

# Inhaltsübersicht

<b>Inhaltsverzeichnis</b> .....	7
<b>Abkürzungen</b> .....	11
<b>Vorwort</b> .....	13
<b>1 Grundlagen der Empirischen Wirtschaftsforschung</b> .....	15
1.1 Ziele und Aufgaben .....	16
1.2 Datenbasis .....	17
1.3 Datenaufbereitung und einfache Datenanalysen .....	18
1.4 Trend- und Saisonbereinigung von Zeitreihendaten .....	47
1.5 Aufgaben .....	81
<b>2 Anwendung ökonomischer Methoden in der Empirischen Wirtschaftsforschung</b> .....	85
2.1 Einführung .....	86
2.2 Spezifikation und Schätzung von Eingleichungsmodellen: die lineare Regressionsanalyse .....	90
2.3 Spezifikation und Schätzung von linearen Mehrgleichungsmodellen .....	161
2.4 Mikroökonomische Modelle .....	189
2.5 Aufgaben .....	235
<b>3 Grundzüge der Input-Output-Analyse (IO-Analyse)</b> .....	251
3.1 Das Grundscheema von Input-Output-Tabellen .....	253
3.2 Das statische offene Mengenmodell .....	258
3.3 Einige Erweiterungen des statischen offenen Mengenmodells .....	264
3.4 Das statische offene Preismodell .....	295
3.5 Erweiterung des statischen offenen Preismodells durch (Teil-) Endogenisierung der Preise .....	301
3.6 Aufgaben .....	309
<b>A Anhang</b> .....	315
A.1 Tabelle zu Beispiel 1.14 .....	316
A.2 Tabelle zu Beispiel 1.15 .....	319
A.3 Tabelle zu Beispiel 2.14 .....	322
A.4 Tabelle zu Beispiel 2.16 .....	323
A.5 Tabelle zu Beispiel 2.31 .....	329

A.6 Der EM-ALGORITHMUS .....	330
A.7 Das RAS-Verfahren zur Ergänzung/Erstellung von IO-Tabellen (Beispiel) .....	332
<b>Literatur</b> .....	<b>334</b>
<b>Register</b> .....	<b>343</b>

# Inhaltsverzeichnis

<b>Abkürzungen</b> .....	11
<b>Vorwort</b> .....	13
<b>1 Grundlagen der Empirischen Wirtschaftsforschung</b> .....	15
1.1 Ziele und Aufgaben .....	16
1.2 Datenbasis .....	17
1.2.1 Arten von Daten .....	17
1.2.2 Datenquellen .....	17
1.3 Datenaufbereitung und einfache Datenanalysen .....	18
1.3.1 Methoden der Informationsverdichtung und einfache statistische Kenngrößen; Exkurs: ökonomische Indikatoren .....	18
1.3.2 Ausreißerwerte und Messfehler .....	41
1.3.2.1 Stamm-Blätter-Darstellung .....	41
1.3.2.2 Kennwertediagramm .....	42
1.3.2.3 Schachteldiagramm .....	45
1.4 Trend- und Saisonbereinigung von Zeitreihendaten .....	47
1.4.1 Trendbestimmung und Trendbereinigung .....	48
1.4.1.1 Lineare Trendfunktion .....	48
1.4.1.2 Polynomiale Trendfunktionen .....	50
1.4.1.3 Nichtlineare Trendfunktionen .....	53
1.4.2 Saisonbereinigung .....	67
1.4.2.1 Das Phasendurchschnittsverfahren .....	67
1.4.2.2 Das CENSUS-X-11 -Verfahren .....	68
1.4.2.3 Das Berliner Verfahren .....	71
1.4.2.4 Das saisonale ARIMA-Modell .....	77
1.5 Aufgaben .....	81
<b>2 Anwendung ökonometrischer Methoden in der Empirischen Wirtschaftsforschung</b> .....	85
2.1 Einführung .....	86
2.2 Spezifikation und Schätzung von Eingleichungsmodellen: die lineare Regressionsanalyse .....	90
2.2.1 Das klassische Modell der linearen Mehrfachregression .....	90
2.2.1.1 Das Annahmensystem des klassischen Modells der linearen Regressionsanalyse .....	90
2.2.1.2 Die gewöhnliche Methode der kleinsten Quadrate .....	92
2.2.1.3 Hypothesenprüfung, Intervallschätzung und Prognose im klassischen Modell der linearen Mehrfachregression .....	103

2.2.1.4	Verletzung von Modellannahmen	115
2.2.1.5	Einige Ergänzungen zur OLS-Schätzung	147
2.2.1.6	Die Maximum-Likelihood-Methode	151
2.2.2	Das verallgemeinerte Modell der linearen Regressionsanalyse	152
2.2.2.1	Die verallgemeinerte Methode der kleinsten Quadrate	153
2.2.2.2	Die GLS-Schätzung bei Vorliegen von autokorrelierten bzw. heteroskedastischen Störgrößen	155
2.3	Spezifikation und Schätzung von linearen Mehrgleichungsmodellen	161
2.3.1	Formen von Mehrgleichungsmodellen	161
2.3.2	Das Annahmesystem für Mehrgleichungsmodelle	171
2.3.3	Das Identifikationsproblem	173
2.3.4	Die Parameterschätzung in linearen Mehrgleichungsmodellen	177
2.3.4.1	Die OLS-Methode	177
2.3.4.2	Die ILS-Methode (indirekte Methode der Kleinsten Quadrate)	179
2.3.4.3	Die 2SLS-Methode (zweistufige Methode der Kleinsten Quadrate)	185
2.4	Mikroökonomische Modelle	189
2.4.1	Mikroökonomische Modellierung, Schätz- und Testmethoden	190
2.4.2	Modelle für diskrete abhängige Variable	194
2.4.2.1	Binäres und multinomiales Logit-Modell für ungeordnete Kategorien	194
2.4.2.2	Binäres und multinomiales Probit-Modell für ungeordnete Kategorien	200
2.4.2.3	Multinomiale Logit- und Probit-Modelle für geordnete Kategorien	203
2.4.2.4	Diskrete Entscheidungsmodelle	206
2.4.3	Modelle für beschränkt abhängige Variable	209
2.4.4	Zeitabhängige Modelle	218
2.4.4.1	Modelle für Zähldaten	218
2.4.4.2	Modelle zur Analyse von Verweildauern und Hazardratenmodelle	222
2.4.5	Analyse von Paneldaten	227
2.4.5.1	Ein lineares Modell zur Analyse von Paneldaten	227
2.4.5.2	Ein binäres Logit-Modell mit festen Effekten für Paneldaten	229
2.4.5.3	Ein binäres Probit-Modell mit stochastischen Effekten für Paneldaten	231
2.4.5.4	Ein Tobit-Modell mit stochastischen Effekten für Paneldaten	233
2.4.5.5	Panelmodelle für Zähldaten	233
2.5	Aufgaben	235

<b>3</b>	<b>Grundzüge der Input-Output-Analyse (IO-Analyse)</b>	251
3.1	Das Grundscheema von Input-Output-Tabellen	253
3.2	Das statische offene Mengenmodell	258
3.3	Einige Erweiterungen des statischen offenen Mengenmodells	264
3.3.1	Verknüpfung mit zusätzlichen Größen, insbesondere der Beschäftigung	264
3.3.2	(Teil-)Endogenisierung der Endnachfrage	280
3.4	Das statische offene Preismodell	295
3.5	Erweiterung des statischen offenen Preismodells durch (Teil-)Endogenisierung der Preise	301
3.6	Aufgaben	309

<b>A Anhang</b> .....	315
A.1 Tabelle zu Beispiel 1.14 .....	316
A.2 Tabelle zu Beispiel 1.15 .....	319
A.3 Tabelle zu Beispiel 2.14 .....	322
A.4 Tabelle zu Beispiel 2.16 .....	323
A.5 Tabelle zu Beispiel 2.31 .....	329
A.6 Der EM-ALGORITHMUS .....	330
A.7 Das RAS-Verfahren zur Ergänzung/Erstellung von IO-Tabellen (Beispiel) .....	332
<b>Literatur</b> .....	335
<b>Register</b> .....	343