
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 Literaturlauswahl	7

Teil II Daten

2 Datenbasis der empirischen Wirtschaftsforschung	11
2.1 Arten von Daten	15
2.2 Amtliche Statistik	17
2.3 Nicht amtliche Statistik	21
2.4 Internationale Statistik	23
2.5 Zugang zu verfügbaren Daten	28
2.6 Datenqualität	28
2.7 Literaturlauswahl	32
3 Datenaufbereitung	33
3.1 Grafische Darstellung von Daten	34
3.2 Einfache Transformationen von Daten	35
3.2.1 Quotientenbildung	35
3.2.2 Wachstumsraten	36
3.2.3 Maßzahlen	38
3.2.4 Preisbereinigung	39
3.2.5 Elastizitäten	40
3.2.6 Inter- und Extrapolation	41

3.3	Einige statistische Kenngrößen	44
3.4	Preis- und Mengenindizes	48
3.5	Saldierung von Tendenzindikatoren	58
3.6	Aggregation von Zeitreihen	61
3.7	Ausreißer und Messfehler	62
3.8	Literaturauswahl	64
4	Wirtschaftsindikatoren	67
4.1	Einteilung von Konjunkturindikatoren	67
4.2	Geschichte des Einsatzes von Konjunkturindikatoren	71
4.3	Stabilitätsgesetz und Indikatoren	74
4.3.1	Indikatoren für das Preisniveau	75
4.3.2	Indikatoren für den Beschäftigungsstand	76
4.3.3	Indikatoren für das außenwirtschaftliche Gleichgewicht ...	78
4.3.4	Wachstumsindikatoren	83
4.3.5	Verteilungsindikatoren	84
4.3.6	Weitere gesamtwirtschaftliche Indikatoren	91
4.4	Komplexe Indikatoren	94
4.4.1	Gesamtindikatoren aus Umfragedaten	94
4.4.2	Das gesamtwirtschaftliche Produktionspotential	96
4.5	Literaturauswahl	100
5	Input-Output-Analyse	103
5.1	Geschichte der Input-Output-Analyse	105
5.2	Die Input-Output-Tabelle	108
5.2.1	Herleitung von Input-Output-Tabellen	108
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
6.5	Vorgehen der ökonometrischen Analyse	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	148

7.3.2	Der F -Test	154
7.4	Ein Anwendungsbeispiel	156
7.5	Literaturauswahl	159
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	184
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 Variable	197
9.1	Qualitative erklärende Variable	197
9.1.1	Dummyvariablen	198
9.1.2	Kategoriale Variable	202
9.1.3	Interaktion von Dummyvariablen	207
9.1.4	Dummyvariablen und Strukturbruchtest	209
9.2	Abhängige qualitative Variable	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 (X11, X-12-ARIMA)	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	265
11.3.1	Zeitreihenmodelle als reduzierte Form.....	265
11.3.2	ARMA-Prozesse	266
11.4	Literaturauswahl	267
12	Nichtstationarität und Kointegration	269
12.1	Nichtstationarität	269
12.1.1	Deterministische und stochastische Trends	269
12.1.2	Scheinregressionen.....	270
12.1.3	Kovarianz-Stationarität und I(1)-Prozesse	272
12.2	Unit-Root-Tests	274
12.2.1	Dickey-Fuller-Test	274
12.2.2	Augmented Dickey-Fuller-Test.....	277
12.2.3	KPSS-Test	278
12.2.4	HEGY-Test	280
12.3	Kointegration	281
12.3.1	Engle-Granger-Verfahren	282
12.3.2	Kointegration im Fehlerkorrekturmodell	284
12.4	Literaturauswahl	287
12.5	Anhang: Kritische Werte für das Engle-Granger-Verfahren	288
12.6	Anhang: Kritische Werte für Fehlerkorrekturtest auf Kointegration ..	289
13	Diagnose und Prognose	291
13.1	Wozu werden Prognosen benötigt?	291
13.2	Klassifikation von Prognosen	293
13.3	Grenzen des Einsatzes von Prognosen	294
13.4	Konjunkturprognose	295
13.4.1	Diagnose der gegenwärtigen Lage	297
13.4.2	Entwicklung exogener Größen	298
13.4.3	Prognose	298
13.5	Prognose mit ökonometrischen Modellen	303
13.6	Bewertung der Prognosegüte	305
13.6.1	Mittlerer und mittlerer absoluter Prognosefehler	307
13.6.2	Mittlerer quadratischer Prognosefehler	309
13.6.3	Theils Ungleichheitskoeffizient	309
13.6.4	Tests für den Vergleich von Prognosen	311

13.6.5 Bewertung qualitativer Prognosen	313
13.7 Simulation mit ökonomischen Modellen	315
13.7.1 Arten der Simulation	316
13.7.2 Prognosemodellselektion.....	317
13.7.3 Politiksimulationen	318
13.8 Literaturhinweise.....	319
Abbildungsverzeichnis	321
Tabellenverzeichnis	325
Verzeichnis der Fallbeispiele	327
Literaturverzeichnis	329
Sachverzeichnis	341