Prognoseproblem im klassischen linearen Modell	51
2.2.	Formulierung der Risikofunktion	53
2.3.	Auswahlverfahren für Prognosemodelle	55
2.4.	Zusammenfassung	57
3.	Eine Monte-Carlo-Untersuchung der Auswahlverfahren	58
3.1.	Die generelle Zielsetzung der Monte-Carlo-Untersuchung	58

3.2.	Die Monte-Carlo-Untersuchung	59
3.2.1.	Das Konzept der Monte-Carlo-Untersuchung	59
3.2.2.	Parameter und Variable der Monte-Carlo-Untersuchung	61
3.2.3.	Beurteilung der Monte-Carlo-Ergebnisse	63
3.2.4.	Die Monte-Carlo-Ergebnisse	67
3.2.4.1.	Schätzergebnisse der Auswahlverfahren	71
3.2.4.2.	Die Prognoseergebnisse der Auswahlverfahren	77
3.2.4.3.	Zusammenfassende Beurteilung der Monte-Carlo-Ergebnisse	79
3.3.	Die Simulation empirischer Nachfragegleichungen	80
3.4.	Die Simulationsergebnisse	86
3.4.1.	Die Schätzergebnisse	86
3.4.1.1.	Die Schätzergebnisse der reinen Strategien	86
3.4.1.2.	Schätzergebnisse der Auswahlverfahren	87
3.4.2.	Die Prognose der Nahrungs- und Genußmittelausgaben	96
3.4.2.1.	Die Prognoseergebnisse der reinen Strategien	96
3.4.2.2.	Die Prognoseergebnisse der Auswahlverfahren	98
3.5.	Zusammenfassende Beurteilung der Simulationsergebnisse	98
4.	Zusammenfassung	102
	Literaturverzeichnis	108
	Tabellenanhang	113